



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司

Yongan Futures Co.,Ltd.

一切只为客户

All For You

年度报告

2020

公司年度大事记

2020 年疫情发生后，公司第一时间向浙大一院捐款 200 万元，全体员工纷纷奉献爱心，捐款 15.7 万元，并捐赠了价值 7.2 万元的防护物资。

2020 年 6 月公司当选郑州商品交易所第七届理事会会员理事单位；2020 年 12 月，公司当选大连商品交易所第四届理事会会员理事单位。

2020 年 7 月，公司赴贵州省威宁县开展“同心树人”教育帮扶活动，投入 55 万元帮助当地的九三中学和二塘中学，并成立了“九三中学永安民族艺术团”，予以长期关心和支持。

分支机构建设取得新突破。公司立足浙江，沿海、沿江、沿产业密集区进行网点布局，2020 年 11 月，第 44 家分支机构杭州西湖分公司成立。

“数字永安”战略全面推行。7 月，公司设立数字金融服务中心，加速推进“数字永安”建设；10 月，公司官方抖音平台上线，完善多媒体营销渠道；11 月，公司荣获中国金融 CIO 年会颁布的 2020 “金麒麟”年度金融行业优秀信息化团队。

“保险+期货”业务继续走在前列。5 月，公司在云南勐腊县实施的天然橡胶“保险+期货+订单收购”精准扶贫项目，荣获上海期货交易所 2019 年“保险+期货”精准扶贫项目评审一等奖；8 月，公司在云南勐腊县实施的天然橡胶“保险+期货”和在陕西扶风县实施的猪饲料成本指数“保险+期货”两个案例入围中期协“2019 年度期货经营机构服务实体经济优秀案例”。

目 录

第一节	重要提示、目录和释义	4
第二节	公司概况	10
第三节	会计数据和财务指标	12
第四节	管理层讨论与分析	16
第五节	重大事件	44
第六节	股份变动、融资和利润分配	47
第七节	董事、监事、高级管理人员及核心员工情况	54
第八节	行业信息	59
第九节	公司治理、内部控制和投资者保护	60
第十节	财务会计报告	71
第十一节	备查文件目录	172

第一节 重要提示、目录和释义

【声明】

公司控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

公司负责人葛国栋、主管会计工作负责人黄峥嵘及会计机构负责人（会计主管人员）黄峥嵘保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司出具了标准无保留意见的审计报告。

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

未按要求披露的事项及原因

- 1.由于行业客户期货经纪、风险管理等业务特性，市场竞争激烈，期货经纪可复制性强，风险管理业务为目前期货公司争夺的领域，客户和供应商为公司宝贵的资源，为公司的商业秘密，若披露公司重要客户名称、重要供应商名称，可能会导致公司流失重要客户及供应商，从而对公司的经营业绩造成不良影响，出于保护商业秘密，重要客户、供应商信息避免流失，在报告中未披露重要客户和供应商名称。
- 2.公司融资银行较多，具体提款价格为与各银行逐一谈判形成，最终银行融资价格属于公司融资谈判的商业秘密，为公司能进一步取得更优惠的融资价格，在报告中未披露公司融资利息率信息。

【重大风险提示表】

重大风险事项名称	重大风险事项描述及分析
1.期货、期权经纪业务风险	经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日趋激烈，手续费率呈逐渐下降态势，公司经纪业务可能面临着盈利下降风险。
2.利息收入下滑风险	利息收入是期货公司营业收入的重要来源之一。公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。公司的客户保证金规模、自有资金规模和市场利率的变化将影响公司的营业收入和净利润。如果市场利率出现大幅下降，或者客户保证金、自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风

	<p>险。此外，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。</p>
3.期货投资咨询业务风险	<p>由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广。若公司未能在研究分析、市场推广、客户体验等方面做到进一步提高或突破，可能导致期货投资咨询业务收入难以取得实质性起色。同时，期货投资咨询业务依赖于投资咨询部门及工作人员的专业能力。客户根据公司对行情、风险等要素的判断进行交易，若投资策略出现重大失误或者员工出现违规行为，可能导致客户亏损或与公司产生纠纷，从而影响公司期货投资咨询业务的开展及公司声誉。</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业务的激烈竞争。同时，期货行业专业投资人才相对缺乏。若公司不能在投资团队、产品设计、市场推广、绩效机制及客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司资产管理业务的进一步拓展。此外，在资产管理业务拓展过程中，可能存在投资团队建设和投资管理能力不足的风险，导致公司为客户设定的资产组合方案受市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当及人员操作失误等原因无法达到预期收益，甚至遭受损失，从而导致公司资产管理规模的降低和收入的下降。</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类似业务的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广及客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司基金销售业务的进一步拓展。</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与业务经验、人才储备和经营管理水平等不相匹配情况，从而导致因产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位及风险管理和内控措施不健全而带来的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、应对措施不完善或执行不力，可能发生较大规模的风险事件或出现严重亏损，从而造成公司经营业绩大幅下滑。</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，配置范围包括权益、商品、债券、信托等。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的市场风险和操作风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损从而影响公司盈利的可能。</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。目前中国证券监督管理委员会根据监管需要，以期货公司风险管理能力为基础，结合公司市场影响力和持续合规状况，对期货公司进行分类评价。分类评价结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标。如果公司未来评级出现下调，可能对公司现有业务开展、新业务申请等方面产生不利影响。</p>

<p>9. 信息技术系统风险</p>	<p>信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，其安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要。公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，并制定了完整的信息技术相关制度，确保信息技术系统稳定运行。但是公司向客户提供的交易系统主要来源于与外部公司合作，自主研发能力相对不足。由于各种原因，信息技术系统仍可能出现硬件故障、软件崩溃、通信线路中断、遭受病毒、黑客攻击、数据丢失与泄露等风险。如果公司遭受上述突发性事件，或信息技术系统未能及时、有效地改进或升级而发生故障，可能对公司的声誉、竞争力和经营业绩造成不利影响。此外，随着业务量的不断扩大、创新业务的不断推出，公司信息技术系统的处理能力和功能模块需要持续升级和扩展，以适应业务发展需要。若信息技术系统不能得到相应提升，公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。</p>
<p>10.信用风险</p>	<p>公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：（1）客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；（2）客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；（3）存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；（4）存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；（5）存放在银行的客户保证金不能提取的风险；（6）代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；（7）涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；（8）基差业务中，交易对手不按合同约定履行其义务的风险；（9）非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。</p>
<p>11.居间人管理风险</p>	<p>居间人非期货公司的员工，而是与期货公司签订居间合同，促成期货公司和客户订立期货经纪合同，并根据居间合同的约定取得手续费返佣的个人或法人，居间人独立承担基于居间关系产生的民事责任。期货公司与居间人合作拓宽了开发客户的渠道，是重要的营销补充方式。由于目前期货监管体系并未形成居间业务的统一规定，且公司不能完全控制拥有丰富客户资源的居间人流动，管理难度较大。若公司的经纪业务开展较为依赖居间人，可能对公司盈利情况产生不利影响。同时，居间人素质参差不齐，部分居间人可能采取私印名片、私设网点等方式冒充公司工作人员，可能给公司带来表见代理的诉讼风险。如果公司对居间人管理不当，发生上述情形，可能被监管部门采取监管措施或处以行政处罚，亦有可能产生诉讼风险。</p>
<p>12.人才流失和储备不足风险</p>	<p>期货行业是知识密集型行业，需要大批高素质专业人才。随着期货市场的发展，以及期货分支机构的大规模扩张，期货人才竞争日趋激烈。近年来金融衍生品推出的步伐加快，资产管理业务发展迅速，对期货人才提出了更高要求，也加剧了对期货人才尤其是复合型人才的需求和竞争。若公司流失关键优秀管</p>

	理人员和专业人才，可能会对公司的经营发展造成一定影响。同时，面对各个金融子行业的竞争，公司存在人才流失和储备不足的风险。
13.政策风险	公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家法律、法规及规范性文件的约束。如果国家关于期货行业的有关法律、法规和政策（如税收政策、业务许可、利率政策、业务收费标准及收费方式等）发生变化，可能会引起期货市场的波动和期货行业发展环境的变化，进而对公司的各项业务产生影响。目前，期货市场快速发展，期货法律法规的建设处于完善阶段，相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会对期货行业的经营模式和竞争方式产生影响。公司无法保证上述变化不会对公司的业务、经营业绩和财务状况产生重大不利影响，也无法保证能够及时调整以充分适应上述变化。如果公司未能完全遵守相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化，可能导致公司被罚款、暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。
14.重大诉讼、仲裁风险	截至报告期末，公司无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现相关诉讼或仲裁，可能会对公司经营带来不利影响。
15.商标风险	公司使用中的永安期货 YONGAN FUTURE 标识尚未取得商标专用权，在使用过程中，可能会引起法律纠纷，从而使公司声誉遭到损害，并对公司的业务开展及整体经营战略布局带来不利影响。
本期重大风险是否发生重大变化：	本期重大风险未发生重大变化

是否存在被调出创新层的风险

是 否

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
上海瑞萌	指	上海永安瑞萌商贸有限公司
永安新加坡	指	永安（新加坡）国际贸易有限公司
新永安控股	指	新永安国际金融控股有限公司
新永安资管	指	新永安国际资产管理有限公司
永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安国际金融	指	YONGANINTERNATIONAL FINANCIAL (SINGAPORE) PTE. LTD
玉皇山南	指	浙江玉皇山南投资管理有限公司
鞍钢商贸	指	鞍钢永安商品贸易有限公司
财通证券	指	财通证券股份有限公司，系永安期货的第一大股东
省财开	指	浙江省财务开发有限责任公司
省金控	指	浙江省金融控股有限公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
浙江东方	指	浙江东方金融控股集团股份有限公司
经建投	指	浙江省经济建设投资有限公司
协作大厦	指	浙江省协作大厦有限公司
新永安期货	指	中国新永安期货有限公司
新永安实业	指	中国新永安实业有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
浙江国油能源	指	浙江国油能源有限公司
永安全球基金	指	永安全球基金独立投资组合公司
永安国富	指	永安国富资产管理有限公司
公司章程	指	永安期货现行有效并经工商行政管理部门备案的章程
报告期	指	2020年1月1日-2020年12月31日
报告期末	指	2020年12月31日
IB业务	指	证券公司为本公司提供中间介绍服务业务
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本年度报告中，部分合计数与加总数在尾数上可能略有差异，系四舍五入造成。

第二节 公司概况

一、 基本信息

公司中文全称	永安期货股份有限公司
英文名称及缩写	Yongan Futures Co.,Ltd. YONGAN FUTURES
证券简称	永安期货
证券代码	833840
法定代表人	葛国栋

二、 联系方式

董事会秘书姓名	黄峥嵘
是否具备全国股转系统董事会秘书任职资格	否
联系地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼
电话	0571-88353525
传真	0571-88388193
电子邮箱	yaqh_ir@yafco.com
公司网址	www.yafco.com
办公地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16-17 层
邮政编码	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	公司董事会办公室

三、 企业信息

股票交易场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1992 年 9 月 7 日
挂牌时间	2015 年 10 月 28 日
分层情况	创新层
行业（挂牌公司管理型行业分类）	金融业（J）-资本市场服务（J67）-期货市场服务（J672）-其他期货市场服务（J6729）
主要产品与服务项目	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售、风险管理等
普通股股票交易方式	<input type="checkbox"/> 连续竞价交易 <input checked="" type="checkbox"/> 集合竞价交易 <input type="checkbox"/> 做市交易
普通股总股本（股）	1,310,000,000
优先股总股本（股）	0
做市商数量	0

控股股东	无
实际控制人及其一致行动人	实际控制人为浙江省财政厅，无一致行动人

四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	9133000010002099X5	否
注册地址	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16-17 层	是
注册资本（元）	1,310,000,000	否

五、 中介机构

主办券商（报告期内）	中信证券	
主办券商办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	
报告期内主办券商是否发生变化	否	
主办券商（报告披露日）	中信证券	
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及连续签字年限	宋慧娟	刘晓冬
	1 年	1 年
会计师事务所办公地址	浙江省杭州市江干区钱江路 1366 号华润大厦	

六、 自愿披露

适用 不适用

七、 报告期后更新情况

适用 不适用

第三节 会计数据和财务指标

一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	25,469,307,566.01	22,757,609,299.75	11.92%
利润总额	1,445,106,298.20	1,251,049,171.82	-
归属于挂牌公司股东的净利润	1,146,009,285.30	1,000,720,583.15	14.52%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	1,138,113,141.54	997,012,155.04	14.15%
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）	15.49%	15.37%	-
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	15.39%	15.32%	-
基本每股收益	0.87	0.76	14.31%

二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	45,377,194,307.14	36,799,466,218.55	23.31%
负债总计	37,579,148,862.16	29,935,540,124.23	25.53%
归属于挂牌公司股东的净资产	7,798,045,444.98	6,863,926,094.32	13.61%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	5.95	5.24	13.61%
资产负债率%（母公司）	19.59%	17.10%	-
资产负债率%（合并）	43.74%	41.98%	-
流动比率	1.18	1.19	-

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	4,544,716,739.44	1,638,715,958.63	177.33%
应收账款周转率	761.76	3,506.53	-
存货周转率	15.08	16.18	-

四、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	23.31%	25.03%	-
营业收入增长率%	11.92%	44.37%	-
净利润增长率%	14.52%	14.74%	-

五、 股本情况

单位：股

	本期期末	本期期初	增减比例%
普通股总股本	1,310,000,000	1,310,000,000	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、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

七、 与业绩预告/业绩快报中披露的财务数据差异

适用 不适用

八、 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	93,921.31
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）	10,188,300.06
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	441,689.93
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-937,906.10
非经常性损益合计	9,786,005.20
所得税影响数	1,889,861.44
少数股东权益影响额（税后）	
非经常性损益净额	7,896,143.76

九、 其他主要会计数据和指标

单位：元

	本期期末	本期期初	增减比例%
净资本	1,900,232,727.01	1,512,371,088.41	25.6%
风险资本准备总额	879,704,662.83	758,814,620.33	15.9%
净资本与风险资本准备总额的比例	216%	199%	-
净资本与净资产的比例	27%	24%	-
扣除客户保证金的流动资产	5,345,114,032.89	4,610,491,619.57	15.9%
扣除客户权益的流动负债	1,308,159,778.21	1,219,747,473.59	7.2%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	409%	378%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	24%	21%	-
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	20%	17%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	44%	42%	-
结算准备金额	1,926,561,763.43	1,673,944,727.36	15.1%

注：根据监管要求，数据口径为母公司口径。

十、 补充财务指标

适用 不适用

十一、 预计负债情况

适用 不适用

（一） 明细情况

项目	本期期末	本期期初	增减比例%
未决诉讼	418,767.91	445,737.05	-6.05%
合计	418,767.91	445,737.05	-6.05%

（二） 重大项目的确认依据说明

2015年1月，新永安期货公司收到来自 Alterra International Holdings Limited 公司（以下简称“ALterra 公司”）的律师函，要求赔偿其客户翁超颖诈骗的 588,600.00 欧元。2016年10月，Alterra 公司在塞浦路斯当地法院对新永安期货公司和交通银行提起诉讼，要求赔偿上述款项。截至资产负债表日，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 10%的预计负债，期末余额变化系汇率变动所致。

十二、 会计数据追溯调整或重述情况

√ 会计政策变更 □ 会计差错更正 □ 其他原因 □ 不适用

单位：元

科目	上年期末（上年同期）		上上年期末（上上年同期）	
	调整重述前	调整重述后	调整重述前	调整重述后
预收款项	741,569,234.77	741,569,234.77		
合同负债	0.00	0.00		
其他负债	0.00	0.00		

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

执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

单位：元

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

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 业务渠道和居间人渠道。期货交易实行保证金制度。根据《期货交易管理条例》的规定，保证金是指期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价证券，用于结算和保证履约。在实际业务中，客户多以资金的形式向期货公司交纳保证金，客户保证金带来的利息收入亦是公司收入的重要来源。

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

2. 期货投资咨询业务

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

3. 资产管理业务

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

4. 基金销售业务

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

5. 风险管理业务

公司风险管理业务主要通过风险管理子公司开展基差贸易、做市业务和场外衍生品业务等风险管理服务以及其他与风险管理相关的服务，涵盖期货期权上市品种及其产业链相关品种等。公司风险管理业务以服务实体产业客户为宗旨，以基本面研究为基础，依靠期、现货各方面的渠道资源，结合场内交易和场外交易两个市场，综合利用期货、期权、互换等金融衍生工具，致力于为客户提供一流的风险管理产品与服务，形成稳定、可持续的盈利模式和交易体系。

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

适用 不适用

2020年是极不平凡的一年，全球经济发展受到新冠疫情冲击，经过全社会的共同努力，中国经济率先实现“V”型反弹。迎来成立30周年的中国期货市场，在服务实体经济、助力脱贫攻坚等方面发挥了更大的作用。2020年，也是公司“十三五”战略规划的收官之年，公司立足期货市场价格发现和风险管理两大基本功能，通过强化党建工作、开展挖潜增效、提高专业能力、扩大内外部协同效能等工作，净利润、客户权益等多项关键指标再创新高，分类监管评级、信用评级、社会责任担当继续走在前列。

报告期内，公司经营情况良好，实现营业收入 25,469,307,566.01 元，同比增长 11.92%；净利润 1,146,009,285.30 元，同比增长 14.52%；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) 15.49%，公司盈利能力稳定。截止本期期末，公司归属于母公司所有者的权益 7,798,045,444.98 元，同比增长 13.61%，资产规模进一步增大。

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 19.00 亿元，风险资本准备总额为 8.80 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 216%，净资产为 69.91 亿元，净资本与净资产的比例为 27%，流动资产与流动负债的比例为 409%，负债与净资产的比例为 24%，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）及《期货公司监管报表填报说明 1.1 版》的要求计算，持续符合监管标准。

（二） 行业情况

√适用 □不适用

我国现代期货市场起步于二十世纪九十年代初期，经过 30 年的探索发展，中国期货市场逐步进入了稳定健康发展、经济功能日益显现的良性轨道，上市品种日益丰富，创新品种加快推出，市场规模稳步扩大。截至 2020 年末，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 90 个，其中商品期货 64 个、金融期货 6 个、商品期权 19 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。2020 年，我国期货市场在疫情期间运行平稳，避险功能有效发挥，有力支持了实体企业复工复产；品种创新和规则制度改革加速推进，市场运行质量不断提升；场外衍生品市场建设初见成效，服务实体经济空间不断扩展；对外开放品种增加，开放路径更加多元化；境外投资者参与度稳步提升，助力我国重要大宗商品定价影响力得到提高；期货经营机构综合实力提升，创新发展提速，我国期货市场各方面进展令人鼓舞。

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

(三) 财务分析

1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		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	20,011,941,230.41	44.10%	17,277,242,747.04	46.95%	15.83%
应收票据					
应收账款	46,631,793.13	0.10%	11,013,567.11	0.03%	323.40%
存货	1,487,519,112.57	3.28%	1,531,314,799.31	4.16%	-2.86%
长期股权投资	704,400,897.48	1.55%	486,824,372.27	1.32%	44.69%
投资性房地产	339,048,536.78	0.75%	10,035,071.69	0.03%	3,278.64%
固定资产	98,341,683.77	0.22%	232,130,750.50	0.63%	-57.64%
在建工程					
短期借款	1,237,622,713.74	2.73%	562,544,509.00	1.53%	120.00%
长期借款					
应收货币保证金	15,817,455,680.10	34.86%	11,325,661,929.26	30.78%	39.66%
应收质押保证金	1,048,318,156.00	2.31%	621,717,032.00	1.69%	68.62%
存出保证金	1,213,700.40	0.00%	841,892.55	0.00%	44.16%
交易性金融资产	3,948,448,688.50	8.70%	4,130,938,590.83	11.23%	-4.42%
应收款项融资	49,147,244.81	0.11%	1,793,095.85	0.00%	2,640.92%
预付款项	520,667,316.35	1.15%	302,040,051.78	0.82%	72.38%
应收结算担保金	69,440,425.56	0.15%	34,593,853.25	0.09%	100.73%
应收风险损失款	676,263.93	0.00%	17,004.09	0.00%	3,877.07%
应收佣金	3,266,507.87	0.01%	13,861,553.98	0.04%	-76.43%
其他应收款	450,700,058.47	0.99%	88,317,675.95	0.24%	410.32%
买入返售金融资产	7,100,000.00	0.02%	44,800,508.00	0.12%	-84.15%
其他流动资产	457,739,482.53	1.01%	221,297,636.02	0.60%	106.84%
其他权益工具投资	25,838,630.14	0.06%	26,845,000.00	0.07%	-3.75%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.00%	1,400,000.00	0.00%	0.00%
无形资产	23,955,193.26	0.05%	233,733,432.01	0.64%	-89.75%
长期待摊费用	11,508,050.85	0.03%	9,454,316.78	0.03%	21.72%
递延所得税资产	252,435,654.23	0.56%	193,591,338.28	0.53%	30.40%
应付货币保证金	30,659,518,043.39	67.57%	24,535,428,916.12	66.67%	24.96%
应付质押保证金	857,391,364.00	1.89%	434,089,168.00	1.18%	97.52%
交易性金融负债	758,704,192.57	1.67%	1,783,215,819.12	4.85%	-57.45%
期货风险准备金	256,567,983.48	0.57%	232,191,214.15	0.63%	10.50%
应付账款	92,533,817.44	0.20%	107,960,512.29	0.29%	-14.29%
预收账款	7,217,084.50	0.02%	741,569,234.77	2.02%	-99.03%
合同负债	479,222,469.14	1.06%	0.00	0.00%	
应付期货投资者保障基金	827,060.73	0.00%	671,681.51	0.00%	23.13%

应付手续费及佣金	1,153,012.55	0.00%	840,649.07	0.00%	37.16%
应付职工薪酬	877,368,031.14	1.93%	783,931,911.56	2.13%	11.92%
应交税费	156,179,183.84	0.34%	168,563,751.51	0.46%	-7.35%
其他应付款	1,329,791,897.91	2.93%	453,060,831.14	1.23%	193.51%
其他流动负债	374,447,383.37	0.83%	43,497,081.98	0.12%	760.86%
预计负债	418,767.91	0.00%	445,737.05	0.00%	-6.05%
递延所得税负债	188,807,500.29	0.42%	87,529,106.96	0.24%	115.71%
资产总计	45,377,194,307.14	100.00%	36,799,466,218.55	100.00%	23.31%

公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 14 号——收入》，公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务作为合同负债列示，上年末将该等款项列入预收账款列示。

资产负债项目重大变动原因：

- 1) 应收账款：期末较期初增加 323.40%，主要系子公司现货贸易赊销规模扩大，应收账款增加；
- 2) 长期股权投资：期末较期初增加 44.69%，主要系主要系公司权益法下确认的投资损益增加；
- 3) 投资性房地产：期末较期初增加 3278.64%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；
- 4) 固定资产：期末较期初减少 57.64%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；
- 5) 短期借款：期末较期初增加 120.00%，主要系子公司永安资本因业务规模扩大银行借款增加；
- 6) 应收货币保证金：期末较期初增长 39.66%，主要系客户持仓量升高，持仓占用保证金金额增加；
- 7) 应收质押保证金：期末较期初增长 68.62%，主要系本期客户质押业务规模增加，公司在交易所质押的仓单增加；
- 8) 存出保证金：期末较期初增长 44.16%，主要系子公司新永安证券业务规模扩大，存出保证金增加；
- 9) 应收款项融资：期末较期初增长 2640.92%，主要系子公司永安资本现货贸易以票据方式结算的业务增加；
- 10) 预付款项：期末较期初增长 72.38%，主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，预付货款增加；
- 11) 应收结算担保金：期末较期初增长 100.73%，主要系客户业务量增加，担保金增加；
- 12) 应收风险损失款：期末较期初增长 3877.07%，主要系本期原油客户穿仓客户损失增加；
- 13) 应收佣金：期末较期初减少 76.43%，主要系应收资产管理业务佣金较上期期末减少；
- 14) 其他应收款：期末较期初增加 410.32%，主要系应收理财产品清算款、认购款项以及子公司永安资本场外应收款增加；
- 15) 买入返售金融资产：期末较期初减少 84.15%，主要系本期期末持有的国债逆回购余额减少；
- 16) 其他流动资产：期末较期初增加 106.84%，主要系子公司新永安控股融出资金增加；
- 17) 无形资产：期末较期初减少 89.75%，主要系本期公司将自建办公楼对外出租；

- 18) 递延所得税资产：期末较期初增加 30.40%，主要系期末公允价值变动浮亏大幅增加；
- 19) 应付货币保证金：期末较期初增加 24.96%，主要系客户权益增长；
- 20) 应付质押保证金：期末较期初增加 97.52%，主要系本期客户质押业务增加；
- 21) 交易性金融负债：期末较期初减少 57.45%，主要系期末结构化主体其他投资者享有的份额减少；
- 22) 预收账款：期末较期初减少 99.03%，主要系本期执行新收入准则影响；
- 23) 应付手续费及佣金：期末较期初增加 37.16%，主要系应付 IB 业务费增加；
- 24) 其他应付款：期末较期初增加 193.51%，主要系子公司永安资本衍生业务应付款增加；
- 25) 其他流动负债：期末较期初增加 760.86%，主要系本期子公司代理买卖证券款增加；
- 26) 递延所得税负债：期末较期初增加 115.71%，主要系本期公允价值变动浮盈增加。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		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	25,469,307,566.01	-	22,757,609,299.75	-	11.92%
手续费及佣金净收入	677,157,713.06	2.66%	516,308,160.73	2.27%	31.15%
其中：经纪业务手续费收入	568,458,668.73	2.23%	427,857,510.01	1.88%	32.86%
资产管理业务收入	41,222,039.96	0.16%	35,929,709.16	0.16%	14.73%
投资咨询业务收入	1,997,922.28	0.01%	2,912,778.01	0.01%	-31.41%
代理销售金融产品收入	65,479,082.09	0.26%	49,608,163.55	0.22%	31.99%
其他手续费及佣金收入	-	0.00%	-	0.00%	
利息净收入	499,077,057.36	1.96%	552,305,587.41	2.43%	-9.64%
投资收益	899,362,995.71	3.53%	712,152,946.29	3.13%	26.29%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	242,716,171.58	0.95%	212,858,720.40	0.94%	14.03%
公允价值变动收益	194,887,036.09	0.77%	438,751,993.31	1.93%	-55.58%
汇兑收益	7,272,235.82	0.03%	-3,233,184.93	-0.01%	不适用
其他业务收入	23,179,084,179.39	91.01%	20,533,400,840.53	90.23%	12.88%
其中：风险管理业务收入	23,133,547,521.31	38.95%	20,512,110,273.07	45.03%	-3.20%
其他收益	12,466,348.58	0.05%	7,922,956.41	0.03%	57.34%
二、营业成本	24,160,089,841.10	94.86%	21,577,925,727.76	94.82%	11.97%
提取期货风险准备金	24,393,773.42	0.10%	19,051,965.16	0.08%	28.04%
税金及附加	11,874,820.87	0.05%	8,564,808.13	0.04%	38.65%

