



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司

Yongan Futures Co.,Ltd.

年度报告

—2018—

公司年度大事记

2018年5月，公司分别与河北省大名县政府、辽宁省朝阳市杨树岭乡政府签订帮扶协议并提供专项扶贫资金，与浙江省常山县大桥头乡客弄村签订“千企结千村，消灭薄弱村”村企结对协议书。

2018年5月，公司“源点资讯”综合性期货投研服务平台获“第六届证券期货科学技术奖优秀奖”。

2018年6月，在2018浙江新三板峰会暨第二届浙江新三板年会上，公司获得“浙江精选企业奖”和“浙江新三板特别贡献奖”两项大奖。

2018年6月，在《证券时报》主办的“2018中国财富管理高峰论坛”上，公司荣获“2018中国财富管理机构君鼎奖”和“2018中国优秀期货公司君鼎奖”两项大奖。

2018年6月，在第九届中国私募金牛奖颁奖典礼暨高峰论坛上，参股公司永安国富荣膺“一年期宏观期货策略管理公司奖”。

2018年8月，公司第42家分支机构—唐山营业部正式成立。

2018年8月，中期协公布符合展开个股场外衍生品业务要求的风险管理公司名单，子公司浙江永安资本成为首批7家公司之一。

2018年9月，在中期协第五次会员大会上，总经理葛国栋当选为中期协理事、兼职副会长。

2018年11月，子公司中国新永安期货有限公司（香港）获第五届全球衍生品实盘交易大赛“优秀交易指导奖”。

2018年12月，公司与中央广播电视台经济之声联合主办的“2018大国经济报告会暨东方智慧财富论坛”在厦门召开。论坛就中国改革开放40年来金融行业的发展历程进行回顾与总结，展望金融行业深入改革与发展路径，探讨2019年投资方向。

注：本页内容原则上应当在一页之内完成。

目 录

第一节	声明与提示	5
第二节	公司概况	9
第三节	会计数据和财务指标摘要	11
第四节	管理层讨论与分析	15
第五节	重要事项	46
第六节	股本变动及股东情况	50
第七节	融资及利润分配情况	53
第八节	董事、监事、高级管理人员及员工情况	55
第九节	行业信息	59
第十节	公司治理及内部控制	60
第十一节	财务报告	69

释义

释义项目	指	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
上海瑞萌	指	上海永安瑞萌商贸有限公司
永安新加坡	指	永安（新加坡）国际贸易有限公司
新永安控股	指	新永安国际金融控股有限公司
新永安资管	指	新永安国际资产管理有限公司
新永安证券	指	新永安国际证券有限公司
永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安国际金融	指	YONGAN INTERNATIONAL FINANCIAL (SINGAPORE) PTE. LTD
玉皇山南	指	浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司
鞍钢商贸	指	鞍钢永安商品贸易有限公司
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，系永安期货的第一大股东
中期协	指	中国期货业协会
省财开	指	浙江省财务开发公司
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
新永安期货	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12月31日的期间
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本年度报告中，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。

第一节 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）罗利周保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司更正前的财务报告出具了标准无保留意见审计报告。公司经过自查，针对发现的会计差错，出具了《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》。天健会计师事务所（特殊普通合伙）和中汇会计师事务所（特殊普通合伙）对《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》进行了专项审核，出具了《永安期货股份有限公司前期会计差错更正专项说明的审核报告》。经其审核，天健会计师事务所（特殊普通合伙）和中汇会计师事务所（特殊普通合伙）均认为公司对相关会计差错更正的会计处理符合《企业会计准则第28号——会计政策、会计估计变更和差错更正》和全国中小企业股份转让系统有限责任公司《挂牌公司信息披露及会计业务问答（三）》的规定。

本年度报告涉及未来计划等前瞻性陈述，不构成公司对投资者的实质承诺，投资者及相关人士均应对此保持足够的风险认识，并且应当理解计划、预测与承诺之间的差异。

事项	是或否
是否存在董事、监事、高级管理人员对年度报告内容异议事项或无法保证其真实、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 checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否

1、豁免披露事项及理由


由于行业竞争激烈，公开披露客户及供应商信息容易引起商业机密泄露，很有可能引发同行业恶性竞争。因此，永安期货特申请豁免披露 2018 年年度报告第四节销售部分主要客户的名称、经纪业务部分主要客户的名称以及主要供应商的名称。

【重要风险提示表】

重要风险事项名称	重要风险事项简要描述
1. 期货、期权经纪业务风险	经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，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，手续费率呈逐渐下降态势，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。

2. 利息收入下滑风险	利息收入是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。公司的客户保证金和自有资金规模保持稳定，利率水平的变化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降，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。
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。
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。
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。
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。
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。
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

	<p>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。</p>
<p>9. 信息技术系统风险</p>	<p>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。</p>
<p>10. 信用风险</p>	<p>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。</p>
<p>11. 居间人管理风险</p>	<p>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</p>

	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。
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。
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期货法律法规的建设处于完善阶段，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。
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。
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。
本期重大风险是否发生重大变化：	否

第二节 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	浙江省杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16-17 层、2702 室

二、 联系方式

董事会秘书或信息披露事务负责人	叶元祖
是否具备全国股转系统董事会秘书任职资格	是
电话	(0571) 86672053
传真	(0571) 88388193
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
公司年度报告备置地	公司董事会秘书办公室

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	无
实际控制人及其一致行动人	浙江省财政厅
期货公司最新分类评价结果	AA

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
注册地址	浙江省杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16-17 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	宋慧娟、张汇江
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

第三节 会计数据和财务指标摘要

一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例
营业收入	15,763,889,406.71	9,589,243,052.39	64.39%
利润总额	1,113,033,385.76	1,147,106,572.25	-2.97%
归属于挂牌公司股东的净利润	872,197,337.15	922,069,555.33	-5.41%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	856,435,695.95	943,422,880.31	-9.22%
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）	14.92%	17.56%	-
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）	14.65%	17.97%	-
基本每股收益	0.67	0.70	-5.41%

二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例
资产总计	29,433,156,045.91	30,512,689,595.67	-3.54%
负债总计	23,460,988,714.90	24,951,269,942.15	-5.97%
归属于挂牌公司股东的净资产	5,972,167,331.01	5,561,419,653.52	7.39%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	4.56	4.25	7.39%
资产负债率%（母公司）	14.85%	20.68%	-
资产负债率%（合并）	35.47%	33.92%	-
流动比率	1.11	1.13	-

三、 营运情况

单位：元

	本期	上年同期	增减比例
经营活动产生的现金流量净额	-1,091,342,393.69	-3,499,992,717.39	68.82%
应收账款周转率	14,768.53	12,603.79	-
存货周转率	13.36	9.61	-

四、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例
总资产增长率%	-3.54%	-2.82%	-
营业收入增长率%	64.39%	41.03%	-
净利润增长率%	-5.41%	51.52%	-

五、 股本情况

单位：股

	本期期末	上年期末	增减比例
普通股总股本	1,310,000,000	1,310,000,000	0.00%
计入权益的优先股数量	0	0	-
计入负债的优先股数量	0	0	-

六、 非经常性损益

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	266,941.72
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）	3,824,232.17
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,082,731.77
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合并单位可辨认净资产公允价值产生的收益	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	16,103,213.97
其他符合非经常性损益定义的损益项目	
非经常性损益合计	21,277,119.63
所得税影响数	5,515,478.43
少数股东权益影响额（税后）	
非经常性损益净额	15,761,641.20

七、 其他主要会计数据和指标

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例
净资产	1,535,953,835.89	1,835,627,752.14	-16.33%
风险资本准备总额	589,029,649.20	614,744,718.63	-4.18%
净资产与风险资本准备总额的比例	261%	299%	-

净资本与净资产的比例	29%	36%	-
扣除客户保证金的流动资产	2,006,457,832.13	2,745,106,784.61	-26.91%
扣除客户权益的流动负债	938,027,772.91	1,346,958,238.66	-30.36%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	214%	204%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	17%	26%	-
结算准备金额	1,556,982,936.98	2,136,922,802.92	-27.14%

八、 补充财务指标

适用 不适用

九、 预计负债情况

适用 不适用

(一) 明细情况

项目	本期期末	上年期末	增减比例
待执行合同亏损	68,429,437.53	51,946,333.29	31.73%
未决诉讼	435,984.37	417,623.47	4.40%
合计	68,865,421.90	52,363,956.76	31.51%

(二) 重大项目的确认依据说明

1) 永安资本、上海瑞萌、永安新加坡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，新永安期货收到来自 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 435,984.37 元。

十、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

会计政策变更 会计差错更正 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	1,107,368.64		4,826,110.87	
应收票据及应收账款[注 1]		1,107,368.64		4,826,110.87

应收利息	13,398,157.39		1,465,340.51	
应收股利				
其他应收款	55,882,199.77	69,280,357.16	37,400,765.76	38,866,106.27
应付账款	24,274,821.46			
应付票据及应付账款		24,274,821.46		
应付利息	9,453,253.06		17,743,182.49	
应付股利	196,500,000.00			
其他应付款[注2]	361,142,685.91	567,095,938.97	384,508,879.20	402,252,061.69
其他收益	4,661,340.80	5,645,701.61		
营业外收入	2,349,116.97	1,364,756.16	12,692,151.29	12,692,151.29

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六（一）5存在差异，系审计报告将“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六（一）29存在差异，系审计报告将“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。

十一、业绩预告、业绩快报的差异说明

适用 不适用

公司年度报告中披露的财务数据与2018年年度业绩预告中披露的财务数据不存在超过10%的差异。

第四节 管理层讨论与分析

一、 业务概要

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参与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、可持续发展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。

核心竞争力分析：

适用 不适用

1. 行业地位优势明显

公司自成立以来，公司经营规模牢固占据浙江省第一，已连续二十一年年跻身全国期货公司十强行列，近年来经营规模稳居全国前三。公司在全国设有营业部 37 家、分公司 5 家，是国内营业网点最多的期货公司之一。作为中国期货行业领军者，公司在国内各交易所和行业自律机构中担任重要职务。根据中国证监会对期货公司分类评价结果，本公司的分类评级结果为行业内最高的 A 类 AA 级。

2. 公司治理完善高效

永安期货已建立起规范的法人治理结构与合理的内部控制体系。公司视合规经营、诚信自律为企业发展的第一生命线，坚持“一切只为客户”的发展理念，突出党建统领，强调党的领导和适应市场的经营决策机制，重视战略规划的制定和完善，营造合作、分享、共赢的“伙伴文化”，最大限度地满足投资者的需求，努力实现客户、股东和员工的共赢，打造永安核心文化凝聚力。公司围绕体系与机制、制度与流程、专业技术、管理平台、专业队伍的工作策略，完善风险管理组织架构，构建公司风

险偏好体系，强化合规风控的绩效考核问责机制，紧密结合行业监管与业务发展需求，以“打造专业、高效的风险管控体系，使之成为与业务发展并行的核心竞争力”为方向，提高整体风险防范能力，为公司持续、稳定、健康发展保驾护航。

3. 经纪业务实现差异化竞争

作为复杂的金融工具，期货交易对投资者的专业性要求较高。公司已建立完善的投资者教育平台，为投资者提供以投教为中心的增值服务能够有效满足客户对于附加服务价值的需求，增强客户粘性。为确保投资者教育活动切实符合客户需求，公司对客户进行分类并提供针对性的投资者教育服务。针对机构客户与专业投资客户，公司通过组织高端沙龙、搭建沟通平台，促进公司与客户、客户与客户之间的沟通交流；针对产业客户，公司通过品种推介会、套保专题培训、上门授课等形式，引导产业客户树立并形成成熟的风险管控理念，同时协助产业客户建立套保工作制度，并指导其进行套保交易操作；针对中小投资客户，公司专门设计“客户成长计划”，重点培育客户的风险管理能力、资金管理能力和交易技术等，携手客户共同成长。

4. 期货工具服务实体经济

以风险管理子公司为平台，公司打造形成服务实体经济的产业链服务模式，运用在市场纠偏、定向配送、向客户提供金融支持、为实体企业提供咨询服务、培育市场、成为客户安全可靠的交易对手、对不活跃月份合约提供远期连续报价、为上游生产企业锁定远期利润、为期货公司的投资咨询业务提供理论与实践支撑等多功能保障体系，帮助实体企业实现价格、产销、库存等多要素波动风险管理和产业转型优化升级，为实体经济注入发展动力。

5. 资产配置助力公司发展

公司利用资本市场和资本实力进行资产配置，推动公司业务发展和增加公司收入，形成自身独特的竞争优势。公司利用自有资金以发掘、引进优秀投顾为目的，体现自有资金对期货经纪业务落地撬动作用为衡量进行战略性投资，大力发展资产管理和财富管理业务，打造永安“资产管理”、“财富管理”特色品牌，同时利用自有资金进行财务性投资取得较好的经济效益。公司自有资金投资业务通过战略性投资、财务性投资的双向驱动，促使公司实现了更快的业务增长和更高的资本回报，已成为重要的盈利增长点。

6. 研发团队领先同业

作为塑造核心竞争力、发展各类新兴业务与创新业务的基础，公司始终重视研究能力的提升。公司现设有杭州研究中心、北京研究院两大投研机构，专业研究人员多具有知名高等院校或海外留学教育背景，整体规模、研究范围、综合实力均居于业内领先地位。其中杭州研究中心通过运用结构研究

方法对期货定价，深入产业生态圈各环节，为套期保值和期货投资提供基础性和应用性研究，并依托公司旗下的投资管理业务、期现结合业务和新永安期货的境外期货交易平台，实行全球交易活跃的品种全覆盖的研究战略，为投资者提供丰富资讯和优质服务。北京研究院建立了基本面量化的估值驱动研究体系，形成系列产品线包括基础报告、调研报告、深度报道等，开创了投资咨询、产业基金、基差交易、场外期权（期权+保险）、合作套保以及仓单服务等多种客户服务模式，有效提升了客户服务的质量与附加价值。公司卓越的研究实力业已得到社会各界的高度认可。公司研究团队屡获“最佳期货研究院”、“中国金牌期货研究所”等荣誉称号，公司连续多年获得各大交易所设立的产品类奖项，涌现出一大批荣获由期货日报、和讯网等主流媒体颁发的“最佳分析师”、“优秀分析师”等奖项的优秀研究人员。

报告期内变化情况：

事项	是或否
所处行业是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主营业务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主要产品或服务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
客户类型是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
关键资源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
销售渠道是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
收入来源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
商业模式是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

二、 经营情况回顾

（一） 经营计划

2018年是中国改革开放40周年，也是中国探索期货交易30周年，面对复杂严峻的国际形势和日趋激烈的市场竞争，公司深入贯彻党的十九大精神和习近平新时代中国特色社会主义思想，坚持党的领导，坚持一切只为客户和稳中求进规范发展总基调，深入推进服务实体经济和高质量发展。公司坚持经营机制改革，构建系统完备、科学规范、运行有效的制度体系，不断推进公司治理体系和治理能力现代化；坚持新发展理念，做深经纪业务，做精风险管理和财富管理、资产管理业务，大力拓展国际业务，做好金融服务实体经济、精准扶贫和防范金融风险大文章；坚持依靠并发挥全体员工积极性，着力做好高素质和专业化干部及人才队伍建设。公司围绕金融全面扩大开放和服务“一带一路”建设国家战略，深耕金融衍生品市场，以专业的服务能力，赢得了客户的广泛信任，在行业内打造出独特的核心竞争力，继续引领行业发展。

报告期内，公司经营情况良好，实现营业收入15,763,889,406.71元，同比增长64.39%；净利润

872,197,337.15 元，同比下降 5.41%；归属于母公司所有者的净利润 872,197,337.15 元，同比下降 5.41%；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）14.92%，较上年同比下降 2.64 个百分点，公司盈利能力稳定。截止本期期末，公司归属于母公司所有者的权益 5,972,167,331.01 元，同比增长 7.39%，资产规模进一步增大，资产质量优良。

公司（母公司本级）自 2011 年起监管评级保持 A 类 AA 级，各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截止本期末，公司净资本为 15.36 亿元，风险资本准备总额为 5.89 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 261%，净资产为 53.77 亿元，净资本与净资产的比例为 29%，流动资产与流动负债的比例为 214%，负债与净资产的比例为 17%，各项风险监管指标数据按照《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令【第 131 号】）、《期货公司风险监管报表编制与报送指引》（证监会公告[2017]8 号）的要求计算，持续符合监管标准。

（二） 行业情况

我国现代期货市场起步于二十世纪九十年代初期，经过逾 20 年的探索发展，中国期货市场逐步进入了稳定健康发展、经济功能日益显现的良性轨道，市场交易规模稳步增长。截至 2018 年末，我国共设有 3 家商品期货交易所（上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所）和 1 家金融期货交易所（中国金融期货交易所），已上市期货品种 61 个，其中商品期货 51 个、金融期货 6 个、商品期权 3 个、金融期权 1 个，基本形成了覆盖农业、金属、能源、化工以及金融等国民经济主要领域的产品体系，每个商品期货品种都连接着一个实体产业链，与实体经济密切相关，期货市场已经成为现代金融体系的重要组成部分。2018 年，我国商品期货成交量已经连续九年位居世界前列，金融期货重要作用不断显现，市场运行日趋规范，监管有效性不断提升。期货市场发展在我国深入推进供给侧结构性改革的新形势下，以服务实体经济为着力点，创新服务“三农”模式，助力产业结构调整和企业转型，服务国家“一带一路”战略和脱贫攻坚战略，稳妥推进品种创新，加大对外开放，市场核心竞争力和国际影响力不断增强，我国期货市场正逐步发展成为全球重要的风险管理市场。

目前我国期货行业形成了以中国证监会依法进行集中统一监督管理为主，中国期货业协会、期货交易所和中国期货保证金监控中心等自律性组织对期货行业会员实施自律管理的管理体制，期货公司正朝着风险管理服务和财富管理服务方向加快创新发展，健全法律法规体系，完善内控制度建设，深化对外不断开放，增加品种有效供给，强化风险防范意识，提升风险管控能力，保护投资者合法权益，充分发挥期货经营机构作为期货及衍生品服务供应商的专业能力，促进期货市场持续健康稳定发展。

(三) 财务分析

1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		本期期末 与上年期 末金额变 动比例
	金额	占总资 产的比 重	金额	占总资 产的比 重	
货币资金	15,100,136,062.53	51.30%	16,146,165,727.06	52.92%	-6.48%
其中：期货保证金存款	13,987,081,754.86	47.52%	14,801,097,903.82	48.51%	-5.50%
应收货币保证金	8,634,466,301.81	29.34%	9,624,944,308.77	31.54%	-10.29%
应收质押保证金	453,138,812.00	1.54%	284,486,362.00	0.93%	59.28%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	251,501,334.99	0.85%	31,586,974.11	0.10%	696.22%
应收票据					
应收账款	651,510.76	0.00%	1,107,368.64	0.00%	-41.17%
预付款项	176,585,144.04	0.60%	110,094,354.67	0.36%	60.39%
应收结算担保金	25,513,880.92	0.09%	25,513,887.40	0.08%	0.00%
应收风险损失款	62,322.49	0.00%	66,201.51	0.00%	-5.86%
应收佣金	2,345,603.23	0.01%	3,994,945.13	0.01%	-41.29%
其他应收款	93,487,921.96	0.32%	69,280,357.16	0.23%	34.94%
存货	973,484,388.78	3.31%	1,008,106,211.20	3.30%	-3.43%
其他流动资产	165,645,006.09	0.56%	260,610,832.09	0.85%	-36.44%
可供出售金融资产	2,631,966,620.73	8.94%	2,151,163,825.45	7.05%	22.35%
长期股权投资	326,610,079.92	1.11%	294,320,282.20	0.96%	10.97%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.00%	1,400,000.00	0.00%	0.00%
投资性房地产	3,602,959.06	0.01%	3,737,264.38	0.01%	-3.59%
固定资产	102,603,824.08	0.35%	108,288,008.05	0.35%	-5.25%
在建工程	87,245,315.29	0.30%	49,308,879.59	0.16%	76.94%
无形资产	241,219,290.44	0.82%	252,293,380.97	0.83%	-4.39%
长期待摊费用	14,308,002.80	0.05%	14,008,820.25	0.05%	2.14%
递延所得税资产	147,181,663.99	0.50%	72,211,605.04	0.24%	103.82%
短期借款	428,000,000.00	1.45%	560,000,000.00	1.84%	-23.57%
应付货币保证金	19,952,524,955.66	67.79%	21,923,322,332.85	71.85%	-8.99%
应付质押保证金	225,137,938.00	0.76%	173,328,692.00	0.57%	29.89%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	988,122,622.02	3.36%	132,748,600.25	0.44%	644.36%
期货风险准备金	213,203,152.39	0.72%	191,824,966.82	0.63%	11.14%
应付票据及应付账款	16,818,922.30	0.06%	24,274,821.46	0.08%	-30.71%
预收款项	406,991,421.73	1.38%	239,168,377.13	0.78%	70.17%

应付期货投资者保障基金	547,449.15	0.00%	535,879.52	0.00%	2.16%
应付手续费及佣金	1,023,763.63	0.00%	1,500,959.27	0.00%	-31.79%
应付职工薪酬	534,545,299.95	1.82%	416,560,567.84	1.37%	28.32%
应交税费	145,792,896.46	0.50%	148,336,872.28	0.49%	-1.71%
其他应付款	461,016,541.82	1.57%	567,095,938.97	1.86%	-18.71%
应付债券	0.00	0.00%	430,000,000.00	1.41%	-100.00%
长期借款		0.00%		0.00%	
预计负债	68,865,421.90	0.23%	52,363,956.76	0.17%	31.51%
递延所得税负债	18,398,329.89	0.06%	90,207,977.00	0.30%	-79.60%
资产总计	29,433,156,045.91	100.00%	30,512,689,595.67	100.00%	-3.54%

