

证券代码： 601375 证券简称： 中原证券 公告编号： 2020-025

中原证券股份有限公司第六届董事会 第十八次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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责任。

中原证券股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第十八次会议通知于 2020 年 4 月 9 日以邮件等方式发出，并于 2020 年 4 月 17 日以通讯表决方式召开。会议应出席董事 11 人，实际出席董事 11 人。本次会议的召集、召开及表决程序符合《公司法》和《公司章程》的规定。本次会议由董事长菅明军先生主持，审议并通过了以下议案：

一、审议通过了《关于计提资产减值准备的议案》

表决结果：同意 11 票，反对 0 票，弃权 0 票。

公司董事会审计委员会对本议案进行了预先审阅。

独立董事对本议案发表了同意的独立意见。独立董事认为：公司本次计提资产减值准备符合《企业会计准则》和公司会计政策等相关规定，真实公允地反映了公司截至 2020 年 3 月 31 日的财务状况及 2020 年第一季度的经营成果，有助于向投资者提供更加真实、可靠、准确的会计信息，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

具体内容请参阅公司于 2020 年 4 月 10 日披露的《中原证券股份有限公司关于计提资产减值准备的公告》（公告编号：2020-023）。

二、审议通过了《关于确定 2020 年度风险偏好和风险容忍度的议案》

表决结果：同意 11 票，反对 0 票，弃权 0 票。

公司董事会发展战略委员会及风险控制委员会对本议案进行了预先审阅。

根据公司目前状况和未来经营规划，在符合监管要求的基础上，同意公司

2020 年度风险偏好和风险容忍度：

(一) 公司风险偏好

2020 年总体定位为稳健风险偏好策略，始终秉持资本、风险与收益相匹配的风险管理理念，以承担适度风险，实现业务规模、盈利能力与风险承受能力的最优平衡，为股东带来持续稳定的利润回报。有效控制市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险以及声誉风险等各项风险，确保公司不发生严重风险事件。

流动性风险偏好定位为稳健风险偏好策略，正常情景下公司流动性监管指标能够持续符合监管预警标准，压力情景下公司流动性监管指标能够持续符合监管标准，确保公司具备充足的流动性储备能力及筹资能力，满足各项业务的正常开展。

(二) 公司风险容忍度

- 1、风险覆盖率不低于 125%；
- 2、资本杠杆率不低于 10%；
- 3、流动性覆盖率在正常情景下不低于 120%，在压力情景下不低于 100%；
- 4、净稳定资金率在正常情景下不低于 120%，在压力情景下不低于 100%；
- 5、净资本/净资产不低于 26%；
- 6、净资本/负债不低于 10.4%；
- 7、净资产/负债不低于 13%；
- 8、自营权益类证券及其衍生品/净资本不超过 70%；
- 9、自营非权益类证券及其衍生品/净资本不超过 350%；
- 10、融资（含融券）的金额/净资本不超过 280%。

三、审议通过了《关于 2020 年度资产管理业务自有资金投入规模及风险限额的议案》

表决结果：同意 11 票，反对 0 票，弃权 0 票。

公司董事会发展战略委员会对本议案进行了预先审阅。

同意公司 2020 年度自有资金用于资产管理业务的总规模不超过 2 亿元，资管产品风险限额不超过投入资金的 5%。

四、审议通过了《关于确定 2020 年度融资融券、股票质押、约定购回及转

融通业务规模的议案》

表决结果：同意 11 票，反对 0 票，弃权 0 票。

公司董事会发展战略委员会对本议案进行了预先审阅。

根据公司业务开展情况和未来经营需要，同意以下事项：

（一）2020 年度融资融券与约定购回业务规模为 79 亿元。

（二）董事会授权投资决策委员会根据公司自有资金、证券情况，在中国证券金融股份有限公司授信额度内确定转融通业务规模。

（三）董事会授权投资决策委员会根据公司资金和流动性情况，在风控指标持续达标的前提下配置融资融券和约定购回业务资金规模。

（四）2020 年度股票质押业务（自有资金出资）规模确定为 21 亿元（含应收利息，并扣除减值后金额），股票质押业务（非自有资金出资）规模确定为 15 亿元。

特此公告。

中原证券股份有限公司董事会

2020 年 4 月 18 日