



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

半年度报告

— 2021 —

公司半年度大事记

2021年1月，公司助力中国期货市场首次跨境交收破题，服务产业客户托克新加坡顺利完成1500吨的低硫燃料油“境内交割+境外提货”业务。这是继公司完成燃料油仓单首次通关进口、原油仓单首次复运出口之后，又一项联动境内外业务的创新实践。

2021年1月，郑州商品交易所表彰2020年度优秀会员。公司荣获优秀会员奖、产业服务优秀会员奖、综合业务平台建设优秀会员奖、人才培育优秀会员奖及国际市场服务优秀会员奖。子公司浙江永安资本管理有限公司荣获2020年度优秀风险管理子公司奖。

2021年1月，大连商品交易所表彰2020年度优秀会员。公司荣获优秀会员金奖、优秀农产品产业服务奖、优秀黑色产品产业服务奖、优秀机构服务奖、优秀期权市场服务奖、优秀国际市场服务奖、优秀技术支持奖及优秀场外市场支持奖。

2021年3月，上海期货交易所表彰2020年度优秀会员。公司荣获上海期货交易所优秀会员金奖、期权市场服务奖以及多项品种产业服务奖；荣获上海国际能源中心优秀会员奖。

2021年3月，中国金融期货交易所表彰2020年度优秀会员。公司荣获优秀会员白金奖、风险管理服务奖（股指期货类、国债期货类）、抗疫贡献奖及扶贫贡献奖。

2021年5月，浙江省人民政府公布2020年度融资畅通工程工作考核结果，公司荣获“服务创新奖”。

目 录

第一节	重要提示、目录和释义	4
第二节	公司概况	9
第三节	会计数据和经营情况	11
第四节	重大事件	29
第五节	股份变动和融资	32
第六节	董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况	36
第七节	财务会计报告	39
第八节	备查文件目录	124

第一节 重要提示、目录和释义

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）黄峥嵘保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本半年度报告未经会计师事务所审计。

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

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

1、未按要求披露的事项及原因

期货市场竞争激烈，业务具有一定的同质性，公司重要客户及重要供应商具体信息为公司的商业秘密。为避免相关信息泄露对公司的经营业绩造成不良影响，本报告中未披露重要客户和供应商名称。

【重大风险提示表】

重大风险事项名称	重大风险事项简要描述
1. 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盈利下降风险。
2. 利息收入下滑风险	利息收入是期货公司收入的重要来源之一。公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。公司的客户保证金规模、自有资金规模和市场利率的变化将影响公司的营业收入和净利润。如果市场利率出现大幅下降或者客户保证金、自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。此外，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。
3. 期货投资咨询业务风险	由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广。若公司未能在研究分析、市场推

	<p>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。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。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。此外，我国金融机构资产管理业务的政策环境差异较大、发展起点不同，期货公司开展资产管理业务的起步较晚，期货公司资产管理规模相对较小。如果相关监管政策在未来出现调整或变化，可能导致公司资管产品不符合监管要求，这将对公司资产管理业务开展及收入规模的扩大造成不利的影响。</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，面临的主要风险包括管理人尽职调查风险、投资者适当性风险、操作风险及信息披露风险。</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、衍生品等。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。合规经营既是期货公司经营的重要保障，也是监管部门及各市场参与主体最重视的部分。虽然公司已按照《公司法》《期货交易管理条例》《期货公司监督管理办法》等一系列法律法规、监管政策的要求，建立了合规管理制度、完善了合规管理组织体系、营造并形成了合规文化氛围，但公司及其子公司、下属分支机构、相关主体仍可能因为存在不遵守相关法律法规及监管政策要求而承担法律风险、被</p>

	<p>行政处罚或被采取监管措施的情形，这将对公司业务开展、声誉造成损失。</p>
9. 信息技术系统风险	<p>信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，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，或信息技术系统因未能及时、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受到不利影响。</p>
10.信用风险	<p>公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：（1）客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；（2）客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；（3）存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；（4）存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；（5）存放在银行的客户保证金不能提取的风险；（6）代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；（7）涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；（8）基差业务中，交易对手不按合同约定履行其义务的风险；（9）非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。</p>
11.居间人管理风险	<p>居间人非期货公司的员工，而是与期货公司签订居间合同，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，如果公司对居间人管理不当，可能被监管部门采取监管措施或处以行政处罚，亦有可能产生诉讼风险。</p>
12.人才流失和储备不足风险	<p>期货行业是知识密集型行业，需要大批高素质专业人才。随着期货市场的发展，以及期货分支机构的大规模扩张，期货人才竞争日趋激烈。近年来金融衍生品推出的步伐加快，资产管理业务发展迅速，对期货人才提出了更高要求，也加剧了对期货</p>

	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。
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、法规及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、法规及规范性文件的变化，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	公司无法保证自身能够避免在未来开展业务过程中因为工作过失、第三方责任或行为不当等而面临司法诉讼、仲裁或受到监管调查的风险。如果公司未来因为上述事项或其他不确定因素导致的风险而出现相关重大诉讼、仲裁或受到监管调查，将可能对公司正常业务的开展与经营带来不利影响。
15. 商标风险	公司使用中的 永安期货 等含有“永安”字样的标识尚未取得商标专用权，上述商标使用过程中可能会使本公司遭受法律纠纷，进而对业务正常开展、经营业绩及财务状况产生不利影响。
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 不适用

释义

释义项目		释义
公司、本公司、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
永安瑞萌	指	上海永安瑞萌商贸有限公司
永安国贸	指	永安（新加坡）国际贸易有限公司
新永安金控	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
香港永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安国际金融	指	永安国际金融（新加坡）有限公司
玉皇山南	指	浙江玉皇山南投资管理有限公司

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
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
新永安证券	指	新永安国际证券有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
永安国油	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
IB 业务	指	证券公司为本公司提供中间介绍服务业务
报告期	指	2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日
报告期末	指	2021 年 6 月 30 日
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本半年度报告中，部分合计数与加总数在尾数上可能略有差异，系四舍五入造成。

第二节 公司概况

一、 基本信息

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

二、 联系方式

董事会秘书	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
公司半年度报告备置地	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）
主要业务	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
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	无控股股东
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
金融许可证机构编码	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	否
注册资本（元）	1,310,000,000	否