资产负债项目重大变动原因:

1、应收质押保证金:期末较期初增长59.28%，主要系本期客户质押业务增加，公司在交易所质押的仓单增加；

2、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：期末较期初增长696.22%，主要系本期并表理财产品增加，理财产品投资的期货浮盈较大；

3、应收账款：期末较期初下降41.17%，主要系子公司永安资本期末应收客户商品销售款较上期减少；

4、预付款项：期末较期初增长60.39%，主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，预付款项相应增加；

5、应收佣金：期末较期初下降41.29%，主要系资产管理业务应收款较上期减少；

6、其他应收款：期末较期初增长34.94%，主要系子公司永安新加坡存放在境外的期货保证金增加；

7、其他流动资产：期末较期初下降36.44%，主要系待抵扣增值税、买入返售金融资产期末较期初减少；

8、在建工程：期末较期初增长76.94%，主要系公司大楼建造投入增加；

9、递延所得税资产：期末较期初增长103.82%，主要系持有的理财产品期末公允价值低于成本，形成可抵扣暂时性差异增加；

10、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：期末较期初增长644.36%，主要系结构化主体其他投资者享有的份额增加。

11、应付票据及应付账款：期初较期末下降30.71%，主要系本期期末子公司应付供应商货款较上期减少；

12、预收款项：期末较期初增长70.17%，主要系永安资本等子公司业务规模扩大，预收的货款及衍生品交易保证金增加；

13、应付手续费及佣金：期末较期初下降31.79%，主要系本期应付劳务费较期末减少；

14、应付债券：期末较期初下降100.00%，主要系本期次级债券到期清偿；

15、预计负债：期末较期初增长31.51%，主要期末累计待执行合同亏损额较期初增加；

16、递延所得税负债：期末较期初下降79.60%，主要系本期期末可供出售金融资产公允价值较上期大幅下降。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例
	金额	占营业收入的比重	金额	占营业收入的比重	
一、营业收入	15,763,889,406.71	-	9,589,243,052.39	-	64.39%
手续费及佣金净收入	534,254,965.29	3.39%	593,347,524.35	6.19%	-9.96%
其中：经纪业务手续费收入	473,656,522.69	3.00%	528,451,063.95	5.51%	-10.44%
资产管理业务收入	10,183,394.38	0.07%	14,992,345.10	0.16%	-29.48%
投资咨询业务收入	6,291,242.47	0.04%	13,506,897.33	0.14%	-53.42%
代理销售金融产品收入	44,123,805.75	0.28%	36,397,217.97	0.38%	21.23%
其他手续费及佣金收入	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
利息净收入	569,688,435.51	3.61%	524,237,811.89	5.47%	8.67%
投资收益	921,167,244.16	5.84%	904,981,185.99	9.44%	1.79%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	153,509,885.56	0.97%	205,968,886.40	2.15%	-25.47%
公允价值变动收益	46,332,896.52	0.29%	43,153,642.03	0.45%	7.37%
汇兑收益	2,953,804.50	0.02%	-2,489,634.96	-0.03%	-
其他业务收入	13,684,164,075.39	86.81%	7,520,366,821.48	78.43%	81.96%
其中：风险管理业务收入	13,671,612,382.29	86.73%	7,509,893,265.03	78.32%	82.05%
资产处置收益	347,653.10	0.00%			
其他收益	4,980,332.24	0.03%	5,645,701.61	0.06%	-11.79%
二、营业成本	14,652,062,489.53	92.95%	8,363,998,572.14	87.22%	75.18%
提取期货风险准备金	21,395,264.59	0.14%	24,751,281.94	0.26%	-13.56%
税金及附加	5,566,520.89	0.04%	5,375,318.24	0.06%	3.56%
业务及管理费	875,955,401.11	5.56%	854,710,567.66	8.91%	2.49%
资产减值损失	270,021,886.07	1.71%	232,009,437.39	2.42%	16.38%

其他业务成本	13,479,123,416.87	85.51%	7,247,151,966.91	75.58%	85.99%
三、营业利润	1,111,826,917.18	7.05%	1,225,244,480.25	12.78%	-9.26%
营业外收入	24,367,583.02	0.15%	1,364,756.16	0.01%	1,685.49%
营业外支出	23,161,114.44	0.15%	79,502,664.16	0.83%	-70.87%
四、利润总额	1,113,033,385.76	7.06%	1,147,106,572.25	11.96%	-2.97%
五、净利润	872,197,337.15	5.53%	922,069,555.33	9.62%	-5.41%

项目重大变动原因:

- 1、投资咨询业务收入：本期较上期下降53.42%，主要系本期投资咨询业务受到基金销售等业务分流，业务量减少；
- 2、汇兑收益：本期为2,953,804.50元，较上期-2,489,634.96有所增加，主要受外汇汇率波动影响；
- 3、其他业务收入：本期较上期增长81.96%，主要系永安资本等子公司现货业务规模扩大；
- 4、其他业务成本：本期较上期增长85.99%，主要系永安资本等子公司现货业务规模扩大；
- 5、营业外收入：本期较上期增长1685.49%，主要系本期子公司永安资本、上海瑞萌收到2017年12月存放第三方仓库货物遭受火灾的橡胶理赔款，确认营业外收入合计约2,010万元；该受损事项公司已于2017年12月6日披露了《永安期货关于期货交割仓库发生火灾事故涉及子公司货物情况的公告》（公告编号：2017-064）；
- 6、营业外支出：本期较上期下降 70.87%，主要系子公司永安资本预计合同亏损发生额较上期大幅减少。

(2) 收入构成

公司主营业务收入包括手续费及佣金净收入、利息净收入、投资收益、公允价值变动收益、汇兑收益、其他业务收入、资产处置收益、其他收益等，其中手续费及佣金收入又分为经纪业务手续费收入（包括期货经纪手续费、期权经纪手续费和交易所返还减收手续费）、资产管理业务收入、投资咨询业务收入和基金销售业务收入（即代理销售金融产品收入）；其他业务收入主要为公司全资子公司永安资本的现货贸易业务收入。

报告期内，公司实现经纪业务手续费收入 473,267,701.94 元，同比下降 10.44%；资产管理业务收入 10,572,215.13 元，同比下降 29.48%；投资咨询业务收入 6,291,242.47 元，同比下降 53.42%；基金销售业务收入 44,123,805.75 元，同比增长 21.23%；利息净收入 569,688,435.51 元，同比增长 8.67%；投资收益 921,167,244.16 元，同比增长 1.79%；公允价值变动收益 46,332,896.52 元，同比增长 7.37%；汇兑收益 2,953,804.50 元，同比增加 5,443,439.46 元；其他业务收入 13,684,164,075.39

元，同比增长 81.96%；资产处置收益 347,653.10 元；其他收益 4,980,332.24 元，同比下降 11.79%。

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例
手续费收入	534,254,965.29	593,347,524.35	-9.96%
利息净收入	569,688,435.51	524,237,811.89	8.67%
其他业务收入	13,684,164,075.39	7,520,366,821.48	81.96%
投资收益	921,167,244.16	904,981,185.99	1.79%
公允价值变动收益	46,332,896.52	43,153,642.03	7.37%
汇兑收益	2,953,804.50	-2,489,634.96	-218.64%
资产处置收益	347,653.10		-
其他收益	4,980,332.24	5,645,701.61	-11.79%

1) 手续费收入

① 期货经纪业务的经营情况

项目		代理交易量（手）			代理交易金额（万元）		
交易所	品种	本期	上期	增减百分比	本期	上期	增减百分比
郑州商品交易所	苹果	2,767,703	20,020	13724.69%	26,675,261.82	160,024.48	16,569.49%
郑州商品交易所	棉花一号	3,804,862	1,666,606	128.30%	31,805,107.01	12,886,964.92	146.80%
郑州商品交易所	棉纱	42,549	6,781	527.47%	560,937.75	78,369.60	615.76%
郑州商品交易所	玻璃	2,000,257	2,765,177	-27.66%	5,588,068.26	7,520,462.47	-25.70%
郑州商品交易所	粳稻	603	5	11960.00%	3,673.18	33.13	10,988.51%
郑州商品交易所	晚籼稻	35,402	1	3,540,100.00%	202,684.29	5.80	3,493,252.05%
郑州商品交易所	甲醇 N	9,350,489	7,538,089	24.04%	26,478,351.41	20,152,172.20	31.39%
郑州商品交易所	菜籽油 N	1,474,303	1,181,529	24.78%	9,783,963.68	7,934,321.76	23.31%
郑州商品交易所	普麦	15	4	275.00%	181.62	50.12	262.37%
郑州商品交易所	早籼稻 N	2,040	13	15592.31%	10,498.57	70.53	14,785.67%
郑州商品交易所	菜籽粕	3,030,624	3,440,626	-11.92%	7,363,033.69	7,979,517.78	-7.73%
郑州商品交易所	油菜籽	18	2	800.00%	95.86	10.55	808.31%

							%
郑州商品交易所	硅铁	639,647	563,890	13.43%	2,105,264.70	1,933,675.48	8.87%
郑州商品交易所	锰硅	644,749	988,110	-34.75%	2,572,656.15	3,384,313.17	-23.98%
郑州商品交易所	白糖	2,400,585	2,511,084	-4.40%	12,577,409.63	16,239,612.78	-22.55%
郑州商品交易所	白糖期权	500,080	177,340	181.99%	33,779.62	16,342.72	106.70%
郑州商品交易所	PTA	13,501,467	8,901,873	51.67%	43,804,077.05	23,424,014.59	87.00%
郑州商品交易所	强麦 N	13,257	21,611	-38.66%	68,141.92	123,361.13	-44.76%
郑州商品交易所	新动力煤	2,543,739	1,985,447	28.12%	15,667,817.15	11,742,787.91	33.43%
大连商品交易所	黄大豆	943,999	1,085,612	-13.04%	3,451,790.56	4,220,186.73	-18.21%
大连商品交易所	豆二	333,801	984	33822.87%	1,140,553.27	3,252.47	34,967.30%
大连商品交易所	玉米	4,528,698	7,598,145	-40.40%	8,408,266.84	12,567,236.17	-33.09%
大连商品交易所	铁矿石	12,212,701	20,689,099	-40.97%	60,188,508.82	108,742,246.20	-44.65%
大连商品交易所	焦炭	4,370,516	2,946,073	48.35%	94,604,162.29	57,278,964.84	65.16%
大连商品交易所	聚乙烯	3,056,884	4,371,008	-30.06%	14,199,842.75	20,707,894.45	-31.43%
大连商品交易所	豆粕	15,534,254	9,340,426	66.31%	47,635,038.27	26,311,918.40	81.04%
大连商品交易所	豆粕期权	1,935,467	319,017	506.70%	137,829.39	20,425.56	574.79%
大连商品交易所	棕榈油	2,067,258	3,087,203	-33.04%	10,093,501.34	17,180,307.87	-41.25%
大连商品交易所	聚氯乙烯	3,251,877	2,403,442	35.30%	10,895,444.91	7,883,671.17	38.20%
大连商品交易所	豆油	2,750,836	2,966,182	-7.26%	15,774,266.68	18,356,875.23	-14.07%
大连商品交易所	胶合板	10	42	-76.19%	66.90	219.58	-69.53%
大连商品交易所	玉米淀粉	914,493	3,096,574	-70.47%	2,047,648.09	6,053,834.16	-66.18%
大连商品交易所	乙二醇	101,990		-	553,669.85		-

大连商品交易所	纤维板	2,192	51	4198.04%	9,280.67	220.78	4,103.58%
大连商品交易所	鸡蛋	949,077	1,852,591	-48.77%	3,713,689.32	7,059,170.17	-47.39%
大连商品交易所	焦煤	2,536,116	2,435,136	4.15%	19,351,694.34	17,923,261.43	7.97%
大连商品交易所	聚丙烯	4,408,934	4,509,671	-2.23%	20,484,041.85	19,284,376.96	6.22%
上海期货交易所	白银	1,458,254	1,925,536	-24.27%	8,048,898.64	11,631,992.76	-30.80%
上海期货交易所	铝	1,207,877	2,154,267	-43.93%	8,677,660.71	16,318,760.67	-46.82%
上海期货交易所	黄金	406,809	531,880	-23.51%	11,155,254.64	14,795,129.25	-24.60%
上海期货交易所	沥青	3,943,951	5,426,082	-27.31%	12,327,932.72	14,131,995.22	-12.77%
上海期货交易所	铜	1,894,440	1,936,644	-2.18%	48,223,234.15	47,797,403.97	0.89%
上海期货交易所	铜期权	15,233		-	8,256.07		-
上海期货交易所	燃料油	1,106,582	40	2,766,355.00%	3,382,059.06	853.98	395,934.93%
上海期货交易所	热轧卷板	6,030,183	7,173,839	-15.94%	22,827,697.91	26,494,364.53	-13.84%
上海期货交易所	镍	5,635,708	4,227,796	33.30%	58,770,093.47	36,989,561.21	58.88%
上海期货交易所	铅	354,267	337,966	4.82%	3,338,765.61	3,146,558.77	6.11%
上海期货交易所	螺纹	34,468,284	43,400,442	-20.58%	130,373,988.05	150,232,635.23	-13.22%
上海期货交易所	橡胶	2,633,597	4,109,431	-35.91%	31,397,152.80	63,666,670.28	-50.69%
上海期货交易所	锡	77,222	45,647	69.17%	1,141,819.38	660,357.45	72.91%
上海期货交易所	漂针浆	347,831		-	1,781,337.34		-
上海期货交易所	线材	6,594	-	-	25,058.99	-	-
上海期货交易所	锌	2,883,320	3,011,107	-4.24%	32,595,491.57	35,439,846.57	-8.03%
中国金融期货交易所	国债 10 年期	397,293	469,623	-15.40%	37,641,713.71	44,532,426.69	-15.47%
中国金融期货交易所	中证 500	198,671	184,546	7.65%	20,219,631.94	23,007,945.32	-12.12%

中国金融期货交易所	沪深 300	284,602	198,052	43.70%	29,701,307.32	21,683,501.93	36.98%
中国金融期货交易所	上证 50	144,638	140,241	3.14%	11,357,324.68	10,820,226.38	4.96%
中国金融期货交易所	国债 5 年期	88,647	171,802	-48.40%	8,621,644.48	16,764,373.35	-48.57%
中国金融期货交易所	国债 2 年期	2,723		-	542,458.84		-
上海国际能源交易中心	原油	339,434		-	16,252,368.71		-
合计	-	166,577,652	173,914,405	-4.22%	996,401,450.29	975,284,776.85	2.17%

② 明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
期货经纪手续费	166,793,726.93	1.06%	209,296,802.94	2.18%
交易所返还减收手续费	306,862,795.76	1.95%	319,154,261.01	3.33%
资产管理业务收入	10,183,394.38	0.07%	14,992,345.10	0.16%
投资咨询业务收入	6,291,242.47	0.04%	13,506,897.33	0.14%
代理销售金融产品收入	44,123,805.75	0.28%	36,397,217.97	0.38%
合计	534,254,965.29	3.39%	593,347,524.35	6.19%

③ 分行政区域营业部及手续费收入情况

单位：元

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额	占营业收入比例
杭州本部		405,140,480.37	2.57%
香港特别行政区[注]		40,087,502.93	0.25%
浙江省(不含杭州本部)	14	34,433,471.13	0.22%
辽宁省	3	7,751,869.55	0.05%
山东省	7	6,752,045.11	0.04%
北京市	1	6,157,751.60	0.04%
广东省	2	5,497,894.73	0.03%
上海市	1	5,270,181.37	0.03%
福建省	2	3,273,304.53	0.02%
河南省	1	2,659,104.89	0.02%
江苏省	2	2,634,251.40	0.02%
吉林省	1	2,630,775.63	0.02%
天津市	1	2,340,012.16	0.01%
重庆市	1	2,256,891.27	0.01%
河北省	2	1,979,034.02	0.01%
湖北省	1	1,757,746.53	0.01%

四川省	1	1,450,867.18	0.01%
湖南省	1	1,226,805.22	0.01%
江西省	1	954,975.67	0.01%
合计	42	534,254,965.29	3.38%

注：香港特别行政区营业部系指公司子公司新永安期货公司。

2) 利息净收入

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
利息收入	639,545,275.16	4.06%	615,381,251.86	6.42%
其中：境内期货保证金存货利息收入	585,437,094.25	3.71%	565,495,162.41	5.90%
境外利息收入	27,248,295.02	0.17%	22,000,595.32	0.23%
境内其他利息收入	26,859,885.89	0.17%	27,885,494.13	0.29%
利息支出	69,856,839.65	0.44%	91,143,439.97	0.95%
利息净收入	569,688,435.51	3.61%	524,237,811.89	5.47%

3) 其他业务收入

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
销售货物收入	13,671,612,382.29	86.73%	7,509,893,265.03	78.32%
租赁收入	228,963.13	0.00%	138,790.08	0.00%
其他	12,322,729.97	0.08%	10,334,766.37	0.11%
合计	13,684,164,075.39	86.81%	7,520,366,821.48	78.43%

4) 投资收益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
权益法核算的长期股权投资收益	153,509,885.56	0.97%	205,968,886.40	2.15%
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	348,394,784.51	2.21%	257,114,077.02	2.68%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产持有期间取得的投资收益	8,306,722.37	0.05%	174,363.32	0.00%
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的	500,535,941.85	3.18%	435,704,673.63	4.54%

金融资产/负债取得的投资收益				
处置可供出售金融资产取得的投资收益	-1,982,055.73	-0.01%	20,198,660.69	0.21%
扣除结构化主体其他投资者享有的损益	-87,598,034.40	-0.56%	-14,195,224.94	-0.15%
其他		0.00%	15,749.87	0.00%
合计	921,167,244.16	5.84%	904,981,185.99	9.44%

5) 公允价值变动收益
明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	46,332,896.52	0.29%	43,153,642.03	0.45%
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益[注]	64,690,410.51	0.41%	42,285,875.07	0.44%
合计	46,332,896.52	0.29%	43,153,642.03	0.45%

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。

6) 汇兑收益
明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
汇兑收益	2,953,804.50	0.02%	-2,489,634.96	-0.03%
合计	2,953,804.50	0.02%	-2,489,634.96	-0.03%

7) 资产处置收益
明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
非流动资产处置收益	347,653.10	0.00%		
合计	347,653.10	0.00%		

8) 其他收益
明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
----	--------	----------	--------	----------

财政补助	3,824,232.17	0.02%	4,089,641.74	0.04%
个税手续费返还	1,156,100.07	0.01%	984,360.81	0.01%
水利基金返还			571,699.06	0.01%
合计	4,980,332.24	0.03%	5,645,701.61	0.06%

收入构成变动的原因:

本期公司收入结构无重大变动，各项收入变动原因请参见本节“二、经营情况分析（三）财务分析 2. 营业情况分析（1）利润构成”之“项目重大变动原因”。

(3) 主要客户情况

1) 销售部分

单位：元

序号	客户名称	销售金额	收入占比	是否存在关联关系
1	客户 1	1,264,971,240.68	8.02%	否
2	客户 2	537,667,443.19	3.41%	否
3	客户 3	474,409,690.21	3.01%	否
4	客户 4	400,718,405.86	2.54%	否
5	客户 5	316,061,594.90	2.00%	否
	合计	2,993,828,374.84	18.98%	-

2) 经纪业务部分

单位：元

序号	客户名称	经纪金额	收入占比	是否存在关联关系
1	第一大	12,723,654.52	0.08%	否
2	第二大	5,848,086.11	0.04%	是
3	第三大	1,381,706.34	0.01%	是
4	第四大	1,211,156.02	0.01%	否
5	第五大	1,059,176.44	0.01%	否
	合计	22,223,779.43	0.15%	-

(4) 主要供应商情况

单位：元

序号	供应商名称	采购金额	年度采购占比	是否存在关联关系
1	供应商 1	1,081,549,468.00	7.28%	否
2	供应商 2	804,540,575.34	5.42%	否
3	供应商 3	366,080,203.00	2.46%	否
4	供应商 4	300,684,593.16	2.02%	否
5	供应商 5	269,771,266.78	1.82%	否
	合计	2,822,626,106.28	19.00%	-

3. 现金流量状况

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例
经营活动产生的现金流量净额	-1,091,342,393.69	-3,499,992,717.39	68.82%
投资活动产生的现金流量净额	52,236,579.19	27,566,638.32	-89.49%
筹资活动产生的现金流量净额	-39,435,516.46	-257,417,522.54	84.68%

现金流量分析：

1. 经营活动产生的现金流量净额：本期较上期增加约 24.09 亿元，主要系本期公司在交易所存取交易保证金的净出入金与上期相比，增加约 21.41 亿元；

2. 投资活动产生的现金流量净额：本期较上期增加约 0.25 亿元，主要系本期收到永安国富分红款。；

3. 筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期增加约 2.18 亿元，主要系本期结构化产品其他投资者投入资金增加；

