

证券代码：600918

证券简称：中泰证券

中泰证券股份有限公司投资者关系活动记录表

投资者关系活动类别	<input checked="" type="checkbox"/> 特定对象调研 <input type="checkbox"/> 分析师会议 <input type="checkbox"/> 媒体采访 <input type="checkbox"/> 业绩说明会 <input type="checkbox"/> 新闻发布会 <input type="checkbox"/> 路演活动 <input type="checkbox"/> 现场参观 <input type="checkbox"/> 其他（请文字说明其他活动内容）
参与单位名称及人员姓名	太平洋证券非银分析师 夏聿印
时间	2023年9月11日上午10:00-11:30
地点	济南市经七路86号证券大厦
上市公司接待人员姓名	董事会办公室副主任、证券事务代表 英学夫 计划财务总部总经理助理 梁博然
投资者关系活动主要内容介绍	交流公司经营情况等
本次活动是否涉及应当披露的重大信息	不涉及
日期	2023年9月11日
问答交流主要内容	<p>1.请介绍一下公司自营业务情况。</p> <p>2023年上半年，公司强化投研和交易能力建设，积极探索低波动盈利模式，加强非方向性投资策略开发和运用。固定收益投资业务方面，进一步丰富投资策略，优化组合管理，加快做市和客需业务发展。股票投资业务方面，强化交易策略制定过程中的风险评估、风险预案执行管理，通过更灵活、更有效的策略应对复杂市场形势变化。衍生品业务方面，不断优化产品结构，提升</p>

产品策略创新、交易对冲及风险管控能力。做市业务方面，严格履行期权做市商合规报价职责，2023年上半年，新增上交所科创50ETF期权做市资格，沪深交易所各期权品种主做市商月度评级均为最高评级AA；截至2023年6月30日，新三板做市数量58家。

2.请介绍一下公司主要风险控制指标情况。

公司通过持续优化以净资本和流动性为核心的风险控制指标动态监控机制，动态监控并测算指标变动情况，适时开展综合压力测试及各类专项压力测试，及时采取风险控制措施，公司净资本等各项风险控制指标均持续符合监管要求。截至2023年6月30日，公司净资本270.15亿元，风险覆盖率217.59%，资本杠杆率15.27%，流动性覆盖率237.46%，净稳定资金率149.44%。

3.请介绍一下公司两融业务、股票质押式回购交易业务的规模及维保比例。

截至2023年6月末，公司融资融券余额310.82亿元，总体维持担保比例为268.33%，融资融券业务整体风险可控。截至2023年6月末，公司股票质押业务待购回余额59.97亿元，其中，自有资金融资规模为46.44亿元，平均履约保障比例为280.09%，业务整体风险可控。

4.请介绍一下公司资产管理业务规模。

截至2023年6月30日，中泰资管资产管理业务规模1,407.12亿元。其中，公募基金业务规模389.73亿元，私募及专项产品规模1,017.39亿元。截至2023年6月30日，万家基金旗下管理公募基金131只，管理规模3,899.85亿元，较去年末增长410.61亿元，增幅11.77%。