

## **西南证券股份有限公司**

### **关于证券自营业务风险控制指标情况及收到重庆证 监局行政监管措施决定书的公告**

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2015年8月18日，西南证券股份有限公司（以下简称公司）因开展约定购回式证券交易业务而通过约定购回交易专户被动持有江苏中泰桥梁钢构股份有限公司（以下简称中泰桥梁）股票 15,500,000 股，占其总股本的 4.98%。2016年4月19日、20日，公司量化投资业务因进行阿尔法策略调仓交易，通过证券交易所集中交易方式合计买入中泰桥梁 141,435 股，占其总股本的 0.05%，本次交易后，公司合计持有中泰桥梁 15,641,435 股，占其总股本的 5.03%。其后，公司通过中泰桥梁及时公告了《江苏中泰桥梁钢构股份有限公司简式权益变动报告书》，并就上述情况向监管部门进行了报告。

2016年6月23日，公司收到中国证券监督管理委员会重庆监管局（以下简称重庆证监局）《关于对西南证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施决定书[2016]11号，以下简称《决定书》），主要内容如下：

经查，公司合计持有中泰桥梁 15,641,435 股，占中泰桥梁总股本的 5.03% 的行为违反了《证券公司风险控制指标管理办法》第二十二条第一款第（四）项的规定。同时，公司未按规定发布相关临时公告，违反了《关于加强上市公司监管的规定》（证监会公告[2010]20号）第十三条和《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第40号）第二条的规定。

按照《证券法》第一百五十一条第一款的规定，重庆证监局要求公司在4个月内对风险控制指标不符合规定的情形予以改正。同时，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，要求公司对信息披露违规行为进行整改，在2个

工作日内按有关规定对风险控制指标不符合规定标准的相关情况进行补充披露。

根据《决定书》的要求，公司对上述证券自营业务风险控制指标不符合规定标准的相关情况说明如下：

公司本次证券自营业务风险控制指标不符合规定标准系公司约定购回式证券交易业务被动持有中泰桥梁股票以及自营业务通过二级市场交易持有中泰桥梁股票之合计数量达到其总股本 5.03%所致。根据上述约定购回式证券交易业务购回协议安排，公司持有的该股票风险能够得到有效管控，上述情况不会给公司业务带来重大不利影响，亦不会对公司利益造成重大损害。

后续，公司将按《决定书》要求及时披露本次整改报告，对上述风险控制指标不符合规定标准的相关情况进行改正，并进一步强化全面风险管理制度建设，防范类似情况的再次发生，同时加强信息披露工作，确保及时、准确、完整地披露相关信息。

特此公告

西南证券股份有限公司董事会

二〇一六年六月二十四日