



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司

年度报告

—2017—

# 公司年度大事记

2017年，公司成为上海国际能源中心首批会员，中国银行间市场交易商协会会员；获首批白糖、豆粕期权做市业务资格；获首批镍、PTA和动力煤商品做市资格。

公司开发的国内第一个综合性期货研究网络服务平台“源点资讯”于2017年10月16日正式上线，并获中期协证券期货科学技术优秀奖。

“期货+保险”专业扶贫，获国家扶贫办、中国证监会扶贫办、中期协联合考评第一名；“保险+期货+订单”试点项目获大商所专业评审第一名、2017年度吉林省财政金融创新最高奖。

公司在期货日报社联合证券时报社共同主办的“第十届中国最佳期货经营机构暨最佳分析师”评选中喜获“中国最佳期货公司”、“最佳诚信自律期货公司”、“年度最佳投资者教育奖”等19项大奖。

公司全资子公司浙江永安资本管理有限公司获业内首个玻璃交割厂库资格；与鞍钢集团开展战略合作，翻开产业与金融合作新篇章。

公司全资子公司“新永安国际金融控股有限公司”正式在香港设立，国际化业务迈出新步伐。

公司董事长阮琪、总经理葛国栋在首届钱塘江论坛上被评为第三届（2017）“浙江金融创新人物”。

公司在“第十七届中国上市公司百强高峰论坛”上荣获“中国百强企业奖”，董事会秘书叶元祖荣获“中国百强优秀董秘奖”。

# 目 录

第一节	声明与提示 .....	5
第二节	公司概况 .....	9
第三节	会计数据和财务指标摘要 .....	11
第四节	管理层讨论与分析 .....	14
第五节	重要事项 .....	40
第六节	股本变动及股东情况 .....	45
第七节	融资及利润分配情况 .....	48
第八节	董事、监事、高级管理人员及员工情况 .....	51
第九节	公司治理及内部控制 .....	56
第十节	财务报告 .....	65

## 释义

释义项目	指	释义
公司、本公司、股份公司、永安期货	指	永安期货股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
财通证券	指	财通证券股份有限公司，系永安期货的控股股东
中期协	指	中国期货业协会
省财开	指	浙江省财务开发公司
省金控	指	浙江省金融控股有限公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
浙江东方	指	浙江东方集团股份有限公司
经建投	指	浙江省经济建设投资有限公司
协作大厦	指	浙江省协作大厦有限公司
香港新永安	指	中国新永安期货有限公司
新永安实业	指	中国新永安实业有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
永安国富	指	永安国富资产管理有限公司
公司章程	指	永安期货现行有效的并经工商行政管理部门备案的章程
报告期	指	2017年1月1日-2017年12月31日的期间
元、万元	指	人民币元、人民币万元

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

## 第一节 声明与提示

**【声明】**公司董事会及其董事、监事会及其监事、公司高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

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

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

### 1、豁免披露事项及理由

由于行业竞争历来激烈，公开披露客户及供应商信息容易引起商业机密泄露，很有可能引发同行业恶性竞争。因此，永安期货特申请豁免披露 2017 年年度报告第四节销售部分主要客户的名称、经纪业务部分主要客户的名称以及主要供应商的名称。

### 【重要风险提示表】

重要风险事项名称	重要风险事项简要描述
1.期货、期权经纪业务风险	目前期货公司经纪业务手续费收入仍是我国期货业主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日趋激烈，近年来公司客户交易规模增长的同时，手续费率和手续费收入在持续下滑，公司期货经纪业务面临着竞争风险以及盈利能力下降风险。
2.利息收入下滑风险	利息收入是我国期货公司营业收入的重要来源之一，公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。虽然公司的客户保证金和自有资金规模逐年上升，利息收入逐年增长，但是利率水平的变化也将影响公司的营业收入和净利润水平。如果利率水平出现大幅下滑，或者客户保证金和自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。另外，随着市场竞争加剧、客户保证金规模持续上升、市场关注度提高，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。
3.期货投资咨询业务风险	由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致营利性质的期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广，且公司未能在研究分析、市场推广、客户体验等方面做到进一步提高或突破，可能导致期货投资咨询业务收入仍难以取得实质性突破。同时，期

	<p>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。</p>
4.资产管理业务风险	<p>公司的资产管理业务面临证券公司、基金公司、保险公司、信托公司、银行及其他期货公司等金融机构类似产品的激烈竞争，同时期货行业专业投资人才相对缺乏。若公司不能在投资团队、产品设计、市场推广、投资绩效、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司资产管理业务的进一步拓展。此外，资产管理业务拓展过程中，可能存在投资团队建设和投资管理能力不足的风险，导致公司为客户设定的资产组合方案由于市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当、人员操作失误等原因无法达到预期收益或遭受损失，从而导致公司资产管理规模的降低和收入的下降。</p>
5.基金销售业务风险	<p>公司的基金销售业务面临证券公司、银行及其他三方销售机构等金融机构类似产品的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司基金销售业务的进一步拓展。</p>
6.业务创新风险	<p>由于我国期货行业的创新业务尚处于发展期，公司在开展创新业务过程中可能存在因业务经验、人才储备和经营管理水平等不相匹配，从而出现产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位、风险管理及内控措施不健全而导致的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、机制不健全、措施不完善或执行不力，可能发生较大规模的风险事件或出现严重亏损，从而造成公司经营业绩大幅下滑。</p>
7.投资风险	<p>在风险可控的情况下，公司使用自有资金开展投资业务，配置范围包括私募基金、证券市场、基金、信托产品等金融产品。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的操作风险和市场风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损影响公司盈利能力的可能。</p>
8.合规风险	<p>金融行业属于国家特许经营行业，公司具体开展业务时需满足净资本、风险管理、公司治理、人才储备、机构设置、合规运营等方面满足监管部门的要求。目前中国证监会根据监管需要，以期货公司风险管理能力为基础，结合公司市场影响力和持续合规状况，对期货公司进行分类评价，其分类结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标，如果公司未来获得的评级结果出现下调，将可能对公司现有业务开展、申请增加新业务或新业务试点范围等方面产生不利影响。</p>
9.信息技术系统风险	<p>信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，信息系统的安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要，公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，并制定了完整的信息技术相关制度，确保信息技术系统稳定运行。然而由于各种原因，</p>

	<p>信息技术系统仍可能出现硬件故障、软件崩溃、通信线路中断、遭受病毒、黑客攻击、数据丢失与泄露等情况。公司向客户提供的交易系统主要来源于与外部公司合作，自主研发能力相对不足。如果公司遭受上述突发性事件，或信息技术系统未能及时、有效地改进或升级而发生故障，可能对公司的声誉、竞争力和经营业绩造成不利影响。此外，随着业务量的不断扩大、创新业务的不断推出，公司信息技术系统的处理能力和功能模块需要不断升级和扩展，以适应业务发展需要。若信息技术系统不能得到相应提升，公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。</p>
10.信用风险	<p>公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：（1）客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；（2）客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；（3）存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；（4）存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；（5）存放在银行的客户保证金不能提取的风险；（6）代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；（7）涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；（8）基差业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；（9）非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。此外，公司子公司新永安实业作为持牌放债人，面临债务人不能按照合同约定偿还债务、支付利息的风险。</p>
11.居间人管理风险	<p>居间人非期货公司的员工，而是与期货公司签订居间合同，为期货公司和客户提供订立期货经纪合同，并根据居间合同的约定取得手续费返佣的个人或法人，居间人独立承担基于居间关系产生的民事责任。期货公司与居间人合作拓宽了开发客户的渠道，是重要的营销补充方式。目前期货监管体系并未形成居间业务的统一规定。由于公司不能完全控制拥有丰富客户资源的居间人流动，管理难度较大，若公司的经纪业务开展较为依赖居间人，将对公司盈利情况产生不利影响。同时，居间人素质参差不齐，部分居间人可能采取私印名片、私设网点等方式冒充公司工作人员，可能给公司带来表见代理的诉讼风险。如果公司由于管理不当发生这类情形，可能被监管部门采取监管措施或处以行政处罚，亦有可能产生诉讼风险。</p>
12.人才流失和储备不足风险	<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，不但对期货人才提出了更高要求，也加剧了对期货人才尤其是复合型人才的需求和竞争。若公司流失部分关键优秀管理人员和专业人才，将会对公司的经营发展造成一定障碍。同时，面对各个金融子行业的竞争，公司存在人才流失和储备不足的风险。</p>

13.政策风险	<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各种法律、法规及规范性文件的监管。如果国家关于期货行业的有关法律、法规和政策，如税收政策、业务许可、利率政策、业务收费标准及收费方式等发生变化，可能会引起期货市场的波动和期货行业发展环境的变化，进而对公司的各项业务产生影响。目前，随着期货市场的快速发展和行政管制的逐渐放松，相关期货法律法规的建设也处于完善阶段，部分限制性的规定正逐步取消，关于新业务及新产品的规定可能逐步出台。相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会对期货行业的经营模式和竞争方式产生影响，公司无法保证上述变化不会对公司的业务、经营业绩和财务状况产生重大不利影响，也无法保证能够及时调整以充分适应上述变化。如果公司未能完全遵守相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化，可能导致公司被罚款、暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。</p>
14.重大诉讼、仲裁风险	<p>期货公司作为金融衍生品服务提供商，截至本年度末公司尚无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现相关重大诉讼或仲裁，将可能对公司经营带来不利影响。</p>
15.商标风险	<p>公司使用中的标识尚未取得商标专用权，上述商标使用过程中可能会使本公司产生法律纠纷，使本公司声誉遭到损害，并对本公司的业务开展及公司整体经营战略布局构成不利影响。</p>
本期重大风险是否发生重大变化：	否

## 第二节 公司概况

### 一、 基本信息

公司中文全称	永安期货股份有限公司
英文名称及缩写	Yongan Futures Co.,Ltd.
证券简称	永安期货
证券代码	833840
法定代表人	葛国栋
办公地址	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 16-17 层，2603 室、2702 室

### 二、 联系方式

董事会秘书或信息披露事务负责人	叶元祖
是否通过董秘资格考试	是
电话	(0571) 86672053
传真	(0571) 88388193
电子邮箱	yaqh@yafco.com
公司网址	www.yafco.com
联系地址及邮政编码	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼，310016
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司年度报告备置地	公司董事会秘书办公室

### 三、 企业信息

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

#### 四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	9133000010002099X5	否
注册地址	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 16-17 层, 2603 室、2702 室	否
注册资本	1,310,000,000 元	否
无		

#### 五、 中介机构

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

#### 六、 报告期后更新情况

适用 不适用

2018 年 1 月 15 日起，公司普通股股票转让方式由协议转让变更为集合竞价转让。

### 第三节 会计数据和财务指标摘要

#### 一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例
营业收入	9,669,953,631.77	6,799,568,594.26	42.21%
毛利率%	12.30%	12.58%	-
归属于挂牌公司股东的净利润	887,528,756.90	608,537,129.08	45.85%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	910,257,044.28	601,333,712.46	51.37%
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）	16.91%	13.85%	-
加权平均净资产收益率%（归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	17.34%	13.69%	-
基本每股收益	0.68	0.46	45.85%

#### 二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例
资产总计	30,426,240,615.95	31,397,582,191.38	-3.09%
负债总计	24,884,162,222.65	26,630,966,371.52	-6.56%
归属于挂牌公司股东的净资产	5,542,078,393.30	4,766,601,130.04	16.27%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	4.23	3.64	16.27%
资产负债率%（母公司）	20.68%	22.45%	-
资产负债率%（合并）	33.47%	33.77%	-
流动比率	1.13	1.14	-
利息保障倍数	13.20	15.11	-

#### 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	-2,454,149,124.69	3,454,984,588.87	-171.03%
应收账款周转率	3,243.42	1,093.44	-
存货周转率	11.43	19.10	-

#### 四、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例
总资产增长率%	-3.09%	27.28%	-
营业收入增长率%	42.21%	55.89%	-
净利润增长率%	45.21%	25.87%	-

#### 五、 股本情况

单位：股

	本期期末	上年期末	增减比例
普通股总股本	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00	0%
计入权益的优先股数量	0	0	0%
计入负债的优先股数量	0	0	0%

#### 六、 非经常性损益

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-75,056.08
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）	4,661,340.80
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,242,794.45
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被合并单位可辨认净资产公允价值产生的收益	0
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-26,669,607.69
其他符合非经常性损益定义的损益项目	0
<b>非经常性损益合计</b>	<b>-20,840,528.52</b>
所得税影响数	1,887,758.86
少数股东权益影响额（税后）	0
<b>非经常性损益净额</b>	<b>-22,728,287.38</b>

#### 七、 其他主要会计数据和指标

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例
--	------	------	------

净资本	1,835,627,752.14	2,257,209,958.64	-18.68%
风险资本准备总额	614,744,718.63	900,972,567.27	-31.77%
净资本与风险资本准备总额的比例	299%	251%	-
净资本与净资产的比例	36%	51%	-
扣除客户保证金的流动资产	2,745,106,784.61	3,019,428,013.23	-9.09%
扣除客户权益的流动负债	1,346,958,238.66	1,279,215,508.09	5.30%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	204%	236%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	26%	29%	-
结算准备金额	2,136,922,802.92	2,662,350,087.14	-19.74%

注：1. 此表为期货公司监管指标数据，数据口径根据监管要求为母公司口径。

2. 中国证监会于2017年4月21日发布《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令【第131号】）、《期货公司风险监管报表编制与报送指引》（证监会公告[2017]8号），自2017年10月1日起施行。《期货公司风险监管指标管理试行办法》（证监发[2007]55号公布、证监会公告[2013]12号修订）、《关于期货公司风险资本准备计算指标的规定》（证监会公告[2013]13号）同时废止。此处本期期末数据按照新制度的口径、方法计算，上期期末数据未作调整。

## 八、 预计负债情况

适用 不适用

### （一） 明细情况

项目	本期期末	上年期末	增减比例
待执行合同亏损	52,134,360.38	65,754,665.27	-20.71%
诉讼事项	417,623.47	417,623.47	0.00%
合计	52,551,983.85	66,172,288.74	-20.58%

### （二） 重大项目的确认依据说明

1) 永安资本公司对待执行货物购销合同按合同价与市场价的差额确认预计亏损。

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

## 九、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

适用 不适用

## 十、 业绩预告、业绩快报的差异说明

适用 不适用

## 第四节 管理层讨论与分析

### 一、 业务概要

#### 商业模式

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

#### 1. 期货、期权经纪业务

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

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

#### 2. 期货投资咨询业务

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

#### 3. 资产管理业务

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

#### 4. 基金销售业务

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

#### 5. 风险管理业务

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

#### 6. 自有资金投资业务

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

### 核心竞争力分析：

适用 不适用

#### 1. 行业地位优势明显

公司自成立以来，公司经营规模牢固占据浙江省第一，已连续二十年年跻身全国期货公司十强行列，近年来经营规模基本稳定在全国前三。公司在全国设有营业部 35 家、分公司 5 家，是国内营业网点最多的期货公司之一。作为中国期货行业中的翘楚，公司在国内各交易所和行业自律机构中担任重要职务。根据中国证监会对期货公司分类评价结果，本公司的分类评级结果为行业内最高的 A 类 AA 级。

#### 2. 公司治理完善高效

永安期货已建立起规范的法人治理结构与合理的内部控制体系。公司视合规经营、诚信自律为企业发展的第一生命线，坚持“一切只为客户”的发展理念，突出党建引领，强调党的领导和适应市场的经营决策机制，重视战略规划制定和完善，营造合作、分享、共赢的“伙伴文化”，最大限度地满足投资者的需求，努力实现客户、股东和员工的共赢，打造永安核心文化凝聚力。公司围绕体系与机制、制度与流程、专业技术、管理平台、专业队伍的工作策略，完善风险管理组织架构，构建公司风险偏好体系，强化合规风控的绩效考核问责机制，紧密结合监管与业务发展需求，以“打造专业、高效的风险管控体系，使之成为与业务发展并行的核心竞争力”为方向，提高整体风险防范能力，为公司持续、稳定、

健康发展保驾护航。

### 3. 经纪业务实现差异化竞争

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

### 4. 资产配置助力公司发展

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

### 5. 研发团队领先同业

作为塑造核心竞争力、发展各类新兴业务与创新业务的基础，公司始终重视研究能力的提升。公司现设有杭州研究中心、北京研究院两大投研机构，专业研究人员多具有知名高等院校或海外留学教育背景，整体规模、研究范围、综合实力均居于业内领先地位。其中杭州研究中心通过运用结构研究方法对期货定价，深入产业链各环节，为套期保值和期货投资提供基础性和应用性研究，并依托公司旗下的投资管理业务、期现结合业务和香港新永安的境外期货交易平台，实行全球交易活跃的品种全覆盖的研究战略，为投资者提供丰富资讯和优质服务。北京研究院建立了基本面量化的估值驱动研究体系，形成系列产品线包括基础报告、调研报告、深度报道等，开创了投资咨询、产业基金、基差交易、场外期权（期权+保险）、合作套保以及仓单服务等多种客户服务模式，有效提升了客户服务的质量与附加价值。公司卓越的研究实力业已得到社会各界的高度认可。公司研究团队多次获得诸如“最佳期货研究院”、“中国金牌期货研究所”等荣誉称号，公司多次获得各大交易所设立的品种类奖项，公司拥有的一大批优秀研究人员屡获得由期货日报、和讯网等主流媒体颁发的“最佳分析师”、“优秀分析师”等奖项。

### 报告期内变化情况：

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

## 二、经营情况回顾

### (一) 经营计划

报告期内，公司经营情况良好，实现营业收入 9,669,953,631.77 元，同比增长 42.21%；归属于母公司所有者的净利润 887,528,756.90 元，同比增长 45.85%；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）16.91%，较上年同比增加 3.05 个百分点，公司盈利能力持续提高。截止本期末，公司归属于母公司所有者的权益 5,542,078,393.30 元，同比增长 16.27%，资产规模进一步增大，资产质量优良。

2017 年，我国期货市场整体交易规模呈下降态势，全年期市累计成交量、成交金额同比下降，公司加强党建引领，以“一切只为客户”为中心，以高质量发展为主线，坚持合法合规的经营理念，在稳固市场份额的同时，立足自身优势，开展差异化竞争。公司风险管理业务以服务实体经济为宗旨，运用多种手段和工具，不断加深与现货全产业链的合作。现货贸易、交割场库、场内场外衍生品业务、“保险+期货”服务“三农”和精准扶贫亮点频出。公司财富管理、基金销售等业务，坚持产品质量为生命线，以专业的服务能力，赢得了客户的广泛信任，在行业内积累起一定的知名度和品牌号召力，产品规模继续增加。公司国际化战略加快布局，出资 1 亿港币设立全资子公司新永安国际金融控股有限公司，正开启海外业务新征程。

公司（母公司本级）自 2011 年起监管评级保持 A 类 AA 级，各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截止本期末，公司净资本为 18.36 亿元，风险资本准备总额为 6.15 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 299%，净资产为 51.66 亿元，净资本与净资产的比例为 36%，流动资产与流动负债的比例为 204%，负债与净资产的比例为 26%，各项风险监管指标数据按照《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令【第 131 号】）、《期货公司风险监管报表编制与报送指引》（证监会公告[2017]8 号）的要求计算，持续符合监管标准。

## (二) 行业情况

我国现代期货市场起步于二十世纪九十年代初期，经过逾 20 年的探索发展，中国期货市场逐步进入了稳定健康发展、经济功能日益显现的良性轨道，市场交易量迅速增长，交易规模日益扩大。截至 2017 年末，我国共设有 3 家商品期货交易所（上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所）和 1 家金融期货交易所（中国金融期货交易所），已上市期货品种 55 个，其中商品期货 47 个、金融期货 5 个、商品期权 2 个、金融期权 1 个，基本形成了覆盖农业、金属、能源、化工以及金融等国民经济主要领域的产品体系，每个商品期货品种都连接着一个实体产业链，与实体经济密切相关，期货市场已经成为现代金融体系的重要组成部分。2017 年，我国商品期货成交量已经连续八年位居世界第一，金融期货重要作用不断显现，市场运行日趋规范、监管有效性不断提升，期货市场发展在我国深入推进供给侧结构性改革的新形势下，以服务实体经济为着力点，创新服务“三农”模式，助力产业结构调整和企业转型，服务国家“一路一带”战略和脱贫攻坚战略，稳妥推进品种创新，加大对外开放，市场核心竞争力和国际影响力不断增强。

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

## (三) 财务分析

### 1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		本期期末与上年期末金额变动比例
	金额	占总资产的比重	金额	占总资产的比重	
货币资金	16,164,165,727.06	53.13%	19,028,977,119.47	60.61%	-15.05%
应收账款	683,162.17	0.00%	4,826,110.87	0.02%	-85.84%
存货	909,621,858.05	2.99%	478,212,721.87	1.52%	90.21%
长期股权投资	294,320,282.20	0.97%	140,586,734.48	0.45%	109.35%
固定资产	108,288,008.05	0.36%	121,877,408.71	0.39%	-11.15%
在建工程	49,308,879.59	0.16%	26,892,629.60	0.09%	83.35%
短期借款	560,000,000.00	1.84%	150,000,000.00	0.48%	273.33%
长期借款					

应收货币保证金	9,615,496,632.61	31.60%	8,971,772,982.30	28.57%	7.17%
应收质押保证金	284,486,362.00	0.94%	387,035,648.00	1.23%	-26.50%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	31,586,974.11	0.10%	57,291,850.58	0.18%	-44.87%
预付款项	110,094,354.67	0.36%	110,851,275.23	0.35%	-0.68%
应收结算担保金	25,513,887.40	0.08%	25,482,868.49	0.08%	0.12%
应收风险损失款	66,201.51	0.00%	120,244.77	0.00%	-44.94%
应收佣金	3,994,945.13	0.01%	6,241,118.09	0.02%	-35.99%
应收利息	15,351,917.04	0.05%	1,465,340.51	0.00%	947.67%
其他应收款	59,576,612.94	0.20%	37,400,765.76	0.12%	59.29%
其他流动资产	260,718,376.25	0.86%	128,232,278.81	0.41%	103.32%
可供出售金融资产	2,151,163,825.45	7.07%	1,562,575,403.24	4.98%	37.67%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.00%	1,400,000.00	0.00%	0.00%
投资性房地产	3,737,264.38	0.01%	3,270,713.33	0.01%	14.26%
无形资产	252,293,380.97	0.83%	256,133,151.87	0.82%	-1.50%
长期待摊费用	14,008,820.25	0.05%	17,647,075.05	0.06%	-20.62%
递延所得税资产	70,363,144.12	0.23%	29,288,750.35	0.09%	140.24%
应付货币保证金	21,923,322,332.85	72.05%	23,913,728,723.82	76.16%	-8.32%
应付质押保证金	173,328,692.00	0.57%	287,062,372.00	0.91%	-39.62%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	133,889,030.51	0.44%	191,727,783.55	0.61%	-30.17%
期货风险准备金	191,824,966.82	0.63%	167,143,962.32	0.53%	14.77%
应付账款	27,142,702.05	0.09%		0.00%	-
预收款项	163,464,424.95	0.54%	129,854,002.35	0.41%	25.88%

