



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司

Yongan Futures Co.,Ltd.

半年度报告

— 2020 —

## 公司半年度大事记

2020年1月，公司向浙江大学教育基金会捐款200万元，纳入“浙江大学教育基金会医学院附属第一医院新型冠状病毒肺炎疾病专项基金”统一管理，用于支持该院采购防控疫情所需医疗用品和救治所需医疗设备，推动传染病学科的研究与发展。

2020年1月，郑州商品交易所表彰2019年度优秀会员。公司荣获优秀会员奖、产业服务优秀会员奖及人才培育优秀会员奖；子公司浙江永安资本管理有限公司荣获2019年度优秀风险管理子公司奖。

2020年3月，上海期货交易所表彰2019年度优秀会员。公司荣获上海期货交易所优秀会员金奖以及多项品种产业服务奖，荣获上海国际能源中心优秀会员奖。

2020年3月，中国金融期货交易所表彰2019年度优秀会员。公司荣获优秀会员白金奖、产品拓展奖（股指期货类、国债期货类）、业务创新奖及技术管理奖。

2020年3月，大连商品交易所表彰2019年度优秀会员。公司荣获优秀会员金奖、优秀产业服务奖、优秀机构服务奖、优秀农产品服务奖、优秀化工产品服务奖、优秀黑色产品服务奖、优秀期权市场服务奖、优秀国际市场服务奖及优秀技术支持奖。

2020年6月，在上海期货交易所2019年“保险+期货”精准扶贫项目评审中，公司与子公司浙江永安资本管理有限公司联合中国人民财产保险股份有限公司北京分公司、云南省分公司及部分橡胶加工企业在国家级贫困县云南省勐腊县开展的2019年天然橡胶“保险+期货+订单收购”精准扶贫项目荣获一等奖。

# 目 录

第一节	重要提示、目录和释义 .....	4
第二节	公司概况 .....	11
第三节	会计数据和经营情况 .....	13
第四节	重大事件 .....	35
第五节	股份变动和融资 .....	39
第六节	董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况 .....	43
第七节	财务会计报告 .....	46
第八节	备查文件目录 .....	126

## 第一节 重要提示、目录和释义

公司实际控制人、董事、监事、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黄峥嵘及会计机构负责人（会计主管人员）黄峥嵘保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本半年度报告未经会计师事务所审计。

本半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当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
是否存在控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员对半年度报告内容存在异议或无法保证其真实、准确、完整	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未出席董事会审议半年度报告的董事	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未按要求披露的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否审计	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

**【重大风险提示表】**

重大风险事项名称	重大风险事项简要描述
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，公司经纪业务可能面临着盈利下降风险。
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。公司的客户保证金规模、自有资金规模和市场利率的变化将影响公司的营业收入和净利润。如果市场利率出现大幅下降，或者客户保证金、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。此外，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，导致期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广。若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难以取得实质性起色。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业务的激烈竞争。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、绩效机制及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，在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受市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当及人员操作失误等

	原因无法达到预期收益，甚至遭受损失，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类似业务的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广及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与业务经验、人才储备和经营管理水平等不相匹配情况，从而导致因产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位及风险管理和内控措施不健全而带来的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、应对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，配置范围包括权益、商品、债券、信托等。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的市场风险和操作风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损从而影响公司盈利的可能。
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。目前中国证券监督管理委员会根据监管需要，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。分类评价结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标。如果公司未来评级出现下调，可能对公司现有业务开展、新业务申请等方面产生不利影响。
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，其安全性、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

	<p>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。但是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。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、数据丢失与泄露等风险。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持续升级和扩展，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义务的风险；（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，促成期货公司和客户订立期货经纪合同，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。由于目前期货监管体系并未形成</p>

	<p>居间业务的统一规定，且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，可能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。如果公司对居间人管理不当，发生上述情形，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。</p>
<p>12.人才流失和储备不足风险</p>	<p>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，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。若公司流失关键优秀管理人员和专业人才，可能会对公司的经营发展造成一定影响。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。</p>
<p>13.政策风险</p>	<p>公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家法律、法规及规范性文件的约束。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，期货市场快速发展，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。</p>
<p>14.重大诉讼、仲裁风险</p>	<p>截至报告期末，公司无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的</p>



	风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现相关诉讼或仲裁，可能会对公司经营带来不利影响。
15.商标风险	公司使用中的永安期货 YONGAN FUTURE 标识尚未取得商标专用权，在使用过程中，可能会引起法律纠纷，从而使公司声誉遭到损害，并对公司的业务开展及整体经营战略布局带来不利影响。
本期重大风险是否发生重大变化：	否

是否存在被调出创新层的风险

是 否 不适用

释义

释义项目		释义
公司、本公司、股份公司、永安期货	指	永安期货股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
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
永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安国际金融	指	YONGANINTERNATIONAL FINANCIAL (SINGAPORE) PTE. LTD
玉皇山南	指	浙江玉皇山南投资管理有限公司
鞍钢商贸	指	鞍钢永安商品贸易有限公司
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
省财开	指	浙江省财务开发有限责任公司
省金控	指	浙江省金融控股有限公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
浙江东方	指	浙江东方金融控股集团股份有限公司
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
浙江国油能源	指	浙江国油能源有限公司
永安全球基金	指	永安全球基金独立投资组合公司
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	2020年1月1日-2020年6月30日
报告期末	指	2020年6月30日
IB业务	指	证券公司为本公司提供中间介绍服务业务
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本半年度报告中，部分合计数与加总数在尾数上可能略有差异，系四舍五入造成。

## 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. YONGAN FUTURES
证券简称	永安期货
证券代码	833840
法定代表人	葛国栋

### 二、 联系方式

董事会秘书	马冬明
是否具备全国股转系统董事会秘书 任职资格	是
联系地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼
电话	0571-86672053
传真	0571-88388193
电子邮箱	yaqh@yafco.com
公司网址	www.yafco.com
办公地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、 1102 室、1104 室、16-17 层、2604 室
邮政编码	310016
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司半年度报告备置地	公司董事会秘书办公室

### 三、 企业信息

股票交易场所	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）	金融业（J）-资本市场服务（J67）-期货市场服务（J672）- 其他期货市场服务（J6729）
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。
普通股股票交易方式	集合竞价交易
普通股总股本（股）	1,310,000,000
优先股总股本（股）	0
控股股东	无
实际控制人及其一致行动人	实际控制人为浙江省财政厅

#### 四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	9133000010002099X5	否
注册地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1102 室、1104 室、16-17 层、2604 室	是
注册资本（元）	1,310,000,000	否

#### 五、 中介机构

主办券商（报告期内）	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
主办券商（报告披露日）	中信证券

#### 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 会计数据和经营情况

#### 一、主要会计数据和财务指标

##### (一) 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	11,094,744,238.08	11,887,871,264.56	-6.67%
利润总额	526,982,831.68	832,608,580.20	-36.71%
归属于挂牌公司股东的净利润	410,371,541.96	661,860,645.80	-38.00%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	405,539,273.87	658,234,094.37	-38.39%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	5.80%	10.45%	-
加权平均净资产收益率%（依据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）	5.73%	10.39%	-
基本每股收益	0.31	0.51	-38.00%

##### (二) 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	40,940,782,264.43	36,799,466,218.55	11.25%
负债总计	33,651,027,729.37	29,935,540,124.23	12.41%
归属于挂牌公司股东的净资产	7,289,754,535.06	6,863,926,094.32	6.20%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	5.56	5.24	6.20%
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	13.36%	17.10%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	39.26%	41.98%	-
流动比率	1.18	1.19	-
利息保障倍数	23.95	52.38	-

##### (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	1,893,036,151.63	776,102,190.33	143.92%
应收账款周转率	269.77	1,110.53	-
存货周转率	5.43	8.71	-

#### (四) 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	11.25%	23.83%	-
营业收入增长率%	-6.67%	83.34%	-
净利润增长率%	-38.00%	19.63%	-

#### (五) 行业主要财务及监管指标

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
净资本	1,852,894,160.09	1,512,371,088.41	22.52%
风险资本准备总额	837,637,166.37	758,814,620.33	10.39%
净资本与风险资本准备总额的比例	221%	199%	-
净资本与净资产的比例	28%	24%	-
扣除客户保证金的流动资产	4,552,778,275.54	4,610,491,619.57	-1.25%
扣除客户权益的流动负债	1,007,895,858.49	1,285,553,890.92	-21.60%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	452%	359%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	15%	21%	-
结算准备金额	963,667,981.81	1,673,944,727.36	-42.43%

注1：根据监管要求，数据口径为母公司口径，“扣除客户保证金的流动资产”不含报表列示的其他流动资产、应收股利，“扣除客户权益的流动负债”包含递延所得税负债。

#### (六) 补充财务指标

适用 不适用

#### 二、 非经常性损益项目及金额

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	61,768.85
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）	5,865,833.06
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	295,709.23
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-289,106.11
<b>非经常性损益合计</b>	<b>5,934,205.03</b>
所得税影响数	1,101,936.94
少数股东权益影响额（税后）	
<b>非经常性损益净额</b>	<b>4,832,268.09</b>

### 三、 会计政策变更、会计估计变更或重大差错更正等情况

#### (一) 会计数据追溯调整或重述情况

会计政策变更  会计差错更正  其他原因  不适用

单位：元

科目/指标	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
货币资金	18,268,513,375.80	17,277,242,747.04		
应收货币保证金	11,393,350,910.18	11,325,661,929.26		
存出保证金		841,892.55		
交易性金融资产	4,158,242,252.04	4,130,938,590.83		
应收票据	1,793,095.85			
应收账款	31,254,687.05	24,875,121.09		
应收款项融资		1,793,095.85		
预付款项	345,098,951.92	302,040,051.78		
应收结算担保金	31,112,096.04	34,593,853.25		
其他应收款	97,497,881.85	88,317,675.95		
存货	1,276,598,775.77	1,531,314,799.31		
其他资产（其他流动资产）[注2]	296,766,187.48	234,630,376.94		
结算备付金（其他流动资产）		732,176.67		
融出资金（其他流动资产）		40,189,907.19		
递延所得税资产	168,330,122.59	193,591,338.28		
应付货币保证金	25,612,483,939.73	24,535,428,916.12		
交易性金融负债	1,750,540,144.36	1,783,215,819.12		
应付账款	173,944,586.98	107,960,512.29		
预收款项[注3]	532,199,605.37	741,569,234.77		
应交税费	164,289,339.32	168,563,751.51		
其他应付款	454,246,578.45	453,901,480.21		
代理买卖证券款（其他流动负债）		43,497,081.98		
递延所得税负债	84,236,031.71	87,529,106.96		
其他综合收益	38,546,345.56	39,928,823.91		
未分配利润	3,188,985,150.81	3,156,082,214.84		
公允价值变动收益	433,439,792.66	403,239,373.39		
其他业务收入	10,602,507,068.14	10,618,588,839.46		
业务及管理费	482,358,328.88	480,075,859.56		
信用减值损失	5,439,920.87	5,322,508.71		
其他业务成本	10,338,878,944.74	10,380,414,619.60		
所得税费用	192,297,038.46	170,747,934.40		
外币财务报表折算差额	8,322,341.22	8,255,854.14		

注 2：列示项目为新三板年度报告之财务报表附注列示科目名称，与原审计报告列示项目名称一致，括号内科目为受影响的新三板财务报表项目名称，下同。

注 3：公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部于 2017 年 7 月修订并发布的《企业会计准则第 14 号—收入》，根据相关新旧准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新准则的累积影响数追溯调整 2020 年 1 月 1 日的留存收益及财务报表其他相关项目金额，上年期末“预收账款”科目在本期期初调整列示为“合同负债”和“其他流动负债”。

## （二） 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因及影响

√适用 □不适用

### 1. 会计差错调整事项如下：

#### （1）上年期末影响

1) 根据《关于广发证券股指期货会计核算有关问题的复函》（中国证券监督管理委员会机构部部函（2011）35 号），在当日无负债结算制度下，期货合约每日结算，公司对子公司期货合约持仓盈亏的核算科目重新列示。调减货币资金 511,518.86 元，调增应收货币保证金 13,131,182.31 元，调减其他应收款 13,311,876.65 元，调减交易性金融资产 40,475,438.70 元，调减应付货币保证金 31,435,738.54 元，调减交易性金融负债 9,731,913.36 元。

2) 子公司新永安期货的离岸收入免缴企业所得税，调减递延所得税资产 77,273.07 元，调增其他综合收益 813,880.88 元，调减未分配利润 891,153.95 元。

3) 调整公司跨期损益。调减应收账款 6,715,332.59 元，调增预付账款 27,933,664.72 元，调增存货 246,943,848.05 元，调减其他资产（其他流动资产）63,611,881.35 元，调增预收账款 209,369,629.40 元，调增应付账款 3,693,382.19 元，调增其他应付款 13,988.20 元，调减未分配利润 8,526,700.96 元。

4) 为保持前后各期财务报表列报的一致性，对部分项目重分类列示。调减应收票据 1,793,095.85 元，调增应收款项融资 1,793,095.85 元；调增其他资产（其他流动资产）1,476,070.81 元，调减其他应收款 1,476,070.81 元。

将公司证券业务相关报表项目重分类列示。调增其他流动资产(结算备付金)739,169.66 元，调增其他流动资产(融出资金)42,305,165.46 元，调减应收货币保证金 81,229,773.46 元，调增存出保证金 876,773.21 元，调增应收结算担保金 3,481,757.21 元，调增其他应收款 4,711,303.50 元，调增代理买卖证券款(其他流动负债)43,497,081.98 元，调减应付货币保证金 72,612,686.40 元。

5) 调整合并抵消数据。调减预付账款 69,677,456.88 元，调减应付账款 69,677,456.88 元；调减



货币资金 990,759,109.90 元，调增应收货币保证金 17,393,424.79 元，调减应付货币保证金 973,006,598.67 元，调减其他应付款 359,086.44 元。

6) 根据上述调整重新厘定坏账准备、存货跌价准备等科目。调减应收货币保证金 16,983,814.56 元，调增应收账款 335,766.63 元，调减预付款项 1,315,107.98 元，调增其他应收款 896,438.06 元，调减融出资金（其他流动资产）2,115,258.27 元，调减存出保证金 34,880.66 元，调减结算备付金（其他流动资产）6,992.99 元，调增存货 7,772,175.49 元，调增交易性金融资产 13,171,777.49 元，调增递延所得税资产 25,338,488.76 元，调增交易性金融负债 42,407,588.12 元，调增应交税费 4,274,412.19 元，调增递延所得税负债 3,293,075.25 元，调增其他综合收益 568,597.47 元，调减未分配利润 23,485,081.06 元。

## （2）上年同期

1) 调整公司跨期损益。调增其他业务收入 16,081,771.32 元，调增其他业务成本 41,535,674.86 元，调减业务及管理费 2,282,469.32 元。

2) 如本报告第三节三（二）1（6）所述原因之说明，调减公允价值变动损益 30,200,419.27 元，调减信用减值损失 117,412.16 元，调减所得税费用 21,549,104.08 元，调减外币财务报表折算差额 66,487.08 元。

## 2. 会计政策变更的原因及影响

2017 年 7 月 5 日，财政部修订发布《企业会计准则第 14 号—收入》（财会〔2017〕22 号），根据财政部要求，在境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报表的企业，自 2018 年 1 月 1 日起施行；其他境内上市企业，自 2020 年 1 月 1 日起施行；执行企业会计准则的非上市企业，自 2021 年 1 月 1 日起施行。

公司于 2020 年 4 月 20 日召开的第三届董事会第五次会议、第三届监事会第三次会议审议通过了《关于会计政策变更的议案》。公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部于 2017 年 7 月修订并发布的《企业会计准则第 14 号—收入》。

根据相关新旧准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新准则的累积影响数追溯调整 2020 年 1 月 1 日的留存收益及财务报表其他相关项目金额。

执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2019 年 12 月 31 日	新收入准则调整影响	2020 年 1 月 1 日
预收款项	741,569,234.77	-741,569,234.77	

合同负债		657,269,581.43	657,269,581.43
其他流动负债		84,299,653.34	84,299,653.34

#### 四、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

#### 五、 主要经营情况回顾

##### (一) 经营计划

适用 不适用

2020年下半年，公司将做好长期应对内外部环境变化的思想准备和工作准备，加快转型升级步伐，以平台化为发展方向，进一步突出期货衍生品服务实体经济功能，加快发展以经纪业务为基础，以风险管理业务和财富管理业务为两翼，以境外业务、期权衍生品业务和投资业务为驱动的“一体两翼，三轮驱动”业务体系，不断稳固公司行业地位，向“国内领先、国际一流”衍生品综合服务商的发展目标不断迈进。

1. 经纪业务聚焦扩大金融期货业务规模。在巩固商品期货经纪业务优势阵地的同时，抓住新品种、新业务机会，加大金融期货营销人才培育，加强金融期货知识普及和投资者风险教育培训，丰富金融期货的套保、套利和资产配置策略，扩大券商 IB 合作范围，打造先进的技术优势和综合化的服务优势，不断提高公司客户权益规模。

2. 风险管理业务聚焦打造大宗商品投行。加强业务单元协同，丰富期现业务品种线，深入推进基差贸易、合作套保、含权贸易及仓单服务等业务模式，提升服务实体经济能力。整合公司渠道、投研、风控等方面优势，创新应用现货、期货、期权等工具，在增强期现业务差异化竞争力的同时，提高公司服务产业链的能力。