4. 本期经营活动产生的现金流量净额比本期净利润金额少约 19.64 亿元，主要系公司客户权益的变动体现在现金流量中，而不体现在净利润中所致。

(四) 投资状况分析

1、 主要控股子公司、参股公司情况

永安资本为公司全资子公司，本期注册资本由 5 亿元人民币增加至 10 亿元人民币，2018 年营业收入 12,898,345,085.45 元，较 2017 年同期收入 6,860,479,820.84 元增长 88.01%；2018 年营业成本 13,171,038,334.13 元，较 2017 年同期营业成本 7,015,618,925.69 元增长 87.74%；2018 年净利润 145,140,682.43 元，较 2017 年同期净利润 171,709,644.98 元下降 15.47%；永安资本公司 2018 年度净利润占公司合并报表净利润的 16.64%。永安资本公司 2018 年度坚持服务实体经济，加强产业链上下游合作交流，促进产融结合，业务规模发展迅速，优势品种不断做强。

永安国富为公司联营企业，成立于 2015 年 1 月，注册资本 8,000 万元人民币。2018 年营业收入 1,281,525,686.40 元，较 2017 年营业收入 1,142,570,503.95 元增长 12.16%；2018 年净利润 466,927,159.57 元，较 2017 年净利润 485,456,427.15 元下降-3.82%。2018 年度，公司确认投资收益 150,359,762.64 元，永安国富向公司发放现金股利 132,000,000.00 元。永安国富积极强化后台建设，提升服务品质，开辟投资理财新思路；本期成立全资子公司浙江永安国富实业有限公司，其业务范围涉及大宗商品贸易、实业投资、投资管理等。

2、 委托理财及衍生品投资情况

无

3、 主要分公司、营业部情况

截至本期末，本公司下设北京、上海、广州、山东、杭州 5 家分公司，温州、福州、宁波、台州、嘉兴、绍兴、义乌、沈阳、余姚、金华、无锡、萧山、济南、青岛、长沙、石家庄、瑞安、南昌、鞍山、重庆、淄博、长春、武汉、舟山、深圳、杭州潮王路、潍坊、天津、成都、诸暨、厦门、郑州、大连、烟台、日照、南京、唐山 37 家营业部。其中，南京营业部、唐山营业部系新设。

4、 重大的资产处置、置换、剥离情况

无

5、 合规情况

本期公司不存在表外负债、账外资产和账外经营的情况，遵守《期货公司管理办法》的各项规定，合法经营。公司在期货行业分类监管获最高 AA 评级，各项风险监管指标持续符合监管要求。

(五) 研发情况

√适用 □不适用

研发支出情况：

项目	本期金额/比例	上期金额/比例
研发支出金额	0.00	0.00
研发支出占营业收入的比例	0.00%	0.00%
研发支出中资本化的比例	-	-

研发人员情况：

教育程度	期初人数	期末人数
博士	0	0
硕士	0	0
本科以下	0	0
研发人员总计	0	0
研发人员占员工总量的比例	0%	0%

专利情况：

项目	本期数量	上期数量
公司拥有的专利数量	0	0
公司拥有的发明专利数量	0	0

研发项目情况：

无

(六) 审计情况

1. 非标准审计意见说明

适用 不适用

2. 关键审计事项说明:

适用 不适用

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. 事项描述

永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询业务收入、基金代销业务收入及资产管理业务收入。如附注三（二十六）所述，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；投资咨询业务、基金代销业务和资产管理业务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凭据时确认。

由于手续费收入是公司关键业绩指标之一，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. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

（1）了解与手续费收入确认相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

（2）针对处理与手续费收入相关交易的关键信息技术系统，我们利用本所内部信息技术专家的工作，评价和测试该系统关于信息系统应用的关键内部控制的设计和运行有效性。

（3）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，并将财务账面记录的手续费收入与交易运作总部业务系统中记录的数据进行核对。

（4）对于投资咨询业务和基金代销业务收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同，核实相关收入确认与合同条款是否一致，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。

（5）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) 结构化主体是否纳入合并范围

1. 事项描述

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。永安期货公司管理层（以下简称管理层）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。

由于相关结构化主体是否纳入合并范围可能对财务报表产生重大影响，且涉及重大管理层判断，因此，我们将结构化主体是否纳入合并范围确定为关键审计事项。

2. 审计应对

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合并财务报表范围的评估过程。
- （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。

（七） 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

√适用 □不适用

1. 本公司参照《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 年度财务报表，此项会计政策变更采用追溯调整法。2017 年度财务报表受重要影响的报表项目和金额如下：

原列报报表项目及金额		新列报报表项目及金额	
应收账款	1,107,368.64	应收票据及 应收账款	1,107,368.64
应收利息	13,398,157.39	其他应收款	69,280,357.16
其他应收款	55,882,199.77		
应付账款	24,274,821.46	应付票据及 应付账款	24,274,821.46
应付利息	9,453,253.06	其他应付款	567,095,938.97
应付股利	196,500,000.00		
其他应付款	361,142,685.91		

其他收益	4,661,340.80	其他收益	5,645,701.61
营业外收入	2,349,116.97	营业外收入	1,364,756.16

2. 财政部于 2017 年度颁布了《企业会计准则解释第 9 号——关于权益法下投资净损失的会计处理》《企业会计准则解释第 10 号——关于以使用固定资产产生的收入为基础的折旧方法》《企业会计准则解释第 11 号——关于以使用无形资产产生的收入为基础的摊销方法》及《企业会计准则解释第 12 号——关于关键管理人员服务的提供方与接受方是否为关联方》。公司自 2018 年 1 月 1 日起执行上述企业会计准则解释，执行上述解释对公司期初财务数据无影响。

(八) 合并报表范围的变化情况

√适用 □不适用

(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	设立	2018 年 6 月	2,000 万港币	100.00%
新永安证券	设立	2018 年 6 月	2,000 万港币	100.00%
永安国际金融	设立	2018 年 6 月	150 万新加坡币	100.00%

2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

本公司管理的永屹 1 号、永进 1 号、永利 2 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，故将前述资管计划自满足上述条件之日起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. 本期不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

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)、黑色多头一号、黑色空头一号、有色多头一号、有色空头一号因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

(三) 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	杭州	杭州	商业	100.00		设立
中邦实业	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下 企业合并
上海瑞萌	上海	上海	商业		100.00	设立
永安商贸	香港	香港	商业		100.00	设立
永安新加坡	新加坡	新加坡	商业		100.00	设立
新永安控股	香港	香港	金融业	100.00		设立
新永安期货	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安实业	香港	香港	商业		100.00	设立
新永安资管	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安证券	香港	香港	金融业		100.00	设立
永安国际金融	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，本公司管理的七禾言起 2 号、永利 1 号、永屹 1 号、永进 1 号、永利 2 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。

(四) 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	杭州	杭州	金融业	33.00		权益法核算
玉皇山南	杭州	杭州	金融业		19.00	权益法核算
鞍钢商贸	杭州	杭州	商业		49.00	权益法核算

(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			期初数/上年同期数	
	永安国富	玉皇山南	鞍钢商贸[注]	永安国富	玉皇山南
流动资产	870,041,901.02	92,502,938.30	111,255,106.09	1,123,526,597.69	111,804,528.224
非流动资产	458,445,989.52	25,489,416.85	26,096.34	174,926,530.33	32,912,542.52
资产合计	1,328,487,890.54	117,992,355.15	111,281,202.43	1,298,453,128.02	144,717,070.74
流动负债	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71	435,522,635.00	58,087,443.37
非流动负债				16,555,818.77	
负债合计	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71	452,078,453.77	58,087,443.37
少数股东权益		16,468,750.59			7,594,681.59
归属于母公司所有者权益	867,753,06.73	73,865,950.62	51,125,394.72	846,374,674.25	79,034,945.78
按持股比例计算的净资产份额	286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41	279,303,642.50	15,016,639.70
对联营企业权益投资的账面价值	286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41	279,303,642.50	15,016,639.70
营业收入	1,281,525,66.40	2,046,677.87	486,385,002.58	1,142,570,503.95	957,651.25
净利润	455,635,644.35	-7,131,923.03	1,125,394.72	485,456,427.15	-5,732,220.72
其他综合收益	-34,257,111.87			13,159,562.58	
综合收益总额	421,378,532.48	-7,131,923.03	1,125,394.72	498,615,989.73	-5,732,220.72
本期收到的来自联营企业的股利	132,000,000.00			88,353,968.50	

注：鞍钢商贸成立于2018年2月5日，故未列示期初/上年同期可比数。

(五) 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	21,696,090.01	4,013,366.17
永利1号	517,093,854.38	81,453,315.14
永屹1号	7,776,620.72	688,420.13

永进 1 号	48,033,933.63	338,803.96
永利 2 号	646,462,868.33	13,790,229.26
小计	1,241,063,367.07	100,284,134.66

(九) 企业社会责任

2018 年是改革开放四十周年，是国家脱贫攻坚战略的关键之年，也是中国经济从高速发展向高质量发展的转型之年，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三年行动的指导意见》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，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。2018 年，公司先后与河北省大名县、吉林省龙井市、黑龙江海伦市、新疆巴楚县等 10 个贫困县签订扶贫帮扶协议，开展交易所“保险+期货”服务“三农”项目 8 个，承担保费超过 2000 万元。公司将坚持以“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”为要求，完善扶贫工作保障机制、实施系列扶贫举措，充分发挥期货行业风险管理专长，切实将扶贫工作与服务实体经济发展有效结合，形成特色扶贫，探索扶贫工作长效机制。

三、 持续经营评价

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。

报告期内，公司实现营业收入 15,763,889,406.71 元，同比增长 64.39%；利润总额 1,113,033,385.76 元，同比下降 2.97%；净利润 872,197,337.15 元，同比下降 5.41%，公司盈利水平处于行业领先地位，各项风险监管指标均符合监管部门要求，内部治理结构合理、稳定，具备良好的持续经营能力。

四、 未来展望

√适用 □不适用

(一) 行业发展趋势

近年来，期货业作为现代金融业的重要组成部分，行业规模稳步增长，服务实体经济的能力不断增强，合规风控能力显著提升，业务范围从期货经纪业务，向资产管理、风险管理、投资咨询等多领域拓展，期货上市品种进一步丰富，衍生品市场体系日益完善，遵循市场化法制化国际化的方向，推

动期货经营机构实施差异化、特色化、专业化发展。目前，作为中国期货市场最为重要的法律《期货法》的立法进程加快推进，《期货法》的出台将保障期货市场在法制化的道路上迈上新台阶。期货品种的上市步伐逐步加快，市场工具不断丰富，对外开放的大门越开越大，期货市场的定价能力和国际影响力持续提升。在支持服务实体经济方面，经过多年的探索和实践，期货风险管理子公司作为期货公司从事风险管理业务的平台服务供给侧结构性改革、推进“一带一路”国家战略、促进实体企业转型升级发挥了至关重要的作用。在精准扶贫、服务“三农”方面，创新出了“保险+期货”新模式，把扶贫助农做精、做细、做实。而风险管理业务、财富管理业务随着我国经济的发展发展潜力和空间巨大，期货公司凭借自身专业能力和资源，综合实力和核心竞争力持续提高，期货市场在防范化解金融风险的能力上正不断加强。未来，我国金融市场将进一步扩大双向开放，随着期货品种、机构、投资者国际化水平加速推进，我国经济配置全球资源的能力将大幅提升。整体而言，期货市场在服务实体经济优化升级过程中，在服务金融市场高质量发展中大有可为。

(二) 公司发展战略

公司立足于大资本市场，以服务实体经济为宗旨，深化供给侧结构性改革、融入“一带一路”战略，抓住加快对外开放的历史性机遇，以永安文化为精神引领，构筑风险管理和财富管理两大核心竞争力，以专业的产业服务能力、投资管理能力、策略研究能力、金融衍生工具综合运用能力为支撑，全面推进业务创新，打造期现结合、混业经纪、私募资管、场外交易、跨境服务等平台，促进期货市场功能发挥。同时适时开展重大战略重组，优化治理结构和激励机制，实现向具有国际竞争力的衍生品综合金融集团迈进。

(三) 经营计划或目标

公司将秉承持续创新的理念，以金融市场风险管理和财富管理为突破口，致力于为实体经济转型升级、国内外投资提供全球资产配置的优质服务，朝着国内第一，国际一流的衍生品综合服务商不断努力。

(四) 不确定性因素

参见“第四节管理层讨论与分析”之“五、风险因素”。

五、 风险因素

(一) 持续到本年度的风险因素

1. 期货、期权经纪业务风险

经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，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，手续费率呈逐渐下降态势，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。公司的客户保证金和自有资金规模保持稳定，利率水平的变化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降，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故障，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善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期货法律法规的建设处于完善阶段，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**永安期货**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。

(二) 报告期内新增的风险因素

无

第五节 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	五.二.(一)
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	五.二.(二)
是否存在偶发性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(三)
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项或者本年度发生的企业合并事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(四)
是否存在股权激励事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股份回购事项	<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	五.二.(五)
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	五.二.(六)
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（如事项存在选择以下表格填写）

（一） 重大诉讼、仲裁事项：

1、 报告期内发生的诉讼、仲裁事项

报告期内发生的诉讼、仲裁事项涉及的累计金额是否占净资产 10%及以上

是 否

单位：元

性质	累计金额		合计	占期末净资产比例%
	作为原告/申请人	作为被告/被申请人		
诉讼或仲裁	0	0	0	0%

2、 以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

3、 以临时公告形式披露且在报告期内结案的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

（二） 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	60,977,454.03
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托, 委托或	399,000,000.00	25,905,468.55

者受托销售		
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	4,150,000,000.00	1,578,792,733.37
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	1,103,000,000.00	22,292,343.97
6. 其他		
总计	8,652,000,000.00	1,687,967,999.92

（三） 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	是否履行必要决策程序	临时报告披露时间	临时报告编号
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	已事前及时履行	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384,507,230.00元。

（四） 经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项或者本年度发生的企业合并事项

1.对永安资本增资

公司第二届董事会第十五次会议、2018年第二次临时股东大会审议通过《关于对永安资本管理有限公司增资的议案》，增资基本情况如下：

投资标的名称：浙江永安资本管理有限公司

投资标的所在地：中国杭州

投资标的类别：股权

股权类资产信息说明：永安资本是公司全资的以开展风险管理服务业务为主的风险管理子公司。

永安资本成立于 2013 年 5 月 8 日，注册资本人民币 50,000 万元，法定代表人葛国栋，注册地址杭州市西湖区教工路 199 号 5 楼 511 室，经营范围：不带储存经营其他危险化学品(凭许可证经营)，批发兼零售：预包装食品兼散装食品(《食品流通许可证》)。实业投资,投资管理,商务信息咨询,经营进出口业务,金属材料、建材、化工产品及其原料(不含危险品及易制毒化学品)、橡胶及制品、轻纺产品、纸张、纸浆、初级食用农产品、五金交电、日用百货、机械产品、计算机及配件、饲料、燃料油(不含成品油及危化品)、棉花、玻璃、煤炭(无储存)、焦炭、沥青、贵金属、木材、汽车配件、矿产品(不含专控)、有色金属的销售(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)。

本次增资前，永安资本的注册资本为人民币 5 亿元，公司持股比例为 100%。本次增资，公司认缴出资人民币 5 亿元。增资后，永安资本的注册资本为人民币 10 亿元，公司持股比例仍为 100%。

永安资本成立五年多来，以服务实体产业为宗旨，业务规模持续扩大，经营业绩屡创新高，市场影响力持续提升，本次对永安资本的增资是围绕公司战略发展规划，综合考量业务规模增长的需要，进一步增强子公司的资本实力和综合竞争力，为公司保持行业领先地位奠定基础。

公司已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《临 2018-027 永安期货股份有限公司对外投资公告》和《临 2018-037 永安期货股份有限公司关于全资子公司完成工商变更登记并换发营业执照的公告》。

(五) 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：

1、关于避免同业竞争的承诺

2015 年 10 月，公司挂牌时的控股股东财通证券，实际控制人浙江省财政厅控制的省财开、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

2015 年 10 月，公司挂牌时的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。

除此上述承诺之外，2015年12月2日，财通证券与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，协议有效期至不早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，协议有效期至不早于财通证券上市后三年的时间。2019年4月22日，财通证券与浙江产业基金续签了前述《关于永安期货股份有限公司的一致行动人协议》，有效期至2020年10月23日。该承诺正在履行中。

(六) 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	268,992,765.61	0.91%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	质押	47,151,792.67	0.16%	作为远期结售汇保证金、信用证保证金、保函保证金或借款质押保证金等
总计	-	316,144,558.28	1.07%	-

第六节 股本变动及股东情况

一、普通股股本情况

(一) 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					
	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					
	董事、监事、高管					
	核心员工					
总股本		1,310,000,000	-	0	1,310,000,000	-
普通股股东人数		201				

注：截至 2018 年 12 月 31 日，公司股东浙江省协作大厦有限公司将其持有本公司股份进行了质押，质押股份数 51,600,000 股，占公司总股本 3.94%；公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有本公司股份进行了质押，质押股份数 24,850,000 股，占公司总股本 1.90%。

(二) 普通股股东情况

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	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727

	资有限公司						
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	-9,182,000	6,142,000	0.47%	0	6,142,000
8	浙江省经协集团有限公司	5,055,000	-257,000	4,798,000	0.37%	0	4,798,000
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
	合计	1,285,828,969	-6,046,000	1,279,782,969	97.71%	292,898,550	986,884,419

以上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.省金控持有本公司第一大股东财通证券 32.25%股权，同时省金控直接和间接合计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第一大股东财通证券 2.03%股权，同时持有本公司股东经建投 100%股权。

二、 优先股股本基本情况

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

公司无控股股东。

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 100%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。

第七节 融资及利润分配情况

一、最近两个会计年度内普通股股票发行情况

适用 不适用

二、存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

三、债券融资情况

适用 不适用

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	5.4%	2015.08.17- 2018.08.17	否
合计	-	-	600,000,000.00	-	-	-

债券违约情况

适用 不适用

公开发行债券的特殊披露要求

适用 不适用

四、可转换债券情况

适用 不适用

五、间接融资情况

适用 不适用

违约情况

适用 不适用

六、权益分派情况

(一) 报告期内的利润分配与公积金转增股本情况

适用 不适用

单位：元/股

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12月30日	1.20	0	0
合计	1.20	0	0

报告期内未执行完毕的利润分配与公积金转增股本的情况：

适用 不适用

2018年半年度权益分派方案获2018年12月30日召开的股东大会审议通过，本次权益分派权益

登记日为 2019 年 2 月 26 日，除权除息日为 2019 年 2 月 27 日。

(二) 权益分派预案

适用 不适用

未提出利润分配预案的说明

适用 不适用

公司在 2018 年中期已进行了每 10 股分 1.2 元的利润分配，考虑对子公司增资及扩大业务规模等需要，2018 年度拟不进行利润分配。

第八节 董事、监事、高级管理人员及员工情况

一、 董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	学历	任期	是否在公司 领取薪酬	年度薪酬
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	295.63 万元
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	171.41 万元
毛贵明	职工监事	男	1977-09-28	本科	2016.01-2019.01	是	54.82 万元

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	216.63 万元
金吉来	副总经理	男	1961-10- 14	本科	2016.01-2019.01	是	192.63 万元
石春生	副总经理	男	1965-04- 16	本科	2016.01-2019.01	是	192.63 万元
陈敏	首席风险官	女	1976-04- 25	本科	2016.01-2019.01	是	175.92 万元
董事会人数:							11
监事会人数:							6
高级管理人员人数:							5

注：1.公司第二届董事会、监事会及高级管理人员的任期于 2019 年 1 月 25 日届满。鉴于新一届董事会董事候选人、监事会监事候选人的提名工作尚未完成，为保持董事会、监事会工作连续性及稳定性，公司董事会、监事会将延期换届，同时高级管理人员任期亦相应顺延。公司已于 2019 年 4 月 4 日披露《永安期货股份有限公司关于董事会、监事会延期换届选举的公告》（公告编号：临 2019-013）。

2.独立董事朱国华、汪炜津贴分别为 15 万元，独立董事李义超、黄平津贴分别为 10 万元。

董事、监事、高级管理人员相互间关系及与实际控制人间关系：

<p>董事长阮琪，现任财通证券股份有限公司董事总经理。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

(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	-	0	0	0	0%	0
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

报告期内董事会秘书变动情况及任职资格的说明

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	92	95
市场业务人员	372	396
研究人员	89	73
信息技术人员	81	89
财务人员	68	67
合规管理及风控人员	78	79
其他职能人员	211	242
员工总计	991	1,041

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	3	6
硕士	237	256
本科	636	673
专科	93	90
专科以下	22	16
员工总计	991	1,041

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，公司在职员工总数 1,041 人，较期初增长 50 人，增长主要体现在市场开发及其他职能领域，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发展需要，拟制年度招聘计划，通过“黄埔联盟”在校大学生实

习培育、“新动力”应届大学生招聘、精英专才海内外招聘等方式，推广优秀雇主品牌、拓展招聘渠道，广泛甄优秀人才，为公司战略发展提供人才支撑。

报告期内，公司围绕战略规划及经营目标，建立四级人才培养及学习体系，分层分类组织新员工、产业经理、理财师、国际业务、期权种子、新任干部等人才队伍培训；启动“永动成长”后备干部人才梯队建设项目；组织产业经理、分析师、技术工程、内训师等职业技术等级认证，完善员工职业发展体系，牵引员工不断提高专业能力；上线“永安大讲堂”E-learning学习平台，提高培训效率、扩大培训覆盖面、沉淀优秀经验及知识。

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，梳理岗位价值评估模型、员工定岗定薪、调薪等管理制度，实现薪酬的内部公平、公正；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