业务及管理费	1,012,549,588.68	3.98%	1,095,510,076.60	4.81%	-7.57%
研发费用		0.00%	-	0.00%	
信用减值损失	36,394,654.37	0.14%	3,243,087.24	0.01%	1,022.22%
其他资产减值损失	462,861,109.02	1.82%	354,745,444.10	1.56%	30.48%
其他业务成本	22,612,015,894.74	88.78%	20,096,810,346.53	88.31%	12.52%
三、营业利润	1,309,217,724.91	5.14%	1,179,683,571.99	5.18%	10.98%
营业外收入	140,200,623.91	0.55%	77,097,898.60	0.34%	81.85%
营业外支出	4,312,050.62	0.02%	5,732,298.77	0.03%	-24.78%
四、利润总额	1,445,106,298.20	5.67%	1,251,049,171.82	5.50%	15.51%
五、净利润	1,146,009,285.30	4.50%	1,000,720,583.15	4.40%	14.52%

项目重大变动原因：

- 1) 经纪业务手续费收入：较上期相比增长 32.86%，主要系本期交易所减收增加；
- 2) 投资咨询业务收入：较上期相比下降 31.41%，主要系本期投资咨询业务减少；
- 3) 代理销售金融产品收入：较上期相比增长 31.99%，主要系本期基金销售业务存量规模增大，业绩较好；
- 4) 公允价值变动收益：较上期相比下降 55.58%，变动系本期理财产品公允价值下降；
- 5) 汇兑收益：上年同期金额为-3,233,184.93 元，变动系外汇汇率波动；
- 6) 其他收益：较上期相比增长 57.34%，主要系政府补助增加；
- 7) 税金及附加：较上期相比增长 38.65%，主要系房产税增加；
- 8) 信用减值损失：较上期相比增长 1022.22%，主要系本期子公司新永安期货应收货币保证金及新永安证券融出资金增加，相应坏账准备增加；
- 9) 其他资产减值损失：较上期相比增长 30.48%，主要系本期存货跌价损失计提增加；
- 10) 营业外收入：较上期相比增长 81.85%，主要系本期风险管理子公司客户根据行情判断，执行合同损失超过已交保证金金额，自主选择提前终止履约，放弃保证金的情况增多所致。

(2) 收入构成

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
手续费收入	677,157,713.06	516,308,160.73	31.15%
利息净收入	499,077,057.36	552,305,587.41	-9.64%
其他业务收入	23,179,084,179.39	20,533,400,840.53	12.88%
投资收益	899,362,995.71	712,152,946.29	26.29%
公允价值变动收益	194,887,036.09	438,751,993.31	-55.58%
汇兑收益	7,272,235.82	-3,233,184.93	不适用

其他收益	12,466,348.58	7,922,956.41	57.34%
------	---------------	--------------	--------

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

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	1,792,214	1,195,240	49.95%	13,302,542.51	10,766,394.62	23.56%
郑州商品交易所	棉花一号	4,519,876	2,741,493	64.87%	29,240,722.04	18,880,542.65	54.87%
郑州商品交易所	棉花期权	275,763	180,409	52.85%	35,655.24	20,397.18	74.80%
郑州商品交易所	干制红枣	218,048	811,918	-73.14%	1,095,184.08	4,175,144.78	-73.77%
郑州商品交易所	棉纱	155,327	43,763	254.93%	1,593,063.30	469,508.24	239.30%
郑州商品交易所	玻璃	6,555,783	2,778,220	135.97%	21,975,994.27	7,940,426.07	176.76%
郑州商品交易所	粳稻	484	140	245.71%	2,822.50	807.85	249.38%
郑州商品交易所	晚籼稻	10	1,302	-99.23%	59.13	6,939.23	-99.15%
郑州商品交易所	甲醇 N	13,739,591	13,821,090	-0.59%	26,993,853.62	31,717,278.83	-14.89%
郑州商品交易所	甲醇期权	375,064	4,782	7743.25%	17,069.95	258.15	6512.42%
郑州商品交易所	菜籽油 N	2,597,502	986,190	163.39%	22,140,563.35	6,983,387.82	217.05%
郑州交易所	短纤	846,512			2,648,547.35		
郑州商品交易所	普麦	24	5	380.00%	278.22	58.695	374.01%
郑州商品交易所	早籼稻 N	34	58	-41.38%	178.95	275.79	-35.11%
郑州商品交易所	菜籽粕	4,475,503	4,178,455	7.11%	10,839,084.85	9,664,648.61	12.15%
郑州商品交易所	菜籽粕期权	568,678			20,554.20		
郑州商品交易所	油菜籽	37	2,063	-98.21%	191.69	8,270.511	-97.68%
郑州商品交易所	纯碱	2,605,053	98,552	2543.33%	8,167,291.67	320,219.432	2450.53%
郑州商品交易所	硅铁	1,088,499	363,711	199.28%	3,238,926.80	1,084,014.56	198.79%
郑州商品交易所	锰硅	1,484,339	456,010	225.51%	4,868,365.68	1,601,558.48	203.98%
郑州商品交易所	白糖	3,783,955	3,647,754	3.73%	19,841,444.59	19,211,610.26	3.28%
郑州商品交易所	白糖期权	856,097	523,060	63.67%	52,895.62	35,193.91	50.30%
郑州商品交易所	PTA	16,467,336	18,192,776	-9.48%	30,184,712.31	51,958,668.54	-41.91%
郑州商品交易所	PTA 期权	586,600	7,850	7372.61%	21,783.91	374.28	5720.22%

郑州商品交易所	尿素	838,132	323,862	158.79%	2,809,071.08	1,127,059.11	149.24%
郑州商品交易所	强麦 N	4,793	4,056	18.17%	24,709.87	19,558.13	26.34%
郑州商品交易所	新动力煤	2,142,837	1,265,105	69.38%	12,679,641.56	7,343,616.46	72.66%
郑州商品交易所	动力煤期权	373,447			30,576.77		
大连商品交易所	黄大豆	1,770,185	724,623	144.29%	8,215,790.81	2,525,718.50	225.29%
大连商品交易所	豆二	471,080	497,708	-5.35%	1,539,481.30	1,517,382.83	1.46%
大连商品交易所	玉米	11,321,500	6,462,515	75.19%	25,991,058.07	12,305,798.55	111.21%
大连商品交易所	玉米期权	360,755	1,008,603	-64.23%	10,698.93	21,329.99	-49.84%
大连商品交易所	铁矿石	15,630,982	20,829,745	-24.96%	116,093,327.99	140,404,081.84	-17.31%
大连商品交易所	铁矿石期权	342,683	6,105	5513.15%	56,237.30	1,291.33	4254.99%
大连商品交易所	焦炭	2,175,530	3,023,841	-28.05%	44,885,988.60	60,468,956.40	-25.77%
大连商品交易所	聚乙烯	4,238,859	3,936,729	7.67%	14,430,708.30	15,221,053.05	-5.19%
大连交易所	聚乙烯期权	15,284			829.84		
大连商品交易所	豆粕	13,483,909	10,814,046	24.69%	39,968,407.78	30,155,771.13	32.54%
大连商品交易所	豆粕期权	1,772,045	2,624,604	-32.48%	100,014.10	97,590.88	2.48%
大连商品交易所	棕榈油	8,575,803	4,690,313	82.84%	48,459,331.29	24,384,918.99	98.73%
大连商品交易所	聚氯乙烯	3,411,237	2,689,387	26.84%	11,114,511.26	8,911,801.96	24.72%
大连交易所	聚氯乙烯期权	139,120			10,425.58		
大连商品交易所	豆油	5,236,757	3,898,616	34.32%	34,053,055.87	23,201,624.43	46.77%
大连商品交易所	胶合板	130	16	712.50%	1,277.70	125.3375	919.41%
大连商品交易所	玉米淀粉	760,239	649,063	17.13%	1,966,300.00	1,492,498.18	31.75%
大连商品交易所	苯乙烯	2,253,322	242,359		7,034,234.27	881,072.26	
大连商品交易所	乙二醇	3,451,057	4,042,475	-14.63%	13,226,340.80	19,013,576.61	-30.44%
大连商品交易所	纤维板	45,446	53,802	-15.53%	61,476.10	108,175.58	-43.17%
大连商品交易所	鸡蛋	3,956,009	1,452,287	172.40%	14,093,344.64	6,102,627.89	130.94%
大连商品交易所	焦煤	1,221,339	1,376,168	-11.25%	9,373,113.51	10,704,600.65	-12.44%
大连交易所	液化石油气	1,904,116			13,207,710.28		
大连交易所	液化石油气期权	31,443			6,777.55		

大连商品交易所	聚丙烯	7,281,828	5,676,759	28.27%	26,647,669.03	23,620,273.57	12.82%
大连商品交易所	聚丙烯期权	161,326			7,868.89		
大连商品交易所	粳米	314,268	17,838	1661.79%	1,110,712.00	64,868.80	1612.24%
上海期货交易所	白银	8,242,043	4,431,290	86.00%	63,394,705.79	27,814,347.93	127.92%
上海期货交易所	铝	1,304,874	870,435	49.91%	9,170,819.00	6,055,351.32	51.45%
上海交易所	铝期权	34,054			3,573.52		
上海期货交易所	黄金	919,662	769,441	19.52%	36,479,086.02	24,845,660.83	46.82%
上海期货交易所	黄金期权	37,338	1,543	2319.83%	22,157.86	1,325.99	1571.04%
上海期货交易所	沥青	7,430,826	4,923,443	50.93%	17,986,666.04	15,799,003.61	13.85%
上海期货交易所	铜	1,242,557	1,209,632	2.72%	30,409,068.07	28,922,596.02	5.14%
上海期货交易所	铜期权	101,934	56,437	80.62%	23,941.79	9,157.81	161.44%
上海期货交易所	燃料油	10,244,898	5,107,755	100.58%	18,332,094.23	12,330,488.44	48.67%
上海期货交易所	热轧卷板	4,399,539	4,092,488	7.50%	16,396,349.35	14,778,128.71	10.95%
上海期货交易所	镍	3,253,112	4,376,741	-25.67%	35,964,811.65	49,313,576.49	-27.07%
上海期货交易所	铅	297,121	282,446	5.20%	2,190,707.80	2,330,509.11	-6.00%
上海期货交易所	螺纹	21,617,961	30,215,630	-28.45%	78,434,209.80	110,056,856.66	-28.73%
上海期货交易所	橡胶	2,492,403	1,872,023	33.14%	32,216,436.63	22,337,475.96	44.23%
上海期货交易所	天胶期权	116,512	78,596	48.24%	45,425.81	28,043.56	61.98%
上海期货交易所	锡	96,783	59,280	63.26%	1,358,115.21	833,148.42	63.01%
上海期货交易所	漂针浆	2,123,118	1,726,371	22.98%	10,049,988.83	8,351,531.63	20.34%
上海期货交易所	不锈钢	292,076	34,473	747.26%	1,963,116.27	254,454.01	671.50%
上海期货交易所	线材	78	3,350	-97.67%	309.78	12,989.48	-97.62%
上海期货交易所	锌	1,701,836	2,553,059	-33.34%	15,527,743.71	25,976,778.44	-40.22%
上海交易所	锌期权	44,886			7,823.83		
中国金融期货交易所	国债 10 年期	613,568	371,638	65.10%	60,959,805.36	36,361,138.49	67.65%
中国金融期货交易所	中证 500	1,176,434	766,046	53.57%	137,967,036.69	76,427,099.30	80.52%
中国金融期货交易所	沪深 300	863,268	760,670	13.49%	112,881,285.09	85,702,620.74	31.71%
中国金融期货交易所	上证 50	389,437	372,346	4.59%	36,217,327.13	31,709,790.43	14.21%

中国金融期货交易所	沪深 300 期权	295,238	2,365	12383.64%	242,874.59	3,096.91	7742.48%
中国金融期货交易所	国债 5 年期	416,569	132,857	213.55%	42,051,496.00	13,227,525.01	217.91%
中国金融期货交易所	国债 2 年期	292,787	455,176	-35.68%	58,991,276.21	91,244,564.65	-35.35%
上海国际能源交易中心	国际铜	13,260			342,262.22		
上海国际能源交易中心	低硫燃料油	433,013			1,037,601.24		
上海国际能源交易中心	20 号胶	277,132	70,754	291.68%	2,720,751.90	747,781.59	263.84%
上海国际能源交易中心	原油	1,343,222	554,422	142.27%	38,662,028.88	24,733,174.53	56.32%
合计	-	228,785,329	192,496,173	18.85%	1,505,543,373.2	1,264,749,567.02	19.04%

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	568,458,668.73	2.23%	427,857,510.01	1.88%
资产管理业务收入	41,222,039.96	0.16%	35,929,709.16	0.16%
投资咨询业务收入	1,997,922.28	0.01%	2,912,778.01	0.01%
代理销售金融产品收入	65,479,082.09	0.26%	49,608,163.55	0.22%
合计	677,157,713.06	2.66%	516,308,160.73	2.27%

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		562,990,666.17	2.21%
香港特别行政区[注]		37,118,723.41	0.15%
浙江省(不含杭州本部)	15	33,165,957.69	0.13%
辽宁省	3	4,050,564.40	0.02%
山东省	7	7,511,514.27	0.03%
北京市	1	2,292,498.49	0.01%
广东省	2	4,287,513.07	0.02%
上海市	1	2,537,324.04	0.01%
福建省	2	2,749,116.73	0.01%
河南省	1	2,837,712.63	0.01%
江苏省	2	2,375,334.70	0.01%
吉林省	1	2,879,727.20	0.01%
天津市	1	1,423,335.87	0.01%
重庆市	1	1,930,166.43	0.01%
河北省	2	2,370,476.36	0.01%
湖北省	1	1,129,279.42	0.00%
四川省	1	2,109,450.21	0.01%
湖南省	1	2,010,239.53	0.01%
江西省	1	957,049.02	0.00%
陕西省	1	431,063.42	0.00%
合计	44	677,157,713.06	2.67%

注：香港特别行政区系指公司子公司新永安期货、新永安证券、新永安资管和永安国际金融。

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	599,455,204.98	2.35%	618,496,985.72	2.72%
其中：境内保证金利息收入	550,158,337.54	2.16%	579,363,001.64	2.55%

境外利息收入	36,686,999.08	0.14%	30,901,144.79	0.14%
境内其他利息收入	12,609,868.36	0.05%	8,232,839.29	0.04%
利息支出	100,378,147.62	0.39%	66,191,398.31	0.29%
合计	499,077,057.36	1.96%	552,305,587.41	2.43%

3)

其他业务收入

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	23,133,547,521.31	90.83%	20,512,110,273.07	90.13%
租赁收入	14,833,690.31	0.06%	302,433.99	0.00%
交易所课题费、 活动费等收入	24,587,614.49	0.10%	19,579,535.77	0.09%
其他	5,973,913.39	0.02%	1,375,308.09	0.01%
合计	23,178,942,739.50	91.01%	20,533,367,550.92	90.23%

收入构成变动的原因：

本期公司收入结构无重大变动，各项收入变动原因请参见本节“二、经营情况回顾（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	685,509,624.56	2.69%	否
2	客户 2	552,258,694.71	2.17%	否
3	客户 3	353,198,007.90	1.39%	否
4	客户 4	341,078,962.01	1.34%	否
5	客户 5	322,708,814.95	1.27%	否
合计		2,254,754,104.13	8.86%	-

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	5,032,115.88	0.02%	否
2	客户 B	2,106,113.45	0.01%	是
3	客户 C	1,689,069.41	0.01%	否
4	客户 D	1,485,921.76	0.01%	否
5	客户 E	1,203,344.61	0.00%	否
合计		11,516,565.11	0.05%	-

(4) 主要供应商情况

单位：元

序号	供应商名称	采购金额	年度采购占比	是否存在关联关系
1	供应商 1	1,022,727,120.36	4.45%	否
2	供应商 2	990,636,571.44	4.31%	否
3	供应商 3	435,109,416.50	1.89%	否
4	供应商 4	393,452,963.81	1.71%	否
5	供应商 5	378,391,665.35	1.65%	否
合计		3,220,317,737.46	14.01%	-

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	4,544,716,739.44	1,638,715,958.63	177.33%
投资活动产生的现金流量净额	7,921,421.99	8,527,609.62	-7.11%
筹资活动产生的现金流量净额	-919,992,453.23	379,814,890.80	-342.22%

现金流量分析：

1. 经营活动产生的现金流量净额：本期较上期增加约 29.06 亿元，主要系与上期相比，本期交易性金融资产净减少带来现金增加 15.21 亿元，其他经营活动现金净增加 11.72 亿元；

2. 筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少 13 亿元，主要系本期合并结构化主体清算支付的现金 16 亿元；

3. 本期经营活动产生的现金流量净额较本期净利润金额多约 33.99 亿元，主要系公司客户权益、保证金及往来款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

√适用 □不适用

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	总资产	净资产	营业收入	净利润
永安	控股	风险	5,875,018,575.03	1,876,612,360.75	23,122,928,740.78	207,355,123.05

资本	子公司	管理业务				
永安国富	参股公司	资产管理	3,425,260,283.55	2,155,552,136.00	4,280,356,532.96	735,407,409.27

主要控股参股公司情况说明

永安资本为公司全资子公司，本期注册资本由 10 亿元增加至 13 亿，2020 年营业收入 231.23 亿元，较 2019 年同期收入 200.66 亿元增长 15.23%；2020 年净利润 2.07 亿元，较 2019 年同期净利润 1.36 亿元增加 52.62%；永安资本公司 2020 年度净利润占公司合并报表净利润的 18.09%。永安资本公司坚持服务实体经济，加强产业链上下游合作交流，促进产融结合，业务规模发展迅速，优势品种不断做强。

永安国富为公司联营企业，成立于 2015 年 1 月，本期注册资本由 8,420 万元增加至 1 亿元。2020 年营业收入 42.80 亿元，较 2019 年同期营业收入 10.42 亿元增长 310.95%；2020 年净利润 7.35 亿元，较 2019 年同期净利润 6.48 亿元增长 13.33%。2020 年度，公司确认投资收益 2.31 亿元。永安国富积极强化后台建设，提升服务品质，开辟投资理财新思路。目前下设浙江永安国富实业有限公司、永富物产有限公司和永富置业有限公司三家全资子公司，业务范围进一步扩大。

公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

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

截至报告期末，纳入合并范围的结构化主体的净资产为 48,789,602.31 元，公司享有的权益账面价值为 5,783,362.22 元，公司以外各方所持上述结构性主体的权益账面价值为 43,006,240.09 元。对于公司以外各方所持上述结构化主体的权益，公司确认为交易性金融负债。

2、合并财务报表的合并范围内是否包含私募基金管理人

是 否

3、主要分公司、营业部情况

截至本期末，本公司下设北京、上海、广州、山东、杭州、西湖、辽宁、深圳、宁波、绍兴、温州、天津、大连、吉林、河南、西安 16 家分公司，福州、台州、嘉兴、义乌、余姚、金华、无锡、萧山、济南、青岛、长沙、石家庄、瑞安、南昌、鞍山、重庆、淄博、武汉、舟山、杭州潮王路、潍坊、成都、诸暨、厦门、烟台、日照、南京、唐山 28 家营业部。

本报告期，公司新设西湖分公司。

4、重大的资产处置、置换、剥离情况

无

5、合规情况

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

(五) 研发情况

适用 不适用

研发支出情况：

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

研发人员情况：

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

研发项目情况：

本期无研发支出。

(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

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。我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

（一）手续费收入的确认

1. 事项描述

相关信息披露详见财务报表附注三（二十八）及五(二)之1。

永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入（含经纪业务手续费收入和交易所减收手续费收入）、资产管理业务收入、基金销售业务收入及投资咨询收入等。经纪业务手续费收入在与客户办理每日款项清算时确认收入；交易所减收手续费收入在交易所资金清算完成时确认收入；资产管理、基金销售和投资咨询业务收入在相关服务已经提供，相关的经济利益能够流入及收入的金额能够可靠地计量时，按合同约定方式确认当期收入。

由于手续费收入是永安期货公司关键业绩指标之一，可能存在重大错报风险，因此我们将手续费收入的确认确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

（1）经纪业务手续费收入

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

2) 对于涉及手续费收入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，对与该系统相关的信息技术一般控制的设计和运行的有效性进行测试和评价，并测试和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的有效性。

3) 获取经纪业务手续费收入明细账，并与报表数、总账数核对。

4) 将财务账面记录的经纪业务手续费收入与业务系统中记录的数据进行核对，并执行分析性复核，包括：① 年度比较，分析变动是否合理；② 获取全国期货市场成交数据，将永安期货公司期货代理成交数据与全国市场趋势进行比较分析；③ 选取成交金额较大的期货品种进行月度波动分析，将永安期货公司每月经纪业务手续费收入、成交金额与全国市场总成交金额变动进行比较分析。

（2）交易所减收手续费收入

1) 了解与交易所减收手续费收入确认相关的关键内部控制，评价其设计是否有效，并测试相关内部控制运行的有效性。

2) 获取交易所减收手续费收入明细账，并与报表数、总账数核对。

3) 选取样本，对交易所对账单中交易所减收手续费收入数据与账面进行核对。

(3) 对于资产管理业务收入，取得业务台账，与账面数据核对；抽取样本，核对管理费和业绩报酬的费率与合同约定是否一致，并复核管理费和业绩报酬的计算过程。

(4) 对于投资咨询业务和基金销售业务收入，取得业务台账，与账面数据核对；抽取部分业务项目，获取银行流水，核对明细账、业务台账与银行流水记录是否一致。

(二) 以公允价值计量的金融工具估值

1. 事项描述

相关信息披露详见财务报表附注九。

公司金融工具的估值是基于市场数据与估值模型的结合，通常需要输入较多的变量。在这些输入值当中，大部分输入值均取自于流动市场的现有数据。对于第二层次的金融工具而言，可观察的输入值无法可靠获取时，会涉及永安期货公司管理层(以下简称管理层)的重大判断及估计。

由于部分以公允价值计量的金融工具公允价值的评估较为复杂，且在确定估值模型使用的输入值时涉及管理层判断的程度重大，我们将金融工具公允价值的评估识别为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解并评估管理层用于识别、计量和管理金融工具估值风险相关的内部控制流程的有效性。

(2) 评估公司运用的估值方法的适当性，并与同类或类似行业进行比较。

(3) 对于第一层次金融工具的估值，我们独立获取可观察市场资料，并通过审计抽样的方式与公司使用的估值价格进行比较。

(4) 对于分类为第二层次的权益工具的估值，我们独立获取相关资产管理人提供的资产净值，通过审计抽样的方式与公司使用的估值价格进行比较，并向资产管理人函证确认净值。

(5) 对于分类为第二层次的衍生金融工具的估值，管理层依赖直接或间接可观察的参数。我们基于对当前行业实务的了解，评价管理层作出的假设和判断。

1) 获取以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债明细账，并与报表数、总账数核对。

2) 获取公司场外衍生品交易明细表，通过抽样的方式获取交易确认书等资料，了解交易相关条款及估值要素，并与交易明细表进行核对。

3) 获取盯市报告和外部估值数据，结合公司的估值方法及管理层在估值方法中采用的关键参数，

通过抽样的方式独立复核部分衍生金融工具估值的计算。

4) 获取远期合同中相关标的公允价值，重新计算浮动盈亏。

(6) 评价财务报表的相关披露是否符合企业会计准则的披露要求，适当反映了金融工具估值风险。”

(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

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

执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响：调减预收款项 741,569,234.77 元，分别调增合同负债、其他流动负债 657,269,581.43 元、84,299,653.34 元。

(八) 合并报表范围的变化情况

适用 不适用

合并范围增加：

本公司作为资产管理计划管理人并投资永盈 1 号集合资产管理计划，对上述资产管理计划拥有实质性权利，且公司通过在上述资产管理计划中享有份额、收取管理费或业绩报酬的形式获得可变回报为重大，故将其纳入公司合并财务报表合并范围。

合并范围减少：

本公司管理的永利 1 号资产管理计划、永利 2 号资产管理计划和永屹 1 号资产管理计划因已到期清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

(九) 企业社会责任

1. 精准扶贫工作情况

适用 不适用

2020年是决胜全面建成小康社会、决战脱贫攻坚之年，也是“十三五”规划收官之年。在突如其来的新冠肺炎疫情冲击下，公司深入学习习近平总书记关于扶贫工作的重要论述，贯彻落实中央和省委、省政府决策部署，努力克服疫情影响，充分发挥期货专业优势，持续拓宽扶贫工作思路，不断推进精准扶贫工作，取得了优异成绩。2020年7月，在中期协开展的期货公司扶贫工作考评中再次荣获第一名，连续四年蝉联榜首。2020年10月，成为中国证监会发起成立的“资本市场扶贫公益联盟”首批会员。

公司全年共投入扶贫专项资金468万余元，其中“保险+期货”专业扶贫方面，共开展项目40个，承保现货33.36万吨，承保货值近20亿元，覆盖种植面积100余万亩，覆盖新疆、云南、广西等17个省35个县区2万余户农户，帮助农企农户有效应对生产经营风险，提高收入，在相关项目中公司捐赠191万余元；产业扶贫方面，再次在河南省桐柏县捐赠20万元；消费扶贫方面，累计投入194万余元；教育扶贫方面，捐赠61万元，特别是2020年7月，公司赴贵州省威宁县开展教育帮扶活动，用于当地九三中学和二塘中学改善教学生活条件，并成立了“九三中学永安民族艺术团”，予以长期关心支持；乡村振兴方面，向公司结对帮扶的浙江省常山县客弄村困难人员送温暖，在多年帮扶下，该村于2020年3月获得“2019年度浙江省善治示范村”称号。公司工会支持消费扶贫67万多元，共同助力打赢脱贫攻坚战。

2. 其他社会责任履行情况

适用 不适用

2020年1月27日，公司向浙大教育基金会捐款200万元，用于支持浙江大学医学院附属第一医院采购防控新冠肺炎疫情所需医疗用品和救治所需医疗设备，奖励疫情防控一线医护人员（含浙江支援武汉医疗队），加强新冠肺炎疾病的科学研究，促进传染病学科的研究与发展。

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25,469,307,566.01元，同比增长11.92%；净利润1,146,009,285.30元，同比增长14.52%，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

