

长江证券股份有限公司

2023 年半年度风险控制指标报告

2023 年上半年，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，持续动态监控净资本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	2022年12月31日 (经审计)	2023年6月30日 (未审计)	预警标准	监管标准
核心净资本(亿元)	175.84	184.00		
附属净资本(亿元)	34.80	47.00		
净资本(亿元)	210.64	231.00		
净资产(亿元)	288.83	323.07		
各项风险资本准备之和(亿元)	89.46	94.66		
表内外资产总额(亿元)	1173.94	1,268.60		
风险覆盖率	235.45%	244.02%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	15.67%	15.06%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	169.05%	201.57%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	179.03%	158.86%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	72.93%	71.50%	≥24%	≥20%
净资本/负债	24.86%	25.68%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	34.09%	35.91%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	18.71%	21.98%	≤80%	≤100%

自营非权益类证券及其衍生品/净资本	302.25%	299.76%	≤400%	≤500%
融资（含融券）的金额/净资本	140.47%	129.38%	≤320%	≤400%

报告期内，公司净资本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，公司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

2023年上半年，公司根据监管下发的统一情景，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，实施了1次综合压力测试；专项压力测试方面，公司开展了市场风险、季度限额授权、债券承销等类别压力测试。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 5 亿元、永续次级债券 25 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

二〇二三年八月二十九日