适用 不适用

第九节 行业信息

是否自愿披露

是 否

第十节 公司治理及内部控制

事项	是或否
年度内是否建立新的公司治理制度	√是 □否
董事会是否设置专门委员会	√是 □否
董事会是否设置独立董事	√是 □否
投资机构是否派驻董事	□是 √否
监事会对本年监督事项是否存在异议	□是 √否
管理层是否引入职业经理人	□是 √否
会计核算体系、财务管理、风险控制及其他重大内部管理制度本年是否发现重大缺陷	□是 √否
是否建立年度报告重大差错责任追究制度	√是 □否

一、 公司治理

(一) 制度与评估

1、 公司治理基本状况

公司严格按照《公司法》《期货公司监督管理办法》《非上市公众公司监督管理办法》《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》等有关法律法规的要求，不断完善公司法人治理结构、建立现代企业制度、规范公司运作。2018 年度，公司新制定了《董事长联席会议制度》，目前已制定的内部规则制度包括《公司章程》《股东大会会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》《关联交易决策制度》《对外投资管理制度》《投资者关系管理制度》《信息披露管理制度》《防止大股东及关联方占用公司资金管理制度》《利润分配管理制度》《承诺管理制度》《下属子公司对外担保管理制度》《募集资金管理办法》和《年报信息披露重大差错责任追究制度》等。

公司已建立了规范的法人治理结构、合理的内部控制体系，现有治理机制能够提高公司的治理水平，公司内部控制制度能够适应公司现行管理的要求，预防公司运营过程中的经营风险，提高公司的经营效率、实现经营目标。

报告期内，公司股东大会、董事会、监事会的召集、召开、表决程序均符合有关法律、法规的要求，且严格按照相关法律法规忠实履行各自的权利和义务。公司重大经营决策、投资决策及财务决策均按照《公司章程》及有关内控制度规定的控制程序和规则进行。公司将密切关注行业发展动态及监管机构的政策走向，不断调整与优化公司内部控制体系，保障公司稳健持续发展。

2、 公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

公司治理机制完善，严格按照《公司法》《证券法》等法律法规及以及全国中小企业股份转让系统制定的相关业务规则的要求规范运作，信息披露准确、真实、完整、及时，努力寻求股东权益的最大

化，切实维护所有股东的利益。

报告期内，公司根据公司章程及股东大会、董事会、监事会“三会”议事规则的要求定期召开“三会”会议，公司董事会、监事会的人数和人员构成符合法律、法规规定，公司股东、董事、监事均能按照要求出席参加相关会议，并履行相关权利义务，确保每次会议程序合法，内容有效。现有的治理机制保证了所有股东充分享有知情权、参与权、质询权和表决权等权利。

3、公司重大决策是否履行规定程序的评估意见

公司 2018 年度重要的人事变动、对外投资、融资、关联交易、担保等重大事项，均严格按照相关法律法规、《公司章程》及公司其他相关内控制度的规定履行了相应的决策程序。

报告期内，公司治理机构成员均依法运作，能够切实履行应尽的职责和义务，涉及关联交易事项，严格执行关联方回避制度，治理机制健全规范，决策程序完整有效，信息披露及时完整。

4、公司章程的修改情况

(1) 2018 年 3 月 16 日，公司 2018 年第一次临时股东大会审议通过《关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案》的议案，对公司章程中第四条做出修订：公司原注册地址为“杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 16-17 层、2603 室、2702 室”，变更为“杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10-11 层、16-17 层”。

(2) 2018 年 5 月 14 日，公司 2017 年年度股东大会审议通过关于修订《关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案》的议案。对公司章程中第四条做出修订：公司原注册地址为“杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10-11 层、16-17 层”，变更为“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) 三会运作情况

1、三会召开情况

会议类型	报告期内会议召开的次数	经审议的重大事项（简要描述）
董事会	7	1. 2018 年 2 月 26 日，公司召开第二届董事会第十二次会议，审议通过关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于公司投资永安国富私募基金的议案、关于召开 2018 年第一次临时股东大会的议案； 2. 2018 年 4 月 12 日，公司召开第二届董事会第十三次会议，审议通过 2017 年工作总结和 2018 年工作计划（总经理工作报告）、2017 年

		<p>董事会工作报告、首席风险官 2017 年度工作报告、2017 年年度报告及摘要、2017 年财务决算报告和 2018 年财务预算报告、2017 年资本性支出预算执行情况报告与 2018 年资本性支出预算计划、关于确认公司 2017 年关联交易并预计公司 2018 年关联交易的议案、2017 年度利润分配方案、2017 年下半年风险监管指标情况报告、2017 年度经营层薪酬考核报告与 2018 年度经营层薪酬考核方案、关于相关经营管理事项授权的议案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于续聘会计师事务所的议案、2017 年扶贫工作总结和 2018 年扶贫工作计划、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于会计政策变更的议案、关于召开公司 2017 年度股东大会的议案；</p> <p>3. 2018 年 4 月 26 日，公司召开第二届董事会第十四次会议，审议通过 2017 年第一季度报告；</p> <p>4. 2018 年 8 月 1 日，公司召开第二届董事会第十五次会议，审议通过关于对浙江永安资本管理有限公司增资的议案、关于召开 2018 年第二次临时股东大会的议案；</p> <p>5. 2018 年 8 月 17 日，公司召开第二届董事会第十六次会议，审议通过 2018 年年上半年工作总结及下半年工作计划、2018 年半年度报告、2018 年上半年度财务执行情况报告、2018 年上半年风险监管指标情况报告、关于制定《董事长联席会议制度》的议案、关于会计政策变更的议案、关于召开公司 2018 年第三次临时股东大会的议案；</p> <p>6. 2018 年 10 月 29 日，公司召开第二届董事会第十七次会议，审议通过 2018 年第三季度报告；</p> <p>7. 2018 年 12 月 19 日，公司召开第二届董事会第十八次会议，审议通过 2018 年半年度利润分配的议案、关于豁免股东大会通知期限的议案、关于召开公司 2018 年第四次临时股东大会的议案。</p>
监事会	6	<p>1. 2018 年 2 月 26 日，公司召开第二届监事会第九次会议，审议通过关于公司投资永安国富私募基金的议案；</p> <p>2. 2018 年 4 月 12 日，公司召开第二届监事会第十次会议，审议通过 2017 年监事会工作报</p>

		<p>告、首席风险官 2017 年度工作报告、2017 年年度报告及摘要、2017 年财务决算报告和 2018 年财务预算报告、2017 年资本性支出预算执行情况报告与 2018 年资本性支出预算计划、关于确认公司 2017 年关联交易并预计公司 2018 年关联交易的议案、2017 年度利润分配方案、2017 年下半年风险监管指标情况报告、2017 年度经营层薪酬考核报告与 2018 年度经营层薪酬考核方案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于会计政策变更的议案；</p> <p>3. 2018 年 4 月 26 日，公司召开第二届监事会第十一次会议，审议通过 2018 年第一季度报告；</p> <p>4. 2018 年 8 月 17 日，公司召开第二届监事会第十二次会议，审议通过 2018 年半年度报告、2018 年上半年财务执行情况报告、2018 年上半年风险监管指标情况报告、关于会计政策变更的议案；</p> <p>5. 2018 年 10 月 29 日，公司召开第二届监事会第十三次会议，审议通过 2018 年第三季度报告；</p> <p>6. 2018 年 12 月 19 日，公司召开第二届监事会第十四次会议，审议通过 2018 年半年度利润分配的议案、关于豁免股东大会通知期限的议案。</p>
<p>股东大会</p>	<p>5</p>	<p>1. 2018 年 3 月 26 日，公司召开 2018 年第一次临时股东大会，审议通过关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于投资永安国富私募基金的议案；</p> <p>2. 2018 年 5 月 14 日，公司召开 2017 年年度股东大会，审议通过 2017 年董事会工作报告、2017 年监事会工作报告、2017 年年度报告及摘要、2017 年财务决算报告和 2018 年财务预算报告、2017 年资本性支出预算执行情况报告与 2018 年资本性支出预算计划、关于确认公司 2017 年关联交易并预计公司 2018 年度关联交易的议案、2017 年度利润分配方案、2017 年下半年风险监管指标情况报告、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于续聘会计师事务所的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案；</p> <p>3. 2018 年 8 月 17 日，公司召开 2018 年第二次临时股东大会，审议通过关于对永安资本管</p>

		<p>理有限公司增资的议案；</p> <p>4. 2018年9月6日，公司召开2018年第三次公式股东大会，审议通过2018年上半年风险监管指标情况报告；</p> <p>5. 2018年12月30日，公司召开2018年度第四次临时股东大会，审议通过2018年半年度利润分配的议案、关于豁免股东大会通知期限的议案。</p>
--	--	--

2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见

报告期内公司共召开7次董事会、6次监事会、5次股东大会，“三会”的召集、提案审议、通知时间、召开程序、授权委托、表决和决议等运作程序，符合《公司法》及有关法律法规和《公司章程》的相关规定，公司董事、监事及高级管理人员符合《公司法》等法律法规的任职要求，能够按照《公司章程》、三会议事规则等治理制度勤勉、诚信地履行职责和义务。

(三) 公司治理改进情况

公司不断完善公司治理结构，报告期内，公司修订了《公司章程》，建立了《董事长联席会议制度》，确保董事长在董事会闭会期间审慎、勤勉地履行各项法定职责，加强信息交流与沟通。在行情波动加大、企业信用风险陡增的环境下，董事会加强对公司各业务板块的运行关注，研究了公司《全面风险排查阶段性报告》，听取了《永安期货反洗钱分类评级情况的通报》，有效夯实基础稽核工作，防范化解金融风险，确保实现公司可持续健康发展。

报告期内，公司股东大会、董事会、监事会和管理层均严格按照《公司法》、《公司章程》等法律、法规和规范性文件的要求，履行各自的权利和义务。公司重大生产经营决策、投资决策及财务决策均按照《公司章程》及有关内控制度规定的程序和规则进行。截至报告期末，上述机构和人员依法运作，未出现重大违法违规情况。公司将根据经营发展需要，按照协调运转、有效制衡的要求，进一步梳理公司决策层、经营层、监督层“各司其职、各负其责、相互制衡、协调发展”的现代公司法人规范治理要求，完善落实公司三会议事规则，加强董事、监事、管理层人员在公司治理方面的能力培训，不断提升公司的治理水平。

报告期内，公司管理层未引入职业经理人。

(四) 投资者关系管理情况

公司重视与投资者关系管理，在公司章程中“投资者关系管理”作为单独章节，详尽规定了公司

与投资者沟通的主要内容、公司与投资者沟通的基本原则、公司与投资者的沟通方式等。公司按照公平、公开、公正原则，平等对待全体投资者，通过公告、公司网站等多种形式及时披露公司的发展战略、重大事项、关联交易等信息，保障所有投资者的合法权益。公司制定了《投资者关系管理制度》，进一步加强管理公司与投资者以及潜在投资者之间的信息沟通，加深投资者对公司的了解和认同，建立与投资者之间长期、稳定的良性合作关系，促进公司诚信自律、规范运作，提升公司投资价值。

公司董事长是投资者关系管理的第一责任人，董事会秘书是日常业务负责人，全面负责公司投资者关系管理工作，在深入了解公司运作和管理、经营状况、发展战略等情况下，负责策划、安排和组织各类投资者关系管理活动。董事会办公室是投资者关系工作的归口管理部门和日常工作机构，在董事会秘书的领导下开展信息披露工作，并负责处理投资者关系管理的日常事务及组织对公司高级管理人员及相关人员就投资者关系管理进行全面和系统的培训等工作。公司与投资者沟通的方式包括但不限于：公告（包括定期报告和临时公告）；股东大会；公司网站；机构调研；业绩发布与路演活动、分析师会议；一对一沟通；现场参观；电话咨询、传真与电子信箱；媒体宣传与访谈；邮寄资料；广告或其他宣传资料等。

(五) 董事会下设专门委员会在本年度内履行职责时所提出的重要意见和建议

√适用 □不适用

公司董事会下设 4 个专门委员会：战略发展委员会、审计委员会、风险控制委员会、提名与薪酬考核委员会。报告期内，公司各委员会各司其职，为公司中远期战略发展规划、经营风险管理等事项提出了建议，为公司治理结构不断完善、长期发展规划和可持续发展起到了积极的作用。

(六) 独立董事履行职责情况

√适用 □不适用

姓名	本年应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数
朱国华	7	7	0	0
汪炜	7	7	0	0
李义超	7	7	0	0
黄平	7	7	0	0

独立董事的意见：

报告期内，独立董事严格按照相关法律法规、《公司章程》和《独立董事工作制度》的要求，认真履行职责，积极了解公司经营管理、公司治理、内部控制等情况，切实维护公司整体利益。独立董事

认为公司董事会和股东大会的召集、召开符合法定程序，重大经营事项均履行了相关审批程序，合法有效，对报告期内的事项无异议。

二、 内部控制

(一) 监事会就年度内监督事项的意见

监事会在报告期内的监督活动中未发现公司存在重大风险事项。公司依据国家有关法律、法规和公司章程的规定，已建立较完善的内部控制制度，决策程序符合相关规定。公司董事、总经理及其他高级管理人员在履行职责时，不存在违反法律、法规和《公司章程》等规定或损害股东利益的行为。监事会对报告期内的监督事项无异议。

(二) 公司保持独立性、自主经营能力的说明

公司运营独立，与实际控制人及其控制的其他企业在业务、人员、资产、机构、财务等方面已分开。

1. 业务独立

本公司根据《营业执照》及《经营期货业务许可证》所核定的经营范围独立开展业务。本公司各项业务具有完整的业务流程、独立的经营场所。本公司经营的业务与实际控制人及其控制的其他企业之间不存在实质性同业竞争，未受到本公司股东及其他关联方的干涉、控制，也未因与本公司股东及其他关联方存在关联关系，而使得本公司经营自主权的独立性和完整性受到不良影响。

2. 人员独立

本公司具有独立的劳动、人事以及相应的社会保障等管理体系及独立的员工队伍。公司董事、监事、总经理及其他高级管理人员，均以合法程序选举或聘任，不存在实际控制人及其控制的其他企业违规作出人事任免决定的情况。公司总经理、财务负责人、董事会秘书等高级管理人员不存在在实际控制人及其控制的其他企业中担任除董事、监事以外的职务或领取薪酬的情形；公司的财务人员均只在公司任职并领取薪酬，不存在在实际控制人及其控制的其他企业中兼职或领取薪酬的情形。

3. 资产独立

本公司拥有独立完整的经营期货业务相关资产，与实际控制人及其控制的其他企业资产完全分离，不存在本公司实际控制人及其控制的其他企业违规占用本公司资金、资产及其他资源的情况。

4. 机构独立

本公司以《公司法》等法律、法规以及《公司章程》相关规定为依据，以建立权责分明、管理科

学、激励和约束相结合的现代企业制度为目标，完善了以股东大会、董事会、监事会为基础的公司治理结构，聘任了总经理、副总经理、财务总监、首席风险官、董事会秘书等人员在内的高级管理人员。并根据自身经营管理需要设置了各业务及职能部门，本公司拥有机构设置自主权，组织机构健全。且完全独立于实际控制人及其控制的其他企业，不存在与实际控制人及其控制的其他企业职能部门之间的从属关系。本公司经营办公场所与实际控制人及其控制的其他企业完全分离，不存在合署办公的情形。

5. 财务独立

本公司依法制定了财务内部控制制度，设立了独立的财务会计部门，建立了独立完善的财务会计核算体系和财务管理制度以及风险控制等内部管理制度。公司聘有专门的财务人员，且财务人员未在任何关联单位兼职，能够独立作出财务决策。本公司独立在银行开户，并无与实际控制人及其控制的其他企业共用一个银行账户的情况。公司独立纳税，不存在实际控制人及其控制的其他企业干预本公司资金运用的情况。

报告期内，公司无资金被实际控制人及其控制的其他企业以借款、代偿债务、代垫款项或者其他方式占用的情形。

(三) 对重大内部管理制度的评价

公司依据《公司法》、《会计法》及《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《关于加强期货经纪公司内部控制的指导原则》等有关法律法规的规定，按照建立现代企业制度的要求，以全面性、重要性、制衡性和成本效益为原则，制定了本公司内部控制管理制度。

公司内控制度包括公司治理制度、公司基本管理制度、公司部门管理制度等三个层级，这三个层级的制度包括了公司治理、业务管理、风险合规、综合管理等四个大类。这些制度已从本公司的内部环境、风险评估、控制措施、信息与沟通、监督检查等五要素建立起一套较完整、严密、合理、有效的内部控制体系，覆盖了公司所有业务、各个部门和分支机构以及全体工作人员，贯穿事前、事中和事后的决策、执行、监督、反馈等各个环节。

报告期内，公司未发现上述管理制度存在重大缺陷。

(四) 年度报告差错责任追究制度相关情况

公司已根据《公司法》、《会计法》、《全国中小企业股份转让系统挂牌公司信息披露规则》等法律法规及其他规范性文件，建立《年报信息披露重大差错责任追究制度》。

截止报告期末，公司未发生重大会计差错更正、重大遗漏信息等情况。

第十一节 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	<input checked="" type="checkbox"/> 无 <input type="checkbox"/> 强调事项段 <input type="checkbox"/> 其他事项段 <input type="checkbox"/> 持续经营重大不确定段落 <input type="checkbox"/> 其他信息段落中包含其他信息存在未更正重大错报说明
审计报告编号	天健审〔2019〕2975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	2019年4月22日
注册会计师姓名	宋慧娟、张汇江
会计师事务所是否变更	否
会计师事务所连续服务年限	11
会计师事务所审计报酬	55万元

审计报告正文：

审计报告

天健审〔2019〕2975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12月31日的合并及母公司资产负债表，2018年度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12月31日的合并及母公司财务状况，以及2018年度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. 事项描述

永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询业务收入、基金代销业务收入及资产管理业务收入。如附注三（二十六）所述，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；投资咨询业务、基金代销业务和资产管理业务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凭据时确认。

由于手续费收入是公司关键业绩指标之一，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. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

（1）了解与手续费收入确认相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

（2）针对处理与手续费收入相关交易的关键信息技术系统，我们利用本所内部信息技术专家的工作，评价和测试该系统关于信息系统应用的关键内部控制的设计和运行有效性。

（3）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，并将财务账面记录的手续费收入与交易运作总部业务系统中记录的数据进行核对。

（4）对于投资咨询业务和基金代销业务收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同，核实相关收入确认与合同条款是否一致，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。

（5）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) 结构化主体是否纳入合并范围

1. 事项描述

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。永安期货公司管理层（以下简称管理层）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。

由于相关结构化主体是否纳入合并范围可能对财务报表产生重大影响，且涉及重大管理层判断，因此，我们将结构化主体是否纳入合并范围确定为关键审计事项。

2. 审计应对

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合并财务报表范围的评估过程。
- （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

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：宋慧娟
（项目合伙人）

中国·杭州 中国注册会计师：张汇江

二〇一九年四月二十二日

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	六（一）1	15,100,136,062.53	16,146,165,727.06
其中：期货保证金存款		13,987,081,754.86	14,801,097,903.82
应收货币保证金	六（一）2	8,634,466,301.81	9,624,944,308.77
应收质押保证金	六（一）3	453,138,812.00	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	六（一）4	251,501,334.99	31,586,974.11
衍生金融资产			
应收票据及应收账款	六（一）5注 1	651,510.76	1,107,368.64
预付款项	六（一）6	176,585,144.04	110,094,354.67
应收结算担保金	六（一）7	25,513,880.92	25,513,887.40
应收风险损失款	六（一）8	62,322.49	66,201.51
应收佣金	六（一）5注 1	2,345,603.23	3,994,945.13
其他应收款	六（一）9	93,487,921.96	69,280,357.16
买入返售金融资产			
存货	六（一）10	973,484,388.78	1,008,106,211.20
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	六（一）18注 2	165,645,006.09	260,610,832.09

流动资产合计		25,877,018,289.60	27,565,957,529.74
非流动资产:			
可供出售金融资产	六(一)11	2,631,966,620.73	2,151,163,825.45
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	六(一)12	326,610,079.92	294,320,282.20
期货会员资格投资	六(一)13	1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产	六(一)15	3,602,959.06	3,737,264.38
固定资产	六(一)14	102,603,824.08	108,288,008.05
在建工程	六(一)18注 2	87,245,315.29	49,308,879.59
无形资产	六(一)16	241,219,290.44	252,293,380.97
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	六(一)18注 2	14,308,002.80	14,008,820.25
递延所得税资产	六(一)17	147,181,663.99	72,211,605.04
其他非流动资产			
非流动资产合计		3,556,137,756.31	2,946,732,065.93
资产总计		29,433,156,045.91	30,512,689,595.67
流动负债:			
短期借款	六(一)19	428,000,000.00	560,000,000.00
应付货币保证金	六(一)20	19,952,524,955.66	21,923,322,332.85
应付质押保证金	六(一)21	225,137,938.00	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	六(一)22	988,122,622.02	132,748,600.25
期货风险准备金	六(一)23	213,203,152.39	191,824,966.82
衍生金融负债			
应付票据及应付账款	六(一)24	16,818,922.30	24,274,821.46
预收款项	六(一)25	406,991,421.73	239,168,377.13
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金	六(一)26	547,449.15	535,879.52
应付手续费及佣金	六(一)29注 3	1,023,763.63	1,500,959.27
应付职工薪酬	六(一)27	534,545,299.95	416,560,567.84
应交税费	六(一)28	145,792,896.46	148,336,872.28
其他应付款	六(一)29注 3	461,016,541.82	567,095,938.97
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
流动负债合计		23,373,724,963.11	24,378,698,008.39
非流动负债:			