五、 中介机构

主办券商（报告期内）	中信证券
主办券商办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
报告期内主办券商是否发生变化	否
主办券商（报告披露日）	中信证券

六、 自愿披露

适用 不适用

七、 报告期后更新情况

适用 不适用

第三节 会计数据和经营情况

一、主要会计数据和财务指标

(一) 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	16,684,579,435.27	11,094,744,238.08	50.38%
利润总额	894,873,418.14	526,982,831.68	69.81%
归属于挂牌公司股东的净利润	739,645,964.41	410,371,541.96	80.24%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	736,308,799.82	405,539,273.87	81.56%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	9.06%	5.80%	-
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）	9.02%	5.73%	-
基本每股收益	0.56	0.31	78.76%

(二) 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	56,914,982,890.21	45,377,194,307.14	25.43%
负债总计	48,388,505,801.23	37,579,148,862.16	28.76%
归属于挂牌公司股东的净资产	8,526,477,088.98	7,798,045,444.98	9.34%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	6.51	5.95	9.34%
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	17.13%	19.59%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	55.82%	43.74%	-
流动比率	1.15	1.18	-
利息保障倍数	38.72	23.95	-

(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	4,155,603,121.45	1,893,036,151.63	119.52%
应收账款周转率	182.87	269.77	-
存货周转率	8.98	5.43	-

(四) 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	25.43%	11.25%	-
营业收入增长率%	50.38%	-6.67%	-
净利润增长率%	80.24%	-38.00%	-

(五) 行业主要财务及监管指标

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
净资本	2,379,799,581.19	1,900,232,727.01	25.24%
风险资本准备总额	1,051,734,719.10	879,704,662.83	19.56%
净资本与风险资本准备总额的比例	226%	216%	-
净资本与净资产的比例	32%	27%	-
扣除客户保证金的流动资产	5,456,952,325.70	5,345,114,032.89	2.09%
扣除客户权益的流动负债	1,144,575,696.82	1,308,159,778.21	-12.50%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	477%	409%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	21%	24%	-
结算准备金额	1,245,272,897.22	1,926,561,763.43	-35.36%

(六) 补充财务指标

适用 不适用

二、 非经常性损益项目及金额

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-19,087.57
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	5,143,786.11
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-614,053.89
非经常性损益合计	4,510,644.65
减：所得税影响数	1,173,480.06
少数股东权益影响额（税后）	
非经常性损益净额	3,337,164.59

三、 会计政策变更、会计估计变更或重大差错更正等情况

(一) 会计数据追溯调整或重述情况

√ 会计政策变更 □ 会计差错更正 □ 其他原因 □ 不适用

单位：元

科目/指标	上年期末（上年同期）		上上年期末（上上年同期）	
	调整重述前	调整重述后	调整重述前	调整重述后
预付账款	520,667,316.35	520,667,316.35		
其他流动资产	457,739,482.53	457,739,482.53		
使用权资产	0.00	0.00		
一年内到期的非流动负债	0.00	0.00		
租赁负债	0.00	0.00		

(二) 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因及影响

√ 适用 □ 不适用

本公司自 2021 年 1 月 1 日起执行经修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》（以下简称新租赁准则）。

根据新租赁准则衔接规定，公司作为承租人，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新租赁准则与原准则的差异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。

执行新租赁准则对公司 2021 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		
	2020 年 12 月 31 日	新租赁准则调整影响	2021 年 1 月 1 日
使用权资产		90,407,315.27	90,407,315.27
租赁负债		59,305,425.75	59,305,425.75
一年内到期的非流动负债		24,423,360.37	24,423,360.37
其他流动资产	457,739,482.53	-4,035,652.01	453,703,830.52
预付账款	520,667,316.35	-2,642,877.14	518,024,439.21

四、 境内外会计准则下会计数据差异

□ 适用 √ 不适用

五、 主要经营情况回顾

（一） 经营计划

√适用 □不适用

2021年，公司加快转型升级步伐，以平台化为发展方向，进一步突出期货衍生品服务实体经济功能，不断稳固公司行业地位，打造国内领先、国际知名的衍生品投资银行。

一、经纪业务聚焦做大做强。公司始终将经纪业务作为核心和基础，保持行业领先地位。一是推进金融机构总部建设，在北京、上海、广州、深圳等重点地区，着重开发私募机构、证券公司、银行理财子公司等金融机构业务，快速提高客户权益，赋能财富管理业务。二是加大金融期货营销人才培育，扩大券商IB合作范围，加快金融期货领域的投入。

二、风险管理业务聚焦模式创新。公司将风险管理业务作为扩大业务规模和客户群体的重要渠道，开发产业客户的经纪业务、财富管理、境外业务等各类需求。一是以仓储物流业务为切入点，利用分支机构的区位优势，快速提升永安资本现货端的能力，促进期货和现货融合。二是加快期现业务与场外业务融合，创新含权贸易模式，形成独特竞争优势，做厚风险管理业务利润。三是利用非标仓单、场外期权等工具拓展供应链金融，满足实体企业多样化需求，提高产业客户粘性。四是做市商业品种进一步丰富，提升盈利能力。

三、财富管理业务聚焦配置能力提升。公司发挥财富管理业务规模效应，发挥品牌价值。一是推出“鲲鹏计划”，加快推进“投研一体化”工作，将公司的研究、品牌以及资源配置能力转化为产品组织和创设能力。二是积极申请公募投顾业务资格，梳理公募投顾业务展业流程，开发公募投顾业务技术系统，推进公募线上化。三是吸引开发各类资产管理机构并提供差异化服务，推动人才的共同培养与良性流动。

四、资产管理业务聚焦投研能力提升。公司紧抓大宗商品成为满足社会财富配置重要渠道的时间窗口，构建资产管理业务核心竞争力。一是加大“投研+金融科技”的探索力度，推进另类数据研究成果化，结合宏观经济，加强投资策略的研究和应用。二是加强对股票、债券等大类资产的投资研究，丰富产品线。三是立足公司财富管理能力，打造具有永安特色的FOF、MOM资产配置型产品。

