

# 长江证券股份有限公司

## 2022 年度风险控制指标报告

2022 年，长江证券股份有限公司（以下简称公司）严格贯彻落实《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》等各项监管制度要求，持续动态监控净资产和流动性等风险控制指标，完善压力测试体系，开展各项专项和综合压力测试，确保风险控制指标持续符合监管标准。

### 一、报告期内公司风险控制指标的具体情况和达标情况

项目	2021年12月31日 (经审计)	2022年12月31日 (经审计)	预警标准	监管标准
核心净资产(亿元)	195.00	175.84		
附属净资产(亿元)	35.00	34.80		
净资产(亿元)	230.00	210.64		
净资产(亿元)	292.21	288.83		
各项风险资本准备之和(亿元)	112.34	89.46		
表内外资产总额(亿元)	1156.48	1173.94		
风险覆盖率	204.73%	235.45%	≥ 120%	≥ 100%
资本杠杆率	17.47%	15.67%	≥ 9.6%	≥ 8%
流动性覆盖率	165.57%	169.05%	≥ 120%	≥ 100%
净稳定资金率	156.38%	179.03%	≥ 120%	≥ 100%
净资本/净资产	78.71%	72.93%	≥ 24%	≥ 20%
净资本/负债	27.13%	24.86%	≥ 9.6%	≥ 8%
净资产/负债	34.46%	34.09%	≥ 12%	≥ 10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	17.99%	18.71%	≤ 80%	≤ 100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	254.13%	302.25%	≤ 400%	≤ 500%
融资(含融券)的金额/净资本	157.58%	140.47%	≤ 320%	≤ 400%

报告期内，母公司净资产等主要风险控制指标均持续符合监管标准。

### 二、风险控制指标动态监控情况

#### (一) 指标动态监控机制

公司严格执行监管机构的相关要求，建立了净资本和流动性指标动态监控系统，在中国证监会规定的风险控制指标监管标准和预警标准的基础上，设置了更为严格的内部预警标准对风险控制指标实施动态监控。风险管理部、财务总部及相关业务部门设立专人专岗，相互配合，动态监控风险控制指标的变动情况，并按照监管规定，当指标出现异常情形时，及时向监管机构进行报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。总体而言，公司建立的风险控制指标动态监控机制，能够全面监控各项风险控制指标的变动情况，及时预警并采取有效措施，确保各项风险控制指标持续满足监管要求。

## **（二）指标动态监控情况**

报告期内，净资本及流动性等主要风险控制指标持续满足监管要求，监控机制和报告程序均符合监管规定，未发生违规情形。

## **三、报告期内风险控制指标压力测试情况**

2022年，公司通过对经济形势、市场环境进行综合评估，结合公司资产负债结构、业务发展策略，设定了不同程度的压力情景，共实施了3次综合压力测试；专项压力测试方面，公司开展了市场风险、信用风险、流动性风险、年度授权、股东分红、子公司担保、债券承销等各类专项压力测试。上述测试结果显示，公司风险控制指标承压能力较强，在轻、中、重三类压力情景下，公司主要风险控制指标均符合监管标准。

## **四、净资本补足机制**

公司根据中国证券业协会发布的《证券公司资本补充指引》，建

立了动态的净资本补足机制，持续拓展资本补充渠道，确保公司净资本与业务发展需要相匹配：（1）优化资产结构，适时调节风险较高的资产品种和规模；（2）综合评估补充资本的必要性、可行性，制定外部资本补充方案，包括资本补充工具的类型、发行规模、发行市场、投资者群体、定价机制等；（3）提高公司自身盈利能力，同时调整资本补充期间分红政策。

报告期内，公司成功发行次级债券 14 亿元，补充了公司净资本，增强了公司主要风险控制指标的承压能力。

长江证券股份有限公司董事会

二〇二三年四月二十九日