



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司  
Yongan Futures Co.,Ltd.

半年度报告

—2018—

## 公司半年度大事记

2018年1月，永安期货南京营业部正式营业。公司现共设立有36家营业部，5家分公司。

2018年1月，公司获上海期货交易所2017年天然橡胶“保险+期货”精准扶贫试点项目贡献奖。

公司荣获第十五届中国财经风云榜“金牌资产管理奖”“年度期货行业品牌奖”两项大奖，总经理葛国栋荣获“杰出奖门人”。

公司与吉林人保财险、吉林云天化、哈尔滨泰和丰供应链公司联合开展的“收入保险+订单农业”金融扶贫试点项目全面完成出单。

公司“源点资讯”综合性期货研究网络服务平台获第六届证券期货科学技术奖优秀奖。

公司荣获金融界第六届领航中国年度评选“杰出产业服务奖”

风险管理子公司浙江永安资本管理有限公司与河北正大玻璃有限公司达成战略合作，双方将深耕于玻璃产业链，共同展开期现结合业务，建立长期战略合作伙伴关系。

公司荣获浙江省人民政府颁发的“支持浙江经济社会发展先进单位”二等奖。

公司在2018浙江新三板峰会上获得“浙江精选企业奖、浙江新三板特别贡献奖”两项大奖。

# 目 录

声明与提示 .....	5
第一节 公司概况 .....	6
第二节 会计数据和财务指标摘要 .....	8
第三节 管理层讨论与分析.....	10
第四节 重要事项 .....	18
第五节 股本变动及股东情况.....	22
第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工情况.....	25
第七节 财务报告 .....	29
第八节 财务报表附注 .....	44

## 释义

释义项目		释义
公司、本公司、股份公司、永安期货	指	永安期货股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
财通证券	指	财通证券股份有限公司，系永安期货的控股股东
中期协	指	中国期货业协会
省财开	指	浙江省财务开发公司
省金控	指	浙江省金融控股有限公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
浙江东方	指	浙江东方集团股份有限公司
经建投	指	浙江省经济建设投资有限公司
协作大厦	指	浙江省协作大厦有限公司
香港新永安	指	中国新永安期货有限公司
新永安实业	指	中国新永安实业有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
永安国富	指	永安国富资产管理有限公司
公司章程	指	永安期货现行有效的并经工商行政管理部门备案的章程
报告期	指	2018年1月1日-2018年6月30日的期间
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本半年度报告中，部分合计数与加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，此类差异系四舍五入造成。

## 声明与提示

**【声明】**公司董事会及其董事、监事会及其监事、公司高级管理人员保证本报告所载资料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。

公司负责人葛国栋、主管会计工作负责人叶元祖及会计机构负责人（会计主管人员）罗利周保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

事项	是或否
是否存在董事、监事、高级管理人员对半年度报告内容存在异议或无法保证其真实、准确、完整	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未出席董事会审议半年度报告的董事	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在豁免披露事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否审计	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否

### 【备查文件目录】

文件存放地点	公司董事会办公室
备查文件	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 报告期内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原件；</li><li>2. 载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表；</li><li>3. 公司 2018 年半年度报告及审议半年度报告的董事会决议、监事会决议。</li></ol>

## 第一节 公司概况

### 一、 基本信息

公司中文全称	永安期货股份有限公司
英文名称及缩写	Yongan Futures Co., Ltd.
证券简称	永安期货
证券代码	833840
法定代表人	葛国栋
办公地址	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16 层-17 层、2702 室

### 二、 联系方式

董事会秘书或信息披露负责人	叶元祖
是否通过董秘资格考试	是
电话	(0571) 8837 1925
传真	(0571) 8837 1935
电子邮箱	yaqh@yafco.com
公司网址	www.yafco.com
联系地址及邮政编码	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼, 310016
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司半年度报告备置地	公司董事会办公室

### 三、 企业信息

股票公开转让场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1992 年 9 月 7 日
挂牌时间	2015 年 10 月 28 日
分层情况	创新层
行业（挂牌公司管理型行业分类）	J 金融业-67 资本市场服务-672 期货市场服务-6729 其他期货市场服务
主要产品与服务项目	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售、风险管理等
普通股股票转让方式	集合竞价
普通股总股本（股）	1,310,000,000
优先股总股本（股）	0
做市商数量	0
控股股东	财通证券股份有限公司
实际控制人及其一致行动人	浙江省财政厅

#### 四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	9133000010002099X5	否
金融许可证机构编码	000000012114	否
注册地址	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16 层-17 层、2702 室	是
注册资本（元）	1,310,000,000	否

#### 五、 中介机构

主办券商	中信证券
主办券商办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
报告期内主办券商是否发生变化	否
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
签字注册会计师姓名	葛徐、宋慧娟
会计师事务所办公地址	杭州市江干区钱江路 1366 号华润大厦 B 座

#### 六、 自愿披露

适用 不适用

#### 七、 报告期后更新情况

适用 不适用

## 第二节 会计数据和财务指标摘要

### 一、基本财务指标

单位：元

	本期/本期期末	上年同期/上期期末	增减比例
营业收入	6,484,165,503.29	4,903,209,488.93	32.24%
归属于挂牌公司股东的净利润	548,598,935.52	472,832,055.88	16.02%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	532,060,068.84	473,416,890.82	12.39%
加权平均净资产收益率%(依据归属于挂牌公司股东的净利润计算)	9.61%	9.48%	-
加权平均净资产收益率%(归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算)	9.32%	9.49%	-
基本每股收益(元/股)	0.42	0.36	16.02%
经营活动产生的现金流量净额	-160,694,433.84	-2,227,180,920.42	-92.78%
资产总计	32,268,394,204.92	30,426,240,615.95	6.05%
负债总计	26,042,679,998.47	24,755,558,801.78	5.20%
归属于挂牌公司股东的净资产	5,870,863,432.92	5,542,078,393.30	5.93%
归属于挂牌公司股东的每股净资产(元/股)	4.48	4.23	5.93%
总资产增长率	6.05%	-2.64%	-
营业收入增长率%	32.24%	108.12%	-
净利润增长率%	17.18%	142.52%	-
扣除客户权益的资产负债率%(母公司)	16.87%	20.68%	-
扣除客户权益的资产负债率%(合并)	29.20%	31.92%	-

### 二、行业主要财务及监管指标

单位：元

	本期期末	本期期初	增减比例
净资本	1,955,208,419.13	1,835,627,752.14	6.51%
风险资本准备总额	657,930,510.68	614,744,718.63	7.02%
净资本与风险资本准备总额的比例	297%	299%	-
净资本与净资产的比例	36%	36%	-
扣除客户保证金的流动资产	2,592,464,262.14	2,745,106,784.61	-5.56%
扣除客户权益的流动负债	1,097,882,296.97	1,346,958,238.66	-18.49%
流动资产与流动负债的比例(扣除客户权益)	236%	204%	-
负债与净资产的比例(扣除客户权益)	20%	26%	-
结算准备金额	1,765,451,105.60	2,136,922,802.92	-17.38%

注：根据监管要求，数据口径为母公司口径，“扣除客户保证金的流动资产”不含报表列示的其他流动资产、应收股利；

“扣除客户权益的流动负债”包含报表列示的非流动负债。

### 三、 补充财务指标

适用 不适用

### 四、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

适用 不适用 单位：元

科目	上年期末（上年同期）		上上年期末（上上年同期）	
	调整重述前	调整重述后	调整重述前	调整重述后
应收账款[注 1]	683,162.17	0	4,826,110.87	0
应收票据及应收账款[注 1]	0	683,162.17	0	4,826,110.87
应收利息	15,351,917.04	0	1,465,340.51	0
其他应收款	59,576,612.94	74,928,529.98	37,400,765.76	38,866,106.27
应付账款	27,142,702.05	0	0	0
应付票据及应付账款	0	27,142,702.05	0	0
应付利息	9,453,253.06	0	17,743,182.49	0
应付股利	196,500,000.00	0	0	0
其他应付款[注 2]	359,180,178.12	565,133,431.18	384,508,879.20	402,252,061.69
业务及管理费	403,144,899.91	402,041,621.00	293,819,163.67	292,946,577.25
研发费用	0	1,103,278.91		872,586.42

注 1：此处所列“应收票据及应收账款”与第八节财务报表附注五（一）5 存在差异，系审计将“应收票据及应收账款”、“应收佣金”合并列示为“应收票据及应收账款”。

注 2：此处所列“其他应付款”与第八节财务报表附注五（一）29 存在差异，系审计将“其他应付款”、“应付手续费及佣金”合并列示为“其他应付款”。

注 3：财政部于 2018 年度颁布了《财政部关于修订印发 2018 年度一般企业财务报表格式的通知》（财会[2018]15 号），公司按照企业会计准则和通知的要求进行编制财务报表，对比较报表的列报进行了上表相应调整，仅对财务报表项目列示产生影响，对公司财务状况、经营成果和现金流量无重大影响。

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、 商业模式

本公司经营业务主要包括：期货、期权经纪业务、期货投资咨询业务、资产管理业务、风险管理业务、基金销售业务等，具体商业模式如下：

#### 1. 期货、期权经纪业务

期货经纪业务主要包括代理客户的经纪业务和代理客户的结算业务，是期货公司最基本的一项业务。公司期货经纪业务收入主要包含三方面：交易手续费、交割手续费和交易所手续费返还或减收。期货经纪业务的主要营销渠道包括传统网点渠道、券商 IB 业务渠道和居间人。保证金利息收入亦是公司收入的重要来源。期货交易实行保证金制度，根据《期货交易管理条例》的规定，保证金是指期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价证券，用于结算和保证履约。在实际业务中，客户多以资金的形式向期货公司交纳保证金。

期权经纪业务即代理客户期权方面的经纪业务，业务收入主要包括交易手续费和保证金利息收入。期权交易实行保证金制度，作为期权卖方的交易者需按照规定缴纳足额的资金或者标的证券，用于开仓前端检查和结算、履约保证。期权经纪业务的主要营销渠道包括传统网点渠道以及期货公司 IB 业务渠道。

#### 2. 期货投资咨询业务

期货投资咨询业务是指公司基于客户委托，提供包括风险管理顾问咨询、行业研究分析、交易策略咨询等服务。期货投资咨询服务的对象有普通投资者、产业客户、机构投资者。期货投资咨询业务作为公司开展差异化竞争的服务模式，通过专业化金融衍生品及策略研究，为客户量身打造个性化的风险管理和投资管理的服务模块，帮助产业客户实现保值增值，帮助机构客户实现资产优化配置的多样化需求。

#### 3. 资产管理业务

资产管理业务是指公司接受单一客户或者特定多个客户的书面委托，根据相关规定及合同约定，运用客户委托资产进行投资，并按照合同约定收取费用或者报酬的业务活动，包括：期货、期权及其他金融衍生品；股票、债券、证券投资基金、集合资产管理计划、央行票据、短期融资券、资产支持证券等；中国证监会认可的其他投资品种。公司资产管理业务收入主要来自两方面：一是管理费收入，二是基于资产管理业绩的分成收入。公司收取的管理费率按合同约定比例为准。管理业绩分成收入是公司与管理受托资产盈利水平挂钩的利润分成，产品到期时公司按照约定的比例收取管理业绩分成。

#### 4. 基金销售业务

基金销售业务是指公司接受基金管理人的委托，签订书面代销协议，代理基金管理人销售经国家有关部门或者其授权机构批准或者备案在境内发行的基金产品，受理投资者基金认购、申购和赎回等业务申请，同时提供配套服务的一项中间业务。

#### 5. 风险管理业务

公司风险管理业务主要通过设立的风险管理子公司开展包括基差交易、仓单服务、合作套保、定价服务、做市业务及其他与风险管理服务相关的试点业务，涵盖期货上市品种及其产业链相关品种的现货贸易、远期交易和期货交割等。公司风险管理业务以服务实体产业客户为宗旨，以品种基本面研究为基础，依靠期、现货各方面的渠道资源，结合场内交易和场外交易两个市场，综合利用期货、期权、互换等金融衍生工具，致力于为客户提供一流的期现结合与风险管理产品与服务，形成稳定、可持续的盈利模式和交易体系，发展成为业内领先的商品、金融市场风险管理服务商。

#### 6. 自有资金投资业务

自有资金投资业务是指公司通过战略性投资、财务性投资和资本市场运作，促使公司实现更高的资本回报和更快的业务增长，是公司投研能力的直接体现，为公司创新业务提供支持的同时兼顾开拓稳定、可持续的收入来源。

### 商业模式变化情况：

适用 不适用

## 二、 经营情况回顾

2018年上半年，公司以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，深入学习贯彻党的十九大精神，全面加强党的领导，坚持一切只为客户，回归本源发展主业，着力控制不发生金融风险，努力做好精准扶贫、人才培养和制度建设等工作，公司各项业务取得高质量发展。

报告期内，公司经纪业务、风险管理、财富管理和国际业务继续向好，资管业务风险可控可测稳中向好，投资收益稳步增长，营业收入继续增长，盈利能力进一步增强。公司实现营业收入 64.84 亿元，同比增长 32.24%；归属于母公司所有者的净利润 5.49 亿元，同比增长 16.02%。

截止报告期末，公司注册资本 13.10 亿元，归属于母公司所有的净资产为 58.71 亿元。公司（母公司本级）自 2011 年起监管评级为 A 类 AA 级，各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截止报告期末，公司净资本为 19.55 亿元，风险资本准备总额为 6.58 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 297%，净资产为 54.12 亿元，净资本与净资产的比例为 36%，流动资产与流动负债的比例为 236%，负债与净资产的比例为 20%，各项风险监管指标均符合监管部门要求。

### 三、 风险与价值

#### 1. 期货、期权经纪业务风险

目前期货公司经纪业务手续费收入仍是我国期货业主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日趋激烈，近年来公司客户交易规模增长的同时，手续费率和手续费收入在持续下滑，公司期货经纪业务面临着竞争风险以及盈利能力下降风险。

应对措施：公司的经纪业务构建了高效的集中管理模式，依托集中交易、集中清算、集中财务、集中风控四大技术平台来实现业务连接和安全运行。公司期货、期权经纪业务立足以产业客户为基础，始终坚持服务客户，发挥各营业网点区域优势，成立专门的期货品种业务团队，进行以扩大市场，同时向金融期货寻求突破。

#### 2. 利息收入下滑风险

利息收入是我国期货公司营业收入的重要来源之一，公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。虽然公司的客户保证金和自有资金规模逐年上升，利息收入逐年增长，但是利率水平的变化也将影响公司的营业收入和净利润水平。如果利率水平出现大幅下滑，或者客户保证金和自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。另外，随着市场竞争加剧、客户保证金规模持续上升、市场关注度提高，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。

应对措施：公司已与多家保证金存管银行开展业务合作，存款利率由各银行报价，按竞争报价原则协定存款；自有资金关注证券等金融机构稳定的固收产品，往往会高于存款利率。这些措施一定程度对冲利率下行风险。

#### 3. 期货投资咨询业务风险

由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致营利性质的期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广，且公司未能在研究分析、市场推广、客户体验等方面做到进一步提高或突破，可能导致期货投资咨询业务收入仍难以取得实质性突破。同时，期货投资咨询业务依赖于投资咨询部门及工作人员的专业能力，客户根据公司对行情、风险等要素的判断进行交易，若投资策略出现重大失误或者员工出现违规行为，可能导致客户亏损或与公司产生纠纷，从而影响公司期货投资咨询业务的开展及公司声誉。

应对措施：公司以提升研究水平为目标，全面整合研究资源，强化研究在公司发展中的核心竞争力。同时梳理了对投资咨询业务的规范化管理，明确投资咨询业务的审核流程，对投资咨询业务进行定期回访。

#### 4. 资产管理业务风险

公司的资产管理业务面临证券公司、基金公司、保险公司、信托公司、银行及其他期货公司等金融

机构类似产品的激烈竞争，同时期货行业专业投资人才相对缺乏。若公司不能在投资团队、产品设计、市场推广、投资绩效、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司资产管理业务的进一步拓展。此外，资产管理业务拓展过程中，可能存在投资团队建设和投资管理能力不足的风险，导致公司为客户设定的资产组合方案由于市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当、人员操作失误等原因无法达到预期收益或遭受损失，从而导致公司资产管理规模的降低和收入的下降。

应对措施：公司正开始向全资产配置转型：一是抓好优质资产，以统分结合的方式，开发优秀投顾；二是加强大型机构资金对接；三是做好 FOF 等自主品牌的产品创设工作。

#### 5. 基金销售业务风险

公司的基金销售业务面临证券公司、银行及其他三方销售机构等金融机构类似产品的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司基金销售业务的进一步拓展。

应对措施：公司将加强基金销售在技术上的互联网化，特别是移动端的开发使用。对于潜在经营风险，公司将根据基金产品尽职调查及风险评估制度对所销售产品的风险状况进行审慎评估，并据此划分其风险等级，确定适合购买的客户类别和范围；同时根据基金销售适用性管理制度，向客户推介基金产品之前，了解客户的身份、财产和收入状况、金融知识和投资经验、投资目标、风险偏好等基本情况，评估其购买基金产品的适当性；此外，公司 CRM 系统已经上线，其作用是整理公司基金产品直销、代销数据，明确业务人员和客户归属关系，完善客户资产信息，统一业务流程，有助于公司进一步提高业务人员的服务效率。

#### 6. 业务创新风险

由于我国期货行业的创新业务尚处于发展期，公司在开展创新业务过程中可能存在因业务经验、人才储备和经营管理水平等不相匹配，从而出现产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位、风险管理及内控措施不健全而导致的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、机制不健全、措施不完善或执行不力，可能发生较大规模的风险事件或出现严重亏损，从而造成公司经营业绩大幅下滑。

应对措施：公司将加强对创新业务的建制工作，结合监管要求，加大内部稽核，确保创新业务可持续发展。

#### 7. 投资风险

在风险可控的情况下，公司使用自有资金开展投资业务，配置范围包括私募基金、证券市场、基金、信托产品等金融产品。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的操作风险和市场