3. 财富管理业务聚焦提升大类资产配置能力。充分发挥公司投研优势，提升投资团队专业能力，提高公司大类资产配置能力，做大主动管理规模，实现“稳增长、调结构、强品牌”目标。加大金融科技投入，扩大私募线上化系统功能效用，加强管理人交易风格、投资者风险、产品风险及策略风险的大数据分析，强化移动互联网营销和服务能力，为投资者提供一站式综合金融服务。

4. 境外业务聚焦服务国家重大战略。以境外混业经纪、内外盘套利基金、风险管理业务为抓手，加快推进境外综合金融业务发展，推进境内外交易通道、资金通道、资管平台和贸易平台建设。积极参与并服务“一带一路”项目和浙江经济“走出去”项目，打造高质量的境外综合金融业务服务能力。

5. 期权衍生品业务聚焦提升产品创新能力。重点关注各大交易所的实体服务试点、专业扶贫试点、

“保险+期货/期权”试点等各种创新试点，探索将“保险+期货”的业务模式从农业领域扩展至制造业领域。抓住各类期权新品种上市机会，加强期权业务人才培养，做好市场培训，强化与私募机构、券商自营及银行理财子公司等机构的业务对接，扩大业务规模，做强业务影响力。加快技术运维系统建设，人才队伍培养和交易能力提升，提高业务竞争力。

6. 投资业务聚焦协同公司业务发展。坚持安全性、流动性、收益性原则，基于公司资产配置需要、业务单元撬动效益需要和财务收益产品配置需要，优化投资结构、发挥杠杆作用，适当配置各类资产，在实现稳健资本回报的同时，探索新的业务领域。

## (二) 行业情况

√适用 □不适用

经过近 30 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。上市品种日益丰富，创新品种加快推出，市场规模稳步扩大。截至 2020 年上半年末，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），已上市期货期权品种 83 个，其中商品期货 60 个、金融期货 6 个、商品期权 13 个、股票期权 3 个、股指期货 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。每个商品期货期权品种都连接着一个实体产业链，与实体经济密切相关，期货期权市场已经成为现代金融体系的重要组成部分。2020 年上半年，我国期货市场成交量和成交额再创新高，商品期货成交量稳居世界前列，金融期货重要作用不断显现。在经济下行压力增大的背景下，期货工具愈发成为实体经济对冲经营风险、发现价格的有效手段。在我国深入推进供给侧结构性改革的新形势下，期货工具围绕服务实体经济需求的目标，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。“保险+期货”、仓单服务、合作套保、基差贸易、场外衍生品业务等风险管理业务模式日益清晰，做市业务发展迅速，市场核心竞争力不断增强，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组织实施自律管理为辅的管理体制，持续健全法律法规体系，完善内控制度建设，深化对外开放，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) 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，基金销售业务及自有资金投资业务等。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 业务渠道和居间人渠道。期货交易实行保证金制度。根据《期货交易管理条例》的规定，保证金是指期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价值证券，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，客户保证金带来的利息收入亦是公司收入的重要来源。

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券商 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、产业客户及机构投资者等。期货投资咨询业务作为公司开展差异化竞争的服务模式，通过专业化的金融衍生品策略研究，为客户量身打造个性化的风险管理和投资管理的服务模块，帮助产业客户实现资产保值增值，帮助机构客户优化资产配置。

#### 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。投资范围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、短期融资券及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与管理的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风险管理子公司开展基差贸易、做市业务和场外衍生品业务等风险管理服务以及其他与风险管理相关的服务，涵盖期货期权上市品种及其产业链相关品种等。公司风险管理业务以服务实体产业客户为宗旨，以基本面研究为基础，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风险管理产品与服务，形成稳定、可持续的盈利模式和交易体系。

#### 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开拓稳定、可持续的收入来源。

### (四) 经营情况回顾

2020年上半年，公司坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为统领，牢记“服务实体、创造价值”的初心和使命，秉持“四个敬畏”行为准则，一手抓疫情防控，一手抓复工复产，经受住了特殊时期各项考验，服务实体经济效果显著，整体经营业绩保持平稳，分类监管、社会责任担当继续在行业前列，保持 3A 信用评级，头部优质企业的品牌形象更加全面、稳固、突出。

报告期内，公司实现营业收入 110.95 亿元，同比下降 6.67%；实现净利润 4.10 亿元，同比下降 38.00%，其中归属于挂牌公司股东的净利润 4.10 亿元，同比下降 38.00%。截至报告期末，公司总资产 409.41 亿元，同比增长 11.25%；净资产 72.90 亿元，同比增长 6.20%，其中归属于挂牌公司股东的净资产 72.90 亿元，同比增长 6.20%。

报告期内，永安期货母公司各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截至报告期末，永安期货母公司净资本为 18.53 亿元，风险资本准备总额为 8.38 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 221%，净资本与净资产的比例为 28%，流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）为 452%，负债与净资产的比例（扣除客户权益）为 15%，结算准备金余额 9.64 亿元。

### (五) 财务分析

#### 1. 资产负债结构分析

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期期末		上年期末		本期期末 与本期期
	金额	占总资	金额	占总资	

		产的比 重%		产的比 重%	初金额变 动比例%
货币资金	17,841,293,503.65	43.58%	17,277,242,747.04	46.95%	3.26%
应收票据					
应收账款	58,993,257.47	0.14%	11,013,567.11	0.03%	435.64%
应收货币保证金	14,318,243,064.62	34.97%	11,325,661,929.26	30.78%	26.42%
应收质押保证金	932,166,832.00	2.28%	621,717,032.00	1.69%	49.93%
存出保证金	1,021,138.27	0.00%	841,892.55	0.00%	21.29%
交易性金融资产	2,954,801,024.00	7.22%	4,130,938,590.83	11.23%	-28.47%
应收款项融资	20,591,285.00	0.05%	1,793,095.85	0.00%	1,048.36%
预付款项	639,023,474.04	1.56%	302,040,051.78	0.82%	111.57%
应收结算担保金	47,328,324.69	0.12%	34,593,853.25	0.09%	36.81%
应收风险损失款	697,920.42	0.00%	17,004.09	0.00%	4,004.43%
应收佣金	8,972,405.33	0.02%	13,861,553.98	0.04%	-35.27%
其他应收款	339,649,978.08	0.83%	88,317,675.95	0.24%	284.58%
买入返售金融资产	16,900,000.00	0.04%	44,800,508.00	0.12%	-62.28%
存货	2,030,358,829.21	4.96%	1,531,314,799.31	4.16%	32.59%
其他流动资产	434,851,160.31	1.06%	221,297,636.02	0.60%	96.50%
长期股权投资	571,599,809.61	1.40%	486,824,372.27	1.32%	17.41%
其他权益工具投资	26,845,000.00	0.07%	26,845,000.00	0.07%	0.00%
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	344,315,284.44	0.84%	10,035,071.69	0.03%	3,331.12%
固定资产	100,152,788.72	0.24%	232,130,750.50	0.63%	-56.86%
无形资产	24,124,502.57	0.06%	233,733,432.01	0.64%	-89.68%
长期待摊费用	9,365,168.32	0.02%	9,454,316.78	0.03%	-0.94%
递延所得税资产	218,087,513.68	0.53%	193,591,338.28	0.53%	12.65%
短期借款	880,588,289.30	2.15%	562,544,509.00	1.53%	56.54%
应付货币保证金	28,376,820,672.33	69.31%	24,535,428,916.12	66.67%	15.66%
应付质押保证金	563,338,484.00	1.38%	434,089,168.00	1.18%	29.77%
交易性金融负债	749,118,602.81	1.83%	1,783,215,819.12	4.85%	-57.99%
期货风险准备金	241,878,662.38	0.59%	232,191,214.15	0.63%	4.17%
应付账款	87,550,845.57	0.21%	107,960,512.29	0.29%	-18.90%
合同负债	779,196,138.22	1.90%	657,269,581.43	1.79%	18.55%
应付期货投资者保障基金	359,709.00	0.00%	671,681.51	0.00%	-46.45%
应付手续费及佣金	828,367.63	0.00%	840,649.07	0.00%	-1.46%
应付职工薪酬	779,568,778.86	1.90%	783,931,911.56	2.13%	-0.56%
应交税费	60,551,545.03	0.15%	168,563,751.51	0.46%	-64.08%
其他应付款	807,878,339.85	1.97%	453,060,831.14	1.23%	78.32%
其他流动负债	231,420,823.05	0.57%	127,796,735.32	0.35%	81.09%
预计负债	454,494.55	0.00%	445,737.05	0.00%	1.96%
递延所得税负债	91,473,976.79	0.22%	87,529,106.96	0.24%	4.51%
资产总计	40,940,782,264.43	100.00%	36,799,466,218.55	100.00%	11.25%

#### 资产负债项目重大变动原因：

- 1) 应收账款：期末较期初增长 435.64%，主要系子公司现货贸易赊销规模扩大，应收账款增加；
- 2) 应收货币保证金：期末较期初增长 26.42%，主要系客户持仓量升高，持仓占用保证金金额增加；
- 3) 应收质押保证金：期末较期初增长 49.93%，主要系本期客户质押业务规模增加，公司在交易所质押的仓单增加；
- 4) 应收款项融资：期末较期初增长 1048.36%，主要系子公司永安资本现货贸易以票据方式结算的业务增加；
- 5) 预付款项：期末较期初增长 111.57%，主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，预付货款增加；
- 6) 应收结算担保金：期末较期初增长 36.81%，主要系客户业务量增加，担保金增加；
- 7) 应收风险损失款：期末较期初增长 4004.43%，主要系本期穿仓客户损失增加；
- 8) 应收佣金：期末较期初减少 35.27%，主要系应收资产管理业务佣金较上期期末减少；
- 9) 其他应收款：期末较期初增加 284.58%，主要系应收清算款以及子公司永安资本场外应收款增加；
- 10) 买入返售金融资产：期末较期初减少 62.28%，主要系本期期末持有的国债逆回购余额减少；
- 11) 存货：期末较期初增加 32.59%，主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，用于交易的存货增加；
- 12) 其他流动资产：期末较期初增加 96.50%，主要系子公司新永安控股融出资金增加；
- 13) 投资性房地产：期末较期初增加 3331.12%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；
- 14) 固定资产：期末较期初减少 56.86%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；
- 15) 无形资产：期末较期初减少 89.68%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；
- 16) 短期借款：期末较期初增加 56.54%，主要系子公司永安资本因业务规模扩大银行借款增加；
- 17) 应付货币保证金：期末较期初增加 15.66%，主要系客户权益增长；
- 18) 交易性金融负债：期末较期初减少 57.99%，主要系期末结构化主体其他投资者享有的份额减少；
- 19) 应付期货投资者保障基金：期末较期初减少 46.45%，主要系期初数已经在本期全额上缴，期末数为 2020 年 1-6 月计提金额；
- 20) 应交税费：期末较期初减少 64.08%，主要系企业所得税汇算清缴；
- 21) 其他应付款：期末较期初增加 78.32%，主要系子公司永安资本衍生业务应付款增加；
- 22) 其他流动负债：期末较期初增加 81.09%，主要系本期子公司代理买卖证券款增加。

## 2. 营业情况分析

### (1) 利润构成

√适用 □不适用

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	11,094,744,238.08	-	11,887,871,264.56	-	-6.67%
手续费及佣金净收入	276,016,332.31	2.49%	203,240,044.87	1.71%	35.81%
其中：经纪业务手续费收入	224,188,636.91	2.02%	171,146,892.79	1.44%	30.99%
资产管理业务收入	30,052,884.30	0.27%	10,902,184.71	0.09%	175.66%
投资咨询业务收入	1,196,870.48	0.01%	1,321,382.40	0.01%	-9.42%
代理销售金融产品收入	20,577,940.62	0.19%	19,869,584.97	0.17%	3.57%
其他手续费及佣金收入	-	0.00%	-	0.00%	
利息净收入	254,532,312.32	2.29%	307,960,764.09	2.59%	-17.35%
投资收益	744,554,239.46	6.71%	352,753,652.15	2.97%	111.07%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	84,842,316.48	0.76%	125,050,134.42	1.05%	-32.15%
公允价值变动收益	-134,846,913.72	-1.22%	403,239,373.39	3.39%	不适用
汇兑收益	-2,126,363.60	-0.02%	-836,894.08	-0.01%	不适用
其他业务收入	9,948,868,179.96	89.67%	10,618,588,839.46	89.32%	-6.31%
其中：风险管理业务收入	9,919,444,867.16	89.41%	10,247,839,812.08	86.20%	-3.20%
其他收益	7,746,451.35	0.07%	2,925,484.68	0.02%	164.79%
二、营业成本	10,683,555,475.38	96.29%	11,056,737,351.23	93.01%	-3.38%
提取期货风险准备金	9,687,448.23	0.09%	7,510,329.13	0.06%	28.99%
税金及附加	3,014,773.41	0.03%	3,040,326.84	0.03%	-0.84%
业务及管理费	486,260,699.48	4.38%	480,075,859.56	4.04%	1.29%
研发费用		0.00%	-	0.00%	
信用减值损失	20,950,492.92	0.19%	5,322,508.71	0.04%	293.62%
其他资产减值损失	418,046,162.62	3.77%	180,373,707.39	1.52%	131.77%
其他业务成本	9,745,595,898.72	87.84%	10,380,414,619.60	87.32%	-6.12%
三、营业利润	411,188,762.70	3.71%	831,133,913.33	6.99%	-50.53%
营业外收入	117,976,582.13	1.06%	4,182,438.83	0.04%	2,720.76%
营业外支出	2,182,513.15	0.02%	2,707,771.96	0.02%	-19.40%
四、利润总额	526,982,831.68	4.75%	832,608,580.20	7.00%	-36.71%
五、净利润	410,371,541.96	-	661,860,645.80	-	-38.00%

#### 项目重大变动原因：

1) 手续费及佣金收入：较上期相比增加 35.81%，主要系交易所减收及资产管理业务收入增加；



- 2) 投资收益：较上期相比增加 111.07%，主要系理财产品收益增加；
- 3) 公允价值变动收益：上年同期金额为 403,239,373.39 元，变动系本期理财产品公允价值下降；
- 4) 汇兑收益：上年同期金额为-836,894.08 元，变动系外汇汇率波动；
- 5) 其他收益：较上期相比增加 164.79%，主要系收到的政府补助增加；
- 6) 信用减值损失：较上期相比增加 293.62%，主要系本期坏账准备计提增加；
- 7) 其他资产减值损失：较上期相比增加 131.77%，主要系本期存货跌价损失计提增加；
- 8) 营业外收入：较上期相比增加 2720.76%，主要系本期风险管理子公司客户违约赔款增加。

## (2) 收入构成

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
手续费及佣金净收入	276,016,332.31	203,240,044.87	35.81%
利息净收入	254,532,312.32	307,960,764.09	-17.35%
其他业务收入	9,948,868,179.96	10,618,588,839.46	-6.31%
投资收益	744,554,239.46	352,753,652.15	111.07%
公允价值变动收益	-134,846,913.72	403,239,373.39	不适用
汇兑收益	-2,126,363.60	-836,894.08	不适用
其他收益	7,746,451.35	2,925,484.68	164.79%

## 分行政区域营业部及手续费收入情况

√适用 □不适用

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		221,710,145.88	2.01%
香港特别行政区[注 4]		18,927,847.55	0.17%
浙江省(不含杭州本部)	14	14,253,460.18	0.13%
辽宁省	3	1,913,021.07	0.02%
山东省	7	3,813,686.45	0.03%
北京市	1	1,350,341.44	0.01%
广东省	2	1,997,813.94	0.02%
上海市	1	1,594,705.67	0.01%
福建省	2	1,113,842.51	0.01%
河南省	1	1,269,121.17	0.01%
江苏省	2	1,186,852.26	0.01%
吉林省	1	1,268,826.70	0.01%
天津市	1	717,140.61	0.01%
重庆市	1	891,749.98	0.01%
河北省	2	1,153,721.62	0.01%

湖北省	1	544,551.08	0.00%
四川省	1	1,000,624.72	0.01%
湖南省	1	766,729.22	0.01%
江西省	1	373,004.04	0.00%
陕西省	1	169,146.22	0.00%
<b>合计</b>	<b>43</b>	<b>276,016,332.31</b>	<b>2.49%</b>

注 4：香港特别行政区营业部指子公司新永安期货。

### 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“五、主要经营情况回顾（五）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. 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	1,893,036,151.63	776,102,190.33	143.92%
投资活动产生的现金流量净额	-1,189,927,018.35	-31,429,951.99	3,685.97%
筹资活动产生的现金流量净额	150,146,761.91	645,876,113.76	-76.76%

### 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 11.17 亿元，主要系与上期相比，本期交易性金融资产净减少带来现金增加 18.14 亿，现货贸易现金净流出增加 7.83 亿；

2. 投资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少 11.58 亿，主要系本期永利 1 号资产管理计划到期清算，不纳入合并范围；

3. 筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期较少 4.96 亿，主要系本期结构化产品其他投资者投入资金减少；