五、场外衍生品业务聚焦投资能力提升。公司将场外衍生品业务打造成为公司重要利润来源和永安资本期现业务竞争壁垒的重要手段。一是提升场外衍生品的产品设计能力、交易对冲能力，加强场外衍生品的产品化和标准化，保持风险管理业务盈利能力。二是完善风险管理系统场外风险管理部分，加强场外衍生品业务风险防控。三是加快发展金融衍生品业务。四是探索境外衍生品业务。

六、国际业务聚焦协同能力提升。推进境内外交易通道、资金通道、资管平台和贸易平台建设，发挥境内外业务联动作用。一是抢抓RCEP等发展机遇，发挥境外子公司协同发展优势，研究相关品种境

外设库的可行性和必要性，逐步实现新加坡平台化、独立化运营。二是有效结合境内平台业务，积极布局 QFII、RQFII 业务，加深国际化品种的开发力度。

（二） 行业情况

√适用 □不适用

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 2021 年 6 月末，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）、1 家金融期货交易所（中国金融期货交易所）和 1 家创新型期货交易所（广州期货交易所）。已上市期货期权品种 91 个，其中商品期货 64 个、金融期货 6 个、商品期权 20 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。每个商品期货期权品种都连接着一个实体产业链，与实体经济密切相关，期货期权市场已经成为现代经济体系的重要组成部分，在服务宏观形势研判、产业发展和居民财富管理需要等方面发挥着重要作用，是研判宏观形势的重要参考，是服务产业发展的重要平台，是居民财富管理的重要途经。2021 年上半年，我国期货市场成交量和成交额再创新高，期货市场客户权益首次突破 1 万亿元，市场规模继续稳步扩大，市场运行质量不断提升，吸引了实体企业客户利用期货衍生品市场进行风险管理，服务实体经济空间不断扩展。同时，十三届全国人大常委会第二十八次会议首次审议了《中华人民共和国期货法（草案）》并面向社会公开征求意见，《期货公司子公司管理暂行办法（征求意见稿）》发布，期货市场将进一步透明、规范、开放，行业迎来战略机遇期。

目前，我国期货行业形成了以中国证监会集中统一监督管理为主，中国期货业协会、期货交易所和中国期货市场监控中心等自律组织自律管理为辅的管理体制。期货公司正朝着风险管理服务和财富管理服务等方向加快创新，进一步发挥期货及衍生品服务供应商的专业能力，促进期货市场持续健康稳定发展。

（三） 商业模式

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

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减收。期货经纪业务的主要营销渠道包括传统网点渠道、券商 IB 业务渠道和居间人渠道。期货交易实行保证金制度。

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

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

2. 期货投资咨询业务

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

（四） 经营情况回顾

2021年上半年，公司坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为统领，围绕“国内领先、国际知名的衍生品投资银行”企业愿景，践行“一切为了客户，一切为了发展”核心价值观，坚持服务实体经济，整体经营业绩大幅增长，分类监管、社会责任担当继续走在行业前列，保持3A信用评级，头部优质企业的品牌形象更加全面、稳固、突出。

报告期内，公司实现营业收入1,668,457.94万元，同比增长50.38%；净利润73,964.60万元，同比增长80.24%；加权平均净资产收益率（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）9.06%。截止本报告期末，公司归属于母公司所有者的权益852,647.71万元，同比增长9.34%，规模进一步增大。

公司自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。截止本报告期末，公司净资本为23.80亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为226%，净资本与净资产的比例为32%，流动资产与流动负债的比例为477%，负债与净资产的比例为21%，各项风险监管指标持续符合监管标准。

（五） 财务分析

1. 资产负债结构分析

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期期末		上年期末		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	25,765,930,553.62	45.27%	20,011,941,230.41	44.10%	28.75%
应收票据		0.00%		0.00%	
应收账款	114,530,315.35	0.20%	46,631,793.13	0.10%	145.61%
应收货币保证金	16,461,896,327.45	28.92%	15,817,455,680.10	34.86%	4.07%
应收质押保证金	1,972,600,980.00	3.47%	1,048,318,156.00	2.31%	88.17%
存出保证金	836,033.34	0.00%	1,213,700.40	0.00%	-31.12%
交易性金融资产	4,681,156,410.12	8.22%	3,948,448,688.50	8.70%	18.56%
应收款项融资	95,491,034.89	0.17%	49,147,244.81	0.11%	94.30%
预付款项	1,419,272,425.64	2.49%	520,667,316.35	1.15%	172.59%
应收结算担保金	84,822,043.30	0.15%	69,440,425.56	0.15%	22.15%
应收风险损失款	676,263.93	0.00%	676,263.93	0.00%	0.00%
应收佣金	3,274,381.10	0.01%	3,266,507.87	0.01%	0.24%
其他应收款	1,051,804,961.64	1.85%	450,700,058.47	0.99%	133.37%
买入返售金融资产	13,922,044.92	0.02%	7,100,000.00	0.02%	96.09%
存货	1,898,884,930.71	3.34%	1,487,519,112.57	3.28%	27.65%
其他流动资产	1,523,371,137.33	2.68%	457,739,482.53	1.01%	232.80%
长期股权投资	883,824,440.74	1.55%	704,400,897.48	1.55%	25.47%