风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损影响公司盈利能力的可能。

应对措施：公司设有自有资金评审委员会、投资决策委员会，实行自有资金集体决策管理，并对自有资金投资制定了一整套明晰完备的投资管理制度，以强化对投资项目的风险管控。

#### 8. 合规风险

金融行业属于国家特许经营行业，公司具体开展业务时需满足净资本、风险管理、公司治理、人才储备、机构设置、合规运营等方面满足监管部门的要求。目前中国证监会根据监管需要，以期货公司风险管理能力为基础，结合公司市场影响力和持续合规状况，对期货公司进行分类评价，其分类结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标，如果公司未来获得的评级结果出现下调，将可能对公司现有业务开展、申请增加新业务或新业务试点范围等方面产生不利影响。

应对措施：公司致力于加强风险管理水平，将“合规创造价值”引入以风险管理能力为核心的考核指标体系，牢固树立合规经营和风险管理理念。公司已建立符合监管规定的、较为完善的风险管理和内部控制制度。通过制度建设、宣传培训、实时监控、配合跟进、合规稽核等方式对公司的经营管理各环节开展从事前至事后的内部监督。公司加强企业文化建设和法制教育等措施，出台员工职业行为“十严禁”，让“合法合规、诚实自律”的经营理念深入人心。公司稽核督查总部协助首席风险官工作，向经营层负责，形成的监控、稽核报告及时汇报公司经营层，相关部门密切配合稽核督查总部的监督措施，根据相关报告进行纠正和整改。

#### 9. 信息技术系统风险

信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，信息系统的安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要，公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，并制定了完整的信息技术相关制度，确保信息技术系统稳定运行。然而由于各种原因，信息技术系统仍可能出现硬件故障、软件崩溃、通信线路中断、遭受病毒、黑客攻击、数据丢失与泄露等情况。公司向客户提供的交易系统主要来源于与外部公司合作，自主研发能力相对不足。如果公司遭受上述突发性事件，或信息技术系统未能及时、有效地改进或升级而发生障碍，可能对公司的声誉、竞争力和经营业绩造成不利影响。此外，随着业务量的不断扩大、创新业务的不断推出，公司信息技术系统的处理能力和功能模块需要不断升级和扩展，以适应业务发展需要。若信息技术系统不能得到相应提升，公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。

应对措施：公司重视信息技术系统的搭建和完善，组织参与交易所期货品种测试工作。同时持续加大对软硬件的投入，加强机房、系统建设，为各项业务提供保障与支撑。并制定了公司通过建立完整的信息技术相关制度，积极与公司内外部机构开展技术支持、运维工作，确保信息技术系统安全稳定运行。

## 10. 信用风险

公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：（1）客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；（2）客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；（3）存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；（4）存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；（5）存放在银行的客户保证金不能提取的风险；（6）代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；（7）涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；（8）基差业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；（9）非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。

应对措施：本公司将制度建设视为内控机制的根基，已建立了各项治理制度、交易、开户、结算及风控、财务、信息技术、金融期货业务、IB 业务、信息披露、合规（含反洗钱）等 7 大系列制度，以及营业部管理制度，明确决策、执行、监督等方面的职责权限，形成科学有效的职责分工制衡机制，结合业务特点和内部控制要求设置内部机构，明确职责权限，将权利与责任落实到各责任部门，同时确保了稽核督查总部机构设置、人员配备和工作的独立性。在基差贸易业务中，建立完善的客户、仓储企业资质调查制度，对客户信用进行评定，有限选择信用等级较高的客户，避免选择信用等级较低的客户。

## 11. 居间人管理风险

居间人非期货公司的员工，而是与期货公司签订居间合同，为期货公司和客户提供订立期货经纪合同，并根据居间合同的约定取得手续费返佣的个人或法人，居间人独立承担基于居间关系产生的民事责任。期货公司与居间人合作拓宽了开发客户的渠道，是重要的营销补充方式。目前期货监管体系并未形成居间业务的统一规定。由于公司不能完全控制拥有丰富客户资源的居间人流动，管理难度较大，若公司的经纪业务开展较为依赖居间人，将对公司盈利情况产生不利影响。同时，居间人素质参差不齐，部分居间人可能采取私印名片、私设网点等方式冒充公司工作人员，可能给公司带来表见代理的诉讼风险。如果公司由于管理不当发生这类情形，可能被监管部门采取监管措施或处以行政处罚，亦有可能产生诉讼风险。

应对措施：公司制定居间人管理办法，明确规范居间人行为准则；在对居间人充分了解的情况下，方可签署居间合同，确立居间关系；对居间人进行执业前培训，定期进行回访；对居间人进行年度培训，加强居间人合法合规意识。

## 12. 人才流失和储备不足风险

期货行业是知识密集型行业，需要大批高素质专业人才。随着期货市场的发展，以及期货分支机构

的大规模扩张，期货人才竞争日趋激烈。近年来金融衍生品推出的步伐加快，资产管理业务发展迅速，不但对期货人才提出了更高要求，也加剧了对期货人才尤其是复合型人才的需求和竞争。若公司流失部分关键优秀管理人员和专业人才，将会对公司的经营发展造成一定障碍。同时，面对各个金融子行业的竞争，公司存在人才流失和储备不足的风险。

应对措施：公司围绕引、育、留、用的管理体系，推出名校宣讲会，高校合作培养，增加海外招聘渠道，组织核心业务和人才培养、文化传承专项培训，公开竞聘选拔干部，通过制定和实施企业可持续发展的人力资源政策，形成了完善的激励与考核体系。

### 13. 政策风险

公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家各种法律、法规及规范性文件的监管。如果国家关于期货行业的有关法律、法规和政策，如税收政策、业务许可、利率政策、业务收费标准及收费方式等发生变化，可能会引起期货市场的波动和期货行业发展环境的变化，进而对公司的各项业务产生影响。目前，随着期货市场的快速发展和行政管制的逐渐放松，相关期货法律法规的建设也处于完善阶段，部分限制性的规定正逐步取消，关于新业务及新产品的规定可能逐步出台。相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会对期货行业的经营模式和竞争方式产生影响，公司无法保证上述变化不会对公司的业务、经营业绩和财务状况产生重大不利影响，也无法保证能够及时调整以充分适应上述变化。如果公司未能完全遵守相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化，可能导致公司被罚款、暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。

应对措施：公司密切关注行业监管政策变化，配合各项业务监管核查，积极履行定期及临时报告义务，并根据市场环境持续优化各项内控制度，保证公司经营的合法、合规进行。

### 14. 重大诉讼、仲裁风险

期货公司作为金融衍生品服务提供商，截至本年度末公司尚无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现相关重大诉讼或仲裁，将可能对公司经营带来不利影响。

应对措施：公司自成立起便将稳健合规作为公司发展的首要方针，合法合规是公司发展的生命线。公司不断改进治理结构，完善内控制度，加强信息披露，着重培养执业员工的职业操守、风险防范意识和职业道德水平。

### 15. 商标风险

公司使用中的标识尚未取得商标专用权，上述商标使用过程中可能会使本公司产生法律纠纷，使本公司声誉遭到损害，并对本公司的业务开展及公司整体经营战略布局构成不利影响。

应对措施：公司已经准备永安图形为注册商标的全部资料，公司持续关注商标使用情况，启动注册商标申请程序。

#### 四、 企业社会责任

2018 年是国家脱贫攻坚战略的关键之年，公司始终以习近平总书记扶贫开发重要战略思想为指导，积极贯彻落实党的十九大、《中共中央国务院关于打赢脱贫攻坚战的决定》和《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》精神，履行企业社会责任、服务国家脱贫攻坚战略，领会中国期货业协会推动期货行业服务国家脱贫攻坚战略动员会议要义，充分发挥公司专业优势，发挥引领作用，坚持按照“要始终着眼于机制、着力于大局,努力形成可复制、可推广的制度与机制”的要求，始终坚守在金融扶贫一线，把精准扶贫工作的开展当作自身的使命和责任。

2018 年 3 月，公司与国家级贫困县吉林省龙井市签订精准扶贫帮扶协议，投入扶贫资金 240 万元扶持该县玉米种植贫困农户规避价格风险，获取稳定收益，搭建“政府+产业+金融机构”的联合扶贫方式，开展“保险+期货”扶贫项目。同月，公司与河北省大名县签订精准扶贫帮扶协议，投入扶贫资金 120 万元，开展农特产品电子商务平台建设及蛋鸡养殖“保险+期货”项目，运用自身专业优势及资源优势，同时借助培训等手段，帮助大名县贫困农户增收降风险。5 月 18 日，公司与辽宁省朝阳市杨树岭乡签订精准扶贫帮扶协议，投入资金 100 万元开展“玉米场外期权价格保险”项目，连续两年助力杨树岭乡开展扶贫工作。6 月 20 日，公司为 2017 年结对帮扶的国家级贫困县吉林省大安市，再次投入扶贫资金 40 万元，用于持续维护 2017 年开展的电子商务平台和农机租赁项目。扶贫款项均到账，相关工作已经开始启动。

#### 五、 对非标准审计意见审计报告的说明

适用 不适用

## 第四节 重要事项

### 一、重要事项索引

事项	是或否	索引
是否存在重大诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(一)
是否存在偶发性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(二)
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资、企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(三)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(四)
是否存在被调查处罚的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在利润分配或公积金转增股本的情况	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(五)
是否存在普通股股票发行事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在存续至本期的债券融资事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(六)
是否存在存续至本期的可转换债券相关情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在自愿披露的其他重要事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

### 二、重要事项详情

#### (一) 报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
1. 购买原材料、燃料、动力	3,000,000,000.00	7,290,754.80
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托，委托或者受托销售	399,000,000.00	24,615,373.61
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	4,160,000,000.00	1,546,290,798.14
4. 财务资助（挂牌公司接受的）		
5. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	1,093,000,000.00	18,134,582.63
6. 其他		
合计	8,652,000,000.00	1,596,331,509.18

#### (二) 报告期内公司发生的偶发性关联交易情况

单位：元

关联方	交易内容	交易金额	是否履行必要	临时公告披露	临时公告编号
-----	------	------	--------	--------	--------

			决策程序	时间	
永安国富资产管理 有限公司	永安国富一 稳健6号私募 基金	382,100,000.00	是	2018年2月26 日	2018-006

#### 偶发性关联交易的必要性、持续性以及对公司生产经营的影响：

2018年2月26日，公司第二届董事会第十二次会议审议通过了《关于投资永安国富私募基金的议案》，公司拟认购参股公司永安国富资产管理有限公司发起的“永安国富一稳健6号私募基金”，认购份额最高不超过4亿元人民币。该事项已经公司2018年第一次临时股东大会审议通过。

2018年4月12日，公司第二届董事会第十三次会议审议通过了《关于确认公司2017年关联交易并预计2018年度关联交易的议案》，并于该日披露了《永安期货有限公司2018年度预计关联交易公告》，将公司拟认购永安国富资产管理有限公司发行的产品作为公司日常性关联交易事项。该事项已经公司2017年年度股东大会审议通过。

上述偶发性关联交易报告期内的投资成本为382,100,000.00元，期末账面价值为398,950,610.00元。

### (三) 承诺事项的履行情况

公司股东、公司及其董事、监事、高级管理人员在公开转让说明书中作出以下承诺，无需公司内部程序审议批准。

#### 1、关于避免同业竞争的承诺

公司控股股东财通证券、实际控制人控制的省财开、省金控、其他持股5%以上股东及董事、监事、高级管理人员承诺现时及将来均不会以任何方式从事与公司的业务有竞争或可能构成竞争的业务或活动。

#### 2、公司股东所持股份的限售安排及股东对所持股份自愿锁定的承诺

公司控股股东财通证券承诺：“本公司将严格遵守《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》的规定，不得超出“挂牌公司控股股东及实际控制人在挂牌前直接或间接持有的股票分三批解除转让限制，每批解除转让限制的数量均为其挂牌前所持股票的三分之一，解除转让限制的时间分别为挂牌之日、挂牌期满一年和两年”的规定进行股票交易，也不要求公司回购该部分股份。”

公司及其董事、监事、高级管理人员或股东、实际控制人及其他信息披露义务人均能在承诺履行期内严格遵守承诺，没有发生违反承诺的情况发生，也不存在超过期限未完成的承诺事项。上述承诺已在公司招股说明书和公司2017年年度报告中（定2018-001）披露。

除此上述承诺之外，2015年12月2日，公司控股股东财通证券与公司股东浙江产业基金签订了《关于永安期货股份有限公司的一致行动人协议》。2017年5月，公司实际控制人浙江省财政厅控制的省金控作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将促使子公司浙江产业基金与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间；同时，公司股东浙江产业基金作出承诺，在《一致行

动人协议》到期后，将与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间。该承诺正在履行中，无需公司内部程序审议批准。具体内容见公司于 2017 年 9 月 26 日在全国中小企业股份转让系统信息披露平台 <http://www.neeq.com.cn/>披露的《永安期货关于一致行动协议人的公告》（临 2017-056）。

#### （四） 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例	发生原因
存货	质押	162,935,120.49	0.50%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	质押	13,195,105.86	0.04%	作为远期结售汇保证金、信用证保证金、保函保证金
合计	-	176,130,226.35	0.54%	-

#### （五） 利润分配与公积金转增股本的情况

##### 1、报告期内的利润分配与公积金转增股本情况

适用 不适用

股利分配日期	每 10 股派现数 (含税)	每 10 股送股数	每 10 股转增数
2018 年 2 月 9 日	1.50	0.00	0.00

##### 2、报告期内的利润分配预案

适用 不适用

##### 报告期内利润分配与公积金转增股本的执行情况：

适用 不适用

公司 2017 年半年度权益分派方案已获 2017 年 12 月 27 日召开的股东大会审议通过，2017 年半年度权益分派方案为：以公司当时总股本 1,310,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 1.50 元人民币现金。

本次分派对象为：截止 2018 年 2 月 9 日下午全国中小企业股份转让系统收市后，在中国证券登记结算有限责任公司北京分公司登记在册的本公司全体股东。投资者 R 日（R 日为权益登记日）买入的证券，享有相关权益；对于投资者 R 日卖出的证券，不享有相关权益。

本次权益分派于 2018 年 2 月 12 日通过股东托管证券公司（或其他托管机构）直接划入其资金账户。

#### （六） 存续至本期的债券融资情况

单位：元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续时间	是否违约
125872	15 永安债	其他	600,000,000.00	5.40%	2015.08.17-2018.08.17	否

合计	-	-	600,000,000.00	-	-	
----	---	---	----------------	---	---	--

注：公司于 2017 年 8 月完成次级债券 15 永安债（债券代码：125872）回售工作，回售数量为 170,000 手（1 手为 10 张），回售金额 17,000 万元。同时支付 15 永安债第二年利息共计 3,240 万元。本次回售实施完毕后，15 永安债在上海证券交易所上市并交易的留存数量为 430,000 手（面值 43,000 万元）。

**债券违约情况：**

适用 不适用

## 第五节 股本变动及股东情况

### 一、普通股股本情况

#### (一) 报告期期末普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末		
		数量	比例		数量	比例	
无限售条件股份	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%	
	其中：控股股东、实际控制人	146,449,275	11.18%	0	146,449,275	11.18%	
	董事、监事、高管						
	核心员工						
有限售条件股份	有限售股份总数	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%	
	其中：控股股东、实际控制人	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%	
	董事、监事、高管						
	核心员工						
<b>总股本</b>		1,310,000,000	-	0	1,310,000,000	-	
<b>普通股股东人数</b>							185

#### (二) 报告期期末普通股前十名股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例	期末持有限售股份数量	期末持有无限售股份数量
1	财通证券股份有限公司	439,347,825	0	439,347,825	33.54%	292,898,550	146,449,275
2	浙江省产业基金有限公司	350,000,000	0	350,000,000	26.72%	0	350,000,000
3	浙江东方金融控股集团股份有限公司	166,427,690	0	166,427,690	12.70%	0	166,427,690
4	浙江省经济建设投资有限公司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727
5	浙江省协作大厦有限公司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727

6	物产中大集团股份有限公司	27,500,000	0	27,500,000	2.10%	0	27,500,000
7	方继方	15,324,000	-9,082,000	6,242,000	0.48%	0	6,242,000
8	浙江省经协集团有限公司	5,055,000	-71,000	4,984,000	0.38%	0	4,984,000
9	南通金玖惠通三期创业投资基金合伙企业(有限合伙)	4,795,000	0	4,795,000	0.37%	0	4,795,000
10	江苏柏博产业基金管理有限公司-南京柏载投资合伙企业(有限合伙)	0	3,393,000	3,393,000	0.26%	0	3,393,000
<b>合计</b>		<b>1,285,828,969</b>	<b>-5,760,000</b>	<b>1,280,068,969</b>	<b>97.73%</b>	<b>292,898,550</b>	<b>987,170,419</b>

前十名股东间相互关系说明:

1. 省财开持有本公司股东协作大厦 100% 股权。
2. 省金控持有本公司控股股东财通证券 32.25% 股权，同时省金控持有本公司股东浙江产业基金 100% 股权，省金控为省财开的控股子公司。
3. 浙江省交通投资集团有限公司持有本公司控股股东财通证券 2.03% 股权，同时持有本公司股东经建投 95.32% 股权。

## 二、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用  不适用

## 三、 控股股东、实际控制人情况

是否合并披露:

是  否

### (一) 控股股东情况

公司控股股东为财通证券，持有本公司 33.54% 股权，浙江产业基金持有本公司 26.72%，财通证券与浙江产业基金于 2015 年 12 月 2 日签订了《关于永安期货股份有限公司的一致行动人协议》，浙江产业基金就永安期货经营发展的重大事项向股东大会、董事会行使提案权和在相关股东大会、董事会上行使表决权时和财通证券保持一致。一致行动人协议期限为自生效之日起 36 个月，但因上级国有资产管理部门统一进行划转的情形除外。通过与浙江产业基金的一致行动协议，财通证券拥有永安期货 60.26%

表决权。

法定代表人：陆建强

成立日期：2003 年 06 月 11 日

统一社会信用代码：913300007519241679

注册资本：35.89 亿元

住所：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201，501，502，1103，1601-1615，1701-1716 室

