

证券代码：832970

证券简称：东海证券

主办券商：中信建投

## 东海证券股份有限公司 2023 年度风险控制指标报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

2023 年，东海证券股份有限公司（以下简称“公司”）严格落实《证券公司风险控制指标管理办法》等相关法规规定，持续完善以净资本和流动性为核心的风险控制指标管理体系，通过动态监控指标、开展压力测试、补足净资本和流动性管理等措施管理公司风险控制指标，确保公司风险控制指标持续符合监管要求。

### 一、风险控制指标达标情况

报告期内，公司净资本及流动性等主要风险控制指标没有发生触及预警标准或不符合监管标准的情形。报告期末，公司主要风险控制指标情况如下表：

项 目	2022 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	预警标准	监管标准
	(经审计)	(经审计)		
核心净资本（元）	7,354,055,586.35	6,260,702,468.90		
附属净资本（元）	0.00	1,050,000,000.00		
净资本（元）	7,354,055,586.35	7,310,702,468.90		
净资产（元）	10,288,954,757.19	9,782,568,842.26		
各项风险资本准备之和（元）	3,759,316,529.53	3,112,721,545.77		
表内外资产总额（元）	37,011,538,400.41	34,355,315,223.28		
风险覆盖率（%）	195.62%	234.87%	≥120%	≥100%
资本杠杆率（%）	19.87%	18.22%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率（%）	357.86%	258.20%	≥120%	≥100%
净稳定资金率（%）	139.90%	166.00%	≥120%	≥100%
净资本/净资产（%）	71.48%	74.73%	≥24%	≥20%
净资本/负债（%）	29.00%	31.86%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债（%）	40.57%	42.63%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本（%）	34.60%	35.48%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本（%）	262.36%	215.58%	≤400%	≤500%
融资（含融券）的金额/净资本（%）	85.67%	88.01%	≤320%	≤400%

### 二、风险控制指标动态监控情况

公司建立了以净资本和流动性为核心的风险控制指标动态监控机制，主要通过风险控制指标动态监控系统对风险控制指标准确计量、动态监控和及时预警。

报告期内，公司及时接入新业务和新系统数据，不断完善系统功能，保障了风险控制指标动态监控的全面性、稳定性及准确性，确保各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。

报告期内，公司每月初按照监管要求及时报送月度净资本计算表、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。当公司风险控制指标与上月相比发生不利变化超过20%的情形时，按要求分析和报告变化原因。

### 三、风险控制指标压力测试情况

公司建立健全压力测试机制，定期或不定期组织开展综合压力测试和专项压力测试工作，覆盖子公司增资、规模限额调整、余额包销和净资本补充等事项，测算压力情景下净资本和流动性等风险控制指标、财务指标、内部风险限额及业务指标的变化情况，评估风险承受能力。报告期内，公司风险管理部门进一步细化完善风险因子参数和传导机制，审慎设置压力情景及数据范围，实施综合压力测试、协会统一情景压力测试及专项压力测试共计近27次，出具分析报告并提出应对建议，为业务规模调整、子公司增资和净资本补充等提供了决策依据。

### 四、净资本补足和流动性管理机制

报告期末，公司净资本为73.11亿元，较期初减少0.43亿元，降幅0.59%。公司建立了净资本补足机制，当净资本等各项风险控制指标接近预警标准时，公司将采用减少或暂停利润分配、发行次级债、减少长期资产占比或其他符合监管规定的方式及时补充净资本。报告期内，公司发行3年期次级债15亿元，按规定比例计入附属净资本，保障公司风险控制指标持续符合监管要求。

报告期内，公司加强流动性管理，积极拓展融资渠道，通过发行公司债券、收益凭证和同业拆借等方式融入资金，及时补充流动资金；持续监控短期和长期的资金需求，确保维持充裕的现金储备和可供随时变现的有价证券，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求，防范公司流动性风险。

东海证券股份有限公司  
董事会  
2024年4月26日