其他权益工具投资	25,780,900.94	0.05%	25,838,630.14	0.06%	-0.22%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.00%	1,400,000.00	0.00%	0.00%
投资性房地产	333,699,114.08	0.59%	339,048,536.78	0.75%	-1.58%
固定资产	96,092,227.28	0.17%	98,341,683.77	0.22%	-2.29%
使用权资产	91,623,093.58	0.16%		0.00%	
无形资产	21,796,507.85	0.04%	23,955,193.26	0.05%	-9.01%
长期待摊费用	10,820,178.51	0.02%	11,508,050.85	0.03%	-5.98%
递延所得税资产	361,476,583.89	0.64%	252,435,654.23	0.56%	43.20%
短期借款	3,032,455,351.41	5.33%	1,237,622,713.74	2.73%	145.02%
应付货币保证金	36,145,893,248.38	63.51%	30,659,518,043.39	67.57%	17.89%
应付质押保证金	1,471,250,596.00	2.58%	857,391,364.00	1.89%	71.60%
交易性金融负债	1,257,297,804.38	2.21%	758,704,192.57	1.67%	65.72%
期货风险准备金	271,679,699.90	0.48%	256,567,983.48	0.57%	5.89%
应付票据	50,000,000.00	0.09%		0.00%	
应付账款	187,744,458.38	0.33%	92,533,817.44	0.20%	102.89%
预收款项	7,338,417.86	0.01%	7,217,084.50	0.02%	1.68%
合同负债	1,023,446,719.15	1.80%	479,222,469.14	1.06%	113.56%
应付期货投资者保障基金	508,773.13	0.00%	827,060.73	0.00%	-38.48%
应付手续费及佣金	1,236,966.13	0.00%	1,153,012.55	0.00%	7.28%
应付职工薪酬	853,920,682.39	1.50%	877,368,031.14	1.93%	-2.67%
应交税费	249,292,632.85	0.44%	156,179,183.84	0.34%	59.62%
其他应付款	2,809,684,453.72	4.94%	1,329,791,897.91	2.93%	111.29%
一年内到期的非流动负债	29,137,420.53	0.05%			
其他流动负债	399,929,761.88	0.70%	374,447,383.37	0.83%	6.81%
应付债券	307,828,356.16	0.54%	301,378,356.16	0.66%	2.14%
租赁负债	62,251,189.01	0.11%		0.00%	
预计负债	414,040.85	0.00%	418,767.91	0.00%	-1.13%
递延所得税负债	227,195,229.12	0.40%	188,807,500.29	0.42%	20.33%
资产总计	56,914,982,890.21	100.00%	45,377,194,307.14	100.00%	25.43%

资产负债项目重大变动原因：

- 1) 应收账款：期末较期初增加 145.61%，主要系子公司基差贸易业务赊销规模扩大，应收账款增加；
- 2) 应收质押保证金：期末较期初增加 88.17%，主要系本期客户质押业务规模增加，公司在交易所质押物增加；
- 3) 存出保证金：期末较期初减少 31.12%，主要系公司存放在香港交易所的存出保证金下降；
- 4) 应收款项融资：期末较期初增加 94.30%，主要系本期永安资本客户承兑汇票支付规模扩大；
- 5) 预付款项：期末较期初增长 172.59%，主要系子公司永安资本基差贸易规模扩大，预付货款增加；
- 6) 其他应收款：期末较期初增加 133.37%，主要系本期永安资本场外应收款大幅增加；

- 7) 买入返售金融资产：期末较期初增加 96.09%，主要系本期期末持有的国债逆回购余额增加；
- 8) 其他流动资产：期末较期初增加 232.80%，主要系子公司新永安金控融出资金增加；
- 9) 使用权资产：期末金额为 91,623,093.58 元，主要系适用新租赁准则影响；
- 10) 递延所得税资产：期末较期初增加 43.20%，主要系期末公允价值变动浮亏大幅增加；
- 11) 短期借款：期末较期初增加 145.02%，主要系子公司因业务规模扩大银行借款增加；
- 12) 应付质押保证金：期末较期初增加 71.60%，主要系本期客户质押业务增加；
- 13) 交易性金融负债：期末较期初增加 65.72%，主要系本期衍生金融工具浮亏增加以及结构化主体其他投资者享有的权益增加；
- 14) 应付票据：期末余额为 50,000,000.00 元，主要系永安资本新增票据形式筹资；
- 15) 应付账款：期末较期初增加 102.89%，主要系本期永安资本基差贸易规模扩大，应付货款增加；
- 16) 合同负债：期末较期初增加 113.56%，主要系本期永安资本基差贸易规模扩大，预收货款增加；
- 17) 应付期货投资者保障基金：期末较期初减少 38.48%，主要系期末余额按 1-6 月代理交易额进行计提；
- 18) 应交税费：期末较期初增加 59.62%，主要系应交所得税大幅增加；
- 19) 其他应付款：期末较期初增加 111.29%，主要系子公司永安资本衍生业务应付款增加；
- 20) 一年内到期的非流动负债：期末金额为 29,137,420.53 元，主要系适用新租赁准则影响；
- 21) 租赁负债：期末金额为 62,251,189.01 元，主要系适用新租赁准则影响。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
一、营业收入	16,684,579,435.27	-	11,094,744,238.08	-	50.38%
手续费及佣金净收入	422,879,742.93	2.53%	276,016,332.31	2.49%	53.21%
其中：经纪业务手续费收入	367,921,268.13	2.21%	224,188,636.91	2.02%	64.11%
资产管理业务收入	5,973,652.28	0.04%	30,052,884.30	0.27%	-80.12%
投资咨询业务收入	868,253.58	0.01%	1,196,870.48	0.01%	-27.46%
代理销售金融产品收入	48,116,568.94	0.29%	20,577,940.62	0.19%	133.83%
其他手续费及佣金收入	0.00	0.00%	0.00	0.00%	
利息净收入	183,056,031.59	1.10%	254,532,312.32	2.29%	-28.08%

投资收益	755,951,596.72	4.53%	744,554,239.46	6.71%	1.53%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	247,172,052.17	1.48%	84,842,316.48	0.76%	191.33%
公允价值变动收益	-222,869,678.13	-1.34%	-134,846,913.72	-1.22%	
汇兑收益	-57,374.90	0.00%	-2,126,363.60	-0.02%	
其他业务收入	15,539,375,556.58	93.14%	9,948,797,213.60	89.67%	56.19%
其中：风险管理业务收入	15,516,932,559.13	93.00%	9,939,995,024.09	89.59%	56.11%
其他收益	6,243,120.64	0.04%	7,746,451.35	0.07%	-19.41%
二、营业成本	15,892,444,841.42	95.25%	10,683,555,475.38	96.29%	48.76%
提取期货风险准备金	15,111,716.42	0.09%	9,687,448.23	0.09%	55.99%
税金及附加	6,402,360.00	0.04%	3,014,773.41	0.03%	112.37%
业务及管理费	574,118,025.38	3.44%	486,260,699.48	4.38%	18.07%
研发费用	0.00	0.00%	0.00	0.00%	
信用减值损失	49,693,342.66	0.30%	20,950,492.92	0.19%	137.19%
其他资产减值损失	131,874,091.89	0.79%	418,046,162.62	3.77%	-68.45%
其他业务成本	15,115,245,305.07	90.59%	9,745,595,898.72	87.84%	55.10%
三、营业利润	792,134,593.85	4.75%	411,188,762.70	3.71%	92.65%
营业外收入	104,489,840.19	0.63%	117,976,582.13	1.06%	-11.43%
营业外支出	1,751,015.90	0.01%	2,182,513.15	0.02%	-19.77%
四、利润总额	894,873,418.14	5.36%	526,982,831.68	4.75%	69.81%
五、净利润	739,645,964.41	-	410,371,541.96	-	80.24%