经营范围：经营证券业务（详见《经营证券业务许可证》）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

报告期内，公司控股股东未发生变化。

## （二） 实际控制人情况

省金控目前持有财通证券 32.25% 股权，持有浙江产业基金 100% 股权，系财通证券与浙江产业基金的控股股东。省财开持有省金控 100% 的股权，持有协作大厦 10.59% 的股权，省财开是浙江省人民政府批准成立并委托浙江省财政厅领导和管理的政府投资平台公司，因此浙江省财政厅是本公司的实际控制人。浙江省财政厅是机关法人，是浙江省人民政府综合管理国家财政收支、财税政策，实施财政监督，参与国民经济进行宏观调控的职能部门，住所为杭州市环城西路 37 号。

报告期内，公司实际控制人未发生变化。

## 第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工情况

### 一、董事、监事、高级管理人员情况

#### (一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生日期	学历	任期	是否在公司领取薪酬
阮琪	董事长	男	1963-06-16	本科	2016.01-2019.01	否
葛国栋	董事、 总经理、 法定代表人	男	1972-01-09	本科	2017.03-2019.01	是
黄志明	董事	男	1976-04-13	硕士	2017.12-2019.01	否
金朝萍	董事	女	1975-07-04	硕士	2016.01-2019.01	否
林瑛	董事	男	1959-07-29	本科	2016.01-2019.01	否
麻亚峻	董事	男	1974-02-28	硕士	2017.12-2019.01	否
申建新	董事	男	1973-01-15	EMBA	2016.01-2019.01	否
朱国华	独立董事	男	1950-08-14	硕士	2016.01-2019.01	否
汪炜	独立董事	男	1967-08-11	博士	2016.01-2019.01	否
李义超	独立董事	男	1963-05-16	博士	2016.01-2019.01	否
黄平	独立董事	男	1969-02-03	博士	2016.01-2019.01	否
马成骁	监事会主席	男	1972-08-15	本科	2016.01-2019.01	否
胡启彪	监事	男	1962-07-20	硕士	2016.01-2019.01	否
胡慧珺	监事	女	1962-01-26	大专	2016.01-2019.01	否
钱焕军	监事	男	1969-08-09	本科	2016.01-2019.01	否
余晓红	职工监事	女	1964-09-13	本科	2016.01-2019.01	是
毛贵明	职工监事	男	1977-09-28	本科	2016.01-2019.01	是
叶元祖	党委书记、 副总经理、 董事会秘书、 财务总监	男	1962-05-20	本科	2016.01-2019.01	是
金吉来	副总经理	男	1961-10-14	本科	2016.01-2019.01	是
石春生	副总经理	男	1965-04-16	本科	2016.01-2019.01	是
陈敏	首席风险官	女	1976-04-25	本科	2016.01-2019.01	是
<b>董事会人数:</b>						11
<b>监事会人数:</b>						6
<b>高级管理人员人数:</b>						5

#### 董事、监事、高级管理人员相互间关系及与控股股东、实际控制人间关系:

董事长阮琪，现任财通证券股份有限公司董事总经理。

董事申建新，现任财通证券股份有限公司董事会秘书兼总经理办公室主任。

董事黄志明，现任浙江省金融控股有限公司党委委员兼金融管理部总经理。

监事会主席马成骁，现任浙江省协作大厦有限公司副总经理。

监事胡启彪，现任财通证券股份有限公司工会副主席兼工会办公室主任。

公司控股股东为财通证券股份有限公司，实际控制人为浙江省财政厅，财通证券股份有限公司、浙江省金融控股有限公司、浙江省协作大厦有限公司、浙江省财务开发公司实际控制人均为浙江省财政厅，董事、监事、高级管理人员之间无其他关联关系。

## (二) 持股情况

单位：股

姓名	职务	期初持普通股股数	数量变动	期末持普通股股数	期末普通股持股比例	期末持有股票期权数量
无						
合计	-	0	0	0	0%	0

## (三) 变动情况

信息统计	董事长是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	总经理是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	首席风险官是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	董事会秘书是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	财务总监是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：

适用 不适用

报告期内新任董事、监事、高级管理人员简要职业经历：

适用 不适用

## 二、 员工情况

### (一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	期末人数
中层以上管理人员	100	99
市场业务人员	370	366
研究人员	87	82
信息技术人员	80	76
财务人员	66	67
合规管理及风控人员	82	81
其他职能人员	207	233
员工总计	992	1004

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	3	5
硕士	237	259
本科	636	630
专科	103	95
专科以下	13	15
员工总计	992	1004

**员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：**

1. 人员变动

截至报告期末，公司在职工总数 1004 人，较期初增长 12 人，增长主要体现在业务支持人员上，公司中高层及骨干员工保持稳定，人才梯队建设不断完善。

2. 人才引进、培训及招聘情况

报告期内，公司根据战略及业务扩展需要，拟制招聘计划，通过“黄埔联盟”大学生实习培育、海内外招聘等渠道，采用职业性格及思维能力测评等方式，广泛甄优秀人才，有效补充了各类关键岗位员工队伍，为公司战略发展提供人才支持。

报告期内，公司系统推进人才培育、创新培训形式。拟制了员工培训与学习管理办法，开发了“永安大讲堂”E-learning 平台，组织了“新员工、产业经理、理财师、境外业务、新任营业部经理”等专业序列人才培养，积极打造学习型组织、落实人才强企战略。

3. 薪酬政策

公司员工薪酬包括基本薪金、绩效薪金、专项薪金、保障性福利等，保障性福利包括五险一金、企业年金、健康体检、婚丧礼金、节日慰问、带薪休假等；报告期内，公司密切关注同行业薪酬状况，及时调整薪酬水平，保证关键岗位的薪酬竞争力；同时，优化业务单元、平台部门考核体系，增强考核的目标性、激励性；同时，继续推进企业文化建设，提升员工的企业认同感和团队凝聚力。

4. 需公司承担费用的离退休职工人数

无。

**(二) 核心人员（公司及控股子公司）基本情况**

**核心员工：**

适用 不适用

**其他对公司有重大影响的人员（非董事、监事、高级管理人员）**

适用 不适用

**核心人员的变动情况：**

无

### 三、 报告期后更新情况

适用 不适用

## 第七节 财务报告

### 一、 审计报告

是否审计	是
审计意见	无保留意见
审计报告中的特别段落	无
审计报告编号	天健审〔2018〕7665号
审计机构名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
审计机构地址	杭州市江干区钱江路1366号华润大厦B座
审计报告日期	2018年8月17日
注册会计师姓名	葛徐、宋慧娟
审计报告正文：	

## 审 计 报 告

天健审〔2018〕7665号

永安期货股份有限公司全体股东：

### 一、 审计意见

我们审计了永安期货股份有限公司（以下简称永安期货公司）财务报表，包括2018年6月30日的合并及母公司资产负债表，2018年1-6月份的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永安期货公司2018年6月30日的合并及母公司财务状况，以及2018年1-6月的合并及母公司经营成果和现金流量。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永安期货公司，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不对这些事项单独发表意见。

#### （一）手续费收入的确认

##### 1. 关键审计事项

相关信息披露详见财务报表附注三（二十五）及五（二）1。

永安期货公司手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询收入、代销基金收入及资产管理业务收入。期货经纪业务收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认；投资咨询、资产管理业务、基金代销收入在业务提供的相关服务已经完成，收到价款或取得收取款项的证据时确认收入。

由于手续费收入是公司关键业绩指标之一，收入可能存在重大错报风险，因此我们将手续费收入确定为关键审计事项。

##### 2. 审计中的应对

我们实施的审计程序主要包括：（1）了解和评价与手续费收入确认相关的关键内部控制的设计和运行有效性。（2）对于期货经纪业务收入，将公司记录的交易量与从中国期货业协会网站获取的同期交易数据进行核对，并抽样检查客户的佣金费率与相关客户服务合同是否一致。（3）对于投资咨询、基金代销收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同，核对相关收入确认与协议条款是否一致，并评价相关收入确认是否符合公司关于收入确认的会计政策。（4）对于资产管理业务收入，抽取样本，核对管理费和业绩报酬的费率与合同约定是否一致，并复核管理费和业绩报酬的计算过程。

#### （二）结构化主体的合并

##### 1. 关键审计事项

相关信息披露详见财务报表附注六（一）及七（一）。

永安期货公司通过发起设立、持有投资或保留权益份额等方式在结构化主体中享有权益。管理层评估对结构化主体是否存在控制，对结构化主体是否应纳入合并财务报表范围作出重大判断。

由于合并的结构化主体可能对合并资产负债表产生重大影响，因此，我们将公司结构化主体的合并确定为关键审计事项。

##### 2. 审计中的应对

我们实施的审计程序主要包括：（1）了解管理层确定结构化主体纳入财务报表合并范围的评估过程。（2）获取结构化主体的相关合同，分析永安期货公司在结构化主体决策中拥有的权利和义务。（3）复核永安期货公司在结构化主体中享有的收益情况并判断享有的可变回报是否重大，包括因持有权益份额应当享有的收益和作为管理人应当收取的管理费和业绩报酬。（4）评估结构化主体是否符合纳入合并财务报表范围的条件。

#### 四、其他信息

永安期货公司管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 五、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估永安期货公司的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

永安期货公司治理层（以下简称治理层）负责监督永安期货公司的财务报告过程。

#### 六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对永安期货公司持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永安期货公司不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

(六) 就永安期货公司中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表审计意见。我们负责指导、监督和执行集团审计，并对审计意见承担全部责任。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施（如适用）。

从与治理层沟通过的事项中，我们确定哪些事项对本期财务报表审计最为重要，因而构成关键审计事项。我们在审计报告中描述这些事项，除非法律法规禁止公开披露这些事项，或在极少数情形下，如果合理预期在审计报告中沟通某事项造成的负面后果超过在公众利益方面产生的益处，我们确定不应在审计报告中沟通该事项。

天健会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师：葛徐  
（项目合伙人）

中国·杭州 中国注册会计师：宋慧娟

二〇一八年八月十七日

## 二、 财务报表

### （一） 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
流动资产：			

货币资金	五（一）1	16,210,740,283.21	16,164,165,727.06
其中：期货保证金存款		14,139,857,243.15	14,801,097,903.82
应收货币保证金	五（一）2	10,966,085,345.04	9,615,496,632.61
应收质押保证金	五（一）3	654,556,030.50	284,486,362.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	五（一）4	90,915,311.83	31,586,974.11
衍生金融资产			
应收票据及应收账款	五（一）5[注1]	1,717,946.63	683,162.17
预付款项	五（一）6	132,286,158.87	110,094,354.67
应收结算担保金	五（一）7	25,535,905.87	25,513,887.40
应收风险损失款	五（一）8	66,201.51	66,201.51
应收佣金	五（一）5[注1]	4,429,717.70	3,994,945.13
其他应收款	五（一）9	85,044,091.06	74,928,529.98
买入返售金融资产			
存货	五（一）10	844,219,451.40	909,621,858.05
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	五（一）18[注2]	297,830,165.69	260,718,376.25
<b>流动资产合计</b>		29,313,426,609.31	27,481,357,010.94
<b>非流动资产：</b>			
可供出售金融资产	五（一）11	2,125,267,987.93	2,151,163,825.45
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	五（一）12	310,223,933.32	294,320,282.20
期货会员资格投资	五（一）13	1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产	五（一）15	3,670,111.72	3,737,264.38
固定资产	五（一）14	104,995,576.67	108,288,008.05
在建工程	五（一）18[注2]	64,062,078.94	49,308,879.59
无形资产	五（一）16	243,927,735.14	252,293,380.97
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	五（一）18[注2]	15,953,208.36	14,008,820.25
递延所得税资产	五（一）17	85,466,963.53	70,363,144.12
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		2,954,967,595.61	2,944,883,605.01
<b>资产总计</b>		32,268,394,204.92	30,426,240,615.95
<b>流动负债：</b>			
短期借款	五（一）19	699,308,995.50	560,000,000.00
应付货币保证金	五（一）20	22,989,107,816.35	21,923,322,332.85
应付质押保证金	五（一）21	485,976,978.00	173,328,692.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	五（一）22	7,309,121.05	5,285,609.64

期货风险准备金	五（一）23	202,094,101.13	191,824,966.82
衍生金融负债			
应付票据及应付账款	五（一）24	603,592.05	27,142,702.05
预收款项	五（一）25	250,993,937.89	163,464,424.95
卖出回购金融资产			
应付期货投资者保障基金	五（一）26	264,431.26	535,879.52
应付手续费及佣金	五（一）29[注3]	1,234,604.56	1,500,959.27
应付职工薪酬	五（一）27	434,043,765.91	416,560,567.84
应交税费	五（一）28	76,920,606.78	154,699,274.81
其他应付款	五（一）29[注3]	381,735,567.00	565,133,431.18
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
<b>流动负债合计</b>		<b>25,529,593,517.48</b>	<b>24,182,798,840.93</b>
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券	五（一）31[注4]	430,000,000.00	430,000,000.00
其中：优先股			
永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债	五（一）30	64,235,302.29	52,551,983.85
递延收益			
递延所得税负债	五（一）17	18,851,178.70	90,207,977.00
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		<b>513,086,480.99</b>	<b>572,759,960.85</b>
<b>负债合计</b>		<b>26,042,679,998.47</b>	<b>24,755,558,801.78</b>
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
股本	五（一）32	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	五（一）33	1,500,868,930.15	1,500,868,930.15
减：库存股			
其他综合收益	五（一）34	22,790,728.52	242,604,624.42
专项储备			
盈余公积	五（一）35	229,132,515.87	229,132,515.87
一般风险准备	五（一）36	289,023,529.80	289,023,529.80
未分配利润	五（一）37	2,519,047,728.58	1,970,448,793.06
归属于母公司所有者权益合计		5,870,863,432.92	5,542,078,393.30
少数股东权益		354,850,773.53	128,603,420.87
<b>所有者权益合计</b>		<b>6,225,714,206.45</b>	<b>5,670,681,814.17</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>32,268,394,204.92</b>	<b>30,426,240,615.95</b>

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

注 1：财务报表附注按照审计报告的财务报表科目编制，审计报告与新三板报告列示科目略有不同，以下相似情况不再赘述。财务报表附注五（一）5 应收票据及应收账款包含上表所列的“应收票据及应收账款”和“应收佣金”；

注 2：财务报表附注五（一）18 其他资产包含上表所列的“其他流动资产”、“在建工程”、“长期待摊费用”和“其他非流动资产”；

注 3：财务报表附注五（一）29 其他应付款包含上表所列的“应付手续费及佣金”和“其他应付款”；

注 4：财务报表附注中将此项列示在“其他负债”。

## （二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>流动资产：</b>			
货币资金		14,167,626,581.69	14,502,200,675.46
其中：期货保证金存款		13,389,996,408.83	13,938,365,352.23
应收货币保证金		10,529,569,551.79	9,187,412,309.75
应收质押保证金		654,556,030.50	284,486,362.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			
衍生金融资产			
应收票据及应收账款			
预付款项			
应收结算担保金		25,535,905.87	25,513,887.40
应收风险损失款		66,201.51	66,201.51
应收佣金		4,610,039.34	4,249,564.80
其他应收款		182,006,840.65	177,355,008.44
存货			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		20,029,401.09	19,613,742.92
<b>流动资产合计</b>		<b>25,584,000,552.44</b>	<b>24,200,897,752.28</b>
<b>非流动资产：</b>			
可供出售金融资产		2,053,319,701.88	1,914,873,375.60
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	十二（一）1	1,201,415,489.87	1,209,869,244.69
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产		3,670,111.72	3,737,264.38
固定资产		101,924,348.73	105,776,461.70
在建工程		64,062,078.94	49,308,879.59
无形资产		243,123,455.57	251,280,148.22
开发支出			

商誉			
长期待摊费用		15,558,181.44	13,802,675.02
递延所得税资产		49,911,900.28	35,196,938.96
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		3,734,385,268.43	3,585,244,988.16
<b>资产总计</b>		29,318,385,820.87	27,786,142,740.44
<b>流动负债：</b>			
短期借款			
应付货币保证金		22,154,114,855.02	20,988,854,859.06
应付质押保证金		654,556,030.50	284,486,362.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
期货风险准备金		202,094,101.13	191,824,966.82
衍生金融负债			
应付票据及应付账款			216,465.47
预收款项		2,516,358.46	646,196.66
应付期货投资者保障基金		264,431.26	535,879.52
应付手续费及佣金		1,234,604.56	1,500,959.27
应付职工薪酬		384,155,254.47	347,370,249.85
应交税费		38,562,339.33	84,934,465.62
其他应付款		34,589,402.94	213,599,302.28
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
<b>流动负债合计</b>		23,472,087,377.67	22,113,969,706.55
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券		430,000,000.00	430,000,000.00
其中：优先股			
永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债		4,465,804.82	76,329,753.17
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		434,465,804.82	506,329,753.17
<b>负债合计</b>		23,906,553,182.49	22,620,299,459.72
<b>所有者权益</b>			
股本		1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			

资本公积		1,502,700,854.26	1,502,700,854.26
减：库存股			
其他综合收益		18,494,641.11	234,202,625.60
专项储备			
盈余公积		229,132,515.87	229,132,515.87
一般风险准备		289,023,529.80	289,023,529.80
未分配利润		2,062,481,097.34	1,600,783,755.19
<b>所有者权益合计</b>		<b>5,411,832,638.38</b>	<b>5,165,843,280.72</b>
<b>负债和所有者权益合计</b>		<b>29,318,385,820.87</b>	<b>27,786,142,740.44</b>