应付期货投资者保障基金	535,879.52	0.00%	1,169,255.40	0.00%	-54.17%
应付手续费及佣金	1,500,959.27	0.00%	2,038,374.47	0.01%	-26.36%
应付职工薪酬	416,560,567.84	1.37%	226,500,324.76	0.72%	83.91%
应交税费	154,699,274.81	0.51%	126,175,030.60	0.40%	22.61%
应付利息	9,453,253.06	0.03%	17,743,182.49	0.06%	-46.72%
应付股利	196,500,000.00	0.65%			-
其他应付款	359,180,178.12	1.18%	384,508,879.20	1.22%	-6.59%
其他流动负债	0.00	0.00%	115,271,007.24	0.37%	-100.00%
应付债券	430,000,000.00	1.41%	600,000,000.00	1.91%	-28.33%
预计负债	52,551,983.85	0.17%	66,172,288.74	0.21%	-20.58%
递延所得税负债	90,207,977.00	0.30%	51,871,184.58	0.17%	73.91%
其他非流动负债	0.00	0.00%	200,000,000.00	0.64%	-100.00%
资产总计	30,426,240,615.95	-	31,397,582,191.38	-	-3.09%

#### 资产负债项目重大变动原因：

主要资产负债项目变动原因如下：

1. 以公允价值计量期末较期初且其变动计入当期损益的金融资产：期末较期初下降 44.87%，主要系期末持有的股票、基金减少。
2. 应收账款：期末较期初下降 85.84%，主要系本期加大了收款力度，期末客户欠款大部分得以归还所致。
3. 应收风险损失款：期末较期初下降 44.94%，主要系公司本期将无法收回的穿仓损失款进行了核销。
4. 应收佣金：期末较期初下降 35.99%，主要系本期加大收款力度，收回了大部分欠款，导致期末存续应收佣金减少。
5. 应收利息：期末较期初增长 947.67%，主要系本期末尚未到期的定期存款金额较上期末增加，部分尚未到期的定期存款利率较上期末更高、计息期更长，从而导致应计利息增加所致。
6. 其他应收款：期末较期初增长 59.29%，主要系子公司新永安实业放债业务规模扩大，导致期末应收客户贷款增加。
7. 存货：期末较期初增长 90.21%，主要系永安资本本期加大基差贸易力度，匹配期货的现货贸易规模扩大，导致期末库存商品增加。

8. 其他流动资产：期末较期初增长 103.32%，主要系待抵扣增值税大幅度增加，较期初增长 50.04%。  
买入反售金融资产较期初增加 7323.50 万元，增长 519.26%。

9. 可供出售金额资产：期末较期初增长 37.67%，主要系本期公司自有资金投资业务日常化，利用闲置资金拓展投资业务规模所致。

10. 长期股权投资：期末较期初增长 109.35%，主要系投资联营企业永安国富业绩大幅度增长所致。

11. 在建工程：期末较期初增长 83.35%，主要系公司联建办公楼仍处于在建阶段，增加投入所致。

12. 递延所得税资产：期末较期初增长 140.24%，主要系公司本期计提尚未发放的工资奖金增加所致。

13. 短期借款：期末较期初增长 273.33%，主要系子公司永安资本业务规模扩大，间接融资金额增加。

14. 应付质押保证金：期末较期初下降 39.62%，主要系客户质押物减少所致。

15. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：期末较期初下降 30.17%，主要系结构化主体其他投资者享有的份额下降。

16. 应付账款：期末较期初增加 2714.27 万元，主要系子公司永安资本本期期末存续的应付未付仓储费等费用。

17. 应付期货投资者保障基金：期末较期初下降 54.17%，主要系按照财政部令第 129 号、财政部公告 2016 年第 26 号等相关政策规定，期货投资者保障基金计缴比例由千万分之五点五下调至亿分之五点五。

18. 应付职工薪酬：期末较期初增长 83.91%，主要系公司已计提尚未发放的工资奖金余额增加。

19. 应付利息：期末较期初下降 46.72%，主要系本期公司提前偿还部分次级债并结清应付利息。

20. 应付股利：期末较期初增加 19650 万元，系本期公司股东大会决议向股东分配现金红利尚未支付。

21. 其他流动负债：期末较期初下降 100%，主要系子公司永安资本期初应付锁定终值的期权款已经到期偿还完毕。

22. 递延所得税负债：期末较期初增长 73.91%，主要系本期可供出售金融资产公允价值变动增加尚未到期分红所致。

23. 其他非流动负债：期末较期初下降 100%，系公司提前偿还次级债务 200,00 万元。

截止 2017 年 12 月 31 日，公司资产负债率 33.47%（资产、负债均不含客户权益），利息保障倍数 13.20，资产负债结构良好，负债对公司现金流不存在不利影响。

## 2. 营业情况分析

### (1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例
	金额	占营业收入的比重	金额	占营业收入的比重	
一、营业收入	9,669,953,631.77	-	6,799,568,594.26	-	42.21%
手续费及佣金净收入	593,347,524.35	6.14%	585,732,176.34	8.61%	1.30%
其中：经纪业务手续费收入	528,451,063.95	5.46%	521,502,727.70	7.67%	1.33%
资产管理业务收入	14,992,345.10	0.16%	26,355,191.20	0.39%	-43.11%
投资咨询业务收入	13,506,897.33	0.14%	34,266,984.69	0.50%	-60.58%
代理销售金融产品收入	36,397,217.97	0.38%	3,607,272.75	0.05%	909.00%
其他代理业务收入					
利息净收入	524,237,811.89	5.42%	496,322,853.52	7.30%	5.62%
投资收益	904,981,185.99	9.36%	344,791,879.61	5.12%	162.47%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	205,968,886.40	2.13%	74,357,527.46	1.09%	177.00%
公允价值变动收益	43,153,642.03	0.45%	-8,920,789.43	-0.13%	-583.74%
汇兑收益	-2,489,634.96	-0.03%	1,303,169.31	0.02%	-291.04%
其他业务收入	7,602,061,761.67	78.62%	5,380,339,304.91	79.08%	41.29%
其中：风险管理业务收入	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他收益	4,661,340.80	0.05%	0.00	0.00%	-
二、营业成本	8,480,427,384.65	87.70%	5,944,087,088.62	87.37%	42.67%
提取期货风险准备金	24,751,281.94	0.26%	23,607,674.51	0.35%	4.84%
税金及附加	5,375,318.24	0.06%	12,630,468.68	0.19%	-57.44%
业务及管理费	857,578,448.25	8.87%	655,826,630.31	9.64%	30.76%
资产减值损失	267,007,450.49	2.76%	37,707,552.90	0.55%	608.10%
其他业务成本	7,325,714,885.73	75.76%	5,214,314,762.22	76.64%	40.49%
三、营业利润	1,189,526,247.12	12.30%	855,481,505.64	12.58%	39.05%
营业外收入	2,349,116.97	0.02%	12,692,151.29	0.19%	-81.49%
营业外支出	79,690,691.25	0.82%	73,977,761.87	1.09%	7.72%
四、净利润	887,528,756.90	-	611,186,601.95	-	45.21%

#### 项目重大变动原因：

主要收入、成本项目变动原因如下：

1. 资产管理业务收入：本期较上期下降 43.11%，主要系公司业务结构调整，本期资产管理业务规模减小。
2. 投资咨询业务收入：本期较上期下降 60.58%，主要系公司业务结构调整，本期投资咨询业务规模减小。
3. 代理销售金融产品收入：本期较上期增长 909.00%，主要系公司自 2016 年取得基金业务销售资格

后，代理基金销售业务规模不断扩大，本期取得新的突破。

4. 投资收益：本期较上期增长 162.47%，主要系联营企业永安国富本期盈利大幅增加，公司按比例享受的投资收益增加；期现业务期货端收入增加；同时公司利用闲置自有资金购买理财产品取得了良好收益。

5. 公允价值变动收益：本期较上期增加 52,074,431.46 元，主要系本期永安资本期货端浮盈。

6. 汇兑收益：本期较上期下降 291.04%，主要系汇率波动。

7. 其他业务收入：本期较上期增长 41.29%，主要系子公司永安资本现货业务规模扩大。

8. 其他收益：本期新增项目，系根据《企业会计准则第 16 号——政府补助》（财会[2017]15 号）、《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》（财会[2017]30 号）等相关规定，将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。

9. 税金及附加：本期较上期下降 57.44%，主要系营改增制度实施影响所致。

10. 业务及管理费：本期较上期增长 30.76%，主要系本期人力费用增加所致。

11. 资产减值损失：本期较上期增长 608.10%，主要系本期期末持有的期货对冲存货贬值，导致本期计提的存货跌价准备增加所致。

12. 其他业务成本：本期较上期增长 40.49%，主要系永安资本现货业务规模扩大。

13. 营业外收入：本期较上期下降 81.49%，主要系上期公司收购中邦实业合并成本低于可辨认净资产公允价值的差额计入营业外收入，本期无此项营业外收入，且本期与公司日常经营活动相关的政府补助等按照相关规定计入其他收益。

## (2) 收入构成

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

报告期内，公司实现经纪业务手续费收入 528,451,063.95 元，同比增长 1.33%；资产管理业务收入 14,992,345.10 元，同比下降 43.11%；投资咨询业务收入 13,506,897.33 元，同比下降 60.58%；基金销售业务收入 36,397,217.97 元，同比增长 909.00%；利息净收入 524,237,811.89 元，同比增长 5.62%；投资收益 904,981,185.99 元，同比增长 162.47%；公允价值变动收益 43,153,642.03 元，同比增加 52,074,431.46 元；汇兑收益-2,489,634.96 元，同比减少 3,792,804.27 元。本期实现其他业务收入

7,602,061,761.67 元，同比增长 41.29%。根据《企业会计准则第 16 号——政府补助》（财会[2017]15 号）、《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》（财会[2017]30 号）等相关规定，本期将与公司日常经营活动相关的政府补助，按照其经济业务实质，计入其他收益，金额共计 4,661,340.80 元。

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例
手续费收入	593,347,524.35	585,732,176.34	1.30%
利息净收入	524,237,811.89	496,322,853.52	5.62%
其他业务收入	7,602,061,761.67	5,380,339,304.91	41.29%
投资收益	904,981,185.99	344,791,879.61	162.47%
公允价值变动收益	43,153,642.03	-8,920,789.43	-583.74%
汇兑收益	-2,489,634.96	1,303,169.31	-291.04%
其他收益	4,661,340.80	0.00	-

## 1) 手续费收入

### ① 期货经纪业务的经营情况

项目		代理交易量（手）			代理交易金额（万元）		
交易所	品种	本期	上期	增减百分比	本期	上期	增减百分比
郑州商品交易所	苹果	20,020	-	-	160,024.48	-	-
郑州商品交易所	棉花一号	1,666,606	4,206,958	-60.38%	12,886,964.92	28,409,766.10	-54.64%
郑州商品交易所	棉纱	6,781	-	-	78,369.60	-	-
郑州商品交易所	玻璃	2,765,177	3,394,208	-18.53%	7,520,462.47	7,510,427.05	0.13%
郑州商品交易所	粳稻	5	10	-50.00%	33.13	59.39	-44.22%
郑州商品交易所	晚籼稻	1	2	-50.00%	5.80	11.27	-48.52%
郑州商品交易所	甲醇 N	7,538,089	8,635,317	-12.71%	20,152,172.20	18,164,592.92	10.94%
郑州商品交易所	菜籽油 N	1,181,529	1,288,634	-8.31%	7,934,321.76	8,348,138.29	-4.96%
郑州商品交易所	普麦	4	6	-33.33%	50.12	72.13	-30.51%
郑州商品交易所	早籼稻 N	13	41	-68.29%	70.53	220.46	-68.01%
郑州商品交易所	菜籽粕	3,440,626	9,973,745	-65.50%	7,979,517.78	23,292,523.95	-65.74%
郑州商品交易所	油菜籽	2	299	-99.33%	10.55	1,237.75	-99.15%
郑州商品交易所	硅铁	563,890	27,506	1,950.06%	1,933,675.48	73,290.58	2,538.37%
郑州商品交易所	锰硅	988,110	76,705	1,188.20%	3,384,313.17	279,868.65	1,109.25%
郑州商品交易所	白糖	2,511,084	4,983,903	-49.62%	16,239,612.78	29,558,433.39	-45.06%
郑州商品交易所	白糖期权	177,340	-	-	16,342.72	-	-
郑州商品交易所	PTA	8,901,873	12,082,980	-26.33%	23,424,014.59	29,207,664.69	-19.80%
郑州商品交易所	强麦 N	21,611	25,733	-16.02%	123,361.13	145,859.40	-15.42%
郑州商品交易所	新动力煤	1,985,447	2,856,824	-30.50%	11,742,787.91	13,567,752.71	-13.45%
大连商品交易所	黄大豆	1,085,612	1,386,445	-21.70%	4,220,186.73	5,210,855.74	-19.01%

大连商品交易所	豆二	984	44	2,136.36%	3,252.47	148.51	2,090.10%
大连商品交易所	玉米	7,598,145	8,131,517	-6.56%	12,567,236.17	12,781,127.22	-1.67%
大连商品交易所	铁矿石	20,689,099	21,930,770	-5.66%	108,742,246.20	93,948,643.07	15.75%
大连商品交易所	焦炭	2,946,073	3,426,499	-14.02%	57,278,964.84	39,190,112.94	46.16%
大连商品交易所	聚乙烯	4,371,008	6,643,207	-34.20%	20,707,894.45	29,247,392.57	-29.20%
大连商品交易所	豆粕	9,340,426	22,457,250	-58.41%	26,311,918.40	64,370,988.62	-59.12%
大连商品交易所	豆粕期权	319,017	-	-	20,425.56	-	-
大连商品交易所	棕榈油	3,087,203	6,389,234	-51.68%	17,180,307.87	34,830,109.12	-50.67%
大连商品交易所	聚氯乙烯	2,403,442	1,045,678	129.85%	7,883,671.17	3,363,381.65	134.40%
大连商品交易所	豆油	2,966,182	4,706,963	-36.98%	18,356,875.23	29,532,094.39	-37.84%
大连商品交易所	胶合板	42	208	-79.81%	219.58	1,119.93	-80.39%
大连商品交易所	玉米淀粉	3,096,574	4,983,931	-37.87%	6,053,834.16	9,510,931.33	-36.35%
大连商品交易所	纤维板	51	58	-12.07%	220.78	147.27	49.92%
大连商品交易所	鸡蛋	1,852,591	1,533,330	20.82%	7,059,170.17	5,471,790.58	29.01%
大连商品交易所	焦煤	2,435,136	2,916,676	-16.51%	17,923,261.43	15,856,471.55	13.03%
大连商品交易所	聚丙烯	4,509,671	9,377,946	-51.91%	19,284,376.96	33,494,454.97	-42.43%
上海期货交易所	白银	1,925,536	3,223,922	-40.27%	11,631,992.76	19,312,828.91	-39.77%
上海期货交易所	铝	2,154,267	1,637,902	31.53%	16,318,760.67	10,082,891.52	61.85%
上海期货交易所	黄金	531,880	1,052,615	-49.47%	14,795,129.25	28,300,896.16	-47.72%
上海期货交易所	沥青	5,426,082	9,043,319	-40.00%	14,131,995.22	17,836,681.46	-20.77%
上海期货交易所	铜	1,936,644	2,863,332	-32.36%	47,797,403.97	54,993,355.59	-13.09%
上海期货交易所	燃料油	40	50	-20.00%	853.98	973.39	-12.27%
上海期货交易所	热轧卷板	7,173,839	3,011,392	138.22%	26,494,364.53	8,411,408.20	214.98%
上海期货交易所	镍	4,227,796	7,130,108	-40.71%	36,989,561.21	55,039,974.58	-32.80%
上海期货交易所	铅	337,966	132,480	155.11%	3,146,558.77	1,152,877.30	172.93%
上海期货交易所	螺纹	43,400,442	52,705,608	-17.65%	150,232,635.23	123,326,517.33	21.82%
上海期货交易所	橡胶	4,109,431	3,948,192	4.08%	63,666,670.28	51,282,337.45	24.15%
上海期货交易所	锡	45,647	107,486	-57.53%	660,357.45	1,287,143.72	-48.70%
上海期货交易所	线材	-	6	-100.00%	-	15.52	-100.00%
上海期货交易所	锌	3,011,107	2,642,987	13.93%	35,439,846.57	22,878,153.13	54.91%
中国金融期货交易所	国债10年期	469,623	221,121	112.38%	44,532,426.69	21,990,500.00	102.51%
中国金融期货交易所	中证500	184,546	187,225	-1.43%	23,007,945.32	22,479,540.15	2.35%
中国金融期货交易所	沪深300	198,052	240,141	-17.53%	21,683,501.93	22,874,736.15	-5.21%
中国金融期货交易所	上证50	140,241	119,508	17.35%	10,820,226.38	7,691,924.40	40.67%
中国金融期货交易所	国债5年期	171,802	132,368	29.79%	16,764,373.35	13,331,183.73	25.75%
<b>合计</b>	<b>-</b>	<b>173,914,405</b>	<b>230,882,389</b>	<b>-24.67%</b>	<b>975,284,776.85</b>	<b>1,017,643,626.88</b>	<b>-4.16%</b>

## ② 明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
期货经纪手续费	208,007,128.65	2.15%	280,865,094.03	4.13%
交易所返还减收手续费	319,154,261.01	3.30%	238,883,474.57	3.51%

资产管理业务收入	14,992,345.10	0.16%	26,355,191.20	0.39%
投资咨询业务收入	13,506,897.33	0.14%	34,266,984.69	0.50%
代理销售金融产品收入	36,397,217.97	0.38%	3,607,272.75	0.05%
期权经纪手续费	1,289,674.29	0.01%	1,754,159.10	0.03%
合计	593,347,524.35	6.14%	585,732,176.34	8.61%

### ③分行政区域营业部及手续费收入情况

单位：元

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额	占营业收入比例
杭州本部	1	446,926,498.83	4.61%
浙江省(不含杭州本部)	14	49,162,859.75	0.51%
山东省	6	8,175,080.60	0.08%
辽宁省	3	7,635,081.39	0.08%
北京市	1	8,304,579.37	0.09%
上海市	1	6,882,401.98	0.07%
广东省	2	5,510,044.22	0.06%
江苏省	1	3,478,403.39	0.04%
福建省	2	3,508,801.46	0.04%
吉林省	1	2,987,841.04	0.03%
天津市	1	2,839,951.73	0.03%
河北省	1	2,601,406.85	0.03%
河南省	1	2,458,279.18	0.03%
湖北省	1	2,021,482.37	0.02%
江西省	1	1,058,757.26	0.01%
重庆市	1	2,643,425.15	0.03%
湖南省	1	1,297,308.99	0.01%
四川省	1	1,200,607.10	0.01%
香港	1	34,654,713.69	0.36%
合计	41	593,347,524.35	6.14%

### 2) 利息净收入

#### 明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
利息收入	615,381,251.86	6.37%	552,616,034.42	8.12%
其中：	565,495,162.41	5.85%	535,061,076.45	7.86%
母公司保证金利息收入				
境外利息收入	22,000,595.32	0.23%	9,759,145.46	0.14%
其他利息收入	27,885,494.13	0.29%	7,795,812.51	0.11%
利息支出	91,143,439.97	0.94%	56,293,180.90	0.83%
合计	524,237,811.89	5.42%	496,322,853.52	7.30%

### 3) 投资收益

明细情况：

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
权益法核算的长期股权投资收益	205,968,886.40	2.13%	74,357,527.46	1.09%
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	248,717,357.30	2.57%	20,134,829.10	0.30%
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债取得的投资收益	435,637,315.09	4.51%	225,845,469.56	3.32%
处置可供出售金融资产取得的投资收益	28,837,102.27	0.30%	28,317,818.75	0.42%
扣除结构化主体其他投资者享有的损益	-14,195,224.94	-0.15%	-3,863,765.26	-0.06%
其他	15,749.87	0.00%	0	0.00%
合计	904,981,185.99	9.36%	344,791,879.61	5.07%

### 4) 公允价值变动收益

明细情况：

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	43,153,642.03	0.45%	-8,920,789.43	-0.13%
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益[注]	42,285,875.07	0.44%	-8,832,559.77	-0.13%
合计	43,153,642.03	0.45%	-8,920,789.43	-0.13%

注：本期衍生金融工具之公允价值变动收益系持有的期货合约、期权等浮动盈亏。

### 5) 汇兑收益

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
汇兑收益	-2,489,634.96	-0.03%	1,303,169.31	0.02%
合计	-2,489,634.96	-0.03%	1,303,169.31	0.02%

### 6) 其他业务收入

明细情况：

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
销售货物收入	7,591,588,205.22	78.54%	5,377,191,205.51	79.03%
租赁收入	138,790.08	0.00%	21,888.00	0.00%
其他	10,334,766.37	0.11%	3,126,211.40	0.05%
合计	7,602,061,761.67	78.65%	5,380,339,304.91	79.08%

## 7) 其他收益

明细情况:

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
财政补助	4,089,641.74	0.04%		
水利基金返还	571,699.06	0.01%		
合计	4,661,340.80	0.05%		

### 收入构成变动的的原因:

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

### (3) 主要客户情况

#### 1) 销售部分

单位：元

序号	客户名称	销售金额	收入占比	是否存在关联关系
1	客户 1	222,290,377.53	2.30%	否
2	客户 2	217,244,317.91	2.25%	否
3	客户 3	179,298,673.73	1.86%	否
4	客户 4	160,307,381.71	1.66%	否
5	客户 5	158,472,337.17	1.64%	否
	合计	937,613,088.05	9.71%	-