是否自愿披露

是 否

（一） 行业发展趋势

经过三十年的发展，期货业已成为我国现代金融业的重要组成部分。在新品种快速推出、市场规模稳步增加、场外业务迅速发展的情况下，期货市场规模保持稳定增长，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、财富管理和风险管理等多领域拓展，期货上市品种供给进一步加大，衍生品工具体系日益完善，遵循市场化法制化国际化的方向，推动期货经营机构实施差异化、特色化、专业化发展。在健全市场法治建设方面，健全的法治是期货市场健康发展的基石。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。在加大市场供给方面，符合实体经济发展需求的商品期货将加快研发，更多金融期货期权产品也将适时推出，为各类机构投资者提供更为有效和精细化的避险工具。在支持服务实体经济方面，经过多年的探索和实践，期货风险管理子公司作为期货公司从事风险管理业务的平台将在服务供给侧结构性改革、推进“一带一路”国家战略、促进实体企业转型升级上发挥更强作用。在精准扶贫、服务“三农”方面，深耕“保险+期货”等创新模式，把扶贫助农做精、做细、做实。风险管理业务、财富管理业务随着我国经济的发展发展潜力和空间巨大，期货公司凭借自身专业能力和资源，综合实力和核心竞争力将显著提升。未来，随着期货公司外资股比限制取消，具有良好国际声誉和经营业绩的境外金融机构将加快进入，我国期货品种、机构、投资者的国际化水平也将加速推进，期货市场竞争活力将进一步释放，在服务经济高质量发展和国家重大战略方面将发挥更大的作用。

（二） 公司发展战略

继往开来，公司站在建党 100 周年、期货市场下一个 30 年的发展新起点上，将谋划好公司“十四五”战略规划，以打造“大宗商品投资银行、大类资产配置专家、产融资源整合者”为战略目标，努力成为国内领先、国际知名的“衍生品投资银行”，助力建设高效率、有活力、开放型的期货市场，为构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局贡献力量。

（三） 经营计划或目标

2021 年，公司将通过强党建、建生态、筑平台、创价值，做好“十四五”开局工作，夯实公司高质量发展根基，建设财富管理和大宗商品金融服务等两大资源协同的外部生态圈，构筑资本运作、投资研究、私募孵化等三大相互赋能的内部平台，夯实风险控制、数字技术、人力资源、企业文化等四大保障，扩大总部与分支机构、母公司与子公司两方面协同效能，打造最具价值创造力的期货公司。

(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

√适用 □不适用

(一) 持续到本年度的风险因素

1. 期货、期权经纪业务风险

经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日趋激烈，手续费率呈逐渐下降态势，公司经纪业务可能面临着盈利下降风险。

应对措施：公司构建了高效的经纪业务集中管理模式，依托集中交易、集中清算、集中财务、集中风控四大技术平台来实现业务连接和安全运行。公司期货、期权经纪业务以产业客户为基础，始终坚持服务客户，发挥各营业网点区域优势，成立专门的期货品种业务团队，以进一步扩大市场，同时采取多种措施，在金融衍生品上寻求突破。

2. 利息收入下滑风险

利息收入是期货公司营业收入的重要来源之一。公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。公司的客户保证金规模、自有资金规模和市场利率的变化将影响公司的营业收入和净利润。如果市场利率出现大幅下降，或者客户保证金、自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。此外，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。

应对措施：一方面，公司通过多项措施，做大公司权益规模；另一方面公司已与多家保证金存管银行开展业务合作，存款利率由各银行报价，按竞争报价原则协定存款。同时，公司通过扩大投资标的，进一步拓展自有资金投资范围，在稳健投资的前提下，提高自有资金收益率。

3. 期货投资咨询业务风险

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

应对措施：公司以提升研究水平为目标，强化研究在公司发展中的核心地位，全面整合研究资源。

同时进一步强调对投资咨询业务的规范化管理，明确投资咨询业务流程及审核流程，并对投资咨询客户进行定期回访。

4. 资产管理业务风险

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

应对措施：公司努力探索资产管理业务发展新方向，积极向大类资产配置转型。一是抓好优质资产，以统分结合的方式，开发优秀投顾；二是加强大型机构资金对接；三是做好 FOF 等自主品牌的产品创设工作。

5. 基金销售业务风险

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

应对措施：公司积极推进基金销售的互联网化，特别是移动端的开发使用。对于潜在经营风险，公司根据基金产品尽职调查结果，严格按照公司风险评估制度要求，对所销售产品的风险状况进行审慎评估，并据此划分其风险等级，确定适合购买的客户类别和范围；同时根据基金销售适当性管理制度，向客户推介基金产品之前，了解客户的身份、财产和收入状况、金融知识和投资经验、投资目标、风险偏好等基本情况，评估其购买基金产品的适当性；此外，公司通过 CRM 系统处理公司基金产品直销、代销数据，明确业务人员和客户归属关系，完善客户资产信息，统一业务流程，有助于公司进一步提高业务人员的服务效率。

6. 业务创新风险

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

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

7. 投资风险

在风险可控的情况下，公司使用自有资金开展投资业务，配置范围包括权益、商品、债券、信托等。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的市场风险和操作风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损从而影响公司盈利的可能。

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

8. 合规风险

金融行业属于国家特许经营行业，公司具体开展业务时需满足净资本、风险管理、公司治理、人才储备、机构设置、合规运营等方面满足监管部门的要求。目前中国证券监督管理委员会根据监管需要，以期货公司风险管理能力为基础，结合公司市场影响力和持续合规状况，对期货公司进行分类评价。分类评价结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标。如果公司未来评级出现下调，可能对公司现有业务开展、新业务申请等方面产生不利影响。

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

9. 信息技术系统风险

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

公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。

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

10. 信用风险

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

应对措施：一是严格落实客户实名制原则，加强客户适当性管理，有效识别客户身份，并了解客户信用状况、财务状况及风险承受能力等信息；二是加强市场风险识别，严格落实客户保证金管理制度及强平风控措施，确保强平操作规范性及有效性；三是建立有效资金存放制度，并加强资金试算平衡管理，确保资金安全；四是建立仓库管理制度，加强对仓储企业的资信调查及日常巡库；五是建立客户授信制度，通过对客户信用评定，实现客户分类管理；六是明确内部决策、执行、监督等方面的职责权限，形成科学有效的职责分工制衡机制，确保有关信用风险防范机制得到有效落实。

11. 居间人管理风险

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

应对措施：公司已制定居间人管理办法，明确规范居间人行为准则。公司要求在对居间人充分了解

的情况下，方可与之签署居间合同，确立居间关系。公司对居间人开展执业前培训，定期进行回访，并对居间人开展年度培训，强化居间人合法合规意识。

12. 人才流失和储备不足风险

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

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

13. 政策风险

公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家法律、法规及规范性文件的约束。如果国家关于期货行业的有关法律、法规和政策（如税收政策、业务许可、利率政策、业务收费标准及收费方式等）发生变化，可能会引起期货市场的波动和期货行业发展环境的变化，进而对公司的各项业务产生影响。目前，期货市场快速发展，期货法律法规的建设处于完善阶段，相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会对期货行业的经营模式和竞争方式产生影响。公司无法保证上述变化不会对公司的业务、经营业绩和财务状况产生重大不利影响，也无法保证能够及时调整以充分适应上述变化。如果公司未能完全遵守相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化，可能导致公司被罚款、暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。

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

14. 重大诉讼、仲裁风险

截至报告期末，公司无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现重大诉讼或仲裁，可能会公司经营带来不利影响。

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

15. 商标风险

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

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

(二) 报告期内新增的风险因素

无

第五节 重大事件

一、 重大事件索引

事项	是或否	索引
是否存在诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	五.二.(一)
是否存在对外担保事项	<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	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	五.二.(二)
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(三)
是否存在其他重大关联交易事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在经股东大会审议通过的收购、出售资产、对外投资事项以及报告期内发生的企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股份回购事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(四)
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.(五)
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	
是否存在应当披露的其他重大事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在自愿披露的其他事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

二、 重大事件详情（如事项存在选择以下表格填列）

（一） 重大诉讼、仲裁事项：

本报告期公司无重大诉讼、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	7, 211, 671. 12	368, 499. 02	7, 580, 170. 14	0. 10%

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的重大

诉讼、仲裁事项

适用 不适用

(二) 股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况

本报告期公司无股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况

(三) 报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
1. 购买原材料、燃料、动力	5,127,000,000.00	181,437,062.41
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托，委托或者受托销售	235,000,000.00	22,202,965.90
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	45,640,000,000.00	2,235,602,135.91
4. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	700,000,000.00	15,279,722.92
总计	51,702,000,000.00	2,454,521,887.14

(四) 承诺事项的履行情况

承诺主体	承诺开始日期	承诺结束日期	承诺来源	承诺类型	承诺具体内容	承诺履行情况
其他股东	2015年10月28日	-	挂牌	同业竞争承诺	承诺不构成同业竞争	正在履行中
其他股东	2015年10月28日	-	挂牌	限售承诺	2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券在挂牌前直接或间接持有的股票分三批解除转让限制，每批解除转让限制的数量均为其挂牌前所持股票的三分之一，解除转让限制的时间分别为挂牌之日、挂牌期满一年和两年”的规定进行股票交易，也不要求公司回购该	已履行完毕

					部分股份	
其他股东	2019年4月22日	2020年10月23日	其他	一致行动承诺	财通证券与浙江产业基金在处理有关永安期货经营发展且根据《中华人民共和国公司法》等有关法律法规和公司章程需要由股东大会、董事会作出决议的事项时均应采取一致行动；本协议有效期内，在任一方拟就永安期货经营发展的重大事项向股东大会、董事会提出议案之前，或在行使股东大会或董事会等事项的表决权之前，以财通证券的意见为准，作为双方的一致意见	已履行完毕

承诺事项详细情况：

1. 同业竞争承诺

2015年公司挂牌时的控股股东财通证券，实际控制人浙江省财政厅控制的省财开、省金控，其他持股5%以上股东及董事、监事、高级管理人员承诺现时及将来均不会以任何方式从事与公司的业务有竞争或可能构成竞争的业务或活动。

2. 限售承诺

2015年公司挂牌时的控股股东财通证券承诺：“本公司将严格遵守《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》的规定，不得超出“挂牌公司控股股东及实际控制人在挂牌前直接或间接持有的股票分三批解除转让限制，每批解除转让限制的数量均为其挂牌前所持股票的三分之一，解除转让限制的时间分别为挂牌之日、挂牌期满一年和两年”的规定进行股票交易，也不要求公司回购该部分股份。本承诺履行期已届满。

3. 一致行动承诺

2015年12月2日，财通证券与浙江产业基金签订了《关于永安期货股份有限公司的一致行动人协议》（以下简称《一致行动人协议》）。2017年5月，公司实际控制人浙江省财政厅控制的省金控作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将促使子公司浙江产业基金与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间；同时，公司股东浙江产业基金作出承诺，在《一致行动人协议》到期后，将与财通证券续签该协议，协议有效期至不迟于财通证券上市后三年的时间。2019年4月22日，财通证券与浙江产业基金续签了前述《一致行动人协议》，有效期至2020年10月23日。该承诺于2020年10月23日到期，双方未续签。

（五） 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产名称	资产类别	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例%	发生原因
存货	存货	质押	185,260,601.24	0.41%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	其他货币资金	质押	138,736,230.06	0.31%	作为融券保证金、远期结售汇保证金、信用证保证金、保函保证金或借款质押保证金等
交易性金融资产	股票	质押	774,760,042.68	1.70%	融券担保品
总计	-	-	1,098,756,873.98	2.42%	-

资产权利受限事项对公司的影响：

公司权利受限事项均因正常业务开展产生，对公司经营无重大影响。

第六节 股份变动、融资和利润分配

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	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%

条件股份	其中：控股股东、实际控制人						
	董事、监事、高管						
	核心员工						
有限售条件股份	有限售股份总数	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%	
	其中：控股股东、实际控制人						
	董事、监事、高管						
	核心员工						
总股本		1,310,000,000	-	0	1,310,000,000	-	
普通股股东人数							739

股本结构变动情况：

适用 不适用

(二) 普通股前十名股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有有限售股份数量	期末持有无限售股份数量	期末持有的质押股份数量	期末持有的司法冻结股份数量
1	财通证券股份有限公司	439,347,825		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		350,000,000	26.72%		350,000,000		
3	浙江东方金融控股集团股份有限公司	166,427,690		166,427,690	12.70%		166,427,690		
4	浙江省金融控股有限公司	0	138,689,727	138,689,727	10.59%		138,689,727		
5	浙江省经济建设投资有限公司	138,689,727		138,689,727	10.59%		138,689,727	26,540,000	

	司								
6	物产中大集团股份有限公司	27,500,000		27,500,000	2.10%		27,500,000		
7	方继方	5,842,000		5,842,000	0.45%		5,842,000		
8	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		4,795,000	0.37%		4,795,000		
9	江苏柏博产业基金管理有限公司—南京柏载投资合伙企业（有限合伙）	3,393,000		3,393,000	0.26%		3,393,000		
10	浙江省经协集团有限公司	3,733,000	-713,000	3,020,000	0.23%		3,020,000		
	合计	1,139,728,242	137,976,727	1,277,704,969	97.55%	292,898,550	984,806,419	26,540,000	

普通股前十名股东间相互关系说明：

- 1.省金控直接持有财通证券 29.03%的股权；
- 2.省金控直接持有浙江产业基金 97.50%的股权，并通过直接持有浙江省创新发展投资有限公司 100.00%的股权，间接控制浙江产业基金 2.50%的股权；
- 3.浙江省交通投资集团有限公司直接持有财通证券 1.93%的股权，直接持有经建投 100%的股权，直接持有物产中大集团股份有限公司 20.72%的股权。

二、 优先股股本基本情况

适用 不适用

三、 控股股东、实际控制人情况

是否合并披露：

是 否

(一) 控股股东情况

公司无控股股东。

报告期内，公司控股股东未发生变化。

(二) 实际控制人情况

公司实际控制人为浙江省财政厅。浙江省财政厅为主管财政工作的浙江省人民政府组成部门。浙江省财政厅通过直接持有省金控、省财开 100.00%股权，间接控制财通证券 32.25%的股权以及浙江产业基金 100.00%的股权。浙江省财政厅系财通证券、浙江产业基金的实际控制人。因此，浙江省财政厅间接控制永安期货 70.84%的表决权。

报告期内，公司实际控制人未发生变化。

四、 报告期内的普通股股票发行及募集资金使用情况

(一) 报告期内普通股股票发行情况

适用 不适用

(二) 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

五、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

六、 存续至本期的债券融资情况

适用 不适用

单位：元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续期间		是否违约
					起始日期	终止日期	

167934	永安期货-永安期货股份有限公司2020年非公开发行次级债券（第一期）	其他	300,000,000.00	4.3%	2020年11月23日	2023年11月23日	否
合计	-	-	300,000,000.00	-	-	-	-

债券违约情况：

适用 不适用

公开发行债券的特殊披露要求：

适用 不适用

七、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用

八、 银行及非银行金融机构间接融资发生情况

适用 不适用

单位：元

序号	贷款方式	贷款提供方	贷款提供方类型	贷款规模	存续期间		利息率
					起始日期	终止日期	
1	保证借款	浦发银行	银行	50,000,000.00	2020年5月12日	2021年5月12日	合同约定利率
2	保证借款	交通银行	银行	30,000,000.00	2020年8月13日	2021年2月13日	合同约定利率
3	保证借款	交通银行	银行	50,000,000.00	2020年8月17日	2021年2月18日	合同约定利率
4	保证借款	交通银行	银行	50,000,000.00	2020年9月16日	2021年9月15日	合同约定利率
5	保证借款	交通银行	银行	70,000,000.00	2020年9月22日	2021年3月22日	合同约定利率
6	保证借款	华夏银行	银行	100,000,000.00	2020年1月9日	2021年1月9日	合同约定利率
7	保证借款	民生银行	银行	45,000,000.00	2020年9月23日	2021年9月23日	合同约定利率
8	保证借款	广发银行	银行	50,000,000.00	2020年4月20日	2021年4月20日	合同约定利率
9	保证借款	杭州银行	银行	125,287,200.00	2020年7月2日	2021年6月25日	合同约定利率
10	保证借款	杭州银行	银行	164,929,310.00	2020年9月7日	2021年8月12日	合同约定利率

11	保证借款	浙商银行	银行	45,000,000.00	2020年3月23日	2021年3月23日	合同约定利率
12	保证借款	江苏银行	银行	90,000,000.00	2020年1月6日	2021年1月5日	合同约定利率
13	保证借款	兴业银行	银行	50,000,000.00	2020年3月4日	2021年3月3日	合同约定利率
14	保证借款	兴业银行	银行	40,000,000.00	2020年3月26日	2021年3月25日	合同约定利率
15	保证借款	北京银行	银行	50,000,000.00	2020年8月3日	2021年8月2日	合同约定利率
16	保证借款	北京银行	银行	50,000,000.00	2020年9月1日	2021年9月1日	合同约定利率
17	保证借款	宁波银行	银行	50,000,000.00	2020年9月10日	2021年9月10日	合同约定利率
18	进口押汇	交通银行	银行	9,168,764.02	2020年12月11日	2021年3月11日	合同约定利率
19	进口押汇	交通银行	银行	13,973,773.02	2020年12月24日	2021年3月24日	合同约定利率
20	进口押汇	交通银行	银行	14,741,162.20	2020年12月24日	2021年3月24日	合同约定利率
21	进口押汇	民生银行	银行	1,731,154.89	2020年11月23日	2021年5月22日	合同约定利率
22	进口押汇	华夏银行	银行	7,217,766.02	2020年10月14日	2021年1月12日	合同约定利率
23	进口押汇	华夏银行	银行	7,232,794.43	2020年10月28日	2021年1月26日	合同约定利率
24	进口押汇	华夏银行	银行	7,216,482.31	2020年11月11日	2021年2月5日	合同约定利率
25	进口押汇	华夏银行	银行	7,067,761.76	2020年11月17日	2021年2月5日	合同约定利率
26	进口押汇	浙商银行	银行	13,275,851.31	2020年10月16日	2021年1月14日	合同约定利率
27	进口押汇	兴业银行	银行	13,352,738.38	2020年10月20日	2021年1月18日	合同约定利率
28	进口押汇	广发银行	银行	3,638,936.73	2020年10月30日	2021年1月28日	合同约定利率
29	进口押汇	广发银行	银行	3,638,936.73	2020年11月6日	2021年2月4日	合同约定利率
30	进口押汇	广发银行	银行	7,029,234.58	2020年11月10日	2021年2月2日	合同约定利率
31	进口押汇	广发银行	银行	7,344,035.95	2020年11月30日	2021年2月26日	合同约定利率
32	进口押汇	广发银行	银行	3,672,017.97	2020年12月4日	2021年3月4日	合同约定利率

33	进口押汇	宁波银行	银行	2,974,736.36	2020年12月28日	2021年3月26日	合同约定利率
合计	-	-	-	1,233,492,656.66	-	-	-

上述借款利率为合同约定利率

九、 权益分派情况

(一) 报告期内的利润分配与公积金转增股本情况

适用 不适用

单位：元或股

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
2020年2月18日	1.20	0	0
合计	1.20	0	0

报告期内未执行完毕的利润分配与公积金转增股本的情况：

适用 不适用

2020年半年度权益分派方案每10股派现数(含税)1.20元获2020年11月30日召开的股东大会审议通过,本次权益分派权益登记日为2021年1月27日,除权除息日为2021年1月28日。

(二) 权益分派预案

适用 不适用

十、 特别表决权安排情况

适用 不适用

第七节 董事、监事、高级管理人员及核心员工情况

一、董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	任职起止日期	
				起始日期	终止日期
方铁道	董事长	男	1980年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
葛国栋	董事、党委书记、总经理	男	1972年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
申建新	董事	男	1973年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
王建	董事	男	1980年12月	2019年10月25日	2022年10月24日
金朝萍	董事	女	1975年7月	2019年10月25日	2022年10月24日
麻亚峻	董事	男	1974年2月	2019年10月25日	2022年10月24日
张天林	董事	男	1984年10月	2020年11月30日	2022年10月24日
李义超	独立董事	男	1963年5月	2019年10月25日	2022年10月24日
黄平	独立董事	男	1969年2月	2019年10月25日	2022年10月24日
冯晓	独立董事	女	1969年11月	2019年10月25日	2022年10月24日
黄德春	独立董事	男	1966年2月	2019年11月27日	2022年10月24日
邵珏	监事会主席	女	1976年3月	2020年9月25日	2022年10月24日
马笑渊	监事	男	1975年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
胡慧珺	监事	女	1962年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
钱焕军	监事	男	1969年8月	2019年10月25日	2022年10月24日
吕仙英	职工监事	女	1974年11月	2019年9月24日	2022年9月23日
史品	职工监事	男	1985年8月	2019年9月24日	2022年9月23日

石春生	副总经理	男	1965年4月	2019年11月27日	2022年10月24日
黄志明	副总经理	男	1976年4月	2019年11月27日	2022年10月24日
陈敏	首席风险官	女	1976年4月	2019年11月27日	2022年10月24日
黄峥嵘	财务总监	男	1980年10月	2019年11月27日	2022年10月24日
黄峥嵘	董事会秘书	男	1980年10月	2020年9月29日	2022年10月24日
董事会人数:				11	
监事会人数:				6	
高级管理人员人数:				5	

董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系:

截至本年度报告报出日,董事、监事、高级管理人员相互关系及与实际控制人关系如下:

董事长方铁道,任财通证券股份有限公司党委委员、副总经理兼综合办公室主任。

董事申建新,任财通证券股份有限公司合规总监。

董事王建,任浙江省金融控股有限公司金融管理部总经理。

董事张天林,任浙江省金融控股有限公司风险合规部副总经理。

监事会主席邵珏,任浙江省金融控股有限公司计划财务部总经理。

监事马笑渊,任财通证券股份有限公司稽核审计部总经理。

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实际控制人均为浙江省财政厅,董事、监事、高级管理人员之间无其他关联关系。

(二) 持股情况

单位:股

姓名	职务	期初持普通股股数	数量变动	期末持普通股股数	期末普通股持股比例%	期末持有股票期权数量	期末被授予的限制性股票数量
无		0		0	0%	0	0
合计	-	0	-	0	0%	0	0

(三) 变动情况

信息统计	董事长是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
------	-----------	--

	总经理是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	董事会秘书是否发生变动	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
	财务总监是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：

适用 不适用

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
金吉来	副总经理	离任	无	工作调整
邵珏	无	新任	监事会主席	新任
马冬明	董事会秘书	离任	无	个人原因
黄峥嵘	财务总监	新任	董事会秘书、财务总监	新任
顾志旭	董事	离任	无	工作变动
张天林	无	新任	董事	新任

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

适用 不适用

邵珏，1976年生，中国国籍，无境外永久居留权，经济师。曾任湖州市财政局预算局长，湖州市旅游投资发展集团有限公司党委委员、副总经理，杭州钢铁集团有限公司财务资产管理部副总经理。自2020年1月起任浙江省金融控股有限公司计划财务部总经理。

黄峥嵘，男，1980年生，中国国籍，无境外永久居留权，本科学历，注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所，星展银行(中国)上海分行，天健会计师事务所，财通证券股份有限公司。自2019年11月起任永安期货股份有限公司财务总监，自2020年9月起，任永安期货股份有限公司董事会秘书。

张天林，男，1984年生，中国国籍，无境外永久居留权，中级经济师。曾任浙江六和律师事务所主任律师助理，坚持我的服饰（杭州）股份有限公司法务主管，浙江省注册会计师服务中心会员管理部干部、会员管理部副主任、资产评估部副主任（主持工作）。自2020年1月起任浙江省金融控股有限公司风险合规部副总经理。兼任浙江省担保集团有限公司监事。

(四) 董事、高级管理人员的股权激励情况

适用 不适用

二、 员工情况

(一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
中层以上管理人员	93	12	28	77
市场业务人员	426	83	90	419

研究人员	80	11	18	73
信息技术人员	88	8	9	87
财务人员	69	18	13	74
合规管理及风控人员	84	20	11	93
其他职能人员	263	73	60	276
员工总计	1,103	225	229	1,099

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	4	3
硕士	293	327
本科	698	704
专科	91	57
专科以下	17	8
员工总计	1,103	1,099

员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：

1.人员变动

截至报告期末，公司在职工总数 1099 人，较期初减少 4 人，财务、合规风控及其他职能人员较期初有所增长，核心管理团队及骨干员工队伍稳定，专业素养有所提升。

2.人才引进、招聘及培训计划

报告期内，公司根据战略规划及业务发展需要，拟定招聘计划，拓展招聘渠道，通过优选社招平台、精选猎头渠道、发挥“黄埔联盟”及“永动新星”等校园招聘品牌影响力，在高级管理人员、专业人才引进及优质应届人才招聘中发挥了重要作用。

报告期内，公司根据发展需要，创新培训形式，优化培训内容、提升培训效果。通过“永安十讲”精品课程、“永安新思享”系列业务论坛等线上培训资源，与“永动新星”新员工集训、“永动成长”后备干部集训、分支机构负责人培训、产业经理集训等线下培训相结合的形式，加强员工文化归属感，提高专业能力，分层分类锻造人才队伍。通过组建“青年讲师团”，为传承永安文化智慧，培养后备人才提供平台。

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，公司关注行业薪酬状况，及时调整薪酬水平，保证关键岗位的薪酬竞争力；突出岗位价值、绩效贡献，定期更新考核制度，实现薪酬的内部公平；将企业文化建设写进公司战略，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）基本情况及变动情况

适用 不适用

三、 报告期后更新情况

适用 不适用

第八节 行业信息

是否自愿披露

是 否

第九节 公司治理、内部控制和投资者保护

事项	是或否
年度内是否建立新的公司治理制度	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
投资机构是否派驻董事	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" 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》和《年报信息披露重大差错责任追究制度》等。

2020年度，为全面落实公司的战略目标，进一步强化对子公司的管控、支持和服务，促进子公司按现代企业制度规范运作，公司对《子公司管理办法》进行全面修订；为适应监管政策的变化，立足加强风险管理的根本目标，防范和化解经营业务风险，结合公司内部组织架构的调整，对《风险管理基本制度》《内部审计制度》《基金销售业务管理办法》进行相应修订，进一步完善了公司内控体系；根据经营需要，对《公司章程》《总经理办公会议事规则》等基本法人治理制度进行了修订完善，治理体系持续提升；因向中国证监会申请首次公开发行股票并在上海证券交易所（主板）上市需要，根据中国证监会、上海证券交易所的有关要求，制定了公司上市后执行的《公司章程（草案）》《股东大会议事规则》《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》《独立董事工作制度》《募集资金管理办法》等基本制度，上述制度于公司完成首次公开发行并上市之日起生效并实施，在此之前，公司现行制度继续适用。

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。公司将持续关注行业发展动态及监管机构的政策走向，及时调整、优化公司内控体系，保障公司高质量稳健发展。