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

### (三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、营业总收入</b>		<b>6,484,165,503.29</b>	<b>4,903,209,488.93</b>
手续费及佣金净收入	五(二)1	255,728,869.47	292,643,821.20
其中：经纪业务手续费收入		226,156,510.40	263,404,484.29
资产管理业务收入		4,573,866.83	9,262,004.96
投资咨询业务收入		2,148,268.81	9,938,025.55
代理销售金融产品收入		22,850,223.43	10,039,306.40
其他代理业务收入			
利息净收入	五(二)2	256,864,819.73	241,167,307.37
投资收益（损失以“-”号填列）	五(二)3	668,709,158.57	415,899,148.57
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		124,904,698.61	103,807,506.72
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	五(二)4	11,994,685.01	29,685,988.77
汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,256,414.46	-827,071.62
其他业务收入	五(二)5	5,286,099,349.41	3,924,640,294.64
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	五(二)6	2,512,206.64	
<b>二、营业总成本</b>		<b>5,782,240,872.59</b>	<b>4,315,618,770.01</b>
提取期货风险准备金		10,282,334.31	12,290,774.79
税金及附加	五(二)7	2,543,024.30	2,624,471.68
业务及管理费	五(二)8	446,897,340.86	402,041,621.00
研发费用	五(二)9	1,374,171.88	1,103,278.91
资产减值损失	五(二)10	122,260,306.59	127,900,554.05
其他业务成本	五(二)11	5,198,883,694.65	3,769,658,069.58
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		<b>701,924,630.70</b>	<b>587,590,718.92</b>
加：营业外收入	五(二)12	23,699,517.90	24,563,069.52
减：营业外支出	五(二)13	16,763,235.88	28,926,954.91

<b>四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）</b>		708,860,912.72	583,226,833.53
减：所得税费用	五（二）14	155,625,266.54	111,104,727.36
<b>五、净利润（净亏损以“－”号填列）</b>		553,235,646.18	472,122,106.17
其中：被合并方在合并前实现的净利润			
（一）按经营持续性分类：	-	-	-
1. 持续经营净利润		553,235,646.18	472,122,106.17
2. 终止经营净利润			
（二）按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益		4,636,710.66	-709,949.71
2. 归属于母公司所有者的净利润		548,598,935.52	472,832,055.88
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-219,813,895.90	-32,168,303.47
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-219,813,895.90	-33,004,580.67
（一）以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益		-219,813,895.90	-33,004,580.67
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		-182,935.09	1,244,631.28
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-223,206,491.63	-27,414,740.33
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额		3,575,530.82	-6,834,471.62
6. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			836,277.20
<b>七、综合收益总额</b>		333,421,750.28	439,953,802.70
归属于母公司所有者的综合收益总额		328,785,039.62	439,827,475.21
归属于少数股东的综合收益总额		4,636,710.66	126,327.49
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益		0.42	0.36

(二) 稀释每股收益		0.42	0.36
------------	--	------	------

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

#### (四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、营业收入</b>		957,155,473.11	809,596,579.34
手续费及佣金净收入	十二(二)1	235,990,806.29	274,943,817.12
其中：经纪业务手续费收入		205,674,023.25	245,815,495.39
资产管理业务收入		5,634,335.17	9,262,004.96
投资咨询业务收入		1,832,224.44	9,827,010.37
代理销售金融产品收入		22,850,223.43	10,039,306.40
其他代理业务收入			
利息净收入		259,780,843.29	243,513,592.00
投资收益(损失以“-”号填列)	十二(二)2	455,877,674.80	287,111,449.10
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		123,662,384.63	106,394,933.78
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)			1,731.00
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-3,460.58	-7,982.47
其他业务收入		5,470,702.67	4,033,972.59
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益(损失以“-”号填列)			
其他收益		38,906.64	
<b>二、营业成本</b>		375,338,535.54	342,372,070.91
提取期货风险准备金		10,282,334.31	12,290,774.79
税金及附加		1,765,616.94	2,083,419.28
业务及管理费		361,564,047.97	326,584,627.46
研发费用		1,374,171.88	1,103,278.91
资产减值损失		285,211.78	255,327.15
其他业务成本		67,152.66	54,643.32
<b>三、营业利润(亏损以“-”号填列)</b>		581,816,937.57	467,224,508.43
加：营业外收入		799,217.43	965,799.20
减：营业外支出		5,014,395.37	5,257,538.31
<b>四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		577,601,759.63	462,932,769.32
减：所得税费用		115,904,417.48	89,332,251.05
<b>五、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		461,697,342.15	373,600,518.27
(一) 持续经营净利润		461,697,342.15	373,600,518.27
(二) 终止经营净利润			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-215,707,984.49	-21,680,952.84

（一）以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益		-215,707,984.49	-21,680,952.84
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		-116,139.45	1,241,587.98
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-215,591,845.04	-22,922,540.82
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额			
6. 其他			
<b>七、综合收益总额</b>		<b>245,989,357.66</b>	<b>351,919,565.43</b>
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

#### （五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金		6,186,215,322.17	4,672,977,084.48
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额		154,246,724.00	136,725,740.65
收取利息、手续费及佣金的现金		564,296,025.39	594,572,339.41
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金	五（三）1	559,974,786.98	10,396,335.85
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>7,464,732,858.54</b>	<b>5,414,671,500.39</b>
购买商品、接受劳务支付的现金		6,121,791,189.93	4,475,631,348.54
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		22,641,799.64	12,530,133.65
以现金支付的业务及管理费		92,331,923.84	95,579,653.29
支付给职工以及为职工支付的现金		323,440,818.40	276,163,125.02
支付的各项税费		263,749,828.79	180,529,192.89
支付其他与经营活动有关的现金	五（三）2	801,471,731.78	2,601,418,967.42

<b>经营活动现金流出小计</b>		7,625,427,292.38	7,641,852,420.81
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		-160,694,433.84	-2,227,180,920.42
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		276,251,773.96	84,703,588.69
取得投资收益收到的现金		456,190,016.42	268,369,265.80
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		4,753.88	17,272.03
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金	五（三）3		
<b>投资活动现金流入小计</b>		732,446,544.26	353,090,126.52
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		26,334,851.77	15,070,998.11
投资支付的现金		595,380,617.21	164,756,993.60
质押贷款净增加额			
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金	五（三）4	358,160,619.51	1,191,892,460.82
<b>投资活动现金流出小计</b>		979,876,088.49	1,371,720,452.53
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-247,429,544.23	-1,018,630,326.01
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			97,599,660.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		372,308,995.50	390,000,000.00
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	五（三）5	236,408,159.29	
<b>筹资活动现金流入小计</b>		608,717,154.79	487,599,660.00
偿还债务支付的现金		233,000,000.00	175,271,007.24
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		218,158,447.32	105,176,468.76
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	五（三）6		37,112,706.39
<b>筹资活动现金流出小计</b>		451,158,447.32	317,560,182.39
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		157,558,707.47	170,039,477.61
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		3,683,516.23	-7,654,414.00
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-246,881,754.37	-3,083,426,182.82
加：期初现金及现金等价物余额		14,994,073,000.33	18,722,837,619.47
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		14,747,191,245.96	15,639,411,436.65

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额			570,543.09
收取利息、手续费及佣金的现金		530,666,351.41	565,204,908.42
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		244,128,237.36	5,923,199.58
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>774,794,588.77</b>	<b>571,698,651.09</b>
购买商品、接受劳务支付的现金			
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		10,809,142.10	12,530,133.65
以现金支付的业务及管理费		57,483,604.07	59,056,102.02
支付给职工以及为职工支付的现金		254,742,086.06	217,452,973.71
支付的各项税费		188,356,755.59	127,824,515.26
支付其他与经营活动有关的现金		415,200,381.68	1,998,299,648.42
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>926,591,969.50</b>	<b>2,415,163,373.06</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>-151,797,380.73</b>	<b>-1,843,464,721.97</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		101,676,515.64	
取得投资收益收到的现金		456,481,455.11	264,400,328.98
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		4,753.88	17,272.03
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>558,162,724.63</b>	<b>264,417,601.01</b>
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		25,035,350.69	14,234,295.53
投资支付的现金		519,404,086.98	213,241,110.87
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金		150,000,000.00	250,000,000.00
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>694,439,437.67</b>	<b>477,475,406.40</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-136,276,713.04</b>	<b>-213,057,805.39</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金			
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>0</b>	<b>0</b>

偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		196,500,000.00	
支付其他与筹资活动有关的现金			
<b>筹资活动现金流出小计</b>		196,500,000.00	
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-196,500,000.00	
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-484,574,093.77	-2,056,522,527.36
加：期初现金及现金等价物余额		14,002,200,675.46	16,299,990,622.15
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		13,517,626,581.69	14,243,468,094.79

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

## 第八节 财务报表附注

### 一、 附注事项

#### (一) 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	√是 □否	(二). 1
2. 半年度报告所采用的会计估计与上年度财务报表是否变化	□是 √否	
3. 是否存在前期差错更正	□是 √否	
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	□是 √否	
5. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	√是 □否	(二). 2
6. 是否存在需要根据规定披露分部报告的信息	□是 √否	
7. 是否存在半年度资产负债表日至半年度财务报告批准报出日之间的非调整事项	□是 √否	
8. 上年度资产负债表日以后所发生的或有负债和或有资产是否发生变化	□是 √否	
9. 重大的长期资产是否转让或者出售	□是 √否	
10. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	□是 √否	
11. 是否存在重大的研究和开发支出	□是 √否	
12. 是否存在重大的资产减值损失	□是 √否	
13. 是否存在预计负债	√是 □否	(二). 3

#### (二) 附注事项详情

##### 1、 会计政策变更

###### 1. 会计政策变更的内容和原因

本公司根据《财政部关于修订印发 2018 年度一般企业财务报表格式的通知》(财会〔2018〕15 号) 和企业会计准则的要求编制 2018 年 1-6 月财务报表，此项会计政策变更采用追溯调整法。

###### 2. 2017 年末资产负债表及 2017 年 1-6 月利润表受重要影响的报表项目和金额

原列报报表项目及金额		新列报报表项目及金额	
应收票据		应收票据及应收账款	4,678,107.30
应收账款	4,678,107.30		
应收利息	15,351,917.04	其他应收款	74,928,529.98
应收股利			
其他应收款	59,576,612.94		
应付票据		应付票据及应付账款	27,142,702.05
应付账款	27,142,702.05		
应付利息	9,453,253.06	其他应付款	566,634,390.45
应付股利	196,500,000.00		
其他应付款	360,681,137.39		
业务及管理费	403,144,899.91	业务及管理费	402,041,621.00

		研发费用	1,103,278.91
--	--	------	--------------

注 1: 财务报表附注按照审计报告的财务报表科目编制, 审计报告与新三板报告列示科目略有不同。上表所列的“应收票据及应收账款”包含合并资产负债表中的“应收票据及应收账款”和“应收佣金”;  
注 2: 上表所列的“其他应付款”包含合并资产负债表中的“应付手续费及佣金”和“其他应付款”。

## 2、合并报表的合并范围

### (一) 合并范围增加

#### 1. 报告期新纳入合并财务报表范围的子公司

因直接设立方式而增加子公司的情况说明

公司名称	股权取得方式	股权取得时点	实际出资额	出资比例
新永安资管公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	2,000 万港元	100.00%
新永安证券公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	2,000 万港元	100.00%
新永安新加坡公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	[注 2]	100.00%

注 1: 系子公司新永安国际金融控股有限公司出资设立。

注 2: 截至 2018 年 6 月 30 日, 新永安国际金融控股有限公司尚未对其出资。

#### 2. 新纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的永屹 1 号, 因公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免, 且享有的可变回报为重大纳入公司合并财务报表范围。

### (二) 合并范围减少

#### 1. 本期无合并财务报表范围的子公司减少。

#### 2. 不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本期, 本公司管理的成长 1 号资产管理计划(以下简称成长 1 号)、成长 2 号资产管理计划(以下简称成长 2 号)、成长 3 号资产管理计划(以下简称成长 3 号)、成长 5 号资产管理计划(以下简称成长 5 号)、成长 6 号资产管理计划(以下简称成长 6 号)、永安瑞意(多策略)一号资产管理计划(以下简称瑞意多策略 1 号)因已清算, 故自清算日起不再纳入合并范围。

## 3、预计负债

### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
待执行合同亏损	63,817,678.82	52,134,360.38
诉讼事项	417,623.47	417,623.47
合 计	64,235,302.29	52,551,983.85

### (2) 其他说明

1) 永安资本公司、上海瑞萌公司、永安新加坡公司对待执行货物购销合同按合同价与市场价的差额确认预计亏损。

2) 诉讼事项系 2015 年 1 月, 新永安公司收到来自 Alterra International Holdings Limited 公司 (以下简称 Alterra 公司) 的律师函, 要求赔偿其客户翁超颖诈骗的 588,600.00 欧元。2016 年 10 月, Alterra 公司在塞浦路斯当地法院对新永安期货公司和交通银行提起诉讼, 要求赔偿上述款项。截至资产负债表日, 新永安公司已聘请香港律师和塞浦路斯当地律师进行处理, 并就此事计提了预计负债 417,623.47 元。

## 二、 报表项目注释

### 永安期货股份有限公司

#### 财务报表附注

2018 年 1—6 月

金额单位: 人民币元

#### 一、 公司基本情况

永安期货股份有限公司 (以下简称公司或本公司) 前身系潮州市国际金融信息咨询服务公司, 于 1992 年 9 月在工商行政管理局登记注册, 取得注册号为 28227265-2 的企业法人营业执照, 注册资金为 50 万元。经历次更名及变更注册资本, 公司作为浙江省永安期货经纪有限公司, 以 2012 年 6 月 30 日为基准日, 整体变更为永安期货股份有限公司。现持有统一社会信用代码为 9133000010002099X5 的营业执照, 及中国证券监督管理委员会 32080000 号期货经纪业务许可证, 注册资本为 131,000 万元。

本公司经营范围为商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售。

本公司下设 35 家营业部及 5 家分公司, 分别位于北京、天津、上海、重庆、浙江、山东、辽宁、江苏、福建、湖北、湖南、江西、吉林、广东、四川、河北、河南等地。本公司拥有控股子公司 11 家, 分别为中国新永安期货有限公司 (以下简称新永安期货公司)、浙江永安资本管理有限公司 (以下简称永安资本公司)、浙江中邦实业发展有限公司 (以下简称中邦实业公司)、上海瑞萌商贸有限公司 (以下简称上海瑞萌公司)、香港永安商贸有限公司 (以下简称永安商贸公司)、永安 (新加坡) 国际贸易有限公司 (以下简称永安新加坡公司)、中国新永安实业有限公司 (以下简称新永安实业公司)、新永安国际金融控股有限公司 (以下简称新永安控股公司)、新永安国际资产管理有限公司 (以下简称新永安资管公司)、新永安国际证券有限公司 (以下简称新永安证券公司) 和永安 (新加坡) 国际金融私人有限公司 (以下简称新永安新加坡公司)。

本财务报表业经公司 2018 年 8 月 17 日第二届董事会第十六次会议批准对外报出。

#### 二、 财务报表的编制基础

##### (一) 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

##### (二) 持续经营能力评价

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营假设产生重大疑虑的事项或情况。

### 三、重要会计政策、会计估计

#### (一) 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

#### (二) 会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表所载财务信息的会计期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日。

#### (三) 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

#### (四) 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

##### 1. 同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。公司按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值份额与支付的合并对价账面价值或发行股份面值总额的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

##### 2. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；如果合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益。

#### (五) 合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

#### (六) 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

#### (七) 外币业务和外币报表折算

##### 1. 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日的即期汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

##### 2. 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

## （八）金融工具

### 1. 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（包括交易性金融资产和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产）、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

### 2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

公司按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：（1）持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；（2）在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

公司采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；（2）与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；（3）不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1）按照《企业会计准则第13号——或有事项》确定的金额；2）初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。（2）可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给了转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：（1）放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；（2）未放弃对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产的账面价值；（2）因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）终止确认部分的账面价值；（2）终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

### 4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

（1）第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

（2）第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

（3）第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

### 5. 金融资产的减值测试和减值准备计提方法

（1）资产负债表日对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，如有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备。

（2）对于持有至到期投资、贷款和应收款，先将单项金额重大的金融资产区分开来，单独进行减值测试；对单项金额不重大的金融资产，可以单独进行减值测试，或包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中进行减值测试；单独测试未发生减值的金融资产（包括单项金额重大和不重大的金融资产），包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。测试结果表明其发生了减值的，根据其账面价值高于预计未来现金流量现值的差额确认减值损失。

（3）可供出售金融资产

以公允价值计量的可供出售金融资产发生减值时，原直接计入其他综合收益的因公允价值下降形成的累计损失予以转出并计入减值损失。对已确认减值损失的可供出售债务工具投资，在期后公允价值回升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的，原确认的减值损失予以转回并计入当期损益。对已确认减值损失的可供出售权益工具投资，期后公允价值回升直接计入其他综合收益。

以成本计量的可供出售权益工具发生减值时，将该权益工具投资的账面价值，与按照类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额，确认为减值损失，计入当期损益，发生的减值损失一经确认，不予转回。

(九) 应收款项

1. 单项金额重大并单项计提坏账准备的应收款项

单项金额重大的判断依据或金额标准	应收款项账面余额 10%以上的款项
单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备

2. 按组合计提坏账准备的应收款项

(1) 确定组合的依据及坏账准备的计提方法

确定组合的依据	
账龄分析法组合	以账龄为信用风险特征
按组合计提坏账准备的计提方法	
账龄分析法组合	账龄分析法

(2) 账龄分析法

账 龄	其他应收款计提比例
1 年以内(含，下同)	5%
1-2 年	20%
2-3 年	30%
3-4 年	40%
4 年以上	100%

3. 单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收款项

单项计提坏账准备的理由	单项金额不重大但信用风险重大
坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备；经单独测试未发生减值的，按组合计提坏账准备

对应收货币保证金、应收质押保证金、应收结算担保金、预付账款等其他应收款项，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备。

(十) 存货

1. 存货的分类

本公司持有存货系为期货交易而持有以备出售的商品。

## 2. 发出存货的计价方法

大连商品交易所、郑州商品交易所交割进来的存货因无法做到批次对应，按先进先出法，其余采用个别计价法。

## 3. 存货可变现净值的确定依据及存货跌价准备的计提方法

资产负债表日，存货采用成本与可变现净值孰低计量，按照存货类别成本高于可变现净值的差额计提存货跌价准备。本公司以该存货的估计售价减去估计的销售费用和相关税费后的金额确定其可变现净值；资产负债表日，同一项存货中一部分有合同价格约定、其他部分不存在合同价格的，分别确定其可变现净值，并与其对应的成本进行比较，分别确定存货跌价准备的计提或转回的金额。