#### 2) 经纪业务部分

单位：元

序号	客户名称	经纪金额	收入占比	是否存在关联关系
1	客户 A	7,858,046.32	0.08%	否
2	客户 B	2,180,794.35	0.02%	否
3	客户 C	2,008,941.88	0.02%	否
4	客户 D	1,992,826.32	0.02%	否
5	客户 E	1,908,567.31	0.02%	否
	合计	15,949,176.18	0.16%	-

### (4) 主要供应商情况

单位：元

序号	供应商名称	采购金额	年度采购占比	是否存在关联关系
1	供应商 1	535,075,123.59	6.16%	否
2	供应商 2	276,440,518.49	3.18%	否
3	供应商 3	240,888,879.29	2.77%	否
4	供应商 4	213,761,090.00	2.46%	否
5	供应商 5	199,436,414.14	2.30%	否
	合计	1,465,602,025.51	16.87%	-

### 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	-2,454,149,124.69	3,454,984,588.87	-171.03%
投资活动产生的现金流量净额	-1,041,683,989.49	-41,232,971.62	2,426.34%
筹资活动产生的现金流量净额	-217,013,796.42	296,008,757.95	-173.31%

#### 现金流量分析：

1. 经营活动产生的现金流量净额：本期较上期减少约 59.09 亿元，主要系由于期货市场行情波动，金融监管从严，客户风险承受意愿降低，更倾向于风险较低的投资项目，本期客户出金金额大于客户入金金额，净出金约 34.06 亿元，上年同期客户出金金额小于客户入金金额，净入金约 16.89 亿元。
2. 投资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少约 10.00 亿元，主要系本期银行存款利率升高，公司本期期末定期存款约 10.92 亿元，较上期期末 3 亿元增加约 7.92 亿元；同时，在新的监管制度下公司可用净资本增加，自由资金投资的空间增加，本期公司自有资金投资规模增大。
3. 筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少约 5.13 亿元，主要系本期公司提前偿还部分债务。
4. 本期经营活动产生的现金流量净额比本期净利润金额少约 33.56 亿元，主要系公司客户权益的变动体现在现金流量中，而不体现在净利润中所致。

#### (四) 投资状况分析

##### 1、 主要控股子公司、参股公司情况

永安资本为公司全资子公司，注册资本 5 亿元人民币，2017 年营业收入 6,942,174,761.03 元，较 2016 年同期收入 4,325,475,942.93 元增长 60.50%；2017 年营业成本 7,116,821,084.28 元，较 2016 年同期营业成本 4,321,578,635.81 元增长 64.68%；2017 年净利润 155,891,321.42 元，较 2016 年同期净利润 107,000,357.61 元增长 45.69%；永安资本公司 2017 年度净利润占公司合并报表净利润的 17.29%。永安资本公司 2017 年度营业收入和净利润大幅增长的主要系主营业务规模不断扩大。

永安国富为公司联营企业，成立于 2015 年 1 月，本期注册资本由 5 千万人民币增加至 8 千万元人民币。2017 年营业收入 1,142,570,503.95 元，较 2016 年同期收入 202,311,556.76 元增长 464.76%；2017 年净利润 485,456,427.15 元，较 2016 年同期净利润 131,138,905.58 元增长 270.18%。2017 年度，公司确认投资收益 209,439,510.15 元，永安国富向公司发放现金股利 88,353,968.50 元。永安国富处于起步阶段，业务发展迅速，旗下管理的理财产品业绩优良，在业内拥有良好的口碑；本期永安国富大量引进高端人才，丰富投资理念，取得了出色的成绩。

##### 2、 委托理财及衍生品投资情况

无

##### 3、 主要分公司、营业部情况

截至本期末，公司本级下设 5 家分公司、35 家营业部。报告期内，公司未新设、处置分公司或营业

部。

#### 4、重大的资产处置、置换、剥离情况

无

#### 5、合规情况

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

#### (五) 研发情况

适用 不适用

#### (六) 审计情况

##### 1. 非标准审计意见说明

适用 不适用

##### 2. 关键审计事项说明：

适用 不适用

公司本期有手续费收入的确认、结构化主体的合并两项关键审计事项，以下内容摘自审计报告正文：

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

##### (一) 手续费收入的确认

##### 1. 关键审计事项

永安期货公司手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询收入、代销基金收入及资产管理业务收入。如附注三（二十五）所述，期货经纪业务收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认；投资咨询、资产管理业务、基金代销收入在业务提供的相关服务已经完成，收到价款或取得收取款项的证据时确认收入。

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

##### 2. 审计中的应对

我们实施的审计程序主要包括：（1）了解和评价与手续费收入确认相关的关键内部控制的设计和运行有效性。（2）对于期货经纪业务收入，将公司记录的全年交易量与从中国期货业协会网站获取的交易数据进行核对，并在抽样的基础上将客户的佣金费率与相关客户服务合同进行核对。（3）对于投资咨询、

基金代销收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同中的重要条款，将相关收入与对应协议条款核对，并评价相关收入确认是否符合协议约定及公司收入确认的会计政策。（4）对于资产管理业务收入，抽取样本将计提管理费和业绩报酬的费率与合同约定进行核对，并复算管理费和业绩报酬的计算过程。（5）就用于处理与手续费相关交易的关键信息技术系统，利用本所内部信息技术专家的工作，评价所选取的该系统内相关的信息技术应用控制的设计和运行有效性。

## （二）结构化主体的合并

### 1. 关键审计事项

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

由于确定是否应将结构化主体纳入公司的合并范围涉及重大的管理层判断，且合并的结构化主体可能对合并资产负债表产生重大影响，因此，我们将公司结构化主体的合并确定为关键审计事项。

### 2. 审计中的应对

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

## （七） 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

√适用 不适用

1. 本公司自 2017 年 5 月 28 日起执行财政部制定的《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》，自 2017 年 6 月 12 日起执行经修订的《企业会计准则第 16 号——政府补助》。本次会计政策变更采用未来适用法处理。

2. 本公司编制 2017 年度报表执行《财政部关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》（财会〔2017〕30 号），将原列报于“营业外收入”和“营业外支出”的非流动资产处置利得和损失和非货币性资产交换利得和损失变更为列报于“资产处置收益”。此项会计政策变更采用追溯调整法。由于上期不存在该项会计政策变更所涉及的交易事项，故本次变更对 2017 年度财务报表的可比数据无影响。

## （八） 合并报表范围的变化情况

√适用 不适用

## 1. 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

本期公司出资设立新永安控股公司,注册资本为1亿港币,公司出资1亿港币,占其注册资本的100%,拥有对其的实质控制权,故自该公司成立之日起,将其纳入合并财务报表范围。

### (2) 新纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的成长1号、成长2号资产管理计划、成长3号资产管理计划(以下简称成长3号)、成长5号、成长6号、七禾言起2号、永利1号、永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数多头一号资产管理计划(以下简称黑色多头一号)、永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数空头一号资产管理计划(以下简称黑色空头一号)、永安恒生聚源千际有色金属指数多头一号资产管理计划(以下简称有色多头一号)、永安恒生聚源千际有色金属指数空头一号资产管理计划(以下简称有色空头一号)、瑞意多策略1号,因满足公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免,且享有的可变回报为重大三个条件,故自上述资管计划成立或购买之日起,将其纳入合并财务报表范围。

## 2. 合并范围减少

### (1) 本期不再纳入合并财务报表范围的子公司

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	期初至处置日净利润
浙江中路投资管理有限公司	注销	2017年8月3日	38,796.31	2.14

### (2) 不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的永安东方智慧1号资产管理计划(以下简称东方智慧1号)因已清算,故自清算日起不再纳入合并范围。本期因公司部分赎回了永安大岩CTA1号资产管理计划(以下简称大岩CTA1号)的份额,使得本公司享有其收益不满足重大条件,故自赎回日起不再纳入合并财务报表范围。

## (九) 企业社会责任

作为国内期货行业领军者,公司高度重视扶贫工作,在做好公司经营的同时,强化社会责任担当意识。公司紧紧围绕国家“五位一体”总体布局和“四个全面”战略方针,把打赢脱贫攻坚战作为公司崇高的政治责任。

2017年,公司先后在吉林省大安市和安图县、陕西省延长县、辽宁省建平县等地推进7个精准扶贫项目,本年度累计投入扶贫资金572万元,帮扶吉林、辽宁、云南等地建档立卡贫困户440户1108余农民攻坚脱贫。开展大豆、玉米、棉花橡胶等7个“保险+期货”扶贫项目,场外期权专业扶贫项目获

大商所玉米价格验收评审第一名、吉林省财政金融创新奖最高奖励 50 万元，公司精准扶贫工作获国家扶贫办、中国证监会扶贫办、中期协联合考评第一名。目前，公司已与吉林省延边州安图县明月镇红星村、吉林省大安市艾里蒙古族乡民生村、吉林省大安市月亮泡镇先进村、吉林省大安市两家子镇同德村共四个村签署精准扶贫框架协议，相应的扶贫措施也将陆续启动。

### 三、 持续经营评价

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

报告期内，公司实现营业收入 9,669,953,631.77 元，同比增长 42.21%；利润总额 1,112,184,672.84 元，同比增长 40.04%；净利润 887,528,756.90 元，同比增长 45.21%，公司盈利水平处于行业领先地位，各项风险监管指标均符合监管部门要求，内部治理结构合理、稳定，具备良好的持续经营能力。

### 四、 未来展望

适用 不适用

#### （一） 行业发展趋势

近年来，期货业作为现代金融业的重要组成部分，行业规模稳步增长，服务实体经济的能力不断增强，合规风控能力显著提升，业务范围从期货经纪业务，向资产管理、风险管理、投资咨询等多领域拓展，期货上市品种进一步丰富，遵循市场化法制化国际化的方向，推动期货经营机构实施差异化、特色化、专业化发展。目前，作为中国期货市场最为重要的法律《期货法》的立法进程加快推进，《期货法》的出台将保障期货市场在法制化的道路上迈上新台阶。经过多年的探索和实践，期货风险管理子公司作为期货公司作为期货公司从事风险管理业务的平台服务供给侧结构性改革，促进实体企业转型升级发挥了至关重要的作用，服务“三农”创新了“保险+期货”的新模式，而财富管理业务随着我国经济的发展发展潜力和空间巨大，期货公司凭借自身专业能力和资源，综合实力和核心竞争力持续提高，期货市场在防范化解金融风险的能力上不断加强。未来，我国期货市场将进一步扩大双向开放，随着原油等国际化新交易品种的推出，我国大宗商品价格的国际影响力将有效提升。整体而言，期货市场在服务产业优化升级过程中，在服务金融市场发展中大有可为。

#### （二） 公司发展战略

公司立足于大资本市场，以服务实体经济为宗旨，深化供给侧结构性改革、融入“一路一带”战略，抓住加快对外开放的历史性机遇，以永安文化为精神引领，构筑风险管理和财富管理两大核心竞争力，

以专业的产业服务能力、投资管理能力、策略研究能力、金融衍生工具综合运用能力为支撑，全面推进业务创新，打造期现结合、混业经纪、私募资管、场外交易、跨境服务等平台，促进期货市场功能发挥。同时适时开展重大战略重组，优化治理结构和激励机制，实现向具有国际竞争力的衍生品综合金融集团迈进。

### **(三) 经营计划或目标**

公司将秉承持续创新的理念，以金融市场风险管理和财务管理为突破口，致力于为实体经济转型升级、国内外投资提供全球资产配置的优质服务，朝着国内一流，国际领先的衍生品综合服务商不断努力。

### **(四) 不确定性因素**

参见“第四节 管理层讨论与分析”之“五、风险因素”

## **五、 风险因素**

### **(一) 持续到本年度的风险因素**

#### **1. 期货、期权经纪业务风险**

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

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

#### **2. 利息收入下滑风险**

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

应对措施：公司已与多家保证金存管银行开展业务合作，存款利率由各银行报价，按竞争报价原则

协定存款；自有资金关注证券等金融机构稳定的固收产品，往往会高于存款利率。这些措施一定程度上对冲利率下行风险。

### 3. 期货投资咨询业务风险

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

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

### 4. 资产管理业务风险

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

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

### 5. 基金销售业务风险

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

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

数据，明确业务人员和客户归属关系，完善客户资产信息，统一业务流程，有助于公司进一步提高业务人员的服务效率。

#### 6. 业务创新风险

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

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

#### 7. 投资风险

在风险可控的情况下，公司使用自有资金开展投资业务，配置范围包括私募基金、证券市场、基金、信托产品等金融产品。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的操作风险和 market 风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损影响公司盈利能力的可能。

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

#### 8. 合规风险

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

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

## 9. 信息技术系统风险

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

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

## 10. 信用风险

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

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

## 11. 居间人管理风险

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

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

#### 12. 人才流失和储备不足风险

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

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

#### 13. 政策风险

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

暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。

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

#### 14. 重大诉讼、仲裁风险

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

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

#### 15. 商标风险

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

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

## (二) 报告期内新增的风险因素

无

## 第五节 重要事项

### 一、 重要事项索引

事项	是或否	索引
是否存在重大诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	五.二.(一)
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(二)
是否存在偶发性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(三)
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项或者本年度发生的企业合并事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(四)
是否存在股权激励事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(五)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(六)
是否存在被调查处罚的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在自愿披露的其他重要事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

### 二、 重要事项详情（如事项存在选择以下表格填列）

#### （一） 重大诉讼、仲裁事项：

##### 1、 报告期内发生的诉讼、仲裁事项

报告期内发生的诉讼、仲裁事项涉及的累计金额是否占净资产 10%及以上

是 否

（不超过净资产 10%的，基础层公司可免披下表，创新层公司必须披露）

单位：元

性质	累计金额		合计	占期末净资产比例%
	作为原告/申请人	作为被告/被申请人		
诉讼或仲裁	0.00	0.00	0.00	0.00%

##### 2、 以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

##### 3、 以临时公告形式披露且在报告期内结案的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

#### （二） 报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
--------	------	------

1. 购买原材料、燃料、动力	3,000,000,000.00	
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	348,000,000.00	32,844,943.88
3. 投资(含共同投资、委托理财、委托贷款)	3,550,000,000.00	1,751,707,273.52
4. 财务资助(挂牌公司接受的)		
5. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	1,054,000,000.00	227,704,575.51
6. 其他		
<b>总计</b>	7,952,000,000.00	2,012,256,792.91

### (三) 报告期内公司发生的偶发性关联交易情况

单位：元

关联方	交易内容	交易金额	是否履行必要决策程序	临时报告披露时间	临时报告编号
敦和资产管理有限公司	期货交易手续费	3,157,788.28	是	2017-8-8	临 2017-043
敦和资产管理有限公司	收取基金销售费	1,556,949.59	是	2017-8-8	临 2017-043
敦和资产管理有限公司	投资敦和八卦田积极1号私募基金(FOF)	21,580,000.00	是	2017-8-8	临 2017-043
<b>总计</b>	-	26,294,737.87	-	-	-

#### 偶发性关联交易的必要性、持续性以及对公司生产经营的影响:

公司原副董事长、总经理、法定代表人施建军先生于 2017 年 4 月辞去职务, 出任敦和资产管理有限公司董事长、法定代表人, 敦和资产管理有限公司因此确认为关联方。上述与敦和资产发生的交易事项基于双方协同发展的日常经营需要, 不存在损害公司和其他股东利益的情形。

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

#### 1.对永安国富增资

公司第二届董事会第九次会议审议通过《关于永安国富资产管理有限公司增资的议案》, 第二届董事会第十次会议、2017 年第二次临时股东大会审议通过《关于永安国富资产管理有限公司增资方案的议案》, 增资基本情况如下:

投资标的名称: 永安国富资产管理有限公司

投资标的所在地: 中国杭州

投资标的类别: 股权

股权类资产信息说明：永安国富资产管理有限公司（以下简称永安国富）成立于 2015 年 1 月，注册资本 5000 万元，法定代表人肖国平，经营范围为实业投资、股权投资、投资管理、资产管理、投资咨询服务。

本次增资前，公司拥有永安国富 2450 万股，现追加认缴出资 190 万股，追加投资方式为现金认购，每股价格 9.31 元，现金缴纳 1768.90 万元，前后共认缴股数 2640 万股，占注册资本的 33%。杭州小牛投资合伙企业（有限公司）原拥有永安国富 2550 万股，现追加认缴出资 2810 万股，追加投资方式为现金认购，每股价格 9.31 元，现金缴纳 26161.10 万元，前后共认缴股数 5360 万股，占注册资本的 67%。

本次增资，并适当调整公司持有永安国富的股权比例，充分考虑了私募基金行业的特点以及核心投资团队在私募基金投资运作中所起的作用，有利于永安国富人才引进、培养、稳定，最大程度满足并提升永安期货股东价值。

公司已在全国中小企业股份转让系统信息披露平台 <http://www.neeq.com.cn>/披露《临 2017-024 永安期货股份有限公司对外投资公告（对子公司增资）》。

## 2. 设立新永安国际金融控股有限公司

公司第一届董事会第二十四次会议、2015 年第七次临时股东大会审议通过《关于在香港设立国际金融控股公司的议案》，相关情况如下：

名称：新永安国际金融控股有限公司

注册地址：香港中环干诺道中 64-66 号中华厂商会大厦 12 楼及 25 楼

经营范围：投资控股

投资规模：港币 1 亿元

持股比例：100%

公司在香港注册成立全资子公司新永安国际金融控股有限公司是为落实公司“走出去、引进来”的多元化国际业务战略规划，夯实境外期货经纪业务，拓展海外业务的多元化发展，满足客户对证券期货等综合化服务的需求。公司将以此为国际化业务平台，逐步建立公司境外业务资源整合机制，加快推进公司国际业务。

公司已在全国中小企业股份转让系统信息披露平台 <http://www.neeq.com.cn>/披露《临 2017-063 永安期货股份有限公司对外投资进展公告（设立全资子公司）》。

## 3. 对中邦实业增资

公司第二届董事会第十一次会议审议通过《关于浙江中邦实业发展有限公司增资的议案》，增资基本情况如下：

名称：浙江中邦实业发展有限公司

注册地址：杭州市潮王路 238 号银地大厦 4 层

经营范围：食品经营（凭许可证经营），金属材料、建材、化工产品及其原理（不含危险品及易制毒化学品）、橡胶及制品、轻纺产品、纸张及纸浆、初级食用农产品、饲料、燃料油、焦炭、棉花、煤炭（无储存）、贵金属的销售、商铺信息服务，投资管理，投资咨询，经营进出口业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

本次增资前，中邦实业的注册资本为 1.2 亿元，公司持股比例为 100%，本次增资，公司认缴出资人民币 1 亿元，增资后，中邦实业的注册资本为 2.2 亿元，公司持股比例仍为 100%。

本次对中邦实业的增资主要是围绕公司战略发展的需要，进一步增强子公司的资本实力和综合竞争力，为其业务拓展提供进一步支持，为公司的未来发展定位奠定基础。

公司已在全国中小企业股份转让系统信息披露平台 <http://www.neeq.com.cn>/披露《临 2017-071 永安期货股份有限公司对外投资公告（对子公司增资）》。

## （五） 承诺事项的履行情况

公司股东、公司及其董事、监事、高级管理人员在公开转让说明书中作出以下承诺：

### 1、关于避免同业竞争的承诺

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

### 2、公司股东所持股份的限售安排及股东对所持股份自愿锁定的承诺

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

公司及其董事、监事、高级管理人员或股东、实际控制人及其他信息披露义务人均能在承诺履行期内严格遵守承诺，没有发生违反承诺的情况发生，也不存在超过期限未完成的承诺事项。

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

协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间；同时，公司股东浙江产业基金作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间。该承诺正在履行中。

(六) 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例	发生原因
存货	质押	111,210,324.87	0.37%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	质押	77,899,414.85	0.26%	作为远期结售汇保证金、信用证保证金、保函保证金或借款质押保证金
<b>总计</b>	-	189,109,739.72	0.63%	-

## 第六节 股本变动及股东情况

### 一、普通股股本情况

#### (一) 普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末	
		数量	比例%		数量	比例%
无限售条件股份	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%
	其中：控股股东、实际控制人	146,449,275	11.18%	0	146,449,275	11.18%
	董事、监事、高管					
	核心员工					
有限售条件股份	有限售股份总数	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%
	其中：控股股东、实际控制人	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%
	董事、监事、高管					
	核心员工					
总股本		1,310,000,000.00	-	0	1,310,000,000.00	-
普通股股东人数						

#### (二) 普通股股东情况

单位：股

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

	司						
5	浙江省协作大厦有限公司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727
6	物产中大集团股份有限公司	27,500,000	0	27,500,000	2.10%	0	27,500,000
7	方继方	0	15,324,000	15,324,000	1.17%	0	15,324,000
8	浙江省经协集团有限公司	0	5,055,000	5,055,000	0.39%	0	5,055,000
9	南通金玖惠通三期创业投资基金合伙企业（有限合伙）	4,795,000	0	4,795,000	0.37%	0	4,795,000
10	浙江物产国际贸易有限公司	2,500,000	0	2,500,000	0.19%	0	2,500,000
<b>合计</b>		<b>1,267,949,969</b>	<b>20,379,000</b>	<b>1,288,328,969</b>	<b>98.36%</b>	<b>292,898,550</b>	<b>995,430,419</b>

以上股东间相互关系说明：

1.省金控持有本公司控股股东财通证券 32.25%股权，同时省金控持有本公司股东浙江产业基金 100% 股权。

2.浙江省交通投资集团有限公司持有本公司控股股东财通证券 2.03%股权，同时持有本公司股东经建投 95.32%股权。

3.物产中大集团股份有限公司持有浙江物产国际贸易有限公司 87.29%股权，系其控股股东。

## 二、 优先股股本基本情况

适用 不适用

### 三、 控股股东、实际控制人情况

#### (一) 控股股东情况

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

法定代表人：沈继宁

成立日期：2003 年 06 月 11 日

统一社会信用代码：913300007519241679

注册资本：35.89 亿元

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

经营范围：经营证券业务

报告期内，公司控股股东未发生变化。

#### (二) 实际控制人情况

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

报告期内，公司实际控制人未发生变化。

## 第七节 融资及利润分配情况

### 一、最近两个会计年度内普通股股票发行情况

单位：元/股

发行方案公告时间	新增股票挂牌转让日期	发行价格	发行数量	募集金额	发行对象中董监高与核心员工人数	发行对象中做市商家数	发行对象中外自然人人数	发行对象中私募投资基金家数	发行对象中信托及资管产品家数	募集资金用途是否变更
2015年11月16日	2016年1月13日	3.89	450,000,000	1,750,500,000	0	0	0	0	0	否

