

证券代码：832970

证券简称：东海证券

主办券商：东吴证券

东海证券股份有限公司 2020 年上半年风险控制指标报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

2020 年上半年，东海证券股份有限公司（以下简称“公司”）严格落实《证券公司风险控制指标管理办法》等相关法规规定，持续完善以净资本和流动性为核心的风险控制指标管理体系。通过开展压力测试、动态监控、净资本补足和流动性管理机制管理公司风险控制指标，确保公司风控指标持续符合监管要求。

一、 风险控制指标达标情况

报告期内，公司净资本及流动性等主要风险控制指标没有发生触及预警标准及不符合监管标准的情形。报告期末，公司主要风控指标情况如下表：

项 目	2019 年 12 月 31 日 (经审计)	2020 年 6 月 30 日(未 经审计)	预警 标准	监管 标准
核心净资本(元)	5,914,461,624.12	6,301,302,397.04		
附属净资本(元)	750,000,000.00	2,010,000,000.00		
净资本(元)	6,664,461,624.12	8,311,302,397.04		
净资产(元)	8,438,672,763.38	8,884,283,749.99		
各项风险资本准备之和(元)	1,518,843,084.21	1,800,756,281.33		
表内外资产总额(元)	19,600,288,514.24	23,044,114,164.54		
风险覆盖率(%)	438.79%	461.55%	≥120%	≥100%
资本杠杆率(%)	30.18%	27.34%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率(%)	729.86%	220.08%	≥120%	≥100%
净稳定资金率(%)	178.88%	212.17%	≥120%	≥100%
净资本/净资产(%)	78.98%	93.55%	≥24%	≥20%
净资本/负债(%)	63.43%	61.18%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债(%)	80.32%	65.40%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/ 净资本(%)	12.88%	18.84%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品 /净资本(%)	113.95%	126.94%	≤400%	≤500%

二、 风险控制指标动态监控情况

公司建立了以净资本和流动性为核心的风险控制指标动态监控机制，主要通过风险控制指标动态监控系统对风险控制指标准确计量、动态监控和及时预警。

报告期内，公司根据 2020 年 6 月 1 日正式实施的《证券公司风险控制指标计算标准规定》新规要求，及时开展指标新规测算分析、系统选型和报表格式转换等工作，顺利完成了风险控制指标动态监控系统的升级改造，确保各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。

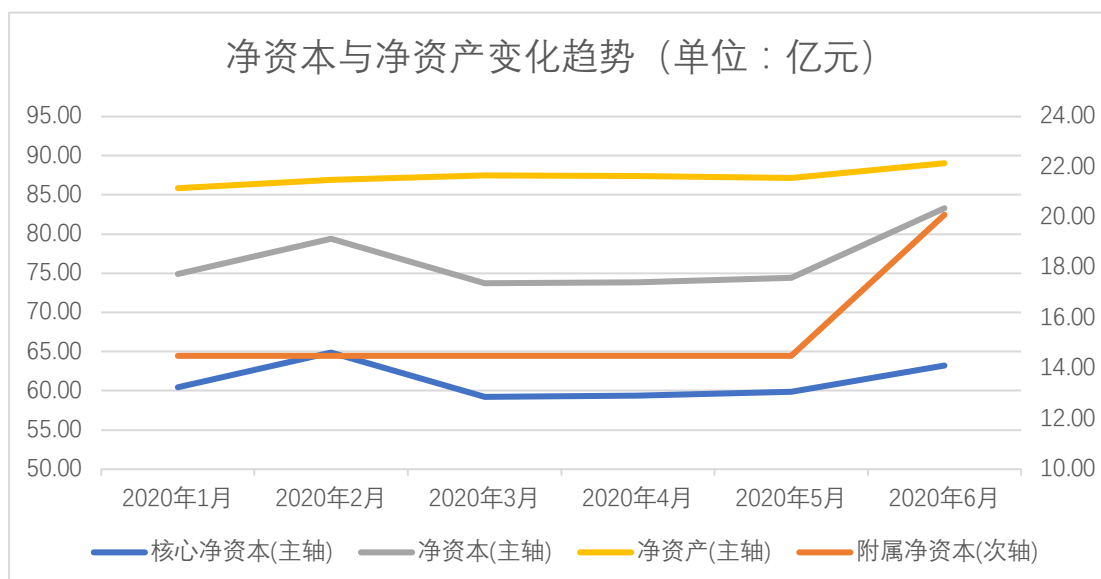
公司每月初按照监管要求及时报送月度净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表和风险控制指标计算表。当公司风险控制指标与上月相比发生不利变化超过 20%的情形时，在 3 个工作日内及时向监管机构上报书面报告，说明基本情况和变化原因。

三、 风险控制指标压力测试情况

公司建立了全面压力测试工作机制，形成了综合压力测试和专项压力测试在内的压力测试体系。报告期内，公司进一步梳理各类风险因子、完善风险压力测试参数，根据监管要求和业务发展，开展了综合压力测试 1 次和专项压力测试 9 次。压力测试机制有效运行为公司经营决策提供了参考作用。

四、 净资本补足和流动性管理机制

报告期末，公司净资本约 83 亿元，比上年度增加 16.47 亿元。主要原因一是因为公司净利润增加；二是 2019 年 12 月、2020 年 6 月公司分别发行了 3 年期 10 亿元面值“19 东海债”和 8 亿元面值“20 东海债”次级债券。报告期内，按照发行规模的 70%计入公司附属净资本。公司次级债券发行对净资本进行了有效补充，增强了公司各项风险控制指标的承压能力。2020 年 1 月至 2020 年 6 月，净资本与净资产变化趋势图如下：



公司建立了净资本补足机制，当净资本等各项风险控制指标接近预警标准时，公司将采用减少或暂停利润分配、借入次级债、减少长期资产占比或其他符合规定的方式及时补充净资本，以确保公司风险控制指标持续符合监管要求。

公司加强流动性管理，积极拓展融资渠道，及时补充流动资金，提高资金实力。通过发行小公募债券、收益凭证和同业拆借等方式及时融入资金。计划财务部持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备和可供随时变现的有价证券，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求，防范公司流动性风险。

东海证券股份有限公司

董事会

2020年8月31日