

海通國際獲《亞洲風險》評為「2017 年度最佳券商」 高水準風險管理通過市場考驗

香港，2017 年 9 月 29 日 – 海通國際(665.HK)日前在由《亞洲風險 Asia Risk》舉辦的「2017 亞洲風險管理大獎」中，獲選「年度最佳券商」，這是公司首次參選，首次獲獎。該獎項旨在表彰亞洲區內于金融風險管理、衍生工具和結構性產品方面具有優異表現及穩健增長的證券公司。評審機構對海通國際紮根香港至今，從未受到香港證監會任何處罰，以及在業務高速發展的同時，不斷改善其風險管理體系表示認可。

風險管理是企業發展不可或缺的基石，海通國際對風險有著精準的定義、識別、度量與有效的管理，同時著眼全域，針對每一條業務線落實健全的風險管理措施，風險管理團隊覆蓋市場、信用及營運風險，由具有高度專業性和國際視野的員工組成，團隊成員具備全球風險管理協會授予的 FRM（風險管理專業人員）資格並擁有在不同類型的國際投行專業工作經驗。

出色的風險管理和雄厚的資本實力持續推動公司成長，繼 2014 年獲得國際信貸評級機構標普 BBB 長期信用評級後，海通國際本月初再獲穆迪首次給予 Baa2 長期發行人評級和 Prime-2 短期發行人評級，展望穩定，該首次信用評級為在港中資金融機構最高級別。公司具靈活性的資金來源及低於國際同業水準的槓桿率，使海通國際成為唯一一家獲穆迪給予獨立評級的中國券商在港子公司，反映了其對海通國際品牌及風險管理能力的認可。

面對瞬息萬變的資本市場及結構複雜的金融產品，海通國際在風險管理上一直對自身有高於行業標準的要求，積極改進並強化公司的風險管理。在市場風險方面，雖然海通國際不受巴塞爾協議的監管約束，但為了準確合理地計量市場風險，公司自 2016 年開始，借鑒巴塞爾協定 III 中對交易帳戶和銀行帳戶的劃分定義(FRTB)，結合自身實際，把產品、業務列入相應的交易帳戶或銀行帳戶。這一舉措有助於利用 VaR 等風險測度對交易性和非交易性的市場風險進行更清晰的計量，以作公司內部的市場風險控制和管理之用。

今年，市場風險管理也在壓力測試中加入前瞻性的風險事件，如美聯儲縮表、中國主權評級降級、香港遭遇恐怖襲擊等，每日監控公司的資產組合在這些壓力情景下的市場風險變化情況，並對相關情景進行季度複審。而在信用風險方面，公司風險管理部通過資料採擷、處理以及相關統計模型的應用，優化了公司的股票品質分類報告引擎(SCReEn)，對在香港市場上市的股票進行品質分類。對品質較差的股票，公司通過該引擎進行過濾，給予相關股票較低的借貸比率，甚至限制其作為抵押品的使用。

海通國際業務多元化，涵蓋企業融資、經紀、資產管理、固定收益/外匯及商品、股票衍生產品等，也是唯一一家為全球的機構、企業及零售客戶提供覆蓋香港、新加坡、東京、紐約、倫敦及孟買市場金融業務的中資投行。公司的總資產 4 年內增長近 800%至 2016 年底的 1,320 億港元。以 2016 年底資產規模計算，海通國際位居在港中資券商首位。



《亞洲風險》是亞洲地區唯一一家專業報導金融風險管理和衍生產品市場的國際媒體，自2000年起，該雜誌每年在亞洲地區金融機構中開展風險管理相關獎項評選。今年是第十八屆「亞洲風險管理大獎」評選。





海通國際證券集團有限公司

海通國際證券集團有限公司(「海通國際」, 股份代號: 665.HK)是一家立足香港, 面向全球的國際金融機構, 致力於成為連接中國與海外資本市場的橋樑。母公司為海通證券股份有限公司(股份代號: 600837.SH, 6837.HK)。海通國際致力為近 20 萬全球及本地企業、機構及零售客戶提供包括企業融資、經紀業務、資產管理、固定收益/外匯及商品、股本業務等全面金融產品及服務。海通國際擁有完善及國際標準的風險管理體系, 業務網絡涵蓋香港、新加坡、紐約、倫敦、東京及印度等全球主要資本市場。

查詢詳情, 請聯絡:

海通國際證券集團有限公司

鄧玉珊 Theresa Tang

電話: (852) 2213 8508

電郵: theresa.ys.tang@htisec.com