#### 募集资金使用情况：

公司募集资金用途为补充净资本。截至2016年12月31日，募集资金已使用完毕，并于2017年3月6日披露了《2016年永安期货股份有限公司募集资金存放与实际使用情况的专项报告》和《中信证券股份有限公司关于永安期货2016年募集资金存放与使用情况的专项核查报告》。该次募集资金的使用用途未发生变更，与公开披露的募集资金用途一致，未存在用于持有交易性金融资产和可供出售的金融资产、借与他人、委托理财等情形。

### 二、存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

### 三、债券融资情况

适用 不适用

单位：元

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

	安债					
<b>合计</b>	-	-	600,000,000	-	-	-

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

#### 债券违约情况

适用 不适用

#### 公开发行债券的特殊披露要求

适用 不适用

#### 四、可转换债券情况

适用 不适用

#### 五、间接融资情况

单位：元

融资方式	融资方	融资金额	利息率%	存续时间	是否违约
借款	永安资本	50,000,000.00	5.0025%	2017-01-17 至 2017-07-17	否
借款	永安资本	30,000,000.00	4.785	2017-01-25 至 2017-10-27	否
借款	永安资本	150,000,000.00	4.785	2017-03-09 至 2017-09-08	否
借款	永安资本	20,000,000.00	4.872	2017-03-20 至 2017-09-19	否
借款	永安资本	40,000,000.00	4.5675	2017-04-25 至 2017-12-22	否
借款	永安资本	80,000,000.00	4.785	2017-05-11 至 2017-12-22	否
借款	中邦实业	20,000,000.00	5.002	2017-05-22 至 2018-05-16	否
借款	永安资本	20,000,000.00	4.785	2017-07-13 至 2018-07-04	否
借款	永安资本	50,000,000.00	5.0025	2017-07-17 至 2018-06-17	否
借款	永安资本	50,000,000.00	5.250015	2017-08-15 至 2018-08-15	否
借款	永安资本	50,000,000.00	4.785	2017-08-23 至 2018-08-15	否
借款	永安资本	50,000,000.00	4.785	2017-08-29 至 2018-02-28	否
借款	永安资本	60,000,000.00	4.785	2017-09-07 至 2018-03-06	否

借款	永安资本	60,000,000.00	4.785	2017-09-20 至 2018-09-20	否
借款	永安资本	50,000,000.00	5.22	2017-12-13 至 2018-06-12	否
借款	永安资本	80,000,000.00	4.785	2017-12-19 至 2018-12-19	否
借款	永安资本	30,000,000.00	4.785	2017-12-25 至 2018-07-04	否
借款	永安资本	40,000,000.00	4.785	2017-12-25 至 2018-12-25	否
<b>合计</b>	-	<b>930,000,000.00</b>	-	-	-

#### 违约情况

适用 不适用

### 六、 利润分配情况

#### (一) 报告期内的利润分配情况

适用 不适用

单位：元/股

股利分配日期	每 10 股派现数（含税）	每 10 股送股数	每 10 股转增数
2017 年 12 月 27 日	1.50	0	0
<b>合计</b>	<b>1.50</b>	<b>0</b>	<b>0</b>

注：2017 年半年度权益分派方案获 2017 年 12 月 27 日召开的股东大会审议通过，本次权益分派权益登记日为 2018 年 2 月 9 日，除权除息日为 2018 年 2 月 12 日。

#### (二) 利润分配预案

适用 不适用

#### 未提出利润分配预案的说明

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员及员工情况

### 一、 董事、监事、高级管理人员情况

#### (一) 基本情况

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	学历	任期	是否在公司 领取薪酬	年度薪 酬
阮琪	董事长	男	54	本科	2016.01-2019.01	否	
葛国栋	董事、总 经理、法 定代表 人	男	45	本科	2017.03-2019.01	是	383.11
黄志明	董事	男	41	硕士	2017.12-2019.01	否	
金朝萍	董事	女	42	硕士	2016.01-2019.01	否	
林瑛	董事	男	58	本科	2016.01-2019.01	否	
麻亚峻	董事	男	43	硕士	2017.12-2019.01	否	
申建新	董事	男	44	EMBA	2016.01-2019.01	否	
朱国华	独立董 事	男	67	硕士	2016.01-2019.01	否	15
汪炜	独立董 事	男	50	博士	2016.01-2019.01	否	15
李义超	独立董 事	男	54	博士	2016.01-2019.01	否	10
黄平	独立董 事	男	48	博士	2016.01-2019.01	否	10
马成骁	监事会 主席	男	43	本科	2016.01-2019.01	否	
胡启彪	监事	男	55	硕士	2016.01-2019.01	否	
胡慧珺	监事	女	55	大专	2016.01-2019.01	否	
钱焕军	监事	男	48	本科	2016.01-2019.01	否	
余晓红	职工监 事	女	53	本科	2016.01-2019.01	是	217.04
毛贵明	职工监 事	男	40	本科	2016.01-2019.01	是	57.44
叶元祖	党委书 记、副总 经理、董 事会秘 书、财务 总监	男	55	本科	2016.01-2019.01	是	296.35
金吉来	副总经 理	男	56	本科	2016.01-2019.01	是	240.95

石春生	副总经理	男	52	本科	2016.01-2019.01	是	221.43
陈敏	首席风险官	女	41	本科	2016.01-2019.01	是	235.65
董事会人数:							11
监事会人数:							6
高级管理人员人数:							5

注：独立董事在公司领取独立董事津贴。

**董事、监事、高级管理人员相互间关系及与控股股东、实际控制人间关系：**

董事长阮琪，现任财通证券股份有限公司董事总经理。

董事申建新，现任财通证券股份有限公司董事会秘书兼总经理办公室主任。

董事黄志明，现任浙江省金融控股有限公司党委委员兼金融管理部总经理。

监事胡启彪，现任财通证券股份有限公司工会副主席兼工会办公室主任。

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

**(二) 持股情况**

单位：股

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

**(三) 变动情况**

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

姓名	期初职务	变动类型（新任、换届、离任）	期末职务	变动原因
施建军	副董事长、总经理	离任	无	工作变动辞职
汪一兵	副董事长	离任	无	工作变动辞职
于海洋	董事	离任	无	工作变动辞职
葛国栋	副总经理	新任	董事、总经理、法定	

			代表人	
黄志明	无	新任	董事	
麻亚峻	无	新任	董事	

#### 本年新任董事、监事、高级管理人员简要职业经历:

##### 1. 葛国栋先生 中国国籍

葛国栋先生，1972年生，中国国籍。历任永安期货股份有限公司交易员、交易部主管、交易部副经理、营业部经理、市场部经理、总经理助理和副总经理，2017年3月起任永安期货股份有限公司董事、总经理。

##### 2. 黄志明先生 中国国籍

黄志明先生，1976年生，中国国籍，无境外永久居留权，研究生学历，高级经济师。曾任浙江省财务开发公司机要秘书、投资二部项目经理、办公室副主任、主任。2012年9月起任浙江省金融控股有限公司职工董事、办公室主任、风险合规部总经理，2016年4月任公司党委委员，2017年10月兼任金融管理部总经理。

##### 3. 麻亚峻先生 中国国籍

麻亚峻先生，1974年生，中国国籍，无境外永久居留权，研究生学历，经济师。曾任浙江省经济建设投资有限公司投资开发部副经理、总经理助理副总经理，浙江省铁路投资集团有限公司投资发展部经理。2015年5月至今，担任浙江省经济建设投资有限公司党委书记、董事长。

## 二、 员工情况

### (一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	期末人数
中层以上管理人员	101	100
市场业务人员	389	370
研究人员	93	87
信息技术人员	69	80
财务人员	54	66
合规管理及风控人员	75	82
其他职能人员	147	207
<b>员工总计</b>	<b>928</b>	<b>992</b>

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	3	3
硕士	195	237
本科	605	636

专科	117	103
专科以下	8	13
员工总计	928	992

**员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：**

1. 人员变动

截至报告期末，公司在职工工总数 992 人，较期初增长 64 人，增长主要体现在核心业务及技术、研发及控股子公司专业职能管理领域，公司中高层及骨干员工保持稳定，人才梯队建设不断完善。

2. 人才引进、培训及招聘情况

报告期内，公司根据战略及业务扩展需要，拟制年度招聘计划，通过“黄埔班”在校大学生实习培育、“新动力”应届大学生招聘、精英专才海内外招聘等方式，广泛甄优秀人才，有效补充了技术、业务、研发、专业职能等关键岗位员工队伍，为公司战略发展提供人才支撑。

报告期内，公司根据战略规划及经营目标、部门绩效导向需求、员工职业发展需求，以“内外部培训+等级认证”的方式进行人才培育。组织“启明星”新员工培训，逐步开展产业经理、理财师、分析师、技术工程四大专业序列的培训、认证、评聘工作，不断牵引员工提高专业技能。

3. 薪酬政策

公司员工薪酬包括基本薪金、绩效薪金、专项薪金、保障性福利等，保障性福利包括五险一金、企业年金、健康体检、婚丧礼金、节日慰问、带薪休假等；报告期内，公司密切关注同行业薪酬状况，及时调整薪酬水平，保证关键岗位的薪酬竞争力；同时，梳理岗位价值评估模型、员工定岗定薪、调薪等管理制度，实现薪酬的内部公平、公正；同时，继续推进企业文化建设，提升员工的企业认同感和团队凝聚力。

4. 需公司承担费用的离退休职工人数

无

**(二) 核心人员（公司及控股子公司）基本情况**

**核心人员总体情况**

	期初员工数量	期末员工数量	期末普通股持股数量
业务核心人员	0	0	0
投资业务核心人员	0	0	0
关键岗位（如风险管理岗）关键人员	0	0	0

**核心员工：**

适用 不适用

其他对公司有重大影响的人员（非董事、监事、高级管理人员）

适用 不适用

核心人员的变动情况：

不适用

## 第九节 公司治理及内部控制

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

### 一、 公司治理

#### (一) 制度与评估

##### 1、 公司治理基本状况

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

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

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

##### 2、 公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

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

切实维护所有股东的利益。

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

### 3、公司重大决策是否履行规定程序的评估意见

公司 2017 年度重要的人事变动、对外投资、融资、关联交易、担保等重大事项，均严格按照相关法律法规、《公司章程》及公司其他相关内控制度的规定履行了相应的决策程序。

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

### 4、公司章程的修改情况

(1) 2017 年 3 月 3 日，公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过《关于修改公司章程的议案》的议案，对公司章程中第二十三条做出修订：“公司根据经营和发展的需要，依照法律、法规的规定，经股东大会决议，并经中国证监会或其授权的派出机构批准，可以采用下列方式增加资本：（一）公开发行股份；（二）非公开发行股份；（三）向现有股东派送红股；（四）以公积金转增股本；（五）法律、行政法规规定的其他方式。”增加条款“公司以本条前款第（一）、（二）种方式增发新股的，公司股票发行前的在册股东对新增股份不享有优先认购权。”

(2) 2017 年 12 月 27 日，公司 2017 年第三次临时股东大会审议通过关于修订《永安期货股份有限公司章程》的议案。为适应国有企业改革的新形势新要求，进一步健全各司其职、各负其责、协调运转、有效制衡的国有企业法人治理结构，建立新时代中国特色社会主义现代国有企业制度，规范公司的组织和行为，维护公司、股东和债权人的合法权益，公司在章程修订中，新增中国共产党组织章节，在尊重企业市场主体地位，遵循市场经济规律和企业发展规律的基础上，以规范决策机制和完善制衡机制为重点，加强党的领导和完善公司治理统一起来，明确国有企业党组织在法人治理结构中的法定地位，发挥国有企业党组织的领导核心和政治核心作用。

## (二) 三会运作情况

### 1、三会召开情况

会议类型	报告期内会议召开的次数	经审议的重大事项（简要描述）
董事会	5	1.2017 年 3 月 3 日，公司召开第二届董事会第

		<p>七次会议，审议通过 2016 年工作总结和 2017 年工作计划（总经理工作报告）、2016 年董事会工作报告、首席风险官 2016 年度工作报告、2016 年年度报告及摘要、募集资金存放与实际使用情况的专项报告、2016 年财务决算报告和 2017 年财务预算报告、2016 年资本性支出预算执行情况报告与 2017 年资本性支出预算计划、关于确认公司 2016 年关联交易的议案、关于预计公司 2017 年关联交易的议案、2016 年度利润分配方案、2016 年下半年风险监管指标情况报告、2016 年度经营层薪酬考核报告与 2017 年度经营层薪酬考核方案、关于相关经营管理事项授权的议案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于调整独立董事朱国华、汪炜津贴的议案、关于续聘会计师事务所的议案、关于公司与国家级贫困县吉林省大安市（县级市）、安图县等结对帮扶的议案、永安期货“十三五”发展战略规划等 19 项议案；</p> <p>2.2017 年 3 月 24 日，公司召开第二届董事会第八次会议，审议通过关于聘任永安期货股份有限公司总经理的议案、关于更换公司董事的议案等 2 项议案；</p> <p>3.2017 年 4 月 18 日，公司召开第二届董事会第九次会议，审议通过关于施建军总经理离任审计的情况说明、关于永安国富资产管理有限公司增资的议案、关于修订《永安期货股份有限公司人力资源管理制度》的议案、关于制定《永安期货股份有限公司薪酬管理制度》的议案、关于修订《永安期货股份有限公司交易运作管理办法》的议案、关于调整公司反洗钱工作小组组长的议案等 6 项议案；</p> <p>4.2017 年 8 月 4 日，公司召开第二届董事会第十次会议，审议通过 2017 年上半年工作总结及下半年工作计划、2017 年半年度报告、2017 年上半年财务执行情况报告、2017 年上半年风险监管指标情况报告、关于发行次级债的议案、关于同意财通证券股份有限公司担任公司次级债发行的主承销商的议案、关于公司开展境外中介机构委托代理业务的议案、关于公司原总经理施建军 2017 年薪酬考核决算的报告、关于补充确认敦和资产管理有限公司关联交易事项的报告、关于永安国富资产管理有限公司增资方案的议案、关于捐赠浙江国富慈善基金会的议案等 12 项议案；</p> <p>5.2017 年 12 月 11 日，公司召开第二届董事会第十一次会议，</p>
--	--	---

		审议通过关于修订《永安期货股份有限公司章程》的议案、关于修订《永安期货股份有限公司董事会议事规则》的议案、关于董事会成员变更的议案、2017年半年度利润分配的议案、关于实施新永安国际金融控股有限公司资产重组的议案、关于浙江永安资本管理有限公司开展混合所有制改造的议案、关于浙江中邦实业发展有限公司增资的议案、关于制定《永安期货股份有限公司信息报备及公示管理办法》的议案、关于修订《永安期货股份有限公司反洗钱内控制度》的议案等 10 项议案。
监事会	4	1. 2017年3月3日,公司召开第二届监事会第五次会议,审议通过2016年监事会工作报告、首席风险官2016年度工作报告、2016年年度报告及摘要、募集资金存放与实际使用情况的专项报告、2016年财务决算报告和2017年财务预算报告、2016年资本性支出预算执行情况报告与2017年资本性支出预算计划、关于确认公司2016年关联交易的议案、关于预计公司2017年关联交易的议案、2016年度利润分配方案、2016年下半年风险监管指标情况报告、2016年度经营层薪酬考核报告与2017年度经营层薪酬考核方案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案等12项议案;2. 2017年4月18日,公司召开第二届监事会第六次会议,审议通过关于施建军总经理离任审计的情况说明的议案;3. 2017年8月4日,公司召开第二届监事会第七次会议,审议通过2017年半年度报告、2017年上半年财务执行情况报告、2017年上半年风险监管指标情况报告、关于公司原总经理施建军2017年薪酬考核决算的报告等4项议案;4. 2017年12月11日,公司召开第二届监事会第八次会议,审议通过2017年半年度利润分配的议案。
股东大会	4	1. 2017年3月3日,公司召开2017年第一次临时股东大会,审议通过关于修改公司章程的议案;2. 2017年4月18日,公司召开2016年年度股东大会,审议通过2016年董事会工作报告、2016年监事会工作报告、2016年年度报告及摘要、募集资金存放与实际使用情况的专项报告、2016年财务决算报告和2017年财务预算报告、2016年资本性支出预算执行情况报告与2017年资本性支出预算计划、关于确认公司2016年关联交易的议案、关于预计公

		<p>司 2017 年关联交易的议案、2016 年度利润分配方案、2016 年下半年风险监管指标情况报告、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于调整独立董事朱国华、汪炜津贴的议案、关于续聘会计师事务所的议案、关于更换公司董事的议案等 14 项议案；3. 2017 年 8 月 23 日，公司召开 2017 年第二次临时股东大会，审议通过 2017 年半年度报告、2017 年上半年财务执行情况报告、2017 年上半年风险监管指标情况报告、关于发行次级债的议案、关于同意财通证券股份有限公司担任公司次级债发行的主承销商的议案、关于补充确认敦和资产管理有限公司关联交易事项的报告、关于永安国富资产管理有限公司增资方案的议案、关于捐赠浙江国富慈善基金会的议案等 8 项议案；4. 2017 年 12 月 27 日，公司召开 2017 年第三次临时股东大会，审议通过关于修订《永安期货股份有限公司章程》的议案、关于修订《永安期货股份有限公司董事会议事规则》的议案、关于董事会成员变更的议案、2017 年半年度利润分配的议案、关于实施新永安国际金融控股有限公司资产重组的议案、关于浙江永安资本管理有限公司开展混合所有制改造的议案等 6 项议案。</p>
--	--	---

## 2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见

报告期内公司共召开 5 次董事会、4 次监事会、4 次股东大会，“三会”的召集、提案审议、通知时间、召开程序、授权委托、表决和决议等运作程序，符合《公司法》及有关法律法规和《公司章程》的相关规定，公司董事、监事及高级管理人员符合《公司法》等法律法规的任职要求，能够按照《公司章程》、三会议事规则等治理制度勤勉、诚信地履行职责和义务。

### (三) 公司治理改进情况

公司不断完善公司治理结构，报告期内，公司修订了《公司章程》和《董事会议事规则》，将党的领导和党建工作写入公司《公司章程》。公司积极开展“2017 年内控建设年”活动，夯实规范发展基础，针对资产管理和财富管理创新业务的开展情况，修订和发布了《资产管理业务管理办法》、《FOF 基金产品管理暂行办法》等相关制度 11 项，有效保障了基金销售业务及资产管理业务的进一步规范运作。对于子公司管理，公司协助参与其制度框架的重新梳理，确保内控制度的制度的有效性和可操作性。报

告期内，公司重点加强了投资者适当性制度建设，联合公司多部门，完成对开展各项业务的投资者适当性制度的全面梳理并对反洗钱内控制度、CRM 管理制度进行了修订。

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

报告期内，公司管理层未引入职业经理人。

#### **(四) 投资者关系管理情况**

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

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

#### **(五) 董事会下设专门委员会在本年度内履行职责时所提出的重要意见和建议**

公司董事会下设 4 个专门委员会：战略发展委员会、审计委员会、风险控制委员会、提名与薪酬考

核委员会。报告期内，公司各委员会各司其职，为公司中远期战略发展规划、经营风险管理等、董事高管人选推荐、薪酬考核、人才激励等事项等项提出了建议，为公司治理结构不断完善、长期发展规划和可持续发展起到了积极的作用。

## (六) 独立董事履行职责情况

姓名	本年应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数
朱国华	5	4	1	0
汪炜	5	5	0	0
李义超	5	5	0	0
黄平	5	5	0	0

### 独立董事的意见：

报告期内，独立董事严格按照相关法律法规、《公司章程》和《独立董事工作制度》的要求，认真履行职责，积极了解公司经营管理、公司治理、内部控制等情况，切实维护公司整体利益。独立董事认为公司董事会和股东大会的召集、召开符合法定程序，重大经营事项均履行了相关审批程序，合法有效，对报告期内的事项无异议。

## 二、 内部控制

### (一) 监事会就年度内监督事项的意见

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

### (二) 公司保持独立性、自主经营能力的说明

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

#### 1. 业务独立

本公司根据《营业执照》及《经营期货业务许可证》所核定的经营范围独立开展业务。本公司各项业务具有完整的业务流程、独立的经营场所。本公司经营的业务与控股股东及其控制的其他企业之间不存在同业竞争关系，未受到本公司股东及其他关联方的干涉、控制，也未因与本公司股东及其他关联方

存在关联关系，而使得本公司经营自主权的独立性和完整性受到不良影响。

## 2. 人员独立

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

## 3. 资产独立

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

## 4. 机构独立

本公司以《公司法》等法律、法规以及《公司章程》相关规定为依据，以建立权责分明、管理科学、激励和约束相结合的现代企业制度为目标，完善了以股东大会、董事会、监事会为基础的公司治理结构，聘任了总经理、副总经理、财务总监、首席风险官、董事会秘书等人员在内的高级管理人员。并根据自身经营管理需要设置了各业务及职能部门，本公司拥有机构设置自主权，组织机构健全。且完全独立于控股股东，不存在与控股股东职能部门之间的从属关系。本公司经营办公场所与控股股东完全分离，不存在合署办公的情形。

## 5. 财务独立

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

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

### (三) 对重大内部管理制度的评价

公司依据《公司法》、《会计法》及《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《关于加强期货经纪公司内部控制的指导原则》等有关法律法规的规定，按照建立现代企业制度的要求，以全面性、

重要性、制衡性和成本效益为原则，制定了本公司内部控制管理制度。

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

报告期内，公司未发现上述管理制度存在重大缺陷。

#### **(四) 年度报告差错责任追究制度相关情况**

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

截止报告期末，公司未发生重大会计差错更正、重大遗漏信息等情况。

## 第十节 财务报告

### 一、 审计报告

是否审计	是
审计意见	无保留意见
审计报告中的特别段落	无
审计报告编号	天健审〔2018〕2084号
审计机构名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
审计机构地址	杭州市江干区钱江路1366号华润大厦B座
审计报告日期	2018年4月12日
注册会计师姓名	葛徐、宋慧娟
会计师事务所是否变更	否
会计师事务所连续服务年限	10
会计师事务所审计报酬	45万元
审计报告正文：	