长期借款			
应付债券	六（一）32 注 4		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	六（一）30	68,865,421.90	52,363,956.76
递延收益			
递延所得税负债	六（一）31	18,398,329.89	90,207,977.00
其他非流动负债			
非流动负债合计		87,263,751.79	572,571,933.76
负债合计		23,460,988,714.90	24,951,269,942.15
所有者权益（或股东权益）：			
股本	六（一）33	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	六（一）34	1,500,868,930.15	1,500,868,930.15
减：库存股			
其他综合收益	六（一）35	-59,662,853.60	244,586,806.06
专项储备			
盈余公积	六（一）36	296,991,371.55	229,132,515.87
一般风险准备	六（一）37	356,882,385.48	289,023,529.80
未分配利润	六（一）38	2,567,087,497.43	1,987,807,871.64
归属于母公司所有者权益合计		5,972,167,331.01	5,561,419,653.52
少数股东权益		-	-
所有者权益合计		5,972,167,331.01	5,561,419,653.52
负债和所有者权益总计		29,433,156,045.91	30,512,689,595.67

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，下同。财务报表附注六（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：财务报表附注六（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：财务报表附注六（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
流动资产：			
货币资金		13,620,901,224.29	14,502,200,675.46
其中：期货保证金存款		13,235,117,657.99	13,938,365,352.23
应收货币保证金		8,092,469,298.99	9,187,412,309.75
应收质押保证金		453,138,812.00	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		25,513,880.92	25,513,887.40
应收风险损失款		62,322.49	66,201.51
应收佣金		3,795,329.73	4,249,564.80
其他应收款		34,319,795.71	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		18,281,976.97	19,613,742.92
流动资产合计		22,248,482,641.10	24,200,897,752.28
非流动资产：			
可供出售金融资产		2,028,886,327.28	1,914,873,375.60
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	十（一）1	1,716,924,160.41	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		3,602,959.06	3,737,264.38
固定资产		98,694,779.81	105,776,461.70
在建工程		87,245,315.29	49,308,879.59
无形资产		240,288,925.60	251,280,148.22
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		13,286,857.71	13,802,675.02
递延所得税资产		100,425,131.09	35,196,938.96
其他非流动资产			
非流动资产合计		4,290,754,456.25	3,585,244,988.16
资产总计		26,539,237,097.35	27,786,142,740.44
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		19,770,604,020.00	20,988,854,859.06
应付质押保证金		453,138,812.00	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		213,203,152.39	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		1,004,166.79	646,196.66
应付期货投资者保障基金		547,449.15	535,879.52
应付手续费及佣金		1,023,763.63	1,500,959.27
应付职工薪酬		458,848,934.22	347,370,249.85
应交税费		87,595,497.77	84,934,465.62
其他应付款		175,804,808.96	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			
流动负债合计		21,161,770,604.91	22,113,969,706.55
非流动负债：			
长期借款			
应付债券			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			76,329,753.17
其他非流动负债			
非流动负债合计		-	506,329,753.17
负债合计		21,161,770,604.91	22,620,299,459.72
所有者权益（或股东权益）：			
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		-75,562,719.52	234,202,625.60
专项储备			
盈余公积		296,991,371.55	229,132,515.87
一般风险准备		356,882,385.48	289,023,529.80
未分配利润		1,986,454,600.67	1,600,783,755.19
所有者权益合计		5,377,466,492.44	5,165,843,280.72
负债和所有者权益总计		26,539,237,097.35	27,786,142,740.44

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、营业总收入		15,763,889,406.71	9,589,243,052.39
手续费及佣金净收入	六(二)1	534,254,965.29	593,347,524.35
其中：经纪业务手续费收入		473,656,522.69	528,451,063.95
资产管理业务收入		10,183,394.38	14,992,345.10
投资咨询业务收入		6,291,242.47	13,506,897.33
代理销售金融产品收入		44,123,805.75	36,397,217.97
其他手续费及佣金收入		0.00	0.00
利息净收入	六(二)2	569,688,435.51	524,237,811.89
投资收益(损失以“-”号填列)	六(二)3	921,167,244.16	904,981,185.99
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		153,509,885.56	205,968,886.40
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	六(二)4	46,332,896.52	43,153,642.03
汇兑收益(损失以“-”号填列)		2,953,804.50	-2,489,634.96
其他业务收入	六(二)5	13,684,164,075.39	7,520,366,821.48
其中：风险管理业务收入		13,671,612,382.29	7,509,893,265.03
资产处置收益(损失以“-”号填列)	六(二)6	347,653.10	
其他收益	六(二)7	4,980,332.24	5,645,701.61
二、营业总成本		14,652,062,489.53	8,363,998,572.14
提取期货风险准备金		21,395,264.59	24,751,281.94
税金及附加	六(二)8	5,566,520.89	5,375,318.24
业务及管理费	六(二)9	875,955,401.11	854,710,567.66
研发费用	六(二)10		
资产减值损失	六(二)11	270,021,886.07	232,009,437.39
其他业务成本	六(二)12	13,479,123,416.87	7,247,151,966.91
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,111,826,917.18	1,225,244,480.25
加：营业外收入	六(二)13	24,367,583.02	1,364,756.16
减：营业外支出	六(二)14	23,161,114.44	79,502,664.16
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,113,033,385.76	1,147,106,572.25
减：所得税费用	六(二)15	240,836,048.61	225,037,016.92
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		872,197,337.15	922,069,555.33
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（净亏损以“-”号填列）		872,197,337.15	922,069,555.33
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
(二) 按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益		-	-
2. 归属于母公司所有者的净利润		872,197,337.15	922,069,555.33
六、其他综合收益的税后净额	六（二）16	-304,249,659.66	75,006,082.86
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-304,249,659.66	75,006,082.86
(一) 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变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		-304,249,659.66	75,006,082.86
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-11,304,846.92	5,265,376.73
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-312,345,644.00	83,740,710.96
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		19,400,831.26	-14,000,004.83
6. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		567,947,677.49	997,075,638.19
归属于母公司所有者的综合收益总额		567,947,677.49	997,075,638.19
归属于少数股东的综合收益总额			
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益		0.67	0.70
(二) 稀释每股收益		0.67	0.70

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
一、营业收入		1,556,512,450.10	1,712,576,309.69

手续费及佣金净收入	十(二)1	494,167,462.36	560,495,262.25
其中:经纪业务手续费收入		427,905,291.72	494,979,747.72
资产管理业务收入		16,327,297.53	15,722,414.41
投资咨询业务收入		5,811,067.36	13,395,882.15
代理销售金融产品收入		44,123,805.75	36,397,217.97
其他手续费及佣金收入			
利息净收入		572,173,937.31	528,367,525.54
投资收益(损失以“-”号填列)	十(二)2	477,735,138.53	610,756,723.11
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		150,359,762.64	209,439,510.15
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)		3,476.49	11,803.90
其他业务收入		10,916,362.22	10,380,252.33
其中:风险管理业务收入			
资产处置收益(损失以“-”号填列)		219,116.78	
其他收益		1,296,956.41	2,563,011.56
二、营业成本		693,165,037.68	708,064,402.36
提取期货风险准备金		21,395,264.59	24,751,281.94
税金及附加		3,551,711.41	4,119,807.17
业务及管理费		667,570,320.11	678,216,017.40
研发费用			
资产减值损失		513,436.25	847,160.31
其他业务成本		134,305.32	130,135.54
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		863,347,412.42	1,004,511,907.33
加:营业外收入		137,610.42	1,009,754.53
减:营业外支出		6,434,081.04	10,355,450.89
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		857,050,941.80	995,166,210.97
减:所得税费用		178,462,384.96	158,197,324.64
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		678,588,556.84	836,968,886.33
(一)持续经营净利润		678,588,556.84	836,968,886.33
(二)终止经营净利润			
六、其他综合收益的税后净额		-309,765,345.12	94,108,675.03
(一)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变动额			
2.权益法下不能转损益的其他综合收益			
(二)将重分类进损益的其他综合收益		-309,765,345.12	94,108,675.03
1.权益法下可转损益的其他综合收益		-11,304,846.92	5,175,316.50

2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-298,460,498.20	88,933,358.53
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			
七、综合收益总额		368,823,211.72	931,077,561.36
八、每股收益：			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

(五) 合并现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金		15,944,895,336.09	8,876,556,478.97
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		-	303,476,058.61
收取利息、手续费及佣金的现金		1,203,895,742.24	1,227,557,852.04
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金	六（三）1	2,947,015,361.53	778,465,210.71
经营活动现金流入小计		20,095,806,439.86	11,186,055,600.33
购买商品、接受劳务支付的现金		15,849,941,368.16	9,389,609,213.60
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		22,044,551.80	35,798,948.48
以现金支付的业务及管理费		23,514,541.95	200,783,359.43
支付给职工以及为职工支付的现金		483,490,779.16	432,320,747.23
支付的各项税费		315,478,743.44	263,688,907.98
支付其他与经营活动有关的现金	六（三）2	4,274,502,681.79	4,363,847,141.00
经营活动现金流出小计		21,187,148,833.55	14,686,048,317.72
经营活动产生的现金流量净额		-1,091,342,393.69	-3,499,992,717.39
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		500,000.00	960,000.00
取得投资收益收到的现金		132,126,250.00	88,391,218.50
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		441,646.11	35,803.91
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	六（三）3	6,907,526.53	-
投资活动现金流入小计		139,975,422.64	89,387,022.41
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		63,238,843.45	41,131,384.09
投资支付的现金		24,500,000.00	20,689,000.00
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		-	-
投资活动现金流出小计		87,738,843.45	61,820,384.09
投资活动产生的现金流量净额		52,236,579.19	27,566,638.32
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
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		782,900,518.26	930,000,000.00
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	六（三）4	774,247,408.30	-
筹资活动现金流入小计		1,557,147,926.56	930,000,000.00
偿还债务支付的现金		1,344,900,518.26	805,271,007.24
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		251,682,924.76	63,634,420.92
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	六（三）5		318,512,094.38
筹资活动现金流出小计		1,596,583,443.02	1,187,417,522.54
筹资活动产生的现金流量净额		-39,435,516.46	-257,417,522.54
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		20,880,666.94	-15,917,708.54
五、现金及现金等价物净增加额		-1,057,660,664.02	-3,745,761,310.15
加：期初现金及现金等价物余额		14,977,076,309.32	18,722,837,619.47
六、期末现金及现金等价物余额		13,919,415,645.30	14,977,076,309.32

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
一、经营活动产生的现金流量：			
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			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,133,897,111.38	1,172,041,194.23
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		3,977,222,567.91	602,062,232.89
经营活动现金流入小计		5,111,119,679.29	1,774,103,427.12
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		22,044,365.97	26,202,674.60
以现金支付的业务及管理费		124,375,087.12	131,106,073.94
支付给职工以及为职工支付的现金		378,455,299.07	350,902,993.19
支付的各项税费		241,700,988.98	187,385,323.82
支付其他与经营活动有关的现金		4,162,685,679.72	2,817,425,607.58
经营活动现金流出小计		4,929,261,420.86	3,513,022,673.13
经营活动产生的现金流量净额		181,858,258.43	-1,738,919,246.01
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		250,000.00	480,000.00
取得投资收益收到的现金		294,899,128.69	88,372,593.50
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		324,220.98	35,803.91
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			-
投资活动现金流入小计		295,473,349.67	88,888,397.41
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		58,911,059.27	33,768,180.28
投资支付的现金		500,000,000.00	202,769,000.00
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			-
投资活动现金流出小计		558,911,059.27	236,537,180.28
投资活动产生的现金流量净额		-263,437,709.60	-147,648,782.87
三、筹资活动产生的现金流量：			
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			
筹资活动现金流入小计			
偿还债务支付的现金		430,000,000.00	170,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		219,720,000.00	41,221,917.81
支付其他与筹资活动有关的现金			200,000,000.00
筹资活动现金流出小计		649,720,000.00	411,221,917.81
筹资活动产生的现金流量净额		-649,720,000.00	-411,221,917.81
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
五、现金及现金等价物净增加额		-731,299,451.17	-2,297,789,946.69
加：期初现金及现金等价物余额		14,002,200,675.46	16,299,990,622.15
六、期末现金及现金等价物余额		13,270,901,224.29	14,002,200,675.46

(七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	本期												
	归属于母公司所有者权益										少数 股东 权益	所有者 权益	
	股本	其他权益工 具			资 本 公 积	减 ： 库 存 股	其 他 综 合 收 益	专 项 储 备	盈 余 公 积	一 般 风 险 准 备			未 分 配 利 润
优 先 股		永 续 债	其 他										
一、上 年 期 末 余 额	1,310,000,000.0 0				1,500,868,930.1 5		244,586,806.0 6		229,132,515.8 7	289,023,529.8 0	1,987,807,871.6 4		5,561,419,653.5 2
加：会 计 政 策 变 更													
前 期 差 更 正													
同 一 控													

制下 企业 合并												
其他												
二、本 年期 初余 额	1,310,000,000.0 0			1,500,868,930.1 5	244,586,806.0 6		229,132,515.8 7	289,023,529.8 0	1,987,807,871.6 4		5,561,419,653.5 2	
三、本 期增 减变 动金 额(减 少以 “-” 号填 列)					- 304,249,659.6 6		67,858,855.68	67,858,855.68	579,279,625.79		410,747,677.49	
(一) 综合 收益 总额					- 304,249,659.6 6				872,197,337.15		567,947,677.49	
(二) 所有 者投 入和												

减少资本													
1. 股东投入的普通股													
2. 其他权益工具持有者投入资本													
3. 股份支付计入所有者权益的金额													
4. 其他													
(三) 利润								67,858,855.68	67,858,855.68	-		292,917,711.36	-
												157,200,000.00	

分配												
1. 提取盈余公积								67,858,855.68		-67,858,855.68		
2. 提取一般风险准备									67,858,855.68	-67,858,855.68		
3. 对所有者(或股东)的分配										-		-
4. 其他										157,200,000.00		157,200,000.00
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公												

积 转 增 资 本 (或 股 本)													
2. 盈 余 公 积 转 增 资 本 (或 股 本)													
3. 盈 余 公 积 弥 补 亏 损													
4. 设 定 受 益 计 划 变 动 额 结 转 留 存 收 益													
5. 其 他													
(五)													

专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
四、本 年 期 末 余 额	1,310,000,000.0 0				1,500,868,930.1 5	- 59,662,853.60	296,991,371.5 5	356,882,385.4 8	2,567,087,497.4 3		5,972,167,331.0 1	

项目	上期												
	归属于母公司所有者权益											少数股东 权益	所有者 权益
	股本	其他权益工 具			资本 公积	减 ： 库 存 股	其他综合收益	专 项 储 备	盈 余 公 积	一 般 风 险 准 备	未 分 配 利 润		
优 先 股		永 续 债	其 他										
一、上 年 期 末 余	1,310,000,000. 00				1,489,444,325. 01		169,580,723. 20		145,435,627. 24	205,326,641. 17	1,446,813,813. 42	14,689.8 2	4,766,615,819. 86

额												
加：会计政策变更										-17,181,719.85		-17,181,719.85
前期差错更正												
同一控制下企业合并												
其他												
二、本年期初余额	1,310,000,000.00			1,489,444,325.01	169,580,723.20	145,435,627.24	205,326,641.17	1,429,632,093.57	14,689.82			4,749,434,100.01
三、本期增减变动金				11,424,605.14	75,006,082.86	83,696,888.63	83,696,888.63	558,175,778.07	-14,689.82			811,985,553.51

额(减少以“-”号填列)											
(一) 综合收益总额						75,006,082.86				922,069,555.33	997,075,638.19
(二) 所有者投入和减少资本										-14,689.82	-14,689.82
1. 股东投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入											

资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他											-14,689.82	-14,689.82
(三) 利润分配							83,696,888.63	83,696,888.63	-363,893,777.26			-196,500,000.00
1. 提取盈余公积							83,696,888.63		-83,696,888.63			
2. 提取一般风险准备								83,696,888.63	-83,696,888.63			
3. 对所有									-196,500,000.00			-196,500,000.00

者(或 股东) 的 分 配											0		0
4. 其 他													
(四) 所 有 者 权 益 内 部 结 转													
1. 资 本 公 积 转 增 资 本(或 股 本)													
2. 盈 余 公 积 转 增 资 本(或 股 本)													
3. 盈 余 公													

积 弥 补 亏 损												
4. 设 定 受 益 计 划 变 动 额 结 转 留 存 收 益												
5. 其 他												
(五) 专 项 储 备												
1. 本 期 提 取												
2. 本 期 使 用												
(六) 其 他				11,424,605.14								11,424,605.14
四、本 年 期	1,310,000,000.			1,500,868,930.15		244,586,806.06	229,132,515.87	289,023,529.80	1,987,807,871.64			5,561,419,653.52

末 余 额												
----------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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

(八) 母公司股东权益变动表

单位：元

项目	本期											
	股本	其他权益工 具			资本公积	减： 库存股	其他综合收益	专项 储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优 先 股	永 续 债	其 他								
一、 上年 期末 余额	1,310,000,000.0 0				1,502,700,854.2 6		234,202,625.6 0		229,132,515.8 7	289,023,529.8 0	1,600,783,755.1 9	5,165,843,280.7 2
加： 会计 政策 变更												
前 期差 错更 正												

其他										
二、 本年期初 余额	1,310,000,000.0 0			1,502,700,854.2 6		234,202,625.6 0	229,132,515.8 7	289,023,529.8 0	1,600,783,755.1 9	5,165,843,280.7 2
三、 本期 增减 变动 金额 (减少以 “一”号 填列)						- 309,765,345.1 2	67,858,855.68	67,858,855.68	385,670,845.48	211,623,211.72
(一) 综合收 益总额						- 309,765,345.1 2			678,588,556.84	368,823,211.72
(二) 所有者 投入										

和减少资本												
1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
(三)								67,858,855.68	67,858,855.68	-292,917,711.36	-157,200,000.00	

利 润分 配												
1. 提 取盈 余公 积								67,858,855.68		-67,858,855.68		
2. 提 取一 般风 险准 备									67,858,855.68	-67,858,855.68		
3. 对 所有 者 (或 股 东) 的分 配										-157,200,000.00	-157,200,000.00	
4. 其 他												
(四))所 有者 权益												

内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计												

划变动额 结转 留存 收益											
5. 其他											
(五) 专项储备											
1. 本期提取											
2. 本期使用											
(六) 其他											
四、 本年年末 余额	1,310,000,000.0 0			1,502,700,854.2 6		- 75,562,719.52		296,991,371.5 5	356,882,385.4 8	1,986,454,600.6 7	5,377,466,492.4 4

项目	上期										
----	----	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

	股本	其他权益工具			资本公积	减： 库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		140,093,950.57		145,435,627.24	205,326,641.17	1,127,708,646.12	4,419,841,114.22
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		140,093,950.57		145,435,627.24	205,326,641.17	1,127,708,646.12	4,419,841,114.22
三、本期增减					11,424,605.14		94,108,675.03		83,696,888.63	83,696,888.63	473,075,109.07	746,002,166.50

变动 金额 (减 少以 “一 ”号 填 列)											
(一) 综 合收 益总 额						94,108,675.03				836,968,886.33	931,077,561.36
(二) 所 有者 投入 和减 少资 本											
1. 股 东投 入的 普通 股											
2. 其											

他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配							83,696,888.63	83,696,888.63	-363,893,777.26	-196,500,000.00	
1. 提取盈余公积							83,696,888.63		-83,696,888.63		
2. 提取一								83,696,888.63	-83,696,888.63		

般风 险准 备													
3. 对 所有 者 (或 股 东) 的 分 配												-196,500,000.00	-196,500,000.00
4. 其 他													
(四))所 有者 权益 内部 结转													
1. 资 本公 积转 增资 本 (或 股													

本)												
2. 盈 余公 积转 增资 本 (或 股 本)												
3. 盈 余公 积弥 补亏 损												
4. 设 定受 益计 划变 动额 结转 留存 收益												
5. 其 他												
(五)专												

项储备											
1. 本期提取											
2. 本期使用											
(六) 其他				11,424,605.14							11,424,605.14
四、本年年末余额	1,310,000,000.00			1,502,700,854.26		234,202,625.60	229,132,515.87	289,023,529.80	1,600,783,755.19		5,165,843,280.72

永安期货股份有限公司

财务报表附注

2018 年度

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)前身系浙江省永安期货经纪有限公司,于 1992 年 9 月在工商行政管理局登记注册,总部位于浙江省杭州市。公司现持有统一社会信用代码为 9133000010002099X5 的营业执照,注册资本 131,000 万元,股份总数 131,000 万股(每股面值 1 元)。公司股票已于 2015 年 10 月 28 日在全国中小企业股份转让系统挂牌交易。

本公司经营范围: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 32 家营业部及 10 家分公司,分别位于北京、天津、上海、重庆、浙江、山东、辽宁等地。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)、新永安国际证券有限公司(以下简称新永安证券公司)、新永安国际资产管理有限公司(以下简称新永安资管公司)和永安国际金融(新加坡)有限公司(以下简称永安国际金融公司)。

更正前的财务报告经公司 2019 年 4 月 22 日第二届二十次董事会批准对外报出。公司经过自查,针对发现的会计差错,出具了《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》,并据此重新编制了财务报告。更正后的财务报告经公司 2020 年 12 月 9 日第三届十次董事会批准对外报出。天健会计师事务所(特殊普通合伙)对公司更正前的财务报告出具了文号为天健审(2019)2975 号的标准无保留意见审计报告。天健会计师事务所(特殊普通合伙)和中汇会计师事务所(特殊普通合伙)对《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》进行了专项审核,出具了《永安期货股份有限公司前期会计差错更正专项说明的审核报告》。经其审核,天健会计师事务所(特殊普通合伙)和中汇会计师事务所(特殊普通合伙)均认为公司对相关会计差错更正的会计处理符合《企业会计准则第 28 号——会计政策、会计估计变更和差错更正》和全国中小企业股份转让系统有限责任公司《挂牌公司信息披露及会计业务问答(三)》的规定。