4. 本期经营活动产生的现金流量净额较本期净利润金额多约 14.83 亿元，主要系公司交易性金融资产处置体现在现金流量表，而不体现在净利润中。

## 六、 主要控股参股公司分析

### （一） 主要控股子公司、参股公司经营情况

√适用 □不适用

单位：元

公司	公	主	与公	持有目	注册资本	总资产	净资产	营业收入	净利润
----	---	---	----	-----	------	-----	-----	------	-----

名称	司类型	要业务	司从事业务的关联性	的					
永安资本	子公司	风险管理业务	风险子公司	开展风险管理业务	1,000,000,000	4,541,946,435.44	1,485,774,667.71	9,919,444,867.16	101,745,221.95
永安国富	参股公司	资产管理	公司代销其产品，购买其销售产品	战略投资	84,200,000	2,575,473,846.18	1,662,059,556.51	1,637,210,918.20	241,914,829.78

## (二) 报告期内取得和处置子公司的情况

适用 不适用

合并财务报表的合并范围是否发生变化

是 否

报告期内，本公司管理的永利1号资产管理计划、永屹一号资产管理计划因已到期清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

## (三) 合并报表范围内是否包含私募基金管理人：

是 否

## 七、 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

对于公司管理的结构化主体，公司通过评估管理人各项收益所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致可表明公司对结构化主体拥有控制权。若公司对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。截至报告期末，有1只产品纳入本公司合并范围。

截至报告期末，纳入合并范围的结构化主体的净资产为713,423,210.19元，公司享有的权益账面价值为137,103,929.95元，公司以外各方所持上述结构性主体的权益账面价值为576,319,280.24元。对于公司以外各方所持上述结构化主体的权益，公司确认为交易性金融负债。

## 八、 对非标准审计意见及关键审计事项的说明

### (一) 非标准审计意见说明

适用 不适用

### (二) 关键审计事项说明:

适用 不适用

## 九、 企业社会责任

### (一) 精准扶贫工作情况

适用 不适用

2020年是脱贫攻坚收官之年,公司深入贯彻习近平总书记在决战决胜脱贫攻坚座谈会上的重要讲话精神,不忘初心、牢记使命,坚定信心、顽强奋斗,坚持久久为功,以钉钉子精神扎实推进扶贫工作,为夺取脱贫攻坚战全面胜利作出更大贡献。公司始终坚守金融扶贫一线,认真履行社会责任,以服务实体经济为宗旨,贯彻执行精准扶贫、精准脱贫基本方略,用专业与创新提升扶贫成效。公司注重全方位、多角度扶贫,统筹开展产业扶贫、教育扶贫、公益慈善、乡村振兴等工作。在中国期货业协会组织开展的2019—2020年期货行业扶贫考评中,公司再获第一名,已连续四年夺冠。

2020年上半年,公司在贵州省威宁县开展“同心树人”教育帮扶活动;在河南省桐柏县开展产业帮扶活动;在常山县客弄村开展“千企结千村、消灭薄弱村”帮扶活动,帮助该村永常大客商贸公司销售山茶油和茶叶,实现营业收入85万元,创造利润12万元,并对该村困难群众开展爱心送温暖活动;在江西省赣州市开展消费扶贫,帮助采购销售赣南脐橙,助力当地脐橙产业发展。

### (二) 其他社会责任履行情况

适用 不适用

“保险+期货”创新扶贫思路,助力“三农”管理市场风险。早在2013年,公司就开始探索和尝试如何使用期货工具来服务“三农”,是国内首批开展“保险+期货”试点业务的期货公司之一,试点项目品种范围涵盖国内三大商品期货交易所。为更好地开展精准扶贫,公司成立了“保险+期货”工作领导小组,不断孕育新思路、新模式,提升扶贫工作专业性。近年来,公司创新引进第三方,开发出“订单农业+保险+期货”、“保险+期货+融资”及“保险+期货+银行”等新模式,进一步拓宽了金融助农范围,也为“保险+期货”连续多年写入中央“一号文件”提供了生动的实践经验。2020年上半年,公司共开展13个“保险+期货”项目,覆盖棉花、苹果、橡胶、饲料类等多个品种,承保现货数量76.92万吨,覆盖种植面积12万亩。

积极动员组织抗击疫情,助力复工复产。疫情发生后,公司迅速成立防控工作领导小组,统筹落

实抗疫举措，有序开展客户服务、员工保障、社会责任、媒体宣传等各项工作。公司第一时间向浙大一院捐款 200 万元。全体员工纷纷奉献爱心，共计捐款 15.7 万元，并捐赠了价值 7.2 万元的防护物资。复工开市以来，面对复杂多变的行情，公司充分发挥金融科技优势，通过“源点资讯”APP 开展线上投研服务，通过“永安期货”APP 积极引导非现场交易，为客户提供“一站式”金融服务，助力期货市场稳定运行。同时，公司坚持“产融结合、服务实体”的初心，借助风险管理子公司永安资本的专业优势和渠道优势，以创新的思路、灵活的制度、丰富的工具和敬业的精神，切实为广大实体企业和“保险+期货”客户提供全面服务，努力帮助解决资金、原材料、物流等实际困难，与客户共同战“疫”，共克时艰。

## 十、 公司面临的风险和应对措施

√适用 □不适用

### 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，公司经纪业务可能面临着盈利下降风险。

应对措施：公司构建了高效的经纪业务集中管理模式，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，以进一步扩大市场，同时采取多种措施，在金融衍生品上寻求突破。

### 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。公司的客户保证金规模、自有资金规模和市场利率的变化将影响公司的营业收入和净利润。如果市场利率出现大幅下降，或者客户保证金、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。此外，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：一方面，公司通过多项措施，做大公司权益规模；另一方面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。同时，公司通过扩大投资标的，进一步拓展自有资金投资范围，在稳健投资的前提下，提高自有资金收益率。

### 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，导致期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广。若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

收入难以取得实质性起色。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，强化研究在公司发展中的核心地位，全面整合研究资源。同时进一步强调对投资咨询业务的规范化管理，明确投资咨询业务流程及审核流程，并对投资咨询客户进行定期回访。

#### 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业务的激烈竞争。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、绩效机制及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，在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受市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当及人员操作失误等原因无法达到预期收益，甚至遭受损失，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：公司努力探索资产管理业务发展新方向，积极向大类资产配置转型。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类似业务的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广及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：公司积极推进基金销售的互联网化，特别是移动端的开发使用。对于潜在经营风险，公司根据基金产品尽职调查结果，严格按照公司风险评估制度要求，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当性管理制度，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，公司通过 CRM 系统处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与业务经验、

人才储备和经营管理水平等不匹配情况，从而导致因产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位及风险管理和内控措施不健全而带来的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、应对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章立制工作，并结合监管要求，加大内部稽核力度，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，配置范围包括权益、商品、信托等。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的市场风险和操作风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损从而影响公司盈利的可能。

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，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。目前中国证券监督管理委员会根据监管需要，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。分类评价结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标。如果公司未来评级出现下调，可能对公司现有业务开展、新业务申请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、稽核检查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，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，对经营层负责，形成稽核报告及时汇报公司经营层，有关部门根据相关报告进行整改。

#### 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，其安全性、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。但是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。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、数据丢失与泄露等风险。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持续升级和扩展，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，公司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；并制定了完整的信息技术相关制度，积极与公司外部机构开展技术支持、运维方面的合作，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义务的风险；（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：一是严格落实客户实名制原则，加强客户适当性管理，有效识别客户身份，并了解客户信用状况、财务状况及风险承受能力等信息；二是加强市场风险识别，严格落实客户保证金管理制度及强平风控措施，确保强平操作规范性及有效性；三是建立有效资金存放制度，并加强资金试算平衡管理，确保资金安全；四是建立仓库管理制度，加强对仓储企业的资信调查及日常巡库；五是建立客户授信制度，通过对客户信用评定，实现客户分类管理；六是明确内部决策、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，确保有关信用风险防范机制得到有效落实。

#### 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，促成期货公司和客户订立期货经纪合同，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。由于目前期货监管体



系并未形成居间业务的统一规定，且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，可能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。如果公司对居间人管理不当，发生上述情形，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：公司已制定居间人管理办法，明确规范居间人行为准则。公司要求在对居间人充分了解的情况下，方可与之签署居间合同，确立居间关系。公司对居间人开展执业前培训，定期进行回访，并对居间人开展年度培训，强化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，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。若公司流失关键优秀管理人员和专业人才，可能会对公司的经营发展造成一定影响。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，制定和实施企业可持续发展的人力资源政策，推出名校宣讲会，进行高校合作培养，增加海外招聘渠道，开展核心业务的人才培养，组织文化传承专项培训，公开竞聘选拔干部，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法律、法规及规范性文件的约束。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，期货市场快速发展，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，配合各项业务监管检查，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，确保公司经营的合法、合规。

#### 14. 重大诉讼、仲裁风险

截至报告期末，公司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，如未来出现重大诉讼或仲裁，可能会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，着重培养员工的职业操守、风险防范意识和职业道德水平。

#### 15. 商标风险

公司使用中的标识尚未取得商标专用权，在使用过程中，可能会引起法律纠纷，从而使公司声誉遭到损害，并对公司的业务开展及整体经营战略布局带来不利影响。

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，适时启动注册商标申请程序。

## 第四节 重大事件

### 一、 重大事件索引

事项	是或否	索引
是否存在诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	四.二.(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、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(二)
是否存在其他重大关联交易事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资、企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施	<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	四.二.(三)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(四)
是否存在被调查处罚的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在破产重整事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在应当披露的其他重要事项	<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、 重大事件详情

#### (一) 诉讼、仲裁事项

报告期内，公司无重大诉讼、仲裁事项。

#### (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	5,127,000,000.00	54,068,873.86
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托，委托或者受托销售	235,000,000.00	6,712,182.24
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	45,640,000,000.00	2,361,804,618.56
4. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	700,000,000.00	15,291,615.97
总计	51,702,000,000.00	2,437,877,290.63

1

(三) 承诺事项的履行情况

承诺主体	承诺开始日期	承诺结束日期	承诺来源	承诺类型	承诺具体内容	承诺履行情况
其他	-	-	挂牌	同业竞争承诺	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	正在履行中
其他	-	-	挂牌	限售承诺	2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券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	正在履行中
其他	2019/4/22	2020/10/23	其他（自行填写）	一致行动承诺	财通证券与浙江产业基金在处理有关永安期货经营发展且根据《中华人民共和国公司法》等有关法律法规和公司章程需要由公司股东大会、董事会作出决议的事项时均应采取一致行动；本协议有效期内，在任一方拟就永安期货经营发展的重大事项向股东大会、董事会提出议案之前，或在行使股东大会或董事会等事项的表决权之前，以财通证券的意见为准，作为双方的一致意见	正在履行中
其他	2019/4/22	2020/10/23	其他（自行填写）	一致行动承诺	财通证券与浙江产业基金在处理有关永安期货经营发展且根据《中华人民共和国公司法》等有关法律法规和公司章程需要由公司股	正在履行中

					东大会、董事会作出决议的事项时均应采取一致行动；本协议有效期内，在任一方拟就永安期货经营发展的重大事项向股东大会、董事会提出议案之前，或在行使股东大会或董事会等事项的表决权之前，以财通证券的意见为准，作为双方的一致意见	
--	--	--	--	--	---	--

**承诺事项详细情况：**

<p>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：</p> <p>1. 关于避免同业竞争的承诺</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。”</p> <p>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。</p> <p>除上述承诺外，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》（以下简称《一致行动人协议》）。2017年5月，公司实际控制人浙江省财政厅控制的省金控作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将促使子公司浙江产业基金与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间。同时，公司股东浙江产业基金作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间。2019年4月22日，财通证券与浙江产业基金续签了前述《一致行动人协议》，有效期至2020年10月23日。截至报告期末，该承诺正在履行中。</p>
---

(四) 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产名称	资产类别	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例%	发生原因
标准仓单	存货	质押	370,317,238.42	0.90%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	其他货币资金	质押	30,487,444.07	0.07%	作为信用证保证金、保函保证金等
总计	-	-	400,804,682.49	0.97%	-

资产权利受限事项对公司的影响：

公司权利受限事项均因正常业务开展产生，对公司经营无重大影响。

## 第五节 股份变动和融资

### 一、普通股股本情况

#### (一) 报告期期末普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末	
		数量	比例%		数量	比例%
无限售条件股份	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%
	其中：控股股东、实际控制人					
	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						568

#### 股本结构变动情况：

适用 不适用

#### (二) 报告期期末普通股前十名股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有限售股份数量	期末持有无限售股份数量	期末持有的质押或司法冻结股份数量
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	0
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	0

3	浙 江 东 方 金 融 控 股 集 团 股 份 有 限 公 司	166,427,690	0	166,427,690	12.70%	0	166,427,690	0
4	浙 江 省 经 济 建 设 投 资 有 限 公 司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727	26,540,000
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	0
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	0
7	方 继 方	5,842,000	0	5,842,000	0.45%	0	5,842,000	0
8	南 通 金 玖 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	0
9	浙 江 省 经 协 集	3,733,000	- 14,890	3,718,110	0.28%	0	3,718,110	0



	团有限公司							
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）	3,393,000	0	3,393,000	0.26%	0	3,393,000	0
<b>合计</b>		<b>1,278,417,969</b>	<b>-</b>	<b>1,278,403,079</b>	<b>97.60%</b>	<b>292,898,550</b>	<b>985,504,529</b>	<b>26,540,000</b>

普通股前十名股东间相互关系说明：

1. 省财开持有公司第一大股东财通证券 3.23%股权，持有股东协作大厦 100%股权。
2. 省金控持有公司第一大股东财通证券 29.03%股权，同时省金控持有公司股东浙江产业基金 100%股权。
3. 浙江省交通投资集团有限公司持有公司第一大股东财通证券 2.03%股权，同时持有公司股东经建投 100%股权。
4. 根据浙江省财政厅《关于划转浙江省协作大厦有限公司所持永安期货股份有限公司股权的通知》（浙财金〔2020〕10号）有关要求，协作大厦将其所持公司 10.59%股权（138,689,727股）无偿划转至省金控。内容详见公司于 2020 年 6 月 2 日在全国股转系统指定信息平台披露的《永安期货股权变动报告书》（公告编号：临 2020-034、临 2020-035）。截至报告期末，上述股权尚未完成过户登记。

## 二、 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 29.03%的股权，持有浙江产业基金 100%的股权，系财通证券与浙江产业基金的控股股东。省金控是浙江省人民政府金融投资管理平台，浙江省财政厅持有其 100%的股权，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。

## 三、 报告期内的普通股股票发行及募集资金使用情况

### (一) 股票发行情况

适用 不适用

### (二) 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

## 四、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

## 五、 存续至本期的债券融资情况

适用 不适用

## 六、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用

## 七、 特别表决权安排情况

适用 不适用

## 第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况

### 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	任职起止日期	
				起始日期	终止日期
方铁道	董事长	男	1980年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
葛国栋	董事、党委书记、总经理	男	1972年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
申建新	董事	男	1972年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
王建	董事	男	1980年12月	2019年10月25日	2022年10月24日
金朝萍	董事	女	1975年7月	2019年10月25日	2022年10月24日
麻亚峻	董事	男	1974年2月	2019年10月25日	2022年10月24日
顾志旭	董事	男	1988年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
李义超	独立董事	男	1963年5月	2019年10月25日	2022年10月24日
黄平	独立董事	男	1969年2月	2019年10月25日	2022年10月24日
冯晓	独立董事	女	1969年11月	2019年10月25日	2022年10月24日
黄德春	独立董事	男	1966年2月	2019年11月27日	2022年10月24日
柴会荣	监事会主席	男	1974年8月	2019年10月25日	2022年10月24日
马笑渊	监事	男	1975年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
胡慧珺	监事	女	1962年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
钱焕军	监事	男	1969年8月	2019年10月25日	2022年10月24日
吕仙英	职工监事	女	1974年11月	2019年9月24日	2022年10月24日
史品	职工监事	男	1985年8月	2019年9月24日	2022年10月24日
石春生	副总经理	男	1965年4月	2019年11月27日	2022年11月26日

				日	日
黄志明	副总经理	男	1976年4月	2019年11月27日	2022年11月26日
马冬明	副总经理、 董事会秘书	男	1970年11月	2019年11月27日	2022年11月26日
陈敏	首席风险官	女	1976年4月	2019年11月27日	2022年11月26日
黄峥嵘	财务总监	男	1980年10月	2019年11月27日	2022年11月26日
<b>董事会人数:</b>					11
<b>监事会人数:</b>					6
<b>高级管理人员人数:</b>					6

### 董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系:

<p>董事长方铁道，现任财通证券股份有限公司党委委员、副总经理兼综合办公室主任。</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董事会办公室主任。</p> <p>董事王建，现任浙江省金融控股有限公司金融管理部总经理。</p> <p>董事顾志旭，现任浙江省金融控股有限公司财务主管，浙江省协作大厦有限公司财务部经理。</p> <p>监事会主席柴会荣，现任浙江金控投资有限公司董事长。</p> <p>监事马笑渊，现任财通证券股份有限公司稽核审计部总经理。</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	期末被授予的限制性股票数量
无	-	0	-	0	0%	0	0
合计	-	0	-	0	0%	0	0

### (三) 变动情况

<b>信息统计</b>	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
	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