## 审 计 报 告

天健审〔2018〕2084号

永安期货股份有限公司全体股东：

### 一、 审计意见

我们审计了永安期货股份有限公司（以下简称永安期货公司）财务报表，包括2017年12月31日的合并及母公司资产负债表，2017年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永安期货公司2017年12月31日的合并及母公司财务状况，以及2017年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

### 二、 形成审计意见的基础

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

### 三、关键审计事项

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

#### （一）手续费收入的确认

##### 1. 关键审计事项

永安期货公司手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询收入、代销基金收入及资产管理业务收入。如附注三（二十五）所述，期货经纪业务收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认；投资咨询、资产管理业务、基金代销收入在业务提供的相关服务已经完成，收到价款或取得收取款项的证据时确认收入。

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

##### 2. 审计中的应对

我们实施的审计程序主要包括：（1）了解和评价与手续费收入确认相关的关键内部控制的设计和运行有效性。（2）对于期货经纪业务收入，将公司记录的全年交易量与从中国期货业协会网站获取的交易数据进行核对，并在抽样的基础上将客户的佣金费率与相关客户服务合同进行核对。（3）对于投资咨询、基金代销收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同中的重要条款，将相关收入与对应协议条款核对，并评价相关收入确认是否符合协议约定及公司收入确认的会计政策。（4）对于资产管理业务收入，抽取样本将计提管理费和业绩报酬的费率与合同约定进行核对，并复算管理费和业绩报酬的计算过程。（5）就用于处理与手续费相关交易的关键信息技术系统，利用本所内部信息技术专家的工作，评价所选取的该系统内相关的信息技术应用控制的设计和运行有效性。

#### （二）结构化主体的合并

##### 1. 关键审计事项

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

由于确定是否应将结构化主体纳入公司的合并范围涉及重大的管理层判断，且合并的

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

## 2. 审计中的应对

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

## 四、其他信息

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

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

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

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

## 五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

永安期货公司治理层（以下简称治理层）负责监督永安期货公司的财务报告过程。

## 六、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

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

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

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

天健会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师：葛徐  
（项目合伙人）

中国·杭州 中国注册会计师：宋慧娟  
二〇一八年四月十二日

## 二、 财务报表

### （一） 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>流动资产：</b>			
货币资金	五（一）1	16,164,165,727.06	19,028,977,119.47
其中：期货保证金存款		14,801,097,903.82	17,877,009,692.48
应收货币保证金	五（一）2	9,615,496,632.61	8,971,772,982.30
应收质押保证金	五（一）3	284,486,362.00	387,035,648.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	五（一）4	31,586,974.11	57,291,850.58
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款	五（一）5	683,162.17	4,826,110.87
预付款项	五（一）6	110,094,354.67	110,851,275.23
应收结算担保金	五（一）7	25,513,887.40	25,482,868.49
应收风险损失款	五（一）8	66,201.51	120,244.77
应收佣金	五（一）9	3,994,945.13	6,241,118.09
应收利息	五（一）10	15,351,917.04	1,465,340.51
应收股利			
其他应收款	五（一）11	59,576,612.94	37,400,765.76
存货	五（一）12	909,621,858.05	478,212,721.87
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	五（一）13	260,718,376.25	128,232,278.81
<b>流动资产合计</b>		<b>27,481,357,010.94</b>	<b>29,237,910,324.75</b>

<b>非流动资产：</b>			
可供出售金融资产	五（一）14	2,151,163,825.45	1,562,575,403.24
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	五（一）15	294,320,282.20	140,586,734.48
期货会员资格投资	五（一）16	1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产	五（一）17	3,737,264.38	3,270,713.33
固定资产	五（一）18	108,288,008.05	121,877,408.71
在建工程	五（一）19	49,308,879.59	26,892,629.60
无形资产	五（一）20	252,293,380.97	256,133,151.87
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	五（一）21	14,008,820.25	17,647,075.05
递延所得税资产	五（一）22	70,363,144.12	29,288,750.35
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		2,944,883,605.01	2,159,671,866.63
<b>资产总计</b>		30,426,240,615.95	31,397,582,191.38
<b>流动负债：</b>			
短期借款	五（一）23	560,000,000.00	150,000,000.00
应付货币保证金	五（一）24	21,923,322,332.85	23,913,728,723.82
应付质押保证金	五（一）25	173,328,692.00	287,062,372.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	五（一）26	133,889,030.51	191,727,783.55
期货风险准备金	五（一）27	191,824,966.82	167,143,962.32
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款	五（一）28	27,142,702.05	
预收款项	五（一）29	163,464,424.95	129,854,002.35
应付期货投资者保障基金	五（一）30	535,879.52	1,169,255.40
应付手续费及佣金	五（一）31	1,500,959.27	2,038,374.47
应付职工薪酬	五（一）32	416,560,567.84	226,500,324.76
应交税费	五（一）33	154,699,274.81	126,175,030.60
应付利息	五（一）34	9,453,253.06	17,743,182.49
应付股利	五（一）35	196,500,000.00	
其他应付款	五（一）36	359,180,178.12	384,508,879.20
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债	五（一）37		115,271,007.24
<b>流动负债合计</b>		24,311,402,261.80	25,712,922,898.20
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券	五（一）38	430,000,000.00	600,000,000.00
其中：优先股			

永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
专项应付款			
预计负债	五（一）39	52,551,983.85	66,172,288.74
递延收益			
递延所得税负债	五（一）40	90,207,977.00	51,871,184.58
其他非流动负债	五（一）41		200,000,000.00
<b>非流动负债合计</b>		572,759,960.85	918,043,473.32
<b>负债合计</b>		24,884,162,222.65	26,630,966,371.52
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
股本	五（一）42	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	五（一）43	1,500,868,930.15	1,489,444,325.01
减：库存股			
其他综合收益	五（一）44	242,604,624.42	169,580,723.20
专项储备			
盈余公积	五（一）45	229,132,515.87	145,435,627.24
一般风险准备	五（一）46	289,023,529.80	205,326,641.17
未分配利润	五（一）47	1,970,448,793.06	1,446,813,813.42
归属于母公司所有者权益合计		5,542,078,393.30	4,766,601,130.04
少数股东权益			14,689.82
<b>所有者权益合计</b>		5,542,078,393.30	4,766,615,819.86
<b>负债和所有者权益总计</b>		30,426,240,615.95	31,397,582,191.38

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

## （二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>流动资产：</b>			
货币资金		14,502,200,675.46	16,599,990,622.15
其中：期货保证金存款		13,938,365,352.23	16,278,837,875.25
应收货币保证金		9,187,412,309.75	8,262,930,750.59
应收质押保证金		284,486,362.00	387,035,648.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			606,720.00
衍生金融资产			

应收票据			
应收账款			
预付款项			
应收结算担保金		25,513,887.40	25,482,868.49
应收风险损失款		66,201.51	120,244.77
应收佣金		4,249,564.80	6,241,118.09
应收利息		11,368,767.12	710,547.95
应收股利		162,836,003.69	
其他应收款		3,150,237.63	2,763,679.89
存货			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		19,613,742.92	17,472,800.43
<b>流动资产合计</b>		<b>24,200,897,752.28</b>	<b>25,303,355,000.36</b>
<b>非流动资产:</b>			
可供出售金融资产		1,914,873,375.60	1,362,285,054.93
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	十二(一)1	1,209,869,244.69	869,414,781.40
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产		3,737,264.38	3,270,713.33
固定资产		105,776,461.70	119,809,748.54
在建工程		49,308,879.59	26,892,629.60
无形资产		251,280,148.22	255,520,222.76
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		13,802,675.02	17,370,810.94
递延所得税资产		35,196,938.96	6,191,847.15
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		<b>3,585,244,988.16</b>	<b>2,662,155,808.65</b>
<b>资产总计</b>		<b>27,786,142,740.44</b>	<b>27,965,510,809.01</b>
<b>流动负债:</b>			
短期借款			
应付货币保证金		20,988,854,859.06	21,879,418,538.70
应付质押保证金		284,486,362.00	387,035,648.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
期货风险准备金		191,824,966.82	167,143,962.32
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款		216,465.47	
预收款项		646,196.66	3,669,916.43
应付期货投资者保障基金		535,879.52	1,169,255.40

应付手续费及佣金		1,500,959.27	2,038,374.47
应付职工薪酬		347,370,249.85	178,978,741.30
应交税费		84,934,465.62	51,465,993.63
应付利息		8,715,452.06	15,363,699.56
应付股利		196,500,000.00	
其他应付款		8,383,850.22	12,700,264.65
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
<b>流动负债合计</b>		<b>22,113,969,706.55</b>	<b>22,698,984,394.46</b>
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券		430,000,000.00	600,000,000.00
其中：优先股			
永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
专项应付款			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债		76,329,753.17	46,685,300.33
其他非流动负债			200,000,000.00
<b>非流动负债合计</b>		<b>506,329,753.17</b>	<b>846,685,300.33</b>
<b>负债合计</b>		<b>22,620,299,459.72</b>	<b>23,545,669,694.79</b>
<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		1,502,700,854.26	1,491,276,249.12
减：库存股			
其他综合收益		234,202,625.60	140,093,950.57
专项储备			
盈余公积		229,132,515.87	145,435,627.24
一般风险准备		289,023,529.80	205,326,641.17
未分配利润		1,600,783,755.19	1,127,708,646.12
<b>所有者权益合计</b>		<b>5,165,843,280.72</b>	<b>4,419,841,114.22</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>27,786,142,740.44</b>	<b>27,965,510,809.01</b>

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、营业总收入</b>		9,669,953,631.77	6,799,568,594.26
手续费及佣金净收入	五(二)1	593,347,524.35	585,732,176.34
其中：经纪业务手续费收入		528,451,063.95	521,502,727.70
资产管理业务收入		14,992,345.10	26,355,191.20
投资咨询业务收入		13,506,897.33	34,266,984.69
代理销售金融产品收入		36,397,217.97	3,607,272.75
其他代理业务收入			
利息净收入	五(二)2	524,237,811.89	496,322,853.52
投资收益(损失以“-”号填列)	五(二)3	904,981,185.99	344,791,879.61
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		205,968,886.40	74,357,527.46
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	五(二)4	43,153,642.03	-8,920,789.43
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-2,489,634.96	1,303,169.31
其他业务收入	五(二)5	7,602,061,761.67	5,380,339,304.91
其中：风险管理业务收入		0.00	0.00
资产处置收益(损失以“-”号填列)			
其他收益	五(二)6	4,661,340.80	0.00
<b>二、营业总成本</b>		8,480,427,384.65	5,944,087,088.62
提取期货风险准备金		24,751,281.94	23,607,674.51
税金及附加	五(二)7	5,375,318.24	12,630,468.68
业务及管理费	五(二)8	857,578,448.25	655,826,630.31
资产减值损失	五(二)9	267,007,450.49	37,707,552.90
其他业务成本	五(二)10	7,325,714,885.73	5,214,314,762.22
<b>三、营业利润(亏损以“-”号填列)</b>		1,189,526,247.12	855,481,505.64
加：营业外收入	五(二)11	2,349,116.97	12,692,151.29
减：营业外支出	五(二)12	79,690,691.25	73,977,761.87
<b>四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,112,184,672.84	794,195,895.06
减：所得税费用	五(二)13	224,655,915.94	183,009,293.11
<b>五、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		887,528,756.90	611,186,601.95
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			
2.终止经营净利润			
(二)按所有权归属分类：	-	-	-
1.少数股东损益			2,649,472.87

2. 归属于母公司所有者的净利润		887,528,756.90	608,537,129.08
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>	五(二)14	73,023,901.22	140,540,647.12
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		73,023,901.22	140,540,647.12
(一) 以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
(二) 以后将重分类进损益的其他综合收益		73,023,901.22	140,540,647.12
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		5,265,376.73	817,802.95
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		83,740,710.96	126,524,854.23
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额		-15,982,186.47	13,197,989.94
6. 其他			
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>		960,552,658.12	751,727,249.07
归属于母公司所有者的综合收益总额		960,552,658.12	749,077,776.20
归属于少数股东的综合收益总额			2,649,472.87
<b>八、每股收益：</b>			
(一) 基本每股收益		0.68	0.46
(二) 稀释每股收益		0.68	0.46

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

#### (四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、营业收入</b>		1,711,845,829.20	1,146,311,968.89
手续费及佣金净收入	十二(二)1	560,495,262.25	537,152,244.68
其中：经纪业务手续费收入		494,979,747.72	472,091,007.22
资产管理业务收入		15,722,414.41	29,988,066.98

投资咨询业务收入		13,395,882.15	31,465,897.73
代理销售金融产品收入		36,397,217.97	3,607,272.75
其他代理业务收入			
利息净收入		528,367,525.54	493,087,966.59
投资收益（损失以“-”号填列）	十二（二）2	610,756,723.11	109,666,302.89
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,731.00	-1,731.00
其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
其他业务收入		10,380,252.33	6,395,932.34
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		1,844,334.97	11,253.39
<b>二、营业成本</b>		708,064,402.36	549,045,555.48
提取期货风险准备金		24,751,281.94	23,607,674.51
税金及附加		4,119,807.17	12,550,084.14
业务及管理费		678,216,017.40	512,591,811.17
资产减值损失		847,160.31	268,663.99
其他业务成本		130,135.54	27,321.67
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		1,003,781,426.84	597,266,413.41
加：营业外收入		1,740,235.02	3,768,746.86
减：营业外支出		10,355,450.89	6,028,279.30
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		995,166,210.97	595,006,880.97
减：所得税费用		158,197,324.64	131,246,374.36
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		836,968,886.33	463,760,506.61
（一）持续经营净利润			
（二）终止经营净利润			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		94,108,675.03	112,968,624.66
（一）以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益		94,108,675.03	112,968,624.66
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		5,175,316.50	947,639.10

2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		88,933,358.53	112,020,985.56
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额			
6. 其他			
<b>七、综合收益总额</b>		931,077,561.36	576,729,131.27
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

#### （五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金		8,675,515,528.60	6,364,013,047.19
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额		505,218,443.23	175,579,020.28
收取利息、手续费及佣金的现金		1,227,513,256.41	1,161,866,349.98
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金	五（三）1	789,689,379.51	3,100,644,454.47
<b>经营活动现金流入小计</b>		11,197,936,607.75	10,802,102,871.92
购买商品、接受劳务支付的现金		9,172,096,612.14	6,597,797,191.01
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		26,202,674.60	11,237,244.17
以现金支付的业务及管理费		206,408,235.81	200,244,266.56
支付给职工以及为职工支付的现金		434,654,643.93	318,287,932.03
支付的各项税费		261,112,060.01	193,685,873.30
支付其他与经营活动有关的现金	五（三）2	3,551,611,505.95	25,865,775.98
<b>经营活动现金流出小计</b>		13,652,085,732.44	7,347,118,283.05
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		-2,454,149,124.69	3,454,984,588.87
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		997,250.00	49,002,406.72
取得投资收益收到的现金		337,071,325.80	9,737,740.25
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			

收到其他与投资活动有关的现金	五（三）3	35,803.91	642,502,913.08
<b>投资活动现金流入小计</b>		338,104,379.71	701,243,060.05
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		41,131,384.09	60,129,132.42
投资支付的现金		546,463,673.23	462,346,899.25
质押贷款净增加额			
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金	五（三）4	792,193,311.88	220,000,000.00
<b>投资活动现金流出小计</b>		1,379,788,369.20	742,476,031.67
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-1,041,683,989.49	-41,232,971.62
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			208,943,140.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		930,000,000.00	365,271,007.24
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	五（三）5		200,000,000.00
<b>筹资活动现金流入小计</b>		930,000,000.00	774,214,147.24
偿还债务支付的现金		805,271,007.24	230,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		73,230,694.80	41,719,595.81
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	五（三）6	268,512,094.38	206,485,793.48
<b>筹资活动现金流出小计</b>		1,147,013,796.42	478,205,389.29
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-217,013,796.42	296,008,757.95
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-15,917,708.54	14,489,905.86
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-3,728,764,619.14	3,724,250,281.06
加：期初现金及现金等价物余额		18,722,837,619.47	14,998,587,338.41
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		14,994,073,000.33	18,722,837,619.47

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

#### （六） 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置以公允价值计量且其变动计入当		570,543.09	2,074,164.97

期损益的金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,172,001,213.47	1,100,613,494.21
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		589,203,568.38	2,299,232,580.66
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>1,761,775,324.94</b>	<b>3,401,920,239.84</b>
购买商品、接受劳务支付的现金			
客户贷款及垫款净增加额			
以现金支付的业务及管理费		131,214,358.94	129,010,551.19
支付给职工以及为职工支付的现金		350,794,708.19	268,033,305.06
支付的各项税费		187,385,323.82	157,100,956.21
支付其他与经营活动有关的现金		2,435,310,162.88	21,365,211.02
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>3,104,704,553.83</b>	<b>575,510,023.48</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>-1,342,929,228.89</b>	<b>2,826,410,216.36</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		322,681,562.66	7,589,514.22
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
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		35,803.91	2,886,914.18
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>322,717,366.57</b>	<b>10,476,428.40</b>
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		33,768,180.28	58,318,608.53
投资支付的现金		632,587,986.28	810,663,943.40
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		200,000,000.00	220,000,000.00
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>866,356,166.56</b>	<b>1,088,982,551.93</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-543,638,799.99</b>	<b>-1,078,506,123.53</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金			200,000,000.00
<b>筹资活动现金流入小计</b>			<b>200,000,000.00</b>
偿还债务支付的现金		170,000,000.00	
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		41,221,917.81	32,104,200.00
支付其他与筹资活动有关的现金		200,000,000.00	
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>411,221,917.81</b>	<b>32,104,200.00</b>
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-411,221,917.81</b>	<b>167,895,800.00</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的</b>			

影响			
五、现金及现金等价物净增加额		-2,297,789,946.69	1,915,799,892.83
加：期初现金及现金等价物余额		16,299,990,622.15	14,384,190,729.32
六、期末现金及现金等价物余额		14,002,200,675.46	16,299,990,622.15

(七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	本期												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
优先股		永续债	其他										
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,489,444,325.01		169,580,723.20		145,435,627.24	205,326,641.17	1,446,813,813.42	14,689.82	4,766,615,819.86
加：会计政策变更													
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,489,444,325.01		169,580,723.20		145,435,627.24	205,326,641.17	1,446,813,813.42	14,689.82	4,766,615,819.86
三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列)					11,424,605.14		73,023,901.22		83,696,888.63	83,696,888.63	523,634,979.64	-14,689.82	775,462,573.44
(一)综合收益总额							73,023,901.22				887,528,756.90		960,552,658.12
(二)所有者投入和减少资本												-14,689.82	-14,689.82

1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他											-14,689.82	-14,689.82
(三) 利润分配							83,696,888.63	83,696,888.63	-363,893,777.26			-196,500,000.00
1. 提取盈余公积							83,696,888.63		-83,696,888.63			
2. 提取一般风险准备								83,696,888.63	-83,696,888.63			
3. 对所有者（或股东）的分配									-196,500,000.00			-196,500,000.00
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												

2. 本期使用											
(六) 其他				11,424,605.14							11,424,605.14
<b>四、本期末余额</b>	1,310,000,000.00			1,500,868,930.15		242,604,624.42		229,132,515.87	289,023,529.80	1,970,448,793.06	5,542,078,393.30

项目	上期												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
优先股		永续债	其他										
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		29,040,076.08		99,059,576.58	158,950,590.51	931,028,785.66	174,428,690.79	4,193,783,968.74
加：会计政策变更												-130,282,242.43	-130,282,242.43
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年初余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		29,040,076.08		99,059,576.58	158,950,590.51	931,028,785.66	44,146,448.36	4,063,501,726.31
三、本期增					-1,831,924.11		140,540,647.12		46,376,050.66	46,376,050.66	515,785,027.76	-44,131,758.54	703,114,093.55

减变动金额 (减少以 “-”号填 列)												
(一)综合收 益总额						140,540,647.12				608,537,129.08	2,649,472.87	751,727,249.07
(二)所有者 投入和减少 资本				-1,831,924.11							-46,795,918.74	-48,627,842.85
1. 股东投入 的普通股												
2. 其他权益 工具持有者 投入资本												
3. 股份支付 计入所有者 权益的金额												
4. 其他				-1,831,924.11							-46,795,918.74	-48,627,842.85
(三)利润分 配							46,376,050.66	46,376,050.66	-92,752,101.32			
1. 提取盈余 公积							46,376,050.66		-46,376,050.66			
2. 提取一般 风险准备								46,376,050.66	-46,376,050.66			
3. 对所有 者(或股 东)的												

分配												
4. 其他												
(四)所有者 权益内部结 转												
1. 资本公积 转增资本(或 股本)												
2. 盈余公积 转增资本(或 股本)												
3. 盈余公积 弥补亏损												
4. 其他												
(五)专项储 备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六)其他											14,687.33	14,687.33
<b>四、本年期 末余额</b>	1,310,000,000.00			1,489,444,325.01		169,580,723.20		145,435,627.24	205,326,641.17	1,446,813,813.42	14,689.82	4,766,615,819.86

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：叶元祖

会计机构负责人：罗利周

## (八) 母公司股东权益变动表

单位：元

项目	本期											
	股本	其他权益工具			资本公积	减： 库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		140,093,950.57		145,435,627.24	205,326,641.17	1,127,708,646.12	4,419,841,114.22
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		140,093,950.57		145,435,627.24	205,326,641.17	1,127,708,646.12	4,419,841,114.22
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）					11,424,605.14		94,108,675.03		83,696,888.63	83,696,888.63	473,075,109.07	746,002,166.50
（一）综合收益总额							94,108,675.03				836,968,886.33	931,077,561.36
（二）所有者投入和减少资本												
1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
（三）利润分配									83,696,888.63	83,696,888.63	-363,893,777.26	-196,500,000.00
1. 提取盈余公积									83,696,888.63		-83,696,888.63	

2. 提取一般风险准备									83,696,888.63	-83,696,888.63	
3. 对所有者（或股东）的分配										-196,500,000.00	-196,500,000.00
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 其他											
（五）专项储备											
1. 本期提取											
2. 本期使用											
（六）其他					11,424,605.14						11,424,605.14
<b>四、本年期末余额</b>	1,310,000,000.00				1,502,700,854.26	234,202,625.60		229,132,515.87	289,023,529.80	1,600,783,755.19	5,165,843,280.72

项目	上期											
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		27,125,325.91		99,059,576.58	158,950,590.51	756,700,240.83	3,843,111,982.95
加：会计政策变更												