## 4. 存货的盘存制度为永续盘存制。

### (十一) 营业部的资金管理、交易清算原则

营业部的资金由公司总部统一调拨，营业部客户的交易由公司总部统一结算，统一风险控制，营业部按规定做好交易定单、结算单的客户确认工作。

### (十二) 客户保证金的管理与核算方法

客户缴存的保证金全额存入本公司指定的结算银行，单独立户管理，按每一客户开设保证金账户进行明细核算。对客户委托的交易，控制在客户存入保证金所允许的风险范围内，并根据当日结算的浮动盈亏，调整客户保证金存款账户余额。

### (十三) 质押品的管理与核算方法

接受客户因追加保证金而缴入的质押品。在客户发生损失而客户不能及时追加保证金时，本公司按协议规定强制平仓，并依法处置质押品，其处置质押品所得收入，用以弥补损失后，多余部分返还客户。

### (十四) 实物交割的管理与核算方法

在期货合约到期时，根据各期货交易所制订的规则和程序进行实物交割，分别按照买入交割和卖出交割的实际发生额核算。

### (十五) 客户资产管理业务核算方法

公司受托经营资产管理业务，为每一个客户开设保证金账户进行明细核算，并根据每日结算的盈亏，结算当日客户保证金账户资金。

### (十六) 长期股权投资

#### 1. 共同控制、重要影响的判断

按照相关约定对某项安排存在共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，认定为共同控制。对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定，认定为重大影响。

#### 2. 投资成本的确定

(1) 同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的面

值总额之间的差额调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，在合并日，根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额确定初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

(2) 非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

1) 在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

2) 在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期收益。但由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

(3) 除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第 12 号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》确定其初始投资成本。

### 3. 后续计量及损益确认方法

对被投资单位能够实施控制的长期股权投资采用成本法核算；对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。

### 4. 减值测试方法及减值准备计提方法

对子公司、联营企业及合营企业的投资，在资产负债表日有客观证据表明其发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备。

### 5. 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

#### (1) 个别财务报表

对处置的股权，其账面价值与实际取得价款之间的差额，计入当期损益。对于剩余股权，对被投资单位仍具有重大影响或者与其他方一起实施共同控制的，转为权益法核算；不能再对被投资单位实施控制、共同控制或重大影响的，确认为金融资产，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》

的相关规定进行核算。

## (2) 合并财务报表

### 1) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且不属于“一揽子交易”的

在丧失控制权之前，处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整资本公积（资本溢价），资本溢价不足冲减的，冲减留存收益。

丧失对原子公司控制权时，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益等，应当在丧失控制权时转为当期投资收益。

### 2) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“一揽子交易”的

将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理。但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

## (十七) 投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权和已出租的建筑物。

2. 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。资产负债表日，有迹象表明投资性房地产发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备。

## (十八) 固定资产

### 1. 固定资产的确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

### 2. 各类固定资产的折旧方法

项 目	折旧方法	折旧年限(年)	残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	直线法	30	3	3.23
电子设备及其他	直线法	5	3	19.40
运输工具	直线法	8	3	12.13

3. 资产负债表日，有迹象表明固定资产发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备。

## (十九) 在建工程

1. 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚

未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

3. 资产负债表日，有迹象表明在建工程发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备。

#### (二十) 无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。

2. 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体年限如下：

项 目	摊销年限(年)
软 件	3
土地使用权	40

3. 使用寿命确定的无形资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备；使用寿命不确定的无形资产和尚未达到可使用状态的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

#### (二十一) 长期待摊费用

长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

#### (二十二) 期货风险准备金提取和使用核算方法

1. 期货风险准备金按代理手续费净收入的 5% 计提，计入当期损益。

2. 风险损失的确认标准为：

(1) 因管理不严、错单交易等造成的应由期货经纪公司承担的客户交易损失；

(2) 确认的坏账损失。

风险准备金不足以弥补的损失计入当期损益。

#### (二十三) 预计负债

1. 因对外提供担保、诉讼事项、产品质量保证、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。

2. 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

#### (二十四) 期货投资者保障基金确认和计量

本期期货投资者保障基金按照母公司代理交易额的亿分之五点五计提，计入当期损益。

#### (二十五) 收入

1. 提供劳务

提供劳务交易的结果在资产负债表日能够可靠估计的（同时满足收入的金额能够可靠地计量、相关

经济利益很可能流入、交易的完工进度能够可靠地确定、交易中已发生和将发生的成本能够可靠地计量), 确认提供劳务的收入。

手续费收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认; 期货投资咨询、资产管理业务、基金代销收入在业务提供的相关服务已经完成, 收到价款或取得收取款项的证据时确认收入。

## 2. 让渡资产使用权

让渡资产使用权在同时满足相关的经济利益很可能流入、收入金额能够可靠计量时, 确认让渡资产使用权的收入。利息收入按照他人使用本公司货币资金的时间和实际利率计算确定; 使用费收入按有关合同或协议约定的收费时间和方法计算确定。

## 3. 销售商品

销售商品收入在同时满足下列条件时予以确认: (1) 将商品所有权上的主要风险和报酬转移给购货方; (2) 公司不再保留通常与所有权相联系的继续管理权, 也不再对已售出的商品实施有效控制; (3) 收入的金额能够可靠地计量; (4) 相关的经济利益很可能流入; (5) 相关的已发生或将发生的成本能够可靠地计量。

## (二十六) 政府补助

### 1. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助, 冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关补助确认为递延收益的, 在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助, 直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的, 将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

### 2. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助, 难以区分与资产相关或与收益相关的, 整体归类为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助, 用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的, 确认为递延收益, 在确认相关成本费用或损失的期间, 计入当期损益或冲减相关成本; 用于补偿已发生的相关成本费用或损失的, 直接计入当期损益或冲减相关成本。

3. 与公司日常经营活动相关的政府补助, 按照经济业务实质, 计入其他收益或冲减相关成本费用。与公司日常活动无关的政府补助, 计入营业外收支。

## (二十七) 递延所得税资产、递延所得税负债

1. 根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额 (未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的, 该计税基础与其账面数之间的差额), 按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

2. 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。资产负债表日, 有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的, 确认以

前会计期间未确认的递延所得税资产。

3. 资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核，如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，转回减记的金额。

4. 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列情况产生的所得税：(1) 企业合并；(2) 直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

(二十八) 一般风险准备的提取和使用核算方法

1. 一般风险准备按照当期实现净利润的 10%提取。

2. 公司发生风险损失，使用一般风险准备弥补的，同时贷记“利润分配——一般风险准备补亏”科目。

(二十九) 重要会计政策变更说明

1. 会计政策变更的内容和原因

本公司根据《财政部关于修订印发 2018 年度一般企业财务报表格式的通知》(财会〔2018〕15 号) 和企业会计准则的要求编制 2018 年 1-6 月财务报表，此项会计政策变更采用追溯调整法。

2. 2017 年末资产负债表及 2017 年 1-6 月利润表受重要影响的报表项目和金额

原列报报表项目及金额		新列报报表项目及金额	
应收票据		应收票据及应收账款	4,678,107.30
应收账款	4,678,107.30		
应收利息	15,351,917.04	其他应收款	74,928,529.98
应收股利			
其他应收款	59,576,612.94		
应付票据		应付票据及应付账款	27,142,702.05
应付账款	27,142,702.05		
应付利息	9,453,253.06	其他应付款	566,634,390.45
应付股利	196,500,000.00		
其他应付款	360,681,137.39		
业务及管理费	403,144,899.91	业务及管理费	402,041,621.00
		研发费用	1,103,278.91

注 1：财务报表附注按照审计报告的财务报表科目编制，审计报告与新三板报告列示科目略有不同。上表所列的“应收票据及应收账款”包含合并资产负债表中的“应收票据及应收账款”和“应收佣金”；

注 2：上表所列的“其他应付款”包含合并资产负债表中的“应付手续费及佣金”和“其他应付款”。

**四、税（费）项**

主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
-----	---------	-----

增值税	销售货物或提供应税劳务	17%、16%、11%、10%、6%[注]
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加	应缴流转税税额	2%
房产税	从价计征的，按房产原值一次减除30%后余值的1.2%计缴；从租计征的，按租金收入的12%计缴	1.2%、12%
企业所得税	应纳税所得额	16.5%、17%、25%

注：根据财政部、税务总局《关于调整增值税税率的通知》（财税〔2018〕32号），自2018年5月1日起，发生增值税应税销售行为或者进口货物原适用17%和11%税率的，税率分别调整为16%、10%。

#### 不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率
永安新加坡公司	17%
新永安新加坡公司	17%
永安商贸公司	16.5%
新永安控股公司	16.5%
新永安期货公司	16.5%
新永安实业公司	16.5%
新永安证券公司	16.5%
新永安资管公司	16.5%
除上述以外的其他纳税主体	25%

## 五、合并财务报表项目注释

说明：本财务报表附注的期初数指2018年1月1日财务报表数，期末数指2018年6月30日财务报表数，本期指2018年1月1日—2018年6月30日，上年同期指2017年1月1日—2017年6月30日。母公司同。

### （一）合并资产负债表项目注释

#### 1. 货币资金

##### （1）明细情况

项 目	期末数	期初数
库存现金	13,809.44	10,292.55
自有银行存款	1,968,308,914.23	1,261,296,958.69
期货保证金账户存款	14,139,857,243.15	14,801,097,903.82
其他货币资金	102,560,316.39	101,760,572.00

合 计	16,210,740,283.21	16,164,165,727.06
-----	-------------------	-------------------

(2) 抵押、冻结等对使用有限制或有潜在回收风险款项的说明

期末，其他货币资金中的信用证保证金 10,194,405.86 元、保函保证金 3,000,700.00 元均使用受限。

(3) 货币资金——期货保证金

银 行 名 称	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
工商银行	RMB 474,949,085.89	1.0000	474,949,085.89	RMB 409,432,230.21	1.0000	409,432,230.21
工商银行	HKD 4,271,873.70	0.8431	3,601,616.72	HKD 1,411,422.90	0.8359	1,179,808.40
工商银行	JPY 8,360.00	0.0599	500.76	JPY 1.00	0.0579	0.06
工商银行	USD 2,164,169.30	6.6166	14,319,442.59	USD 7,494,841.10	6.5342	48,972,790.72
工商银行	EUR 5,999,195.38	7.6515	45,902,843.45	EUR 6,934,070.51	7.8023	54,101,698.34
光大银行	RMB 5,058,158.05	1.0000	5,058,158.05	RMB 4,948,470.03	1.0000	4,948,470.03
建设银行	RMB 32,094,162.66	1.0000	32,094,162.66	RMB 43,813,888.46	1.0000	43,813,888.46
交通银行	RMB 8,752,319,758.95	1.0000	8,752,319,758.95	RMB 7,632,118,529.45	1.0000	7,632,118,529.45
交通银行	USD 20,249,917.66	6.6166	133,985,605.19	USD 28,486,894.93	6.5342	186,139,068.85
交通银行				AUD 26,149.49	5.0928	133,174.12
交通银行	EUR 323,232.01	7.6515	2,473,209.72	EUR 346,439.19	7.8023	2,703,022.49
交通银行	GBP 147,752.42	8.6551	1,278,811.97	GBP 146,536.76	8.7792	1,286,475.52
交通银行	HKD 578,657.02	0.8431	487,865.73	HKD 20,732,471.02	0.8359	17,330,272.53
交通银行	JPY 4,958,196.00	0.0599	296,995.94	JPY 75,733,756.00	0.0579	4,384,984.47
民生银行	RMB 940,594,106.10	1.0000	940,594,106.10	RMB 912,447,496.12	1.0000	912,447,496.12
民生银行	HKD 42,452,299.76	0.8431	35,791,533.93	HKD 106,599,220.22	0.8359	89,106,288.18
民生银行	USD 55,031,532.65	6.6166	364,121,638.93	USD 58,843,653.05	6.5342	384,496,197.76
农业银行	RMB 27,982,962.79	1.0000	27,982,962.79	RMB 31,814,277.76	1.0000	31,814,277.76
平安银行	RMB 6,474,989.98	1.0000	6,474,989.98	RMB 68,137,963.16	1.0000	68,137,963.16
浦发银行	RMB 1,408,219,882.87	1.0000	1,408,219,882.87	RMB 2,802,385,122.36	1.0000	2,802,385,122.36
兴业银行	RMB 1,107,041,796.39	1.0000	1,107,041,796.39	RMB 1,100,570,685.85	1.0000	1,100,570,685.85
渣打银行	HKD 961,011.72	0.8431	810,228.98	HKD 648,959.40	0.8359	542,465.16
渣打银行	USD 845,856.13	6.6166	5,596,691.67	USD 1,756,036.34	6.5342	11,474,292.65

招商银行	RMB	6,418,548.40	1.0000	6,418,548.40	RMB	5,373,191.33	1.0000	5,373,191.33
招商银行	HKD	4,007,259.23	0.8431	3,378,520.26	HKD	4,356,527.03	0.8359	3,641,620.94
招商银行	USD	842,867.17	6.6166	5,576,914.92	USD	1,307,943.00	6.5342	8,546,361.15
中国银行	RMB	62,667,262.52	1.0000	62,667,262.52	RMB	50,349,352.94	1.0000	50,349,352.94
中国银行	HKD	34,811,543.10	0.8431	29,349,611.99	HKD	11,572,552.07	0.8359	9,673,496.28
中国银行	USD	8,307,194.85	6.6166	54,965,385.44	USD	154,964.19	6.5342	1,012,567.01
中信银行	RMB	614,099,110.36	1.0000	614,099,110.36	RMB	914,982,111.52	1.0000	914,982,111.52
小计				14,139,857,243.15				14,801,097,903.82

(4) 货币资金——外币货币资金

项 目	期末数		
	原币及金额	汇率	折人民币金额
库存现金	HKD 12,747.50	0.8431	10,747.42
自有银行存款	USD 26,250,769.47	6.6166	173,690,841.28
自有银行存款	HKD 141,169,264.45	0.8431	119,019,806.86
自有银行存款	SGD 28,832.71	4.8386	139,509.95
期货保证金	USD 87,441,537.76	6.6166	578,565,678.74
期货保证金	HKD 87,082,644.53	0.8431	73,419,377.60
期货保证金	JPY 4,966,556.00	0.0599	297,496.70
期货保证金	EUR 6,322,427.39	7.6515	48,376,053.17
期货保证金	GBP 147,752.42	8.6551	1,278,811.97
其他货币资金	HKD 9,068.43	0.8431	7,645.59
小 计			994,805,969.28

2. 应收货币保证金

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,464,006,420.15	3,589,246,087.80
大连商品交易所	2,884,564,009.91	2,607,052,607.38
郑州商品交易所	1,833,211,204.86	982,218,293.26
中国金融期货交易所	1,994,864,113.32	1,720,181,399.44
中国证券登记结算有限责任公司	202,066,513.93	288,713,921.87

上海国际能源交易中心	150,857,289.62	
MAREX FINANCIAL Ltd. [注]	96,421,330.46	81,980,298.03
R. J. O'Brien & Associates[注]	20,395,588.54	22,921,722.75
香港期货交易所	113,350,517.62	136,266,376.08
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED [注]	127,407,636.55	97,235,261.10
KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd[注]	16,017.12	15,813.96
Rakuten Securities. Inc[注]		20,025,715.00
Phillip Futures Pte Ltd [注]	63,501,212.85	69,473,652.41
Hyundai Futures Corporaiong [注]	161,676.74	165,483.53
Phillip Securities Japan Ltd [注]	15,261,813.37	
合 计	10,966,085,345.04	9,615,496,632.61

注：该部分应收货币保证金系本公司的境外子公司存放于境外期货经纪商的保证金。

(2) 其他说明

上述期末余额中包含下述公司和结构化主体在本公司开设期货账户，期末持有的保证金及期货合约浮盈金额：

公司名称	持仓保证金	期货合约浮动盈亏
永安资本公司	258,940,997.10	43,981,220.00
上海瑞萌公司	18,771,482.80	8,050,135.00
中邦实业公司	27,409,522.50	-2,540,025.00
新永安实业公司	4,201,362.15	130,888.43
永安商贸公司	937,160.67	1,640,678.47
永安新加坡公司	2,119,429.31	483,673.46
七禾言起 2 号资产管理计划(以下简称七禾言起 2 号)	4,166,857.75	539,029.29
永利 1 号资产管理计划(以下简称永利 1 号)	25,135,665.80	745,571.21
永屹 1 号资产管理计划(以下简称永屹 1 号)	814,748.00	-10,967.60
永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数多头一号 (以下简称黑色多头 1 号)	282,905.70	225,130.01
永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数空头一号 (以下简称黑色空头 1 号)	286,688.70	-190,203.42
永安恒生聚源千际有色金属指数多头一号(以下简称有色多头 1 号)	400,427.50	-94,775.00

永安恒生聚源千际有色金属指数空头一号（以下简称有色空头 1 号）	400,427.50	85,022.78
小 计	343,867,675.48	53,045,377.63

### 3. 应收质押保证金

#### (1) 明细情况

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	367,359,768.00	152,950,272.00
大连商品交易所	38,130,000.00	37,990,000.00
郑州商品交易所	249,066,262.50	93,546,090.00
合 计	654,556,030.50	284,486,362.00

#### (2) 质押物明细情况

质押物类别	质押时市值	折扣率	期末市值
白银	92,851,500.00	80.00%	91,241,040.00
铝	221,826,750.00	80.00%	214,491,250.00
镍	1,974,120.00	80.00%	2,093,220.00
铜	45,255,250.00	80.00%	45,335,750.00
橡胶	114,413,650.00	80.00%	106,038,450.00
PTA	43,935,000.00	75.00%	58,580,000.00
白糖	944,812.50	75.00%	1,259,750.00
玻璃	16,920,000.00	75.00%	22,560,000.00
棉花一号	187,266,450.00	75.00%	249,688,600.00
豆油	13,700,000.00	79.00%	17,341,772.15
聚丙烯	7,340,000.00	79.00%	9,291,139.24
聚氯乙烯	6,520,000.00	80.00%	8,150,000.00
玉米	10,570,000.00	79.00%	13,379,746.84
合 计	763,517,532.50		839,450,718.23

