

华林证券股份有限公司

2019 年风险控制指标年度报告

2019 年，华林证券股份有限公司（以下简称“公司”）根据《证券公司全面风险管理规范》、《证券公司风险控制指标管理办法》等规范要求，持续加强全面风险管理体系建设，严格按照监管要求落实风险控制指标动态监控和管理工作，不断健全压力测试体系，开展综合压力测试及各类专项压力测试，确保风险控制指标持续符合监管标准。

一、公司主要风险控制指标情况

单位：元

项目	2019 年 12 月 31 日 (未审计数)	2018 年 12 月 31 日 (审计数)	监管基准	预警标准
核心净资本	2,803,074,438.38	3,651,982,456.98	\	\
附属净资本	0	0	\	\
净资本	2,803,074,438.38	3,651,982,456.98	\	\
净资产	5,289,415,930.59	4,022,343,321.97	\	\
各项风险资本准备之和	1,073,018,626.09	1,268,298,124.07	\	\
表内外资产总额	12,819,242,128.75	8,217,008,759.42	\	\
风险覆盖率	261.23%	287.94%	≥100.00%	≥120.00%
资本杠杆率	21.87%	44.44%	≥8.00%	≥9.60%
流动性覆盖率	1253.13%	370.16%	≥100.00%	≥120.00%
净稳定资金率	130.96%	218.86%	≥100.00%	≥120.00%
净资本/净资产	52.99%	90.79%	≥20.00%	≥24.00%
净资本/负债	39.90%	92.67%	≥8.00%	≥9.60%
净资产/负债	75.29%	102.07%	≥10.00%	≥12.00%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	3.07%	2.08%	≤100.00%	≤80.00%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	222.56%	92.51%	≤500.00%	≤400.00%

报告期内，公司以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标均持续符合监管标准。

二、动态风险控制指标监控情况

公司建立了风险控制指标动态监控体系，制定了《华林证券股份有限公司风险控制指标和动态监控系统管理办法》、《华林证券股份有限公司压力测试管理办法》等制度，明确了风险控制指标管理及压力测试等工作要求。

公司按照监管法规的规定计算净资本、风险覆盖率、资本杠杆率、流动性覆盖率、净稳定资金率等各项风险控制指标，编制净资本计算表、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。公司建立了风险控制指标动态监控技术系统，风险管理部及计划财务部每日通过风险控制指标动态监控系统，对公司净资本等各项风险控制指标的前一日动态情况进行监控、审核及报告。公司根据自身资产负债状况和业务发展情况，建立了净资本补足机制，确保净资本等各项风险控制指标符合规定标准。

三、风险控制指标压力测试情况

为促进公司提升风险管理能力，公司按照《关于开展证券公司2019年度压力测试有关工作的通知》（中证协发[2019]41号）、《证券公司压力测试指引（修订稿）》（中证协发[2016]251号）等相关要求，由公司领导牵头，组织风险管理部、计划财务部、运营部等相关职能部门和各业务部门，于2019年3月开展了2019年上半年证券公司统一情景压力测试工作和2019年度综合压力测试工作，于2019年10月开展了证券公司统一情景压力测试工作，评估未来压力情景下公司整体风险状况及风险承受能力。测试结果显示，在轻度、中度和重度三种压力情景下，公司未出现风控指标不达标或者净资本不足的情况。

2019年，在公司发生业务调整、股利分配、子公司增资等重大经营变化时，均开展了风险控制指标专项压力测试，综合分析测试结果并提出相关管理建议，以确保公司的各项风险控制指标持续符合监管要求。

华林证券股份有限公司

2020年4月20日