前期差错更正											
其他											
<b>二、本年期初余额</b>	1,310,000,000.00			1,491,276,249.12		27,125,325.91		99,059,576.58	158,950,590.51	756,700,240.83	3,843,111,982.95
<b>三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）</b>						112,968,624.66		46,376,050.66	46,376,050.66	371,008,405.29	576,729,131.27
（一）综合收益总额						112,968,624.66				463,760,506.61	576,729,131.27
（二）所有者投入和减少资本											
1. 股东投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
（三）利润分配								46,376,050.66	46,376,050.66	-92,752,101.32	
1. 提取盈余公积								46,376,050.66		-46,376,050.66	
2. 提取一般风险准备									46,376,050.66	-46,376,050.66	
3. 对所有者（或股东）的分配											
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											

3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
<b>四、本年期末余额</b>	1,310,000,000.00				1,491,276,249.12		140,093,950.57		145,435,627.24	205,326,641.17	1,127,708,646.12	4,419,841,114.22

# 永安期货股份有限公司

## 财务报表附注

2017 年度

金额单位：人民币元

### 一、公司基本情况

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

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

本公司下设35家营业部及5家分公司,分别位于北京、天津、上海、重庆、浙江、山东、辽宁、江苏、福建、湖北、湖南、江西、吉林、广东、四川、河北、河南等地。本公司拥有控股子公司8家,分别为中国新永安期货有限公司(以下简称新永安期货公司)、浙江永安资本管理有限公司(以下简称永安资本公司)、浙江中邦实业发展有限公司(以下简称中邦实业公司)、上海瑞萌商贸有限公司(以下简称上海瑞萌公司)、香港永安商贸有限公司(以下简称永安商贸公司)、永安(新加坡)国际贸易有限公司(以下简称永安新加坡公司)、中国新永安实业有限公司(以下简称新永安实业公司)和新永安国际金融控股有限公司(以下简称新永安控股公司)。

本财务报表业经公司2018年4月12日第二届第十三次董事会批准对外报出。

### 二、财务报表的编制基础

#### (一) 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

#### (二) 持续经营能力评价

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

### 三、重要会计政策、会计估计

#### (一) 遵循企业会计准则的声明

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

#### (二) 会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### (三) 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

### (四) 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

#### 1. 同一控制下企业合并的会计处理方法

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

#### 2. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

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

### (五) 合并财务报表的编制方法

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

### (六) 现金及现金等价物的确定标准

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

### (七) 外币业务和外币报表折算

#### 1. 外币业务折算

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

#### 2. 外币财务报表折算

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

入其他综合收益。

## (八) 金融工具

### 1. 金融资产和金融负债的分类

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

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

### 2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

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

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

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

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

入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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

### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

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

### 4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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

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

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

### 5. 金融资产的减值测试和减值准备计提方法

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

(2) 对于持有至到期投资、贷款和应收款，先将单项金额重大的金融资产区分开来，单独进行减值测试；对单项金额不重大的金融资产，可以单独进行减值测试，或包括在具有类

似信用风险特征的金融资产组合中进行减值测试；单独测试未发生减值的金融资产（包括单项金额重大和不重大的金融资产），包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。测试结果表明其发生了减值的，根据其账面价值高于预计未来现金流量现值的差额确认减值损失。

### (3) 可供出售金融资产

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

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

## (九) 应收款项

### 1. 单项金额重大并单项计提坏账准备的应收款项

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

### 2. 按组合计提坏账准备的应收款项

#### (1) 确定组合的依据及坏账准备的计提方法

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

#### (2) 账龄分析法

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

### 3. 单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收款项

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

测试未发生减值的，按组合计提坏账准备

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

#### (十) 存货

##### 1. 存货的分类

本公司持有存货系为期货交易而持有以备出售的商品。

##### 2. 发出存货的计价方法

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

##### 3. 存货可变现净值的确定依据及存货跌价准备的计提方法

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

##### 4. 存货的盘存制度为永续盘存制。

#### (十一) 营业部的资金管理、交易清算原则

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

#### (十二) 客户保证金的管理与核算方法

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

#### (十三) 质押品的管理与核算方法

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

#### (十四) 代理实物交割的管理与核算方法

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

#### (十五) 客户资产管理业务核算方法

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

#### (十六) 长期股权投资

### 1. 共同控制、重要影响的判断

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

### 2. 投资成本的确定

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 后续计量及损益确认方法

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

#### 4. 减值测试方法及减值准备计提方法

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

#### 4. 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

##### (1) 个别财务报表

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

##### (2) 合并财务报表

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

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

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

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

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

### (十七) 投资性房地产

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

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

### (十八) 固定资产

#### 1. 固定资产的确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会

计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

## 2. 各类固定资产的折旧方法

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

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

### (十九) 在建工程

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

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

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

### (二十) 无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。

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

项 目	摊销年限(年)
软 件	3
土地使用权	40

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

### (二十一) 长期待摊费用

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

### (二十二) 期货风险准备金提取和使用核算方法

1. 期货风险准备金按代理手续费净收入的5%计提，计入当期损益。

## 2. 风险损失的确认标准为:

- (1) 因管理不严、错单交易等造成的应由期货经纪公司承担的客户交易损失;
- (2) 确认的坏账损失。

风险准备金不足以弥补的损失计入当期损益。

## (二十三) 预计负债

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

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

## (二十四) 期货投资者保障基金确认和计量

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

## (二十五) 收入

### 1. 提供劳务

提供劳务交易的结果在资产负债表日能够可靠估计的(同时满足收入的金额能够可靠地计量、相关经济利益很可能流入、交易的完工进度能够可靠地确定、交易中已发生和将发生的成本能够可靠地计量),确认提供劳务的收入。

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

### 2. 让渡资产使用权

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

### 3. 销售商品

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

## (二十六) 政府补助

### 1. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助,冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关补助确认为递延收益的,在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助,直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报

废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

## 2. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

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

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

## (二十七) 递延所得税资产、递延所得税负债

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

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

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

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

## (二十八) 一般风险准备的提取和使用核算方法

1. 一般风险准备按照当期实现净利润的 10%提取。

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

## (二十九) 重要会计政策变更说明

1. 本公司自 2017 年 5 月 28 日起执行财政部制定的《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》，自 2017 年 6 月 12 日起执行经修订的《企业会计准则第 16 号——政府补助》。本次会计政策变更采用未来适用法处理。

2. 本公司编制 2017 年度报表执行《财政部关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》（财会〔2017〕30 号），将原列报于“营业外收入”和“营业外支出”的非流动资产处置利得和损失和非货币性资产交换利得和损失变更为列报于“资产处置收益”。此项会计政策变更采用追溯调整法。由于上期不存在该项会计政策变更所涉及的交易事项，故本次变更对 2017 年度财务报表的可比数据无影响。

#### 四、税（费）项

##### 主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	销售货物或提供应税劳务	17%、13%、11%、6%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加	应缴流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	16.5%、17%、25%

##### 不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

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

#### 五、合并财务报表项目注释

说明：本财务报表附注的期初数指 2017 年 1 月 1 日财务报表数，期末数指 2017 年 12 月 31 日财务报表数，本期指 2017 年 1 月 1 日—2017 年 12 月 31 日，上年同期指 2016 年 1 月 1 日—2016 年 12 月 31 日。母公司同。

##### （一）合并资产负债表项目注释

##### 1. 货币资金

##### （1）明细情况

项 目	期 末 数	期 初 数
库存现金	10,292.55	24,846.11
自有银行存款	1,261,296,958.69	1,136,369,313.69
期货保证金账户存款	14,801,097,903.82	17,877,009,692.48
其他货币资金	101,760,572.00	15,573,267.19
合 计	16,164,165,727.06	19,028,977,119.47

##### （2）抵押、冻结等对使用有限制或有潜在回收风险款项的说明

期末，其他货币资金中的远期结售汇保证金 1,855,008.99 元、信用证保证金

23,044,405.86 元、保函保证金 3,000,000.00 元及借款质押保证金 50,000,000.00 元均使用受限。

(3) 货币资金——期货保证金

银行名称	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
工商银行	EUR 6,934,070.51	7.8023	54,101,698.34			
工商银行	HKD 1,411,422.90	0.8359	1,179,808.40	HKD 1,555,330.76	0.8945	1,391,243.36
工商银行	JPY 1.00	0.0579	0.06	JPY 1.00	0.0596	0.06
工商银行	USD 7,494,841.10	6.5342	48,972,790.72	USD 35,390,313.97	6.9370	245,502,608.01
工商银行	RMB 409,432,230.21	1.0000	409,432,230.21	RMB 761,016,255.71	1.0000	761,016,255.71
光大银行	RMB 4,948,470.03	1.0000	4,948,470.03	RMB 3,375,471.51	1.0000	3,375,471.51
建设银行	RMB 43,813,888.46	1.0000	43,813,888.46	RMB 68,036,769.77	1.0000	68,036,769.77
交通银行	AUD 26,149.49	5.0928	133,174.12	AUD 26,135.52	5.0157	131,087.93
交通银行	EUR 346,439.19	7.8023	2,703,022.49	EUR 359,360.79	7.3068	2,625,777.42
交通银行	HKD 20,732,471.02	0.8359	17,330,272.53	HKD 896,212.03	0.8945	801,661.66
交通银行	JPY 75,733,756.00	0.0579	4,384,984.47	JPY 35,783,130.00	0.0596	2,132,674.55
交通银行	RMB 7,632,118,529.45	1.0000	7,632,118,529.45	RMB 8,079,535,931.93	1.0000	8,079,535,931.93
交通银行	USD 28,486,894.93	6.5342	186,139,068.85	USD 107,730,665.11	6.9370	747,327,623.87
交通银行	GBP 146,536.76	8.7792	1,286,475.52	GBP 946,533.57	8.5094	8,054,432.76
民生银行	RMB 912,447,496.12	1.0000	912,447,496.12	RMB 3,282,014.93	1.0000	3,282,014.93
民生银行	HKD 106,599,220.22	0.8359	89,106,288.18	HKD 53,105,355.52	0.8945	47,502,740.51
民生银行	USD 58,843,653.05	6.5342	384,496,197.76	USD 69,148,336.06	6.9370	479,682,007.25
农业银行	RMB 31,814,277.76	1.0000	31,814,277.76	RMB 33,232,878.03	1.0000	33,232,878.03
浦发银行	RMB 2,802,385,122.36	1.0000	2,802,385,122.36	RMB 1,751,947,628.93	1.0000	1,751,947,628.93
兴业银行	RMB 1,100,570,685.85	1.0000	1,100,570,685.85	RMB 203,864,556.17	1.0000	203,864,556.17
渣打银行	HKD 648,959.40	0.8359	542,465.16	HKD 482,462.99	0.8945	431,563.14
渣打银行	USD 1,756,036.34	6.5342	11,474,292.65	USD 335,489.12	6.9370	2,327,288.03
招商银行	RMB 5,373,191.33	1.0000	5,373,191.33	RMB 2,089,974.16	1.0000	2,089,974.16
招商银行	HKD 4,356,527.03	0.8359	3,641,620.94	HKD 107,911.66	0.8945	96,526.98
招商银行	USD 1,307,943.00	6.5342	8,546,361.15	USD 3,071,835.51	6.9370	21,309,322.93

中国银行	HKD	11,572,552.07	0.8359	9,673,496.28	HKD	8,906,364.46	0.8945	7,966,743.01
中国银行	USD	154,964.19	6.5342	1,012,567.01	USD	3,374,177.85	6.9370	23,406,671.75
中国银行	RMB	50,349,352.94	1.0000	50,349,352.94	RMB	45,389,714.97	1.0000	45,389,714.97
中信银行	RMB	914,982,111.52	1.0000	914,982,111.52	RMB	5,327,623,631.03	1.0000	5,327,623,631.03
平安银行	RMB	68,137,963.16	1.0000	68,137,963.16	RMB	6,924,892.12	1.0000	6,924,892.12
小计				14,801,097,903.82				17,877,009,692.48

(4) 货币资金——外币货币资金

项 目	期末数		
	原币及金额	汇率	折人民币金额
库存现金	HKD 7,790.30	0.8359	6,511.91
自有银行存款	USD 27,775,168.43	6.5342	181,488,505.56
自有银行存款	HKD 60,504,626.29	0.8359	50,575,817.12
自有银行存款	SGD 28,877.67	4.8831	141,012.55
期货保证金	USD 98,044,332.61	6.5342	640,641,278.14
期货保证金	AUD 26,149.49	5.0928	133,174.12
期货保证金	EUR 7,280,509.70	7.8023	56,804,720.83
期货保证金	GBP 146,536.76	8.7792	1,286,475.52
期货保证金	HKD 145,321,152.64	0.8359	121,473,951.49
期货保证金	JPY 75,733,757.00	0.0579	4,384,984.53
其他货币资金	HKD 3,174.33	0.8359	2,653.42
小 计			1,056,939,085.19

2. 应收货币保证金

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,589,246,087.80	2,015,153,817.88
大连商品交易所	2,607,052,607.38	2,579,904,078.57
郑州商品交易所	982,218,293.26	811,773,407.50
中国金融期货交易所	1,720,181,399.44	2,605,854,929.62
中国证券登记结算有限责任公司	288,713,921.87	250,244,517.02
MAREX FINANCIAL Ltd. [注]	81,980,298.03	311,952,536.75

Newedge Australia Pty Ltd. [注]		76,380.33
R. J. O'Brien & Associates[注]	22,921,722.75	25,925,946.52
香港期货交易所	136,266,376.08	78,625,304.23
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED [注]	97,235,261.10	195,268,764.76
Etrade Korea Col., Ltd[注]		678,400.75
KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd[注]	15,813.96	19,549,010.52
辉立期货私人有限公司[注]		76,749,088.72
Rakuten Securities. Inc[注]	20,025,715.00	16,799.13
Philip Futures Pte Ltd [注]	69,473,652.41	
Hyundai Futures Corporaiong [注]	165,483.53	
合 计	9,615,496,632.61	8,971,772,982.30

注：该部分应收货币保证金系本公司的境外子公司存放于境外期货经纪商的保证金。

(2) 其他说明

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

公司名称	持仓保证金	期货合约浮动盈亏
永安资本公司	295,368,961.22	34,554,390.00
上海瑞萌公司	35,323,611.25	9,627,735.00
新永安实业公司	2,001,557.60	-25,694.19
永安商贸公司	706,732.54	-467,254.11
永安新加坡公司	254,052.48	-267,875.08
成长 1 号资产管理计划(以下简称成长 1 号)	258,713.10	-9,125.00
成长 2 号资产管理计划(以下简称成长 2 号)	81,517.50	-8,550.00
成长 5 号资产管理计划(以下简称成长 5 号)	753,228.00	-67,462.86
成长 6 号资产管理计划(以下简称成长 6 号)	83,496.00	-1,500.00
七禾言起 2 号资产管理计划(以下简称七禾言起 2 号)	5,952,235.60	196,370.00
永利 1 号资产管理计划(以下简称永利 1 号)	3,024,090.00	248,783.33
永安瑞意(多策略)一号资产管理计划(以下简称瑞意	3,441,718.90	-118,558.15

多策略 1 号)		
小 计	347,249,914.19	43,661,258.94

### 3. 应收质押保证金

#### (1) 明细情况

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	152,950,272.00	320,162,648.00
大连商品交易所	37,990,000.00	
郑州商品交易所	93,546,090.00	66,873,000.00
合 计	284,486,362.00	387,035,648.00

#### (2) 质押物明细情况

质押物类别	质押时市值	折扣率	期末市值
白银	18,914,976.00	80.00%	23,145,840.00
沥青	6,848,800.00	80.00%	8,463,000.00
铝	57,337,900.00	80.00%	73,973,500.00
橡胶	68,294,480.00	80.00%	85,605,500.00
白糖	43,606,520.00	75.00%	43,606,520.00
锰硅	65,738,400.00	75.00%	65,738,400.00
棉花一号	15,383,200.00	75.00%	15,383,200.00
聚丙烯	4,430,379.75	79.00%	4,430,379.75
聚氯乙烯	19,645,569.62	79.00%	19,645,569.62
聚乙烯	24,012,658.23	79.00%	24,012,658.23
合 计	324,212,883.60		364,004,567.60

#### (3) 其他说明

期末余额中包括子公司永安资本公司质押保证金 103,041,204.87 元，子公司上海瑞萌公司质押保证金 8,169,120.00 元。

### 4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

#### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
股 票	17,956,661.00	34,217,392.08

债券	3,200,000.00	1,400,000.00
基金	10,037,059.00	20,703,622.50
期货、场外合约浮盈	45,430.00	970,836.00
其他(期权)	347,824.11	
合计	31,586,974.11	57,291,850.58

(2) 股票、基金和债券期末投资情况

项目	投资成本	公允价值	累计的净利得或净损失
股票	17,794,838.84	17,956,661.00	161,822.16
债券	3,200,000.00	3,200,000.00	
基金	10,097,205.72	10,037,059.00	-60,146.72
期货、场外合约浮盈		45,430.00	45,430.00
其他(期权)		347,824.11	347,824.11
小计	31,092,044.56	31,586,974.11	494,929.55

5. 应收账款

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	719,118.07	100.00	35,955.90	5.00	683,162.17
合计	719,118.07	100.00	35,955.90	5.00	683,162.17

(续上表)

种类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	5,243,690.60	100.00	417,579.73	7.96	4,826,110.87
合计	5,243,690.60	100.00	417,579.73	7.96	4,826,110.87

2) 组合中, 采用账龄分析法计提坏账准备的应收账款

账龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	计提比例(%)

1 年以内	719,118.07	100.00	35,955.90	5
小 计	719,118.07	100.00	35,955.90	

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	4,207,722.65	80.24	210,386.14	5
1-2 年	1,035,967.95	19.76	207,193.59	20
小 计	5,243,690.60	100.00	417,579.73	

(2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期转回坏账准备 381,623.83 元。

(3) 期末无关联方应收账款。

## 6. 预付款项

### (1) 账龄分析

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

(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	110,851,275.23	100.00		110,851,275.23
1-2 年				
合 计	110,851,275.23	100.00		110,851,275.23

(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 (%)
天津物产国际贸易有限公司	20,320,000.00	18.46
中建材供应链管理有限公司	16,415,373.53	14.91
北京全国棉花交易市场集团有限公司	12,080,710.80	10.97
GLENCORE INTERNATIONAL AG	7,768,010.07	7.06
Thai Hua Rubber Public coltd	7,478,693.87	6.79

小 计	64,062,788.27	58.19
-----	---------------	-------

#### 7. 应收结算担保金

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	20,113,887.40	20,000,000.00
中国证券登记结算有限责任公司	5,400,000.00	5,482,868.49
合 计	25,513,887.40	25,482,868.49

#### 8. 应收风险损失款

##### (1) 账龄分析

账 龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	17,004.09	25.69		17,004.09	46,088.31	38.32		46,088.31
1-2 年	45,318.40	68.46		45,318.40	3,879.02	3.23		3,879.02
2-3 年	3,879.02	5.86		3,879.02	70,277.44	58.45		70,277.44
合 计	66,201.51	100.00		66,201.51	120,244.77	100.00		120,244.77

##### (2) 应收风险损失款金额前 5 名情况

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

#### 9. 应收佣金

##### (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	2,963,925.35	65.12	148,196.27	2,815,729.08
1-2 年	676,923.10	14.87	135,384.62	541,538.48
2-3 年	910,967.96	20.01	273,290.39	637,677.57

合计	4,551,816.41	100.00	556,871.28	3,994,945.13
----	--------------	--------	------------	--------------

(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	5,697,203.93	84.61	284,860.20	5,412,343.73
1-2年	1,035,967.95	15.39	207,193.59	828,774.36
合计	6,733,171.88	100.00	492,053.79	6,241,118.09

(2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 64,817.49 元。

(3) 期末无应收关联方佣金。

## 10. 应收利息

(1) 账龄分析

账龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	14,640,951.84	95.37		14,640,951.84
1-2年	710,965.20	4.63		710,965.20
合计	15,351,917.04	100.00		15,351,917.04

(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	1,465,340.51	100.00		1,465,340.51
1-2年				
合计	1,465,340.51	100.00		1,465,340.51

(2) 应收利息金额前 5 名情况

单位名称	欠款金额
北京银行杭州分行营业部	6,077,808.22
OSTC Yongan Trading Co., Limited	1,953,759.65
中国银行杭州市高新技术开发区支行营业部	1,853,150.68
中国民生银行香港分行	1,753,575.45
华夏银行杭州新华支行	1,723,835.62
小计	13,362,129.62

(3) 应收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄
-------	-----	-----	----

OSTC Yongan Trading Co., Limited	1,953,759.65	754,792.56	2年以内
小计	1,953,759.65	754,792.56	

11. 其他应收款

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

(续上表)

种类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项计提坏账准备的其他应收款	2,000,000.00	4.45	2,000,000.00	100	
按组合计提坏账准备的其他应收款	42,948,017.67	95.55	5,547,251.91	12.92	37,400,765.76
合计	44,948,017.67	100	7,547,251.91	16.79	37,400,765.76

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

(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	28,437,505.50	66.21	1,421,773.67	27,015,731.83
1-2年	12,057,666.79	28.08	2,411,533.35	9,646,133.44
2-3年	106,429.91	0.25	31,928.98	74,500.93

3-4 年	1,107,332.59	2.58	442,933.03	664,399.56
4 年以上	1,239,082.88	2.89	1,239,082.88	0
合 计	42,948,017.67	100	5,547,251.91	37,400,765.76

(3) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 4,004,981.69 元。

(4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	欠款金额	款项性质
OSTC Yongan Trading Co., Limited	16,195,015.03	往来款
广西糖网食糖批发市场有限责任公司	2,952,400.12	保证金
武汉中润融盛资产管理中心（有限合伙）	2,000,000.00	存出投资款
深圳市昆商易糖供应链有限公司	1,521,617.01	保证金
无锡市不锈钢电子交易中心有限公司	1,036,418.10	保证金
小 计	23,705,450.26	

(5) 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	16,195,015.03	19,878,219.43	3 年以内	往来款
小 计	16,195,015.03	19,878,219.43		

(6) 期末单项计提坏账准备款项说明

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

## 12. 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	994,494,870.17	84,873,012.12	909,621,858.05
合 计	994,494,870.17	84,873,012.12	909,621,858.05

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	489,936,305.36	11,723,583.49	478,212,721.87