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 个月内的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况。

三、重要会计政策和会计估计

（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。

（三）营业周期

公司经营业务的营业周期较短，以 12 个月作为资产和负债的流动性划分标准。

（四）记账本位币

公司采用人民币为记账本位币。

（五）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。

（六）合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司（结构化主体）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。

（七）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。

(八) 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的近似汇率折算。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。

(九) 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。

(十) 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

按信用风险特征组合计提坏账准备的计提方法	
账龄组合	账龄分析法
合并范围内关联方组合	依据以前年度实际损失率，结合现实情况，确认计提比例
应收交易所和商业银行等组合	依据以前年度实际损失率，结合现实情况，确认计提比例

(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

对应收股利、应收利息等其他应收款项，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。

(十一) 存货

14. 存货的分类

本公司持有存货系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。

(十二) 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。

(十三) 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。

(十四) 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。

(十五) 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。

(十六) 客户资产管理业务核算方法

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

(十七) 长期股权投资

14. 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。

(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。

(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。

(十八) 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。

(十九) 固定资产

14. 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	年限平均法	30	3	3.23
电子设备及其他	年限平均法	5	3	19.40
运输工具	年限平均法	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。

(二十) 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。

(二十一) 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。

(二十二) 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。

(二十三) 职工薪酬

1. 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

2. 短期薪酬的会计处理方法

在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

(1) 在职工为公司提供服务的会计期间，根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

1) 根据预期累计福利单位法，采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等作出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的所属期间。同时，对设定受益计划所产生的义务予以折现，以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本；

2) 设定受益计划存在资产的，将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的，以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产；

3) 期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，

其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

4. 辞退福利的会计处理方法

向职工提供的辞退福利，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：(1) 公司不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；(2) 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

向职工提供的其他长期福利，符合设定提存计划条件的，按照设定提存计划的有关规定进行会计处理；除此之外的其他长期福利，按照设定受益计划的有关规定进行会计处理，为简化相关会计处理，将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动等组成项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

(二十四) 期货风险准备金提取和使用的会计处理方法

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公司承担的客户交易损失；

(2) 确认的坏账损失。

3. 风险准备金不足以弥补的损失计入当期损益。

(二十五) 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。

(二十六) 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。

(二十七) 收入

收入是指企业在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加的、与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入只有在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时才能予以确认。符合收入定义和收入确认条件的项目，应当列入利润表。

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凭据时确认收入。

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。

（二十八）政府补助

1. 政府补助在同时满足下列条件时予以确认：（1）公司能够满足政府补助所附的条件；（2）公司能够收到政府补助。政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能可靠取得的，按照名义金额计量。

2. 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。与资产相关的政府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。

3. 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。

4. 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。

(二十九) 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。

(三十) 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。

(三十一) 重要会计政策、会计估计变更说明

本公司参照《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 年度财务报表，此项会计政策变更采用追溯调整法。2017 年度财务报表受重要影响的报表项目和金额如下：

原列报报表项目及金额		新列报报表项目及金额	
应收账款	5,102,313.77	应收票据及应收账款	5,102,313.77
应收利息	13,398,157.39	其他应收款	69,280,357.16
其他应收款	55,882,199.77		
应付账款	24,274,821.46	应付票据及应付账款	24,274,821.46
应付利息	9,453,253.06	其他应付款	568,596,898.24
应付股利	196,500,000.00		
其他应付款	362,643,645.18		
其他收益	4,661,340.80	其他收益	5,645,701.61
营业外收入	2,349,116.97	营业外收入	1,364,756.16

2. 财政部于 2017 年度颁布了《企业会计准则解释第 9 号——关于权益法下投资净损失的会计处理》《企业会计准则解释第 10 号——关于以使用固定资产产生的收入为基础的折旧方法》《企业会计准则解释第 11 号——关于以使用无形资产产生的收入为基础的摊销方法》及《企业会计准则解释第 12 号——关于关键管理人员服务的提供方与接受方是否为

关联方》。公司自 2018 年 1 月 1 日起执行上述企业会计准则解释，执行上述解释对公司期初财务数据无影响。

四、税（费）项

（一）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%、13%、11%、10%、6%、3%
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%
企业所得税	应纳税所得额	16.5%、17%、25%

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%
永安国际金融公司	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%

（二）税收优惠

1. 据财政部、国家税务总局《财政部 国家税务总局关于原油和铁矿石期货保税交割业务增值税政策的通知》（财税〔2015〕35号），自 2015 年 4 月 1 日起，通过上海国际能源交易中心股份有限公司交易的原油和通过大连商品交易所交易的铁矿石期货保税交割业务，暂免征收增值税。2017 年至 2020 年度，子公司永安资本和永安国油经向主管税务机关办理免税备案后，开展的原油期货保税交割业务开具增值税普通发票，免缴增值税。

2. 根据财政部、国家税务总局《关于证券行业准备金支出企业所得税税前扣除有关政策问题的通知》（财税〔2017〕23号），2016 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日，期货公司依据《期货公司管理办法》（证监会令第 43 号）和《商品期货交易财务管理暂行规定》（财商字〔1997〕44 号）的有关规定，从其收取的交易手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5%提取的期货公司风险准备金在企业所得税税前扣除。

五、企业合并、合并财务报表范围及在其他主体中的权益

(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	设立	2018年6月	2,000万港币	100.00%
新永安证券公司	设立	2018年6月	2,000万港币	100.00%
永安国际金融公司	设立	2018年6月	150万新加坡币	100.00%

2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

本公司管理的永屹1号、永进1号、永利2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，自该等资管计划满足上述条件之日起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. 本期不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

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)、黑色多头一号、黑色空头一号、有色多头一号、有色空头一号因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

(三) 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	设立

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
永安国际金融公司	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，本公司管理的七禾言起 2 号、永利 1 号、永屹 1 号、永进 1 号、永利 2 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。

(四) 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	
永安国富资产管理有限公司（以下简称永安国富公司）	杭州	杭州	金融业	33.00		权益法核算
浙江玉皇山南投资管理有限公司（以下简称玉皇山南公司）	杭州	杭州	金融业		19.00	权益法核算
鞍钢永安商品贸易有限公司（以下简称鞍钢商贸公司）	杭州	杭州	商业		49.00	权益法核算

(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			期初数/上年同期数	
	永安国富公司	玉皇山南公司	鞍钢商贸公司	永安国富公司	玉皇山南公司
流动资产	870,041,901.02	92,502,938.30	111,255,106.09	1,123,526,597.69	111,804,528.224
非流动资产	458,445,989.52	25,489,416.85	26,096.34	174,926,530.33	32,912,542.52
资产合计	1,328,487,890.54	117,992,355.15	111,281,202.43	1,298,453,128.02	144,717,070.74
流动负债	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71	435,522,635.00	58,087,443.37
非流动负债				16,555,818.77	
负债合计	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71	452,078,453.77	58,087,443.37
少数股东权益		16,468,750.59			7,594,681.59
归属于母公司所有者权益	867,753,206.73	73,865,950.62	51,125,394.72	846,374,674.25	79,034,945.78

按持股比例计算的净资产份额	286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41	279,303,642.50	15,016,639.70
对联营企业权益投资的账面价值	286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41	279,303,642.50	15,016,639.70
营业收入	1,281,525,686.40	2,046,677.87	486,385,002.58	1,142,570,503.95	957,651.25
净利润	455,635,644.35	-7,131,923.03	1,125,394.72	485,456,427.15	-5,732,220.72
其他综合收益	-34,257,111.87			13,159,562.58	
综合收益总额	421,378,532.48	-7,131,923.03	1,125,394.72	498,615,989.73	-5,732,220.72
本期收到的来自联营企业的股利	132,000,000.00			88,353,968.50	

(五) 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	21,696,090.01	4,013,366.17
永利1号	517,093,854.38	81,453,315.14
永屹1号	7,776,620.72	688,420.13
永进1号	48,033,933.63	338,803.96
永利2号	646,462,868.33	13,790,229.26
小计	1,241,063,367.07	100,284,134.66

六、合并财务报表项目注释

(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	20,185.76	10,292.55
银行存款	1,037,089,547.63	1,261,296,958.69
期货保证金存款	13,987,081,754.86	14,801,097,903.82
其他货币资金	75,944,574.28	83,760,572.00
合计	15,100,136,062.53	16,146,165,727.06

(2) 期末，其他货币资金中有 47,151,792.67 元保证金使用受限。

(3) 货币资金——期货保证金存款

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	EUR 4,008,799.07	7.8473	31,458,248.94	EUR 6,934,070.51	7.8023	54,101,698.34
工商银行	HKD 487,635.68	0.8762	427,266.38	HKD 1,411,422.90	0.8359	1,179,808.40

工商银行	JPY	39,583,026.00	0.0619	2,450,189.31	JPY	1.00	0.0579	0.06
工商银行	USD	1,426,346.38	6.8632	9,789,300.48	USD	7,494,841.10	6.5342	48,972,790.72
工商银行	RMB	440,911,883.25	1.0000	440,911,883.25	RMB	409,432,230.21	1.0000	409,432,230.21
光大银行	RMB	5,138,586.20	1.0000	5,138,586.20	RMB	4,948,470.03	1.0000	4,948,470.03
建设银行	RMB	29,727,493.00	1.0000	29,727,493.00	RMB	43,813,888.46	1.0000	43,813,888.46
交通银行					AUD	26,149.49	5.0928	133,174.12
交通银行	EUR	399,639.57	7.8473	3,136,091.60	EUR	346,439.19	7.8023	2,703,022.49
交通银行	HKD	624,184.06	0.8762	546,910.07	HKD	20,732,471.02	0.8359	17,330,272.53
交通银行	JPY	41,607,594.00	0.0619	2,575,510.07	JPY	75,733,756.00	0.0579	4,384,984.47
交通银行	RMB	11,154,153,310.35	1.0000	11,154,153,310.35	RMB	7,632,118,529.45	1.0000	7,632,118,529.45
交通银行	USD	9,273,580.72	6.8632	63,646,439.19	USD	28,486,894.93	6.5342	186,139,068.85
交通银行	GBP	162,519.00	8.6762	1,410,047.35	GBP	146,536.76	8.7792	1,286,475.52
民生银行	RMB	510,884,818.36	1.0000	510,884,818.36	RMB	912,447,496.12	1.0000	912,447,496.12
民生银行	HKD	42,888,636.55	0.8762	37,579,023.35	HKD	106,599,220.22	0.8359	89,106,288.18
民生银行	USD	57,291,230.88	6.8632	393,201,175.78	USD	58,843,653.05	6.5342	384,496,197.76
农业银行	RMB	29,186,899.99	1.0000	29,186,899.99	RMB	31,814,277.76	1.0000	31,814,277.76
浦发银行	RMB	310,186,592.53	1.0000	310,186,592.53	RMB	2,802,385,122.36	1.0000	2,802,385,122.36
兴业银行	RMB	5,622,157.17	1.0000	5,622,157.17	RMB	1,100,570,685.85	1.0000	1,100,570,685.85
渣打银行	HKD	1,042,315.45	0.8762	913,276.80	HKD	648,959.40	0.8359	542,465.16
渣打银行	USD	1,506,688.88	6.8632	10,340,707.12	USD	1,756,036.34	6.5342	11,474,292.65
招商银行	RMB	5,929,762.60	1.0000	5,929,762.60	RMB	5,373,191.33	1.0000	5,373,191.33
招商银行	HKD	773,286.51	0.8762	677,553.64	HKD	4,356,527.03	0.8359	3,641,620.94
招商银行	USD	719,719.06	6.8632	4,939,575.85	USD	1,307,943.00	6.5342	8,546,361.15
中国银行	HKD	18,905,340.25	0.8762	16,564,859.13	HKD	11,572,552.07	0.8359	9,673,496.28
中国银行	USD	17,935,747.31	6.8632	123,096,620.94	USD	154,964.19	6.5342	1,012,567.01
中国银行	JPY	350,985,017.00	0.0619	21,725,972.55				
中国银行	RMB	103,937,030.28	1.0000	103,937,030.28	RMB	50,349,352.94	1.0000	50,349,352.94
中信银行	RMB	612,955,553.13	1.0000	612,955,553.13	RMB	914,982,111.52	1.0000	914,982,111.52
平安银行	RMB	2,683,017.54	1.0000	2,683,017.54	RMB	68,137,963.16	1.0000	68,137,963.16

星展银行	RMB	51,285,881.91	1.0000	51,285,881.91		
小计				13,987,081,754.86		14,801,097,903.82

(4) 货币资金——外币货币资金

项 目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
美元	122,189,697.95	6.8632	838,612,334.97
港币	180,121,947.95	0.8762	157,822,850.79
新加坡元	1,119,382.41	5.0062	5,603,852.22
欧元	4,408,438.64	7.8473	34,594,340.54
日元	432,175,637.00	0.0619	26,751,671.93
英镑	162,519.00	8.6762	1,410,047.35
小 计			1,064,795,097.80

2. 应收货币保证金

(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	8,651,499,982.10	100.00	17,033,680.29	0.20	8,634,466,301.81
合 计	8,651,499,982.10	100.00	17,033,680.29	0.20	8,634,466,301.81

(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	9,639,579,465.92	100.00	14,635,157.15	0.15	9,624,944,308.77
合 计	9,639,579,465.92	100.00	14,635,157.15	0.15	9,624,944,308.77

2) 采用组合计提坏账准备的应收货币保证金

① 组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的应收货币保证金

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	340,673,605.95	17,033,680.29	5.00	292,703,143.07	14,635,157.15	5.00
小 计	340,673,605.95	17,033,680.29	5.00	292,703,143.07	14,635,157.15	5.00

		9			
--	--	---	--	--	--

② 组合中，采用其他方法计提坏账准备的应收货币保证金

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所和商业银行等组合	8,310,826,376.15			9,346,876,322.85		
小 计	8,310,826,376.15			9,346,876,322.85		

(2) 明细情况——按交易所/清算商

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	2,528,008,697.31	3,589,246,087.80
大连商品交易所	2,675,622,555.31	2,607,052,607.38
郑州商品交易所	1,047,969,608.94	982,218,293.26
中国金融期货交易所	1,491,710,748.42	1,720,181,399.44
上海国际能源交易中心	119,861,077.47	
中国证券登记结算有限责任公司	229,296,611.54	288,713,921.87
香港期货交易所	194,148,336.83	141,464,013.10
G. H. FINANCIALS (HONGKONG) LIMITED	117,993,058.82	97,235,261.12
MAREXFINANCIALLtd	124,041,106.97	81,980,298.03
PhilipFuturesPteLtd	54,319,346.17	70,293,506.66
R. J. O' Brien&Associates	37,434,080.54	22,921,722.78
NissanSecuritiesCo.,Ltd	2,505,054.99	-
HyundaiFuturesCorporaiong	168,094.90	165,483.52
KGIONGCAPITALPTE.Ltd	16,618.80	15,813.96
RakutenSecurities.Inc		20,025,715.00
StraitsFinancialServicesPteLtd		65,342.00
ADMISSINGAPOREPTELTDBANKINGINSTRUCTION	4,196,244.76	
DBSBankLtd	3,451,249.07	
其他	20,757,491.26	18,000,000.00
减：坏账准备	17,033,680.29	14,635,157.15
合 计	8,634,466,301.81	9,624,944,308.77

3. 应收质押保证金

(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	453,138,812.00	100.00			453,138,812.00
合计	453,138,812.00	100.00			453,138,812.00

(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	284,486,362.00	100.00			284,486,362.00
合计	284,486,362.00	100.00			284,486,362.00

2) 采用组合计提坏账准备的应收质押保证金

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收交易所和商业银行等组合	453,138,812.00			284,486,362.00		
小计	453,138,812.00			284,486,362.00		

(2) 明细情况——分交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	188,878,648.00	152,950,272.00
大连商品交易所	11,770,000.00	37,990,000.00
郑州商品交易所	93,760,404.00	93,546,090.00
上海国际能源交易中心	158,729,760.00	
合计	453,138,812.00	284,486,362.00

(3) 质押物明细情况

质押物类别	折扣率	期末市值
白银	80%	26,907,480.00
铝	80%	92,140,000.00
镍	80%	8,985,180.00

铅	80%	38,027,500.00
橡胶	80%	70,038,150.00
原油	80%	198,412,200.00
菜籽油 N	80%	32,685,000.00
硅铁	80%	8,438,080.00
棉花一号	80%	76,077,425.00
玉米	80%	14,712,500.00
合 计		566,423,515.00

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
为交易目的而持有的债券投资		3,200,000.00
为交易目的而持有的权益工具投资	240,417,080.03	27,993,720.00
衍生金融资产	11,084,254.96	393,254.11
合 计	251,501,334.99	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	期末的净利得 或净损失
股票	258,878,501.68	240,417,080.03	-18,461,421.65
期货、场外合约		4,460,920.37	4,460,920.37
期权		6,623,334.59	6,623,334.59
小 计	258,878,501.68	251,501,334.99	-7,377,166.69

. 在当日无负债结算制度下，本公司的期货合约每日结算，其产生的持仓损益金额已在本公司应收货币保证金以及利润表中体现，而并未反映在上述衍生金融工具项目中。截至本期末，公司持有的期货合约的浮盈为 100,189,730.16 元，浮亏为 3,449,611.19 元。截至上期末，公司持有的期货合约的的浮盈为 44,182,125.00 元，浮亏为 1,901,253.64 元。

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	2,997,113.99	5,102,313.77
合 计	2,997,113.99	5,102,313.77

(2) 应收账款

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	计提比例 (%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	3,567,197.26	100.00	570,083.27	15.98	2,997,113.99
合 计	3,567,197.26	100.00	570,083.27	15.98	2,997,113.99

(续上表)

种 类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	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	5,717,467.61	100.00	615,153.84	10.76	5,102,313.77
合 计	5,717,467.61	100.00	615,153.84	10.76	5,102,313.77

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	2,321,613.92	116,080.70	5.00
1-2 年	107,692.28	21,538.46	20.00
2-3 年	226,923.10	68,076.93	30.00
3-4 年	910,967.96	364,387.18	40.00
小 计	3,567,197.26	570,083.27	15.98

(续上表)

账 龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	4,129,576.55	206,478.83	5.00
1-2 年	676,923.10	135,384.62	20.00
2-3 年	910,967.96	273,290.39	30.00
小 计	5,717,467.61	615,153.84	10.76

3) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备-45,070.57 元。

4) 应收账款金额前 5 名情况

单位名称	账面余额	占应收账款余额的比例 (%)	坏账准备
------	------	----------------	------

上海筑欣实业有限公司	685,800.01	19.23	34,290.00
永安财富 CTA 联盟 1 号管理费	398,472.66	11.17	19,923.63
永安 CTA 联盟财富 2 号管理费	396,907.00	11.13	19,845.35
杭州大禾投资管理有限公司	390,000.00	10.93	156,000.00
上海丰范资产管理有限公司	300,000.00	8.41	105,000.00
小 计	2,171,179.67	60.87	335,058.98

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	176,567,742.44	99.99		176,567,742.44
1-2 年	17,401.60	0.01		17,401.60
合计	176,585,144.04	100.00		176,585,144.04

(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 (%)
云南农垦集团兴农农业投资有限公司	22,500,000.00	12.74
诚通发展贸易有限公司	8,561,000.00	4.85
浙江金江实业股份有限公司	7,600,000.00	4.30
河北康航贸易有限公司	6,762,334.76	3.83
中国诚通国际贸易有限公司	6,669,750.00	

		3.78
小 计	52,093,084.76	29.50

7. 应收结算担保金

(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	25,513,880.92	100.00			25,513,880.92
合 计	25,513,880.92	100.00			25,513,880.92

(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	25,513,887.40	100.00			25,513,887.40
合 计	25,513,887.40	100.00			25,513,887.40

2) 采用组合计提坏账准备的应收结算担保金

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
按信用风险特征组合计提坏账准备	25,513,880.92			25,513,887.40		
小 计	25,513,880.92			25,513,887.40		

(2) 明细情况——分客商

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	20,113,880.92	20,113,887.40
中国证券登记结算有限责任公司	5,400,000.00	5,400,000.00
合 计	25,513,880.92	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
1-2 年	17,004.09	27.28		17,004.09	45,318.40	68.46		45,318.40
2-3 年	45,318.40	72.72		45,318.40	3,879.02	5.86		3,879.02
合 计	62,322.49	100.00		62,322.49	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	13,877,742.52	13,398,157.39
应收股利	3,209.07	
其他应收款	79,606,970.37	55,882,199.77
合 计	93,487,921.96	69,280,357.16

(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	13,877,742.52	100.00		13,877,742.52
合 计	13,877,742.52	100.00		13,877,742.52

(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	13,398,157.39	100.00		13,398,157.39
合 计	13,398,157.39	100.00		13,398,157.39

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	10,761,780.82
中国民生银行香港分行	2,648,470.67
交通银行香港分行	164,729.46
青岛德广泰进出口有限公司	127,848.34
中国银行香港分行	93,511.77
小 计	13,796,341.06