2、 公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

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

报告期内，公司根据公司章程及股东大会、董事会、监事会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。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 2020 年度重要的制度修订、关联交易、利润分配、人事任免等重大事项，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) 2020 年 5 月 22 日，公司 2020 年年度股东大会审议通过《关于修订<公司章程>的议案》，根据《公司法》《非上市公众公司监督管理办法》及《全国中小企业股份转让系统挂牌公司治理规则》等相关规定，对《公司章程》的部分条款进行了修订完善。

(2) 2020 年 9 月 25 日，公司 2020 年第一次临时股东大会审议通过《关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案》，对公司章程中第四条做出修订：公司原注册地址为“浙江省杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1102 室、1104 室、16-17 层、2604 室”，变更为“浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1101 室、1102 室、1104 室、16-17 层”。

(3) 2020 年 11 月 30 日，公司 2020 年第二次临时股东大会审议通过《永安期货股份有限公司章程（草案）》（上市后适用）。因向中国证监会申请首次公开发行股票并在上海证券交易所（主板）上市需要，为符合中国证监会关于上市公司章程的有关要求，在不改变现行章程基本原则的情况下，公司根据

《中华人民共和国公司法》《上市公司章程指引》的相关规定，起草了上市后执行的《永安期货股份有限公司章程（草案）》。该章程（草案）于公司完成首次公开发行并上市之日起生效并实施，在此之前，公司现行章程继续适用。

（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	7	<p>1.2020年3月30日，公司召开第三届董事会第四次会议，审议通过关于免去副总经理的议案；</p> <p>2.1.2020年4月20日，公司召开第三届董事会第五次会议，审议通过2019年度总经理工作报告、2019年度董事会工作报告、2019年度首席风险官工作报告、2019年年度报告及摘要、2019年财务决算报告、2019年资本性支出预算执行情况报告与2020年资本性支出预算计划报告、关于确认公司2019年关联交易的议案、关于预计公司2020年日常关联交易的议案、2019年度利润分配方案、2019年下半年风险监管指标情况报告、2019年度合规报告、2019年扶贫工作情况及2020年扶贫工作计划、2019年度廉洁从业管理情况报告、2020年经营管理计划的议案、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、关于前期会计差错更正的议案、关于会计政策变更的议案、关于修订《公司章程》的议案、关于修订《总经理办公会议事规则》的议案、关于修订《子公司管理办法》的议案、关于召开公司2019年度股东大会的议案；</p> <p>3.2020年5月27日，公司召开第三届董事会第六次会议，审议通过2019年度经营层薪酬考核报告与2020年度经营层薪酬考核方案、关于开展股票期权做市业务的议案；</p> <p>4.2020年8月18日，公司召开第三届董事会第七次会议，审议通过2020年上半年工作总结及下半年工作计划、2020年半年度报告、2020年上半年风险监管指标情况报告、关于前期会计差错更正的议案、关于公司首次公开发行股票并上市的议案、关于提请股东大会授权董事会办理首次公开发行股票并上市相关事宜的议案、关于公司首次公开发行股票并上市募集资金</p>

		<p>金用途及可行性分析的议案、关于公司首次公开发行股票并上市前滚存利润分配方案的议案、关于公司上市后未来三年股东分红回报规划的议案、关于公司上市后未来三年稳定股价预案的议案、关于公司就首次公开发行股票并上市事项出具有关承诺并提出相应约束措施的议案、关于公司首次公开发行股票摊薄即期回报填补措施承诺的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于公司资产管理计划延期整改方案的报告、关于召开公司 2020 年第一次临时股东大会的议案；</p> <p>5.2020 年 9 月 29 日,公司召开第三届董事会第八次会议,审议通过关于变更公司董事会秘书的议案；</p> <p>6.2020 年 11 月 13 日,公司召开第三届董事会第九次会议,审议通过关于变更公司董事的议案、关于 2020 年半年度利润分配的议案、关于公司上市后股利分配政策的议案、关于同意报出公司最近三年及一期财务报表的议案、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案、关于审议公司内部控制自我评价报告的议案、关于修订《永安期货股份有限公司内部审计制度》的议案、关于审议《永安期货股份有限公司章程（草案）》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司股东大会议事规则》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司董事会议事规则》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司关联交易决策制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司对外投资管理制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司信息披露事务管理制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司投资者关系管理制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司募集资金管理办法》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司内幕知情人登记管理制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司独立董事工作制度》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司总经理办公会议事规则》（上市后适用）的议案、关于审议《永安期货股份有限公司董事会秘书工作细则》（上市后适用）的议案、关于审议上市后适用的董事会专门委员会相关</p>
--	--	---

		<p>议事规则的议案、关于召开 2020 年第二次临时股东大会的议案；</p> <p>7.2020 年 12 月 9 日，公司召开第三届董事会第十次会议，审议通过关于聘任会计师事务所的议案、关于选举张天林先生担任公司第三届董事会风险控制委员会委员的议案、关于更正相关定期报告及公开文件中有关控股股东披露内容的议案、关于更正以前年度定期报告的议案、关于修订《永安期货股份有限公司风险管理基本制度》的议案、关于修订《永安期货股份有限公司基金销售业务管理办法》的议案、关于制定《永安期货股份有限公司规章制度管理办法》的议案、关于召开 2020 年第三次临时股东大会的议案。</p>
监事会	6	<p>1.2020 年 4 月 20 日，公司召开第三届监事会第三次会议，审议通过 2019 年度监事会工作报告、2019 年度首席风险官工作报告、2019 年年度报告及摘要、2019 年财务决算报告、2019 年资本性支出预算执行情况报告与 2020 年资本性支出预算计划、关于确认公司 2019 年关联交易的议案、关于预计公司 2020 年日常关联交易的议案、2019 年度利润分配方案、2019 年下半年风险监控指标情况报告、2019 年度合规报告、2019 年度廉洁从业管理情况报告、2020 年经营管理计划的议案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于前期会计差错更正的议案、关于会计政策变更的议案、关于修订《子公司管理办法》的议案；</p> <p>2.2020 年 5 月 27 日，公司召开第三届监事会第四次会议，审议通过 2019 年度经营层薪酬考核报告与 2020 年度经营层薪酬考核方案；</p> <p>3.2020 年 8 月 18 日，公司召开第三届监事会第五次会议，审议通过 2020 年半年度报告、2020 年上半年风险监控指标情况报告、关于前期会计差错更正的议案、关于变更监事会成员的议案、关于公司首次公开发行股票并上市前滚存利润分配方案的议案；</p> <p>4.2020 年 9 月 25 日，公司召开第三届监事会第六次会议，审议通过关于豁免永安期货股份有限公司第三届监事会第六次会议提前通知义务的议案、关于选举永安期货股份有限公司第三届监事会主席的议案；</p> <p>5.2020 年 11 月 13 日，公司召开第三届监事会第七次会议，审议通过关于 2020 年半年度利润</p>

		<p>分配的议案、关于公司上市后股利分配政策的议案、关于同意报出公司最近三年及一期财务报表的议案、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案、关于审议公司内部控制自我评价报告的议案、关于审议《永安期货股份有限公司监事会议事规则》（上市后适用）的议案；</p> <p>6.2020年12月9日，公司召开第三届监事会第八次会议，审议通过关于聘任会计师事务所的议案、关于更正相关定期报告及公开文件中有关控股股东披露内容的议案、关于更正以前年度定期报告的议案。</p>
<p>股东大会</p>	<p>3</p>	<p>1.2020年5月22日，公司召开2019年年度股东大会，审议通过2019年度董事会工作报告、2019年度监事会工作报告、2019年年度报告及摘要、2019年财务决算报告、2019年资本性支出预算执行情况报告与2020年资本性支出预算计划报告、关于确认公司2019年关联交易的议案、关于预计公司2020年日常关联交易的议案、2019年度利润分配方案、2019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、关于修订《公司章程》的议案；</p> <p>2.2020年9月25日，公司召开2020年第一次临时股东大会，审议通过2020年上半年风险监管指标情况报告、关于公司首次公开发行股票并上市的议案、关于提请股东大会授权董事会办理首次公开发行股票并上市相关事宜的议案、关于公司首次公开发行股票并上市募集资金用途及可行性分析的议案、关于公司首次公开发行股票并上市前滚存利润分配方案的议案、关于公司上市后未来三年股东分红回报规划的议案、关于公司上市后未来三年稳定股价预案的议案、关于公司就首次公开发行股票并上市事项出具有关承诺并提出相应约束措施的议案、关于公司首次公开发行股票摊薄即期回报填补措施承诺的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于变更监事会成员的议案；</p> <p>3.2020年11月30日，公司召开2020年第二次临时股东大会，审议通过关于变更公司董事的议案、关于2020年半年度利润分配的议案、关于公司上市后股利分配政策的议案、关于同意报出公司最近三年及一期财务报表的议案、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案、</p>

		<p>关于审议公司内部控制自我评价报告的议案、关于审议《永安期货股份有限公司章程(草案)》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司股东大会议事规则》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司董事会议事规则》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司监事会议事规则》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司关联交易决策制度》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司对外投资管理制度》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司募集资金管理办法》(上市后适用)的议案、关于审议《永安期货股份有限公司独立董事工作制度》(上市后适用)的议案。</p>
--	--	---

2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见

报告期内公司共召开7次董事会、6次监事会、3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

适用 不适用

公司不断完善公司治理结构，报告期内，对《公司章程》《总经理办公会议议事规则》《子公司管理办法》《风险管理基本制度》《内部审计制度》《基金销售业务管理办法》等多项基本制度进行了修订，进一步加强了公司内控体系建设，公司治理体系持续提升。

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。公司将持续关注期货行业的发展，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。

(四) 投资者关系管理情况

√适用 □不适用

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、网站等多种形式及时披露公司的发展战略、经营情况、重大事项等信息，保障所有投资者的合法权益。公司制定有《投资者关系管理制度》，加强管理与投资者以及潜在投资者之间的信息沟通，加深投资者对公司的了解和认同，建立与投资者之间长期、稳定的良性合作关系，促进公司诚信自律、规范运作，提升公司投资价值。

公司董事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、一对一沟通、现场参观、电话咨询、传真与电子信箱、媒体宣传与访谈等。

二、 内部控制

(一) 监事会就年度内监督事项的意见

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

(二) 公司保持独立性、自主经营能力的说明

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

1. 业务独立

本公司根据《营业执照》及《经营期货业务许可证》所核定的经营范围独立开展业务。本公司各项

业务具有完整的业务流程、独立的经营场所。本公司经营的业务与实际控制人及其控制的其他企业之间不存在实质性同业竞争，未受到本公司股东及其他关联方的干涉、控制，也未因与本公司股东及其他关联方存在关联关系，而使得本公司经营自主权的独立性和完整性受到不良影响。

2. 人员独立

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

3. 资产独立

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

4. 机构独立

本公司以《公司法》等法律、法规以及《公司章程》相关规定为依据，以建立权责分明、管理科学、激励和约束相结合的现代企业制度为目标，完善了以股东大会、董事会、监事会为基础的公司治理结构，聘任了总经理、副总经理、董事会秘书、首席风险官、财务总监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，不存在与实际控制人及其控制的其他企业职能部门之间的从属关系。本公司经营办公场所与实际控制人及其控制的其他企业完全分离，不存在合署办公的情形。

5. 财务独立

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

报告期内，公司股东及其关联人不存在占用公司资产的情况，未损害公司及客户的合法权益。公司与实际控制人及其控制的其他企业在业务、人员、资产、财务、场所等方面已做到严格分开，独立经营，独立核算。

(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》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》。

报告期内，公司未发生重大会计差错更正、重大遗漏信息等情况。

三、 投资者保护

(一) 公司股东大会实行累积投票制和网络投票安排的情况

适用 不适用

1. 公司于2020年5月22日召开2019年年度股东大会（提供网络投票），现场会议召开时间：2020年5月22日14:30，网络投票起止时间：2020年5月22日9:00—2020年5月22日15:00，登记在册的股东可通过中国证券登记结算有限责任公司持有人大会网络投票系统对有关议案进行投票表决；

2. 公司于2020年9月25日召开2020年第一次临时股东大会（提供网络投票），现场会议召开时间：2020年9月25日14:30，网络投票起止时间：2020年9月24日9:00—2020年9月25日16:00，登记在册的股东可通过中国证券登记结算有限责任公司持有人大会网络投票系统对有关议案进行投票表决；

3. 公司于2020年11月30日召开2020年第二次临时股东大会（提供网络投票），现场会议召开时间：2020年11月30日14:30，网络投票起止时间：2020年11月29日15:00—2020年11月30日15:00，

登记在册的股东可通过中国证券登记结算有限责任公司持有人大会网络投票系统对有关议案进行投票表决。

(二) 特别表决权股份

适用 不适用

第十节 财务会计报告

一、 审计报告

是否审计	是			
审计意见	无保留意见			
审计报告中的特别段落	<input checked="" type="checkbox"/> 无 <input type="checkbox"/> 强调事项段 <input type="checkbox"/> 其他事项段 <input type="checkbox"/> 持续经营重大不确定性段落 <input type="checkbox"/> 其他信息段落中包含其他信息存在未更正重大错报说明			
审计报告编号	天健审（2021）1467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	浙江省杭州市江干区钱江路1366号华润大厦			
审计报告日期	2021年4月6日			
签字注册会计师姓名及连续签字年限	宋慧娟 1年	刘晓冬 1年	年	年
会计师事务所是否变更	否			
会计师事务所连续服务年限	1年			
会计师事务所审计报酬	50万元			
<p>审 计 报 告</p> <p>天健审（2021）1467号</p> <p>永安期货股份有限公司全体股东：</p> <p>一、 审计意见</p> <p>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2020年12月31日的合并及母公司资产负债表，2020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。</p> <p>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2020年12月31日的合并及母公司财务状况，以及2020年度的合并及母公司经营成果和现金流量。</p> <p>二、 形成审计意见的基础</p> <p>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。</p> <p>三、 关键审计事项</p> <p>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。</p> <p>（一） 手续费收入的确认</p> <p>1. 事项描述</p> <p>相关信息披露详见财务报表附注三（二十八）及五（二）之1。</p> <p>永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入（含经纪业务手续费收入和交易所减收手续费收</p>				

入)、资产管理业务收入、基金销售业务收入及投资咨询收入等。经纪业务手续费收入在与客户办理每日款项清算时确认收入；交易所减收手续费收入在交易所资金清算完成时确认收入；资产管理、基金销售和投资咨询业务收入在相关服务已经提供，相关的经济利益能够流入及收入的金额能够可靠地计量时，按合同约定方式确认当期收入。

由于手续费收入是永安期货公司关键业绩指标之一，可能存在重大错报风险，因此我们将手续费收入的确认确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

(1) 经纪业务手续费收入

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

2) 对于涉及手续费收入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，对与该系统相关的信息技术一般控制的设计和运行的有效性进行测试和评价，并测试和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的有效性。

3) 获取经纪业务手续费收入明细账，并与报表数、总账数核对。

4) 将财务账面记录的经纪业务手续费收入与业务系统中记录的数据进行核对，并执行分析性复核，包括：

① 年度比较，分析变动是否合理；② 获取全国期货市场成交数据，将永安期货公司期货代理成交数据与全国市场趋势进行比较分析；③ 选取成交金额较大的期货品种进行月度波动分析，将永安期货公司每月经纪业务手续费收入、成交金额与全国市场总成交金额变动进行比较分析。

(2) 交易所减收手续费收入

1) 了解与交易所减收手续费收入确认相关的关键内部控制，评价其设计是否有效，并测试相关内部控制运行的有效性。

2) 获取交易所减收手续费收入明细账，并与报表数、总账数核对。

3) 选取样本，对交易所对账单中交易所减收手续费收入数据与账面进行核对。

(3) 对于资产管理业务收入，取得业务台账，与账面数据核对；抽取样本，核对管理费和业绩报酬的费率与合同约定是否一致，并复核管理费和业绩报酬的计算过程。

(4) 对于投资咨询业务和基金销售业务收入，取得业务台账，与账面数据核对；抽取部分业务项目，获取银行流水，核对明细账、业务台账与银行流水记录是否一致。

(二) 以公允价值计量的金融工具估值

1. 事项描述

相关信息披露详见财务报表附注九。

公司金融工具的估值是基于市场数据与估值模型的结合，通常需要输入较多的变量。在这些输入值当中，大部分输入值均取自于流动市场的现有数据。对于第二层次的金融工具而言，可观察的输入值无法可靠获取时，会涉及永安期货公司管理层(以下简称管理层)的重大判断及估计。

由于部分以公允价值计量的金融工具公允价值的评估较为复杂，且在确定估值模型使用的输入值时涉及管理层判断的程度重大，我们将金融工具公允价值的评估识别为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解并评估管理层用于识别、计量和管理金融工具估值风险相关的内部控制流程的有效性。

(2) 评估公司运用的估值方法的适当性，并与同类或类似行业进行比较。

(3) 对于第一层次金融工具的估值，我们独立获取可观察市场资料，并通过审计抽样的方式与公司使用的估值价格进行比较。

(4) 对于分类为第二层次的权益工具的估值，我们独立获取相关资产管理人提供的资产净值，通过审计抽样的方式与公司使用的估值价格进行比较，并向资产管理人函证确认净值。

(5) 对于分类为第二层次的衍生金融工具的估值，管理层依赖直接或间接可观察的参数。我们基于对当前行业实务的了解，评价管理层作出的假设和判断。

1) 获取以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债明细账，并与报表数、总账数核对。

2) 获取公司场外衍生品交易明细表，通过抽样的方式获取交易确认书等资料，了解交易相关条款及估值要素，并与交易明细表进行核对。

3) 获取盯市报告和外部估值数据，结合公司的估值方法及管理层在估值方法中采用的关键参数，通过抽样的方式独立复核部分衍生金融工具估值的计算。

4) 获取远期合同中相关标的公允价值，重新计算浮动盈亏。

(6) 评价财务报表的相关披露是否符合企业会计准则的披露要求，适当反映了金融工具估值风险。

四、其他信息

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

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

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

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

五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

永安期货公司治理层（以下简称治理层）负责监督永安期货公司的财务报告过程。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

来的事项或情况可能导致永安期货公司不能持续经营。

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

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

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

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

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

天健会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师：宋慧娟
（项目合伙人）

中国·杭州 中国注册会计师：刘晓冬

二〇二一年四月六日

二、 财务报表

（一） 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年12月31日	2019年12月31日
流动资产：			
货币资金	五（一）1	20,011,941,230.41	17,277,242,747.04
其中：期货保证金存款		17,653,414,687.86	16,209,864,177.87
应收货币保证金	五（一）4	15,817,455,680.10	11,325,661,929.26
应收质押保证金	五（一）5	1,048,318,156.00	621,717,032.00
存出保证金	五（一）6	1,213,700.40	841,892.55
交易性金融资产	五（一）14	3,948,448,688.50	4,130,938,590.83
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款	五（一）7	46,631,793.13	11,013,567.11
应收款项融资	五（一）8	49,147,244.81	1,793,095.85
预付款项	五（一）9	520,667,316.35	302,040,051.78
应收结算担保金	五（一）10	69,440,425.56	34,593,853.25
应收风险损失款	五（一）11	676,263.93	17,004.09
应收佣金	五（一）8注1	3,266,507.87	13,861,553.98
其他应收款	五（一）13	450,700,058.47	88,317,675.95
其中：应收利息		1,503,283.61	1,905,396.09

应收股利			14,558.23
买入返售金融资产	五（一）22 注 2	7,100,000.00	44,800,508.00
存货	五（一）13	1,487,519,112.57	1,531,314,799.31
合同资产			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	五（一）2、3、 22 注 2	457,739,482.53	221,297,636.02
流动资产合计		43,920,265,660.63	35,605,451,937.02
非流动资产：			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资	五（一）15	704,400,897.48	486,824,372.27
其他权益工具投资	五（一）16	25,838,630.14	26,845,000.00
期货会员资格投资	五（一）17	1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产	五（一）18	339,048,536.78	10,035,071.69
固定资产	五（一）19	98,341,683.77	232,130,750.50
在建工程			
使用权资产			
无形资产	五（一）20	23,955,193.26	233,733,432.01
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	五（一）22 注 2	11,508,050.85	9,454,316.78
递延所得税资产	五（一）21	252,435,654.23	193,591,338.28
其他非流动资产			
非流动资产合计		1,456,928,646.51	1,194,014,281.53
资产总计		45,377,194,307.14	36,799,466,218.55
流动负债：			
短期借款	五（一）23	1,237,622,713.74	562,544,509.00
应付货币保证金	五（一）25	30,659,518,043.39	24,535,428,916.12
应付质押保证金	五（一）26	857,391,364.00	434,089,168.00
交易性金融负债	五（一）27	758,704,192.57	1,783,215,819.12
期货风险准备金	五（一）28	256,567,983.48	232,191,214.15
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款	五（一）29	92,533,817.44	107,960,512.29
预收款项	五（一）30	7,217,084.50	741,569,234.77
合同负债	五（一）31	479,222,469.14	
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金	五（一）32	827,060.73	671,681.51
应付手续费及佣金	五（一）35 注 3	1,153,012.55	840,649.07

应付职工薪酬	五（一）33	877,368,031.14	783,931,911.56
应交税费	五（一）34	156,179,183.84	168,563,751.51
其他应付款	五（一）35	1,329,791,897.91	453,060,831.14
其中：应付利息			
应付股利		157,200,000.00	157,200,000.00
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债	五（一）24、37 注4	374,447,383.37	43,497,081.98
流动负债合计		37,088,544,237.80	29,847,565,280.22
非流动负债：			
长期借款			
应付债券	五（一）37注4	301,378,356.16	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债	五（一）36	418,767.91	445,737.05
递延收益			
递延所得税负债	五（一）21	188,807,500.29	87,529,106.96
其他非流动负债			
非流动负债合计		490,604,624.36	87,974,844.01
负债合计		37,579,148,862.16	29,935,540,124.23
所有者权益（或股东权益）：			
股本	五（一）38	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）39	1,501,621,789.21	1,501,682,614.86
减：库存股			
其他综合收益	五（一）40	-14,700,285.08	39,928,823.91
专项储备			
盈余公积	五（一）41	489,739,107.05	398,170,713.39
一般风险准备	五（一）42	549,630,120.98	458,061,727.32
未分配利润	五（一）43	3,961,754,712.82	3,156,082,214.84
归属于母公司所有者权益合计		7,798,045,444.98	6,863,926,094.32
少数股东权益			
股东权益合计		7,798,045,444.98	6,863,926,094.32
负债和股东权益总计		45,377,194,307.14	36,799,466,218.55

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

注 1：财务报表附注与新三板报告列示科目略有不同，下同。财务报表附注五（一）应收款项包含上表

所列的“应收账款”和“应收佣金”；

注 2：财务报表附注五（一）“结算备付金”、“融出资金”、“其他资产-待抵扣增值税”、“其他资产-待摊费用”列示在上表中“其他流动资产”中，“其他资产-长期待摊费用”、“其他资产-买入返售金融资产”单列在上表“长期待摊费用”及“买入返售金融资产”中；

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

注 4：财务报表附注五（一）“代理买卖证券款”、“其他负债-待转销项税额”、“拆入资金”列示在上表中“其他流动负债”中，“其他负债-次级债券”单列在上表“应付债券”中。

（二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
流动资产：			
货币资金		17,375,648,582.32	15,488,253,132.19
其中：期货保证金存款		16,539,184,049.59	15,308,127,388.12
应收货币保证金		15,074,615,352.43	10,815,398,355.32
应收质押保证金		1,048,318,156.00	621,717,032.00
存出保证金			
交易性金融资产		2,406,944,482.40	2,688,152,511.34
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款			
应收款项融资			
预付款项			
应收结算担保金		66,175,935.59	31,112,096.04
应收风险损失款		676,263.93	17,004.09
应收佣金		3,370,446.51	16,120,242.25
其他应收款		97,820,608.30	101,019,294.42
其中：应收利息		1,288,767.12	
应收股利			80,000,000.00
买入返售金融资产		7,100,000.00	
存货			
合同资产			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		17,106,947.00	18,677,298.98
流动资产合计		36,097,776,774.48	29,780,466,966.63
非流动资产：			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资	十四（一）1	2,706,824,178.09	2,176,245,132.90
其他权益工具投资		18,847,000.00	18,922,500.00

期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产		339,048,536.78	10,035,071.69
固定资产		95,472,235.16	228,380,541.36
在建工程			
使用权资产			
无形资产		22,802,973.67	232,219,958.38
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		9,314,568.52	8,483,879.16
递延所得税资产		137,414,877.00	132,961,247.51
其他非流动资产			
非流动资产合计		3,331,124,369.22	2,808,648,331.00
资产总计		39,428,901,143.70	32,589,115,297.63
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		29,687,237,638.59	24,449,581,016.08
应付质押保证金		1,048,318,156.00	621,717,032.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		256,567,983.48	232,191,214.15
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款			
预收款项		7,217,084.50	373,054.92
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金		827,060.73	671,681.51
应付手续费及佣金		1,153,012.55	840,649.07
应付职工薪酬		727,455,538.06	668,066,501.12
应交税费		118,129,668.09	119,142,637.79
其他应付款		196,402,401.13	198,461,735.03
其中：应付利息			
应付股利		157,200,000.00	157,200,000.00
合同负债		383,990.25	
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债		23,039.42	
流动负债合计		32,043,715,572.80	26,291,045,521.67
非流动负债：			
长期借款			
应付债券		301,378,356.16	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			

长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债		93,059,919.56	65,806,417.33
其他非流动负债			
非流动负债合计		394,438,275.72	65,806,417.33
负债合计		32,438,153,848.52	26,356,851,939.00
所有者权益（或股东权益）：			
股本		1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		1,502,904,302.10	1,502,904,302.10
减：库存股			
其他综合收益		-1,220,053.50	-1,220,053.50
专项储备			
盈余公积		489,739,107.05	398,170,713.39
一般风险准备		549,630,120.98	458,061,727.32
未分配利润		3,139,693,818.55	2,564,346,669.32
股东权益合计		6,990,747,295.18	6,232,263,358.63
负债和股东权益总计		39,428,901,143.70	32,589,115,297.63

（三） 合并利润表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、营业收入		25,469,307,566.01	22,757,609,299.75
手续费及佣金净收入	五（二）1	677,157,713.06	516,308,160.73
其中：经纪业务手续费收入		568,458,668.73	427,857,510.01
资产管理业务收入		41,222,039.96	35,929,709.16
投资咨询业务收入		1,997,922.28	2,912,778.01
代理销售金融产品收入		65,479,082.09	49,608,163.55
其他代理业务收入			
利息净收入	五（二）2	499,077,057.36	552,305,587.41
其中：利息收入		599,455,204.98	618,496,985.72
利息支出		100,378,147.62	66,191,398.31
投资收益（损失以“-”号填列）	五（二）3	899,362,995.71	712,152,946.29
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		242,716,171.58	212,858,720.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			