项目重大变动原因：

- 1) 经纪业务手续费收入：本期较上期相比增长 64.11%，主要系本期交易所减收增加；
- 2) 资产管理业务收入：本期较上期相比下降 80.12%，主要系本期资产管理业务管理费减少；
- 3) 代理销售金融产品收入：本期较上期相比增长 133.83%，主要系本期基金销售业务规模增加；
- 4) 公允价值变动收益：本期为-222,869,678.13 元，主要系场外衍生品业务浮亏增加；
- 6) 汇兑收益：本期为-57,374.90 元，主要系本期汇率波动较小；
- 7) 其他业务收入：本期较上期相比增长 56.19%，主要系本期永安资本基差贸易规模扩大；
- 8) 提取期货风险准备金：本期较上期相比增长 55.99%，主要系本期手续费净收入增加，相应期货风险准备金计提增加；
- 9) 税金及附加：本期较上期相比增长 112.37%，主要系本期房产税、城市维护建设税、教育费附加等增加；
- 10) 信用减值损失：本期较上期相比增长 137.19%，主要系本期坏账准备增加；
- 11) 其他资产减值损失：本期较上期相比下降 68.45%，主要系本期存货跌价损失计提减少；
- 12) 其他业务成本：本期较上期相比增长 55.10%，主要系本期永安资本基差贸易业务规模扩大。

(2) 收入构成

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
手续费及佣金净收入	422,879,742.93	276,016,332.31	53.21%
利息净收入	183,056,031.59	254,532,312.32	-28.08%
其他业务收入	15,539,375,556.58	9,948,797,213.60	56.19%
投资收益	755,951,596.72	744,554,239.46	1.53%
公允价值变动收益	-222,869,678.13	-134,846,913.72	
汇兑收益	-57,374.90	-2,126,363.60	
其他收益	6,243,120.64	7,746,451.35	-19.41%

分行政区域营业部及手续费收入情况

√适用 □不适用

单位：元

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额	占营业收入比例%
杭州本部		346,442,058.06	2.08%
香港特别行政区[注]		26,417,722.73	0.16%
浙江省(不含杭州本部)	15	20,010,564.60	0.12%
辽宁省	3	2,597,574.75	0.02%
山东省	7	5,264,482.85	0.03%
北京市	1	2,311,127.54	0.01%
广东省	2	3,718,391.85	0.02%
上海市	1	1,361,812.72	0.01%
福建省	2	2,079,499.31	0.01%
河南省	1	2,020,731.82	0.01%
江苏省	2	1,915,618.38	0.01%
吉林省	1	1,517,671.35	0.01%
天津市	1	857,666.37	0.01%
重庆市	1	938,916.58	0.01%
河北省	2	1,266,626.86	0.01%
湖北省	1	769,836.08	0.00%
四川省	1	1,300,551.57	0.01%
湖南省	1	1,014,028.92	0.01%
江西省	1	710,567.21	0.00%
陕西省	1	364,293.38	0.00%
合计	44	422,879,742.93	2.54%

[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

收入构成变动的原因：

本期公司收入结构无重大变动，各项收入变动原因请参见本节“五、经营情况回顾（五）财务分析 2. 营业情况分析（1）利润构成”之“项目重大变动原因”。

3. 现金流量状况

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
经营活动产生的现金流量净额	4,155,603,121.45	1,893,036,151.63	119.52%
投资活动产生的现金流量净额	52,028,378.33	-1,189,927,018.35	
筹资活动产生的现金流量净额	1,444,236,455.58	150,146,761.91	861.88%

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 22.63 亿元，主要本期客户保证金净额净流入增加 20.32 亿元，交易所保证金净额净流出减少 19.59 亿元，基差贸易现金净流入增加 11.19 亿元，为交易目的而持有的金融资产净流入减少 18.60 亿元，融出资金流出增加 9.97 亿元；
2. 投资活动产生的现金流量净额：本期较上期增加 12.42 亿元，主要系上期合并结构化主体清算支付现金 16 亿元；
3. 筹资活动产生的现金流量净额增加：本期较上期增加 12.94 亿元，主要系公司借款净流入与上期相比增加 11.09 亿元；
4. 本期经营活动产生的现金流量净额较本期净利润金额多约 34.16 亿元，主要系公司客户权益、保证金及往来款等的变动体现在现金流量中，而不体现在净利润中所致。

六、 主要控股参股公司分析

(一) 主要控股子公司、参股公司经营情况

√适用 □不适用

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	与公司从事业务的关联性	持有目的	注册资本	总资产	净资产	营业收入	净利润
永安资本	子公司	风险管理	风险管理业务子公司	开展风险	1,300,000,000.00	9,499,745,665.15	2,089,183,090.57	15,700,934,952.63	215,701,270.72

		业 务	司	管 理 业 务					
永 安 国 富	参 股 公 司	资 产 管 理	基 金 业 务 代 销、 产 品 投 资 等	战 略 投 资	100,000,000.00	4,099,874,846.29	2,714,919,407.76	3,623,601,711.49	759,367,271.76

(二) 报告期内取得和处置子公司的情况

适用 不适用

合并财务报表的合并范围是否发生变化

是 否

2021年3月，公司成立永盈3号集合资产管理计划。公司评估该集合管理计划连同管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口足够重大，以致表明公司对其拥有控制权，自其成立之日起将该结构化主体纳入合并范围。

(三) 合并财务报表范围内是否包含私募基金管理人：

是 否

七、 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

对于公司管理的结构化主体，公司通过评估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2021年6月30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和永盈3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。