3) 应收关联方利息

无

(3) 应收股利

单位名称	期末数	期初数
山东威高集团医用高分子制品股份有限公司	3,136.00	
腾讯控股有限公司	73.07	
小 计	3,209.07	

(4) 其他应收款

1) 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(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	33,508,301.60	36.49	686,415.08	2.05	32,821,886.52
按信用风险特征组合计提坏账准备	45,223,920.41	49.24	9,020,380.78	19.95	36,203,539.63
单项金额不重大但单项计提坏账准备	13,104,592.51	14.27	2,523,048.29	19.25	10,581,544.22
合 计	91,836,814.52	100.00	12,229,844.15	13.32	79,606,970.37

(续上表)

种 类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	29,392,751.70	43.69	1,469,637.58	5.00	27,923,114.12
按信用风险特征组合计提坏账准备	33,912,315.30	50.42	7,814,770.59	23.04	26,097,544.71
单项金额不重大但单项计提坏账准备	3,959,516.78	5.89	2,097,975.84	52.99	1,861,540.94
合 计	67,264,583.78	100.00	11,382,384.01	16.92	55,882,199.77

2) 期末单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
安诚数盈-安远一号量化对冲基金	19,780,000.00			理财产品清算款
万佳	13,728,301.60	686,415.08	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
小计	33,508,301.60	686,415.08	2.05	

3) 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	坏账准备	计提比例(%)
1年以内	24,854,703.82	1,242,734.83	5.00
1-2年	3,385,710.49	677,142.10	20.00
2-3年	10,273,086.20	3,081,925.86	30.00
3-4年	4,486,403.19	1,794,561.28	40.00
4年以上	2,224,016.71	2,224,016.71	100.00
小计	45,223,920.41	9,020,380.78	19.95

(续上表)

账龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1年以内	11,039,541.69	551,977.08	5.00
1-2年	12,187,735.32	2,437,547.08	20.00
2-3年	8,282,372.83	2,484,711.85	30.00
3-4年	103,551.46	41,420.58	40.00
4年以上	2,299,114.00	2,299,114.00	100.00
合计	33,912,315.30	7,814,770.59	23.04

4) 期末单项金额不重大但单项计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
陈石桥	10,460,965.82	523,048.29	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
文胜	2,000,000.00	2,000,000.00	100.00	预计无法收回
安越增益一号私募证券投资基金	626,769.00			理财产品清算款
浩期股指增强一号私募证券投资基金	16,857.69			理财产品清算款
浙江浩期资产管理有限公司	16,857.69			理财产品清算款
小计	13,121,450.20	2,523,048.29	19.23	

5) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 847,460.14 元。

6) 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
安诚数盈-安远一号量化对冲基金	理财产品认购、清算及分红款	19,780,000.00	1 年以内	21.54		否
万佳	对外拆出款	13,728,301.60	1-2 年	14.95	686,415.08	否
OSTC Yongan Trading Co., Limited	对外拆借款	1,082,731.77	1 年以内	16.60	4,626,838.53	是
		947,143.22	1-2 年			
		9,010,977.77	2-3 年			
		4,199,949.93	3-4 年			
陈石桥	对外拆出款	10,460,965.82	1 年以内	11.39	523,048.29	否
中国人民财产保险股份有限公司吉林省分公司	场外业务应收款	6,646,728.16	1 年以内	7.24	332,336.41	否
小 计		65,856,798.27		71.72	6,168,638.31	

7) 期末应收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
OSTC Yongan Trading Co., Limited	15,240,802.69	18,896,953.58	1-4 年	往来款及利息
小 计	15,240,802.69	18,896,953.58		

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	909,810,220.54	63,933,936.79	845,876,283.75
发出商品	127,622,692.26	14,587.23	127,608,105.03
合计	1,037,432,912.80	63,948,524.02	973,484,388.78

(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	60,091,575.62	934,403,294.55

发出商品	78,562,918.82	4,860,002.17	73,702,916.65
合计	1,073,057,788.99	64,951,577.79	1,008,106,211.20

(2) 期末存货账面余额中 301,129,343.50 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
			转回或转销	其他	
库存商品	64,951,577.79	285,468,583.07	286,471,636.8		63,948,524.02
小计	64,951,577.79	285,468,583.07	286,471,636.8		63,948,524.02

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	2,604,426,620.73	2,123,123,825.45
股权投资	27,540,000.00	28,040,000.00
合计	2,631,966,620.73	2,151,163,825.45

(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
理财产品	2,704,803,838.85	2,604,426,620.73	-100,377,218.12
小计	2,704,803,838.85	2,604,426,620.73	-100,377,218.12

(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		500,000.00	8,540,000.00
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		500,000.00	27,540,000.00

(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	126,250.00
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						126,250.00

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	326,610,079.92		326,610,079.92
合 计	326,610,079.92		326,610,079.92

(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
玉皇山南公司	15,016,639.70			-982,109.09	
永安国富公司	279,303,642.50			150,359,762.64	-11,304,846.92
OSTC Yongan Trading Co., Limited				1,302,952.51	-137,404.83
鞍钢商贸公司		24,500,000.00		551,443.41	
合 计	294,320,282.20	24,500,000.00		151,232,049.47	-11,442,251.75

(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		
玉皇山南公司					14,034,530.61	
永安国富公司		132,000,000.00			286,358,558.22	
OSTC Yongan Trading Co., Limited					1,165,547.68	
鞍钢商贸公司					25,051,443.41	
合 计		132,000,000.00			326,610,079.92	

13. 期货会员资格投资

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	期末数	期初数
固定资产	102,603,824.08	108,288,008.05
合计	102,603,824.08	108,288,008.05

(2) 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	67,926,948.97	22,163,034.62	199,325,702.25
本期增加金额		8,267,616.04		8,267,616.04
购置		8,267,616.04		8,267,616.04
本期减少金额		2,462,149.33	3,955,437.00	6,417,586.33
处置或报废		2,462,149.33	3,955,437.00	6,417,586.33
外币报表折算差额		187,539.58	39,038.08	226,577.66
期末数	109,235,718.66	73,919,955.26	18,246,635.70	201,402,309.62
累计折旧				
期初数	27,539,431.82	47,537,053.50	15,961,208.88	91,037,694.20
本期增加金额	3,531,354.24	8,636,894.29	1,654,866.86	13,823,115.39
计提	3,531,354.24	8,636,894.29	1,654,866.86	13,823,115.39
本期减少金额		2,406,108.05	3,836,773.89	6,242,881.94
处置或报废		2,406,108.05	3,836,773.89	6,242,881.94
外币报表折算差额		157,379.02	23,178.87	180,557.89
期末数	31,070,786.06	53,925,218.76	13,802,480.72	98,798,485.54
账面价值				
期末账面价值	78,164,932.60	19,994,736.50	4,444,154.98	102,603,824.08
期初账面价值	81,696,286.84	20,389,895.47	6,201,825.74	108,288,008.05

2) 期末中无固定资产用于担保。

3) 未办妥产权证书的固定资产的情况说明

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
浙江协作大厦 6-8 楼	1,056,478.80	尚未办妥房产证及土地使用权证
福州中盛大厦 7 层 701 室、702 室(不含部分 701	14,656,924.71	尚未办妥房产证及土地使用权证

室)		
长春伟峰彩宇新城 2204、2205 号房屋	7,766,173.52	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 8,153,949.64已办妥房产证但未办妥土地使用权证	7,809,055.84	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	3,367,826.27	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小 计	34,656,459.14	

15. 投资性房地产

(1) 明细情况

账面原值

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	4,153,902.54			4,153,902.54
小 计	4,153,902.54			4,153,902.54

累计折旧和累计摊销

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	416,638.16	134,305.32		550,943.48
小 计	416,638.16	134,305.32		550,943.48

账面价值

项 目	期初数	期末数
房屋及建筑物	3,737,264.38	3,602,959.06
合 计	3,737,264.38	3,602,959.06

(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(部分)	3,052,140.05	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)	550,819.01	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小 计	3,602,959.06	

16. 无形资产

(1) 明细情况

项 目	土地使用权	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		4,570,228.46	4,570,228.46
购置		4,570,228.46	4,570,228.46
本期减少金额			
外币报表折算差 额		72,540.00	72,540.00
期末数	261,915,921.72	40,364,517.14	302,280,438.86
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	6,547,898.04	9,096,420.95	15,644,318.99
计提	6,547,898.04	9,096,420.95	15,644,318.99
本期减少金额			
外币报表折算差 额		72,540.00	72,540.00
期末数	30,363,236.88	30,697,911.54	61,061,148.42
账面价值			
期末账面价值	231,552,684.84	9,666,605.60	241,219,290.44
期初账面价值	238,100,582.88	14,192,798.09	252,293,380.97

(2) 期末无无形资产用于担保。

17. 递延所得税资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
尚未支付的职工薪酬	84,437,196.56	38,411,517.38
可供出售金融资产公允价值变动	25,083,342.73	
存货跌价准备	15,753,134.73	16,042,115.38
预计负债	16,885,483.07	12,963,314.55
坏账准备	1,830,806.93	1,685,456.75
期货风险准备金	1,897,231.99	1,901,501.74
公允价值变动浮亏	1,165,352.61	1,081,312.56
应付期货投资者保障基金	129,115.37	126,386.68

合 计	147,181,663.99	72,211,605.04
(2) 引起暂时性差异的资产和负债项目对应的暂时性差异金额		
项 目	期末数	期初数
尚未支付的职工薪酬	337,748,786.22	153,646,069.53
可供出售金融资产公允价值变动	100,333,370.93	
存货跌价准备	63,012,538.92	64,168,461.52
预计负债	67,541,932.24	51,853,258.19
坏账准备	7,769,978.56	7,275,872.20
期货风险准备金	7,588,927.95	7,606,006.97
公允价值变动浮亏	4,661,410.45	4,333,986.23
应付期货投资者保障基金	516,461.46	505,546.72
小 计	589,173,406.73	289,389,201.36

18. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	105,461,604.70	147,773,332.48
在建工程[注]	87,245,315.29	49,308,879.59
长期待摊费用	14,308,002.80	14,008,820.25
待摊费用	19,646,119.30	20,171,009.55
买入返售金融资产	29,455,327.96	76,508,487.00
预缴所得税	10,704,697.50	5,772,710.35
预计保险理赔		10,242,172.71
其他	377,256.63	143,120.00
合 计	267,198,324.18	323,928,531.93

注：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 37,936,435.70 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	428,000,000.00	510,000,000.00
合计	428,000,000.00	560,000,000.00

20. 应付货币保证金

项目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	101,399	6,617,150,433.04	93,828	7,744,666,636.85
法人	5,637	13,238,243,382.27	5,274	14,067,908,100.75
非结算客户	3	97,131,140.35	4	110,747,595.25
合计	107,039	19,952,524,955.66	99,106	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	10	225,137,938.00	13	173,328,692.00
合计	10	225,137,938.00	13	173,328,692.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数
上海期货交易所	150,481,168.00
大连商品交易所	11,770,000.00
郑州商品交易所	60,758,210.00
上海国际能源交易中心	2,128,560.00
合计	225,137,938.00

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	4,673,758.45	4,145,179.38
结构化主体其他投资者享有的权益	983,448,863.57	128,603,420.87
合计	988,122,622.02	132,748,600.25

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	21,395,264.59	17,079.02	213,203,152.39
合 计	191,824,966.82	21,395,264.59	17,079.02	213,203,152.39

(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核销账龄三年以上的应收风险损失款。

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	16,818,922.30	24,274,821.46
合 计	16,818,922.30	24,274,821.46

(2) 应付账款

项 目	期末数	期初数
货款	16,818,922.30	24,274,821.46
小 计	16,818,922.30	24,274,821.46

25. 预收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
货款	405,987,254.94	238,522,180.47
投资咨询费	1,004,166.79	444,999.92
基金销售业务收入		201,196.74
合 计	406,991,421.73	239,168,377.13

(2) 期末预收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
鞍钢商贸公司	7,518,337.58		1 年以内	货款
小 计	7,518,337.58			

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	547,449.15	535,879.52	547,449.15

合 计	535,879.52	547,449.15	535,879.52	547,449.15
-----	------------	------------	------------	------------

(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	556,141,239.22	443,843,017.92	512,738,258.31
离职后福利—设定提存计划	16,120,530.83	48,368,975.75	42,682,464.94	21,807,041.64
辞退福利		205,604.67	205,604.67	
合 计	416,560,567.84	604,715,819.64	486,731,087.53	534,545,299.95

(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	483,477,192.16	368,634,203.36	488,425,020.86
职工福利费	2,772.00	12,832,990.11	12,835,762.11	
社会保险费	16,055,913.21	30,721,922.27	33,029,642.68	13,748,192.80
其中：医疗保险费	412,834.79	13,548,717.88	13,521,970.79	439,581.88
补充医疗保险	15,600,000.00	15,056,661.44	17,406,661.44	13,250,000.00
工伤保险费	7,179.74	325,499.53	324,306.28	8,372.99
生育保险费	35,898.68	1,345,952.92	1,331,613.67	50,237.93
其 他		445,090.50	445,090.50	
住房公积金	579,314.00	18,768,452.70	18,666,284.70	681,482.00
工会经费和职工教育经费	10,220,005.74	10,340,681.98	10,677,125.07	9,883,562.65
小 计	400,440,037.01	556,141,239.22	443,843,017.92	512,738,258.31

(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	22,657,133.17	22,573,605.49	586,109.17
失业保险费	17,949.34	752,732.60	749,749.47	20,932.47

补充养老保险	15,600,000.00	24,959,109.98	19,359,109.98	21,200,000.00
小 计	16,120,530.83	48,368,975.75	42,682,464.94	21,807,041.64

28. 应交税费

项 目	期末数	期初数
增值税	2,599.42	1,285,700.96
企业所得税	143,190,506.98	143,076,416.89
代扣代缴个人所得税	2,214,977.60	3,448,291.94
城市维护建设税	63,983.79	66,237.70
教育费附加	27,421.61	28,387.55
地方教育附加	18,173.07	18,924.28
其 他	275,233.99	412,912.96
合 计	145,792,896.46	148,336,872.28

29. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付利息	612,626.00	9,453,253.06
应付股利	157,200,000.00	196,500,000.00
其他应付款	304,227,679.45	362,643,645.18
合 计	462,040,305.45	568,596,898.24

(2) 应付利息

项 目	期末数	期初数
次级债券利息		8,715,452.06
短期借款利息	612,626.00	737,801.00
合 计	612,626.00	9,453,253.06

(3) 应付股利

项 目	期末数	期初数
普通股股利	157,200,000.00	196,500,000.00
合 计	157,200,000.00	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	1,023,763.63	1,500,959.27
经营层风险金	8,415,804.41	6,942,181.70
交易所质押款	228,000,874.00	111,157,670.00
场外业务应付款	50,112,756.79	228,714,502.93
其他	16,674,480.62	14,328,331.28
合计	304,227,679.45	362,643,645.18

2) 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	768,009.80	IB 业务费
小计	768,009.80	

3) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
上海国际能源交易中心质押款	156,601,200.00	质押款
上海期货交易所质押款	38,397,480.00	质押款
郑州商品交易所质押款	33,002,194.00	质押款
河北正大玻璃有限公司	10,000,000.00	押金保证金
上海芮广国际贸易有限公司	8,974,006.00	场外期权权利金
小计	246,974,880.00	

4) 其他应付款——外币其他应付款

币种	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
HKD	1,807,017.68	0.8762	1,583,308.89	1,594,001.90	0.8359	1,332,426.19
小计			1,583,308.89			1,332,426.19

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	68,429,437.53	51,946,333.29
未决诉讼	435,984.37	417,623.47
合计	68,865,421.90	52,363,956.76

(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, 新永安期货公司收到来自 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 435,984.37 元。

31. 递延所得税负债

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
可供出售金融资产公允价值变动		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	18,398,329.89	11,176,105.06
合 计	18,398,329.89	90,207,977.00

(2) 引起暂时性差异的资产和负债项目对应的暂时性差异金额

项 目	期末数	期初数
可供出售金融资产公允价值变动		316,127,487.74
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	73,641,076.44	44,634,584.11
合 计	73,641,076.44	360,762,071.85

32. 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
合 计		430,000,000.00

33. 股本

(1) 增减变动

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

(2) 期末股东所持股份的质押或冻结情况

无。

(3) 持股 10% (含 10%) 以上的法人股东情况

股东单位名称	法定代表人	经营范围	行业类别	注册资本
财通证券股份有限公司	陆建强	发行主要从事证券经纪业务、投资银行业务、资产管理业务、证券自营业务、证券信用业务以及研究业务。	券商信托	35.89 亿
浙江省产业基金有限公司	杜祖国	实业投资，投资管理。	金融业	200 亿
浙江东方金融控股集团股份有限公司	金朝萍	资产管理；实业投资、私募股权投资及投资管理；企业管理咨询服务。	国际贸易	8.74 亿
浙江省经济建设投资有限公司	麻亚峻	经济建设项目的投资、开发、经营，房地产的投资；金属材料，化工原料及产品(不含危险品)，建筑材料，纺织原料，橡胶及制品，木材，胶合板，造纸原料，矿产品，机电设备的销售。	租赁和商务服务业	41963.02 万
浙江省协作大厦有限公司	林瑛	实业投资，物业管理，自有房屋租赁，金属材料、木材、建筑材料、化工原料及产品(不含化学危险品和易制毒品)、橡胶材料及制品、纺织品及原料、五金交电、汽车配件、饲料、农副产品(不含食品)的销售。	房地产业	1.5 亿

34. 资本公积

(1) 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

35. 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
将重分类进损益的其他综合收益	244,586,806.06	-61,952,145.55	346,412,728.78
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	5,173,590.18	-11,304,846.92	
可供出售金融资产公允价值变动损益	239,806,845.80	-70,048,129.89	346,412,728.78
外币财务报表折算差额	-393,629.92	19,400,831.26	
其他综合收益合计	244,586,806.06	-61,952,145.55	346,412,728.78

(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	
将重分类进损益的其他综合收益	-104,115,214.67	-304,249,659.66		-59,662,853.60

其中：权益法下可转损益的其他综合收益		-11,304,846.92		-6,131,256.74
可供出售金融资产公允价值变动损益	-104,115,214.67	-312,345,644.00		-72,538,798.20
外币财务报表折算差额		19,400,831.26		19,007,201.34
其他综合收益合计	-104,115,214.67	-304,249,659.66		-59,662,853.60

36. 盈余公积

(1) 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	67,858,855.68		296,991,371.55
合计	229,132,515.87	67,858,855.68		296,991,371.55

(2) 盈余公积本期增减原因及依据说明

本期增加系本公司根据章程规定，按母公司当期净利润的10%计提法定盈余公积。

37. 一般风险准备

(1) 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	67,858,855.68		356,882,385.48
合计	289,023,529.80	67,858,855.68		356,882,385.48

(2) 本期计提方法和比例说明

本期增加系本公司根据章程规定，按母公司当期净利润的10%计提一般风险准备。

38. 未分配利润

项目	金额	提取或分配比例
期初未分配利润	1,987,807,871.64	
加：本期归属于母公司所有者的净利润	872,197,337.15	
减：提取法定盈余公积	67,858,855.68	母公司净利润的10%
提取一般风险准备	67,858,855.68	母公司净利润的10%
应付普通股股利	157,200,000.00	
期末未分配利润	2,567,087,497.43	

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费净收入	166,793,726.93	209,296,802.94
交易所减收手续费收入	306,862,795.76	319,154,261.01
资产管理业务收入	10,183,394.38	14,992,345.10
投资咨询业务收入	6,291,242.47	13,506,897.33
基金销售业务收入	44,123,805.75	36,397,217.97
合 计	534,254,965.29	593,347,524.35

(2) 分行政区域分支机构及手续费收入情况

行政区域名称	分支机构家数	手续费收入金额
杭州本部		408,597,416.54
香港特别行政区[注]		36,630,566.76
浙江省(不含杭州本部)	14	34,433,471.13
辽宁省	3	7,751,869.55
山东省	7	6,752,045.11
北京市	1	6,157,751.60
广东省	2	5,497,894.73
上海市	1	5,270,181.37
福建省	2	3,273,304.53
河南省	1	2,659,104.89
江苏省	2	2,634,251.40
吉林省	1	2,630,775.63
天津市	1	2,340,012.16
重庆市	1	2,256,891.27
河北省	2	1,979,034.02
湖北省	1	1,757,746.53
四川省	1	1,450,867.18
湖南省	1	1,226,805.22
江西省	1	954,975.67
合 计	42	534,254,965.29

2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	639,545,275.16	615,381,251.86
其中：境内保证金存款利息收入	585,437,094.25	565,495,162.41
境外利息收入	27,248,295.02	22,000,595.32
境内其他利息收入	26,859,885.89	27,885,494.13
利息支出	69,856,839.65	91,143,439.97
利息净收入	569,688,435.51	524,237,811.89

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	153,509,885.56	205,968,886.40
持有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	8,306,722.37	174,363.32
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	500,535,941.85	435,704,673.63
可供出售金融资产在持有期间的投资收益	348,394,784.51	257,206,439.17
处置可供出售金融资产取得的投资收益	-1,982,055.73	20,106,298.54
减：结构化主体其他投资者享有的收益	87,598,034.40	14,195,224.94
其他		15,749.87
合 计	921,167,244.16	904,981,185.99

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	46,332,896.52	43,153,642.03
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	64,690,410.51	42,285,875.07
合 计	46,332,896.52	43,153,642.03

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	13,671,612,382.29	7,509,893,265.03

租赁收入	228,963.13	138,790.08
交易所课题费、活动费等收入	10,246,613.78	8,878,969.69
其他	2,076,116.19	1,455,796.68
合计	13,684,164,075.39	7,520,366,821.48