净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	五（二）4	12,466,348.58	7,922,956.41
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	五（二）5	194,887,036.09	438,751,993.31
汇兑收益（损失以“-”号填列）	五（二）6	7,272,235.82	-3,233,184.93
其他业务收入	五（二）7、 8	23,179,084,179.39	20,533,400,840.53
其中：风险管理业务收入		23,133,547,521.31	20,512,110,273.07
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
二、营业支出		24,160,089,841.10	21,577,925,727.76
提取期货风险准备金	五（二）9	24,393,773.42	19,051,965.16
税金及附加	五（二） 10	11,874,820.87	8,564,808.13
业务及管理费	五（二） 11	1,012,549,588.68	1,095,510,076.60
研发费用			
信用减值损失	五（二） 12	36,394,654.37	3,243,087.24
其他资产减值损失	五（二） 13	462,861,109.02	354,745,444.10
其他业务成本	五（二） 14	22,612,015,894.74	20,096,810,346.53
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,309,217,724.91	1,179,683,571.99
加：营业外收入	五（二） 15	140,200,623.91	77,097,898.60
减：营业外支出	五（二） 16	4,312,050.62	5,732,298.77
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,445,106,298.20	1,251,049,171.82
减：所得税费用	五（二） 17	299,097,012.90	250,328,588.67
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,146,009,285.30	1,000,720,583.15
其中：被合并方在合并前实现的净利润			
（一）按经营持续性分类：	-	-	-
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,146,009,285.30	1,000,720,583.15
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
（二）按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益（净亏损以“-”填列）			
2. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”填列）		1,146,009,285.30	1,000,720,583.15
六、其他综合收益的税后净额		-54,629,108.99	22,058,464.07
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-54,629,108.99	22,058,464.07
1. 不能重分类进损益的其他综合收益			
（1）重新计量设定受益计划变动额			

(2) 权益法下不能转损益的其他综合收益			
(3) 其他权益工具投资公允价值变动			
(4) 企业自身信用风险公允价值变动			
(5) 其他			
2. 将重分类进损益的其他综合收益		-54,629,108.99	22,058,464.07
(1) 权益法下可转损益的其他综合收益			
(2) 其他债权投资公允价值变动			
(3) 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
(4) 其他债权投资信用损失准备			
(5) 现金流量套期储备			
(6) 外币财务报表折算差额	五(二) 18	-54,629,108.99	22,058,464.07
(7) 其他			
(二) 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		1,091,380,176.31	1,022,779,047.22
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		1,091,380,176.31	1,022,779,047.22
(二) 归属于少数股东的综合收益总额			
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.87	0.76
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.87	0.76

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、营业收入		1,828,559,613.80	2,054,174,936.99
手续费及佣金净收入	十四(二) 1	601,272,727.77	561,351,813.74
其中：经纪业务手续费收入		487,857,630.59	381,039,303.21
资产管理业务收入		47,557,840.75	127,949,913.22
投资咨询业务收入		378,174.34	2,754,433.76
代理销售金融产品收入		65,479,082.09	49,608,163.55
其他代理业务收入			
利息净收入		507,775,174.66	551,384,976.52
其中：利息收入		556,964,113.99	584,478,191.12
利息支出		49,188,939.33	33,093,214.60
投资收益（损失以“-”号填列）	十四(二) 2	565,282,567.73	561,009,804.43
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		230,579,045.19	211,509,024.65

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		3,953,392.04	3,762,620.52
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		109,014,008.96	355,853,987.57
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-998.96	744.32
其他业务收入		41,158,640.86	20,777,700.28
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）		104,100.74	33,289.61
二、营业支出		676,277,872.29	822,544,973.73
提取期货风险准备金		24,393,773.42	19,051,965.16
税金及附加		9,020,263.73	5,804,812.93
业务及管理费		636,164,811.89	795,657,577.63
研发费用			
信用减值损失		-1,038,687.94	1,566,207.43
其他资产减值损失			
其他业务成本		7,737,711.19	464,410.58
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,152,281,741.51	1,231,629,963.26
加：营业外收入		60,742.78	12,650.76
减：营业外支出		4,247,602.26	5,657,122.94
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,148,094,882.03	1,225,985,491.08
减：所得税费用		232,410,945.48	214,192,072.73
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		915,683,936.55	1,011,793,418.35
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		915,683,936.55	1,011,793,418.35
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额			
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动			
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益			
1. 权益法下可转损益的其他综合收益			
2. 其他债权投资公允价值变动			
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备			
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		915,683,936.55	1,011,793,418.35
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）			

(二) 稀释每股收益(元/股)			
-----------------	--	--	--

(五) 合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金		25,644,814,190.40	23,449,379,329.47
收取利息、手续费及佣金的现金		1,332,593,780.27	1,167,841,289.21
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	五（三）1 注	6,604,136,929.87	2,645,947,318.56
经营活动现金流入小计		33,581,544,900.54	27,263,167,937.24
为交易目的而持有的金融资产净增加额			30,705,567.95
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		25,898,968,749.15	23,712,835,444.60
支付利息、手续费及佣金的现金		52,998,355.30	36,761,634.11
以现金支付的业务及管理费		382,465,699.81	285,528,206.00
支付给职工以及为职工支付的现金		523,237,503.06	533,905,882.85
支付的各项税费		324,987,445.15	240,993,520.37
支付其他与经营活动有关的现金	五（三）2	1,854,170,408.63	783,721,722.73
经营活动现金流出小计		29,036,828,161.10	25,624,451,978.61
经营活动产生的现金流量净额		4,544,716,739.44	1,638,715,958.63
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		25,532,186.62	695,000.00
取得投资收益收到的现金			52,800,000.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		281,945.93	201,491.53
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	11,409,787.51	50,445,501.69
投资活动现金流入小计		37,223,920.06	104,141,993.22
投资支付的现金			
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		29,302,498.07	50,614,383.60
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	-	45,000,000.00
投资活动现金流出小计		29,302,498.07	95,614,383.60
投资活动产生的现金流量净额		7,921,421.99	8,527,609.62
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			

取得借款收到的现金		1,471,116,510.00	982,485,874.00
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	五（三）5	365,000,000.00	454,512,772.00
筹资活动现金流入小计		1,836,116,510.00	1,436,998,646.00
偿还债务支付的现金		950,539,198.26	853,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		204,130,014.08	182,183,755.20
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	1,601,439,750.89	22,000,000.00
筹资活动现金流出小计		2,756,108,963.23	1,057,183,755.20
筹资活动产生的现金流量净额		-919,992,453.23	379,814,890.80
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-55,619,453.51	23,142,419.79
五、现金及现金等价物净增加额		3,577,026,254.69	2,050,200,878.84
加：期初现金及现金等价物余额		15,969,616,524.14	13,919,415,645.30
六、期末现金及现金等价物余额		19,546,642,778.83	15,969,616,524.14

法定代表人：葛国栋 主管会计工作负责人：黄峥嵘 会计机构负责人：黄峥嵘

注1：财务报表附注与新三板报告列示科目略有不同，下同。上表所列的“收到其他与经营活动有关的现金”包含附注中五（三）“收到其他与经营活动有关的现金”、“处置交易目的而持有的金融资产净增加额”1,521,475,813.67元及“代理买卖证券收到的现金”200,556,427.56元。

（六） 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,214,555,964.30	1,178,913,890.98
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		2,599,802,281.79	2,838,816,507.53
经营活动现金流入小计		3,814,358,246.09	4,017,730,398.51
为交易目的而持有的金融资产净增加额			143,837,536.02
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金			
支付利息、手续费及佣金的现金		47,810,583.17	33,093,214.60
以现金支付的业务及管理费		175,242,673.92	145,861,112.67
支付给职工以及为职工支付的现金		391,751,886.21	417,895,682.59
支付的各项税费		251,140,711.91	182,146,211.63
支付其他与经营活动有关的现金		1,059,482,921.57	517,235,038.47
经营活动现金流出小计		1,925,428,776.78	1,440,068,795.98
经营活动产生的现金流量净额		1,888,929,469.31	2,577,661,602.53
二、投资活动产生的现金流量：			

收回投资收到的现金			347,500.00
取得投资收益收到的现金		80,000,000.00	145,800,000.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		140,664.79	201,491.53
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		80,140,664.79	146,348,991.53
投资支付的现金		300,000,000.00	300,408,500.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		26,253,483.97	49,050,186.16
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		326,253,483.97	349,458,686.16
投资活动产生的现金流量净额		-246,112,819.18	-203,109,694.63
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金		300,000,000.00	
筹资活动现金流入小计		300,000,000.00	
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		157,200,000.00	157,200,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计		157,200,000.00	157,200,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		142,800,000.00	-157,200,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
五、现金及现金等价物净增加额		1,785,616,650.13	2,217,351,907.90
加：期初现金及现金等价物余额		15,488,253,132.19	13,270,901,224.29
六、期末现金及现金等价物余额		17,273,869,782.32	15,488,253,132.19

(七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	2020年												
	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				1,501,682,614.86		39,928,823.91		398,170,713.39	458,061,727.32	3,156,082,214.84		6,863,926,094.32
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	-	-	-	1,501,682,614.86	-	39,928,823.91	-	398,170,713.39	458,061,727.32	3,156,082,214.84	-	6,863,926,094.32
三、本期增减变动金额（减少以					-60,825.6		-54,629.1		91,568,	91,568,	805,672,		934,119

“-”号填列)	-	-	-	-	5	-	08.99	-	393.66	393.66	497.98	-	,350.66
(一) 综合收益总额							-54,629,108.99				1,146,009,285.30		1,091,380,176.31
(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	-	-	-	-	-	-	-	-	91,568,393.66	91,568,393.66	-340,336,787.32	-	-157,200,000.00
1. 提取盈余公积									91,568,393.66		-91,568,393.66		-

2. 提取一般风险准备										91,568,393.66	-91,568,393.66		-
3. 对所有者（或股东）的分配											-157,200,000.00		-157,200,000.00
4. 其他													-
（四）所有者权益内部结转													-
1. 资本公积转增资本（或股本）													-
2. 盈余公积转增资本（或股本）													-
3. 盈余公积弥补亏损													-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益													-
5. 其他综合收益结转留存收益													-

													-
6. 其他													-
(五) 专项储备													-
1. 本期提取													-
2. 本期使用													-
(六) 其他					-60,825.65								-60,825.65
四、本年期末余额	1,310,000.00	-	-	-	1,501,621.789.21	-	-14,700,285.08	-	489,739,107.05	549,630,120.98	3,961,754,712.82	-	7,798,045,444.98

项目	2019年												
	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				1,500,860		-59,662,800		296,991,000	356,882,000	2,567,000		5,972,160

	0,000.00				8,930.15		53.60		,371.55	,385.48	87,497.43		7,331.01
加：会计政策变更							77,533,213.44				-52,167,182.06		25,366,031.38
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	-	-	-	1,500,868,930.15	-	17,870,359.84	-	296,991,371.55	356,882,385.48	2,514,920,315.37	-	5,997,533,362.39
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	813,684.71	-	22,058,464.07	-	101,179,341.84	101,179,341.84	641,161,899.47	-	866,392,731.93
（一）综合收益总额							22,058,464.07				1,000,720,583.15		1,022,779,047.22
（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									101,179,341.84	101,179,341.84	-359,558,683.68		-157,200,000.00
1. 提取盈余公积									101,179,341.84		-101,179,341.84		-

											4		
2. 提取一般风险准备									101,179,341.84	-101,179,341.84			-
3. 对所有者（或股东）的分配											4		
											-157,200,000.00		-157,200,000.00
4. 其他											0		
（四）所有者权益内部结转													-
1. 资本公积转增资本（或股本）													-
2. 盈余公积转增资本（或股本）													-
3. 盈余公积弥补亏损													-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益													-
5. 其他综合收益结转留存收益													-
6. 其他													-
（五）专项储备													-
1. 本期提取													-
2. 本期使用													-
（六）其他					813,684.71								813,684.71
四、本年末余额	1,310,000.00	-	-	-	1,501,682,614.86	-	39,928,823.91	-	398,170,713.39	458,061,727.32	3,156,082,214.84	-	6,863,926,094.32

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(八) 母公司股东权益变动表

单位：元

项目	2020年											
	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				1,502,904,302.10		-1,220,053.50		398,170,713.39	458,061,727.32	2,564,346,669.32	6,232,263,358.63
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	-	-	-	1,502,904,302.10	-	-1,220,053.50	-	398,170,713.39	458,061,727.32	2,564,346,669.32	6,232,263,358.63
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	-	-	-	-	91,568,393.66	91,568,393.66	575,347,149.23	758,483,936.55
（一）综合收益总额											915,683,936.55	915,683,936.55
（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		-	-	-	-	-	-	-	91,568,393.66	91,568,393.66	-340,336,787.32	-157,200,000.00	0.00
1. 提取盈余公积									91,568,393.66		-91,568,393.66		-
2. 提取一般风险准备										91,568,393.66	-91,568,393.66		-
3. 对所有者（或股东）的分配											-157,200,000.00	-157,200,000.00	0.00
4. 其他													-
(四) 所有者权益内部结转													-
1. 资本公积转增资本（或股本）													-
2. 盈余公积转增资本（或股本）													-
3. 盈余公积弥补亏损													-

4. 设定受益计划变动额结转留存收益													-
5. 其他综合收益结转留存收益													-
6. 其他													-
(五) 专项储备													-
1. 本期提取													-
2. 本期使用													-
(六) 其他													-
四、本年期末余额	1,310,000,000.00	-	-	-	1,502,904,302.10	-	-1,220,053.50	-	489,739,107.05	549,630,120.98	3,139,693,818.55	6,990,747,295.18	

项目	2019年											
	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				1,502,700,854.26		-75,562,719.52		296,991,371.55	356,882,385.48	1,986,454,600.67	5,377,466,492.44
加：会计政策变更							74,342,666.02				-74,342,666.02	-
前期差错更正												-

其他													-
二、本年期初余额	1,310,000,000.00	-	-	-	1,502,700,854.26	-	-1,220,053.50	-	296,991,371.55	356,882,385.48	1,912,111,934.65	5,377,466,492.44	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	203,447.84	-	-	-	101,179,341.84	101,179,341.84	652,234,734.67	854,796,866.19	
（一）综合收益总额											1,011,793,418.35	1,011,793,418.35	
（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	-	-	-	-	-	-	-	-	101,179,341.84	101,179,341.84	-359,558,683.68	-157,200,000.00	
1. 提取盈余公积									101,179,341.84		-101,179,341.84		-
2. 提取一般风险准备										101,179,341.84	-101,179,341.84		-
3. 对所有者（或股东）的分配											-157,200,000.00	-157,200,000.00	
4. 其他													-
（四）所有者权益内部结转													-
1. 资本公积转增资本（或股本）													-
2. 盈余公积转增资本（或股本）													-
3. 盈余公积弥补亏损													-

4. 设定受益计划变动额结转留存收益													-
5. 其他综合收益结转留存收益													-
6. 其他													-
（五）专项储备													-
1. 本期提取													-
2. 本期使用													-
（六）其他					203,447.84								203,447.84
四、本年期末余额	1,310,000.00	-	-	-	1,502,904,302.10	-	-1,220,053.50	-	398,170,713.39	458,061,727.32	2,564,346,669.32	6,232,263,358.63	

永安期货股份有限公司

财务报表附注

2020 年度

金额单位：人民币元

一、公司基本情况

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

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

本公司下设 28 家营业部及 16 家分公司,分别位于北京、天津、上海、重庆、浙江、山东、辽宁等地。本公司拥有控股子公司 13 家,分别为浙江永安资本管理有限公司(以下简称永安资本)、浙江中邦实业发展有限公司(以下简称中邦实业)、上海永安瑞萌商贸有限公司(以下简称永安瑞萌)、香港永安商贸有限公司(以下简称香港永安商贸)、永安(新加坡)国际贸易有限公司(以下简称永安国贸)、浙江永安国油能源有限公司(以下简称永安国油)、新永安国际金融控股有限公司(以下简称新永安金控)、中国新永安期货有限公司(以下简称新永安期货)、中国新永安实业有限公司(以下简称新永安实业)、新永安国际证券有限公司(以下简称新永安证券)、新永安国际资产管理有限公司(以下简称新永安资管)、永安国际金融(新加坡)有限公司(以下简称永安国际金融)和永安全球基金独立投资组合公司(以下简称永安全球基金)。

本财务报表业经公司 2021 年 4 月 6 日三届十一次董事会批准对外报出。

本公司纳入报告期合并财务报表范围的子公司和结构化主体情况详见本财务报表附注六和七之说明。

二、财务报表的编制基础

(一)编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

(二)持续经营能力评价

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

三、重要会计政策及会计估计

重要提示：本公司根据实际生产经营特点针对金融工具减值、投资性房地产折旧或摊销、固定资产折旧、无形资产摊销、收入确认等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

（一）遵循企业会计准则的声明

本公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

（二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

（三）营业周期

公司经营业务的营业周期为 12 个月。

（四）记账本位币

公司采用人民币为记账本位币。

（五）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

1. 同一控制下企业合并的会计处理方法

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

2. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

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

（六）合并财务报表的编制方法

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

（七）现金及现金等价物的确定标准

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

（八）外币业务和外币报表折算

1. 外币业务折算

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

2. 外币财务报表折算

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

(九) 金融工具

1. 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

(1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第14号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

(2) 金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

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

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

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

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

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

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

(3) 金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

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

按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述 1) 或 2) 的财务担保合同，以及不属于上述 1) 并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：① 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

4) 以摊余成本计量的金融负债

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

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

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

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

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：（1）未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；（2）保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产在终止确认日的账面价值；（2）因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）终止确认部分的账面价值；（2）终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。

4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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

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

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

5. 金融工具减值

（1）金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变

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

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

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

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

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

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

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

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

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

(2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
融出资金	款项性质	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失

结算备付金——应收交易所和商业 银行等组合	款项性质	对于存放在境内外交易所和 商业银行的款项纳入应收交 易所和商业银行组合,结合当 前状况以及对未来经济状况 的预测,通过违约风险敞口和 未来12个月内或整个存续期 预期信用损失率,计算预期信 用损失
存出保证金——应收交易所和商业 银行等组合	款项性质	
应收货币保证金——应收交易所和 商业银行等组合	款项性质	
结算备付金——其他组合	款项性质	参考历史信用损失经验,结合 当前状况以及对未来经济状 况的预测,结合当前状况以及 对未来经济状况的预测,通过 违约风险敞口和未来12个月 内或整个存续期预期信用损 失率,计算预期信用损失
存出保证金——其他组合	款项性质	
应收货币保证金——其他组合	款项性质	
应收质押保证金——应收交易所和 商业银行等组合	款项性质	应收质押保证金系公司代客 户向期货交易所办理有价证 券充抵保证金业务形成的可 用于期货交易的保证金,纳入 应收交易所和商业银行等组 合,参考历史信用损失经验, 结合当前状况以及对未来经 济状况的预测,通过违约风险 敞口和未来12个月内或整个 存续期预期信用损失率,计算 预期信用损失
应收结算担保金——应收交易所和 商业银行等组合	款项性质	应收结算担保金存放于中国 金融期货交易所、中国证券登 记结算有限公司和Asia Pacific Exchange等,纳入应 收交易所和商业银行等组合, 参考历史信用损失经验,结合 当前状况以及对未来经济状 况的预测,通过违约风险敞口 和未来12个月内或整个存续 期预期信用损失率,计算预期 信用损失
其他应收款——账龄组合	账龄	参考历史信用损失经验,结合 当前状况以及对未来经济状 况的预测,通过违约风险敞口 和未来12个月内或整个存续 期预期信用损失率,计算预期 信用损失
其他应收款——合并范围内关联方 组合	合并范围内关联方	参考历史信用损失经验,结合 当前状况以及对未来经济状 况的预测,通过违约风险敞口 和未来12个月内或整个存续 期预期信用损失率,计算预期 信用损失

(3) 按组合计量预期信用损失的应收款项

1) 具体组合及计量预期信用损失的方法

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

2) 账龄组合的账龄与整个存续期预期信用损失率对照表

账 龄	预期信用损失率(%)
1年以内(含,下同)	5
1-2年	20
2-3年	30
3-4年	40
4年以上	100

6. 金融资产和金融负债的抵销

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

不满足终止确认条件的金融资产转移,公司不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

(十) 存货

1. 存货的分类

本公司持有存货系持有以备出售的商品。

2. 发出存货的计价方法

发出存货采用个别计价法。

3. 存货可变现净值的确定依据

资产负债表日,存货采用成本与可变现净值孰低计量,按照存货类别成本高于可变现净

值的差额计提存货跌价准备。本公司以该存货的估计售价减去估计的销售费用和相关税费后的金额确定其可变现净值, 并与其对应的成本进行比较, 确定存货跌价准备的计提或转回的金額。

4. 存货的盘存制度

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, 结算客户保证金账户资金。

(十三) 质押品的管理与核算方法

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

(十四) 实物交割的管理与核算方法

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

(十五) 客户资产管理业务核算方法

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体, 单独建账、独立核算, 单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

(十六) 长期股权投资

1. 共同控制、重大影响的判断

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. 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，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的相关规定进行核算。

(2) 合并财务报表

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

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

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

2) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“一揽子交易”的

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

(十七) 投资性房地产

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

2. 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。

(十八) 固定资产

1. 固定资产确认条件

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

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

(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。

(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)
土地使用权	40
软 件	3

(二十一) 部分长期资产减值

对长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用寿命有限的无形资产等长期资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，估计其可收回金额。对因企业合并所形成的商誉和使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

(二十二) 长期待摊费用

长期待摊费用核算已经支出，摊销期限在1年以上（不含1年）的各项费用。长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

(二十三) 期货风险准备金提取和使用的会计处理方法

1. 期货风险准备金按母公司代理手续费净收入的5%计提，计入当期损益。
2. 风险损失的确认标准为：
 - (1) 因管理不严、错单交易等造成的应由公司承担的客户交易损失；
 - (2) 客户期货业务发生穿仓时，按规定核销难以收回的垫付款项。
3. 风险准备金不足以弥补的损失计入当期损益。

(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) 职工薪酬

1. 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。
2. 短期薪酬的会计处理方法

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

3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

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

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤:

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

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

3) 期末,将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分,其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本,重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益,并且在后续会计期间不允许转回至损益,但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

4. 辞退福利的会计处理方法

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

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

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

(二十六) 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。

(二十七) 合同资产、合同负债

公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。公司将同一合同下的合同资产和合同负债相互抵销后以净额列示。

公司将拥有的、无条件(即,仅取决于时间流逝)向客户收取对价的权利作为应收款项列

示，将已向客户转让商品而有权收取对价的权利（该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示。

公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务作为合同负债列示。

（二十八）收入

1. 收入确认原则

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

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

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

2. 收入计量原则

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

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

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

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

3. 收入确认的具体方法

本公司收入主要包括期货经纪业务收入、资产管理业务收入、利息收入、商品销售收入

和基金销售业务收入等。

(1) 期货经纪业务收入

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

(2) 资产管理业务收入

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

(3) 利息收入

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

(4) 商品销售收入

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

(5) 基金销售业务收入

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

(6) 其他收入

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

(二十九) 政府补助

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

2. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

政府文件规定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。政府文件不明确的，以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断，以购建或以其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

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

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

（三十）递延所得税资产、递延所得税负债

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

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

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

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

（三十一）经营租赁

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

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

（三十二）分部报告

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

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

（三十三）一般风险准备的提取和使用核算方法

1. 一般风险准备按照母公司当期实现净利润的 10%提取。
2. 公司发生风险损失，使用一般风险准备弥补的，同时贷记“利润分配——一般风险

准备补亏”科目。

(三十四) 重要会计政策、会计估计变更说明

1. 企业会计准则变化引起的会计政策变更

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

1) 执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下:

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

2) 对 2020 年 1 月 1 日之前发生的合同变更,公司采用简化处理方法,对所有合同根据合同变更的最终安排,识别已履行的和尚未履行的履约义务、确定交易价格以及在已履行的和尚未履行的履约义务之间分摊交易价格。采用该简化方法对公司财务报表无重大影响。

(2) 公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部于 2019 年度颁布的《企业会计准则解释第 13 号》,该项会计政策变更采用未来适用法处理。

四、税项

(一) 主要税种及税率

1. 主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额,扣除当期允许抵扣的进项税额后,差额部分为应交增值税	13%、9%、6%、3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	8.25%、16.5%、17%、25%

2. 增值税税率说明

根据财政部、税务总局、海关总署《关于深化增值税改革有关政策的公告》(财政部税务局海关总署公告 2019 年第 39 号),自 2019 年 4 月 1 日起,纳税人发生增值税应税销售行为,原适用 16%税率的,税率调整为 13%;原适用 10%税率的,税率调整为 9%。

根据《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

3. 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
永安国贸	17%
永安国际金融	17%
香港永安商贸	16.5%
新永安金控	16.5%
新永安期货	16.5%
新永安实业	16.5%
新永安证券	8.25%、16.5%[注1]
新永安资管	16.5%
永安全球基金	[注2]
除上述以外的其他纳税主体	25%

[注1]新永安证券2020年度缴纳企业所得税(利得税)适用两级制税率，应纳税所得额不超过2,000,000港币的部分适用税率8.25%，超过2,000,000港币的部分适用税率16.5%

[注2]永安全球基金注册地在开曼群岛，免交企业所得税

(二) 税收优惠

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

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

五、合并财务报表项目注释

(一) 合并资产负债表项目注释

1. 货币资金

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
库存现金	8,313.64	8,315.11
银行存款	1,869,350,605.88	897,611,616.61
期货保证金存款	17,653,414,687.86	16,209,864,177.87
证券经纪业务保证金	256,218,024.30	55,713,840.30
其他货币资金	232,949,598.73	114,044,797.15
合 计	20,011,941,230.41	17,277,242,747.04
其中：存放在境外的款项总额	1,780,648,405.15	1,425,392,012.31

