

2026年上半年风险控制指标情况报告

公司已实现对各风险种类、全部业务条线、全体分支机构、全体子公司的风险管理全覆盖。2026年上半年，公司继续从组织架构、制度体系、信息系统、指标体系、员工队伍、风险处置等六个方面推动全面风险管理体系建设。公司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，及时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、报告期内公司主要风险控制指标情况（母公司口径）

单位：元

风控指标	2025 年 12 月 31 日	2026 年 6 月 30 日	预警标准	监管标准
核心净资本	19,107,544,729.08	19,403,414,712.71		
附属净资本	0.00	0.00		
净资本	19,107,544,729.08	19,403,414,712.71		
净资产	23,953,315,643.05	24,422,506,981.32		
各项风险资本准备之和	8,547,972,586.52	6,928,328,490.62		
表内外资产总额	66,847,713,754.86	62,646,687,317.24		

风险覆盖率	223.53%	280.06%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	28.84%	31.25%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	301.03%	254.89%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	211.86%	199.10%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	79.77%	79.45%	≥24%	≥20%
净资本/负债	45.86%	52.68%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	57.49%	66.30%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	3.79%	8.09%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	142.24%	94.56%	≤400%	≤500%

报告期内，公司以净资本和流动性为核心的各主要风险控制指标均持续符合监管标准。

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《风险控制指标管理办法》、《风险限额管理办法》、《压力测试管理办法》等制度，明确了风险控制指标监控及压力测试等工作要求。

公司风险控制指标的动态风险管理流程包括风险识别、评估、监测、控制与报告。公司建立了风险控制指标动态监控技术系统，指定专人对净资本等风险控制指标进行日常监控与报告。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

2026 年上半年，公司根据中国证券业协会下发的通知，组织开展了 2026 年度综合压力测试。测试结果显示，公司在轻、中、重度压力情景各项风险控制指标均未触及监管预警标准。

公司在开展证券承销、利润分配、设立子公司或增资子公司、开展重大创新业务等重大业务或经营行为时，均开展了风险控制指标压力测试，在测算分析基础上提出经营管理建议，确保公司的各项风险控制指标符合监管要求。

华西证券股份有限公司

2026 年 8 月 24 日