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
金吉来	副总经理	离任	无	离任

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

适用 不适用

(四) 董事、监事、高级管理人员股权激励情况

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	本期新增	本期减少	期末人数
中层以上管理人员	93	3	9	87
市场业务人员	426	32	57	401
研究人员	80	4	8	76
信息技术人员	88	2	3	87
财务人员	69	5	3	71
合规管理及风控人员	84	7	7	84
其他职能人员	263	31	28	266
员工总计	1,103	84	115	1,072

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	4	3
硕士	293	305
本科	698	683
专科	91	66
专科以下	17	15
员工总计	1,103	1,072

(二) 核心员工（公司及控股子公司）基本情况

适用 不适用

## 三、 报告期后更新情况

适用 不适用

## 第七节 财务会计报告

### 一、 审计报告

是否审计	否
------	---

### 二、 财务报表

#### (一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>流动资产：</b>			
货币资金	六（一）1	17,841,293,503.65	17,277,242,747.04
其中：期货保证金存款		15,721,910,003.63	16,209,864,177.87
应收货币保证金	六（一）4	14,318,243,064.62	11,325,661,929.26
应收质押保证金	六（一）5	932,166,832.00	621,717,032.00
存出保证金	六（一）6	1,021,138.27	841,892.55
交易性金融资产	六（一）7	2,954,801,024.00	4,130,938,590.83
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款	六（一）8[注5]	58,993,257.47	11,013,567.11
应收款项融资	六（一）9	20,591,285.00	1,793,095.85
预付款项	六（一）10	639,023,474.04	302,040,051.78
应收结算担保金	六（一）11	47,328,324.69	34,593,853.25
应收风险损失款	六（一）12	697,920.42	17,004.09
应收佣金	六（一）8[注5]	8,972,405.33	13,861,553.98
其他应收款	六（一）13	339,649,978.08	88,317,675.95
其中：应收利息		909,935.91	1,905,396.09
应收股利		3,107,816.91	14,558.23
买入返售金融资产	六（一）22[注6]	16,900,000.00	44,800,508.00
存货	六（一）14	2,030,358,829.21	1,531,314,799.31
合同资产			
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）2、3、22 [注6]	434,851,160.31	221,297,636.02
<b>流动资产合计</b>		<b>39,644,892,197.09</b>	<b>35,605,451,937.02</b>
<b>非流动资产：</b>			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资	六（一）15	571,599,809.61	486,824,372.27

其他权益工具投资	六（一）16	26,845,000.00	26,845,000.00
期货会员资格投资	六（一）17	1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产	六（一）18	344,315,284.44	10,035,071.69
固定资产	六（一）19	100,152,788.72	232,130,750.50
在建工程			
使用权资产			
无形资产	六（一）20	24,124,502.57	233,733,432.01
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	六（一）22[注 6]	9,365,168.32	9,454,316.78
递延所得税资产	六（一）21	218,087,513.68	193,591,338.28
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		1,295,890,067.34	1,194,014,281.53
<b>资产总计</b>		40,940,782,264.43	36,799,466,218.55
<b>流动负债：</b>			
短期借款	六（一）23	880,588,289.30	562,544,509.00
应付货币保证金	六（一）25	28,376,820,672.33	24,535,428,916.12
应付质押保证金	六（一）26	563,338,484.00	434,089,168.00
交易性金融负债	六（一）27	749,118,602.81	1,783,215,819.12
期货风险准备金	六（一）28	241,878,662.38	232,191,214.15
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款	六（一）29	87,550,845.57	107,960,512.29
预收款项			-
合同负债	六（一）30	779,196,138.22	657,269,581.43
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金	六（一）31	359,709.00	671,681.51
应付手续费及佣金	六（一）34[注 7]	828,367.63	840,649.07
应付职工薪酬	六（一）32	779,568,778.86	783,931,911.56
应交税费	六（一）33	60,551,545.03	168,563,751.51
其他应付款	六（一）34[注 7]	807,878,339.85	453,060,831.14
其中：应付利息			
应付股利			157,200,000.00
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债	六（一）24、 36[注8]	231,420,823.05	127,796,735.32
<b>流动负债合计</b>		33,559,099,258.03	29,847,565,280.22
<b>非流动负债：</b>			

长期借款			
应付债券			
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债	六（一）35	454,494.55	445,737.05
递延收益			
递延所得税负债	六（一）21	91,473,976.79	87,529,106.96
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		91,928,471.34	87,974,844.01
<b>负债合计</b>		33,651,027,729.37	29,935,540,124.23
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
股本	六（一）37	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）38	1,501,621,789.21	1,501,682,614.86
减：库存股			
其他综合收益	六（一）39	55,446,548.34	39,928,823.91
专项储备			
盈余公积	六（一）40	398,170,713.39	398,170,713.39
一般风险准备	六（一）41	458,061,727.32	458,061,727.32
未分配利润	六（一）42	3,566,453,756.80	3,156,082,214.84
归属于母公司所有者权益合计		7,289,754,535.06	6,863,926,094.32
少数股东权益			
<b>股东权益合计</b>		7,289,754,535.06	6,863,926,094.32
<b>负债和股东权益总计</b>		40,940,782,264.43	36,799,466,218.55

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

注 5：财务报表附注与上表列示项目略有不同，下同。财务报表附注六（一）“应收账款”包含上表所列的“应收账款”和“应收佣金”；

注 6：财务报表附注六（一）“结算备付金”、“融出资金”、“其他资产-待抵扣增值税”、“其他资产-待摊费用”列示在上表“其他流动资产”项目中；财务报表附注六（一）“其他资产-长期待摊费用”、“其他资产-买入返售金融资产”单列在上表“长期待摊费用”及“买入返售金融资产”中；

注 7：财务报表附注六（一）“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 8：财务报表附注六（一）“代理买卖证券款”与“其他流动负债”列示在上表“其他流动负债”中。



## (二) 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>流动资产：</b>			
货币资金		15,360,372,232.63	15,488,253,132.19
其中：期货保证金存款		14,635,947,000.74	15,308,127,388.12
应收货币保证金		13,776,100,385.32	10,815,398,355.32
应收质押保证金		932,166,832.00	621,717,032.00
存出保证金			
交易性金融资产		2,671,041,739.68	2,688,152,511.34
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款			
应收款项融资			
预付款项			
应收结算担保金		43,793,951.01	31,112,096.04
应收风险损失款		697,920.42	17,004.09
应收佣金		10,584,722.53	16,120,242.25
其他应收款		218,566,728.80	101,019,294.42
其中：应收利息			
应收股利		80,000,000.00	80,000,000.00
买入返售金融资产		9,300,000.00	
存货			
合同资产			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		22,684,017.29	18,677,298.98
<b>流动资产合计</b>		<b>33,045,308,529.68</b>	<b>29,780,466,966.63</b>
<b>非流动资产：</b>			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资	十（一）1	2,252,094,913.26	2,176,245,132.90
其他权益工具投资		18,922,500.00	18,922,500.00
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产		344,315,284.44	10,035,071.69
固定资产		96,947,708.92	228,380,541.36
在建工程			
使用权资产			
无形资产		22,693,587.50	232,219,958.38
开发支出			

商誉			
长期待摊费用		7,465,225.94	8,483,879.16
递延所得税资产		132,601,418.85	132,961,247.51
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		2,876,440,638.91	2,808,648,331.00
<b>资产总计</b>		35,921,749,168.59	32,589,115,297.63
<b>流动负债：</b>			
短期借款			
应付货币保证金		27,448,379,404.85	24,449,581,016.08
应付质押保证金		932,166,832.00	621,717,032.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		241,878,662.38	232,191,214.15
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款			
预收款项			
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金		359,709.00	671,681.51
应付手续费及佣金		828,367.63	840,649.07
应付职工薪酬		648,766,092.71	668,066,501.12
应交税费		31,156,657.89	119,142,637.79
其他应付款		49,949,789.92	198,461,735.03
其中：应付利息			
应付股利			157,200,000.00
合同负债		579,958.46	351,938.60
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债		22,149.04	21,116.32
<b>流动负债合计</b>		29,354,087,623.88	26,291,045,521.67
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券			
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
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		34,354,471.46	65,806,417.33
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		34,354,471.46	65,806,417.33
<b>负债合计</b>		29,388,442,095.34	26,356,851,939.00

<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
股本		1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		1,502,904,302.10	1,502,904,302.10
减：库存股			
其他综合收益		-1,220,053.50	-1,220,053.50
专项储备			
盈余公积		398,170,713.39	398,170,713.39
一般风险准备		458,061,727.32	458,061,727.32
未分配利润		2,865,390,383.94	2,564,346,669.32
<b>股东权益合计</b>		<b>6,533,307,073.25</b>	<b>6,232,263,358.63</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>35,921,749,168.59</b>	<b>32,589,115,297.63</b>

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

### （三）合并利润表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
<b>一、营业收入</b>		11,094,744,238.08	11,887,871,264.56
手续费及佣金净收入	六（二）1	276,016,332.31	203,240,044.87
其中：经纪业务手续费收入		224,188,636.91	171,146,892.79
资产管理业务收入		30,052,884.30	10,902,184.71
投资咨询业务收入		1,196,870.48	1,321,382.40
代理销售金融产品收入		20,577,940.62	19,869,584.97
其他代理业务收入			
利息净收入	六（二）2	254,532,312.32	307,960,764.09
其中：利息收入		296,951,486.77	342,496,113.92
利息支出		42,419,174.45	34,535,349.83
投资收益（损失以“-”号填列）	六（二）3	744,554,239.46	352,753,652.15
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		84,842,316.48	125,050,134.42
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	六（二）4	7,746,451.35	2,925,484.68
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六（二）5	-134,846,913.72	403,239,373.39
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,126,363.60	-836,894.08

其他业务收入	六（二） 6[注 9]	9,948,868,179.96	10,618,588,839.46
其中：风险管理业务收入		9,919,444,867.16	10,247,839,812.08
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
<b>二、营业支出</b>		10,683,555,475.38	11,056,737,351.23
提取期货风险准备金		9,687,448.23	7,510,329.13
税金及附加	六（二）8	3,014,773.41	3,040,326.84
业务及管理费	六（二）9	486,260,699.48	480,075,859.56
研发费用			
信用减值损失	六（二）10	20,950,492.92	5,322,508.71
其他资产减值损失	六（二）11	418,046,162.62	180,373,707.39
其他业务成本	六（二）12	9,745,595,898.72	10,380,414,619.60
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		411,188,762.70	831,133,913.33
加：营业外收入	六（二）13	117,976,582.13	4,182,438.83
减：营业外支出	六（二）14	2,182,513.15	2,707,771.96
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		526,982,831.68	832,608,580.20
减：所得税费用	六（二）15	116,611,289.72	170,747,934.40
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		410,371,541.96	661,860,645.80
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）		410,371,541.96	661,860,645.80
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（净亏损以“-”填列）			
2.归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”填列）		410,371,541.96	661,860,645.80
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>	六（二）16	15,517,724.43	8,255,854.14
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		15,517,724.43	8,255,854.14
1.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			
（3）其他权益工具投资公允价值变动			
（4）企业自身信用风险公允价值变动			
（5）其他			
2.将重分类进损益的其他综合收益		15,517,724.43	8,255,854.14
（1）权益法下可转损益的其他综合收益			
（2）其他债权投资公允价值变动			

(3) 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
(4) 其他债权投资信用损失准备			
(5) 现金流量套期储备			
(6) 外币财务报表折算差额		15,517,724.43	8,255,854.14
(7) 其他			
(二) 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
<b>七、综合收益总额</b>		425,889,266.39	670,116,499.94
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		425,889,266.39	670,116,499.94
(二) 归属于少数股东的综合收益总额			
<b>八、每股收益：</b>			
(一) 基本每股收益		0.31	0.51
(二) 稀释每股收益		0.31	0.51

注9：为保持与第三节、五（五）2 营业情况分析中利润构成列示项目一致，财务报表附注六（二）“其他业务收入”与“资产处置收益”列示在上表“其他业务收入”中。

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

#### （四） 母公司利润表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
<b>一、营业收入</b>		699,830,833.69	1,167,629,531.97
手续费及佣金净收入	十（二） 1	249,200,653.08	231,027,435.69
其中：经纪业务手续费收入		193,748,963.20	150,206,606.94
资产管理业务收入		34,196,973.12	59,712,649.12
投资咨询业务收入		676,776.14	1,238,594.66
代理销售金融产品收入		20,577,940.62	19,869,584.97
其他代理业务收入			
利息净收入		253,996,013.84	308,045,932.61
其中：利息收入		276,430,283.20	324,250,527.58
利息支出		22,434,269.36	16,204,594.97
投资收益（损失以“-”号填列）	十（二） 2	313,642,259.30	301,443,591.62
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		75,849,780.36	123,748,402.70
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			

其他收益		1,983,913.81	125,484.68
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-125,807,783.48	324,301,729.49
汇兑收益（损失以“-”号填列）		75.91	720.79
其他业务收入		6,744,734.87	2,679,889.94
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）		70,966.36	4,747.15
<b>二、营业支出</b>		321,506,243.52	375,543,739.71
提取期货风险准备金		9,687,448.23	7,510,329.13
税金及附加		1,980,625.66	1,537,072.55
业务及管理费		306,475,138.77	365,954,733.01
研发费用			
信用减值损失		591,791.70	474,452.36
其他资产减值损失			
其他业务成本		2,771,239.16	67,152.66
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		378,324,590.17	792,085,792.26
加：营业外收入		59.87	3,698.15
减：营业外支出		2,149,696.97	2,640,222.88
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		376,174,953.07	789,449,267.53
减：所得税费用		75,131,238.45	145,488,597.01
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		301,043,714.62	643,960,670.52
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		301,043,714.62	643,960,670.52
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>			
（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			
3. 其他权益工具投资公允价值变动			
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益			
1. 权益法下可转损益的其他综合收益			
2. 其他债权投资公允价值变动			
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备			
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
<b>七、综合收益总额</b>		301,043,714.62	643,960,670.52
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(五) 合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		1,708,786,863.68	
销售商品、提供劳务收到的现金		11,224,814,028.41	12,303,584,591.31
收取利息、手续费及佣金的现金		594,481,322.72	568,457,843.58
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	六（三） 1	4,169,057,349.24	2,742,562,074.05
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>17,697,139,564.05</b>	<b>15,614,604,508.94</b>
为交易目的而持有的金融资产净增加额			104,968,689.26
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		12,215,554,432.07	12,511,551,323.91
支付利息、手续费及佣金的现金		22,961,815.26	16,204,594.97
以现金支付的业务及管理费		153,450,597.03	120,093,396.00
支付给职工以及为职工支付的现金		330,241,961.94	315,713,960.78
支付的各项税费		258,201,985.76	156,343,008.44
支付其他与经营活动有关的现金	六（三） 2	2,823,692,620.36	1,613,627,345.25
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>15,804,103,412.42</b>	<b>14,838,502,318.61</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>1,893,036,151.63</b>	<b>776,102,190.33</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			
取得投资收益收到的现金			3,209.07
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		83,305.15	152,584.92
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	4,160,214.71	
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>4,243,519.86</b>	<b>155,793.99</b>
投资支付的现金			12,593,099.29
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		13,260,791.41	18,992,646.69
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	六（三） 4	1,180,909,746.80	
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>1,194,170,538.21</b>	<b>31,585,745.98</b>

投资活动产生的现金流量净额		-1,189,927,018.35	-31,429,951.99
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
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		687,300,000.00	767,485,874.00
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） 5	65,000,000.00	733,890,579.26
<b>筹资活动现金流入小计</b>		752,300,000.00	1,501,376,453.26
偿还债务支付的现金		417,485,874.00	493,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		180,571,770.78	362,500,339.50
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） 6	4,095,593.31	
<b>筹资活动现金流出小计</b>		602,153,238.09	855,500,339.50
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		150,146,761.91	645,876,113.76
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		15,979,414.79	9,191,804.05
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		869,235,309.98	1,399,740,156.15
加：期初现金及现金等价物余额		15,969,616,524.14	13,919,415,645.30
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		16,838,851,834.12	15,319,155,801.45

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		21,984,465.95	
销售商品、提供劳务收到的现金			
收取利息、手续费及佣金的现金		547,590,852.38	573,220,838.93
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		3,334,415,786.90	2,573,827,061.42
<b>经营活动现金流入小计</b>		3,903,991,105.23	3,147,047,900.35
为交易目的而持有的金融资产净增加额			99,040,809.93
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金			
支付利息、手续费及佣金的现金		22,434,269.36	16,204,594.97
以现金支付的业务及管理费		73,839,118.36	63,609,164.99
支付给职工以及为职工支付的现金		247,087,061.53	243,144,229.40
支付的各项税费		207,605,990.23	117,359,257.83
支付其他与经营活动有关的现金		3,415,200,425.59	1,462,130,176.85



<b>经营活动现金流出小计</b>		3,966,166,865.07	2,001,488,233.97
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		-62,175,759.84	1,145,559,666.38
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			
取得投资收益收到的现金			60,000,000.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		80,888.01	152,548.32
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			350,000,000.00
<b>投资活动现金流入小计</b>		80,888.01	410,152,548.32
投资支付的现金			300,408,500.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		8,586,027.73	17,253,867.98
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			
<b>投资活动现金流出小计</b>		8,586,027.73	317,662,367.98
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-8,505,139.72	92,490,180.34
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金			
<b>筹资活动现金流入小计</b>			
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		157,200,000.00	157,200,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金			
<b>筹资活动现金流出小计</b>		157,200,000.00	157,200,000.00
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-157,200,000.00	-157,200,000.00
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-227,880,899.56	1,080,849,846.72
加：期初现金及现金等价物余额		15,488,253,132.19	13,270,901,224.29
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		15,260,372,232.63	14,351,751,071.01