(2) 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	HKD 3,035,532.39	0.8416	2,554,704.06	HKD 1,476,204.99	0.8958	1,322,384.43
工商银行	JPY 783,784.00	0.0632	49,535.15	JPY 25,391,446.00	0.0641	1,627,591.69
工商银行	USD 853,110.02	6.5249	5,566,457.57	USD 2,403,860.43	6.9762	16,769,811.13
工商银行	RMB 816,413,690.45	1.0000	816,413,690.45	RMB 321,026,270.14	1.0000	321,026,270.14
工商银行	SGD 14,747.46	4.9314	72,725.62	SGD		
光大银行	RMB 5,530,334.42	1.0000	5,530,334.42	RMB 5,477,465.74	1.0000	5,477,465.74
建设银行	RMB 37,023,038.56	1.0000	37,023,038.56	RMB 36,054,317.41	1.0000	36,054,317.41
交通银行	EUR 397,065.59	8.0250	3,186,451.36	EUR 264,912.20	7.8155	2,070,421.30
交通银行	HKD 1,683,626.44	0.8416	1,416,940.01	HKD 23,357,345.26	0.8958	20,923,509.88
交通银行	JPY 26,221,810.00	0.0632	1,657,218.39	JPY 10,092,241.00	0.0641	646,912.65
交通银行	RMB 4,829,151,351.26	1.0000	4,829,151,351.26	RMB 8,934,218,786.33	1.0000	8,934,218,786.33
交通银行	USD 9,987,930.40	6.5249	65,170,247.07	USD 4,494,324.53	6.9762	31,353,306.79
交通银行	GBP 116,770.40	8.8903	1,038,123.89	GBP 153,857.41	9.1501	1,407,810.69
民生银行	RMB 3,081,179,357.39	1.0000	3,081,179,357.39	RMB 2,637,399,231.25	1.0000	2,637,399,231.25
民生银行	HKD 6.80	0.8416	5.72	HKD 6.80	0.8958	6.09
民生银行	USD 16,085,612.89	6.5249	104,957,015.55	USD 25,079,606.91	6.9762	174,960,353.73
农业银行	RMB 541,637,768.72	1.0000	541,637,768.72	RMB 35,249,488.19	1.0000	35,249,488.19
浦发银行	RMB 1,502,990,366.32	1.0000	1,502,990,366.32	RMB 5,561,946.47	1.0000	5,561,946.47

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
兴业银行	RMB 3,315,861,927.25	1.0000	3,315,861,927.25	RMB 2,759,135,469.13	1.0000	2,759,135,469.13
兴业银行	HKD			HKD 20,000,000.00	0.8958	17,916,000.00
兴业银行	USD 89,420,807.64	6.5249	583,461,827.77	USD 57,048,154.78	6.9762	397,979,337.38
渣打银行	HKD 1,088,643.69	0.8416	916,202.53	HKD 1,883,248.11	0.8958	1,687,013.66
渣打银行	USD 891,086.54	6.5249	5,814,250.56	USD 179,236.38	6.9762	1,250,388.83
招商银行	RMB 5,606,035.18	1.0000	5,606,035.18	RMB 5,936,956.61	1.0000	5,936,956.61
招商银行	HKD 2,552,219.47	0.8416	2,147,947.91	HKD 11,341,185.99	0.8958	10,159,434.41
招商银行	USD 1,522,165.63	6.5249	9,931,978.52	USD 1,027,322.26	6.9762	7,166,805.55
中国银行	EUR 2,169,515.97	8.0250	17,410,365.66	EUR 55,580.90	7.8155	434,392.52
中国银行	HKD 73,608,839.50	0.8416	61,949,199.32	HKD 72,751,236.74	0.8958	65,170,557.87
中国银行	USD 37,158,790.49	6.5249	242,457,392.07	USD 15,191,157.51	6.9762	105,976,553.02
中国银行	JPY 40,384,536.00	0.0632	2,552,302.68	JPY 41,284,112.00	0.0641	2,646,311.58
中国银行	RMB 60,607,112.22	1.0000	60,607,112.22	RMB 82,253,432.44	1.0000	82,253,432.44
中国银行	SGD 500.47	4.9314	2,468.02	SGD		
中信银行	RMB 1,314,309,231.20	1.0000	1,314,309,231.20	RMB 12,974,167.78	1.0000	12,974,167.78
平安银行	RMB 507,174,255.24	1.0000	507,174,255.24	RMB 1,998,471.61	1.0000	1,998,471.61
星展银行	RMB 514,790,103.12	1.0000	514,790,103.12	RMB 506,225,490.67	1.0000	506,225,490.67
星展银行	USD 1,200,334.78	6.5249	7,832,064.41	USD 700,063.20	6.9762	4,883,780.90
大华银行	USD 143,376.28	6.5249	935,515.89	USD		
大华银行	SGD 12,000.00	4.9314	59,176.80	SGD		
小计			17,653,414,687.86			16,209,864,177.87

(3) 货币资金——证券经纪业务保证金

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
中国银行	HKD 214,340,681.35	0.8416	180,389,117.42	HKD 45,400,249.67	0.8958	40,669,543.65
中国银行	RMB 3,982,095.09	1.0000	3,982,095.09	RMB 1,639,929.06	1.0000	1,639,929.06
中国银行	USD 10,781,807.92	6.5249	70,350,218.50	USD 1,921,442.56	6.9762	13,404,367.59
交通银行	HKD 1,778,271.50	0.8416	1,496,593.29			

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
小计			256,218,024.30			55,713,840.30

(4) 其他说明

期末货币资金中有融券保证金、保函保证金、信用证保证金和远期结售汇保证金等合计金额为 138,736,230.06 元，其使用受限。

2. 结算备付金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	6,860,225.56	100.00	6,548.32	0.10	6,853,677.24
合计	6,860,225.56	100.00	6,548.32	0.10	6,853,677.24

(续上表)

种类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67
合计	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67

2) 采用组合计提坏账准备的结算备付金

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所和商业银行等组合	6,729,241.35			599,309.79		
其他组合	130,984.21	6,548.32	5.00	139,859.87	6,992.99	5.00
小计	6,860,225.56	6,548.32	0.10	739,169.66	6,992.99	0.95

(2) 明细情况——按类别

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	账面价值	账面余额	坏账准备	账面价值
公司自有备付金	6,860,225.56	6,548.32	6,853,677.24	739,169.66	6,992.99	732,176.67

小 计	6,860,225.56	6,548.32	6,853,677.24	739,169.66	6,992.99	732,176.67
-----	--------------	----------	--------------	------------	----------	------------

(3) 坏账准备变动情况

项 目	期初数	本期增加			本期减少			期末数
		计提	收回	其他	转回	核销	其他	
结算备付金	6,992.99	-21.57		-423.10				6,548.32
小 计	6,992.99	-21.57		-423.10				6,548.32

坏账变动说明：结算备付金余额均属于第一阶段。

3. 融出资金

(1) 明细情况——按类别

项 目	期末数	期初数
孖展融资	300,697,185.23	42,305,165.46
减：减值准备	11,923,481.07	2,115,258.27
合 计	288,773,704.16	40,189,907.19

(2) 明细情况——按客户

项 目	期末数	期初数
个人	172,050,585.98	32,004,680.10
机构	128,646,599.25	10,300,485.36
减：减值准备	11,923,481.07	2,115,258.27
合 计	288,773,704.16	40,189,907.19

(3) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合 计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失(未发生 信用减值)	整个存续期预 期信用损失(已 发生信用减值)	
期初数	2,115,258.27			2,115,258.27
本期计提	8,131,999.32		1,804,206.29	9,936,205.61
本期收回				
本期转回				
本期核销				
其他变动	-127,982.81			-127,982.81
期末数	10,119,274.78		1,804,206.29	11,923,481.07

4. 应收货币保证金

交易所/清算商名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,422,216,335.59	3,597,636,324.04
大连商品交易所	4,289,774,056.09	2,851,763,069.36
郑州商品交易所	1,976,831,487.78	1,194,736,420.73
中国金融期货交易所	4,138,518,349.95	2,548,869,476.49
上海国际能源交易中心	727,999,964.99	278,249,745.06
中国证券登记结算有限责任公司	519,275,158.03	344,143,319.64
香港期货交易所	154,257,111.73	180,607,087.44
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED	243,613,955.22	120,611,578.84
MAREX FINANCIAL Ltd	200,789,583.05	71,599,398.20
Philip Futures Pte Ltd	122,918,054.94	100,755,176.17
DBS Bank Ltd	18,862,746.37	6,148,091.64
R. J. O' Brien & Associates	17,811,149.60	35,675,599.28
ADMIS SINGAPORE PTE LTD BANKING INSTRUCTION	6,625,162.85	8,150,467.19
GF Financial Markets (UK) Limited	3,384,308.72	
Nissan Securities Co.,Ltd	2,453,718.61	2,701,090.81
CGS-CIMB Futures Sdn.Bhd.	873,631.70	
Asia Pacific Exchange	546,018.59	304,399.43
VI INVESTMENT CORPORATION	163,348.85	166,090.73
KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd	15,795.26	16,889.91
其他	458,177.62	511,518.86
减值准备	29,932,435.44	16,983,814.56
合 计	15,817,455,680.10	11,325,661,929.26

5. 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	368,672,492.00	184,389,160.00
大连商品交易所	203,915,440.00	

郑州商品交易所	140,938,784.00	129,312,000.00
上海国际能源交易中心	14,420,400.00	
中国金融期货交易所	320,371,040.00	308,015,872.00
合 计	1,048,318,156.00	621,717,032.00

(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
液化石油气	153,519,800.00	80.00%	122,815,840.00
国债 10 年期	299,089,300.00	80.00%	239,271,440.00
国债 2 年期	202,749,000.00	80.00%	162,199,200.00
20 号胶	14,992,500.00	80.00%	11,994,000.00
原油	3,033,000.00	80.00%	2,426,400.00
白银	314,988,240.00	80.00%	251,990,592.00
沥青	12,000,000.00	80.00%	9,600,000.00
铜	23,156,000.00	80.00%	18,524,800.00
铅	84,186,125.00	80.00%	67,348,900.00
橡胶	26,510,250.00	80.00%	21,208,200.00
棉花一号	24,731,200.00	80.00%	19,784,960.00
干制红枣	3,962,000.00	80.00%	3,169,600.00
硅铁	12,357,840.00	80.00%	9,886,272.00
锰硅	9,461,200.00	80.00%	7,568,960.00
PTA	125,661,240.00	80.00%	100,528,992.00
合 计	1,310,397,695.00		1,048,318,156.00

6. 存出保证金

(1) 明细情况

存放机构	期末数	期初数
PHILLIP CAPITAL	652,399.91	697,613.21
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	593,920.49	179,160.00
减值准备	32,620.00	34,880.66
合 计	1,213,700.40	841,892.55

7. 应收账款

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	52,702,744.35	100.00	2,804,443.35	5.32	49,898,301.00
其中：应收佣金	3,559,012.67	6.75	292,504.80	8.22	3,266,507.87
应收货款	49,143,731.68	93.25	2,511,938.55	5.11	46,631,793.13
合 计	52,702,744.35	100.00	2,804,443.35	5.32	49,898,301.00

(续上表)

种 类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09
其中：应收佣金	15,614,020.73	57.39	1,752,466.75	11.22	13,861,553.98
应收货款	11,593,228.54	42.61	579,661.43	5.00	11,013,567.11
合 计	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09

2) 采用组合计提坏账准备的应收账款

采用账龄组合计提坏账准备的应收账款

账 龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1年以内	52,217,147.93	2,610,857.39	5.00
1-2年	365,013.08	73,002.62	20.00
4年以上	120,583.34	120,583.34	100.00
小 计	52,702,744.35	2,804,443.35	5.32

(2) 坏账准备变动情况

项 目	期初数	本期增加			本期减少			期末数
		计提	收回	其他	转回	核销	其他	
按组合计提坏账准备	2,332,128.18	472,315.17						2,804,443.35
小 计	2,332,128.18	472,315.17						2,804,443.35

(3) 应收账款金额前5名情况

单位名称	账面余额	占应收账款余额	坏账准备

		的比例(%)	
客户 a	12,355,706.57	23.44	617,785.33
客户 b	7,294,168.48	13.84	364,708.42
客户 c	3,518,748.07	6.68	175,937.40
客户 d	3,463,733.64	6.57	173,186.68
客户 e	2,410,787.20	4.57	120,539.36
小计	29,043,143.96	55.10	1,452,157.19

8. 应收款项融资

(1) 明细情况

项目	期末数					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	减值准备
应收票据	49,147,244.81				49,147,244.81	
合计	49,147,244.81				49,147,244.81	

(续上表)

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

(2) 公司已背书或贴现且在资产负债表日尚未到期的应收票据情况

项目	期末终止确认金额	
	期末数	期初数
银行承兑汇票	136,290,126.86	43,622,024.38
小计	136,290,126.86	43,622,024.38

银行承兑汇票的承兑人是商业银行，由于商业银行具有较高的信用，银行承兑汇票到期不获支付的可能性较低，故本公司将已背书或贴现的银行承兑汇票予以终止确认。但如果该等票据到期不获支付，依据《票据法》之规定，公司仍将对持票人承担连带责任。

9. 预付款项

(1) 账龄分析

账龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例(%)	减值准备	账面价值	账面余额	比例(%)	减值准备	账面价值

1年以内	520,600,237.72	99.99		520,600,237.72	298,483,701.06	98.82		298,483,701.06
1-2年	51,078.63	0.01		51,078.63	3,546,949.12	1.17		3,546,949.12
2-3年	16,000.00	0.00		16,000.00	9,401.60	0.01		9,401.60
合计	520,667,316.35	100.00		520,667,316.35	302,040,051.78	100.00		302,040,051.78

(2) 预付款项金额前5名情况

单位名称	账面余额	占预付款项余额的比例(%)
供应商 a	34,943,886.80	6.71
供应商 b	23,849,679.06	4.58
供应商 c	22,097,191.85	4.24
供应商 d	21,504,933.42	4.13
供应商 e	19,517,582.73	3.75
小计	121,913,273.86	23.41

10. 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	55,293,060.51	20,312,096.04
中国证券登记结算有限责任公司	10,882,875.08	10,800,000.00
Asia Pacific Exchange	3,264,489.97	3,481,757.21
合计	69,440,425.56	34,593,853.25

11. 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	676,263.93	100.00		676,263.93				
2-3年					17,004.09	100.00		17,004.09
合计	676,263.93	100.00		676,263.93	17,004.09	100.00		17,004.09

(2) 应收风险损失款金额前5名情况

单位名称	账面余额
客户 f	240,323.52
客户 g	213,567.73
客户 h	158,422.03
客户 i	19,876.29

客户 j	18,268.18
小计	650,457.75

12. 其他应收款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应收利息	1,503,283.61	1,905,396.09
应收股利		14,558.23
其他应收款	449,196,774.86	86,397,721.63
合 计	450,700,058.47	88,317,675.95

(2) 应收利息

项 目	期末数	期初数
定期存款	1,503,283.61	1,848,620.32
债券投资		43,834.47
其他		12,941.30
小 计	1,503,283.61	1,905,396.09

(3) 应收股利

项 目	期末数	期初数
其他零星股利		14,558.23
小 计		14,558.23

(4) 其他应收款

1) 明细情况

① 类别明细情况

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提坏账准备	138,224,665.59	29.38	1,149,528.63	0.83	137,075,136.96
按组合计提坏账准备	332,310,114.85	70.62	20,188,476.95	6.08	312,121,637.90
合 计	470,534,780.44	100.00	21,338,005.58	4.53	449,196,774.86

(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 (%)	

单项计提坏账准备	50,153,408.74	50.92	3,229,194.47	6.44	46,924,214.27
按组合计提坏账准备	48,343,449.27	49.08	8,869,941.91	18.35	39,473,507.36
合计	98,496,858.01	100.00	12,099,136.38	12.28	86,397,721.63

② 期末单项计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
鹏扬基金安盈纯债1号集合资产管理计划	10,012,166.70			理财产品清算款
交银国信·风云16号敦和TOF集合资金信托计划	5,000,000.00			理财产品认购款
浙商中短债债券C	20,000,000.00			理财产品认购款
平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金A	50,022,913.06			理财产品清算款
YONGAN GLOBAL FUND SPC - SERIES 1 SP	15,968,514.16			理财产品清算款
BOCHK short term cash mgt fund	6,523,999.04			理财产品认购款
客户k [注]	13,047,998.08	652,399.90	5.00	该客户以在本公司享有的权益等为担保
客户m	9,942,574.54	497,128.73	5.00	该客户以在本公司享有的权益等为担保
境外证券业务清算及认购款	7,706,500.01			证券业务清算及认购款
小计	138,224,665.59	1,149,528.63	0.83	

[注] 新永安实业与万佳签订的拆借款协议已于2020年到期，本期与SEASON MAPLE PTE LTD重新签订一份等额的拆借款协议，并将相关拆借款转至SEASON MAPLE PTE LTD

2) 采用组合计提坏账准备的其他应收款

组合名称	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
账龄组合	332,310,114.85	20,188,476.95	6.08
其中：1年以内	324,913,319.12	16,245,665.96	5.00
1-2年	2,077,858.14	415,571.63	20.00
2-3年	1,068,115.52	320,434.66	30.00
3-4年	1,740,028.94	696,011.58	40.00
4年以上	2,510,793.13	2,510,793.13	100.00
小计	332,310,114.85	20,188,476.95	6.08

3) 账龄情况

项目	期末账面余额
----	--------

1年以内	440,147,412.09
1-2年	2,077,858.14
2-3年	11,010,690.06
3-4年	14,788,027.02
4年以上	2,510,793.13
小计	470,534,780.44

4) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合 计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失(未发 生信用减值)	整个存续期预期 信用损失(已发 生信用减值)	
期初数	2,799,787.20	558,159.07	8,741,190.11	12,099,136.38
期初数在本期	---	---	---	
--转入第二阶段	-118,302.17	118,302.17		
--转入第三阶段		-214,838.58	214,838.58	
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提	14,837,978.54	-25,987.49	-2,777,248.04	12,034,743.01
本期收回				
本期转回				
本期核销			2,408,982.06	2,408,982.06
其他变动	-124,268.99	-20,063.54	-242,559.22	-386,891.75
期末数	17,395,194.58	415,571.63	3,527,239.37	21,338,005.58

5) 本期实际核销的其他应收款情况

本期实际核销其他应收款 2,408,982.06 元。

6) 其他应收款款项性质分类情况

款项性质	期末数	期初数
押金保证金	15,979,099.47	10,219,875.86
对外拆出款	22,990,572.62	35,551,987.03
理财产品认购、清算及分红款	107,527,592.96	18,079,746.00
境外证券业务清算及认购款	7,706,500.01	5,489,773.29
场外业务应收款	305,722,892.15	24,636,602.08
其他	10,608,123.23	4,518,873.75

合 计	470,534,780.44	98,496,858.01
-----	----------------	---------------

7) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例(%)	坏账准备
客户 n	场外业务应收款	82,188,427.82	1 年以内	17.47	4,109,421.39
客户 0	场外业务应收款	58,566,682.85	1 年以内	12.45	2,928,334.14
客户 p	场外业务应收款	54,171,756.52	1 年以内	11.51	2,708,587.83
平安睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 A	理财产品认购、清算及分红款	50,022,913.06	1 年以内	10.63	
财通证券股份有限公司	场外业务应收款和其他	33,335,010.00	1 年以内	7.08	1,666,750.50
小 计		278,284,790.25		59.14	11,413,093.86

13. 存货

(1) 明细情况

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	1,450,910,879.36	17,096,345.48	1,433,814,533.88	1,309,871,578.16	16,128,741.30	1,293,742,836.86
发出商品	53,828,586.75	124,008.06	53,704,578.69	246,943,848.05	15,341,261.60	231,602,586.45
在途物资				5,969,376.00		5,969,376.00
合 计	1,504,739,466.11	17,220,353.54	1,487,519,112.57	1,562,784,802.21	31,470,002.90	1,531,314,799.31

(2) 存货跌价准备

1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	转回或转销	其他	
存货	31,470,002.90	462,861,109.02		477,110,758.38		17,220,353.54
小 计	31,470,002.90	462,861,109.02		477,110,758.38		17,220,353.54

2) 确定可变现净值的具体依据、报告期转回或转销存货跌价准备的原因

项 目	确定可变现净值的具体依据	转回 存货跌价准备的原因	转销 存货跌价准备的原因
存货	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	前期计提存货跌价准备的存货可变现净值上升	前期计提存货跌价准备的存货对外出售

14. 交易性金融资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	3,948,448,688.50	4,130,938,590.83
其中：债务工具投资	1,886,169.06	20,301,792.54
权益工具投资	3,651,359,979.42	4,025,967,544.94
衍生金融资产	295,202,540.02	84,669,253.35
合 计	3,948,448,688.50	4,130,938,590.83

(2) 其他说明

在当日无负债结算制度下，本公司的期货合约每日结算，其产生的持仓损益金额已在本公司应收货币保证金以及利润表中体现，而并未反映在上述衍生金融工具项目中。截至期末，本公司持有的期货合约的浮盈为 91,874,788.54 元，浮亏为 39,808,314.60 元。

15. 其他权益工具投资

项 目	期末数	期初数	本期股利收入	本期从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失	
				金额	原因
股权投资	25,838,630.14	26,845,000.00			
小 计	25,838,630.14	26,845,000.00			

16. 长期股权投资

(1) 分类情况

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
对联营企业投资	704,400,897.48		704,400,897.48	486,824,372.27		486,824,372.27
合 计	704,400,897.48		704,400,897.48	486,824,372.27		486,824,372.27

(2) 明细情况

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
浙江玉皇山南投资管理有限公司（以下简称玉皇山南）	15,880,193.16			3,716,589.27	
永安国富资产管理有限公司（以下简称永安国富）	445,271,030.71			230,579,045.19	
OSTC Yongan Trading Co., Limited	2,682,715.02			6,734,153.74	-402,003.96
鞍钢永安商品贸易有限公司（以下简称鞍钢永安）[注]	22,990,433.38		24,676,816.76	1,686,383.38	
合 计	486,824,372.27		24,676,816.76	242,716,171.58	-402,003.96

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备 期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
玉皇山南	-60,825.65				19,535,956.78	
永安国富					675,850,075.90	
OSTC Yongan Trading Co., Limited					9,014,864.80	
鞍钢永安						
合计	-60,825.65				704,400,897.48	

[注]经鞍钢永安股东会会议批准，鞍钢永安于2020年完成解散清算

17. 期货会员资格投资

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

18. 投资性房地产

(1) 明细情况

项目	房屋及建筑物	土地使用权	合计
账面原值			
期初数	11,695,462.54		11,695,462.54
本期增加金额	129,710,625.56	247,084,504.10	376,795,129.66
固定资产或无形资产转入	129,710,625.56	247,084,504.10	376,795,129.66
本期减少金额	773,902.54		773,902.54
转入固定资产	773,902.54		773,902.54
期末数	140,632,185.56	247,084,504.10	387,716,689.66
累计折旧和累计摊销			
期初数	1,660,390.85		1,660,390.85
本期增加金额	6,261,939.94	40,998,094.08	47,260,034.02
计提或摊销	3,143,526.54	4,118,075.04	7,261,601.58
固定资产或无形资产转入	3,118,413.40	36,880,019.04	39,998,432.44
本期减少金额	252,271.99		252,271.99
转入固定资产	252,271.99		252,271.99
期末数	7,670,058.80	40,998,094.08	48,668,152.88

账面价值			
期末账面价值	132,962,126.76	206,086,410.02	339,048,536.78
期初账面价值	10,035,071.69		10,035,071.69

(2) 未办妥产权证书的投资性房地产情况

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
福州中盛大厦7层701室	9,156,869.88	未通过房地产主管部门的竣工验收备案
浙江协作大厦8楼801-805室	118,506.71	因历史遗留原因至今未办理不动产权证书
小 计	9,275,376.59	

(3) 期末无投资性房地产用于担保。

19. 固定资产

(1) 账面价值

项 目	期末数	期初数
固定资产原价	209,773,359.35	339,701,481.76
减：累计折旧	111,431,675.58	107,570,731.26
加：固定资产清理		
固定资产合计	98,341,683.77	232,130,750.50

(2) 固定资产增减变动表

项 目	房屋及建筑物	电子设备及其他	运输工具	合 计
账面原值				
期初数	245,728,713.05	76,947,822.74	17,024,945.97	339,701,481.76
本期增加金额	773,902.54	4,376,601.80		5,150,504.34
购置		4,376,601.80		4,376,601.80
投资性房地产转入	773,902.54			773,902.54
本期减少金额	129,710,625.56	3,449,787.98	1,468,712.77	134,629,126.31
处置或报废		3,449,787.98	1,468,712.77	4,918,500.75
转入投资性房地产	129,710,625.56			129,710,625.56
外币报表折算差额		-396,997.61	-52,502.83	-449,500.44
期末数	116,791,990.03	77,477,638.95	15,503,730.37	209,773,359.35
累计折旧				
期初数	33,569,391.12	59,986,176.26	14,015,163.88	107,570,731.26
本期增加金额	5,287,032.01	5,807,659.34	953,550.69	12,048,242.04
计提	5,034,760.02	5,807,659.34	953,550.69	11,795,970.05
投资性房地产转入	252,271.99			252,271.99

本期减少金额	3,118,413.40	3,340,812.19	1,389,663.94	7,848,889.53
处置或报废		3,340,812.19	1,389,663.94	4,730,476.13
转入投资性房地产	3,118,413.40			3,118,413.40
外币报表折算差额		-294,108.93	-44,299.26	-338,408.19
期末数	35,738,009.73	62,158,914.48	13,534,751.37	111,431,675.58
账面价值				
期末账面价值	81,053,980.30	15,318,724.47	1,968,979.00	98,341,683.77
期初账面价值	212,159,321.93	16,961,646.48	3,009,782.09	232,130,750.50

(3) 未办妥产权证书的固定资产的情况

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
浙江协作大厦 6-8 楼（不含 8 楼 801-805 室）	592,533.33	因历史遗留原因至今未办理不动产权证
福州中盛大厦 7 层 702 室	7,284,224.72	未通过房地产主管部门的竣工验收备案
小计	7,876,758.05	

(4) 期末无固定资产用于担保。

20. 无形资产

(1) 明细情况

项 目	土地使用权	软件	合 计
账面原值			
期初数	261,915,921.72	45,979,596.11	307,895,517.83
本期增加金额		9,727,679.56	9,727,679.56
购置		9,727,679.56	9,727,679.56
本期减少金额	247,084,504.10		247,084,504.10
转入投资性房地产	247,084,504.10		247,084,504.10
外币报表折算差额		-107,632.35	-107,632.35
期末数	14,831,417.62	55,599,643.32	70,431,060.94
累计摊销			
期初数	36,911,134.92	37,250,950.90	74,162,085.82
本期增加金额	2,429,823.00	6,863,738.15	9,293,561.15
计提	2,429,823.00	6,863,738.15	9,293,561.15
本期减少金额	36,880,019.04		36,880,019.04
转入投资性房地产	36,880,019.04		36,880,019.04
外币报表折算差额		-99,760.25	-99,760.25

期末数	2,460,938.88	44,014,928.80	46,475,867.68
账面价值			
期末账面价值	12,370,478.74	11,584,714.52	23,955,193.26
期初账面价值	225,004,786.80	8,728,645.21	233,733,432.01

