

南华期货股份有限公司

关于风险监管指标专项报告

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。

根据《期货公司风险监管指标管理办法》等相关规定，南华期货股份有限公司 2019 年度各项监管指标均符合标准，具体报告如下：

(1) 从事资产管理业务的期货公司净资本不得低于 50,000 万元，该指标的预警标准为 60,000 万元。我司 2019 年度净资本为 100,477 万元，符合标准。

(2) 净资本与风险资本准备总额的比例（净资本/风险资本准备）不得低于 100%，该指标的预警标准为 120%。我司 2019 年 12 月 31 日净资本为 100,477 万元，风险资本准备总额为 22,073.15 万元，净资本与风险资本准备总额的比例（净资本/风险资本准备总额）为 455%，符合标准。

(3) 净资本与净资产的比例不得低于 20%，该指标的预警标准为 24%。我司 2019 年 12 月 31 日净资本为 100,477 万元，净资产为 226,382.38 万元，净资本与净资产的比例（净资本/净资产）为 44%，符合标准。

(4) 流动资产与流动负债的比例不得低于 100%，该指标的预警标准为 120%。我司 2019 年 12 月 31 日流动资产（不含客户权益）为 157,220.20 万元，流动负债（不含客户权益）为 17,257.32 万元，流动资产与流动负债的比例（流动资产/流动负债）为 911%，符合标准。

(5) 负债与净资产的比例不得高于 150%，该指标的预警标准为 120%。我司 2019 年 12 月 31 日负债（不含客户权益）为 63,151.15 万元，净资产为 226,382.38 万元，负债与净资产的比例（负债/净资产）为 28%，符合标准。

(6) 最低限额的结算准备金要求，目前监管指标为 1200 万元。我司 2018 年 12 月 31 日结算准备金余额为 71,326.60 万元，符合标准。

特此报告。

南华期货股份有限公司董事会

2020 年 3 月 14 日