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

### 三、 财务报表附注

#### (一) 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	第三节三（二）
2. 半年度报告所采用的会计估计与上年度财务报表是否变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
3. 是否存在前期差错更正	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	第三节三（二）
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
5. 存在控制关系的关联方是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
6. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	第七节三（二）附注五
7. 是否存在证券发行、回购和偿还情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
8. 是否存在向所有者分配利润的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
9. 是否根据会计准则的相关规定披露分部报告	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
10. 是否存在半年度资产负债表日至半年度财务报告批准报出日之间的非调整事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
11. 是否存在上年度资产负债表日以后所发生的或有负债和或有资产变化情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
12. 是否存在企业结构变化情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
13. 重大的长期资产是否转让或者出售	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
14. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
15. 是否存在重大的研究和开发支出	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
16. 是否存在重大的资产减值损失	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	如表下所述
17. 是否存在预计负债	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	第七节三（二）附注六（一）35

#### 资产减值损失：

本期其他资产减值损失发生额 4.18 亿元，系公司计提的存货跌价损失，主要由公司风险管理子公司期现结合等业务产生。该等业务的真实利润需要结合其他业务收入、其他业务支出、投资收益及公允价值变动等项目综合考虑，不能简单通过上述单个项目作出判断。

## （二） 报表项目注释

# 永安期货股份有限公司

## 财务报表附注

2020 年 1-6 月

金额单位：人民币元

### 一、公司基本情况

永安期货股份有限公司(以下简称公司或本公司)前身系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 28 家营业部及 15 家分公司,分别位于北京、上海、天津、重庆、浙江、山东及辽宁等地。本公司拥有控股子公司 13 家,分别为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)、浙江国油能源有限公司(以下简称国油能源公司)、新永安国际金融控股有限公司(以下简称新永安控股公司)、中国新永安期货有限公司(以下简称新永安期货公司)、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)、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)和永安全球基金独立投资组合公司(以下简称永安全球基金公司)。

本财务报表业经公司 2020 年 12 月 9 日第三届董事会第十次会议批准对外报出。

### 二、财务报表的编制基础

#### (一) 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

#### (二) 持续经营能力评价

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营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。本财务报表所载财务信息的会计期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。

## （三）营业周期

公司经营业务的营业周期为 12 个月。

## （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三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；（3）不属于上述（1）或（2）的财务担保合同，以及不属于上述（1）并以低于市场利率贷款的贷款承诺；（4）以摊余成本计量的金融负债。

### 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

#### （1）金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

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。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第14号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

#### （2）金融资产的后续计量方法

##### 1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

##### 2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

##### 3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

##### 4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

### (3) 金融负债的后续计量方法

#### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

#### 2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

#### 3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同，以及不属于上述1)并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 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

#### 4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

### (4) 金融资产和金融负债的终止确认

#### 1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；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。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）未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；（2）保留了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）所转移金融资产在终止确认日的账面价值；（2）因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价

值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日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，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）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. 金融工具减值

##### （1）金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资、合同资产、租赁应收款、分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指公司按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于公司购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，公司在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。

对于由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成，且不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损

失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

公司利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

(2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
结算备付金——应收交易所和商业银行组合	款项性质	对于存放在境内外交易所和商业银行的款项纳入应收交易所和商业银行组合，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
存出保证金——应收交易所和商业银行组合	款项性质	
应收货币保证金——应收交易所和商业银行组合	款项性质	
结算备付金——其他组合	款项性质	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
存出保证金——其他组合	款项性质	
应收货币保证金——其他组合	款项性质	
应收质押保证金——应收交易所和商业银行等组合	款项性质	应收质押保证金系公司代客户向期货交易所办理有价证券充抵保证金业务形成的可用于期货交易的保证金，纳入应收交易所和商业银行等组合，参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
应收结算担保金——应收交易所和商业银行等组合	款项性质	公司报告期内应收结算担保金均存放于中国金融期货交易所、中国证券登记结算有限公司和Asia Pacific Exchange等，



项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
		纳入应收交易所和商业银行等组合，参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
融出资金	款项性质	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
其他应收款——账龄组合	账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
其他应收款——应收股利组合	款项性质	
其他应收款——应收利息组合	款项性质	
其他应收款——合并范围内关联方组合	合并范围内关联方	

(3) 按组合计量预期信用损失的应收款项和合同资产

1) 具体组合及计量预期信用损失的方法

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
应收银行承兑汇票	票据类型	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
应收商业承兑汇票		
应收账款——账龄组合	账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，编制应收账款账龄与整个存续期预期信用损失率对照表，计算预期信用损失。
应收账款——合并范围内关联方组合	合并范围内关联方	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。

2) 账龄组合的账龄与整个存续期预期信用损失率对照表

2) 账龄组合的账龄与整个存续期预期信用损失率对照表

账 龄	预期信用损失率(%)
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

#### 6. 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，公司以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：(1) 公司具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；(2) 公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

##### (十) 存货

###### 1. 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，并与其对应的成本进行比较，分别确定存货跌价准备的计提或转回的金额。

###### 4. 存货的盘存制度为永续盘存制。

##### (十一) 营业部的资金管理、交易清算原则

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

##### (十二) 客户保证金的管理与核算方法

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

##### (十三) 质押品的管理与核算方法

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

##### (十四) 实物交割的管理与核算方法

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

##### (十五) 客户资产管理业务核算方法

公司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。

## (十六) 长期股权投资

### 1. 共同控制、重要影响的判断

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

### 2. 投资成本的确定

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 后续计量及损益确认方法

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

资，采用权益法核算。

#### 4. 减值测试方法及减值准备计提方法

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

#### (十七) 投资性房地产

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

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

#### (十八) 固定资产

##### 1. 固定资产的确认条件

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

##### 2. 各类固定资产的折旧方法

项 目	折旧方法	折旧年限(年)	残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	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。

#### (十九) 在建工程

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

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

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

#### (二十) 无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。

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

项 目	摊销年限(年)
软 件	3
土地使用权	40

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

#### (二十一) 长期待摊费用

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

#### (二十二) 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。

### (二十三) 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期货经纪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。

### (二十四) 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。

### (二十五) 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。

### (二十六) 合同负债

合同负债是指已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务，如企业在转让承诺的商品或服务之前已收取的款项。

### (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. 收入确认原则

于合同开始日，公司对合同进行评估，识别合同所包含的各单项履约义务，并确定各单项履约义务是在某一时段内履行，还是在某一时点履行。

满足下列条件之一时，属于在某一时段内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：(1) 客户在公司履约的同时即取得并消耗公司履约所带来的经济利益；(2) 客户能够控制公司履约过程中在建商品或服务；(3) 公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理

确定时，已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。对于在某一时点履行的履约义务，在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品控制权时，公司考虑下列迹象：(1) 公司就该商品享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；(2) 公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有该商品的法定所有权；(3) 公司已将该商品实物转移给客户，即客户已实物占有该商品；(4) 公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；(5) 客户已接受该商品；(6) 其他表明客户已取得商品控制权的迹象。

## 2. 收入计量原则

(1) 公司按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。交易价格是公司因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项以及预期将退还给客户的款项。

(2) 合同中存在可变对价的，公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，但包含可变对价的交易价格，不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。

(3) 合同中存在重大融资成分的，公司按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。

(4) 合同中包含两项或多项履约义务的，公司于合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务。

## 3. 收入确认的具体方法

本公司收入主要包括期货经纪业务收入、资产管理业务收入、利息收入和商品销售收入和基金销售业务收入等。

### (1) 期货经纪业务手续费收入

经纪业务手续费收入为公司向客户收取的交易手续费扣减公司应付交易所交易手续费，在与客户办理每日款项清算时确认。交易所减收手续费收入在交易所资金结算完成时，根据收取手续费减收金额确认。

### (2) 资产管理业务收入

资产管理业务中管理费收入按合同规定的比例计算应由公司享有的管理费收益，相关的经济利益能够流入及收入的金额能够可靠地计量时确认为当期收益；业绩报酬收入在满足合同约定的业绩报酬计提条件时，于合同约定的时点确认。

### (3) 利息收入

利息收入以占用资金的时间为基础，采用实际利率法计算确定。实际利率与合同利率差异较小的，按合同利率计算。

### (4) 商品销售收入

公司在商品货权转移并已经收回货款或取得了收款凭证，且相关的经济利益很可能流入时，视为已将商品所有权上的主要风险和报酬转移给购货方，确认商品销售收入。

### (5) 基金销售业务收入

公司在基金销售服务已经提供，相关的经济利益能够流入及收入的金额能够可靠地计量时确认当期收入。

#### (6) 其他收入

其他业务，在相关服务已经提供，相关的经济利益能够流入及收入的金额能够可靠地计量时，按合同约定方式确认当期收入或损失。

#### (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) 经营租赁

公司为承租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金计入相关资产成本或确认为当期损益，发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

公司为出租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金确认为当期损益，发生的初始直接费用，除金额较大的予以资本化并分期计入损益外，均直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

### (三十一) 分部报告

公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度等为依据确定经营分部。公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

1. 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
2. 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
3. 能够通过分析取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

### (三十二) 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。

### (三十三) 重要会计政策、会计估计变更说明

本公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 14 号——收入》（以下简称新收入准则）。根据相关新旧准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新准则的累积影响数追溯调整 2020 年 1 月 1 日的留存收益及财务报表其他相关项目金额。

执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2019 年 12 月 31 日	新收入准则调整影响	2020 年 1 月 1 日
预收款项	741,569,234.77	-741,569,234.77	
合同负债		657,269,581.43	657,269,581.43
其他流动负债		84,299,653.34	84,299,653.34

## 四、税（费）项

### (一) 主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	13%、9%、6%、3%

城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	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%[注 10]
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%
永安全球基金公司	[注 11]
除上述以外的其他纳税主体	25%

注 10：根据香港相关法律法规并经当地税务局批准，新永安期货公司离岸收入免缴企业所得税注。

注 11：永安全球基金公司注册地在开曼群岛，免交企业所得税。

## （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

本期无新纳入合并财务报表范围的子公司。

#### 2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

本期无新纳入合并范围的结构化主体。

### (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

本公司管理的永利1号资产管理计划（以下简称永利1号）因到期清算、永屹一号资产管理计划（以下简称永屹一号）因已完成清算，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
国油能源公司	舟山	舟山	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
永安全球基金公司	香港	开曼	金融业		100.00	设立

#### 2. 纳入合并范围的结构化主体

永利2号资产管理计划（以下简称永利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	31.35		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/2019年1-6月		
	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	鞍钢商贸公司
流动资产	2,481,764,262.47	394,413,189.18	52,713,029.94	1,940,825,259.42	236,807,821.96	64,233,688.92
非流动资产	93,709,583.71	24,995,386.09		75,236,491.93	23,979,630.09	18,180.28
资产合计	2,575,473,846.18	419,408,575.27	52,713,029.94	2,016,061,751.35	260,787,452.05	64,251,869.20
流动负债	873,383,762.37	201,405,962.47	2,542,850.05	553,808,109.94	137,975,671.50	17,301,924.90
非流动负债	40,030,527.30			42,108,914.68		30,692.50
负债合计	913,414,289.67	201,405,962.47	2,542,850.05	595,917,024.62	137,975,671.50	17,332,617.40
少数股东权益		113,964,465.14			39,231,816.52	
归属于母公司所有者权益	1,662,059,556.51	104,038,147.66	50,170,179.89	1,420,144,726.73	83,579,964.03	46,919,251.80
按持股比例计算的净资产份额	521,120,811.07	19,767,248.05	24,582,838.38	445,271,030.71	15,880,193.16	22,990,433.38
对联营企业权益投资的账面价值	521,120,811.07	19,767,248.05	24,582,838.38	445,271,030.71	15,880,193.16	22,990,433.38
营业收入	1,637,210,918.20	5,784,740.08	112,374,749.65	1,041,569,096.79	13,444,921.76	781,610,040.90
净利润	241,914,829.78	95,266,086.66	3,250,928.09	648,887,520.00	19,014,987.25	-4,206,142.92
其他综合收益						

综合收益总额	241,914,829.78	95,266,086.66	3,250,928.09	648,887,520.00	19,014,987.25	-4,206,142.92
本期收到的来自联营企业的股利						

## 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	3,110.96	8,315.11
银行存款	1,605,951,908.14	897,611,616.61
期货保证金存款	15,721,910,003.63	16,209,864,177.87
证券经纪业务保证金	146,592,282.45	55,713,840.30
其他货币资金	366,836,198.47	114,044,797.15
合计	17,841,293,503.65	17,277,242,747.04

##### (2) 使用受限的货币资金说明

期末其他货币资金中有 19,863,812.00 元保函保证金、10,623,632.07 元信用证保证金使用受限。

##### (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	HKD 1,644,825.20	0.9134	1,502,383.34	HKD 1,476,204.99	0.8958	1,322,384.43
工商银行	JPY 3,002,198.00	0.0658	197,544.63	JPY 25,391,446.00	0.0641	1,627,591.69
工商银行	USD 1,712,833.14	7.0795	12,126,002.21	USD 2,403,860.43	6.9762	16,769,811.13
工商银行	RMB 977,252,771.38	1.0000	977,252,771.38	RMB 321,026,270.14	1.0000	321,026,270.14
工商银行	SGD 67,970.00	5.0813	345,375.96			
光大银行	RMB 5,758,598.64	1.0000	5,758,598.64	RMB 5,477,465.74	1.0000	5,477,465.74
建设银行	RMB 37,144,458.56	1.0000	37,144,458.56	RMB 36,054,317.41	1.0000	36,054,317.41
交通银行	EUR 173,970.89	7.9610	1,384,982.26	EUR 264,912.20	7.8155	2,070,421.30
交通银行	HKD 1,021,824.06	0.9134	933,334.10	HKD 23,357,345.26	0.8958	20,923,509.88
交通银行	JPY 5,766,711.00	0.0658	379,449.58	JPY 10,092,241.00	0.0641	646,912.65
交通银行	RMB 8,497,325,756.32	1.0000	8,497,325,756.32	RMB 8,934,218,786.33	1.0000	8,934,218,786.33

交通银行	USD	33,610,822.98	7.0795	237,947,821.29	USD	4,494,324.53	6.9762	31,353,306.79
交通银行	GBP	148,864.37	8.7144	1,297,263.67	GBP	153,857.41	9.1501	1,407,810.69
民生银行	RMB	1,720,727,496.20	1.0000	1,720,727,496.20	RMB	2,637,399,231.25	1.0000	2,637,399,231.25
民生银行	HKD	6.80	0.9134	6.21	HKD	6.80	0.8958	6.09
民生银行	USD	32,571,074.26	7.0795	230,586,920.22	USD	25,079,606.91	6.9762	174,960,353.73
农业银行	RMB	41,745,101.69	1.0000	41,745,101.69	RMB	35,249,488.19	1.0000	35,249,488.19
浦发银行	RMB	7,619,262.60	1.0000	7,619,262.60	RMB	5,561,946.47	1.0000	5,561,946.47
兴业银行	RMB	1,913,441,323.27	1.0000	1,913,441,323.27	RMB	2,759,135,469.13	1.0000	2,759,135,469.13
兴业银行	HKD				HKD	20,000,000.00	0.8958	17,916,000.00
兴业银行	USD	57,397,048.14	7.0795	406,342,402.31	USD	57,048,154.78	6.9762	397,979,337.38
渣打银行	HKD	1,883,257.45	0.9134	1,720,167.35	HKD	1,883,248.11	0.8958	1,687,013.66
渣打银行	USD	1,968,593.96	7.0795	13,936,660.94	USD	179,236.38	6.9762	1,250,388.83
招商银行	RMB	8,006,006.45	1.0000	8,006,006.45	RMB	5,936,956.61	1.0000	5,936,956.61
招商银行	HKD	2,854,483.59	0.9134	2,607,285.31	HKD	11,341,185.99	0.8958	10,159,434.41
招商银行	USD	18,057,496.19	7.0795	127,838,044.28	USD	1,027,322.26	6.9762	7,166,805.55
中国银行	EUR	95,581.37	7.9610	760,923.29	EUR	55,580.90	7.8155	434,392.52
中国银行	HKD	41,527,545.50	0.9134	37,931,260.06	HKD	72,751,236.74	0.8958	65,170,557.87
中国银行	USD	13,954,102.85	7.0795	98,788,071.13	USD	15,191,157.51	6.9762	105,976,553.02
中国银行	JPY	19,994,337.00	0.0658	1,315,627.37	JPY	41,284,112.00	0.0641	2,646,311.58
中国银行	RMB	102,598,338.42	1.0000	102,598,338.42	RMB	82,253,432.44	1.0000	82,253,432.44
中国银行	SGD	500.47	5.0813	2,543.04				
中信银行	RMB	713,663,542.77	1.0000	713,663,542.77	RMB	12,974,167.78	1.0000	12,974,167.78
平安银行	RMB	3,082,214.94	1.0000	3,082,214.94	RMB	1,998,471.61	1.0000	1,998,471.61
星展银行	RMB	511,195,822.16	1.0000	511,195,822.16	RMB	506,225,490.67	1.0000	506,225,490.67
星展银行	USD	590,221.37	7.0795	4,178,472.19	USD	700,063.20	6.9762	4,883,780.90
大华银行	USD	23,418.87	7.0795	165,793.89				
大华银行	SGD	12,000.00	5.0813	60,975.60				
小计				15,721,910,003.63				16,209,864,177.87