(2) 期末无无形资产用于担保。

21. 递延所得税资产、递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

项 目	期末数		期初数	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
尚未支付的职工薪酬	600,590,370.23	150,147,592.56	584,716,222.37	146,179,055.59
存货跌价准备	12,627,551.60	3,156,887.90	31,470,002.90	7,867,500.72
坏账准备	21,526,904.91	5,381,726.24	10,344,228.32	2,481,575.55
期货风险准备金	7,508,020.48	1,877,005.12	7,525,024.55	1,881,256.14
公允价值变动浮亏	351,983,171.79	87,995,792.95	140,487,141.56	35,023,534.83
应付期货投资者保障基金	780,245.96	195,061.49	633,661.80	158,415.45
其他	14,726,351.89	3,681,587.97		
合 计	1,009,742,616.86	252,435,654.23	775,176,281.50	193,591,338.28

(2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
公允价值变动浮盈	755,230,001.14	188,807,500.29	350,116,427.78	87,529,106.96
合 计	755,230,001.14	188,807,500.29	350,116,427.78	87,529,106.96

(3) 未确认递延所得税资产明细

项 目	期末数	期初数
可抵扣暂时性差异	25,033,368.92	11,857,903.77
可抵扣亏损	16,181,529.04	39,669,257.56
小 计	41,214,897.96	51,527,161.33

22. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	131,877,227.80	159,917,978.67

长期待摊费用	11,508,050.85	9,454,316.78
待摊费用	18,222,067.00	19,951,814.80
买入返售金融资产	7,100,000.00	44,800,508.00
预缴所得税	11,823,446.33	
其他	189,360.00	505,758.69
合 计	180,720,151.98	234,630,376.94

23. 短期借款

项 目	期末数	期初数
保证借款本金	1,110,216,510.00	557,485,874.00
保证借款应付利息	3,844,982.89	5,058,635.00
进口押汇本金	123,276,146.66	
进口押汇应付利息	285,074.19	
合 计	1,237,622,713.74	562,544,509.00

24. 代理买卖证券款

项 目	期末数	期初数
经纪业务	244,053,509.54	43,497,081.98
其中：个人	164,258,155.23	32,759,036.99
机构	79,795,354.31	10,738,044.99
合 计	244,053,509.54	43,497,081.98

25. 应付货币保证金

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	119,880	10,292,916,318.69	109,870	7,961,489,413.71
法人	7,190	20,254,277,887.78	6,395	16,415,028,263.07
非结算客户	2	112,323,836.92	3	158,911,239.34
合 计	127,072	30,659,518,043.39	116,268	24,535,428,916.12

26. 应付质押保证金

(1) 明细情况——按客户类别

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
法人	17	857,391,364.00	11	434,089,168.00
合 计	17	857,391,364.00	11	434,089,168.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	240,562,852.00	78,658,896.00
郑州商品交易所	125,609,632.00	47,414,400.00
中国金融期货交易所	401,470,640.00	308,015,872.00
大连商品交易所	75,327,840.00	
上海国际能源交易中心	14,420,400.00	
合 计	857,391,364.00	434,089,168.00

27. 交易性金融负债

项 目	期末数	期初数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	715,697,952.48	135,074,240.55
其中：衍生金融工具	271,358,561.32	135,074,240.55
融券	444,339,391.16	
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	43,006,240.09	1,648,141,578.57
其中：结构化主体其他投资者享有的权益	43,006,240.09	1,648,141,578.57
合 计	758,704,192.57	1,783,215,819.12

28. 期货风险准备金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
风险准备金	232,191,214.15	24,393,773.42	17,004.09	256,567,983.48
合 计	232,191,214.15	24,393,773.42	17,004.09	256,567,983.48

(2) 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) 动用风险准备金的说明

本期动用期货风险准备金用于核销账龄三年以上的应收风险损失款。

29. 应付账款

项 目	期末数	期初数
货款	92,533,817.44	107,960,512.29
合 计	92,533,817.44	107,960,512.29

30. 预收款项

项 目	期末数	期初数
预收房租	7,217,084.50	
合 计	7,217,084.50	

31. 合同负债

项 目	期末数	期初数
预收货款	478,838,478.88	656,917,642.83
投资咨询费	317,895.92	351,938.60
基金销售业务收入	66,094.34	
合 计	479,222,469.14	657,269,581.43

[注]期初数与上年年末数(2019年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十四)1(1)1)之说明。

31. 合同负债

项 目	期末数	期初数
预收货款	478,838,478.88	656,917,642.83
投资咨询费	317,895.92	351,938.60
基金销售业务收入	66,094.34	
合 计	479,222,469.14	657,269,581.43

[注]期初数与上年年末数(2019年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十四)1(1)1)之说明。

32. 应付期货投资者保障基金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期上缴	期末数
应付期货投资者保障基金	671,681.51	849,929.48	694,550.26	827,060.73
合 计	671,681.51	849,929.48	694,550.26	827,060.73

(2) 应付期货投资者保障基金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《关于明确期货投资者保障基金缴纳比例有关事项的规定》（〔2016〕26号），从2016年12月8日起，本公司按照母公司代理交易额的亿分之五点五计提期货投资者保障基金。

33. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	758,456,793.35	575,512,012.17	485,400,774.38	848,568,031.14
离职后福利—设定提存计划	25,475,118.21	37,922,742.10	34,597,860.31	28,800,000.00
辞退福利		1,117,783.60	1,117,783.60	
合 计	783,931,911.56	614,552,537.87	521,116,418.29	877,368,031.14

(2) 短期薪酬明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	730,324,187.22	486,535,367.40	400,800,628.09	816,058,926.53
职工福利费		16,417,892.98	16,409,492.98	8,400.00
社会保险费	16,054,062.53	36,639,790.08	34,107,185.35	18,586,667.26
其中：医疗保险费	488,878.70	14,094,678.93	13,996,905.37	586,652.26
补充医疗保险	15,500,000.00	21,608,113.53	19,108,098.53	18,000,015.00
工伤保险费	9,311.98	47,855.75	57,167.73	
生育保险费	55,871.85	343,655.30	399,527.15	
其 他		545,486.57	545,486.57	
住房公积金	732,422.00	24,933,077.87	24,868,590.87	796,909.00
工会经费和职工教育经费	11,346,121.60	10,985,883.84	9,214,877.09	13,117,128.35
小 计	758,456,793.35	575,512,012.17	485,400,774.38	848,568,031.14

(3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	651,838.27	3,253,744.47	3,905,582.74	
失业保险费	23,279.94	101,958.03	125,237.97	

补充养老保险	24,800,000.00	34,567,039.60	30,567,039.60	28,800,000.00
小 计	25,475,118.21	37,922,742.10	34,597,860.31	28,800,000.00

34. 应交税费

项 目	期末数	期初数
企业所得税	133,414,878.61	153,907,328.46
增值税	11,614,507.91	6,966,778.76
代扣代缴个人所得税	2,582,678.04	3,393,100.22
城市维护建设税	849,843.39	507,207.13
教育费附加	364,218.55	217,374.48
地方教育附加	242,812.36	144,916.30
印花税	519,590.80	214,884.03
代扣代缴税金	2,404,174.65	970,821.66
房产税	3,942,785.91	2,073,212.15
土地使用税	28,540.00	28,540.00
商品及服务税	215,153.62	139,588.32
合 计	156,179,183.84	168,563,751.51

35. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付股利	157,200,000.00	157,200,000.00
其他应付款	1,173,744,910.46	296,701,480.21
合 计	1,330,944,910.46	453,901,480.21

(2) 应付股利

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

(3) 其他应付款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
-----	-----	-----

应付佣金	1,153,012.55	840,649.07
经营层风险金	9,044,635.20	10,544,154.91
交易所质押款	190,926,792.00	187,627,864.00
场外业务应付款	924,121,865.04	60,942,876.58
暂估工程款	14,107,034.90	24,446,598.04
其他	34,391,570.77	12,299,337.61
合计	1,173,744,910.46	296,701,480.21

2) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
客户 q	406,761,250.00	场外业务应付款
上海期货交易所	128,109,640.00	交易所质押款
客户 r	80,958,406.79	场外业务应付款
客户 s	66,796,498.54	场外业务应付款
客户 t	58,000,000.00	场外业务应付款
小计	740,625,795.33	

36. 预计负债

(1) 明细情况

项目	期末数	期初数
未决诉讼	418,767.91	445,737.05
合计	418,767.91	445,737.05

(2) 未决诉讼的预计负债形成原因

2015 年 1 月，新永安期货收到来自 Alterra International Holdings Limited（以下简称 Alterra）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 在塞浦路斯当地法院对新永安期货和交通银行提起诉讼，要求赔偿上述款项。新永安期货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 10% 的预计负债，各期末余额的变化系汇率变动所致。

37. 其他负债

项目	期末数	期初数
次级债券	301,378,356.16	

待转销项税额	70,350,966.58	84,299,653.34
拆入资金	60,042,907.25	
合计	431,772,229.99	84,299,653.34

[注]期初数与上年年末数(2019年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十四)1(1)1之说明

38. 股本

(1) 增减变动

项目	期初数	本期增减变动(减少以“—”表示)					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	1,310,000,000.00						1,310,000,000.00

(2) 期末股东所持股份的质押或冻结情况

期末,公司股东浙江省经济建设投资有限公司将持有的公司2,654万股股份出质给浙江省交通投资集团财务有限责任公司。

(3) 持股10%(含10%)以上的法人股东情况

股东单位名称	法定代表人	经营范围	行业类别	注册资本
财通证券股份有限公司	陆建强	经营证券业务。	券商信托	35.89亿
浙江省产业基金有限公司	杨强民	实业投资,投资管理。	金融业	200亿
浙江省金融控股有限公司	章启诚	金融类股权投资、政府性股权投资基金管理与资产管理业务。	商务服务业	120亿
浙江东方金融控股集团股份有限公司	金朝萍	资产管理,实业投资,私募股权投资,投资管理,企业管理咨询,投资咨询,供应链管理,电子商务技术服务,进出口贸易(按商务部核定目录经营),进口商品的国内销售,纺织原辅材料、百货、五金交电、工艺美术品、化工产品(不含危险品及易制毒品)、机电设备、农副产品、金属材料、建筑材料、贵金属、矿产品(除专控)、医疗器械的销售,承包境外工程和境内国际招标工程,上述境外工程所需的设备、材料出口,对外派遣工程、生产及服务行业的劳动人员(不含海员),房地产开发经营,房屋租赁,设备租赁,经济技术咨询。	国际贸易	22.28亿
浙江省经济建设投资有限公司	麻亚峻	经济建设项目的投资、开发、经营,房地产的投资;金属材料,化工原料及产品(不含危险品),建筑材料,纺织原料,橡胶及制品,木材,胶合板,造纸原料,矿产品,机电设备的销售;旅游服务,经营进出口业务(国家法律法规禁止限制的除外),地下工程设备的制造、维修和销售。	租赁和商务服务业	15亿

39. 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	12,238,289.85		60,825.65	12,177,464.20
合 计	1,501,682,614.86		60,825.65	1,501,621,789.21

(2) 资本公积本期增减原因及依据说明

本期资本公积变动系公司对联营企业玉皇山南除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动按持股比例计算应享有的份额-60,825.65元，计入其他资本公积。

40. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额	
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益
将重分类进损益的其他综合收益	39,928,823.91	-54,629,108.99	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-1,220,053.50		
外币财务报表折算差额	41,148,877.41	-54,629,108.99	
其他综合收益合计	39,928,823.91	-54,629,108.99	

(续上表)

项 目	本期发生额			期末数
	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
将重分类进损益的其他综合收益		-54,629,108.99		-14,700,285.08
其中：权益法下可转损益的其他综合收益				-1,220,053.50
外币财务报表折算差额		-54,629,108.99		-13,480,231.58
其他综合收益合计		-54,629,108.99		-14,700,285.08

41. 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	398,170,713.39	91,568,393.66		489,739,107.05
合 计	398,170,713.39	91,568,393.66		489,739,107.05

(2) 盈余公积本期增减原因及依据说明

本期增加系公司根据章程规定，按母公司当期净利润的 10%计提法定盈余公积。

42. 一般风险准备

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
一般风险准备	458,061,727.32	91,568,393.66		549,630,120.98
合 计	458,061,727.32	91,568,393.66		549,630,120.98

(2) 本期计提方法和比例说明

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

43. 未分配利润

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
调整前上期末未分配利润	3,156,082,214.84	2,567,087,497.43
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		-52,167,182.06
调整后期初未分配利润	3,156,082,214.84	2,514,920,315.37
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,146,009,285.30	1,000,720,583.15
减：提取法定盈余公积	91,568,393.66	101,179,341.84
提取一般风险准备	91,568,393.66	101,179,341.84
应付普通股股利	157,200,000.00	157,200,000.00
期末未分配利润	3,961,754,712.82	3,156,082,214.84

(2) 其他说明

经 2020 年 9 月 25 日第一次临时股东大会审议批准，首次公开发行股票前的滚存利润由发行完成后的新老股东按持股比例共同享有。

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况—按服务类别

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
经纪手续费净收入	149,163,199.95	139,313,381.01	7.07
交易所减收手续费收入	419,295,468.78	288,544,129.00	45.31
资产管理业务收入	41,222,039.96	35,929,709.16	14.73
投资咨询收入	1,997,922.28	2,912,778.01	-31.41
基金销售业务收入	65,479,082.09	49,608,163.55	31.99

合 计	677,157,713.06	516,308,160.73	31.15
-----	----------------	----------------	-------

(2) 分行政区域分支机构及手续费净收入情况

行政区域名称	分支机构家数	手续费净收入金额
杭州本部		562,990,666.17
香港特别行政区[注]		37,118,723.41
浙江省(不含杭州本部)	15	33,165,957.69
辽宁省	3	4,050,564.40
山东省	7	7,511,514.27
北京市	1	2,292,498.49
广东省	2	4,287,513.07
上海市	1	2,537,324.04
福建省	2	2,749,116.73
河南省	1	2,837,712.63
江苏省	2	2,375,334.70
吉林省	1	2,879,727.20
天津市	1	1,423,335.87
重庆市	1	1,930,166.43
河北省	2	2,370,476.36
湖北省	1	1,129,279.42
四川省	1	2,109,450.21
湖南省	1	2,010,239.53
江西省	1	957,049.02
陕西省	1	431,063.42
合 计	44	677,157,713.06

[注]香港特别行政区系指公司子公司新永安期货、新永安证券、新永安资管和永安国际金融

2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比(%)
利息收入	599,455,204.98	618,496,985.72	-3.08

其中：境内保证金存款利息收入	550,158,337.54	579,363,001.64	-5.04
境外利息收入	36,686,999.08	30,901,144.79	18.72
境内其他利息收入	12,609,868.36	8,232,839.29	53.17
利息支出	100,378,147.62	66,191,398.31	51.65
合 计	499,077,057.36	552,305,587.41	-9.64

3. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
权益法核算的长期股权投资收益	242,716,171.58	212,858,720.40	14.03
金融工具持有期间的投资收益	334,171,198.45	150,205,699.14	122.48
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益）	334,322,198.45	150,205,699.14	122.58
其他权益工具投资	-151,000.00		
处置金融工具取得的投资收益	318,780,038.09	559,268,469.75	-43.00
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债（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）	318,780,038.09	559,268,469.75	-43.00
减：结构化主体其他投资者享有的收益	-3,695,587.59	210,179,943.00	-101.76
合 计	899,362,995.71	712,152,946.29	26.29

4. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)	计入本期非经常性损益的金额
与收益相关的政府补助[注]	10,188,300.06	7,725,687.60	31.88	10,188,300.06
代扣个人所得税手续费返还	2,278,048.52	197,268.81	1,054.79	2,278,048.52
合 计	12,466,348.58	7,922,956.41	57.34	12,466,348.58

[注]计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注五(四)3之说明

5. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
交易性金融资产	419,024,219.02	508,615,042.62	-17.61
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	303,663,564.61	-17,577,089.84	-1,827.61
交易性金融负债	-224,137,182.93	-69,863,049.31	220.82
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	-182,083,670.53	-69,863,049.31	160.63
合 计	194,887,036.09	438,751,993.31	-55.58

6. 汇兑收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
汇兑收益	7,272,235.82	-3,233,184.93	
合 计	7,272,235.82	-3,233,184.93	

7. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
销售货物收入	23,133,547,521.31	20,512,110,273.07	12.78
租赁收入	14,833,690.31	302,433.99	4,804.77
交易所课题费、活动费等收入	24,587,614.49	19,579,535.77	25.58
其 他	5,931,833.39	1,375,308.09	331.31
合 计	23,178,900,659.50	20,533,367,550.92	12.88

8. 资产处置收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
固定资产处置收益	183,519.89	33,289.61	451.28
合 计	183,519.89	33,289.61	451.28

9. 提取期货风险准备金

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
提取期货风险准备金	24,393,773.42	19,051,965.16	28.04

合 计	24,393,773.42	19,051,965.16	28.04
-----	---------------	---------------	-------

10. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
城市维护建设税	2,241,782.31	1,908,370.02	17.47
教育费附加	960,763.97	817,872.77	17.47
地方教育附加	640,419.21	544,724.84	17.57
印花税	3,039,787.25	2,279,344.70	33.36
房产税	4,694,041.51	2,935,733.54	59.89
土地增值税	222,935.68		
其 他	75,090.94	78,762.26	-4.66
合 计	11,874,820.87	8,564,808.13	38.65

11. 业务及管理费

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
职工薪酬	614,552,537.87	783,589,802.70	-21.57
仓储费	114,345,425.56	56,174,612.22	103.55
“保险+期货”业务费用	41,808,589.65	12,520,115.26	233.93
租赁费	41,722,708.35	38,036,891.31	9.69
运输费	23,165,929.58	20,818,734.13	11.27
通讯费	12,927,748.15	12,603,283.02	2.57
业务招待费	12,013,999.95	12,311,090.01	-2.41
折旧费	11,795,970.05	12,410,954.82	-4.96
数据业务费	10,361,703.25	9,713,467.14	6.67
无形资产摊销	9,293,561.15	13,742,751.41	-32.37
信息咨询费	8,466,177.76	9,753,732.17	-13.20
广告宣传费	8,254,005.29	10,081,041.34	-18.12
差旅费	7,852,477.98	15,365,688.28	-48.90
其他	95,988,754.09	88,387,912.79	8.60
合 计	1,012,549,588.68	1,095,510,076.60	-7.57

12. 信用减值损失

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
-----	-----	-------	-----------

融出资金减值损失	9,936,205.61	2,115,258.27	369.74
坏账损失	12,507,058.19	1,242,551.28	906.56
存出保证金减值损失	-150.23	34,880.66	-100.43
结算备付金减值损失	-21.57	6,992.99	-100.31
应收货币保证金减值损失	13,951,562.37	-156,595.96	-9,009.27
合计	36,394,654.37	3,243,087.24	1,022.22

13. 其他资产减值损失

项目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
存货跌价损失	462,861,109.02	354,745,444.10	30.48
合计	462,861,109.02	354,745,444.10	30.48

14. 其他业务成本

项目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
销售货物成本	22,604,278,183.55	20,096,345,935.95	12.48
租赁成本	7,261,601.58	464,410.58	1,463.62
其他	476,109.61		
合计	22,612,015,894.74	20,096,810,346.53	12.52

15. 营业外收入

项目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
合同违约金收入	140,038,902.43	77,085,484.87	81.67
非流动资产毁损报废利得	59.26	2,040.59	-97.10
其他	161,662.22	10,373.14	1,458.47
合计	140,200,623.91	77,097,898.60	81.85

16. 营业外支出

项目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
捐赠支出	2,945,600.00	4,067,516.25	-27.58
残疾人就业保障基金	839,570.03	1,449,007.05	-42.06
违约金	366,249.60		
非流动资产毁损报废损失	89,657.84	60,487.23	48.23
地方水利建设基金	5,205.91	5,063.84	2.81

罚款及滞纳金	8,843.00	67,724.39	-86.94
存货损毁	3,182.00		
其他	53,742.24	82,500.01	-34.86
合计	4,312,050.62	5,732,298.77	-24.78

17. 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	256,686,746.42	235,540,731.75
递延所得税费用	42,410,266.48	14,787,856.92
合计	299,097,012.90	250,328,588.67

(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	1,445,106,298.20	1,251,049,171.82
按母公司适用税率计算的所得税费用	361,276,574.55	312,762,292.95
子公司适用不同税率的影响	-2,964,846.08	-21,843,053.34
调整以前期间所得税的影响	715,663.77	995,199.97
非应税收入的影响	-62,618,032.90	-46,192,071.43
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	4,886,689.33	3,414,120.74
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-2,685,166.89	-729,945.28
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	486,131.12	1,922,045.06
所得税费用	299,097,012.90	250,328,588.67

18. 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五(一)40之说明。

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项目	本期数	上年同期数
客户保证金净额	3,169,257,978.63	2,496,075,591.90
违约金及保险赔付收入	140,038,902.43	77,085,484.87

保证金及定期存款减少	777,327,771.32	
往来款净额	693,359,905.57	
收到的税费返还	36,866,745.88	
其他现金流入	65,253,384.81	29,289,159.81
合计	4,882,104,688.64	2,602,450,236.58

2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
交易所保证金净额	1,549,911,223.08	604,317,393.16
保证金及定期存款增加		104,905,805.67
融出资金	258,392,019.77	42,305,165.46
应收结算担保金和结算备付金增加	40,967,628.21	9,819,141.99
往来款净额		13,931,671.17
其他现金流出	4,899,537.57	8,442,545.28
合 计	1,854,170,408.63	783,721,722.73

3. 收到其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
对外拆出款收回	11,409,787.51	50,445,501.69
合 计	11,409,787.51	50,445,501.69

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
对外拆出款支出		45,000,000.00
合 计		45,000,000.00

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
纳入合并范围的结构化主体收到的现金		454,512,772.00

发行次级债收到的现金	300,000,000.00	
借款保证金的减少	65,000,000.00	
合计	365,000,000.00	454,512,772.00

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
纳入合并范围的结构化主体清算支付的现金	1,601,439,750.89	
借款保证金的增加		22,000,000.00
合计	1,601,439,750.89	22,000,000.00

7. 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

补充资料	本期数	上年同期数
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	1,146,009,285.30	1,000,720,583.15
加: 提取期货风险准备金	24,393,773.42	19,051,965.16
资产减值准备	499,255,763.39	357,988,531.34
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	19,057,571.63	12,789,103.91
无形资产摊销	9,293,561.15	13,742,751.41
长期待摊费用摊销	4,062,390.53	7,087,168.80
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”号填列)	-183,519.89	-33,289.61
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	89,598.58	58,209.61
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-194,887,036.09	-438,751,993.31
财务费用(收益以“-”号填列)	46,938,102.39	29,429,764.20
投资损失(收益以“-”号填列)	-246,411,759.17	-2,678,777.40
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	-58,868,126.85	-46,409,674.29
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	101,278,393.33	61,193,199.87
存货的减少(增加以“-”号填列)	-419,065,422.28	-912,575,854.63
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-1,137,646,615.21	-1,712,486,398.19

经营性应付项目的增加(减少以“－”号填列)	4,751,400,779.21	3,249,590,668.61
经营活动产生的现金流量净额	4,544,716,739.44	1,638,715,958.63
2) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3) 现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	19,546,642,778.83	15,969,616,524.14
减: 现金的期初余额	15,969,616,524.14	13,919,415,645.30
加: 现金等价物的期末余额		
减: 现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	3,577,026,254.69	2,050,200,878.84

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	期末数	期初数
1) 现金	19,546,642,778.83	15,969,616,524.14
其中: 库存现金	8,313.64	8,315.11
可随时用于支付的银行存款	19,450,141,319.34	15,948,539,008.85
可随时用于支付的其他货币资金	96,493,145.85	21,069,200.18
可用于支付的存放中央银行款项		
存放同业款项		
拆放同业款项		
2) 现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		
3) 期末现金及现金等价物余额	19,546,642,778.83	15,969,616,524.14
其中: 母公司或集团内子公司使用受限制的现金及现金等价物		

(3) 现金流量表补充资料的说明

2020 年末、2019 年末货币资金中定期存款、保函保证金、信用证保证金和远期结售汇保证金等合计金额分别为 465,298,451.58 元、1,307,626,222.90 元, 不作为现金及现金等价物反映。

(四) 其他

1. 所有权或使用权受到限制的资产

项 目	期末账面价值	受限原因
货币资金	138,736,230.06	融券保证金、信用证保证金、保函保证金场外衍生品保证金等
存货	185,260,601.24	质押
交易性金融资产	774,760,042.68	融券担保品
合 计	1,098,756,873.98	

2. 外币货币性项目

(1) 明细情况

项 目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
货币资金			1,834,558,185.16
其中：美元	221,686,174.92	6.5249	1,446,480,122.74
港币	418,127,042.86	0.8416	351,895,719.27
新加坡元	1,927,503.36	4.9314	9,505,290.07
欧元	2,617,784.57	8.0250	21,007,721.17
日元	72,265,367.00	0.0632	4,567,171.19
英镑	123,973.40	8.8903	1,102,160.72
结算备付金			6,328,691.56
其中：美元	19,979.00	6.5249	130,360.98
港币	7,364,936.53	0.8416	6,198,330.58
融出资金			288,621,230.43
其中：美元	191,217.64	6.5249	1,247,675.98
港币	341,460,972.49	0.8416	287,373,554.45
应收货币保证金			692,648,498.59
其中：美元	82,041,415.54	6.5249	535,312,032.26
港币	142,747,404.86	0.8416	120,136,215.93
新加坡元	20,019.53	4.9314	98,724.31
欧元	1,034,273.12	8.0250	8,300,041.79
日元	67,764,267.00	0.0632	4,282,701.67
英镑	241,870.91	8.8903	2,150,304.95
马来西亚币	13,750,727.18	1.6173	22,239,051.07
韩元	21,571,101.00	0.0060	129,426.61

存出保证金			1,246,410.49
其中：美元	100,000.00	6.5249	652,490.00
港币	705,704.00	0.8416	593,920.49
应收账款			1,323,763.95
其中：美元	202,878.81	6.5249	1,323,763.95
应收结算担保金			3,262,450.00
其中：美元	500,000.00	6.5249	3,262,450.00
其他应收款			50,624,164.67
其中：美元	4,913,459.48	6.5249	32,059,831.76
港币	20,839,201.11	0.8416	17,538,271.65
新加坡元	208,066.93	4.9314	1,026,061.26
交易性金融资产			23,103,604.96
其中：美元	3,341,549.15	6.5249	21,803,274.05
港币	1,545,070.00	0.8416	1,300,330.91
短期借款			123,276,146.66
其中：美元	18,893,185.59	6.5249	123,276,146.66
代理买卖证券款			242,237,655.12
其中：美元	10,667,149.85	6.5249	69,602,086.06
港币	205,127,814.95	0.8416	172,635,569.06
应付货币保证金			1,766,314,497.61
其中：美元	232,367,871.52	6.5249	1,516,177,124.88
港币	221,438,208.00	0.8416	186,362,395.85
新加坡元	20,533.80	4.9314	101,260.38
欧元	3,600,852.89	8.0250	28,896,844.44
日元	150,724,397.50	0.0632	9,525,781.92
英镑	358,641.24	8.8903	3,188,428.22
马来西亚币	13,561,636.87	1.6173	21,933,235.31
韩元	21,571,101.00	0.0060	129,426.61
交易性金融负债			2,939,150.01
其中：美元	450,451.35	6.5249	2,939,150.01
应付职工薪酬			8,175,419.10
其中：港币	9,650,000.00	0.8416	8,121,440.00
新加坡元	10,946.00	4.9314	53,979.10