八、 对非标准审计意见及关键审计事项的说明

(一) 非标准审计意见说明

适用 不适用

（二） 关键审计事项说明：

适用 不适用

未经审计

九、 企业社会责任

（一） 乡村振兴工作情况

适用 不适用

2021年，我国脱贫攻坚战取得了全面胜利，进入了全面实施乡村振兴战略新阶段。公司认真学习领会习近平总书记关于乡村振兴的重要论述，设立乡村振兴与“保险+期货”工作领导小组，继续发扬“上下同心、尽锐出战、精准务实、开拓创新、攻坚克难、不负人民”的脱贫攻坚精神，将脱贫攻坚时期形成的好经验好做法延续下去，坚持各项帮扶工作方向不偏、劲头不松、力度不减，为全面推进乡村振兴而持续奋斗。今年上半年，公司累计开展了25个“保险+期货”项目，承保现货10余万吨，运用期货期权专业手段帮助广大农企农户降低生产经营风险，增加收入；累计投入120多万元开展了特色农产品采购、教育帮扶、乡村电商平台建设、困难群众慰问等乡村振兴相关活动。今年6月，公司走进新疆阿克苏地区开展乡村振兴活动，捐赠100万元支持当地开展“保险+期货”项目，同时向当地启明学校捐赠20万元，巩固拓展脱贫攻坚成果，助力浙江援疆事业。公司连续5年获得中国期货业协会扶贫工作考评第一名。

（二） 其他社会责任履行情况

适用 不适用

十、 公司面临的风险和应对措施

适用 不适用

1. 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。公司经纪业务始终坚持服务客户，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。

2. 利息收入下滑风险

利息收入是期货公司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。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。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。此外，我国金融机构资产管理业务的政策环境差异较大、发展起点不同，期货公司开展资产管理业务的起步较晚，期货公司资产管理规模相对较小。如果相关监管政策在未来出现调整或变化，可能导致公司资管产品不符合监管要求，这将对公司资产管理业务开展及收入规模的扩大造成不利的影响。

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。一是培养资管团队快速成长；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，面临的主要

风险包括管理人尽职调查风险、投资者适当性风险、操作风险及信息披露风险。

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。

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、衍生品等。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。合规经营既是期货公司经营的重要保障，也是监管部门及各市场参与主体最重视的部分。虽然公司已按照《公司法》《期货交易管理条例》《期货公司监督管理办法》等一系列法律法规、监管政策的要求，建立了合规管理制度、完善了合规管理组织体系、营造并形成了合规文化氛围，但公司及其子公司、下属分支机构、相关主体仍可能因为存在不遵守相关法律法规及监管政策要求而承担法律风险、被行政处罚或被采取监管措施的情形，这将对公司业务开展、

声誉造成损失。

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，对经营管理层负责，形成稽核报告及时汇报公司经营管理层，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，或信息技术系统因未能及时、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，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，如果公司对居间人管理不当，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

公司无法保证自身能够避免在未来开展业务过程中因为工作过失、第三方责任或行为不当等而面临司法诉讼、仲裁或受到监管调查的风险。如果公司未来因为上述事项或其他不确定因素导致的风险而出现相关重大诉讼、仲裁或受到监管调查,将可能对公司正常业务的开展与经营带来不利影响。

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**等含有“永安”字样的标识尚未取得商标专用权,上述商标使用过程中可能会使本公司遭受法律纠纷,进而对业务正常开展、经营业绩及财务状况产生不利影响。

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

第四节 重大事件

一、 重大事件索引

事项	是或否	索引
是否存在诉讼、仲裁事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(一)
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<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	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四.二.(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过的收购、出售资产、对外投资，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	四.二.(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	四.二.(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	
是否存在破产重整事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在应当披露的其他重大事件	<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

(一) 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

2、 报告期内未结案的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

3、 报告期内结案的重大诉讼、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	5,260,000,000.00	123,994,304.68
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	185,000,000.00	17,316,037.18
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	59,000,000,000.00	2,230,508,300.09
4. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	1,500,000,000.00	10,807,626.76
总计	65,945,000,000.00	2,382,626,268.71

(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承诺按“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	已履行完毕

超期未履行完毕的承诺事项详细情况：

无

(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
货币资金	其他货币资金	质押	355,336,499.73	0.62%	融券保证金、保函保证金、信用证保证金和场外衍生品保证金等
应收账款	应收账款	质押	9,295,593.10	0.02%	保理
存货	存货	质押	391,891,225.82	0.69%	质押
交易性金融资产	股票	质押	535,676,425.10	0.94%	融券担保品
总计	-	-	1,292,199,743.75	2.27%	-

资产权利受限事项对公司的影响：

公司权利受限事项均因正常业务开展产生，对公司经营无重大影响。

第五节 股份变动和融资

一、普通股股本情况

(一) 普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末		
		数量	比例%		数量	比例%	
无限售 条件股 份	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%	
	其中：控股股东、实际控制人						
	董事、监事、高管						
	核心员工						
有限售 条件股 份	有限售股份总数	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%	
	其中：控股股东、实际控制人						
	董事、监事、高管						
	核心员工						
总股本		1,310,000,000	-	0	1,310,000,000	-	
普通股股东人数							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	0	439,347,825	33.54%	292,898,550	146,449,275	0	0
2	浙江省产业基金有限公司	350,000,000	0	350,000,000	26.72%		350,000,000	0	0

	司								
3	浙江 东方 金融 控股 集团 股份 有限 公司	166,427,690	0	166,427,690	12.70%		166,427,690	0	0
4	浙江 省金 融控 股有 限公 司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%		138,689,727	0	0
5	浙江 省经 济建 设投 资有 限公 司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%		138,689,727	26,540,000	0
6	物产 中大 集团 股份 有限 公司	27,500,000	0	27,500,000	2.10%		27,500,000	0	0
7	方继 方	5,842,000	0	5,842,000	0.45%		5,842,000	0	0
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	0	4,795,000	0.37%		4,795,000	0	0
9	江苏 柏博	3,393,000	0	3,393,000	0.26%		3,393,000	0	0

	产业基金管理有限公司—南京柏载投资合伙企业（有限合伙）								
10	浙江省经协集团有限公司	3,020,000	0	3,020,000	0.23%		3,020,000	0	0
	合计	1,277,704,969	0	1,277,704,969	97.55%	292,898,550	984,806,419	26,540,000	0