(4) 货币资金——证券经纪业务保证金存款

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
中国银行	HKD 101,157,349.25	0.9134	92,397,122.80	HKD 45,400,249.67	0.8958	40,669,543.65
中国银行	RMB 10,448,381.95	1.0000	10,448,381.95	RMB 1,639,929.06	1.0000	1,639,929.06
中国银行	USD 6,179,359.80	7.0795	43,746,777.70	USD 1,921,442.56	6.9762	13,404,367.59
小计			146,592,282.45			55,713,840.30

## 2. 结算备付金

### (1) 明细情况

#### 1) 类别明细情况

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	6,069,107.86	100.00	75,940.76	1.25	5,993,167.10
合计	6,069,107.86	100.00	75,940.76	1.25	5,993,167.10

(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(%)	
按组合计提坏账准备	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67
合计	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67

#### 2) 采用组合计提坏账准备的结算备付金

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组合	4,550,292.67			599,309.79		
其他组合	1,518,815.19	75,940.76	5.00	139,859.87	6,992.99	5.00
小计	6,069,107.86	75,940.76	1.25	739,169.66	6,992.99	0.95

#### (2) 明细情况——按类别

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	账面价值	账面余额	坏账准备	账面价值
公司自有备付金	6,069,107.86	75,940.76	5,993,167.10	739,169.66	6,992.99	732,176.67
小计	6,069,107.86	75,940.76	5,993,167.10	739,169.66	6,992.99	732,176.67

### 3. 融出资金

#### (1) 明细情况——按类别

项 目	期末数	期初数
孖展融资	220,851,967.89	42,305,165.46
减：减值准备	8,614,950.78	2,115,258.27
合 计	212,237,017.11	40,189,907.19

#### (2) 明细情况——按客户

项 目	期末数	期初数
个人	129,182,143.83	32,004,680.10
机构	91,669,824.06	10,300,485.36
减：减值准备	8,614,950.78	2,115,258.27
合 计	212,237,017.11	40,189,907.19

### 4. 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 (%)	
按组合计提坏账准备	14,342,268,882.29	100.00	24,025,817.67	0.17	14,318,243,064.62
合 计	14,342,268,882.29	100.00	24,025,817.67	0.17	14,318,243,064.62

(续上表)

种 类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	11,342,645,743.82	100.00	16,983,814.56	0.15	11,325,661,929.26
合 计	11,342,645,743.82	100.00	16,983,814.56	0.15	11,325,661,929.26

##### 2) 采用组合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组合	13,861,752,528.99			11,002,969,452.69		
其他组合	480,516,353.30	24,025,817.67	5.00	339,676,291.13	16,983,814.56	5.00
小 计	14,342,268,882.29	24,025,817.67	0.17	11,342,645,743.82	16,983,814.56	0.15

(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	3,743,888,290.82	3,597,636,324.04
大连商品交易所	3,872,833,696.48	2,851,763,069.36
郑州商品交易所	1,539,914,510.37	1,194,736,420.73
中国金融期货交易所	3,207,762,275.58	2,548,869,476.49
上海国际能源交易中心	984,887,205.48	278,249,745.06
中国证券登记结算有限责任公司	426,814,406.59	344,143,319.64
香港期货交易所	79,082,466.99	180,607,087.44
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED	164,920,582.97	120,611,578.84
MAREX FINANCIAL Ltd.	134,413,934.78	71,599,398.20
Philip Futures Pte Ltd	147,365,483.24	100,755,176.17
R. J. O' Brien & Associates	29,784,511.27	35,675,599.28
Nissan Securities Co., Ltd	2,027,412.01	2,701,090.81
Hyundai Futures Corporaiong	165,348.28	166,090.73
KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd	17,139.49	16,889.91
Asia Pacific Exchange	341,879.95	304,399.43
ADMIS SINGAPORE PTE LTD BANKING INSTRUCTION	1,821,941.25	8,150,467.19
DBS Bank Ltd	5,631,426.22	6,148,091.64
其他	596,370.52	511,518.86
减：坏账准备	24,025,817.67	16,983,814.56
合 计	14,318,243,064.62	11,325,661,929.26

5. 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(%)	
按组合计提坏账准备	932,166,832.00	100.00			932,166,832.00
合计	932,166,832.00	100.00			932,166,832.00

(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(%)	
按组合计提坏账准备	621,717,032.00	100.00			621,717,032.00
合计	621,717,032.00	100.00			621,717,032.00

## 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(%)
应收交易所组合	932,166,832.00			621,717,032.00		
小计	932,166,832.00			621,717,032.00		

## (2) 明细情况

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	261,284,848.00	184,389,160.00
郑州商品交易所	167,888,816.00	129,312,000.00
上海国际能源交易中心	191,443,360.00	
中国金融期货交易所	311,549,808.00	308,015,872.00
合计	932,166,832.00	621,717,032.00

## (3) 质押物明细情况

质押物类别	期末市值	折扣率
棉花一号	96,375,200.00	80.00%
干制红枣	5,881,050.00	80.00%
甲醇 N	4,947,000.00	80.00%
硅铁	31,361,880.00	80.00%

锰硅	33,343,250.00	80.00%
PTA	37,952,640.00	80.00%
白银	94,892,040.00	80.00%
沥青	164,681,920.00	80.00%
铜	1,217,250.00	80.00%
燃料油	10,101,000.00	80.00%
镍	23,985,000.00	80.00%
橡胶	10,758,850.00	80.00%
漂针浆	20,970,000.00	80.00%
国债 10 年期	286,782,960.00	80.00%
国债 2 年期	102,654,300.00	80.00%
20 号胶	9,223,500.00	80.00%
原油	230,080,700.00	80.00%
合 计	1,165,208,540.00	

6. 存出保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	1,056,534.35	100.00	35,396.08	3.35	1,021,138.27
合 计	1,056,534.35	100.00	35,396.08	3.35	1,021,138.27

(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 (%)	
按组合计提坏账准备	876,773.21	100.00	34,880.66	3.98	841,892.55
合 计	876,773.21	100.00	34,880.66	3.98	841,892.55

2) 采用组合计提坏账准备的存出保证金

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组合	348,612.81			179,160.00		
其他组合	707,921.54	35,396.08	5.00	697,613.21	34,880.66	5.00
小计	1,056,534.35	35,396.08	3.35	876,773.21	34,880.66	3.98

## 7. 交易性金融资产

### (1) 明细情况

期末数						
项目	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	初始成本合计
债券	1,378,648.88		1,378,648.88	1,341,511.31		1,341,511.31
基金	2,726,536,481.39		2,726,536,481.39	2,581,086,755.81		2,581,086,755.81
股票	50,007,946.15		50,007,946.15	48,888,972.24		48,888,972.24
衍生工具	176,877,947.58		176,877,947.58			
合计	2,954,801,024.00		2,954,801,024.00	2,631,317,239.36		2,631,317,239.36

(续上表)

期初数						
项目	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	初始成本合计
债券	20,301,792.54		20,301,792.54	18,225,010.98		18,225,010.98
基金	3,265,155,923.10		3,265,155,923.10	2,992,634,357.76		2,992,634,357.76
股票	760,811,621.84		760,811,621.84	627,308,359.95		627,308,359.95
衍生工具	84,669,253.35		84,669,253.35			
合计	4,130,938,590.83		4,130,938,590.83	3,638,167,728.69		3,638,167,728.69

### (2) 其他说明

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科目中。截至报告期末本公司持有的期货

合约的浮盈为 52,998,387.06 元，浮亏为 28,810,963.76 元。截至 2019 年 12 月 31 日，本公司持有的期货合约浮盈为 42,163,112.40 元，浮亏为 11,445,003.06 元。

8. 应收账款

(1) 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 (%)	
按组合计提坏账准备	72,691,675.81	100.00	4,726,013.01	6.50	67,965,662.80
其中：应收佣金	10,592,244.83	14.57	1,619,839.50	15.29	8,972,405.33
应收货款	62,099,430.98	85.43	3,106,173.51	5.00	58,993,257.47
合计	72,691,675.81	100.00	4,726,013.01	6.50	67,965,662.80

(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 (%)	
按组合计提坏账准备	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09
其中：应收佣金	15,614,020.73	57.39	1,752,466.75	11.22	13,861,553.98
应收货款	11,593,228.54	42.61	579,661.43	5.00	11,013,567.11
合计	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09

(2) 采用组合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	71,438,079.41	3,571,903.97	5.00
1-2 年	8,013.06	1,602.61	20.00
2-3 年	100,000.00	30,000.00	30.00
3-4 年	38,461.52	15,384.61	40.00
4 年以上	1,107,121.82	1,107,121.82	100.00
小计	72,691,675.81	4,726,013.01	6.50

(续上表)

账龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	25,961,665.93	1,298,083.30	5.00

1-2 年			
2-3 年	107,692.28	32,307.68	30.00
3-4 年	226,923.10	90,769.24	40.00
4 年以上	910,967.96	910,967.96	100.00
小 计	27,207,249.27	2,332,128.18	8.57

(3) 坏账准备变动情况

本期计提坏账准备 2,393,884.83 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
江苏通用科技股份有限公司	9,859,192.00	13.56	492,959.60
河钢集团物资贸易有限公司	9,099,194.89	12.52	454,959.74
桐昆集团浙江恒腾差别化纤维有限公司	8,416,800.00	11.58	420,840.00
中石化浙江舟山石油有限公司	8,140,780.20	11.20	407,039.01
永利 4 号集合资产管理计划管理费	5,444,167.40	7.49	272,208.37
小 计	40,960,134.49	56.35	2,048,006.72

9. 应收款项融资

项 目	期末数					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	减值准备
应收票据	20,591,285.00				20,591,285.00	
合 计	20,591,285.00				20,591,285.00	

(续上表)

项 目	期初数					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	减值准备
应收票据	1,793,095.85				1,793,095.85	
合 计	1,793,095.85				1,793,095.85	

10. 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	639,002,639.92	100.00		639,002,639.92
1-2 年	12,834.12	0.00		12,834.12
2-3 年	8,000.00	0.00		8,000.00
合 计	639,023,474.04	100.00		639,023,474.04

(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	298,483,701.06	98.82		298,483,701.06
1-2 年	3,546,949.12	1.17		3,546,949.12
2-3 年	9,401.60	0.01		9,401.60
合 计	302,040,051.78	100.00		302,040,051.78

(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 (%)
上海钢银电子商务股份有限公司	61,707,767.29	9.66
浙江明日控股集团股份有限公司	26,292,112.63	4.11
上海建发物资有限公司	23,397,686.95	3.66
中国诚通国际贸易有限公司	22,690,266.19	3.55
武安市裕华钢铁有限公司	21,565,717.22	3.37
小 计	155,653,550.28	24.35

## 11. 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 (%)	
按组合计提坏账准备	47,328,324.69	100.00			47,328,324.69
合 计	47,328,324.69	100.00			47,328,324.69

(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 (%)	
按组合计提坏账准备	34,593,853.25	100.00			34,593,853.25
合计	34,593,853.25	100.00			34,593,853.25

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 (%)
应收交易所组合	47,328,324.69			34,593,853.25		
小计	47,328,324.69			34,593,853.25		

(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	32,952,676.30	20,312,096.04
中国证券登记结算有限责任公司	10,841,274.71	10,800,000.00
Asia Pacific Exchange	3,534,373.68	3,481,757.21
合计	47,328,324.69	34,593,853.25

12. 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	680,916.33	97.56		680,916.33				
1-2年								
2-3年	17,004.09	2.44		17,004.09	17,004.09	100.00		17,004.09
合计	697,920.42	100.00		697,920.42	17,004.09	100.00		17,004.09

(2) 应收风险损失款金额前5名情况

单位名称	期末数
倪威中	240,323.52
褚建坤	213,567.73
上海连濠贸易有限公司	158,422.03
陈忠良	19,876.29
李元星	18,268.18



小 计	650,457.75
-----	------------

13. 其他应收款

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提坏账准备	205,293,802.81	57.52	3,906,976.87	1.90	201,386,825.94
其中：其他应收款	205,293,802.81	57.52	3,906,976.87	1.90	201,386,825.94
按组合计提坏账准备	151,621,307.88	42.48	13,358,155.74	8.81	138,263,152.14
其中：应收利息	909,935.91	0.25			909,935.91
应收股利	3,107,816.91	0.87			3,107,816.91
其他应收款	147,603,555.06	41.36	13,358,155.74	9.05	134,245,399.32
合 计	356,915,110.69	100.00	17,265,132.61	4.84	339,649,978.08

(续上表)

种 类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
单项计提坏账准备	50,153,408.74	49.95	3,229,194.47	6.44	46,924,214.27
其中：其他应收款	50,153,408.74	49.95	3,229,194.47	6.44	46,924,214.27
按组合计提坏账准备	50,263,403.59	50.05	8,869,941.91	17.65	41,393,461.68
其中：应收利息	1,905,396.09	1.90			1,905,396.09
应收股利	14,558.23	0.01			14,558.23
其他应收款	48,343,449.27	48.14	8,869,941.91	18.35	39,473,507.36
合 计	100,416,812.33	100.00	12,099,136.38	12.05	88,317,675.95

2) 单项计提坏账准备的其他应收款

① 2020年6月30日

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
永利 1 号资产管理计划	120,680,066.42			理财产品清算款
境外证券业务清算及认购款	8,944,335.04			证券业务清算款及认购款
万佳	17,698,038.40	884,901.92	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保

陈石桥	10,788,724.21	539,436.21	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
汇添富灵兴1号集合资产管理计划	10,000,000.00			理财产品赎回款
易方达兴盛1号集合资产管理计划	9,000,000.00			理财产品认购款
易方达兴盛2号集合资产管理计划	9,000,000.00			理财产品认购款
易方达兴荣1号集合资产管理计划	9,000,000.00			理财产品认购款
招商基金锐信1号集合资产管理计划	7,700,000.00			理财产品赎回款
文胜	2,000,000.00	2,000,000.00	100.00	预计无法收回
应收穿仓款	482,638.74	482,638.74	100.00	预计无法收回
小计	205,293,802.81	3,906,976.87	1.90	

② 2019年12月31日

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
万佳	13,952,264.16	697,613.21	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
七禾言起1号资产管理计划	12,772,869.90			理财产品清算款
陈石桥	10,631,625.29	531,581.26	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
境外证券业务清算及认购款	5,489,773.29			境外证券业务清算及认购款
千象全景19号私募证券投资基金	5,306,876.10			理财产品清算款
文胜	2,000,000.00	2,000,000.00	100.00	预计无法收回
小计	50,153,408.74	3,229,194.47	6.44	

3) 采用组合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(%)
应收利息组合	909,935.91		
应收股利组合	3,107,816.91		
其他应收款账龄组合	147,603,555.06	13,358,155.74	9.05
其中：1年以内	132,484,052.66	6,624,202.63	5.00
1-2年	3,606,351.31	721,270.26	20.00

2-3 年	2,876,116.87	862,835.07	30.00
3-4 年	5,811,977.41	2,324,790.97	40.00
4 年以上	2,825,056.81	2,825,056.81	100.00
小 计	151,621,307.88	13,358,155.74	8.81

(续上表)

账 龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收利息组合	1,905,396.09		
应收股利组合	14,558.23		
其他应收款账龄组合	48,343,449.27	8,869,941.91	18.35
其中：1 年以内	31,416,553.63	1,570,592.73	5.00
1-2 年	2,790,795.28	558,159.07	20.00
2-3 年	1,810,696.07	543,208.83	30.00
3-4 年	10,212,371.69	4,084,948.68	40.00
4 年以上	2,113,032.60	2,113,032.60	100.00
合 计	50,263,403.59	8,869,941.91	17.65

(2) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合 计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失(未发生 信用减值)	整个存续期预期 信用损失(已发 生信用减值)	
期初数	2,799,787.20	558,159.07	8,741,190.11	12,099,136.38
期初数在本期				
--转入第二阶段	-165,428.00	165,428.00		
--转入第三阶段		-244,451.19	244,451.19	
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提	5,378,959.10	239,453.94	-304,903.65	5,313,509.39
本期收回				
本期转回				
本期核销			244,334.21	244,334.21

其他变动	35,222.46	2,680.44	58,918.15	96,821.05
期末数	8,048,540.76	721,270.26	8,495,321.59	17,265,132.61

(3) 应收股利明细情况

单位名称	期末数	期初数
BOCHK Wealth Achieve Fund Series SPC	3,023,133.96	
其他零星股利	84,682.95	14,558.23
合 计	3,107,816.91	14,558.23

