

华西证券股份有限公司

2020 年度风险控制指标情况报告

2020年，华西证券股份有限公司（以下简称“公司”）持续加强全面风险管理体系建设，从制度体系、组织架构、信息系统、指标体系、人员配备、应对机制等六个方面不断建立健全公司全面风险管理体系。公司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，及时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、报告期内公司主要风险控制指标情况

单位：元

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	预警标准	监管标准
核心净资本	15,939,475,277.15	16,681,422,444.74		
附属净资本	550,000,000.00	950,000,000.00		
净资本	16,489,475,277.15	17,631,422,444.74		
净资产	19,369,138,973.68	20,873,131,610.73		
各项风险资本准备之和	4,522,195,895.26	4,326,033,113.14		
表内外资产总额	51,388,726,278.35	57,336,268,979.59		
风险覆盖率	364.63%	407.57%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	31.12%	29.13%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	263.49%	335.38%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	161.03%	197.78%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	85.13%	84.47%	≥24%	≥20%
净资本/负债	53.48%	50.58%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	62.82%	59.88%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	14.65%	20.99%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	147.82%	153.00%	≤400%	≤500%

报告期内，公司以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标均持续符合监管标准。

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《风险控制指标管理办法》、《风险限额管理办法》、《压力测试管理办法》等制度，明确了风险控制指标监控及压力测试等工作要求。

公司风险控制指标的动态风险管理流程包括风险识别、评估、监测、控制与报告。公司建立了风险控制指标动态监控技术系统，指定专人对净资本等风险控制指标进行日常监控与报告。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

受新冠疫情影响，2020 年春节前后，境内外资本市场大幅波动，根据监管要求和公司风险管理需要，公司分别以 1 月 22 日和 3 月 13 日为基期，完成《关于新型冠状病毒肺炎疫情对公司潜在影响的压力测试报告》。在轻、中、重度场景下，虽然公司固定收益投资、融资融券等五项主要业务合计产生一定浮动亏损，但公司主要监管指标均符合监管要求，总体风险可控。

2020 年上半年，公司根据中国证券业协会下发的《关于报送证券公司 2020 年度综合压力测试报告的通知》，组织开展了 2020 年年度综合压力测试以及统一情景压力测试。2020 年下半年，虽然中国证券业协会未组织券商开展统一场景压力测试，公

公司内部自行组织开展了 2020 年下半年综合压力测试。测试结果显示，公司在轻、中、重度压力情景各项风险控制指标均未触及监管预警标准。

公司在开展证券承销、股利分配、设立子公司或增资子公司等重大业务或经营行为时，均开展了风险控制指标压力测试，在测算分析基础上提出经营管理建议，确保公司的各项风险控制指标符合监管要求。

华西证券股份有限公司

2021 年 4 月 13 日