合 计	489,936,305.36	11,723,583.49	478,212,721.87
-----	----------------	---------------	----------------

(2) 期末存货账面余额中 111,210,324.87 元用于质押。

(3) 存货跌价准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少		期末数
			转 回	转 销	
库存商品	11,723,583.49	281,305,014.02	17,987,617.33	190,167,968.06	84,873,012.12
小 计	11,723,583.49	281,305,014.02	17,987,617.33	190,167,968.06	84,873,012.12

### 13. 其他流动资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	156,842,296.25	104,535,827.01
其他流动资产[注]	87,338,744.09	14,103,745.02
待摊费用	16,537,335.91	9,592,706.78
合 计	260,718,376.25	128,232,278.81

注 2：2017 年 12 月，中远海运物流仓储配送有限公司青岛物流中心南泉库存放点发生火灾，存放货物全损。事发时，公司存放于该仓库的存货账面价值 25,063,820.23 元，对应进项税 4,938,480.29 元，合计 30,002,300.52 元。公司对该批存货予以核销，同时将预计的可赔付金额 10,242,172.71 元记入其他流动资产，将估计损失 19,760,127.81 元记入营业外支出。

### 14. 可供出售金融资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
理财产品	2,123,123,825.45	1,530,577,603.24
信托产品		5,997,800.00
其 他	28,040,000.00	26,000,000.00
合 计	2,151,163,825.45	1,562,575,403.24

(2) 期末按公允价值计量的可供出售金额资产

可供出售金融资产分类	理财产品	小 计
权益工具的成本/债务工具的摊余成本	1,807,086,031.38	1,807,086,031.38
公允价值	2,123,123,825.45	2,123,123,825.45
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	316,037,794.07	316,037,794.07

已计提减值金额		
---------	--	--

(3) 期末按成本计量的可供出售金融资产

被投资单位	账面余额			
	期初数	本期增加	本期减少	期末数
浙江银杏云股权投资基金合伙企业(有限合伙)	10,000,000.00		960,000.00	9,040,000.00
证通股份有限公司	15,000,000.00			15,000,000.00
阳富教育咨询服务(深圳)有限公司	1,000,000.00			1,000,000.00
杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业(有限合伙)		3,000,000.00		3,000,000.00
小计	26,000,000.00	3,000,000.00	960,000.00	28,040,000.00

(续上表)

被投资单位	减值准备				在被投资单位持股比例(%)	本期现金红利
	期初数	本期增加	本期减少	期末数		
浙江银杏云股权投资基金合伙企业(有限合伙)					10.00	37,250.00
证通股份有限公司					1.22	
阳富教育咨询服务(深圳)有限公司					10.00	
杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业(有限合伙)					3.00	
小计						37,250.00

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	294,320,282.20		294,320,282.20
合计	294,320,282.20		294,320,282.20

(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	140,586,734.48		140,586,734.48
合计	140,586,734.48		140,586,734.48

(2) 对联营企业投资

被投资	期初数	本期增减变动
-----	-----	--------

单位		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司（以下简称玉皇山南公司）	16,616,415.42			-1,599,775.72	
永安国富资产管理有限公司（以下简称永安国富公司）[注1]	123,929,179.21	17,689,000.00		209,439,510.15	5,175,316.50
OSTC Yongan Trading Co., Limited[注2]					
杭州双联公司[注3]	41,139.85				
合计	140,586,734.48	17,689,000.00		207,839,734.43	5,175,316.50

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司（以下简称玉皇山南公司）					15,016,639.70	
永安国富资产管理有限公司（以下简称永安国富公司）[注1]	11,424,605.14	88,353,968.50			279,303,642.50	
OSTC Yongan Trading Co., Limited[注2]						
杭州双联公司 [注3]				-41,139.85		
合计	11,424,605.14	88,353,968.50		-41,139.85	294,320,282.20	

注1：根据永安国富第一届董事会第十一次会议通过的《永安国富资产管理有限公司增资扩股实施方案》，本公司和杭州小牛投资合伙企业（有限合伙）分别对其追加投资1,768.90万元及26,161.10万元。本次增资后，公司对永安国富的持股比例由49%下降为33%，按变更后的持股比例计算的应享有永安国富净资产与原账面价值及新增投资成本的差额11,424,605.14元计入其他资本公积。

注2：OSTC Yongan Trading Co., Limited为永安商贸公司持股49.00%的联营企业，本期应对其确认投资收益-1,870,848.03元，其他综合收益90,060.23元，由于长期股权投资账面价值已经冲减至零，故上述-1,780,787.80元冲减其他应收款。

注3：杭州双联公司已于2015年进入清算期，本期已注销。

## 16. 期货会员资格投资

### (1) 明细情况

项目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值

期货会员资格投资	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00
合 计	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00

## 17. 投资性房地产

### (1) 明细情况

项 目	房屋及建筑物	合 计
账面原值		
期初数	3,380,000.00	3,380,000.00
本期增加金额	773,902.54	773,902.54
本期减少金额		
期末数	4,153,902.54	4,153,902.54
累计折旧和累计摊销		
期初数	109,286.67	109,286.67
本期增加金额	307,351.49	307,351.49
本期减少金额		
期末数	416,638.16	416,638.16
账面价值		
期末账面价值	3,737,264.38	3,737,264.38
期初账面价值	3,270,713.33	3,270,713.33

(2) 期末无投资性房地产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的投资性房地产的情况说明如下：

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
福州中盛大厦 701 号房屋	3,161,426.69	尚未办妥房产证及土地使用权证
沈阳财富中心 23-5(部分)、 23-6(部分)	575,837.69	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小 计	3,737,264.38	

## 18. 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	115,483,022.50	65,126,333.79	20,943,351.50	201,552,707.79
本期增加金额[注]	-5,473,401.30	5,582,353.79	1,370,940.17	1,479,892.66

购置	-5,473,401.30	5,582,353.79	1,370,940.17	1,479,892.66
本期减少金额	773,902.54	2,542,989.78	94,492.00	3,411,384.32
处置或报废		2,542,989.78	94,492.00	2,637,481.78
转入投资性房地产	773,902.54			773,902.54
外币报表折算差额		-238,748.84	-56,765.05	-295,513.89
期末数	109,235,718.66	67,926,948.96	22,163,034.62	199,325,702.24
累计折旧				
期初数	24,048,415.69	41,386,098.44	14,240,784.95	79,675,299.08
本期增加金额	3,668,232.08	8,803,745.73	1,823,412.55	14,295,390.36
计提	3,668,232.08	8,803,745.73	1,823,412.55	14,295,390.36
本期减少金额	177,215.95	2,450,241.79	76,380.00	2,703,837.74
处置或报废		2,450,241.79	76,380.00	2,526,621.79
转入投资性房地产	177,215.95			177,215.95
外币报表折算差额		-202,548.89	-26,608.62	-229,157.51
期末数	27,539,431.82	47,537,053.49	15,961,208.88	91,037,694.19
账面价值				
期末账面价值	81,696,286.84	20,389,895.47	6,201,825.74	108,288,008.05
期初账面价值	91,434,606.81	23,740,235.35	6,702,566.55	121,877,408.71

注：本公司与浙江省协作大厦有限公司（以下简称协作大厦公司）、浙江省经协集团有限公司联建浙江协作大厦，达到可使用状态后，将归属于本公司房产按1,500万元暂估记入固定资产。根据浙江宏达会计师事务所有限公司出具的《浙江协作大厦建设项目竣工决算审计报告》（浙宏会（2015）审338号），本公司应承担的投资款为9,526,598.70元（不含未补缴的土地出让金），与原固定资产暂估金额差额为5,473,401.30元。本期公司根据前述差额调减了固定资产原值并相应转销了已收购置返还款（其中以前年度收到5,202,194.60元，本期收到271,206.70元）。

(2) 期末无固定资产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的固定资产的情况说明如下：

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
浙江协作大厦6-8楼	1,364,454.72	尚未办妥房产证及土地使用权证
福州中盛大厦702号房屋	15,181,623.15	尚未办妥房产证及土地使用权证
长沙市开福区芙蓉中路一段109号第2-7栋及地下室11层1101、1117至1120号房[注1]	4,078,954.78	尚未办妥房产证及土地使用权证
长春伟峰彩宇新城2204、2205号房屋	8,076,774.08	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
沈阳财富中心B座23-1至23-7号房[注2]	8,153,949.64	已办妥房产证但未办妥土地使用权证

潍坊金融服务区 2 号楼 2701 至 2703、2705 至 2708 号房	3,510,533.15	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小 计	40,366,289.52	

注 1：截至审计报告日，该房产已办妥不动产权证。

注 2：沈阳财富中心 B 座 23-5、23-6 中部分房产已用于出租，转入投资性房地产科目核算。

#### 19. 在建工程

项 目	期末数	期初数
在建工程[注]	49,308,879.59	26,892,629.60
合 计	49,308,879.59	26,892,629.60

注：2013 年度，本公司与双冠控股集团有限公司、财通证券股份有限公司（以下简称财通证券公司）合作购买杭州翠苑单元 B1/B2-10-2 地块用于联建办公楼，三方出资比例分别为 30%、35%和 35%。该工程造价总预算数 14.43 亿元，其中土地款 8.73 亿元，根据前述出资比例，本公司应承担的土地款为 2.62 亿元。根据本期该工程支出情况和前述出资比例，本公司本期在建工程增加 22,416,249.99 元。

#### 20. 无形资产

##### (1) 明细情况

项 目	土地使用权[注]	软 件	合 计
账面原值			
期初数	261,915,921.72	24,754,582.33	286,670,504.05
本期增加金额		11,072,646.35	11,072,646.35
1) 购置		11,072,646.35	11,072,646.35
本期减少金额			
外币报表折算差额		-105,480.00	-105,480.00
期末数	261,915,921.72	35,721,748.68	297,637,670.40
累计摊销			
期初数	17,267,440.80	13,269,911.38	30,537,352.18
本期增加金额	6,547,898.04	8,364,519.21	14,912,417.25
1) 计提	6,547,898.04	8,364,519.21	14,912,417.25
本期减少金额			
外币报表折算差额		-105,480.00	-105,480.00

期末数	23,815,338.84	21,528,950.59	45,344,289.43
账面价值			
期末账面价值	238,100,582.88	14,192,798.09	252,293,380.97
期初账面价值	244,648,480.92	11,484,670.95	256,133,151.87

注：土地使用权说明详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之在建工程说明。

(2) 期末无无形资产用于担保。

## 21. 长期待摊费用

项 目	期初数	本期增加	本期摊销	期末数
装修费	17,647,075.05	2,785,063.26	6,423,318.06	14,008,820.25
合 计	17,647,075.05	2,785,063.26	6,423,318.06	14,008,820.25

## 22. 递延所得税资产

### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
预计负债	12,620,426.10	16,438,666.32
未付工资	32,477,231.01	3,500,000.00
存货跌价准备	20,358,073.96	2,930,895.88
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债公允变动	1,042,957.62	2,443,846.20
期货风险准备金	1,901,501.74	1,919,071.10
坏账准备	1,798,212.07	1,342,246.39
应付期货投资者保障基金	126,386.68	292,313.85
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允变动	38,354.94	193,410.61
可供出售金融资产公允变动		228,300.00
合 计	70,363,144.12	29,288,750.35

### (2) 引起暂时性差异的资产和负债项目对应的暂时性差异金额

项 目	期末数	期初数
预计负债	50,481,704.38	65,754,665.27
未付工资	129,908,924.04	14,000,000.00
存货跌价准备	81,432,295.81	11,723,583.49
以公允价值计量且其变动计入当	4,180,566.48	9,775,384.80

期损益的金融负债公允变动		
期货风险准备金	7,606,006.97	7,676,284.41
坏账准备	8,021,288.85	5,765,282.62
应付期货投资者保障基金	505,546.72	1,169,255.40
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允变动	153,419.75	773,642.46
可供出售金融资产公允变动		913,200.00
合 计	282,289,753.00	117,551,298.45

### 23. 短期借款

项 目	期末数	期初数
质押借款	50,000,000.00	
保证借款	510,000,000.00	150,000,000.00
合 计	560,000,000.00	150,000,000.00

### 24. 应付货币保证金

#### (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
自然人	93,828	7,744,666,636.85	84,353	8,287,477,205.61
法人	5,279	14,178,655,696.00	4,713	15,626,251,518.21
合 计	99,107	21,923,322,332.85	89,066	23,913,728,723.82

### 25. 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	13	173,328,692.00	12	287,062,372.00
合 计	13	173,328,692.00	12	287,062,372.00

#### (2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数
上海商品期货交易所	63,413,752.00
大连商品期货交易所	37,990,000.00
郑州商品期货交易所	71,924,940.00

合 计	173,328,692.00
-----	----------------

26. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

项 目	期末数	期初数
衍生金融负债	5,285,609.64	
收益互换		4,563,000.00
结构化主体其他投资者享有的份额	128,603,420.87	187,164,783.55
合 计	133,889,030.51	191,727,783.55

27. 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	167,143,962.32	24,751,281.94	70,277.44	191,824,966.82
合 计	167,143,962.32	24,751,281.94	70,277.44	191,824,966.82

(2) 本期风险准备金计提方法和比例说明

按本期母公司代理手续费净收入的 5%计提期货风险准备金。

(3) 本期动用风险准备金说明

本期动用期货风险准备金系用于核销账龄三年以上的应收风险损失款。

28. 应付账款

(1) 明细情况

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

(2) 期末无账龄 1 年以上重要的应付账款。

29. 预收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
货款	162,818,228.29	126,184,085.92
投资咨询费	444,999.92	1,887,915.82

投资意向金		1,000,000.00
基金销售业务收入	201,196.74	782,000.61
合计	163,464,424.95	129,854,002.35

(2) 本期无账龄 1 年以上重要的预收款项。

### 30. 应付期货投资者保障基金

#### (1) 明细情况

项目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
应付期货投资者保障基金	1,169,255.40	535,879.53	1,169,255.41	535,879.52
合计	1,169,255.40	535,879.53	1,169,255.41	535,879.52

#### (2) 本期计提方法和比例说明

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

### 31. 应付手续费及佣金

#### (1) 明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
应付佣金	2,038,374.47	19,877,922.72	20,415,337.92	1,500,959.27

#### (2) 应付关联方款项

关联方名称	期末数	款项性质
财通证券股份有限公司	841,723.40	IB 业务费
小计	841,723.40	

### 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	213,073,366.62	589,587,931.97	402,221,261.58	400,440,037.01
离职后福利—设定提存计划	13,426,958.14	36,243,005.78	33,549,433.09	16,120,530.83
合计	226,500,324.76	625,830,937.75	435,770,694.67	416,560,567.84

#### (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	197,038,579.06	521,388,083.25	344,844,630.25	373,582,032.06
职工福利费		11,359,772.17	11,357,000.17	2,772.00
社会保险费	13,361,491.23	29,736,211.99	27,041,790.01	16,055,913.21
其中：医疗保险费	327,334.57	11,262,903.11	11,177,402.89	412,834.79
补充医疗保险	13,000,000.00	16,653,934.01	14,053,934.01	15,600,000.00
工伤保险费	5,692.78	312,643.41	311,156.45	7,179.74
生育保险费	28,463.88	1,015,989.61	1,008,554.81	35,898.68
其他		490,741.85	490,741.85	
住房公积金	440,979.00	16,521,303.13	16,382,968.13	579,314.00
工会经费和职工教育经费	2,232,317.33	10,582,561.43	2,594,873.02	10,220,005.74
小计	213,073,366.62	589,587,931.97	402,221,261.58	400,440,037.01

(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	398,494.26	18,809,281.58	18,705,194.35	502,581.49
失业保险费	28,463.88	779,790.20	790,304.74	17,949.34
补充养老保险	13,000,000.00	15,600,000.00	13,000,000.00	15,600,000.00
其他年金缴费		1,053,934.00	1,053,934.00	
小计	13,426,958.14	36,243,005.78	33,549,433.09	16,120,530.83

33. 应交税费

项目	期末数	期初数
增值税	1,285,700.96	
企业所得税	149,435,953.27	108,512,331.73
代扣代缴企业所得税	305,491.12	14,684,316.16
代扣代缴个人所得税	3,448,291.94	2,332,241.20
城市维护建设税	66,237.70	36,881.74
地方水利建设基金		447,835.77
教育费附加	28,387.55	15,806.42
地方教育费附加	18,924.28	10,493.63
其他	110,287.99	135,123.95
合计	154,699,274.81	126,175,030.60

### 34. 应付利息

项 目	期末数	期初数
次级债券	8,715,452.06	12,145,800.00
次级债务		3,217,899.56
借款利息	737,801.00	2,379,482.93
合 计	9,453,253.06	17,743,182.49

### 35. 应付股利

#### (1) 明细情况

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

#### (3) 其他说明

公司 2017 年第三次临时股东大会决议通过《2017 年半年度利润分配的议案》，决定以现有总股本 131,000 万股为基数，向全体股东每 10 股派 1.5 元(含税)人民币现金，合计发放现金股利 19,650.00 万元。

### 36. 其他应付款

#### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
经营层风险金	4,900,000.00	4,500,000.00
交易所质押款	111,157,670.00	99,973,276.00
合作投资款	228,714,502.93	265,004,738.76
旧城改造房屋购置款返还款[注]		5,202,194.60
其他	14,408,005.19	9,828,669.84
合 计	359,180,178.12	384,508,879.20

注：旧城改造房屋购置款返还款本期减少详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之固定资产说明。

#### (2) 账龄 1 年以上重要的其他应付款

项 目	期末数	未偿还或结转的原因
九三粮油工业集团有限公司	105,894,246.79	尚在合作，尚未结清

莱芜京华制管有限公司	100,865,742.06	尚在施工, 尚未结清
小 计	206,759,988.85	

(3) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
九三粮油工业集团有限公司	105,894,246.79	合作投资款
莱芜京华制管有限公司	100,865,742.06	合作投资款
上海期货交易所质押款	81,367,400.00	质押款
江苏润之源国际贸易有限公司	21,954,514.08	合作投资款
郑州商品交易所质押款	21,621,150.00	质押款
小 计	331,703,052.93	

37. 其他流动负债

项 目	期末数	期初数
借款		115,271,007.24
合 计		115,271,007.24

38. 应付债券

项 目	期末数	期初数
永安期货公司 2015 年次级债券	430,000,000.00	600,000,000.00
合 计	430,000,000.00	600,000,000.00

39. 预计负债

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
待执行合同亏损	52,134,360.38	65,754,665.27
诉讼事项	417,623.47	417,623.47
合 计	52,551,983.85	66,172,288.74

(2) 其他说明

1) 永安资本公司对待执行货物购销合同按合同价与市场价的差额确认预计亏损。

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

律师进行处理，并就此事计提了预计负债 417,623.47 元。

#### 40. 递延所得税负债

##### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
可供出售金融资产公允价值变动	79,031,871.94	50,328,191.43
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动	11,176,105.06	1,542,993.15
合 计	90,207,977.00	51,871,184.58

##### (2) 引起暂时性差异的资产和负债项目对应的暂时性差异金额

项 目	期末数	期初数
可供出售金融资产公允价值变动	316,037,794.07	201,312,765.69
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动	44,634,584.11	6,265,964.08
合 计	360,672,378.18	207,578,729.77

#### 41. 其他非流动负债

项 目	期末数	期初数
次级债务		200,000,000.00
合 计		200,000,000.00

#### 42. 股本

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

#### 43. 资本公积

##### (1) 明细情况

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

##### (2) 资本公积本期增减原因及依据说明

本期其他资本公积增加详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之长期股权投资说明。

#### 44. 其他综合收益

##### (1) 明细情况

项 目	期初数	本期发生额	
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益
以后将重分类进损益的其他综合收益	169,580,723.20	126,533,800.94	24,577,919.21
其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额	-91,786.55	5,265,376.73	
可供出售金融资产公允价值变动损益	156,066,134.84	137,250,610.68	24,577,919.21
外币财务报表折算差额	13,606,374.91	-15,982,186.47	
其他综合收益合计	169,580,723.20	126,533,800.94	24,577,919.21

(续上表)

项 目	本期发生额			期末数
	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
以后将重分类进损益的其他综合收益	28,931,980.51	73,023,901.22		242,604,624.42
其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		5,265,376.73		5,173,590.18
可供出售金融资产公允价值变动损益	28,931,980.51	83,740,710.96		239,806,845.80
外币财务报表折算差额		-15,982,186.47		-2,375,811.56
其他综合收益合计	28,931,980.51	73,023,901.22		242,604,624.42

#### 45. 盈余公积

##### (1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	145,435,627.24	83,696,888.63		229,132,515.87
合 计	145,435,627.24	83,696,888.63		229,132,515.87

##### (2) 盈余公积本期增减原因及依据说明

本期增加系本公司根据章程规定，按母公司当期净利润的 10% 计提法定盈余公积。

#### 46. 一般风险准备

##### (1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
一般风险准备	205,326,641.17	83,696,888.63		289,023,529.80

合 计	205,326,641.17	83,696,888.63		289,023,529.80
-----	----------------	---------------	--	----------------

(2) 本期计提方法和比例说明

本期增加系本公司根据章程规定，按母公司当期净利润的 10%计提一般风险准备。

47. 未分配利润

项 目	金 额	提取或分配比例
期初未分配利润	1,446,813,813.42	
加：本期归属于母公司所有者的净利润	887,528,756.90	
减：提取法定盈余公积	83,696,888.63	母公司净利润的 10%
提取一般风险准备	83,696,888.63	母公司净利润的 10%
应付普通股股利[注]	196,500,000.00	
期末未分配利润	1,970,448,793.06	

注：应付普通股股利情况详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之应付股利说明。

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费	208,007,128.65	280,865,094.03
交易所返还减收手续费	319,154,261.01	238,883,474.57
投资咨询收入	13,506,897.33	34,266,984.69
资产管理业务净收入	14,992,345.10	26,355,191.20
期权经纪手续费	1,289,674.29	1,754,159.10
代销基金收入	36,397,217.97	3,607,272.75
合 计	593,347,524.35	585,732,176.34

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部	1	446,926,498.83
浙江省(不含杭州本部)	14	49,162,859.75
山东省	6	8,175,080.60
辽宁省	3	7,635,081.39
北京市	1	8,304,579.37
上海市	1	6,882,401.98