(4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例 (%)	坏账准备
永利 1 号资产管理计划	理财产品认购、清算及分红款	120,680,066.42	1 年以内	34.20	
江西铜业(深圳)国际投资控股有限公司	场外应收款	77,000,000.00	1 年以内	21.82	3,850,000.00
万佳	对外拆出款	3,539,607.68	1 年以内	5.02	884,901.92
		14,158,430.72	2-3 年		
深圳市前海锐斯得金融投资有限公司	押金保证金和其他	16,247,322.90	1 年以内	4.60	812,366.15
中信中证资本管理有限公司	场外业务应收款	10,347,695.74	1 年以内	2.93	517,384.79
小 计		241,973,123.46		68.57	6,064,652.86

(5) 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	7,103,592.10	10,968,097.58	1-4 年	借款及利息
财通证券	6,157,185.35		1 年以内	房租收入和场外应收款
小 计	13,260,777.45	10,968,097.58		

14. 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	1,905,715,478.72	69,514,688.35	1,836,200,790.37
发出商品	181,815,438.84	235,828.94	181,579,609.90

在途物资	13,683,182.69	1,104,753.75	12,578,428.94
合 计	2,101,214,100.25	70,855,271.04	2,030,358,829.21

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	1,309,871,578.16	16,128,741.30	1,293,742,836.86
发出商品	246,943,848.05	15,341,261.60	231,602,586.45
在途物资	5,969,376.00		5,969,376.00
合 计	1,562,784,802.21	31,470,002.90	1,531,314,799.31

(2) 期末存货账面余额中 370,317,238.42 元用于质押。

(3) 存货跌价准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少		期末数
			转 回	转 销	
存货	31,470,002.90	426,422,701.12	8,376,538.50	378,660,894.48	70,855,271.04
小 计	31,470,002.90	426,422,701.12	8,376,538.50	378,660,894.48	70,855,271.04

## 15. 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	571,599,809.61		571,599,809.61
合 计	571,599,809.61		571,599,809.61

(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	486,824,372.27		486,824,372.27
合 计	486,824,372.27		486,824,372.27

(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	15,880,193.16			3,947,880.54	
永安国富公司	445,271,030.71			75,849,780.36	
OSTC Yongan	2,682,715.02			3,452,250.57	-6,053.49

Trading Co., Limited					
鞍钢商贸公司	22,990,433.38			1,592,405.01	
合计	486,824,372.27			84,842,316.48	-6,053.49

(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	-60,825.65				19,767,248.05	
永安国富公司					521,120,811.07	
OSTC Yongan Trading Co., Limited					6,128,912.10	
鞍钢商贸公司					24,582,838.39	
合计	-60,825.65				571,599,809.61	

#### 16. 其他权益工具投资

项目	期末数			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	26,845,000.00	26,845,000.00		战略投资
合计	26,845,000.00	26,845,000.00		

(续上表)

项目	期初数			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	26,845,000.00	26,845,000.00		战略投资
合计	26,845,000.00	26,845,000.00		

#### 17. 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

18. 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	11,695,462.54	129,390,625.56	773,902.54	140,312,185.56
土地使用权		247,084,504.10		247,084,504.10
小 计	11,695,462.54	376,475,129.66	773,902.54	387,396,689.66

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	1,660,390.85	3,763,748.56	252,271.99	5,171,867.42
土地使用权		37,909,537.80		37,909,537.80
小 计	1,660,390.85	41,673,286.36	252,271.99	43,081,405.22

账面价值

项 目	期初数	期末数
房屋及建筑物	10,035,071.69	135,140,318.14
土地使用权		209,174,966.30
合 计	10,035,071.69	344,315,284.44

(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7层701室	9,333,070.62	尚未办妥房产证及土地使用权证
杭州财通双冠大厦（不含东楼18层南面）	125,675,053.01	已办妥土地使用权证但未办妥房产证
浙江协作大厦8楼801-805室	132,194.51	尚未办妥房产证及土地使用权证
小 计	135,140,318.14	

19. 固定资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
固定资产	100,152,788.72	232,130,750.50
合 计	100,152,788.72	232,130,750.50

(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	245,728,713.05	76,947,822.74	17,024,945.97	339,701,481.76
本期增加金额	773,902.54	741,501.99		1,515,404.53
购置		741,501.99		741,501.99
投资性房地产转入	773,902.54			773,902.54
本期减少金额	129,390,625.56	383,013.63	222,304.00	129,995,943.19
处置或报废		383,013.63	222,304.00	605,317.63
转入投资性房地产	129,390,625.56			129,390,625.56
外币报表折算差额		88,201.86	17,048.88	105,250.74
期末数	117,111,990.03	77,394,512.96	16,819,690.85	211,326,193.84
累计折旧				
期初数	33,569,391.12	59,986,176.26	14,015,163.88	107,570,731.26
本期增加金额	3,114,454.25	2,992,301.28	515,291.06	6,622,046.59
计提	2,862,182.26	2,992,301.28	515,291.06	6,369,774.60
投资性房地产转入	252,271.99			252,271.99
本期减少金额	2,536,787.54	368,146.45	215,634.88	3,120,568.87
处置或报废		368,146.45	215,634.88	583,781.33
转入投资性房地产	2,536,787.54			2,536,787.54
外币报表折算差额		86,811.13	14,385.01	101,196.14
期末数	34,147,057.83	62,697,142.22	14,329,205.07	111,173,405.12
账面价值				
期末账面价值	82,964,932.20	14,697,370.74	2,490,485.78	100,152,788.72
期初账面价值	212,159,321.93	16,961,646.48	3,009,782.09	232,130,750.50

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（不含 8 楼 801-805 室）	660,972.45	因历史遗留原因至今未办理不动产权证
福州中盛大厦 7 层 702 室	7,425,351.86	未通过房地产主管部门的竣工验收备案



长春伟峰彩宇新城 2204、2205 号房屋	7,300,272.68	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 号房屋	7,805,006.13	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 号房屋	3,153,765.95	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
杭州财通双冠大厦东楼 18 层南面	7,609,453.98	已办妥土地使用权证但未办妥房产证
小计	33,954,823.05	

## 20. 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	45,979,596.11	307,895,517.83
本期增加金额		6,679,145.75	6,679,145.75
购置		6,679,145.75	6,679,145.75
本期减少金额	247,084,504.10		247,084,504.10
转入投资性房地产	247,084,504.10		247,084,504.10
外币报表折算差额		33,892.06	33,892.06
期末数	14,831,417.62	52,692,633.92	67,524,051.54
累计摊销			
期初数	36,911,134.92	37,250,950.90	74,162,085.82
本期增加金额	1,729,670.88	3,840,592.41	5,570,263.29
计提	1,729,670.88	3,840,592.41	5,570,263.29
本期减少金额	36,365,259.66		36,365,259.66
转入投资性房地产	36,365,259.66		36,365,259.66
外币报表折算差额		32,459.52	32,459.52
期末数	2,275,546.14	41,124,002.83	43,399,548.97
账面价值			
期末账面价值	12,555,871.48	11,568,631.09	24,124,502.57
期初账面价值	225,004,786.80	8,728,645.21	233,733,432.01

(2) 期末无无形资产用于担保。

21. 递延所得税资产、递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

项 目	期末数		期初数	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
尚未支付的职工薪酬	581,979,429.72	145,494,857.43	584,716,222.37	146,179,055.59
存货跌价准备	66,069,478.99	16,515,666.29	31,470,002.90	7,867,500.72
坏账准备	18,368,963.83	4,471,172.23	10,344,228.32	2,481,575.55
期货风险准备金	7,525,024.55	1,881,256.14	7,525,024.55	1,881,256.14
公允价值变动减少	197,643,593.22	49,389,724.56	140,487,141.56	35,023,534.83
应付期货投资者保障基金	339,348.11	84,837.03	633,661.80	158,415.45
其他	1,000,000.00	250,000.00		
合 计	872,925,838.42	218,087,513.68	775,176,281.50	193,591,338.28

(2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
公允价值变动增加	365,991,905.38	91,473,976.79	350,116,427.78	87,529,106.96
合 计	365,991,905.38	91,473,976.79	350,116,427.78	87,529,106.96

22. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	192,526,219.86	159,917,978.67
长期待摊费用	9,365,168.32	9,454,316.78
待摊费用	24,094,756.24	20,457,573.49
买入返售金融资产	16,900,000.00	44,800,508.00
合 计	242,886,144.42	234,630,376.94

23. 短期借款

项 目	期末数	期初数
保证借款本金	827,300,000.00	557,485,874.00

保证借款应付利息	1,055,827.72	5,058,635.00
进口押汇本金	52,144,065.89	
进口押汇应付利息	88,395.69	
合 计	880,588,289.30	562,544,509.00

24. 代理买卖证券款

项 目	期末数	期初数
经纪业务	132,480,941.63	43,497,081.98
其中：个人	99,497,143.07	32,759,036.99
机构	32,983,798.56	10,738,044.99
合 计	132,480,941.63	43,497,081.98

25. 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	115,713	8,931,287,719.63	109,870	7,961,489,413.71
法人	6,775	19,196,911,387.76	6,395	16,415,028,263.07
非结算客户	3	248,621,564.94	3	158,911,239.34
合 计	122,491	28,376,820,672.33	116,268	24,535,428,916.12

26. 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	19	563,338,484.00	11	434,089,168.00
合 计	19	563,338,484.00	11	434,089,168.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数
上海期货交易所	31,352,136.00
郑州商品交易所	81,763,980.00

中国金融期货交易所	311,549,808.00
上海国际能源交易中心	138,672,560.00
合 计	563,338,484.00

### 27. 交易性金融负债

项 目	期末数	期初数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	172,799,322.57	135,074,240.55
其中：衍生金融工具	172,799,322.57	135,074,240.55
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	576,319,280.24	1,648,141,578.57
其中：结构化主体其他投资者享有的权益	576,319,280.24	1,648,141,578.57
合 计	749,118,602.81	1,783,215,819.12

### 28. 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	232,191,214.15	9,687,448.23		241,878,662.38
合 计	232,191,214.15	9,687,448.23		241,878,662.38

#### (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

本期无动用风险准备金的情况。

### 29. 应付账款

项 目	期末数	期初数
货款	87,550,845.57	107,960,512.29
小 计	87,550,845.57	107,960,512.29

### 30. 合同负债

#### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
预收货款	778,616,179.76	656,917,642.83

投资咨询费	369,150.74	351,938.60
基金销售业务收入	53,474.58	
其他	157,333.14	
合 计	779,196,138.22	657,269,581.43

(2) 期末关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
永富物产有限公司（以下简称永富物产公司）	509,596.01		1年以内	预收货款
小 计	509,596.01		1年以内	

31. 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	本期上缴	期末数
应付期货投资者保障基金	671,681.51	382,577.75	694,550.26	359,709.00
合 计	671,681.51	382,577.75	694,550.26	359,709.00

(2) 本期计提方法和比例说明

根据证监会和财政部《关于明确期货投资者保障基金缴纳比例有关事项的规定》（〔2016〕26号），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。

32. 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	758,456,793.35	304,239,843.43	297,769,741.77	764,926,895.01
离职后福利—设定提存计划	25,475,118.21	17,565,841.13	28,399,075.49	14,641,883.85
辞退福利		999,783.60	999,783.60	
合 计	783,931,911.56	322,805,468.16	327,168,600.86	779,568,778.86

(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	730,324,187.22	265,709,631.48	260,092,556.88	735,941,261.82
职工福利费		6,773,215.10	6,773,215.10	
社会保险费	16,054,062.53	15,297,401.65	11,062,725.26	20,288,738.92

其中：基本医疗保险费	488,878.70	5,100,773.66	5,327,323.66	262,328.70
工伤保险	9,311.98	46,248.28	55,560.26	
生育保险费	55,871.85	228,094.41	283,966.26	
补充医疗保险	15,500,000.00	9,606,694.88	5,080,284.66	20,026,410.22
其他		315,590.42	315,590.42	
住房公积金	732,422.00	11,196,342.45	11,248,616.45	680,148.00
工会经费和职工教育经费	11,346,121.60	5,263,252.75	8,592,628.08	8,016,746.27
小 计	758,456,793.35	304,239,843.43	297,769,741.77	764,926,895.01

(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	651,838.27	3,075,027.35	3,726,865.62	
失业保险费	23,279.94	-153,086.07	-129,806.13	
补充养老保险	24,800,000.00	14,643,899.85	24,802,016.00	14,641,883.85
小 计	25,475,118.21	17,565,841.13	28,399,075.49	14,641,883.85

33. 应交税费

项 目	期末数	期初数
企业所得税	53,636,615.28	153,907,328.46
增值税	4,233,388.26	6,966,778.76
代扣代缴个人所得税	1,842,686.15	3,393,100.22
房产税		2,073,212.15
城市维护建设税	314,087.99	507,207.13
教育费附加	134,604.29	217,374.48
印花税	224,800.71	214,884.03
地方教育附加	89,736.18	144,916.30
代扣代缴税金	75,626.17	970,821.66
其他		168,128.32
合 计	60,551,545.03	168,563,751.51

34. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付股利		157,200,000.00
其他应付款	808,706,707.48	296,701,480.21
合 计	808,706,707.48	453,901,480.21

(2) 应付股利

项 目	期末数	期初数
普通股股利		157,200,000.00
合 计		157,200,000.00

(3) 其他应付款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付佣金	828,367.63	840,649.07
经营层风险金	9,042,112.01	10,544,154.91
交易所质押款	368,828,348.00	187,627,864.00
场外应付款	377,033,142.61	60,942,876.58
业务保证金	7,023,563.01	
暂估工程款	21,506,612.87	24,446,598.04
其 他	24,444,561.35	12,299,337.61
合 计	808,706,707.48	296,701,480.21

2) 应付关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
财通证券	661,144.40	53,346,303.08	1年以内	应付佣金、应收股利
永富物产公司	1,000,000.00		1年以内	场外应付款
小 计	1,661,144.40	53,346,303.08		

3) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
上海期货交易所	229,932,712.00	交易所质押款
招商证券股份有限公司	90,141,000.00	场外应付款
浙商证券股份有限公司	89,992,560.00	场外应付款

郑州商品交易所	86,124,836.00	交易所质押款
展弘稳进1号私募证券投资基金	77,000,000.00	场外业务应付款
小计	573,191,108.00	

### 35. 预计负债

#### (1) 明细情况

项目	期末数	期初数
未决诉讼	454,494.55	445,737.05
合计	454,494.55	445,737.05

#### (2) 其他说明

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。截至本期末，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，并就此事在 2017 年度计提了预计负债折合人民币 417,623.47 元，期末余额的变化系外币报表折算。

### 36. 其他流动负债

项目	期末数	期初数
待转销项税额	98,939,881.42	84,299,653.34
合计	98,939,881.42	84,299,653.34

### 37. 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

截至 2020 年 6 月 30 日，公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有公司的 2,654 万股股份出质给浙江省交通投资集团财务有限责任公司。

#### (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	主要从事证券经纪业务、投资银行业务、资产	券商信托	35.89 亿元



公司		管理业务、证券自营业务、证券信用业务以及研究业务。		
浙江省产业基金有限公司	章启诚	实业投资，投资管理。	金融业	200 亿元
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。	其他金融业	15.91 亿元
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	4.20 亿元
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 亿元

### 38. 资本公积

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	12,238,289.85		60,825.65	12,177,464.20
合计	1,501,682,614.86		60,825.65	1,501,621,789.21

### 39. 其他综合收益

项目	期初数	期初调整数	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	39,928,823.91		15,517,724.43	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-1,220,053.50			
外币财务报表折算差额	41,148,877.41		15,517,724.43	
其他综合收益合计	39,928,823.91		15,517,724.43	

(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		15,517,724.43		55,446,548.34
其中：权益法下可转损益的其他综合收益				-1,220,053.50
外币财务报表折算差额		15,517,724.43		56,666,601.84
其他综合收益合计		15,517,724.43		55,446,548.34

#### 40. 盈余公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	398,170,713.39			398,170,713.39
合 计	398,170,713.39			398,170,713.39

#### 41. 一般风险准备

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
一般风险准备	458,061,727.32			458,061,727.32
合 计	458,061,727.32			458,061,727.32

#### 42. 未分配利润

项 目	金 额
期初未分配利润	3,156,082,214.84
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）	
调整后期初未分配利润	3,156,082,214.84
加：本期归属于母公司所有者的净利润	410,371,541.96
减：提取一般风险准备	
期末未分配利润	3,566,453,756.80

### （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
经纪手续费净收入	71,749,088.28	67,522,358.51
交易所减收手续费收入	152,439,548.63	103,624,534.28
投资咨询业务收入	1,196,870.48	1,321,382.40
资产管理业务收入	30,052,884.30	10,902,184.71
基金销售业务收入	20,577,940.62	19,869,584.97
合 计	276,016,332.31	203,240,044.87

##### （2）分行政区域营业部及手续费收入情况

行政区域名称	分支机构家数	手续费净收入金额
杭州本部		221,710,145.88
香港特别行政区[注 12]		18,927,847.55
浙江省(不含杭州本部)	14	14,253,460.18
辽宁省	3	1,913,021.07
山东省	7	3,813,686.45
北京市	1	1,350,341.44
广东省	2	1,997,813.94
上海市	1	1,594,705.67
福建省	2	1,113,842.51
河南省	1	1,269,121.17
江苏省	2	1,186,852.26
吉林省	1	1,268,826.70
天津市	1	717,140.61
重庆市	1	891,749.98
河北省	2	1,153,721.62
湖北省	1	544,551.08
四川省	1	1,000,624.72
湖南省	1	766,729.22
江西省	1	373,004.04
陕西省	1	169,146.22
合 计	43	276,016,332.31