应交税费			1,589,165.70
其中：美元	3,946.00	6.5249	25,747.26
港币	1,857,674.00	0.8416	1,563,418.44
其他应付款			6,188,208.87
其中：美元	161,922.04	6.5249	1,056,525.12
港币	5,669,417.61	0.8416	4,771,381.86
新加坡元	73,062.80	4.9314	360,301.89
其他负债			60,042,907.25
其中：港币	71,343,758.61	0.8416	60,042,907.25

(2) 境外经营实体说明

公司名称	记账本位币	选择依据	记账本位币变化及原因
永安国贸	美元	以美元作为商品和劳务的计价及结算	无
永安国际金融	新加坡元	主要经营地为新加坡	无
香港永安商贸	美元	以美元作为商品和劳务的计价及结算	无
新永安金控	港币	主要经营地为香港	无
新永安期货	港币	主要经营地为香港	无
新永安实业	港币	主要经营地为香港	无
新永安证券	港币	主要经营地为香港	无
新永安资管	港币	主要经营地为香港	无
永安全球基金	美元	以美元作为商品和劳务的计价及结算	无

3. 政府补助

(1) 明细情况

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
财政扶持资金	2,700,000.00	其他收益	杭州市西湖区人民政府翠苑街道办事处街道税收补助款
就业补助	2,092,791.06	其他收益	香港政府“保就业”补助、新加坡就业支持计划(JSS)资金、新加坡工资补助计划和失业补助计划、人社部线上培训补贴、台州市就业服务中心发放的以工代训补

			贴
出疆棉花运费补贴	1,551,200.00	其他收益	新疆维吾尔自治区财政对出疆棉花的运费补贴
经济发展专项资金	1,298,000.00	其他收益	上海市保税区域企业财政扶持资金
稳岗补贴	751,931.42	其他收益	对稳定就业企业给予失业保险金返还
金融业发展专项资金	500,000.00	其他收益	吉林省金融业发展专项资金
政府考评奖励	471,400.00	其他收益	绍兴、台州、大连、辽宁等营业部政府考评奖
企业扶持资金	458,200.00	其他收益	郑州市郑东新区重点企业资金扶持资金
金融业扶持资金	124,550.00	其他收益	烟台市芝罘区金融业发展扶持资金
疫情补贴	164,227.58	其他收益	香港抗疫基金、杭州市人才服务中心疫情额外补助、新加坡居家隔离补贴
房屋装修补贴	66,000.00	其他收益	长沙市政府购房及房屋装修补贴款
房屋补贴	10,000.00	其他收益	杭州市拱墅区人民政府米市巷街道办事处房屋补贴
小计	10,188,300.06		

(2) 本期计入当期损益的政府补助金额为 10,188,300.06 元。

六、合并范围的变更

(一) 合并范围增加

公司名称	股权取得方式	股权取得时点	出资额	出资比例
永盈1号集合资产管理计划	设立	2020年9月	5,000,486.11元	12.25%

(二) 合并范围减少

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	处置当期期初至处置日净利润
永屹1号资产管理计划	终止清算	2020年1月	5,088,785.15	42,076.71
永利1号资产管理计划	终止清算	2020年6月	1,179,025,051.80	-18,153,179.65
永利2号资产管理计划	终止清算	2020年7月	713,399,558.23	8,403,120.61

七、在其他主体中的权益

(一) 在重要子公司中的权益

重要子公司的构成

(1) 基本情况

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
永安资本	杭州	杭州	商业	100.00		设立
中邦实业	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下企业合并
永安瑞萌	上海	上海	商业		100.00	设立
香港永安商贸	香港	香港	商业		100.00	设立
永安国贸	新加坡	新加坡	商业		100.00	设立
永安国油	舟山	舟山	商业		100.00	设立
新永安金控	香港	香港	金融业	100.00		设立
新永安期货	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安实业	香港	香港	商业		100.00	设立
新永安资管	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安证券	香港	香港	金融业		100.00	设立
永安国际金融	新加坡	新加坡	金融业		100.00	设立
永安全球基金	香港	开曼	金融业		100.00	设立

(2) 对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据

对于公司管理的结构化主体，公司通过评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明公司对结构化主体拥有控制权。若公司对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

截至2020年12月31日，本公司作为资产管理计划管理人并投资永盈1号集合资产管理计划，对上述资产管理计划拥有实质性权利，且公司通过在上述资产管理计划中享有份额、收取管理费或业绩报酬的形式获得可变回报为重大，故将其纳入公司合并财务报表合并范围。

(二) 在联营企业中的权益

1. 重要的联营企业

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
永安国富	杭州	杭州	金融业	31.35		权益法核算

2. 重要联营企业的主要财务信息

项目	永安国富

	期末数	期初数
流动资产	3,325,552,379.60	1,940,825,259.42
非流动资产	99,707,903.95	75,236,491.93
资产合计	3,425,260,283.55	2,016,061,751.35
流动负债	1,210,803,470.41	553,808,109.94
非流动负债	58,904,677.14	42,108,914.68
负债合计	1,269,708,147.55	595,917,024.62
少数股东权益		
归属于母公司所有者权益	2,155,552,136.00	1,420,144,726.73
按持股比例计算的净资产份额	675,850,075.90	445,271,030.71
对联营企业权益投资的账面价值	675,850,075.90	445,271,030.71
营业收入	4,280,356,532.96	1,041,569,096.79
净利润	735,407,409.27	648,887,520.00
归属于母公司所有者的净利润	735,407,409.27	648,887,520.00
其他综合收益		
综合收益总额	735,407,409.27	648,887,520.00
本期收到的来自联营企业的股利		52,800,000.00

3. 不重要的联营企业的汇总财务信息

项 目	期末数	期初数
联营企业		
投资账面价值合计	28,550,821.58	41,553,341.56
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	12,137,126.39	1,349,695.75
其他综合收益	-402,003.96	-658,112.76
综合收益总额	11,735,122.43	691,582.99

(三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的基础信息

截至2020年12月31日，与公司相关联、但未纳入公司合并财务报表范围的结构化主体是公司发起设立的资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要是通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

截至 2020 年 12 月 31 日，与本公司相关联、但未纳入本公司合并财务报表范围的结构化主体主要从事证券投资业务。这类结构化主体 2020 年 12 月 31 日的资产总额为 19.33 亿元。

八、与金融工具相关的风险

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

本公司在日常活动中面临各种与金融工具相关的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理层已审议并批准管理这些风险的政策，概括如下。

（一）信用风险

公司可能存在的信用风险主要包括：

1. 客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；
2. 客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；
3. 存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；
4. 存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；
5. 存放在银行的客户保证金不能提取的风险；
6. 代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；
7. 涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；
8. 基差贸易业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；
9. 场外衍生品业务中，客户在交易和结算的过程中不能或不愿意履行合同承诺的风险。

为控制该项风险，公司将制度建设视为内控机制的根基，已建立了各项治理制度，包括交易、开户、结算及风控，财务，信息技术，金融期货业务，IB 业务，信息披露，合规(含反洗钱)等系列制度，以及营业部管理制度，明确决策、执行、监督等方面的职责权限，形成科学有效的职责分工制衡机制，结合业务特点和内部控制要求设置内部机构，明确职责权限，将权利与责任落实到各责任部门，同时确保了稽核督查总部机构设置、人员配备和工作的独立性。各业务部门、各分支机构在公司相应职能部门的指导下，严格按照内部控制要求执行，主动做好本部门、分支机构的风险管理工作，防范各类潜在风险。在基差贸易业务和场外衍生品业务中，建立完善的客户、仓储企业资信调查制度，对客户信用进行评定，有限

选择信用等级较高的客户，避免选择信用等级较低的客户。

(二) 流动风险

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

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

金融负债按剩余到期日分类

项 目	期末数				
	账面价值	未折现合同金额	1年以内	1-3年	3年以上
银行借款	1,237,622,713.74	1,256,806,077.18	1,256,806,077.18		
代理买卖证券款	244,053,509.54	244,053,509.54	244,053,509.54		
应付货币保证金	30,659,518,043.39	30,659,518,043.39	30,659,518,043.39		
应付质押保证金	857,391,364.00	857,391,364.00	857,391,364.00		
交易性金融负债	758,704,192.57	758,704,192.57	758,704,192.57		
应付账款	92,533,817.44	92,533,817.44	92,533,817.44		
其他应付款	1,330,944,910.46	1,330,944,910.46	1,330,944,910.46		
其他负债	361,421,263.41	398,827,205.24	61,470,218.94	337,356,986.30	
小 计	35,542,189,814.55	35,598,779,119.82	35,261,422,133.52	337,356,986.30	

(续上表)

项 目	期初数				
	账面价值	未折现合同金额	1年以内	1-3年	3年以上
银行借款	562,544,509.00	567,491,202.19	567,491,202.19		
代理买卖证券款	43,497,081.98	43,497,081.98	43,497,081.98		
应付货币保证金	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12		
应付质押保证金	434,089,168.00	434,089,168.00	434,089,168.00		
交易性金融负债	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12		
应付账款	107,960,512.29	107,960,512.29	107,960,512.29		
其他应付款	453,901,480.21	453,901,480.21	453,901,480.21		
其他负债					
小 计	27,920,637,486.72	27,925,584,179.91	27,925,584,179.91		

(三) 市场风险

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

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

1. 利率风险

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

报告期各期末，本公司以浮动利率计息的银行借款人民币均为 0 元，在其他变量不变的假设下，假定利率变动 50 个基准点，不会对本公司的利润总额和股东权益产生重大的影响。

2. 外汇风险

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

3. 价格风险

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

九、公允价值的披露

(一) 以公允价值计量的资产和负债的公允价值明细情况

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. 交易性金融资产和其他非流动金融资产	1,452,545,980.04	2,587,777,497.00		4,040,323,477.04
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,452,545,980.04	2,587,777,497.00		4,040,323,477.04
债务工具投资	1,886,169.06			1,886,169.06
权益工具投资	1,353,731,143.94	2,297,628,835.48		3,651,359,979.42
衍生金融资产[注]	96,928,667.04	290,148,661.52		387,077,328.56
2. 其他权益工具投资			25,838,630.14	25,838,630.14
持续以公允价值计量的资产	1,452,545,980.04	2,587,777,497.00	25,838,630.14	4,066,162,107.18

总额				
3. 交易性金融负债	492,758,875.76	305,753,631.41		798,512,507.17
(1) 交易性金融负债	492,758,875.76	262,747,391.32		755,506,267.08
衍生金融负债[注]	48,419,484.60	262,747,391.32		311,166,875.92
融券	444,339,391.16			444,339,391.16
(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		43,006,240.09		43,006,240.09
结构化主体其他投资者享有的权益		43,006,240.09		43,006,240.09
持续以公允价值计量的负债总额	492,758,875.76	305,753,631.41		798,512,507.17

[注] 衍生金融资产、衍生金融负债中含期货合约持仓损益，相关说明见本财务报表附注五(一)交易性金融资产之说明

(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

根据二级市场公开报价确认该计量项目的市价。

(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。

(四) 持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

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

十、关联方及关联交易

(一) 关联方认定标准

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、共同控制的，构成关联方。本公司按照《企业会计准则》及中国证监会《上市公司信息披露管理办法》确定关联方。

(二) 关联方情况

1. 本公司的第一大股东情况

(1) 本公司的第一大股东

第一大股东名称	注册地	业务性质	注册资本	第一大股东对本公司的持股比例 (%)	第一大股东对本公司的表决权比例 (%)
财通证券	杭州	金融业-资本市场服务	358,900 万元	33.538%	[注]

[注] 财通证券与浙江省产业基金有限公司（以下简称浙江产业基金，其持有本公司股权

比例为 26.718%) 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》，浙江产业基金就公司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，期限为自生效之日起 36 个月。财通证券与浙江产业基金于 2019 年 4 月 22 日重新签订了《关于永安期货股份有限公司的一致行动人协议》，约定协议有效期至 2020 年 10 月 23 日。到期后，双方并未续签。

(2) 本公司最终控制方是浙江省财政厅。

浙江省财政厅间接控制永安期货 70.843%的股权：1) 浙江省财政厅通过直接持有浙江省金融控股有限公司（以下简称省金控）100.00%股权，间接控制财通证券 32.25%的股权以及浙江产业基金 100.00%的股权；2) 省金控子公司浙江产业基金持有本公司 26.718%的股权；3) 省金控直接持有本公司 10.587%的股权。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注七之说明。

3. 本公司的联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见本财务报表附注七之说明。报告期与本公司发生关联方交易，或报告期与本公司发生关联方交易形成余额的其他联营企业情况如下：

联营企业名称	与本公司关系
OSTC Yongan Trading Co., Limited	香港永安商贸之联营企业
鞍钢永安	永安资本之联营企业
玉皇山南	永安资本之联营企业

4. 本公司的其他关联方情况

(1) 本公司的其他关联方

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系
浙江永安国富实业有限公司（以下简称永安国富实业）	永安国富之子公司
永富物产有限公司（以下简称永富物产）	永安国富之子公司
财通证券资产管理有限公司（以下简称财通资管）	财通证券之子公司
浙江财通资本投资有限公司	财通证券之子公司
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
财通基金管理有限公司（以下简称财通基金）	财通证券之联营企业
浙江省协作大厦有限公司（以下简称协作大厦）[注]	原持股 5%以上股东
浙江永安投资咨询有限公司（以下简称永安投资咨询）	OSTC Yongan Trading Co., Limited 之子公司
浙江潮王大酒店有限公司	协作大厦之子公司

[注] 2020 年 9 月 15 日，协作大厦将其持有的本公司 10.587%股权无偿划转至省金控

(三) 关联交易情况

1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

(1) 明细情况

1) 采购商品和接受劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鞍钢永安	采购货物	30,515,858.63	45,021,731.55
永安国富实业	采购货物		8,939,180.93
永富物产	采购货物	50,874,808.63	
财通证券	接受IB业务服务	8,166,077.69	7,405,007.94
财通证券	接受证券承销业务服务、资产管理产品[注]代理销售服务	2,869,585.93	78,113.21

[注]资产管理产品包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品，资金信托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等

2) 出售商品和提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鞍钢永安	销售货物		63,033,204.83
永安国富实业	销售货物		3,712,499.24
永富物产	销售货物	86,771,249.30	
永安国富	提供资产管理产品代销服务	19,938,372.04	15,179,831.86
玉皇山南	提供资产管理产品代销服务	12,867.24	

2. 关联方在本公司开设期货账户，从事期货交易，关联交易明细如下：

客户名称[注]	权益	手续费净收入
财通证券	200,858,650.79	50,821.05
永安国富实业	69,404,943.06	63,050.02
永富物产	25,768,027.62	25,783.41
协作大厦	20.82	
永安投资咨询	1,011.00	
鞍钢永安		122.78
财通基金	2,011.00	

财通资管	10,684,261.91	5,835.91
永安国富	2,305,705,109.20	2,106,113.45
小 计	2,612,424,035.40	2,251,726.62

[注]该等公司包含公司及其管理的资产管理产品

3. 本公司及子公司持有关联方作为管理人募集设立的资产管理产品

资产管理产品名称	管理人	账面价值
永安国富-永富1号资产管理计划	永安国富	7,980,008.23
永安国富-永富3号资产管理计划	永安国富	953,418,762.67
永安国富-永富10号私募证券投资基金	永安国富	235,172,933.73
永安国富-FOF1号私募投资基金	永安国富	116,160,000.00
永安国富-稳健5号私募投资基金	永安国富	52,130,021.06
永安国富-稳健6号私募基金	永安国富	474,186,100.00
永安国富-永富12号私募基金	永安国富	7,667,798.79
永安国富-永富15号私募基金	永安国富	7,280,000.00
山南敦和私募资产配置基金	玉皇山南	10,110,000.00
小 计		1,864,105,624.48

4. 关联方持有本公司作为管理人募集设立的资产管理产品

资产管理产品名称	持有人	持有份额
CTA联盟2号FOF集合资产管理计划	本公司董监高及其关系密切的家庭成员、直接或间接控制本公司的法人的董监高	2,200,000.00
永庆1号集合资产管理计划		5,000,388.89
永盈1号集合资产管理计划		1,000,194.44
小 计		8,200,583.33

5. 在财通证券开户从事股票交易

(1) 本公司及子公司在财通证券开户从事股票交易，关联交易明细情况如下：

公 司	资金余额	证券交易费
本公司	7,793.11	6,591.64
永安资本	905.52	27,252.25
合 计	8,698.63	33,843.89

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

关联方	本期数	上年同期数
-----	-----	-------

财通证券	2,205,638.34	1,375,948.27
------	--------------	--------------

6. 关联租赁情况

公司出租情况

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的 租赁收入	上年同期确认的 租赁收入
财通证券	房屋租赁	14,410,169.01	

7. 关联方资金拆借

香港永安商贸于 2015 年、2016 年向 OSTC Yongan Trading Co., Limited 共拆出资金 2,924,893.30 美元，本期计提利息 67,692.98 美元，本期收回本息 1,639,909.60 美元。截至期末，已收回全部本息。

8. 关键管理人员报酬

项 目	本期数	上年同期数
关键管理人员报酬	2,230.86 万元	3,179.62 万元

9. 永安资本与关联方发生场外期权交易，取得投资收益明细如下：

关联方	本期数	上年同期数
财通证券	4,720,923.20	
鞍钢永安	2,829,267.50	1,020,257.00
永富物产	-10,650.00	

10. 其他关联交易

(1) 本期财通证券代公司结算相关费用 427,863.98 元。

(2) 2020 年 11 月公司发行 3 亿次级债，期限为 2020 年 11 月 23 日至 2023 年 11 月 23 日，财通资管管理的产品认购 50,000,000.00 元次级债，本期计提利息 229,726.03 元。

(3) 截至期末，永安资本与财通证券签订的场外期权合约浮亏 13,587,037.90 元。

(四) 关联方往来余额

1. 应收关联方款项

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
预付款项					
	鞍钢永安			1,440,757.90	
小 计				1,440,757.90	
其他应收款					
	OSTC Yongan Trading Co.,			10,968,097.58	3,887,950.13

	Limited				
	财通证券	33,335,010.00	1,666,750.50		
小计		33,335,010.00	1,666,750.50	10,968,097.58	3,887,950.13

2. 应付关联方款项

项目名称	关联方	期末数	期初数
合同负债			
	永富物产	1,037,542.24	
小计		1,037,542.24	
其他负债			
	永富物产	93,378.80	
小计		93,378.80	
预收款项			
	财通证券	7,205,084.50	
小计		7,205,084.50	
其他应付款			
	财通证券	934,381.16	624,564.08
小计		934,381.16	624,564.08

十一、承诺及或有事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的重要承诺及或有事项。

十二、资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，公司不存在需要披露的资产负债表日后事项。

十三、其他重要事项

(一) 分部信息

1. 确定报告分部考虑的因素

公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度等为依据确定报告分部，并以经营分部为基础确定报告分部。分别对期货经纪业务、资产管理业务等业务的经营业绩进行考核。与各分部共同使用的资产、负债按照规模比例在不同的分部之间分配。

2. 报告分部的财务信息

(1) 2020 年度

项目	期货经纪业务等	资产管理业务	基金销售业务	风险管理业务
营业收入	1,715,522,690.96	47,557,840.75	65,479,082.09	23,519,306,355.90
营业支出	612,516,820.19	25,974,508.29	37,786,543.81	23,378,063,008.67
营业利润	1,103,005,870.77	21,583,332.46	27,692,538.28	141,243,347.23
资产总额	39,390,858,731.31	16,320,379.41	21,722,032.98	6,175,368,830.87
负债总额	32,437,068,339.18	132,880.07	952,629.27	4,006,191,902.56

(续上表)

项目	境外业务	结构化主体	分部间抵销	合计
营业收入	201,250,421.82	12,079,134.25	-91,887,959.76	25,469,307,566.01
营业支出	185,568,867.30	8,356,843.98	-88,176,751.14	24,160,089,841.10
营业利润	15,681,554.52	3,722,290.27	-3,711,208.62	1,309,217,724.91
资产总额	3,011,346,168.47	49,073,503.62	-3,287,495,339.52	45,377,194,307.14
负债总额	2,342,254,947.63	283,901.31	-1,207,735,737.86	37,579,148,862.16

(2) 2019 年度

项目	期货经纪业务等	资产管理业务	基金销售业务	风险管理业务
营业收入	1,876,616,860.22	127,949,913.22	49,608,163.55	20,789,290,250.16
营业支出	725,792,342.69	70,869,272.19	25,883,358.85	20,687,882,759.83
营业利润	1,150,824,517.53	57,080,641.03	23,724,804.70	101,407,490.33
资产总额	32,501,840,910.61	58,080,963.66	29,193,423.36	3,721,085,810.86
负债总额	26,355,573,520.84	921,239.38	357,178.78	2,055,860,223.71

(续上表)

项目	境外业务	结构化主体	分部间抵销	合计
营业收入	179,758,215.37	365,572,072.92	-631,186,175.69	22,757,609,299.75
营业支出	160,030,184.39	103,331,148.46	-195,863,338.65	21,577,925,727.76
营业利润	19,728,030.98	262,240,924.46	-435,322,837.04	1,179,683,571.99
资产总额	2,139,988,795.97	1,914,993,440.66	-3,565,717,126.57	36,799,466,218.55
负债总额	1,442,541,130.24	7,550,729.30	72,736,101.98	29,935,540,124.23

(二) 其他事项

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

非公开发行总额不超过 10 亿元的次级债券。截至期末，公司债券实际发行规模为人民币 3 亿元，债券票面利率为 4.30%。

2. 2017-2019 年度，公司根据第二届董事会第九次会议通过的《薪酬管理制度（2017 版）》，按营业收入的 25%计提工资奖金。2021 年 4 月 1 日总经理办公会议审议通过相关议案，将截止 2020 年 12 月 31 日尚未发放的工资奖金中的 5.69 亿元工资奖金分配到具体部门。该事项已经 2021 年 4 月 6 日第三届董事会第十一次会议审议通过。

十四、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	本期数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	2,030,974,102.19		2,030,974,102.19
对联营、合营企业投资	675,850,075.90		675,850,075.90
合 计	2,706,824,178.09		2,706,824,178.09

（续上表）

项 目	上年同期数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	1,730,974,102.19		1,730,974,102.19
对联营、合营企业投资	445,271,030.71		445,271,030.71
合 计	2,176,245,132.90		2,176,245,132.90

（2）对子公司投资

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	本期计提减值准备	减值准备期末数
中邦实业	251,984,002.19			251,984,002.19		
永安资本	1,000,000,000.00	300,000,000.00		1,300,000,000.00		
新永安金控	478,990,100.00			478,990,100.00		
小 计	1,730,974,102.19	300,000,000.00		2,030,974,102.19		

（3）对联营、合营企业投资

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	445,271,030.71			230,579,045.19	
合 计	445,271,030.71			230,579,045.19	

(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					675,850,075.90	
合 计					675,850,075.90	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
经纪手续费净收入	113,055,387.65	109,958,962.11	2.82
交易所减收手续费收入	374,802,242.94	271,080,341.10	38.26
投资咨询收入	378,174.34	2,754,433.76	-86.27
资产管理业务收入	47,557,840.75	127,949,913.22	-62.83
基金销售业务收入	65,479,082.09	49,608,163.55	31.99
合 计	601,272,727.77	561,351,813.74	7.11

(2) 分行政区域分支机构及手续费净收入情况

行政区域名称	分支机构家数	手续费净收入金额
杭州本部		524,224,404.29
浙江省(不含杭州本部)	15	33,165,957.69
辽宁省	3	4,050,564.40
山东省	7	7,511,514.27
北京市	1	2,292,498.49
广东省	2	4,287,513.07
上海市	1	2,537,324.04
福建省	2	2,749,116.73
河南省	1	2,837,712.63
江苏省	2	2,375,334.70

吉林省	1	2,879,727.20
天津市	1	1,423,335.87
重庆市	1	1,930,166.43
河北省	2	2,370,476.36
湖北省	1	1,129,279.42
四川省	1	2,109,450.21
湖南省	1	2,010,239.53
江西省	1	957,049.02
陕西省	1	431,063.42
合 计	44	601,272,727.77

2. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数	增减百分比 (%)
权益法核算的长期股权投资收益	230,579,045.19	211,509,024.65	9.02
成本法核算的长期股权投资收益		173,000,000.00	-100.00
金融工具持有期间的投资收益	318,108,276.13	159,896,764.37	98.95
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益）	318,108,276.13	159,896,764.37	98.95
处置金融工具取得的投资收益	16,595,246.41	16,604,015.41	-0.05
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债（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）	16,595,246.41	16,604,015.41	-0.05
合 计	565,282,567.73	561,009,804.43	0.76

十五、其他补充资料

（一）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	15.49	0.87	0.87
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	15.39	0.87	0.87

2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	本期数	
归属于公司普通股股东的净利润	A	1,146,009,285.30	
非经常性损益	B	7,896,143.76	
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	1,138,113,141.54	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	6,863,926,094.32	
发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	E		
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	F		
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	G	157,200,000.00	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H	1	
其他	权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	I1	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	
	可供出售金融资产公允价值变动	I2	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	
	外币报表折算差额变动	I3	-54,629,108.99
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	6
	其他	I4	-60,825.65
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J4	6
报告期月份数	K	12	
加权平均净资产	$L = \frac{D+A}{2} + \frac{E \times F}{K} - \frac{G \times H}{K} \pm \frac{I \times J}{K}$	7,396,485,769.65	
加权平均净资产收益率	$M = A/L$	15.49%	
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	$N = C/L$	15.39%	

3. 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	1,146,009,285.30
非经常性损益	B	7,896,143.76
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	1,138,113,141.54
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	$L = D + E + F \times G / K - H \times I / K - J$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M = A / L$	0.87
扣除非经常损益基本每股收益	$N = C / L$	0.87

永安期货股份有限公司

二〇二一年四月六日

附：

第十一节 备查文件目录

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

（二）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：

永安期货股份有限公司董事会办公室