广东省	2	5,510,044.22
江苏省	1	3,478,403.39
福建省	2	3,508,801.46
吉林省	1	2,987,841.04
天津市	1	2,839,951.73
河北省	1	2,601,406.85
河南省	1	2,458,279.18
湖北省	1	2,021,482.37
江西省	1	1,058,757.26
重庆市	1	2,643,425.15
湖南省	1	1,297,308.99
四川省	1	1,200,607.10
香港	1	34,654,713.69
合 计	41	593,347,524.35

## 2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	615,381,251.86	552,616,034.42
其中：母公司保证金利息收入	565,495,162.41	535,061,076.45
境外利息收入	22,000,595.32	9,759,145.46
其他利息收入	27,885,494.13	7,795,812.51
利息支出	91,143,439.97	56,293,180.90
合 计	524,237,811.89	496,322,853.52

## 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	205,968,886.40	74,357,527.46
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	248,717,357.30	20,134,829.10
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债取得的投资收益	435,637,315.09	225,845,469.56
处置可供出售金融资产取得的投资收益	28,837,102.27	28,317,818.75
其他	15,749.87	
扣除结构化主体其他投资者享有的	-14,195,224.94	-3,863,765.26

损益		
合 计	904,981,185.99	344,791,879.61

#### 4. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	43,153,642.03	-8,920,789.43
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益[注]	42,285,875.07	-8,832,559.77
合 计	43,153,642.03	-8,920,789.43

注：本期衍生金融工具之公允价值变动收益系持有的期货合约、期权等浮动盈亏。

#### 5. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
销售货物收入	7,591,588,205.22	5,377,191,205.51
租赁收入	138,790.08	21,888.00
其他	10,334,766.37	3,126,211.40
合 计	7,602,061,761.67	5,380,339,304.91

#### 6. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
财政补助	4,089,641.74		4,089,641.74
水利基金返还	571,699.06		571,699.06
合 计	4,661,340.80		4,661,340.80

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

#### 7. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
营业税	42,246.67	8,862,895.35
城市维护建设税	1,666,621.22	2,200,002.65
教育费附加	714,314.59	940,630.13
地方教育附加	475,991.63	626,940.55
其他	2,476,144.13	

合 计	5,375,318.24	12,630,468.68
-----	--------------	---------------

#### 8. 业务及管理费

##### 业务及管理费前 10 名明细情况

项 目	本期数	上年同期数
工资、奖金、津贴和补贴	625,830,937.75	423,068,252.09
仓储费	40,145,195.97	38,303,046.61
租赁费	32,029,572.30	32,353,186.25
无形资产摊销	14,912,417.25	12,477,512.66
折旧费	14,295,390.36	14,530,394.34
IB 业务费	12,062,531.73	12,757,135.45
通讯费	11,557,667.45	11,192,617.72
差旅费	11,447,087.71	9,784,816.64
业务招待费	10,569,013.34	12,447,433.20
数据业务费	7,950,188.35	8,368,093.94
小 计	780,800,002.21	575,282,488.90

#### 9. 资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
坏账损失	3,690,053.80	-52,032.01
存货跌价损失	263,317,396.69	37,759,584.91
合 计	267,007,450.49	37,707,552.90

#### 10. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
销售货物成本	7,325,584,750.19	5,214,287,440.55
租赁成本	130,135.54	27,321.67
合 计	7,325,714,885.73	5,214,314,762.22

#### 11. 营业外收入

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产毁损报废利得	1,864.35	8,492.35	1,864.35

个人所得税代扣代缴手续费返还	984,360.81	791,464.34	984,360.81
合同违约及赔付收入	1,355,001.63		1,355,001.63
政府补助		4,988,010.67	
非同一控制下企业合并的购买利得		6,833,104.88	
其他	7,890.18	71,079.05	7,890.18
合 计	2,349,116.97	12,692,151.29	2,349,116.97

## 12. 营业外支出

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产毁损报废损失	76,920.43	304,478.67	76,920.43
待执行亏损合同	49,178,138.17	65,754,665.27	
残疾人就业保障基金	1,403,014.45	560,573.32	
地方水利建设基金	15,757.89	2,861,306.40	
捐赠支出	5,380,000.00	518,000.00	5,380,000.00
存货损毁[注]	19,760,127.81		19,760,127.81
赔偿支出		2,700,000.00	
其 他	3,876,732.50	1,278,738.21	3,876,732.50
合 计	79,690,691.25	73,977,761.87	29,093,780.74

注：存货损毁说明详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之其他流动资产说明。

## 13. 所得税费用

### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	256,325,497.80	207,433,587.34
递延所得税费用	-31,669,581.86	-24,424,294.23
合 计	224,655,915.94	183,009,293.11

### (2) 会计利润与所得税费用调整过程

项 目	本期数	上年同期数
利润总额	1,112,184,672.84	794,195,895.06
按母公司适用税率计算的所得税费用	278,046,168.21	198,548,973.77
子公司适用不同税率的影响	-7,099,489.98	-2,637,302.24

调整以前期间所得税的影响	2,236,563.52	7,511,884.58
免税收入影响	-55,777,226.16	-22,504,841.45
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	8,712,954.82	1,818,552.67
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	636,519.63	4,592,800.01
弥补以前年度亏损	-5,648,380.34	-3,266,101.25
合并范围内利润抵销影响		-1,708,276.22
研发费加计扣除		-312,338.07
结构化主体其他投资者享有的损益的影响	3,548,806.24	965,941.32
所得税费用	224,655,915.94	183,009,293.11

#### 14. 其他综合收益的税后净额

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

### (三) 合并现金流量表项目注释

#### 1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
客户净入金		1,689,350,578.93
交易所净出金	772,166,089.79	1,229,747,555.29
其他收入现金流入	10,473,556.45	7,325,136.07
其他现金流入	7,049,733.27	174,221,184.18
合 计	789,689,379.51	3,100,644,454.47

#### 2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
客户净出金	3,406,296,131.07	
保证金增加	71,759,914.85	
往来款项	53,805,553.77	14,409,330.83
其他现金流出	19,749,906.26	11,456,445.15
合 计	3,551,611,505.95	25,865,775.98

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
定期存款		585,717,103.10
其他	35,803.91	56,785,809.98
合 计	35,803.91	642,502,913.08

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
定期存款	792,193,311.88	220,000,000.00
合 计	792,193,311.88	220,000,000.00

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
次级债借入		200,000,000.00
合 计		200,000,000.00

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
结构化产品其他投资者赎回及到期清算	68,512,094.38	206,485,793.48
次级债偿还	200,000,000.00	
合 计	268,512,094.38	206,485,793.48

(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
产业扶持资金	2,000,000.00	其他收益	西湖区产业扶持资金
金融中心建设支持资金	500,000.00	其他收益	广州市对新设立或新迁入金融机构一次性奖励1款
金融业发展专项资金	500,000.00	其他收益	吉林省财政支持金融创新一次性奖励款
房租补贴	380,000.00	其他收益	米市巷街道房租补贴款
房租补贴	136,392.00	其他收益	武汉市汉江区招商局对武汉营业部房屋租金的补贴

房租补贴	157,800.00	其他收益	诸暨经济开发区管理委员会对营业部房屋装修补贴
稳定岗位补贴	258,175.63	其他收益	杭州人社局对稳定就业企业给予失业保险金返还
水利建设基金	571,699.06	其他收益	
其他	157,274.11	其他收益	
小计	4,661,340.80		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 4,661,340.80 元。

## 六、合并范围的变更

### (一) 合并范围增加

#### 1. 报告期新纳入合并财务报表范围的子公司

因直接设立方式而增加子公司的情况说明

本期公司出资设立新永安控股公司，注册资本为 1 亿港币，公司出资 1 亿港币，占其注册资本的 100%，拥有对其的实质控制权，故自该公司成立之日起，将其纳入合并财务报表范围。

#### 2. 新纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的成长 1 号、成长 2 号资产管理计划、成长 3 号资产管理计划(以下简称成长 3 号)、成长 5 号、成长 6 号、七禾言起 2 号、永利 1 号、永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数多头一号资产管理计划(以下简称黑色多头一号)、永安恒生聚源千际钢材及黑色原料指数空头一号资产管理计划(以下简称黑色空头一号)、永安恒生聚源千际有色金属指数多头一号资产管理计划(以下简称有色多头一号)、永安恒生聚源千际有色金属指数空头一号资产管理计划(以下简称有色空头一号)、瑞意多策略 1 号，因满足公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免，且享有的可变回报为重大三个条件，故自上述资管计划成立或购买之日起，将其纳入合并财务报表范围。

### (二) 合并范围减少

#### 1. 本期不再纳入合并财务报表范围的子公司

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	期初至处置日净利润
浙江中路投资管理有限公司	注销	2017 年 8 月 3 日	38,796.31	2.14

#### 2. 不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的永安东方智慧 1 号资产管理计划(以下简称东方智慧 1 号)因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。本期因公司部分赎回了永安大岩 CTA1 号资产管理计划(以下简称大岩 CTA1 号)的份额，使得本公司享有其收益不满足重大条件，故自赎回日起不再纳入合并财务报表范围。

## 七、在其他主体中的权益

### (一) 在子公司中的权益

#### 1. 子公司的构成

##### 基本情况

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

#### 2. 纳入合并范围的结构化主体

期末，本公司管理并投资的成长1号、成长2号、成长3号、成长5号、成长6号、七禾言起2号、永利1号、黑色多头一号、黑色空头一号、有色多头一号、有色空头一号、瑞意多策略1号，因满足公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免，且享有的可变回报为重大三个条件，故将上述结构化主体纳入公司合并财务报表范围。

### (二) 在联营企业中的权益

#### 1. 重要的联营企业

##### (1) 基本情况

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

##### (2) 持有20%以下表决权但具有重大影响

永安资本公司因向玉皇山南公司派遣董事，故能够对其生产经营产生重大影响。

#### 2. 重要联营企业的主要财务信息

项目	期末数/本期数		期初数/上年同期数	
	永安国富公司	玉皇山南公司	永安国富公司	玉皇山南公司

流动资产	1,123,526,597.69	111,804,528.22	265,200,770.97	99,928,748.25
非流动资产	174,926,530.33	32,912,542.52	42,368,127.55	21,012,405.31
资产合计	1,298,453,128.02	144,717,070.74	307,568,898.52	120,941,153.56
流动负债	435,522,635.00	58,087,443.37	91,154,653.67	34,619,239.64
非流动负债	16,555,818.77		698,946.17	
负债合计	452,078,453.77	58,087,443.37	91,853,599.84	34,619,239.64
少数股东权益		7,594,681.59		2,601,918.56
归属于母公司所有者权益	846,374,674.25	79,034,945.78	215,715,298.68	83,719,995.36
按持股比例计算的净资产 份额	279,303,642.50	15,016,639.70	105,700,496.35	15,906,799.12
调整事项				
商誉				
内部交易未实现利润				
其他			18,228,682.86	709,616.30
对联营企业权益投资的账 面价值	279,303,642.50	15,016,639.70	123,929,179.21	16,616,415.42
存在公开报价的联营企业 权益投资的公允价值				
营业收入	1,142,570,503.95	957,651.25	202,311,556.76	434,504.11
净利润	485,456,427.15	-5,732,220.72	133,898,107.60	-5,370,078.83
终止经营的净利润				
其他综合收益	13,159,562.58		1,872,648.50	
综合收益总额	498,615,989.73	-5,732,220.72	135,770,756.10	-5,370,078.83
本期收到的来自联营企业 的股利	88,353,968.50			

## 八、关联方关系及其交易

### (一) 关联方认定标准说明

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

### (二) 关联方关系

关联方名称	与本公司的关系
财通证券公司	第一大股东

永安国富公司	联营企业
浙江省协作大厦有限公司（以下简称协作大厦公司）	股东
财通证券资产管理有限公司（以下简称财通资管公司）	财通证券公司之子公司
财通基金管理有限公司（以下简称财通基金公司）	财通证券公司之联营公司
OSTC Yongan Trading Co., Limited	永安商贸公司之联营公司
浙江潮王大酒店有限公司	该公司董事总经理出任本公司监事会主席
浙江省金融业发展促进会	该公司法定代表人出任本公司独立董事
玉皇山南公司	永安资本公司之联营公司
敦和资产管理有限公司（以下简称敦和资管公司）	该公司董事长、法定代表人在过去十二个月内出任本公司副董事长、总经理、法定代表人
浙江永安投资咨询有限公司（以下简称永安咨询公司）	OSTC Yongan Trading Co., Limited 之子公司
浙江财通资本投资有限公司	财通证券公司之子公司
宁波财通涌创投资管理有限公司	浙江财通资本投资有限公司之子公司

### （三）关联方交易情况

1. 关联方未结算项目金额详见本财务报表相关项目注释。

2. 关联方在本公司开设账户，从事期货交易的情况如下：

客户名称	期末权益	本期手续费收入
财通证券公司	46,158,282.94	158,528.91
永安国富公司	19,156,426.43	73,773.85
协作大厦公司	4,703,024.15	42,266.53
永安咨询公司	59,989.65	9.47
小 计	70,077,723.17	274,578.76

3. 特殊法人机构期货经纪业务

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

客户名称	期末权益	本期手续费收入
财通基金公司	2,000,000.00	730.75
财通资管公司	4,780,380.09	4,888.80
永安国富公司	1,353,848,045.48	5,569,282.28
敦和资管公司	2,865,139,791.52	3,157,788.28
小 计	4,225,768,217.09	8,732,690.11

#### 4. IB 业务佣金

本公司与财通证券公司签约,由财通证券公司经正式审批的证券营业部为本公司提供中间介绍服务(以下简称 IB 业务),本期本公司因上述 IB 业务应支付财通证券公司 IB 业务费 12,062,531.73 元。

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

证券代码	证券名称	管理人	持仓成本	期末账面价值
S65140	永安国富-永富 1 号资产管理计划	永安国富公司	24,806,685.27	28,168,798.34
SE5386	永安国富-永富 3 号资产管理计划	永安国富公司	770,000,000.00	1,038,637,600.00
SM9085	永安国富-永富 10 号私募证券投资基金	永安国富公司	223,865,548.82	225,698,015.83
ST0836	永安国富-永富 FOF1 号私募投资基金	永安国富公司	80,000,000.00	93,920,000.00
SX7360	永安国富-稳健 5 号私募投资基金	永安国富公司	50,000,000.00	50,400,000.00
ST5354	敦和八卦田积极 1 号私募基金 (FOF)	敦和资管公司	20,060,000.00	21,580,000.00
003480	财通资管鑫管家货币 B	财通资管公司	50,304,631.69	50,304,631.69

6. 期末永安国富公司持有本公司作为管理人募集设立的资产管理计划:

证券代码	证券名称	管理人	持仓成本	期末账面价值
SR1319	永安期货股份有限公司工银量化恒盛精选 A 类 25 期	本公司	20,000,000.00	24,110,000.00

7. 本期本公司持有永安国富公司、玉皇山南公司管理的资产管理计划分红:

(1) 现金分红情况

证券代码	证券名称	管理人	分红金额
S65140	永安国富-永富 1 号资产管理计划	永安国富公司	7,821,264.09
SE5386	永安国富-永富 3 号资产管理计划	永安国富公司	175,271,758.75
SM9085	永安国富-永富 10 号私募证券投资基金	永安国富公司	3,847,539.20
SK6218	永安山南 CTA 组合私募基金 1 号	玉皇山南公司	509,656.00

(2) 分红转产品份额情况

证券代码	证券名称	分红金额 (元)
S65140	永安国富-永富 10 号私募证券投资基金	50,018,009.62

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

公 司	期末有价证券市值	期末资金余额	本期证券交易费
本公司		683.44	
永安资本公司			8,493.08
上海瑞萌公司	1,418,553.00	3,056,449.74	40,793.01
中邦实业公司	1,863,342.00	306.89	6,010.21
合 计	3,281,895.00	3,057,440.07	55,296.30

#### 9. 关联租赁

本期，本公司和永安资本公司向浙江潮王大酒店公司租用其部分楼层作为办公用房，各支付房租费 116,941.51 元。

#### 10. 关键管理人员报酬

项 目	2017 年度
关键管理人员报酬	26,161,967.00

#### 11. 与关联企业共同投资

本期，永安资本公司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)。其中永安资本公司投资 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。

(1) 本公司与财通基金公司签约向其提供投资咨询服务，本期确认咨询费收入 880,345.74 元。

(2) 本公司与永安国富公司签约向其提供投资咨询服务，本期确认咨询费收入 2,830,188.68 元。

(3) 本公司为永安国富公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 10,281,995.28 元。

(4) 本公司为玉皇山南公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 441,751.68 元。

(5) 本公司为财通基金公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 443,353.88 元。

(6) 本公司为敦和资管公司提供代销基金产品服务，本期确认基金代销业务收入 1,556,949.59 元。

(7) 本期向浙江省金融业发展促进会无偿捐赠 500,000.00 元，主要用于协会日常运营使用。

(8) 本期本公司归还财通证券公司次级债务 2 亿元，支付累计应付利息 8,821,917.81 元。

(9) 永安商贸公司向 OSTC Yongan Trading Co., Limited 拆出资金 2,117,647.00 英镑，本期计提利息折合人民币为 1,242,794.45 元。

## 九、公允价值的披露

### (一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

项 目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合 计
持续的公允价值计量				
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	75,769,099.11			75,769,099.11
交易性金融资产	75,769,099.11			75,769,099.11
债务工具投资	3,200,000.00			3,200,000.00
权益工具投资	27,993,720.00			27,993,720.00
衍生金融资产	44,575,379.11			44,575,379.11
2. 可供出售金融资产		2,123,123,825.45		2,123,123,825.45
权益工具投资		2,123,123,825.45		2,123,123,825.45
持续以公允价值计量的资产总额	75,769,099.11	2,123,123,825.45		2,198,892,924.56
3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	5,285,609.64	128,603,420.87		133,889,030.51
交易性金融负债	5,285,609.64	128,603,420.87		133,889,030.51
衍生金融负债	5,285,609.64			5,285,609.64
结构化主体其他投资者享有的份额		128,603,420.87		128,603,420.87
持续以公允价值计量的负债总额	5,285,609.64			133,889,030.51

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

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

## 十、承诺及或有事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的承诺及或有事项。

## 十一、资产负债表日后事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的资产负债表日后事项。

## 十二、母公司财务报表主要项目注释

### (一) 母公司资产负债表项目注释

#### 1. 长期股权投资

##### (1) 明细情况

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

(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	745,485,602.19		745,485,602.19
对合营联营企业投资	123,929,179.21		123,929,179.21
合 计	869,414,781.40		869,414,781.40

##### (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	100	85,080,000.00
新永安期货公司	100	100	93,501,600.00
永安资本公司	100	100	500,000,000.00
中邦实业公司	100	100	251,984,002.19
小 计			930,565,602.19

##### (3) 对合营联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
永安国富公司	123,929,179.21	17,689,000.00		209,439,510.15	5,175,316.50
小 计	123,929,179.21	17,689,000.00		209,439,510.15	5,175,316.50

(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	11,424,605.14	88,353,968.50			279,303,642.50	
小 计	11,424,605.14	88,353,968.50			279,303,642.50	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费	174,535,812.42	231,453,373.55
交易所返还减收手续费	319,154,261.01	238,883,474.57
投资咨询收入	13,395,882.15	31,465,897.73
资产管理业务净收入	15,722,414.41	29,988,066.98
期权经纪手续费	1,289,674.29	1,754,159.10
代销基金收入	36,397,217.97	3,607,272.75
合 计	560,495,262.25	537,152,244.68

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部	1	448,728,950.42
浙江省(不含杭州本部)	14	49,162,859.75
山东省	6	8,175,080.60
辽宁省	3	7,635,081.39
北京市	1	8,304,579.37
上海市	1	6,882,401.98
广东省	2	5,510,044.22
江苏省	1	3,478,403.39
福建省	2	3,508,801.46
吉林省	1	2,987,841.04
天津市	1	2,839,951.73
河北省	1	2,601,406.85
河南省	1	2,458,279.18
湖北省	1	2,021,482.37
江西省	1	1,058,757.26
重庆市	1	2,643,425.15
湖南省	1	1,297,308.99
四川省	1	1,200,607.10
合 计	40	560,495,262.25

## 2. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	209,439,510.15	79,033,515.67
成本法核算的长期股权投资收益	162,836,003.69	2,160,499.50
可供出售金融资产持有期间取得的投资收益	233,900,235.67	5,429,014.72
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益	-37,907.91	2,682,615.97
处置可供出售金融资产取得的投资收益	4,618,881.51	20,360,657.03
合 计	610,756,723.11	109,666,302.89

## 十三、其他补充资料

### (一) 非经常性损益

项 目	金额	说明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-75,056.08	
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	4,661,340.80	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,242,794.45	
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、金融负债产生的公允价值变动收益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益		

单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-26,669,607.69	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小 计	-20,840,528.52	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“－”表示）	1,887,758.86	
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	-22,728,287.38	

## （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	16.82	0.68	0.68
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	17.25	0.69	0.69

### 2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	2017 年度
归属于公司普通股股东的净利润	A	887,528,756.90
非经常性损益	B	-22,728,287.38
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	910,257,044.28
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	4,766,601,130.04
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	196,500,000.00
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H	
其他	权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	5,265,376.73
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	6

	可供出售金融资产公允价值变动	I2	83,740,710.96
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	6
	外币报表折算差额变动	I3	-15,982,186.47
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	6
	其他	I4	11,424,605.14
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J4	3
报告期月份数		K	12
加权平均净资产		$L = \frac{D+A}{2} + E \times \frac{F}{K} - G \times \frac{H}{K} \pm I \times \frac{J}{K}$	5,249,733,610.39
加权平均净资产收益率		$M = A/L$	16.91%
扣除非经常损益加权平均净资产收益率		$N = C/L$	17.34%

### 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	883,269,573.84
非经常性损益	B	-22,728,287.38
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	$C = A - B$	905,997,861.22
期初股份总数	D	1,310,000,000.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E	
发行新股或债转股等增加股份数	F	
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G	
因回购等减少股份数	H	
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I	
报告期缩股数	J	
报告期月份数	K	12
发行在外的普通股加权平均数	$L = D + E + F \times \frac{G}{K} - H \times \frac{I}{K} - J$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M = A/L$	0.68
扣除非经常损益基本每股收益	$N = C/L$	0.69

(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

二〇二〇年四月二十日

附：

### 备查文件目录

（一）载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表。

（二）载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。

（三）年度内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

文件备置地址：

公司董事会秘书办公室