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 0.93%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 17.63%的股权。

二、 控股股东、实际控制人变化情况

报告期内控股股东、实际控制人未发生变化

三、 报告期内的普通股股票发行及募集资金使用情况

（一） 股票发行情况

适用 不适用

（二） 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

四、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

五、 存续至本期的债券融资情况

适用 不适用

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

募集资金用途变更情况

适用 不适用

六、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用

七、 特别表决权安排情况

适用 不适用

第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况

一、 董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	任职起止日期	
				起始日期	终止日期
方铁道	董事长	男	1980年10月	2019年10月25日	2022年10月24日
葛国栋	董事、党委书记、总经理	男	1972年1月	2019年10月25日	2022年10月24日
申建新	董事	男	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	董事会秘书、财务总监	男	1980年10月	2019年11月27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:

截至本半年度报告报出日, 董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系如下:

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, 任浙江省财务开发有限责任公司综合办公室主任。

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、浙江省财务开发有限责任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	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 type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	财务总监是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：

适用 不适用

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

适用 不适用

（四） 董事、监事、高级管理人员股权激励情况

适用 不适用

二、 员工情况

（一） 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
中层以上管理人员	77	1	1	77
市场业务人员	419	55	34	440
研究人员	73	11	17	67
信息技术人员	87	8	7	88
财务人员	74	6	3	77
合规管理及风控人员	93	10	11	92
其他职能人员	276	39	28	287

员工总计	1,099	130	101	1,128
------	-------	-----	-----	-------

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	3	4
硕士	327	350
本科	704	705
专科	57	60
专科以下	8	9
员工总计	1,099	1,128

(二) 核心员工(公司及控股子公司)基本情况及变动情况

适用 不适用

第七节 财务会计报告

一、 审计报告

是否审计	否
------	---

二、 财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2021年6月30日	2020年12月31日
流动资产：			
货币资金	六（一）1	25,765,930,553.62	20,011,941,230.41
其中：期货保证金存款		21,876,961,163.42	17,653,414,687.86
应收货币保证金	六（一）4	16,461,896,327.45	15,817,455,680.10
应收质押保证金	六（一）5	1,972,600,980.00	1,048,318,156.00
存出保证金	六（一）6	836,033.34	1,213,700.40
交易性金融资产	六（一）14	4,681,156,410.12	3,948,448,688.50
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款	六（一）7注1	114,530,315.35	46,631,793.13
应收款项融资	六（一）8	95,491,034.89	49,147,244.81
预付款项	六（一）9	1,419,272,425.64	520,667,316.35
应收结算担保金	六（一）10	84,822,043.30	69,440,425.56
应收风险损失款	六（一）11	676,263.93	676,263.93
应收佣金	六（一）7注1	3,274,381.10	3,266,507.87
其他应收款	六（一）12	1,051,804,961.64	450,700,058.47
其中：应收利息		111,533.21	1,503,283.61
应收股利		24,599.31	
买入返售金融资产	六（一）23注2	13,922,044.92	7,100,000.00
存货	六（一）13	1,898,884,930.71	1,487,519,112.57
合同资产			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	六（一）2、3、23注 2	1,523,371,137.33	457,739,482.53
流动资产合计		55,088,469,843.34	43,920,265,660.63
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	六（一）16	883,824,440.74	704,400,897.48
其他权益工具投资	六（一）15	25,780,900.94	25,838,630.14

期货会员资格投资	六（一）17	1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产	六（一）18	333,699,114.08	339,048,536.78
固定资产	六（一）19	96,092,227.28	98,341,683.77
在建工程			
使用权资产	六（一）20	91,623,093.58	
无形资产	六（一）21	21,796,507.85	23,955,193.26
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	六（一）23注2	10,820,178.51	11,508,050.85
递延所得税资产	六（一）22	361,476,583.89	252,435,654.23
其他非流动资产			
非流动资产合计		1,826,513,046.87	1,456,928,646.51
资产总计		56,914,982,890.21	45,377,194,307.14
流动负债：			
短期借款	六（一）24	3,032,455,351.41	1,237,622,713.74
应付货币保证金	六（一）26	36,145,893,248.38	30,659,518,043.39
应付质押保证金	六（一）27	1,471,250,596.00	857,391,364.00
交易性金融负债	六（一）28	1,257,297,804.38	758,704,192.57
期货风险准备金	六（一）29	271,679,699.90	256,567,983.48
衍生金融负债			
应付票据	六（一）30	50,000,000.00	
应付账款	六（一）31	187,744,458.38	92,533,817.44
预收款项	六（一）32	7,338,417.86	7,217,084.50
合同负债	六（一）33	1,023,446,719.15	479,222,469.14
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金	六（一）34	508,773.13	827,060.73
应付手续费及佣金	六（一）37注3	1,236,966.13	1,153,012.55
应付职工薪酬	六（一）35	853,920,682.39	877,368,031.14
应交税费	六（一）36	249,292,632.85	156,179,183.84
其他应付款	六（一）37注3	2,809,684,453.72	1,329,791,897.91
其中：应付利息			
应付股利			157,200,000.00
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债	六（一）39注4	29,137,420.53	
其他流动负债	六（一）25、40 注5	399,929,761.88	374,447,383.37
流动负债合计		47,790,816,986.09	37,088,544,237.80
非流动负债：			
长期借款			
应付债券	六（一）40注5	307,828,356.16	301,378,356.16
其中：优先股			
永续债			

租赁负债	六（一）39注4	62,251,189.01	
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债	六（一）38	414,040.85	418,767.91
递延收益			
递延所得税负债	六（一）22	227,195,229.12	188,807,500.29
其他非流动负债			
非流动负债合计		597,688,815.14	490,604,624.36
负债合计		48,388,505,801.23	37,579,148,862.16
所有者权益（或股东权益）：			
股本	六（一）41	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	六（一）42	1,501,072,377.99	1,501,621,789.21
减：库存股			
其他综合收益	六（一）43	-25,365,194.27	-14,700,285.08
专项储备			
盈余公积	六（一）44	489,739,107.05	489,739,107.05
一般风险准备	六（一）45	549,630,120.98	549,630,120.98
未分配利润	六（一）46	4,701,400,677.23	3,961,754,712.82
归属于母公司所有者权益合计		8,526,477,088.98	7,798,045,444.98
少数股东权益			
股东权益（或股东权益）合计		8,526,477,088.98	7,798,045,444.98
负债和股东权益（或股东权益）总计		56,914,982,890.21	45,377,194,307.14

