

华林证券股份有限公司

2025 年上半年风险控制指标情况报告

2025 年上半年，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	2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日	监管基准	预警标准
核心净资本	5,098,205,966.22	4,873,613,895.60	\	\
附属净资本	-	-	\	\
净资本	5,098,205,966.22	4,873,613,895.60	\	\
净资产	6,654,560,416.16	6,259,100,969.86	\	\
各项风险资本准备之和	2,373,763,777.47	1,827,834,122.50	\	\
表内外资产总额	20,578,557,442.67	14,362,399,907.15	\	\
风险覆盖率	214.77%	266.63%	≥100.00%	≥120.00%
资本杠杆率	24.77%	33.93%	≥8.00%	≥9.60%
流动性覆盖率	400.75%	215.29%	≥100.00%	≥120.00%
净稳定资金率	201.90%	169.93%	≥100.00%	≥120.00%
净资本/净资产	76.61%	77.86%	≥20.00%	≥24.00%
净资本/负债	41.58%	86.36%	≥8.00%	≥9.60%
净资产/负债	54.27%	110.91%	≥10.00%	≥12.00%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	22.34%	33.19%	≤100.00%	≤80.00%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	208.08%	68.52%	≤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 2025 年度压力测试有关工作的通知》（中证协发[2025]62 号）、《证券公司压力测试指引（2023 年修订）》（中证协发[2023]137 号）等相关要求，由公司领导牵头，组织风险管理部、计划财务部等相关职能部门和各业务部门，开展了 2025 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。

2025 年上半年，公司针对自营投资项目、调整两融业务规模及发行公司债等重大事件，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

二〇二五年八月二十三日