#### (3) 其他说明

期末余额中包括子公司永安资本公司质押保证金 160,720,972.50 元，子公司上海瑞萌公司质押保证金 7,858,080.00 元。

### 4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

## (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
股 票	33,021,372.00	17,956,661.00
债 券		3,200,000.00
基 金	53,589,478.75	10,037,059.00
期货、场外合约浮盈	164,763.00	45,430.00
其他（期权）	4,139,698.08	347,824.11
合 计	90,915,311.83	31,586,974.11

## (2) 股票、基金和债券期末投资情况

项 目	投资成本	公允价值	累计的净利得 或净损失
股 票	32,723,265.60	33,021,372.00	298,106.40
基 金	53,579,858.17	53,589,478.75	9,620.58
期货、场外合约浮盈		164,763.00	164,763.00
其他（期权）		4,139,698.08	4,139,698.08
小 计	86,303,123.77	90,915,311.83	4,612,188.06

## 5. 应收票据及应收账款

## (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应收账款	6,147,664.33	4,678,107.30
合 计	6,147,664.33	4,678,107.30

## (2) 应收账款

## 1) 明细情况

## ① 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按信用风险特征组合 计提坏账准备	6,887,786.57	100.00	740,122.24	10.75	6,147,664.33
合 计	6,887,786.57	100.00	740,122.24	10.75	6,147,664.33

(续上表)

种 类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	

按信用风险特征组合 计提坏账准备	5,270,934.48	100.00	592,827.18	11.25	4,678,107.30
合 计	5,270,934.48	100.00	592,827.18	11.25	4,678,107.30

② 组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的应收账款

账 龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1 年以内	4,987,648.35	249,382.41	5.00
1-2 年	793,016.40	158,603.28	20.00
2-3 年	1,107,121.82	332,136.55	30.00
小 计	6,887,786.57	740,122.24	

2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 147,295.06 元。

3) 期末大额应收账款情况说明

单位名称	账面余额	占应收账款余额 的比例(%)	坏账准备
江苏通用科技股份有限公司	1,807,448.28	26.24	90,372.41
小 计	1,807,448.28	26.24	90,372.41

## 6. 预付款项

(1) 账龄分析

账 龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	132,286,158.87	100.00		132,286,158.87
1-2 年				
合 计	132,286,158.87	100.00		132,286,158.87

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	109,944,354.67	99.86		109,944,354.67
1-2 年	150,000.00	0.14		150,000.00
合 计	110,094,354.67	100.00		110,094,354.67

(2) 预付款项金额前 5 名情况

单位名称	账面余额	占预付款项余额 的比例(%)
------	------	-------------------

浙江物产金属集团有限公司	32,981,881.04	24.93
中建材供应链管理有限公司	27,780,580.08	21.00
汉邦（江阴）石化有限公司	23,376,660.00	17.67
宁波恒逸实业有限公司	23,102,112.00	17.46
杭州象喆实业有限公司	20,947,500.00	15.83
小 计	128,188,733.12	96.89

#### 7. 应收结算担保金

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	20,115,122.00	20,113,887.40
中国证券登记结算有限责任公司	5,420,783.87	5,400,000.00
合 计	25,535,905.87	25,513,887.40

#### 8. 应收风险损失款

##### (1) 账龄分析

账 龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	17,004.09	25.69		17,004.09	17,004.09	25.69		17,004.09
1-2 年	45,318.40	68.45		45,318.40	45,318.40	68.45		45,318.40
2-3 年	3,879.02	5.86		3,879.02	3,879.02	5.86		3,879.02
合 计	66,201.51	100.00		66,201.51	66,201.51	100.00		66,201.51

##### (2) 应收风险损失款金额前 5 名情况

单位名称	期末数
王永	23,896.92
李学礼	9,240.28
董伟华	7,938.60
申洋	7,273.55
宋文	6,848.75
小 计	55,198.10

#### 9. 其他应收款

##### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
-----	-----	-----

应收利息	20,426,602.44	15,351,917.04
其他应收款	64,617,488.62	59,576,612.94
合 计	85,044,091.06	74,928,529.98

(2) 应收利息

1) 账龄分析

账 龄	期末数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	19,055,776.04	93.29		19,055,776.04
1-2 年	970,864.77	4.75		970,864.77
2-3 年	399,961.63	1.96		399,961.63
合 计	20,426,602.44	100.00		20,426,602.44

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	14,640,951.84	95.37		14,640,951.84
1-2 年	710,965.20	4.63		710,965.20
2-3 年				
合 计	15,351,917.04	100.00		15,351,917.04

2) 应收利息金额前 5 名情况

单位名称	欠款金额
中国银行杭州市高新技术开发区支行营业部	4,059,863.01
北京银行杭州分行营业部	3,995,068.49
华夏银行杭州新华支行	3,905,753.42
中国银行杭州市高新技术开发区支行营业部	3,086,712.33
中国民生银行香港分行	2,863,838.33
小 计	17,911,235.58

3) 应收关联方款项

关联方名称	期末数	账 龄
OSTC Yongan Trading Co., Limited	2,521,935.94	3 年以内
小 计	2,521,935.94	

(3) 其他应收款

1) 明细情况

① 类别明细情况

种 类	期末数
-----	-----

	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
单项计提坏账准备的其他应收款	2,000,000.00	2.62	2,000,000.00	100.00	
按组合计提坏账准备的其他应收款	74,199,765.68	97.38	9,582,277.06	12.91	64,617,488.62
合计	76,199,765.68	100.00	11,582,277.06	15.20	64,617,488.62

(续上表)

种类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
单项计提坏账准备的其他应收款	2,000,000.00	2.81	2,000,000.00	100.00	
按组合计提坏账准备的其他应收款	69,128,846.54	97.19	9,552,233.60	13.82	59,576,612.94
合计	71,128,846.54	100.00	11,552,233.60	16.24	59,576,612.94

② 组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

账龄	期末数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	52,303,549.05	70.49	2,615,502.17	49,688,046.88
1-2 年	11,605,654.14	15.64	2,321,130.83	9,284,523.31
2-3 年	7,856,252.11	10.59	2,356,875.62	5,499,376.49
3-4 年	242,569.94	0.33	97,028.00	145,541.94
4 年以上	2,191,740.44	2.95	2,191,740.44	
合计	74,199,765.68	100.00	9,582,277.06	64,617,488.62

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	46,426,496.71	67.16	2,321,324.85	44,105,171.86
1-2 年	11,995,311.49	17.35	2,399,062.30	9,596,249.19
2-3 年	8,304,372.88	12.01	2,491,311.87	5,813,061.01
3-4 年	103,551.46	0.15	41,420.58	62,130.88
4 年以上	2,299,114.00	3.33	2,299,114.00	
合计	69,128,846.54	100.00	9,552,233.60	59,576,612.94

2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 30,043.46 元。

3) 其他应收款款项性质分类情况

款项性质	期末数	期初数
押金保证金	19,116,377.93	17,195,698.81
拆借款	28,707,856.66	31,352,268.48
合并外关联方往来款	15,112,646.69	16,195,015.03
投资款	2,000,000.00	2,000,000.00
其他	11,262,884.40	4,385,864.22
合计	76,199,765.68	71,128,846.54

4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例(%)	坏账准备	是否为关联方
OSTC Yongan Trading Co, Limited	往来款	15,112,646.69	3 年以内	19.83	3,659,165.12	是
陈石桥	贷出款	13,390,049.45	1 年以内	17.57	669,502.47	否
万佳	贷出款	13,231,274.16	1 年以内	17.36	661,563.71	否
中华人民共和国黄岛海关	关税保证金	4,399,364.92	1 年以内	5.77	219,968.25	否
无锡市不锈钢电子交易中心有限公司	保证金	2,238,367.48	1 年以内	2.94	111,918.37	否
小计		48,371,702.70		63.47	5,322,117.92	

5) 应收关联方款项

关联方名称	期末数	账龄	款项性质
OSTC Yongan Trading Co. , Limited	15,112,646.69	3 年以内	往来款
小计	15,112,646.69		

6) 期末单项计提坏账准备款项说明

永安资本公司 2014 年购买武汉中润融盛资产管理中心（有限合伙）公司的程序化策略私募基金 2,000,000.00 元。2015 年该基金到期清算，但该基金的投资经理文胜拖延还款，永安资本公司已向武汉硚口区汉正街派出所报案。2015 年已对该应收款项全额计提坏账。

10. 存货

(1) 明细情况

项目	期末数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	909,477,353.16	65,257,901.76	844,219,451.40
合计	909,477,353.16	65,257,901.76	844,219,451.40

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	994,494,870.17	84,873,012.12	909,621,858.05
合 计	994,494,870.17	84,873,012.12	909,621,858.05

(2) 期末存货账面余额中 162,935,120.49 元用于质押。

(3) 存货跌价准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少		期末数
			转 回	转 销	
库存商品	84,873,012.12	122,178,360.58		141,793,470.94	65,257,901.76
小 计	84,873,012.12	122,178,360.58		141,793,470.94	65,257,901.76

#### 11. 可供出售金融资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
理财产品	2,097,227,987.93	2,123,123,825.45
其 他	28,040,000.00	28,040,000.00
合 计	2,125,267,987.93	2,151,163,825.45

(2) 期末按公允价值计量的可供出售金额资产

可供出售金融资产分类	理财产品	小 计
权益工具的成本	2,078,863,590.86	2,078,863,590.86
公允价值	2,097,227,987.93	2,097,227,987.93
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	18,364,397.07	18,364,397.07
已计提减值金额		

(3) 期末按成本计量的可供出售金融资产

被投资单位	账面余额			
	期初数	本期增加	本期减少	期末数
浙江银杏云股权投资基金合伙企业（有限合伙）	9,040,000.00			9,040,000.00
证通股份有限公司	15,000,000.00			15,000,000.00
阳富教育咨询服务（深圳）有限公司	1,000,000.00			1,000,000.00
杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业（有限合伙）	3,000,000.00			3,000,000.00
小 计	28,040,000.00			28,040,000.00

(续上表)

被投资单位	减值准备				在被投资单位 持股比例(%)	本期 现金红利
	期初数	本期增加	本期减少	期末数		
浙江银杏云股权投资基金合伙企业(有限合伙)					10.00	
证通股份有限公司					0.60	
阳富教育咨询服务(深圳)有限公司					10.00	
杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业(有限合伙)					3.00	
小 计						

## 12. 长期股权投资

### (1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	310,223,933.32		310,223,933.32
合 计	310,223,933.32		310,223,933.32

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	294,320,282.20		294,320,282.20
合 计	294,320,282.20		294,320,282.20

### (2) 对联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司(以下简称玉皇山南公司)	15,016,639.70			-305,738.27	
永安国富资产管理有限公司(以下简称永安国富公司)	279,303,642.50			123,662,384.63	-116,139.45
OSTC ongan Trading Co., Limited[注]					
鞍钢永安商品贸易有限公司(以下简称鞍钢贸易公司)		24,500,000.00		163,144.21	
合 计	294,320,282.20	24,500,000.00		123,519,790.57	-116,139.45

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备 期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		

浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司(以下简称玉皇山南公司)					14,710,901.43	
永安国富资产管理有限公司(以下简称永安国富公司)		132,000,000.00			270,849,887.68	
OSTC Yongan Trading Co., Limited[注]						
鞍钢永安商品贸易有限公司(以下简称鞍钢贸易公司)					24,663,144.21	
合计		132,000,000.00			310,223,933.32	

注：OSTC Yongan Trading Co., Limited 为永安商贸公司持股 49.00%的联营企业，本期应对其确认投资收益 1,384,908.04 元，其他综合收益-66,795.64 元，由于长期股权投资账面价值已经冲减至零，故上述 1,318,112.40 元调整其他应收款。

### 13. 期货会员资格投资

#### (1) 明细情况

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
期货会员资格投资	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00
合计	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00

### 14. 固定资产

#### (1) 明细情况

项 目	房屋及建筑物	电子设备及其他	运输工具	合计
账面原值				
期初数	109,235,718.66	67,926,948.96	22,163,034.62	199,325,702.24
本期增加金额		3,685,984.14		3,685,984.14
购置		3,685,984.14		3,685,984.14
本期减少金额		357,485.43		357,485.43
处置或报废		357,485.43		357,485.43
外币报表折算差额		33,558.23	6,974.55	40,532.78
期末数	109,235,718.66	71,289,005.90	22,170,009.17	202,694,733.73
累计折旧				
期初数	27,539,431.82	47,537,053.49	15,961,208.88	91,037,694.19
本期增加金额	1,765,677.12	4,366,168.46	844,092.89	6,975,938.47
计提	1,765,677.12	4,366,168.46	844,092.89	6,975,938.47
本期减少金额		346,760.35		346,760.35

处置或报废		346,760.35		346,760.35
外币报表折算差额		28,143.61	4,141.14	32,284.75
期末数	29,305,108.94	51,584,605.21	16,809,442.91	97,699,157.06
账面价值				
期末账面价值	79,930,609.72	19,704,400.69	5,360,566.26	104,995,576.67
期初账面价值	81,696,286.84	20,389,895.47	6,201,825.74	108,288,008.05

(2) 期末无固定资产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的固定资产的情况说明如下：

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
长春伟峰彩宇新城 11 幢 2204、2205 室	7,921,473.80	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
沈阳财富中心 B 座 23-1 至 23-7 号房[注]	7,981,502.74	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
潍坊金融服务区 2 号楼 2701 至 2703、2705 至 2708 号房	3,439,179.71	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
浙江协作大厦 6-8 楼	1,210,466.76	尚未办妥房产证及土地使用权证
福州中盛大厦 702 号房屋	14,919,273.93	尚未办妥房产证及土地使用权证
小 计	35,471,896.94	

注：沈阳财富中心 B 座 23-5、23-6 中部分房产已用于出租，转入投资性房地产科目核算。

## 15. 投资性房地产

(1) 明细情况

项 目	房屋及建筑物	合 计
账面原值		
期初数	4,153,902.54	4,153,902.54
本期增加金额		
本期减少金额		
期末数	4,153,902.54	4,153,902.54
累计折旧和累计摊销		
期初数	416,638.16	416,638.16
本期增加金额	67,152.66	67,152.66
本期减少金额		
期末数	483,790.82	483,790.82
账面价值		

期末账面价值	3,670,111.72	3,670,111.72
期初账面价值	3,737,264.38	3,737,264.38

(2) 期末无投资性房地产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的投资性房地产的情况说明如下：

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
福州中盛大厦 701 号房屋	3,106,783.37	尚未办妥房产证及土地使用权证
沈阳财富中心 23-5(部分)、23-6(部分)	563,328.35	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小 计	3,670,111.72	

## 16. 无形资产

(1) 明细情况

项 目	土地使用权[注]	软 件	合 计
账面原值			
期初数	261,915,921.72	35,721,748.68	297,637,670.40
本期增加金额		93,791.69	93,791.69
1) 购置		93,791.69	93,791.69
本期减少金额			
外币报表折算差额		12,960.00	12,960.00
期末数	261,915,921.72	35,828,500.37	297,744,422.09
累计摊销			
期初数	23,815,338.84	21,528,950.59	45,344,289.43
本期增加金额	3,273,949.02	5,185,488.50	8,459,437.52
1) 计提	3,273,949.02	5,185,488.50	8,459,437.52
本期减少金额			
外币报表折算差额		12,960.00	12,960.00
期末数	27,089,287.86	26,727,399.09	53,816,686.95
账面价值			
期末账面价值	234,826,633.86	9,101,101.28	243,927,735.14
期初账面价值	238,100,582.88	14,192,798.09	252,293,380.97

注： 土地使用权说明详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之其他资产说明。

(2) 期末无无形资产用于担保。

## 17. 递延所得税资产、递延所得税负债

### (1) 未经抵销的递延所得税资产

项 目	期末数		期初数	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
预计负债	42,275,843.76	10,568,960.94	50,481,704.38	12,620,426.10
未付工资	213,897,722.79	53,474,430.70	129,908,924.04	32,477,231.01
存货跌价准备	60,333,058.26	15,083,264.56	81,432,295.81	20,358,073.96
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债公允价值变动	9,849,146.05	2,462,286.51	4,180,566.48	1,042,957.62
期货风险准备金	7,592,806.97	1,898,201.74	7,606,006.97	1,901,501.74
坏账准备	8,410,265.10	1,917,453.22	8,021,288.85	1,798,212.07
应付期货投资者保障基金	249,463.45	62,365.86	505,546.72	126,386.68
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动			153,419.75	38,354.94
合 计	342,608,306.38	85,466,963.53	282,289,753.00	70,363,144.12

### (2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
可供出售金融资产公允价值变动	18,518,832.23	4,629,708.06	316,037,794.07	79,031,871.94
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动	57,162,678.60	14,221,470.64	44,634,584.11	11,176,105.06
合 计	75,681,510.83	18,851,178.70	360,672,378.18	90,207,977.00

## 18. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	160,190,547.22	156,842,296.25
在建工程[注 1]	64,062,078.94	49,308,879.59
长期待摊费用	15,953,208.36	14,008,820.25
其他流动资产[注 2]	119,945,586.51	87,338,744.09
待摊费用	17,694,031.96	16,537,335.91
合 计	377,845,452.99	324,036,076.09

注 1: 2013 年度, 本公司与双冠控股集团有限公司、财通证券股份有限公司 (以下简称财通证券公

司)合作购买杭州翠苑单元 B1/B2-10-2 地块用于联建办公楼,三方出资比例分别为 30%、35%和 35%。该工程造价总预算数 14.43 亿元,其中土地款 8.73 亿元,根据前述出资比例,本公司应承担的土地款为 2.62 亿元。根据本期该工程支出情况和前述出资比例,本公司本期在建工程增加 14,753,199.35 元。

