

# 华林证券股份有限公司

## 2023 年度风险控制指标情况报告

2023 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	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日	监管基准	预警标准
核心净资本	4,345,837,799.37	4,139,150,523.11	\	\
附属净资本	-	-	\	\
净资本	4,345,837,799.37	4,139,150,523.11	\	\
净资产	5,913,846,274.32	5,951,711,011.30	\	\
各项风险资本准备之和	1,267,125,207.69	1,482,679,769.24	\	\
表内外资产总额	12,201,360,634.65	13,459,018,241.52	\	\
风险覆盖率	342.97%	279.17%	≥100.00%	≥120.00%
资本杠杆率	35.62%	30.75%	≥8.00%	≥9.60%
流动性覆盖率	199.83%	211.14%	≥100.00%	≥120.00%
净稳定资金率	153.84%	169.94%	≥100.00%	≥120.00%
净资本/净资产	73.49%	69.55%	≥20.00%	≥24.00%
净资本/负债	91.47%	74.43%	≥8.00%	≥9.60%
净资产/负债	124.48%	107.03%	≥10.00%	≥12.00%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	23.02%	26.65%	≤100.00%	≤80.00%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	47.57%	117.76%	≤500.00%	≤400.00%

### 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2023年度压力测试有关工作的通知》（中证协发〔2023〕42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、运营管理部等相关职能部门和各业务部门，于2023年4月开展了2023年度综合压力测试工作，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。

2023年，在公司发生业务调整等重大经营变化时，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董事会

二〇二四年四月二十日