

东北证券股份有限公司

2019 年度风险控制指标情况报告

2019 年，东北证券股份有限公司（以下简称“本公司或公司”）切实贯彻监管要求，动态监控净资本、流动性等风险控制指标，全面开展净资本与流动性的敏感性分析和压力测试，确保风险控制指标持续达到监管部门规定的标准。

一、报告期内风险控制指标的具体情况和达标情况

（一）报告期内，本公司风险控制指标具体情况

单位：元

| 项 目 | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 | 预警标准 | 监管标准 |
|-------------|-------------------|-------------------|-------|-------|
| 核心净资本 | 8,832,950,122.28 | 8,002,108,910.45 | - | - |
| 附属净资本 | 4,300,000,000.00 | 3,100,000,000.00 | - | - |
| 净资本 | 13,132,950,122.28 | 11,102,108,910.45 | - | - |
| 净资产 | 14,618,625,768.40 | 14,254,262,206.48 | - | - |
| 各项风险资本准备之和 | 5,033,248,443.56 | 6,378,285,396.06 | - | - |
| 表内外资产总额 | 54,236,068,232.69 | 53,522,519,227.69 | - | - |
| 风险覆盖率 (%) | 260.92% | 174.06% | ≥120% | ≥100% |
| 资本杠杆率 (%) | 16.84% | 16.45% | ≥9.6% | ≥8% |
| 流动性覆盖率 (%) | 249.89% | 177.51% | ≥120% | ≥100% |
| 净稳定资金率 (%) | 146.14% | 145.57% | ≥120% | ≥100% |
| 净资本/净资产 (%) | 89.84% | 77.89% | ≥24% | ≥20% |
| 净资本/负债 (%) | 34.77% | 29.89% | ≥9.6% | ≥8% |
| 净资产/负债 (%) | 38.70% | 38.37% | ≥12% | ≥10% |

| | | | | |
|-----------------------|---------|---------|-------|-------|
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本 (%) | 18.30% | 25.15% | ≤80% | ≤100% |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%) | 184.68% | 231.70% | ≤400% | ≤500% |

(二) 报告期内, 本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, 没有发生触及监管标准的情况。

二、报告期内风险控制指标动态监控情况

公司始终坚持稳健经营, 注重风险管理, 建立了以净资本和流动性为核心的风险控制指标监控体系, 制定了《公司净资本等风险控制指标管理办法》和《公司净资本等风险控制指标监控工作细则》, 通过制度保障、组织保障、技术保障等措施, 确保公司净资本和流动性等风险控制指标在任一时点符合监管要求。公司对净资本和流动性等风险控制指标设定了规定标准、预警标准和公司标准三级监控指标; 对原有的内部风险控制平台进行了升级改造, 进一步优化了系统功能。公司设立专人对净资本和流动性等各项风险控制指标的达标状况进行日常监控, 及时掌握业务变动对净资本和流动性等风险控制指标的影响, 严格按照《证券公司风险控制指标管理办法》等规定, 定期向监管部门书面报告风险控制指标数据和达标情况。报告期内, 公司风险控制指标未发生触及监管标准的情况。

三、报告期内风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

（一）净资本敏感性分析和压力测试情况

报告期内，本公司针对利润分配、IPO 和债券承销项目、新增分支机构等事项，采用情景分析压力测试方法，测试多种风险因素同时变化的压力情景下公司风险控制指标的达标情况，全年共提交 31 次压力测试报告。自设情景综合压力测试 1 次，评估未来压力情景下公司整体风险状况及风险承受能力，并依此设置公司业务规模限额及损失限额。

根据中国证券业协会的统一要求，报告期内本公司共开展 1 次综合压力测试；同时，根据协会要求完成自设情景开展综合压力测试 1 次。依据统一情景压力测试方案，结合自身业务特点，以基期数据为基准，在充分预计整体风险的基础上，审慎、合理设定相关压力情景，对相关时点的业务开展、财务状况及净资本等风险控制指标进行综合压力测试，评估未来压力情景下公司整体风险状况及风险承受能力。

（二）流动性敏感性分析和压力测试情况

报告期内，公司根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司流动性风险管理指引》相关要求，在开展重大投资、重大融资等活动时，及时开展流动性风险控制指标压力测试，发现流动性风险控制指标潜在超标风险。2019 年，合计开展 56 次流动性风险控制指标压力测试，并

完成 3 次综合压力测试的流动性风险控制指标测试部分。测试依据协会的相关规定，以基期历史数据为基准，充分预计整体风险的基础上，审慎、合理设定相关压力情景，对相关时点公司流动性风险监管指标进行了统一情景综合压力测试，评估未来压力情景下公司流动性风险状况及风险承受能力。

四、净资本补足机制建立情况

为有效管理风险，公司制定了《净资本补足管理办法》和《净资本等风险控制指标监控工作细则》，对于证监会规定的“不得低于”一定标准的风险控制指标，公司内部的预警标准根据指标敏感性的不同，分别进行不同程度调高，对于规定“不得超过”一定标准的风险控制指标，预警标准分别进行不同程度调低。预警指标在本公司风险监控系统中予以设置并实时预警。风险管理总部作为公司净资本等风险控制指标的动态监控部门，负责实施对净资本等风险控制指标的动态监控、汇总、分析，并根据指标状况提出调整相关指标和净资本补足的意见建议。当公司净资本等风险控制指标出现预警时，公司风险管理总部将向公司管理层及相关部门发出风险提示，公司将视具体情况，通过减少或暂停利润分配、增资扩股、借入次级债、减少长期资产占比、提高盈利能力或采取其他符合规定的措施，增强公司资产流动性，提高净资本。2019 年度公司

以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标持续符合监管标准。

东北证券股份有限公司

二〇二〇年四月八日