注 2:2017 年度,中远海运物流仓储配送有限公司青岛物流中心南泉库存放点发生火灾,存放货物全损,公司将预计可赔付金额 10,242,172.71 元记入其他流动资产。公司于本期收到赔偿款计 29,033,441.84 元,冲减其他流动资产 10,242,172.71 元,确认营业外收入 18,791,269.13 元。

#### 19. 短期借款

项 目	期末数	期初数
质押借款		50,000,000.00
保证借款	699,308,995.50	510,000,000.00
合 计	699,308,995.50	560,000,000.00

#### 20. 应付货币保证金

明细情况——按客户类别

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	97,552	7,219,686,533.54	93,828	7,744,666,636.85
法人	5,465	15,769,421,282.81	5,279	14,178,655,696.00
合 计	103,017	22,989,107,816.35	99,107	21,923,322,332.85

#### 21. 应付质押保证金

(1) 明细情况——按客户类别

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
法人	16	485,976,978.00	13	173,328,692.00
合 计	16	485,976,978.00	13	173,328,692.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海商品期货交易所	257,684,228.00	63,413,752.00
大连商品期货交易所	30,790,000.00	37,990,000.00
郑州商品期货交易所	197,502,750.00	71,924,940.00
合 计	485,976,978.00	173,328,692.00

22. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

项 目	期末数	期初数
衍生金融负债	7,309,121.05	5,285,609.64
合 计	7,309,121.05	5,285,609.64

23. 期货风险准备金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
风险准备金	191,824,966.82	10,282,334.31	13,200.00	202,094,101.13
合 计	191,824,966.82	10,282,334.31	13,200.00	202,094,101.13

(2) 本期风险准备金计提方法和比例说明

按本期母公司代理手续费净收入的 5%计提期货风险准备金。

(3) 本期动用风险准备金说明

本期动用期货风险准备金系用于弥补错单损失。

24. 应付票据及应付账款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付账款	603,592.05	27,142,702.05
合 计	603,592.05	27,142,702.05

(2) 应付账款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
货款	603,592.05	26,926,236.58
工程款		216,465.47
合 计	603,592.05	27,142,702.05

2) 期末无账龄 1 年以上重要的应付账款。

25. 预收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
货款	248,477,579.43	162,818,228.29

投资咨询费	2,516,358.46	444,999.92
基金销售业务收入		201,196.74
合 计	250,993,937.89	163,464,424.95

(2) 本期无账龄 1 年以上重要的预收款项。

(3) 应付关联方款项

关联方名称	期末数	款项性质
鞍钢贸易公司	4,700,000.00	货款

## 26. 应付期货投资者保障基金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
应付期货投资者保障基金	535,879.52	264,431.26	535,879.52	264,431.26
合 计	535,879.52	264,431.26	535,879.52	264,431.26

(2) 本期计提方法和比例说明

根据中国证券监督管理委员会和财政部（2016）26 号公告，从 2016 年 12 月 8 日起，本公司按照母公司代理交易额的亿分之五点五计提期货投资者保障基金。

## 27. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	400,440,037.01	314,713,480.36	294,094,047.03	421,059,470.34
离职后福利—设定提存计划	16,120,530.83	25,489,954.67	28,626,189.93	12,984,295.57
合 计	416,560,567.84	340,203,435.03	322,720,236.96	434,043,765.91

(2) 短期薪酬明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	373,582,032.06	280,305,536.05	247,379,091.20	406,508,476.91
职工福利费	2,772.00	5,414,215.84	5,416,987.84	
社会保险费	16,055,913.21	14,376,352.40	24,818,395.09	5,613,870.52
其中：医疗保险费	412,834.79	6,377,559.34	6,425,214.43	365,179.70
补充医疗保	15,600,000.00	7,009,456.42	17,409,456.42	5,200,000.00

险				
工伤保险费	7,179.74	172,529.49	172,753.23	6,956.00
生育保险费	35,898.68	649,532.97	643,696.83	41,734.82
其他		167,274.18	167,274.18	
住房公积金	579,314.00	8,621,318.85	8,620,284.69	580,348.16
工会经费和职工教育经费	10,220,005.74	5,996,057.22	7,859,288.21	8,356,774.75
小 计	400,440,037.01	314,713,480.36	294,094,047.03	421,059,470.34

(3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	502,581.49	10,842,020.39	10,857,695.62	486,906.26
失业保险费	17,949.34	360,647.28	361,207.31	17,389.31
补充养老保险	15,600,000.00	14,287,287.00	17,407,287.00	12,480,000.00
小 计	16,120,530.83	25,489,954.67	28,626,189.93	12,984,295.57

28. 应交税费

项 目	期末数	期初数
增值税	1,075,753.70	1,285,700.96
企业所得税	72,700,740.84	149,435,953.27
代扣代缴企业所得税		305,491.12
代扣代缴个人所得税	2,727,710.50	3,448,291.94
城市维护建设税	129,079.04	66,237.70
教育费附加	55,319.54	28,387.55
地方教育费附加	36,877.56	18,924.28
其他	195,125.60	110,287.99
合 计	76,920,606.78	154,699,274.81

29. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付利息	21,490,670.60	9,453,253.06
应付股利		196,500,000.00

其他应付款	361,479,500.96	360,681,137.39
合 计	382,970,171.56	566,634,390.45

(2) 应付利息

项 目	期末数	期初数
次级债券利息	20,548,109.60	8,715,452.06
短期借款应付利息	942,561.00	737,801.00
合 计	21,490,670.60	9,453,253.06

(3) 应付股利

项 目	期末数	期初数
普通股股利		196,500,000.00
合 计		196,500,000.00

(4) 其他应付款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付佣金	1,311,181.31	1,500,959.27
经营层风险金	6,700,000.00	4,900,000.00
交易所质押款	168,579,052.50	111,157,670.00
合作投资款	159,647,399.12	228,714,502.93
场外期权权利金及保证金	16,377,041.29	9,162,868.48
其他	8,864,826.74	5,245,136.71
合 计	361,479,500.96	360,681,137.39

2) 账龄 1 年以上重要的其他应付款

单位名称	期末数	未偿还或结转的原因
莱芜京华制管有限公司	99,647,399.12	尚在合作，未结清
小 计	99,647,399.12	

3) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
上海期货交易所质押款	101,817,460.00	质押款
莱芜京华制管有限公司	99,647,399.12	合作投资款
郑州商品交易所质押款	51,563,512.50	质押款
招商财富光大银行多元投资 3 号资产管理计划	50,000,000.00	合作投资款
河北正大玻璃有限公司	10,000,000.00	合作投资款

小 计	313,028,371.62	
4) 应付关联方款项		
关联方名称	期末数	款项性质
财通证券股份有限公司	871,503.84	IB 业务费
小 计	871,503.84	

### 30. 预计负债

#### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
待执行合同亏损	63,817,678.82	52,134,360.38
诉讼事项	417,623.47	417,623.47
合 计	64,235,302.29	52,551,983.85

#### (2) 其他说明

1) 永安资本公司、上海瑞萌公司、永安新加坡公司对待执行货物购销合同按合同价与市场价的差额确认预计亏损。

2) 诉讼事项系 2015 年 1 月，新永安公司收到来自 Alterra International Holdings Limited 公司（以下简称 ALterra 公司）的律师函，要求赔偿其客户翁超颖诈骗的 588,600.00 欧元。2016 年 10 月，Alterra 公司在塞浦路斯当地法院对新永安期货公司和交通银行提起诉讼，要求赔偿上述款项。截至资产负债表日，新永安公司已聘请香港律师和塞浦路斯当地律师进行处理，并就此事计提了预计负债 417,623.47 元。

### 31. 其他负债

项 目	期末数	期初数
永安期货公司 2015 年次级债券	430,000,000.00	430,000,000.00
合 计	430,000,000.00	430,000,000.00

### 32. 股本

项 目	期初数	本期增减变动					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	1,310,000,000						1,310,000,000

### 33. 资本公积

#### 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	1,489,444,325.01			1,489,444,325.01
其他资本公积	11,424,605.14			11,424,605.14
合 计	1,500,868,930.15			1,500,868,930.15

#### 34. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额	
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益
以后将重分类进损益的其他综合收益	242,604,624.42	-274,158,481.54	20,057,578.24
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	5,173,590.18	-182,935.09	
可供出售金融资产公允价值变动损益	239,806,845.80	-277,551,077.27	20,057,578.24
外币财务报表折算差额	-2,375,811.56	3,575,530.82	
其他综合收益合计	242,604,624.42	-274,158,481.54	20,057,578.24

(续上表)

项 目	本期发生额			期末数
	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
以后将重分类进损益的其他综合收益	-74,402,163.88	-219,813,895.90		22,790,728.52
其中：权益法下可转损益的其他综合收益		-182,935.09		4,990,655.09
可供出售金融资产公允价值变动损益	-74,402,163.88	-223,206,491.63		16,600,354.17
外币财务报表折算差额		3,575,530.82		1,199,719.26
其他综合收益合计	-74,402,163.88	-219,813,895.90		22,790,728.52

#### 35. 盈余公积

明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	229,132,515.87			229,132,515.87
合 计	229,132,515.87			229,132,515.87

#### 36. 一般风险准备

明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
一般风险准备	289,023,529.80			289,023,529.80

合 计	289,023,529.80		289,023,529.80
-----	----------------	--	----------------

### 37. 未分配利润

项 目	金 额	提取或分配比例
期初未分配利润	1,970,448,793.06	
加：本期归属于母公司所有者的净利润	548,598,935.52	
期末未分配利润	2,519,047,728.58	

#### (二) 合并利润表项目注释

##### 1. 手续费收入

###### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费	79,962,753.31	100,847,805.56
交易所返还减收手续费	145,572,151.08	161,955,113.28
投资咨询收入	2,148,268.81	9,938,025.55
资产管理业务净收入	4,573,866.83	9,262,004.96
期权经纪手续费	621,606.01	601,565.45
代销基金收入	22,850,223.43	10,039,306.40
合 计	255,728,869.47	292,643,821.20

###### (2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部	1	196,097,307.64
浙江省(不含杭州本部)	14	16,512,226.57
山东省	6	3,482,102.24
辽宁省	3	3,174,125.70
北京市	1	3,183,246.96
上海市	1	2,324,257.94
广东省	2	2,308,025.48
江苏省	2	1,254,487.04
福建省	2	1,445,097.81
吉林省	1	1,298,074.46
天津市	1	1,006,691.61
河北省	1	1,019,091.97

河南省	1	892,683.40
湖北省	1	876,872.24
江西省	1	356,654.19
重庆市	1	1,148,778.16
湖南省	1	560,516.40
四川省	1	613,281.35
香港	1	18,175,348.31
合 计	42	255,728,869.47

## 2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	298,404,966.94	290,547,429.70
其中：母公司保证金利息收入	273,093,339.76	269,430,627.84
境外利息收入	11,697,946.42	11,762,534.36
其他利息收入	13,613,680.76	9,354,267.50
利息支出	41,540,147.21	49,380,122.33
合 计	256,864,819.73	241,167,307.37

## 3. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	124,904,698.61	103,807,506.72
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	324,190,016.42	175,847,707.52
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债取得的投资收益	199,556,865.30	116,628,159.40
处置可供出售金融资产取得的投资收益	20,057,578.24	19,615,774.93
合 计	668,709,158.57	415,899,148.57

## 4. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	11,994,685.01	29,685,988.77
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益[注]	5,904,290.70	28,516,220.14
合 计	11,994,685.01	29,685,988.77

注：本期衍生金融工具之公允价值变动收益系持有的期货合约、期权等浮动盈亏。

#### 5. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
销售货物收入	5,280,547,947.13	3,921,249,492.23
租赁收入	41,691.42	41,377.70
其他	5,509,710.86	3,349,424.71
合 计	5,286,099,349.41	3,924,640,294.64

#### 6. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
财政补助	2,512,206.64		2,512,206.64
合 计	2,512,206.64		2,512,206.64

本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注合并财务报表项目注释之政府补助说明。

#### 7. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
营业税[注]	13,561.30	
城市维护建设税	653,735.05	826,189.14
教育费附加	280,052.28	354,081.04
地方教育附加	186,566.62	235,925.36
房产税	597,918.12	612,902.98
印花税	764,554.40	542,303.80
土地使用税	35,116.53	40,296.86
车船税	11,520.00	12,772.50
合 计	2,543,024.30	2,624,471.68

注：系补缴以前年度营业税。

#### 8. 业务及管理费

业务及管理费前 10 名明细情况

项 目	本期数	上年同期数
工资、奖金、津贴和补贴	279,226,149.47	246,837,727.56
社会保险费	39,710,007.85	30,141,127.46
租赁费	18,636,065.60	13,799,223.94

仓储费	12,786,355.38	23,109,041.66
住房公积金	8,512,538.85	6,656,336.72
无形资产摊销	8,459,437.52	6,584,475.31
折旧费	6,970,732.39	7,217,722.06
工会经费	5,463,734.01	4,830,663.79
福利费	5,389,715.84	5,536,656.79
差旅费	5,122,133.77	5,102,083.93
小 计	390,276,870.68	349,815,059.22

#### 9. 研发费用

项 目	本期数	上年同期数
工资、奖金、津贴和补贴	1,079,386.58	934,042.10
社会保险费	156,299.22	94,437.26
住房公积金	108,780.00	54,750.00
福利费	24,500.00	14,750.00
折旧费	5,206.08	5,299.55
合 计	1,374,171.88	1,103,278.91

#### 10. 资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
坏账损失	125,335.41	1,608,735.14
存货跌价损失	122,134,971.18	126,291,818.91
合 计	122,260,306.59	127,900,554.05

#### 11. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
销售货物成本	5,198,816,541.99	3,769,603,426.26
租赁成本	67,152.66	54,643.32
合 计	5,198,883,694.65	3,769,658,069.58

#### 12. 营业外收入

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额

非流动资产毁损报废利得	14.17	1,766.16	14.17
个人所得税代扣代缴手续费返还	813,788.77	672,241.60	813,788.77
合同违约金及客户赔款	4,093,865.75		4,093,865.75
存货毁损赔偿[注]	18,791,269.13		18,791,269.13
政府补助		2,285,701.35	
待执行合同亏损转回		20,793,458.96	
其他	580.08	809,901.45	580.08
合 计	23,699,517.90	24,563,069.52	23,699,517.90

注：存货毁损赔偿详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之其他资产说明。

### 13. 营业外支出

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产毁损报废损失	5,985.37	18,801.07	5,985.37
待执行亏损合同	11,662,477.51	23,637,343.60	
残疾人就业保障基金	518,254.08	29,677.16	
地方水利建设基金	2,511.39	9,166.01	
捐赠支出	3,660,000.00	5,170,000.00	3,660,000.00
罚款及滞纳金	904,881.87		904,881.87
其 他	9,125.66	61,967.07	9,125.66
合 计	16,763,235.88	28,926,954.91	4,579,992.90

### 14. 所得税费用

#### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	167,683,720.37	98,138,761.82
递延所得税费用	-12,058,453.83	12,965,965.54
合 计	155,625,266.54	111,104,727.36

#### (2) 会计利润与所得税费用调整过程

项 目	本期数	上年同期数
利润总额	708,860,912.72	583,226,833.53
按母公司适用税率计算的所得税费用	177,215,228.18	145,806,708.38

子公司适用不同税率的影响	-3,180,723.44	-2,631,342.25
调整以前期间所得税的影响	6,759,756.56	-487,489.78
亏损企业免交所得税影响	6,293,612.60	180,585.25
免税收入影响	-32,585,642.66	-28,578,958.91
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	691,617.36	801,387.42
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响		2,424.90
弥补以前年度亏损	-396,266.05	-5,030,485.11
合并范围内利润抵销影响	827,683.99	1,041,897.46
所得税费用	155,625,266.54	111,104,727.36

#### 15. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之其他综合收益说明。

### (三) 合并现金流量表项目注释

#### 1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
客户净入金	453,265,192.63	
其他收入现金流入	5,551,402.28	7,158,646.81
受限保证金变动	64,704,308.99	
其他现金流入	36,453,883.08	3,237,689.04
合 计	559,974,786.98	10,396,335.85

#### 2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
客户净出金		370,715,379.06
交易所净入金	738,068,421.56	2,141,542,079.60
往来款项	56,623,018.93	51,712,568.96
其他现金流出	6,780,291.29	37,448,939.80
合 计	801,471,731.78	2,601,418,967.42

### 3. 支付其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
定期存款	358,160,619.51	1,187,329,460.82
其他		4,563,000.00
合 计	358,160,619.51	1,191,892,460.82

### 4. 收到其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
结构化产品其他投资者投入	236,408,159.29	
合 计	236,408,159.29	

### 5. 支付其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
结构化产品其他投资者赎回及到期清算		37,112,706.39
合 计		37,112,706.39

## (四) 政府补助

### 1. 与收益相关，且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项目	金额	列报项目	说明
开发扶持基金	2,410,000.00	其他收益	上海市浦东新区世博地区开发管理委员会专项资金
金融支持经济发展 考评奖	20,000.00	其他收益	绍兴市地方金融监管局金融支持 经济发展考评奖励
稳定岗位补贴	18,906.64	其他收益	政府对稳定就业企业给予失业 保险金返还
其他	63,300.00	其他收益	
小计	2,512,206.64		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 2,512,206.64 元。

## 六、合并范围的变更

### (一) 合并范围增加

#### 1. 报告期新纳入合并财务报表范围的子公司

因直接设立方式而增加子公司的情况说明

公司名称	股权取得方式	股权取得时点	实际出资额	出资比例
新永安资管公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	2,000 万港元	100.00%
新永安证券公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	2,000 万港元	100.00%
新永安新加坡公司[注 1]	设立	2018 年 6 月	[注 2]	100.00%

注 1：系子公司新永安控股公司出资设立。

注 2：截至 2018 年 6 月 30 日，新永安控股公司尚未对其出资。

## 2. 新纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的永屹 1 号，因公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免，且享有的可变回报为重大纳入公司合并财务报表范围。

