

山西证券股份有限公司

2021 年度风险控制指标情况报告

2021 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。期间，公司持续优化全面风险管理机制，全力推进风险控制指标并表管理工作，加强系统建设，并表系统已上线试运行。

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 12 月末 指标值 (经审计)	2020 年 12 月末 指标值 (经审计)	监管预警标准	监管标准
核心净资本 (亿元)	95.06	107.81	-	-
附属净资本 (亿元)	26.40	15.50	-	-
净资本 (亿元)	121.46	123.31	-	-
净资产 (亿元)	170.81	170.17	-	-
各项风险资本准备之和 (亿元)	53.52	40.16	-	-
表内外资产总额 (亿元)	609.63	499.52	-	-
风险覆盖率	226.95%	307.05%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	15.59%	21.58%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	146.89%	213.75%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	177.78%	192.22%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	71.11%	72.46%	≥24%	≥20%
净资本/负债	29.49%	39.60%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	41.48%	54.65%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品规模/ 净资本	20.78%	11.44%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本	156.72%	135.48%	≤400%	≤500%
融资 (含融券) 的金额/净资本	70.42%	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。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、短期公司债、次级债、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、计划财务部设立专人专岗，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 16 次。

三、风险控制指标并表管理情况

报告期内，公司全力推进风险控制指标并表管理工作，并表系统经过测试与安全检测，已上线试运行。基于并表系统运行的有效性，已向监管部门报告相关情况，待各方面管理成熟后将进一步申请并表监管试点。目前，并表系统可实现计算生成合并口径的净资本计算表、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等监管报表，合并范围包括母公司和境内外全部子公司，同时支持母子公司单一主体与合并口径的监管报表查询。

四、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、增资子公司、开展新业务等进行压力测试，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

2022 年 4 月 28 日