

证券代码： 601375      证券简称： 中原证券      公告编号： 2021-012

## 中原证券股份有限公司第六届董事会 第二十七次会议决议公告

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”）第六届董事会第二十七次会议通知于 2021 年 3 月 11 日以电子邮件等方式发出，并于 2021 年 3 月 25 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《关于确定 2021 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。

董事会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 2021 年度公司风险偏好和风险容忍度：

#### （一）公司风险偏好

2021 年公司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不低于监管预警标准，压力情景下公司流动性监管指标能够持续不低于监管标准，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

在公司稳健风险偏好的指导思想下，制定 2021 年公司风险容忍度指标体系如下：

1、整体风险容忍度

- (1) 风险覆盖率不低于 145%；
- (2) 资本杠杆率不低于 14%；
- (3) 净资本/净资产不低于 46%；
- (4) 净资本/负债不低于 19%；
- (5) 净资产/负债不低于 40%；
- (6) 集团整体损失/上年度经审计净资产（合并）不超过 6.5%。

2、市场风险容忍度

- (1) 自营权益类证券及其衍生品/净资本不超过 50%；
- (2) 自营非权益类证券及其衍生品/净资本不超过 350%。

3、信用风险容忍度

融资（含融券）的金额/净资本不超过 200%。

4、流动性风险容忍度

- (1) 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 108%；
- (2) 净稳定资金率在正常情景下不低于 121%，在压力情景下不低于 109%。

5、操作风险容忍度

年度操作风险损失/上年度经审计营业收入（合并）不超过 2%。

6、声誉风险容忍度

通过有效的管理措施，建立和维护公司良好的社会形象，不发生重大声誉风险事件。

**二、审议通过了《关于确定 2021 年度证券自营业务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。

同意 2021 年度公司自营业务规模及风险限额如下：

（一）自营非权益类证券及其衍生品投资规模不超过（实时）净资产的 350%，可承受风险限额不超过自有资金投资总额的 5%；

（二）自营权益类证券及其衍生品投资规模不超过（实时）净资产的 50%，可承受风险限额不超过自有资金投资总额的 15%。

同意授权公司经营管理层在符合中国证券监督管理委员会有关自营管理、风险监控的相关规定的条件下,根据市场情况在授权额度内确定具体资金规模及风险限额。

本议案需提交股东大会审议。

### **三、审议通过了《关于确定 2021 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。

同意 2021 年度公司自有资金用于资产管理业务的总规模不超过人民币 0.58 亿元, 资管产品风险限额不超过投入资金的 20%。

### **四、审议通过了《关于确定 2021 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。

根据近期公司业务开展情况和未来实际经营需要, 同意以下事项:

(一) 2021 年度公司融资融券与约定购回业务规模为人民币 121 亿元;

(二) 授权公司经营层根据自有资金、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) 授权公司经营层在上述规模内, 根据资金和流动性情况, 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) 2021 年度公司股票质押业务(自有资金出资)规模为人民币 25 亿元, 股票质押业务(非自有资金出资)规模为人民币 12 亿元。

### **五、审议通过了《关于确定 2021 年对外捐赠预算以及制定〈中原证券股份有限公司对外捐赠管理办法〉的议案》**

表决结果: 同意 11 票, 反对 0 票, 弃权 0 票。

结合最近一年度经营和对外捐赠情况, 同意 2021 年度公司对外捐赠预算为人民币 300 万元。

## 六、审议通过了《关于 2021 年预计日常关联/持续关连交易的议案》

表决结果：关联/连董事李兴佳回避表决，同意 10 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。

独立董事对该事项进行了事前认可，并发表了同意的独立意见。独立董事认为：经审查，《关于 2021 年预计日常关联/持续关连交易的议案》符合《公司法》《上市公司治理准则》《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司关联交易实施指引》和香港联交所上市规则及其他相关法律法规等规定，遵循了关联/连交易价格公平、公正原则，关联/连交易定价以公允价格执行，关联董事进行了回避表决，审议程序合法合规，不存在损害公司及中小股东利益的情况，相关业务的开展有利于促进公司的业务增长，符合公司实际业务需要，有利于公司的长远发展。

具体内容请参阅与本公告同日披露的《中原证券股份有限公司关于 2021 年预计日常关联/持续关连交易的公告》（公告编号：2021-014）。

特此公告。

中原证券股份有限公司董事会

2021 年 3 月 26 日