### (二) 合并范围减少

1. 本期无合并财务报表范围的子公司减少。

2. 不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本期，本公司管理的成长 1 号资产管理计划(以下简称成长 1 号)、成长 2 号资产管理计划(以下简称成长 2 号)、成长 3 号资产管理计划(以下简称成长 3 号)、成长 5 号资产管理计划(以下简称成长 5 号)、成长 6 号资产管理计划(以下简称成长 6 号)、永安瑞意（多策略）一号资产管理计划(以下简称瑞意多策略 1 号)因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

## 七、在其他主体中的权益

### (一) 在子公司中的权益

#### 1. 子公司的构成

基本情况

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
永安资本公司	杭州	杭州	商业	100.00		设立
中邦实业公司	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下企业合并
上海瑞萌公司	上海	上海	商业		100.00	设立
永安商贸公司	香港	香港	商业		100.00	设立
永安新加坡公司	新加坡	新加坡	商业		100.00	设立
新永安控股公司	香港	香港	金融业	100.00		设立
新永安期货公司	香港	香港	金融业		100.00	非同一控制下企业合并
新永安实业公司	香港	香港	商业		100.00	设立
新永安资管公司	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安证券公司	香港	香港	金融业		100.00	设立

新永安新加坡公司	新加坡	新加坡	金融业		100.00	设立
----------	-----	-----	-----	--	--------	----

## 2. 纳入合并范围的结构化主体

期末，本公司管理并投资的七禾言起 2 号、永利 1 号、黑色多头 1 号、黑色空头 1 号、有色多头 1 号、有色空头 1 号、永屹 1 号，因满足公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免，且享有的可变回报为重大三个条件，故将上述结构化主体纳入公司合并财务报表范围。

### (二) 在联营企业中的权益

#### 1. 重要的联营企业

##### (1) 基本情况

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
永安国富公司	杭州	杭州	金融业	33.00		权益法核算
玉皇山南公司	杭州	杭州	金融业		19.00	权益法核算
鞍钢贸易公司[注]	杭州	杭州	商业		49.00	权益法核算

注：系子公司永安资本公司出资设立。

##### (2) 持有 20%以下表决权但具有重大影响

永安资本公司因向玉皇山南公司派遣董事，故能够对其生产经营产生重大影响。

#### 2. 重要联营企业的主要财务信息

项 目	期末数/本期数			2017 年 6 月 30 日报表数/上年同期数	
	永安国富公司	玉皇山南公司	鞍钢贸易公司	永安国富公司	玉皇山南公司
流动资产	931,214,028.81	82,511,518.43	60,885,225.87	527,553,625.43	90,386,816.06
非流动资产	408,358,235.99	28,058,398.29		85,332,791.68	34,769,255.88
资产合计	1,339,572,264.80	110,569,916.72	60,885,225.87	612,886,417.11	125,156,071.94
流动负债	513,376,055.37	20,891,386.69	10,552,278.50	318,085,438.44	40,230,909.46
非流动负债	5,438,974.03			6,676,323.20	
负债合计	518,815,029.40	20,891,386.69	10,552,278.50	324,761,761.64	40,230,909.46
少数股东权益		12,252,733.01			2,053,267.35
归属于母公司所有者权益	820,757,235.40	77,425,797.02	50,332,947.37	288,124,655.47	82,871,895.13
按持股比例计算的净资产份额	270,849,887.68	14,710,901.43	24,663,144.21	143,211,732.47	16,135,780.87
调整事项					
商誉					
内部交易未实现利润					

其他					
对联营企业权益投资的账面价值	270,849,887.68	14,710,901.43	24,663,144.21	143,211,732.47	15,745,660.07
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值					
营业收入	911,168,240.76	713,263.77	103,560,427.99	507,508,055.64	89,217.59
净利润	374,734,498.87	-1,609,148.80	332,947.37	217,132,517.92	-11,193,265.15
终止经营的净利润					
其他综合收益	-351,937.72			2,533,853.03	
综合收益总额	374,382,561.15	-1,609,148.80	332,947.37	219,666,370.95	-11,193,265.15
本期收到的来自联营企业的股利	132,000,000.00			88,353,968.50	

### (三) 本期纳入合并范围的结构化主体的财务数据

名称	期末净资产	本期净利润
七禾言起2号	27,491,566.75	5,016,237.83
永利1号	425,908,124.25	1,146,185.26
黑色多头1号	2,656,481.25	-17,511.71
黑色空头1号	2,668,974.80	-70,881.16
有色多头1号	3,626,035.54	-207,072.65
有色空头1号	3,754,333.04	284,424.85
永屹1号	7,389,495.73	289,095.14
成长1号		15,951.49
成长2号		115,836.15
成长3号		104,375.36
成长4号		-12,498.76
成长5号		-87,358.80
瑞意多策略1号		-799,823.46
小计	473,495,011.36	5,776,959.54

## 八、关联方关系及其交易

### (一) 关联方认定标准说明

根据《企业会计准则第36号——关联方披露》，一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响的，构成关联方。

### (二) 关联方关系

关联方名称	与本公司的关系
财通证券公司	第一大股东
永安国富公司	联营企业
浙江永安国富实业有限公司（以下简称国富实业公司）	永安国富公司之子公司
浙江省协作大厦有限公司（以下简称协作大厦公司）	股东
财通证券资产管理有限公司（以下简称财通资管公司）	财通证券公司之子公司
财通基金管理有限公司（以下简称财通基金公司）	财通证券公司之联营公司
OSTC Yongan Trading Co., Limited	永安商贸公司之联营公司
浙江永安投资咨询有限公司（以下简称永安咨询公司）	OSTC Yongan Trading Co., Limited 之子公司
浙江省金融业发展促进会	该公司法定代表人出任本公司独立董事
玉皇山南公司	永安资本公司之联营公司
敦和资产管理有限公司（以下简称敦和资管公司）	该公司董事长、法定代表人在过去十二个月内出任本公司副董事长、总经理、法定代表人
鞍钢贸易公司	永安资本公司之联营企业

### （三）关联方交易情况

1. 关联方未结算项目金额详见本财务报表相关项目注释。
2. 关联方在本公司开设账户，从事期货交易的情况如下：

客户名称	期末权益	本期手续费收入
财通证券公司	35,221,247.83	10,874.08
永安国富公司		2,443.27
国富实业公司	37,706,237.81	2,745.29
协作大厦公司	2,790,343.96	7,907.10
鞍钢贸易公司	9,104,659.63	207.29
永安咨询公司	59,989.65	
小 计	84,882,478.88	24,177.03

### 3. 特殊法人机构期货经纪业务

财通基金、财通资管、永安国富公司、敦和资管公司作为特殊法人机构在本公司开户从事期货交易，相关数据如下：

客户名称	期末权益	本期手续费收入
财通基金公司	10.00	
财通资管公司	15,795,690.04	429.88
永安国富公司	2,464,297,654.53	810,341.08

敦和资管公司		1,734,887.84
小 计	2,480,093,354.57	2,545,658.80

#### 4. IB 业务佣金

本公司与财通证券公司签约，由财通证券公司经正式审批的证券营业部为本公司提供中间介绍服务（以下简称 IB 业务），本期本公司因上述 IB 业务应支付财通证券公司 IB 业务费 3,555,306.75 元。

#### 5. 购销商品

##### (1) 采购商品的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数（含税）
鞍钢贸易公司	采购商品	7,290,754.80
小 计		7,290,754.80

##### (2) 出售商品的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数（含税）
鞍钢贸易公司	销售商品	1,254,270.72
国富实业公司	销售商品	5,752,069.94
小 计		7,006,340.66

6. 期末本公司、永安资本公司、中邦实业公司持有永安国富公司及财通资管公司作为管理人募集设立的资产管理计划、基金如下：

证券代码	证券名称	管理人	持仓成本	期末账面价值
S65140	永安国富-永富 1 号资产管理计划	永安国富公司	24,806,685.27	28,689,432.72
SE5386	永安国富-永富 3 号资产管理计划	永安国富公司	770,000,000.00	753,955,548.18
SM9085	永安国富-永富 10 号私募证券投资基金	永安国富公司	223,865,548.82	230,850,153.94
SCN896	永安国富-永富 12 号私募基金	永安国富公司	5,000,000.00	5,032,000.00
ST0836	永安国富-永富 FOF1 号私募投资基金	永安国富公司	80,000,000.00	80,800,000.00
SX7360	永安国富-稳健 5 号私募投资基金	永安国富公司	50,000,000.00	51,750,000.00
SCK338	永安国富-稳健 6 号私募基金	永安国富公司	382,100,000.00	398,950,610.00
003480	财通资管鑫管家货币 B	财通资管公司	51,388,405.63	51,388,405.63

#### 7. 期末永安国富公司持有本公司作为管理人募集设立的资产管理计划：

证券代码	证券名称	管理人	持仓成本	期末账面价值
SR1319	永安期货股份有限公司工银量化恒盛精选 A 类 25 期	本公司	20,000,000.00	24,544,000.00

#### 8. 本期本公司持有永安国富公司管理的资产管理计划分红：

证券代码	证券名称	管理人	分红金额
SE5386	永安国富-永富3号资产管理计划	永安国富公司	305,618,296.14
ST0836	永安国富-FOF1号私募投资基金	永安国富公司	13,662,961.53

9. 公司、上海瑞萌公司及中邦实业公司在财通证券公司开户从事股票交易，相关数据如下：

公司	期末有价证券市值	期末资金余额	本期证券交易费
本公司		684.64	
上海瑞萌公司	54,158.00	18,311.62	4,255.15
中邦实业公司		0.43	532.59
小计	54,158.00	18,996.69	4,787.74

10. 关键管理人员报酬

项目	2018年1-6月
关键管理人员报酬	257.39万元

11. 其他

(1) 本公司为永安国富公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 6,738,773.59 元。

(2) 本公司为玉皇山南公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 15,386.70 元。

(3) 本公司为敦和资管公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 24,942.34 元。

(4) 本期本公司向浙江省金融业发展促进会支付会议费 500,000.00 元。

(5) 永安商贸公司向 OSTC Yongan Trading Co., Limited 拆出资金 2,117,647.00 英镑，该公司于本期偿还 353,454.31 英镑。永安商贸公司本期计提利息折合人民币为 543,538.27 元。

## 九、公允价值的披露

(一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
持续的公允价值计量				
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	142,952,039.25	4,139,698.08		147,091,737.33
交易性金融资产	142,952,039.25	4,139,698.08		147,091,737.33
债务工具投资				
权益工具投资	86,610,850.75			86,610,850.75
衍生金融资产	56,341,188.50	4,139,698.08		60,480,886.58
2. 可供出售金融资产		2,097,227,987.93		2,097,227,987.93
权益工具投资		2,097,227,987.93		2,097,227,987.93
持续以公允价值计量的资产总额	142,952,039.25	2,101,367,686.01		2,244,319,725.26
3. 以公允价值计量且其变动计入	9,849,146.05			9,849,146.05

当期损益的金融负债			
交易性金融负债	9,849,146.05		9,849,146.05
衍生金融负债	9,849,146.05		9,849,146.05
持续以公允价值计量的负债总额	9,849,146.05		9,849,146.05

(二) 持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据：取自公开市场查询的期末收盘价。

(三) 持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息：采用估值技术（包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等）确定其公允价值。

## 十、承诺及或有事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的承诺及或有事项。

## 十一、资产负债表日后事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的资产负债表日后事项。

## 十二、母公司财务报表主要项目注释

(一) 母公司资产负债表项目注释

### 1. 长期股权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	930,565,602.19		930,565,602.19
对合营联营企业投资	270,849,887.68		270,849,887.68
合 计	1,201,415,489.87		1,201,415,489.87

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	930,565,602.19		930,565,602.19
对合营联营企业投资	279,303,642.50		279,303,642.50
合 计	1,209,869,244.69		1,209,869,244.69

(2) 对子公司投资

被投资单位名称	持股比例 (%)	表决权比例 (%)	期末数
---------	----------	-----------	-----

新永安控股公司	100.00	100.00	178,581,600.00
永安资本公司	100.00	100.00	500,000,000.00
中邦实业公司	100.00	100.00	251,984,002.19
小 计			930,565,602.19

(3) 对合营联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
永安国富公司	279,303,642.50			123,662,384.63	-116,139.45
小 计	279,303,642.50			123,662,384.63	-116,139.45

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
永安国富公司		132,000,000.00			270,849,887.68	
小 计		132,000,000.00			270,849,887.68	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费	62,127,935.40	83,258,816.66
交易所返还减收手续费	142,924,481.84	161,955,113.28
投资咨询收入	1,832,224.44	9,827,010.37
资产管理业务净收入	5,634,335.17	9,262,004.96
期权经纪手续费	621,606.01	601,565.45
代销基金收入	22,850,223.43	10,039,306.40
合 计	235,990,806.29	274,943,817.12

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部	1	194,534,592.77
浙江省(不含杭州本部)	14	16,512,226.57
山东省	6	3,482,102.24
辽宁省	3	3,174,125.70
北京市	1	3,183,246.96
上海市	1	2,324,257.94

广东省	2	2,308,025.48
江苏省	2	1,254,487.04
福建省	2	1,445,097.81
吉林省	1	1,298,074.46
天津市	1	1,006,691.61
河北省	1	1,019,091.97
河南省	1	892,683.40
湖北省	1	876,872.24
江西省	1	356,654.19
重庆市	1	1,148,778.16
湖南省	1	560,516.40
四川省	1	613,281.35
合 计	41	235,990,806.29

## 2. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	123,662,384.63	106,394,933.78
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	324,040,741.84	176,046,360.48
处置可供出售金融资产取得的投资收益	8,174,548.33	4,708,062.75
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益		-37,907.91
合 计	455,877,674.80	287,111,449.10

## 十三、其他补充资料

### (一) 非经常性损益

项 目	金额	说明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-5,971.20	
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	2,512,206.64	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	543,538.27	
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		

非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、金融负债产生的公允价值变动收益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	19,125,496.20	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小 计	22,175,269.91	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	5,636,403.23	
少数股东权益影响额(税后)		
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	16,538,866.68	

## （二）净资产收益率及每股收益

### 1. 明细情况

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益(元/股)	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	9.61	0.42	0.42
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	9.32	0.41	0.41

### 2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	本期数
-----	----	-----

归属于公司普通股股东的净利润		A	548,598,935.52
非经常性损益		B	16,538,866.68
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润		C=A-B	532,060,068.84
归属于公司普通股股东的期初净资产		D	5,542,078,393.30
发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产		E	
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数		F	
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产		G	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数		H	
其他	权益法下可转损益的其他综合收益中所享有的份额	I1	-182,935.09
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	3
	可供出售金融资产公允价值变动	I2	-223,206,491.63
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	3
	外币报表折算差额变动	I3	3,575,530.82
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	3
报告期月份数		K	6
加权平均净资产		$L = D + A/2 + E \times F/K - G \times H/K \pm I \times J/K$	5,706,470,913.11
加权平均净资产收益率		$M = A/L$	9.61%
扣除非经常损益加权平均净资产收益率		$N = C/L$	9.32%

### 3. 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

#### (1) 基本每股收益的计算过程

项 目	序号	本期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	548,598,935.52
非经常性损益	B	16,538,866.68
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	532,060,068.84
期初股份总数	D	1,310,000,000.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E	
发行新股或债转股等增加股份数	F	
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G	
因回购等减少股份数	H	
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I	

报告期缩股数	J	
报告期月份数	K	6
发行在外的普通股加权平均数	$L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.42
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.41

(2) 稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

### (三) 公司主要财务报表项目的异常情况及原因说明

#### 1. 合并资产负债表项目

资产负债表项目	期末数	期初数	变动幅度	变动原因说明
应收质押保证金	654,556,030.50	284,486,362.00	130.08%	主要系公司代客户向交易所办理有价证券充抵保证金业务规模增加所致
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	90,915,311.83	31,586,974.11	187.83%	主要系并表结构化主体持有股票、基金的增加所致
应收票据及应收账款	6,147,664.33	4,678,107.30	31.41%	主要系子公司应收货款增加所致
应付质押保证金	485,976,978.00	173,328,692.00	180.38%	同“应收质押保证金”变动说明
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	7,309,121.05	5,285,609.64	38.28%	主要系子公司持有上清所掉期增加所致
应付票据及应付账款	603,592.05	27,142,702.05	-97.78%	主要系子公司应付货款减少所致
预收款项	250,993,937.89	163,464,424.95	53.55%	主要系销售及远期合同增加所致
应付期货投资者保障基金	264,431.26	535,879.52	-50.65%	主要系涵盖时间范围不同所致
应交税费	76,920,606.78	154,699,274.81	-50.28%	主要系应交企业所得税减少所致
其他应付款	382,970,171.56	566,634,390.45	-32.41%	主要系本期支付了期初应付股利所致
递延所得税负债	18,851,178.70	90,207,977.00	-79.10%	主要系可供出售金融资产公允价值变动减小所致
其他综合收益	22,790,728.52	242,604,624.42	-90.61%	同“递延所得税负债”变动说明
少数股东权益	354,850,773.53	128,603,420.87	175.93%	主要系并表结构化产品少数股东增加投资所致

#### 2. 合并利润表项目

利润表项目	本期数	上年同期数	变动幅度	变动原因说明
投资收益	668,709,158.57	415,899,148.57	60.79%	主要系可供出售金融资产持有期间收益及以公允价值计提且其变动计入当期损益的金融资产/负债外置收益增加所致
公允价值变动收益	11,994,685.01	29,685,988.77	-59.59%	主要系持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产浮盈变动所致
汇兑收益	2,256,414.46	-827,071.62	-372.82%	主要系汇率变动所致
其他业务收入	5,286,099,349.41	3,924,640,294.64	34.69%	主要系本期销售货物增加所致
其他收益	2,512,206.64			主要系本期与经营相关的政府补助转入所致

其他业务成本	5,198,883,694.65	3,769,658,069.58	37.91%	同“其他业务收入”变动说明
营业外支出	16,763,235.88	28,926,954.91	-42.05%	主要系待执行亏损合同金额减少所致
所得税费用	155,625,266.54	111,104,727.36	40.07%	主要系应纳税所得额增加所致

永安期货股份有限公司  
二〇一八年八月十七日