

证券代码：000776

证券简称：广发证券

## 广发证券股份有限公司投资者关系活动记录表

编号：2018090401

投资者关系活动类别	<input checked="" type="checkbox"/> 特定对象调研 <input type="checkbox"/> 分析师会议 <input type="checkbox"/> 媒体采访 <input type="checkbox"/> 业绩说明会 <input type="checkbox"/> 新闻发布会 <input type="checkbox"/> 路演活动 <input type="checkbox"/> 现场参观 <input type="checkbox"/> 其他
参与单位名称及人员姓名	汇丰分析师 York Pan 汇丰分析师 Livy Lyu
时间	2018年9月4日上午 10:00-11:00
地点	公司 38 楼大会议室
上市公司接待人员姓名	公司副总经理、董事会秘书 罗斌华先生 董事会办公室 王强女士
投资者关系活动主要内容介绍	<p><b>1、目前公司股票质押回购业务的规模？</b></p> <p>答：2018年以来，在持续强化股票质押业务的风控准入前提下，公司股票质押业务保持平稳。截至2018年6月底，公司通过自有资金开展场内股票质押式回购业务余额为263.28亿元，较2017年底下降0.96%。</p> <p>公司股票质押回购业务风险整体可控，平均履约保障比例超过230%，远高于市场平均水平，安全垫较大。</p> <p><b>2、公司如何加强股票质押回购业务的风险控制？</b></p> <p>答：目前公司股票质押回购业务的风险总体可控，防范股票质押回购业务风险需要重点做好融资主体尽职调查、标的证券管理和融资后持续管理等工作。</p> <p>公司日常除了维持担保比例盯市之外，还通过多种方式做好业务风险防范工作，例如利用大数据分析和引入第三方征信平台做好对融资主体的征信调查；借助舆情监控</p>

工具和手段做好标的股票的日常跟踪分析；做好质押行为监控工作，密切跟踪市场整体质押比例、融资主体持股质押比例的变化等。

**3、公司获得场外期权一级交易商资格后业务发展情况？**

答：2018年8月，公司收到中国证券监督管理委员会《关于广发证券申请场外期权一级交易商资质的无异议函》，对公司申请场外期权一级交易商资格无异议。

为充分发挥一级交易商的优势，公司将积极加强机构客户拓展，高度重视与金融同业等的交易机会，同时关注海外和香港市场，拓展挂钩境外标的的多品种多结构的场外期权交易，为专业机构投资者提供丰富的风险管理工具。

**4、公司如何防范期权业务的风险？**

答：随着防控金融风险重要性日益提升，公司在制度、人员等方面持续提升合规风控水平。

公司依据场外期权交易业务的风险特征结合公司内部风险管理等规范，针对不同的风险类型制定相应的风险计量与控制措施，风险类型分别包括市场风险、信用风险、流动性风险、模型风险、操作风险等。

**5、目前场外期权业务的发展情况以及未来前景如何？**

答：我国场外衍生品市场仍处于起步阶段，发展空间巨大。场外期权是有助于提升机构投资者的风险管理能力，以及实现个性化需求的重要工具。对于国内证券公司，场外衍生品有助于金融机构开展业务的创新，改变市

	<p>场产品同质化格局，促进产品金融更加成熟，实现资本市场的国际化，同时使得证券公司更好地服务实体经济。</p> <p>未来，公司将稳步开展场外期权业务，持续丰富场外衍生品类型和业务模式。具体工作规划：（1）在符合监管新规要求下，加强机构客户拓展；（2）继续创设新的期权类型；（3）加强业务协同，推进与零售系统、发展研究中心以及投行在业务领域的合作。</p> <p>接待过程中，公司接待人员与投资者进行了充分的交流与沟通，严格按照《信息披露管理制度》等规定，保证信息披露的真实、准确、完整、及时、公平。没有出现未公开重大信息泄露等情况，同时已按深交所要求签署调研《承诺书》。</p>
附件清单（如有）	无
日期	2018年9月4日