注 12：香港特别行政区营业部指公司子公司新永安期货。

## 2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	296,951,486.77	342,496,113.92
其中：境内期货保证金存款利息收入	275,582,977.83	323,573,739.59
境外利息收入	17,643,426.65	14,062,103.18

境内其他利息收入	3,725,082.29	4,860,271.15
利息支出	42,419,174.45	34,535,349.83
合 计	254,532,312.32	307,960,764.09

### 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	84,842,316.48	125,050,134.42
金融工具持有期间取得的投资收益	243,547,964.30	107,526,634.50
处置金融工具取得的投资收益	406,782,239.02	373,940,166.15
减：结构化主体其他投资者享有的收益	-9,381,719.66	253,763,282.92
合 计	744,554,239.46	352,753,652.15

### 4. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数
政府补助	5,865,833.06	2,899,090.00
个税手续费返还	1,880,618.29	26,394.68
合 计	7,746,451.35	2,925,484.68

本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附之政府补助说明。

### 5. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
股票	-72,122,515.19	100,487,460.00
债券	-967,372.39	139,066.05
基金	-126,280,768.53	326,406,969.09
衍生工具[注 13]	64,523,742.39	-23,794,121.75
合 计	-134,846,913.72	403,239,373.39

注 13：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、期权以及远期待执行合同等的浮动盈亏。

### 6. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
销售货物收入	9,939,995,024.09	10,615,333,781.43
租赁收入	5,494,734.77	563,344.09
其 他	3,307,454.74	2,687,203.82
合 计	9,948,797,213.60	10,618,584,329.34

#### 7. 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	70,966.36	4,510.12
合 计	70,966.36	4,510.12

#### 8. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	911,389.07	791,050.79
教育费附加	390,595.39	339,021.81
地方教育附加	260,312.58	225,557.93
印花税	1,034,432.80	1,198,193.40
房产税	385,852.52	459,178.94
土地使用税	13,474.55	18,203.97
车船税	18,716.50	9,120.00
合 计	3,014,773.41	3,040,326.84

#### 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	321,805,684.56	345,352,204.72
仓储费	43,757,709.46	20,165,958.67
租赁费	20,159,965.14	20,142,010.75
“保险+期货”业务费用	19,087,435.94	
运输费	6,899,312.87	8,390,509.80

折旧费	6,369,774.60	6,468,913.10
通讯费	6,112,702.18	5,776,523.91
无形资产摊销	5,570,263.29	6,772,562.68
数据业务费	5,423,946.33	6,110,850.19
IB 业务费	3,427,010.49	3,540,866.76
小 计	438,613,804.86	422,720,400.58

10. 信用减值损失

项 目	本期数	上年同期数
坏账损失	20,950,492.92	5,322,508.71
合 计	20,950,492.92	5,322,508.71

11. 其他资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
存货跌价损失	418,046,162.62	180,373,707.39
合 计	418,046,162.62	180,373,707.39

12. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
销售货物成本	9,742,824,659.56	10,380,347,466.94
投资性房地产成本	2,771,239.16	67,152.66
合 计	9,745,595,898.72	10,380,414,619.60

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	117,976,522.26	4,178,740.68
非流动资产毁损报废利得	59.26	2,277.62
其 他	0.61	1,420.53
合 计	117,976,582.13	4,182,438.83

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	9,256.77	33,697.27
残疾人就业保障基金	1,988.88	454,276.00
地方水利建设基金	1,542.49	1,649.60
捐赠支出	2,135,600.00	2,075,600.00
罚款及滞纳金	8,832.96	67,675.83
其 他	25,292.05	74,873.26
合 计	2,182,513.15	2,707,771.96

#### 15. 所得税费用

项目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	137,154,863.34	111,998,586.60
递延所得税费用	-20,543,573.62	58,749,347.80
合 计	116,611,289.72	170,747,934.40

#### 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
客户保证金净额	3,464,075,329.86	2,598,466,963.16
违约金及保险赔付收入	117,976,522.26	4,178,740.68
往来款净额	241,131,109.49	
保证金及定期存款减少	240,184,553.37	109,210,353.87
其他现金流入	16,705,974.61	6,316,857.62
代理买卖证券收到的现金	88,983,859.65	24,389,158.72
合 计	4,169,057,349.24	2,742,562,074.05

#### 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
-----	-----	-------

交易所保证金净额	2,622,306,712.12	1,536,274,968.28
融出资金	178,546,802.43	
应收结算担保金和结算备付金增加	17,676,225.04	
往来款变动净额		74,353,847.60
其他现金流出	5,162,880.77	2,998,529.37
合 计	2,823,692,620.36	1,613,627,345.25

### 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	4,160,214.71	
合 计	4,160,214.71	

### 4. 支付其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
结构化主体不再纳入合并范围转出的现金	1,180,909,746.80	
合 计	1,180,909,746.80	

### 5. 收到其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
纳入合并范围内的结构化产品其他投资者投入资金		733,890,579.26
借款保证金	65,000,000.00	
合 计	65,000,000.00	733,890,579.26

### 6. 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	4,095,593.31	
合 计	4,095,593.31	

## (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
2019 年度企业扶持资金	2,700,000.00	其他收益	杭州市西湖区人民政府翠苑街道办事处街道税收补助款
出疆棉花运费补贴	1,551,200.00	其他收益	新疆维吾尔自治区财政对出疆棉花的运费补贴
就业支持资金	305,716.88	其他收益	新加坡就业支持计划(JSS)资金
稳岗补贴	196,280.05	其他收益	对稳定就业企业给予失业保险金返还
金融业扶持资金	99,650.00	其他收益	烟台市芝罘区金融业发展扶持资金
金融支持经济发展考评奖	8,000.00	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
金融支持经济发展考评奖	50,000.00	其他收益	台州市金融办支持经济发展考评奖励
工资补助计划	7,059.61	其他收益	新加坡工资补助计划(WCS)资金
就业支持资金	856,586.52	其他收益	香港政府“保就业”补助
抗疫基金	91,340.00	其他收益	香港抗疫基金
	5,865,833.06		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 5,865,833.06 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	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
协作大厦	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	OSTC Yongan Trading Co., Limited 之子公司

安咨询公司)	
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

(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. 其他关联方交易

(1) 关联方在本公司开设账户，从事期货交易的情况

公司名称	期末权益	本期手续费净收入
财通证券	239,599,328.05	19,960.63
国富实业公司	57,363,743.52	17,782.75
永安咨询公司	1,011.00	
鞍钢商贸公司	10.00	122.78
永富物产公司	11,433,618.50	5,421.49
协作大厦	20.82	
小 计	308,397,731.89	43,287.65

(2) 特殊法人机构期货经纪业务

财通基金公司、财通资管公司及永安国富公司作为特殊法人机构在本公司从事期货交易，相关数据如下：

客户名称	期末权益	本期手续费净收入
财通基金公司	2,011.00	
财通资管公司	14,895,622.97	3,531.04
永安国富公司	2,827,300,997.92	1,229,322.44
小 计	2,842,198,631.89	1,232,853.48

(3) IB 业务佣金

财通证券营业部为本公司提供 IB 业务，本期本公司因上述 IB 业务应支付财通证券 IB 业务费 3,427,010.49 元。

(4) 期末本公司、永安资本公司、中邦实业公司持有永安国富公司、财通资管公司及玉皇山南公司作为管理人募集设立的资产管理计划、基金如下：

证券名称	管理人	期末账面价值
永安国富-永富1号资产管理计划	永安国富公司	6,732,136.61
永安国富-永富3号私募基金	永安国富公司	818,646,320.45

永安国富-永富 10 号私募证券投资基金	永安国富公司	241,595,700.28
永安国富-FOF1 号私募投资基金	永安国富公司	89,920,000.00
永安国富-稳健 5 号私募投资基金	永安国富公司	53,394,085.59
永安国富-稳健 6 号私募基金	永安国富公司	409,267,310.00
永安国富-永富 12 号私募基金	永安国富公司	6,519,502.55
永安国富-永富 15 号私募基金	永安国富公司	6,244,000.00
财通资管鑫管家货币 B	财通资管公司	260,060,098.75
山南敦和私募资产配置基金	玉皇山南公司	10,660,000.00
小 计		1,903,039,154.23

(5) 期末财通证券、永安国富公司持有本公司作为管理人募集设立的资产管理计划如下:

证券名称	持有人	份额
永利 1 号资产管理计划	财通证券	100,000,000.00
永利 2 号资产管理计划	财通证券	100,000,000.00
CTA 联盟 3 号 FOF 集合资产管理计划	财通证券	15,000,787.50
永安期货工银量化恒盛精选 A 类 25 期	永安国富公司	18,797,443.76
永利 1 号资产管理计划	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	41,498,889.24
永利 2 号资产管理计划		4,700,000.00
永利 4 号集合资产管理计划		35,602,289.00
CTA 联盟 2 号 FOF 集合资产管理计划		2,200,000.00
小 计		317,799,409.50

(6) 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

1) 采购商品和接受劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数
鞍钢商贸公司	螺纹钢、铁矿石、焦炭等	30,515,858.63
永富物产公司	PTA、热卷、不锈钢、纯碱等	12,011,933.62
财通证券	财务顾问服务	943,396.23

2) 出售商品和提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数
永富物产公司	PTA、不锈钢、乙二醇等	5,846,966.14

永安国富公司	代销基金产品服务	5,423,173.87
玉皇山南公司	代销基金产品服务	12,867.24

(7) 在财通证券开户从事股票交易

1) 本公司及子公司在财通证券开户从事股票交易，关联交易明细情况如下：

公 司	期末资金余额	本期证券交易费
本公司	29,390.76	649.49
永安资本公司	47,587.26	12,227.01
合 计	76,978.02	12,876.50

2) 本公司管理的资产管理计划在财通证券开户从事股票交易，发生证券交易手续费 1,310,832.25 元。

(8) 关联租赁情况

公司出租情况

承租方名称	租赁资产种类	本期租赁收入	上年同期租赁收入
财通证券	房屋租赁	5,257,666.59	

(9) 永安资本公司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	交易类别	本期数	上年同期数
财通证券	收益互换	101,089.87	
鞍钢商贸公司	收益互换	2,829,267.50	1,035,903.00

(10) 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，折合美元为 2,924,893.30 美元。该公司已累计偿还 2,111,952.14 美元，其中本期偿还 500,000.00 美元。永安商贸公司自拆出资金之日起共计提利息 629,968.89 美元，其中本期计提利息 41,769.79 美元。OSTC Yongan Trading Co., Limited 已累计偿还利息 439,506.97 美元，其中本期偿还利息 110,583.33 美元。期末剩余未偿还本金及利息折合人民币为 7,103,592.10 元。

11. 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。

12. 其他关联交易

2020 年 1-6 月，财通证券代公司结算相关费用 231,518.48 元。

(13) 关键管理人员报酬

项 目	本期数
关键管理人员报酬	1,729.40 万元

## 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、流动性风险及市场风险。管理层已审议并批准管理这些风险的政策，概括如下。

### （一）信用风险管理

公司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。
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	880,588,289.30	897,731,045.50	897,731,045.50		
代理买卖证券款	132,480,941.63	132,480,941.63	132,480,941.63		
应付货币保证金	28,376,820,672.33	28,376,820,672.33	28,376,820,672.33		
应付质押保证金	563,338,484.00	563,338,484.00	563,338,484.00		
交易性金融负债	749,118,602.81	749,118,602.81	749,118,602.81		
应付账款	87,550,845.57	87,550,845.57	87,550,845.57		
其他应付款	808,706,707.48	808,706,707.48	808,706,707.48		
小 计	31,598,604,543.12	31,615,747,299.32	31,615,747,299.32		

(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	562,544,509.00	567,491,202.19	567,491,202.19		
代理买卖证券款	43,497,081.98	43,497,081.98	43,497,081.98		
应付货币保证金	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12		
应付质押保证金	434,089,168.00	434,089,168.00	434,089,168.00		
交易性金融负债	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12		
应付账款	107,960,512.29	107,960,512.29	107,960,512.29		
其他应付款	453,901,480.21	453,901,480.21	453,901,480.21		
小 计	27,920,637,486.72	27,925,584,179.91	27,925,584,179.91		

(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，并定期或不定期的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 2020 年 6 月 30 日，本公司以浮动利率计息的银行借款人民币为 0 元 (2019 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. 交易性金融资产和其他非流动金融资产	641,008,823.16	2,366,790,587.90		3,007,799,411.06
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	641,008,823.16	2,366,790,587.90		3,007,799,411.06
债务工具投资	1,378,648.88			1,378,648.88

权益工具投资	584,339,292.08	2,192,205,135.46		2,776,544,427.54
衍生金融资产[注]	55,290,882.20	174,585,452.44		229,876,334.64
2. 其他权益工具投资			26,845,000.00	26,845,000.00
持续以公允价值计量的资产总额			26,845,000.00	26,845,000.00
3. 交易性金融负债	30,468,387.26	747,461,179.31		777,929,566.57
(1) 交易性金融负债	30,468,387.26	171,141,899.07		201,610,286.33
衍生金融负债[注]	30,468,387.26	171,141,899.07		201,610,286.33
(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		576,319,280.24		576,319,280.24
结构化主体其他投资者享有的权益		576,319,280.24		576,319,280.24
持续以公允价值计量的负债总额	30,468,387.26	747,461,179.31		777,929,566.57

[注]衍生金融资产、衍生金融负债中含期货合约持仓损益，相关说明见本财务报表附注六(一)交易性金融资产之说明。

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) 其他事项

1. 2020年6月23日，经上海证券交易所《关于对永安期货股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》（上证函〔2020〕1288号）批复，公司获准面向专业投资者非公开发行总额不超过10亿元的次级债券。

2. 截至2020年6月末，公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有公司的2,654万股股份出质。

3. 经2020年8月6日鞍钢商贸股东会会议批准，鞍钢商贸进行解散清算。截至本财务报告批准报出日，鞍钢商贸尚未完成注销。

## 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	1,730,974,102.19		1,730,974,102.19
对联营企业投资	521,120,811.07		521,120,811.07
合 计	2,252,094,913.26		2,252,094,913.26

(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	1,730,974,102.19		1,730,974,102.19
对联营企业投资	445,271,030.71		445,271,030.71
合 计	2,176,245,132.90		2,176,245,132.90

(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	478,990,100.00
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			1,730,974,102.19

(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	445,271,030.71			75,849,780.36	
合 计	445,271,030.71			75,849,780.36	

(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					521,120,811.07	
合 计					521,120,811.07	

(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	53,221,326.07	53,821,837.10
交易所减收手续费净收入	140,527,637.13	96,384,769.84
期货投资咨询收入	676,776.14	1,238,594.66
资产管理业务收入	34,196,973.12	59,712,649.12
基金销售业务收入	20,577,940.62	19,869,584.97
合 计	249,200,653.08	231,027,435.69

## (2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部		213,822,314.20
浙江省(不含杭州本部)	14	14,253,460.18
辽宁省	3	1,913,021.07
山东省	7	3,813,686.45
北京市	1	1,350,341.44
广东省	2	1,997,813.94
上海市	1	1,594,705.67
福建省	2	1,113,842.51
河南省	1	1,269,121.17
江苏省	2	1,186,852.26
吉林省	1	1,268,826.70
天津市	1	717,140.61
重庆市	1	891,749.98
河北省	2	1,153,721.62
湖北省	1	544,551.08
四川省	1	1,000,624.72
湖南省	1	766,729.22
江西省	1	373,004.04
陕西省	1	169,146.22
合 计	43	249,200,653.08

## 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		93,000,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	75,849,780.36	123,748,402.70
金融工具持有期间的投资收益	238,585,283.19	70,974,348.93
处置金融工具取得的投资收益	-792,804.25	13,720,839.99
合 计	313,642,259.30	301,443,591.62

## 十一、其他补充资料

### (一) 非经常性损益

项 目	金额
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	61,768.85
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）	5,865,833.06
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	295,709.23
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-289,106.11
小 计	5,934,205.03
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	1,101,936.94
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	4,832,268.09

### (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	5.80	0.31	0.31
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	5.73	0.31	0.31

#### 2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	本期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	410,371,541.96

项 目	序号	本期数	
非经常性损益	B	4,832,268.09	
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	405,539,273.87	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	6,863,926,094.32	
发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	E		
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	F		
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	G		
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H		
其他	权益法下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	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	
	可供出售金融资产公允价值变动	I2	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	
	外币报表折算差额变动	I3	15,517,724.43
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	3
	其他	I4	-60,825.65
	J4	3	
报告期月份数	K	6	
加权平均净资产	$L = \frac{D+A/2+E \times F/K - G \times H/K \pm I \times J/K}{K}$	7,076,840,314.69	
加权平均净资产收益率	M=A/L	5.80%	
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	N=C/L	5.73%	

### 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	410,371,541.96
非经常性损益	B	4,832,268.09
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	405,539,273.87
期初股份总数	D	1,310,000,000.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E	
发行新股或债转股等增加股份数	F	

增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G	
因回购等减少股份数	H	
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I	
报告期缩股数	J	
报告期月份数	K	6
发行在外的普通股加权平均数	$L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.31
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.31

(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

## 第八节 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）报告期内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

文件备置地址：

永安期货股份有限公司董事会秘书办公室