6. 资产处置收益

项目	本期数	上年同期数
非流动资产处置收益	347,653.10	
合计	347,653.10	

7. 其他收益

项目	本期数	上年同期数
政府补助	3,824,232.17	4,661,340.80
个税手续费返还	1,156,100.07	984,360.81
合计	4,980,332.24	5,645,701.61

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。

8. 税金及附加

项目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	1,439,339.91	1,666,621.22
教育费附加	616,740.15	714,314.59
地方教育附加	410,283.43	475,991.63
印花税	2,002,087.90	1,228,508.82
房产税	998,434.50	1,053,529.42
其他	99,635.00	236,352.56
合计	5,566,520.89	5,375,318.24

9. 业务及管理费

业务及管理费金额前 10 名明细项目情况

项目	本期数	上年同期数
职工薪酬	604,715,819.64	625,939,222.75

仓储费	40,148,976.46	37,277,315.38
租赁费	38,107,219.20	32,029,572.30
“保险+期货”业务费用	40,672,901.86	
无形资产摊销	15,644,318.99	14,912,417.25
折旧费	13,823,115.39	14,295,390.36
差旅费	13,810,502.86	12,328,606.74
运输费	13,583,288.77	1,109,935.52
通讯费	10,691,283.90	11,557,667.45
业务招待费	10,487,912.40	10,569,013.34
小计	801,685,339.47	760,019,141.09

11. 资产减值损失

项目	本期数	上年同期数
坏账损失	122,063.31	3,506,982.61
存货跌价损失	268,204,748.78	243,395,962.36
应收货币保证金减值损失	1,695,073.98	-14,893,507.58
合计	270,021,886.07	232,009,437.39

12. 其他业务成本

项目	本期数	上年同期数
销售货物成本	13,478,989,111.55	7,247,021,831.37
投资性房地产成本	134,305.32	130,135.54
合计	13,479,123,416.87	7,247,151,966.91

13. 营业外收入

项目	本期数	上年同期数
合同违约及赔付收入	24,229,972.60	
非流动资产毁损报废利得		1,864.35
其他	137,610.42	1,362,891.81
合计	24,367,583.02	1,364,756.16

14. 营业外支出

项目	本期数	上年同期数
----	-----	-------

非流动资产毁损报废损失	80,711.38	76,920.43
待执行亏损合同	16,399,892.24	48,990,111.08
残疾人就业保障基金	1,378,932.10	1,403,014.45
地方水利建设基金	6,215.35	15,757.89
捐赠支出	4,140,700.00	5,380,000.00
罚款及滞纳金	986,267.86	564,580.36
存货损毁		19,760,127.81
其他	168,395.51	3,312,152.14
合计	23,161,114.44	79,502,664.16

15. 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	283,507,427.90	258,672,963.46
递延所得税费用	-42,671,379.29	-33,635,946.54
合计	240,836,048.61	225,037,016.92

(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	1,113,033,385.76	1,147,106,572.25
按母公司适用税率计算的所得税费用	278,258,346.44	286,776,643.06
子公司适用不同税率的影响	-3,514,590.80	-5,943,633.31
调整以前期间所得税的影响	2,902,621.03	775,598.41
非应税收入的影响	-44,367,778.77	-59,400,412.30
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	1,263,392.24	8,313,010.90
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-564,688.99	-5,933,482.43
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	6,858,747.46	449,292.59
所得税费用	240,836,048.61	225,037,016.92

16. 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
交易所保证金净额	2,902,161,949.10	760,941,920.99
违约金及保险赔付收入	24,229,972.60	
其他现金流入	20,623,439.83	17,523,289.72
合 计	2,947,015,361.53	778,465,210.71

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
客户保证金净额	3,884,879,842.47	3,419,154,795.58
保证金及定期存款增加	18,630,999.49	812,949,917.74
往来款净额	129,457,789.94	122,279,484.12
其他现金流出	5,150,277.86	9,462,943.56
为交易目的而持有的金融资产净增加额	236,383,772.03	
合 计	4,274,502,681.79	4,363,847,141.00

3. 收到其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
对外拆借款收回	6,907,526.53	
合 计	6,907,526.53	

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
合并结构化主体收到的现金	767,247,408.30	
借款保证金的减少	7,000,000.00	
合 计	774,247,408.30	

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
-----	-----	-------

合并结构化主体清算支付的现金		68,512,094.38
次级债归还		200,000,000.00
借款保证金的增加		50,000,000.00
合 计		318,512,094.38

6. 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

补充资料	2018 年度	2017 年度
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	872,197,337.15	922,069,555.33
加: 提取期货风险准备金	21,395,264.59	24,751,281.94
资产减值准备	270,021,886.07	232,009,437.39
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	13,957,420.71	14,425,525.90
无形资产摊销	15,644,318.99	14,912,417.25
长期待摊费用摊销	7,402,286.32	6,423,318.06
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”号填列)	-347,653.10	
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	80,711.38	75,056.08
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-46,332,896.52	-43,153,642.03
财务费用(收益以“-”号填列)	45,259,565.93	55,344,491.49
投资损失(收益以“-”号填列)	-66,038,101.16	-191,810,911.46
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	-49,886,716.22	-43,269,058.44
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	7,222,224.83	9,633,111.91
存货的减少(增加以“-”号填列)	-233,582,926.36	-773,289,451.69
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-4,970,684,864.82	-612,806,232.74
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	3,022,349,748.52	-3,115,307,616.38
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-1,091,342,393.69	-3,499,992,717.39
2) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
债务转为资本		

一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3) 现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	13,919,415,645.30	14,977,076,309.32
减: 现金的期初余额	14,977,076,309.32	18,722,837,619.47
加: 现金等价物的期末余额		
减: 现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	-1,057,660,664.02	-3,745,761,310.15

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	期末数	期初数
1) 现金	13,919,415,645.30	14,977,076,309.32
其中: 库存现金	20,185.76	10,292.55
可随时用于支付的银行存款	13,890,602,677.93	14,970,201,550.63
可随时用于支付的其他货币资金	28,792,781.61	6,864,466.14
可用于支付的存放中央银行款项		
存放同业款项		
拆放同业款项		
2) 现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		
3) 期末现金及现金等价物余额	13,919,415,645.30	14,977,076,309.32
其中: 母公司或集团内子公司使用受限制的现金及现金等价物		

(3) 现金流量表补充资料的说明

2018 年度现金流量表中现金期末数为 13,919,415,645.30 元, 2018 年 12 月 31 日资产负债表中货币资金期末数为 15,100,136,062.53 元, 差额 1,180,720,417.23 元, 系现金流量表现金期末数扣除了不符合现金及现金等价物标准的借款保证金、保函保证金、信用证保证金、远期结售汇保证金、和定期存款。

(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
经济发展专项资金	2,589,000.00	其他收益	浦东新区财政局根据企业对浦东新区的贡献程度给

			与企业的奖励
出疆棉花运费补贴	717,700.00	其他收益	新疆维吾尔自治区财政对出疆棉花的运费补贴
稳岗补贴	347,598.17	其他收益	对稳定就业企业给予失业保险金返还
房租物业费补助	56,000.00	其他收益	杭州市拱墅区财政局房租物业费补助
金融业扶持资金	50,000.00	其他收益	台州市金融办支持金融业发展一次性奖励款
房屋装修补贴	35,000.00	其他收益	长沙市政府购房及房屋装修补贴款
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
失业保险基金	8,934.00	其他收益	温州市就业管理服务局失业保险基金返还
小 计	3,824,232.17		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 3,824,232.17 元。

七、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
玉皇山南公司	永安资本公司之联营公司
鞍钢商贸公司	永安资本公司之联营企业
敦和资产管理有限公司	该公司董事长、法定代表人曾在过去十二个月内任本公司总经理、法定代表人[注]

注：截止本期 4 月末，敦和资产管理有限公司董事长、法定代表人已从本公司离职满十二个月，因此本期 1-4 月将该公司认定为关联方。

(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. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

(1) 明细情况

1) 采购商品和接受劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	2018 年度	2017 年度
鞍钢商贸公司	货物	6,244,473.27	
国富实业公司	货物	16,621,904.13	
财通证券公司	IB 业务佣金	8,149,469.29	11,379,746.92

2) 出售商品和提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	2018 年度	2017 年度
鞍钢商贸公司	货物	32,881,922.14	
国富实业公司	货物	5,229,154.49	
财通基金公司	投资咨询服务	45,789.14	880,345.74
永安国富公司	投资咨询服务		2,830,188.68
永安国富公司	代销基金产品服务	13,378,260.99	10,281,995.28
玉皇山南公司	代销基金产品服务	16,337.96	441,751.68
财通基金公司	代销基金产品服务	38,781.17	443,353.88
敦和资管公司	代销基金产品服务	24,942.34	1,556,949.59

3. 关联方在本公司开设期货账户，从事期货交易，关联交易明细如下：

客户名称	期末数权益	2018 年手续费收入
财通证券公司	54,825,037.76	24,796.83
协作大厦公司	20.82	18,237.53
永安国富公司	1,533,576,714.85	1,381,706.34
国富实业公司	23,904,201.54	9,879.30
永安咨询公司	1,011.00	
鞍钢商贸公司	1,599,822.49	761.10

财通基金公司	1,010.00	
财通资管公司	26,962,621.38	1,395.25
玉皇山南	9,551,715.49	2,679.87
敦和资产		2,083,525.29
小计	1,650,422,155.33	3,522,981.51

4. 本公司及子公司持有关联方作为管理人募集设立的资产管理计划、基金，明细情况如下：

证券名称	管理人	期末数 账面价值
永安国富-永富1号资产管理计划	永安国富公司	25,372,772.44
永安国富-永富3号私募基金	永安国富公司	681,563,493.50
永安国富-永富10号私募证券投资基金	永安国富公司	205,284,708.27
永安国富-FOF1号私募投资基金	永安国富公司	71,040,000.00
永安国富-稳健5号私募投资基金	永安国富公司	49,854,704.92
永安国富-稳健6号私募基金	永安国富公司	384,507,230.00
永安国富-永富12号私募基金	永安国富公司	4,450,000.00
永安国富-永富15号私募基金	永安国富公司	4,405,000.00
财通资管鑫管家货币B	财通资管公司	52,317,150.61
小计		1,478,795,059.74

5. 关联方持有本公司作为管理人募集设立的资产管理计划，明细情况如下：

证券名称	持有人	期末数 持有份额
永利2号资产管理计划	财通证券公司	100,000,000.00
永安期货工银量化恒盛精选A类25期	永安国富公司	20,000,000.00
永安定向FOF一号	本公司董监高及其关系密切的家庭成员、直接或间接控制本公司的法人的董监高	2,300,000.00
永安期货CTA联盟2号FOF集合资产管理计划		5,500,000.00
永利1号资产管理计划		17,201,125.64
永利2号资产管理计划		4,700,000.00
永泰1号资产管理计划		4,000,000.00
小计		153,701,125.64

6. 在财通证券公司开户从事股票交易

(1) 本公司及子公司在财通证券公司开户从事股票交易，关联交易明细情况如下：

公 司	期末数资金余额	2018 年证券交易费
本公司	685.85	
上海瑞萌公司		4,266.28
中邦实业公司		532.59
合 计	685.85	4,798.87

(2) 本公司管理的产品在财通证券公司开户从事股票交易，发生证券交易手续费如下：

关联方	2018 年度	2017 年度
财通证券公司	724,107.28	1,215,326.65

7. 关联方资金拆借

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 100 万美元。永安商贸公司本期计提利息折合人民币为 1,082,731.77 元。

8. 关键管理人员报酬

项 目	2018 年度	2017 年度
关键管理人员报酬	2,678.13 万元	2,562.74 万元

9. 永安资本与关联方发生场外期权交易，取得投资收益明细如下：

关联方	2018 年度	2017 年度
财通证券	-2,713,680.00	
鞍钢永安	2,246,883.70	

10. 共同投资

2017 年，永安资本同浙江财通资本投资有限公司、宁波财通涌创投资管理有限公司共同投资了杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业(有限合伙)。其中永安资本投资 300 万元，系有限合伙人；浙江财通资本投资有限公司投资 1,990 万元，系有限合伙人；宁波财通涌创投资管理有限公司投资 10 万元，系普通合伙人。

八、与金融工具相关的风险

本公司从事风险管理的目标是在风险和收益之间取得平衡，将风险对本公司经营业绩的负面影响降至最低水平，使股东和其他权益投资者的利益最大化。基于该风险管理目标，本公司风险管理的基本策略是确认和分析本公司面临的各种风险，建立适当的风险承受底线和进行风险管理，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围内。

本公司在日常活动中面临各种与金融工具相关的风险，主要包括信用风险、流动风险及

市场风险。管理层已审议并批准管理这些风险的政策，概括如下。

（一）信用风险

公司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. 基差贸易业务中，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；
10. 场外衍生品业务中，客户在交易和结算的过程中不能或不愿意履行合同承诺的风险。

为控制该项风险，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，包括交易、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。各业务部门、各分支机构在公司相应职能部门的指导下，严格按照内部控制要求执行，主动做好本部门、分支机构的风险管理工作，防范各类潜在风险。在基差贸易业务和场外衍生品业务中，建立完善的客户、仓储企业资信调查制度，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。

（二）流动风险

流动风险，是指本公司在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。流动风险可能源于无法尽快以公允价值售出金融资产；或者源于对方无法偿还其合同债务；或者源于提前到期的债务；或者源于无法产生预期的现金流量。

为控制该项风险，本公司及子公司综合运用发债、票据融资、银行借款等多种融资手段，并采取长、短期融资方式适当结合，优化融资结构的方法，保持融资持续性与灵活性之间的平衡。本公司已从多家商业银行取得银行授信额度以满足营运资金需求和资本开支。

金融负债按剩余到期日分类

项 目	期末数				
	账面价值	未折现合同金额	1 年以内	1-3 年	3 年以上
银行借款	428,000,000.00	436,769,026.04	436,769,026.04		
应付货币保证金	19,952,524,955.66	19,952,524,955.66	19,952,524,955.66		
应付质押保证金	225,137,938.00	225,137,938.00	225,137,938.00		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	988,122,622.02	988,122,622.02	988,122,622.02		
应付账款	16,818,922.30	16,818,922.30	16,818,922.30		
其他应付款	462,040,305.45	462,040,305.45	462,040,305.45		
小计	22,072,644,743.43	22,081,413,769.47	22,081,413,769.47		

(续上表)

项 目	期初数				
	账面价值	未折现合同金额	1 年以内	1-3 年	3 年以上
银行借款	560,000,000.00	576,627,591.11	576,627,591.11		
应付货币保证金	21,923,322,332.85	21,923,322,332.85	21,923,322,332.85		
应付质押保证金	173,328,692.00	173,328,692.00	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	132,748,600.25	132,748,600.25	132,748,600.25		
应付账款	24,274,821.46	24,274,821.46	24,274,821.46		
其他应付款	568,596,898.24	568,596,898.24	568,596,898.24		
其他负债	430,000,000.00	444,504,547.94	444,504,547.94		
小 计	23,812,271,344.80	23,843,403,483.85	23,843,403,483.85		

(三) 市场风险

市场风险指因利率、汇率、商品价格、权益价格/净值等的变动而导致所持有的金融工具价值产生潜在损失的风险。公司的市场风险主要源于持有各类金融工具的价格波动、期货经纪业务客户损失导致的公司自有资金受损、期货投资咨询业务分析错误、资产管理业务投资失误及基差贸易等。

针对市场风险，公司已建立了风险提示和预警机制，并定期或不定期通过敏感性分析和压力测试对公司的市场风险承受能力进行评估；通过对客户保证金水平的动态检测，实时跟踪客户实际交易风险，对存在交易市场风险的客户及时采取要求追加保证金、甚至强制平仓的应对措施。通过实时检测客户交易品种的集中度，提示和引导交易客户持仓和交易品种的合理化。此外，公司还建立了市场风险隔离墙制度，对公司各业务的人员、信息、物理、财务账户等进行隔离，防止市场风险蔓延到公司其他业务模块。

1. 利率风险

利率风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本公司面临的市场利率变动的风险主要与本公司以浮动利率计息的借款有关。

截至 2018 年 12 月 31 日，本公司以浮动利率计息的银行借款人民币为 0 元(2017 年 12 月 31 日：人民币 0 元)，在其他变量不变的假设下，假定利率变动 50 个基准点，不会对本公司的利润总额和股东权益产生重大的影响。

2. 外汇风险

外汇风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本公司面临的汇率变动的风险主要与本公司外币货币性资产和负债有关。对于外币资产和负债，如果出现短期的失衡情况，本公司会在必要时按市场汇率买卖外币，以确保将净风险敞口维持在可接受的水平。

3. 价格风险

本公司的价格风险主要包括股票、基金、期货、资产管理计划、基差贸易中存货或远期合同、场外业务等品种价格或波动率的变化等而导致的风险。针对各种风险资产，公司制定相关投资管理制度，在风险资产价格偏离一定价格水平时采取适当措施，以确保风险维持在可接受的水平。

九、其他重要事项

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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	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. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	340,606,810.19	11,084,254.96		351,691,065.15
交易性金融资产	340,606,810.19	11,084,254.96		351,691,065.15
权益工具投资	240,417,080.03			240,417,080.03
衍生金融资产 [注]	100,189,730.16	11,084,254.96		111,273,985.12
2. 可供出售金融资产	163,094,161.67	2,441,332,459.06	27,540,000.00	2,631,966,620.73
权益工具投资	163,094,161.67	2,441,332,459.06	27,540,000.00	2,631,966,620.73
持续以公允价值计量的资产总额	503,700,971.86	2,452,416,714.02	27,540,000.00	2,983,657,685.88
5. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	8,110,661.64	983,461,571.57		991,572,233.21
(1) 交易性金融负债	8,110,661.64	12,708.00		8,123,369.64

衍生金融负债 [注]	8,110,661.64	12,708.00		8,123,369.64
(2) 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		983,448,863.57		983,448,863.57
结构化主体其他投资者享有的权益		983,448,863.57		983,448,863.57
持续以公允价值计量的负债总额	8,110,661.64	983,461,571.57		991,572,233.21

说明：

1. 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：根据二级市场公开报价确认该计量项目的市价。

2. 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。

3. 持续和非持续第三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：采用特定估值技术确定公允价值，采用的重要参数包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的股票波动率、使用自身数据作出的财务预测等。

（四）截至 2018 年期末，公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有公司的 2,485 万股股份出质。公司股东协作大厦将其持有公司的 5,160 万股股份出质。

十、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	1,430,565,602.19		1,430,565,602.19
对联营企业投资	286,358,558.22		286,358,558.22
合 计	1,716,924,160.41		1,716,924,160.41

（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	1,000,000,000.00
中邦实业公司	100.00	100.00	251,984,002.19
小计			1,430,565,602.19

(3) 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
永安国富公司	279,303,642.50			150,359,762.64	-11,304,846.92
合计	279,303,642.50			150,359,762.64	-11,304,846.92

(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			286,358,558.22	
合计		132,000,000.00			286,358,558.22	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费净收入	130,655,630.97	175,825,486.71
交易所减收手续费	297,249,660.75	319,154,261.01
期货投资咨询收入	5,811,067.36	13,395,882.15
资产管理业务收入	16,327,297.53	15,722,414.41
基金销售业务收入	44,123,805.75	36,397,217.97
合计	494,167,462.36	560,495,262.25

(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		405,140,480.37
浙江省(不含杭州本部)	14	34,433,471.13
辽宁省	3	7,751,869.55
山东省	7	6,752,045.11

北京市	1	6,157,751.60
广东省	2	5,497,894.73
上海市	1	5,270,181.37
福建省	2	3,273,304.53
河南省	1	2,659,104.89
江苏省	2	2,634,251.40
吉林省	1	2,630,775.63
天津市	1	2,340,012.16
重庆市	1	2,256,891.27
河北省	2	1,979,034.02
湖北省	1	1,757,746.53
四川省	1	1,450,867.18
湖南省	1	1,226,805.22
江西省	1	954,975.67
合 计	42	494,167,462.36

2. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
成本法核算的长期股权投资收益		162,836,003.69
权益法核算的长期股权投资收益	150,359,762.64	209,439,510.15
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	330,413,352.62	233,900,235.67
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
处置可供出售金融资产取得的投资收益	-3,037,976.73	4,618,881.51
合 计	477,735,138.53	610,756,723.11

十一、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	266,941.72	
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）	3,824,232.17	

计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,082,731.77	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	16,103,213.97	
小 计	21,277,119.63	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	5,515,478.43	
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	15,761,641.20	

（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	14.92	0.67	0.67
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	14.65	0.65	0.65

2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	2018 年度	
归属于公司普通股股东的净利润	A	872,197,337.15	
非经常性损益	B	15,761,641.20	
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	856,435,695.95	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	5,561,419,653.52	
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	157,200,000.00	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H		
其他	权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	I1	-11,304,846.92
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	6
	可供出售金融资产公允价值变动	I2	-312,345,644.00
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	6
	外币报表折算差额变动	I3	19,400,831.26
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	6
报告期月份数	K	12	

加权平均净资产	$L = \frac{D+A/2+E \times F/K - G \times H/K \pm I \times J/K}{K}$	5,845,393,492.27
加权平均净资产收益率	$M=A/L$	14.92%
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	$N=C/L$	14.65%

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	872,197,337.15
非经常性损益	B	15,761,641.20
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	856,435,695.95
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	12
发行在外的普通股加权平均数	$L = \frac{D+E+F \times G/K - H \times I/K - J}{K}$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.67
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.65

(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。

永安期货股份有限公司
二〇二〇年十二月九日

附：

备查文件目录

（一）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。

（二）载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。

（三）年度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稿。

文件备置地址：

杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