

山西证券股份有限公司

2021 年上半年风险控制指标情况报告

2021 年上半年，山西证券股份有限公司（以下简称“公司”）持续完善以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系，逐日动态监控风险控制指标情况，并运用压力测试全面评估公司风险，合理进行资产配置和业务规划，确保公司风险控制指标持续符合监管要求。

一、净资本和流动性等主要风险控制指标情况

（一）报告期内风险控制指标具体情况

项 目	2021 年 6 月 30 日 指标值(未经审计)	2020 年 12 月 31 日 指标值(经审计)	监管预警标准	监管标准
核心净资本(亿元)	101.72	107.81	-	-
附属净资本(亿元)	17.50	15.50	-	-
净资本(亿元)	119.22	123.31	-	-
净资产(亿元)	169.14	170.17	-	-
各项风险资本准备之和(亿元)	50.48	40.16	-	-
表内外资产总额(亿元)	656.90	499.52	-	-
风险覆盖率	236.15%	307.05%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	15.48%	21.58%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	195.64%	213.75%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	177.89%	192.22%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	70.49%	72.46%	≥24%	≥20%
净资本/负债	25.75%	39.60%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	36.54%	54.65%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品规模/净资本	11.71%	11.44%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	279.22%	135.48%	≤400%	≤500%
融资(含融券)的金额/净资本	70.70%	63.74%	≤320%	≤400%

（二）报告期内风险控制指标达标情况

报告期内，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标持续符合监管要求，各项风控指标运行平稳。公司在净资本不断变化的同时，合理调整业务结构，在大力发展业务的同时，保证风险控制指标持续合规；同时，通过发行公司债、收益凭证、两融收益权转让和在银行

授信额度内进行同业拆借等确保公司资金来源的稳定性，保证公司的流动性风险控制指标持续合规。

二、风险控制指标动态监控情况

公司风险管理部门、计划财务部门设立专人专岗，相互配合，对风险控制指标进行动态监控，及时掌握风险控制指标的变动情况，确保各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。当风险控制指标出现异常变动时，公司均履行逐级报告程序，并报告监管部门。报告期内，公司向监管部门报送风险控制指标变动情况报告共计 4 次。

三、风险控制指标压力测试情况

2021 年，根据中证协下发的《关于报送证券公司 2021 年度综合压力测试报告的通知》，公司组织开展了 2021 年度综合压力测试。测试结果显示，公司在轻、中、重度压力情景下均发生亏损，但各项风险控制指标均未触及监管预警标准。

报告期内，按照监管要求并结合公司实际情况，公司对 2020 年度现金分红、2021 年各业务规模的确定、新设子公司等进行压力测试，分别测算了上述项目的发生对公司风险控制指标的影响，通过测试及分析为公司经营层提供了有效的决策依据。经过不断努力，公司目前已经建立起较为完善的压力测试工作机制，各项工作符合监管相关要求。公司将积极探索先进的风险计量工具和方法，不断提升压力测试的有效性。

山西证券股份有限公司

2021 年 8 月 27 日