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。财务报表附注六（一）应收款项包含上表所列的“应收账款”和“应收佣金”；

注 2：财务报表附注六（一）“结算备付金”、“融出资金”、“其他资产-待抵扣增值税”、“其他资产-待摊费用”列示在上表中“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：财务报表附注六（一）其他应付款包含上表所列的“应付手续费及佣金”和“其他应付款”；

注 4：财务报表附注六（一）“租赁负债”根据流动性列示在上表中“一年内到期的非流动负债”和“租赁负债”中；

注 5：财务报表附注六（一）“代理买卖证券款”、“其他负债-待转销项税额”、“其他负债-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	2021年6月30日	2020年12月31日
流动资产：			
货币资金		22,225,974,949.92	17,375,648,582.32
其中：期货保证金存款		20,316,035,545.14	16,539,184,049.59
应收货币保证金		15,465,635,099.64	15,074,615,352.43
应收质押保证金		1,972,600,980.00	1,048,318,156.00
存出保证金			
交易性金融资产		2,195,134,393.66	2,406,944,482.40
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		81,588,402.32	66,175,935.59
应收风险损失款		676,263.93	676,263.93
应收佣金		4,184,500.85	3,370,446.51
其他应收款		13,656,462.94	97,820,608.30
其中：应收利息			1,288,767.12
应收股利			
买入返售金融资产		6,500,000.00	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		14,905,147.36	17,106,947.00
流动资产合计		41,980,856,200.62	36,097,776,774.48
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（一）1	2,882,207,740.73	2,706,824,178.09
其他权益工具投资		18,818,135.40	18,847,000.00
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		333,699,114.08	339,048,536.78
固定资产		93,151,347.49	95,472,235.16
在建工程			
使用权资产		71,160,145.64	
无形资产		20,856,900.65	22,802,973.67
开发支出			

商誉			
长期待摊费用		8,845,557.31	9,314,568.52
递延所得税资产		138,631,666.08	137,414,877.00
其他非流动资产			
非流动资产合计		3,568,770,607.38	3,331,124,369.22
资产总计		45,549,626,808.00	39,428,901,143.70
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		34,536,397,747.56	29,687,237,638.59
应付质押保证金		1,972,600,980.00	1,048,318,156.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		271,679,699.90	256,567,983.48
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款			
预收款项		7,338,417.86	7,217,084.50
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金		508,773.13	827,060.73
应付手续费及佣金		1,236,966.13	1,153,012.55
应付职工薪酬		654,746,352.88	727,455,538.06
应交税费		157,632,156.16	118,129,668.09
其他应付款		49,266,914.60	196,402,401.13
其中：应付利息			
应付股利			157,200,000.00
合同负债		2,043,788.83	383,990.25
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债		24,392,425.04	
其他流动负债		122,627.33	23,039.42
流动负债合计		37,677,966,849.42	32,043,715,572.80
非流动负债：			
长期借款			
应付债券		307,828,356.16	301,378,356.16
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		48,164,891.27	
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		23,362,030.02	93,059,919.56
其他非流动负债			
非流动负债合计		379,355,277.45	394,438,275.72
负债合计		38,057,322,126.87	32,438,153,848.52

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	489,739,107.05
一般风险准备		549,630,120.98	549,630,120.98
未分配利润		3,641,251,204.50	3,139,693,818.55
股东权益（或股东权益）合计		7,492,304,681.13	6,990,747,295.18
负债和股东权益（或股东权益）总计		45,549,626,808.00	39,428,901,143.70

（三） 合并利润表

单位：元

项目	附注	2021年1-6月	2020年1-6月
一、营业收入		16,684,579,435.27	11,094,744,238.08
手续费及佣金净收入	六（二）1	422,879,742.93	276,016,332.31
其中：经纪业务手续费收入		367,921,268.13	224,188,636.91
资产管理业务收入		5,973,652.28	30,052,884.30
投资咨询业务收入		868,253.58	1,196,870.48
代理销售金融产品收入		48,116,568.94	20,577,940.62
其他代理业务收入			
利息净收入	六（二）2	183,056,031.59	254,532,312.32
其中：利息收入		255,787,318.68	296,951,486.77
利息支出		72,731,287.09	42,419,174.45
投资收益（损失以“-”号填列）	六（二）3	755,951,596.72	744,554,239.46
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		247,172,052.17	84,842,316.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	六（二）4	6,243,120.64	7,746,451.35
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六（二）5	-222,869,678.13	-134,846,913.72
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-57,374.90	-2,126,363.60
其他业务收入	六（二）6	15,539,375,556.58	9,948,797,213.60
其中：风险管理业务收入		15,516,932,559.13	9,939,995,024.09
资产处置收益（损失以“-”号填列）	六（二）7	439.84	70,966.36
二、营业支出		15,892,444,841.42	10,683,555,475.38

提取期货风险准备金		15,111,716.42	9,687,448.23
税金及附加	六（二）8	6,402,360.00	3,014,773.41
业务及管理费	六（二）9	574,118,025.38	486,260,699.48
研发费用			
信用减值损失	六（二）10	49,693,342.66	20,950,492.92
其他资产减值损失	六（二）11	131,874,091.89	418,046,162.62
其他业务成本	六（二）12	15,115,245,305.07	9,745,595,898.72
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		792,134,593.85	411,188,762.70
加：营业外收入	六（二）13	104,489,840.19	117,976,582.13
减：营业外支出	六（二）14	1,751,015.90	2,182,513.15
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		894,873,418.14	526,982,831.68
减：所得税费用	六（二）15	155,227,453.73	116,611,289.72
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		739,645,964.41	410,371,541.96
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）		739,645,964.41	410,371,541.96
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）		739,645,964.41	410,371,541.96
六、其他综合收益的税后净额	六（二）16	-10,664,909.19	15,517,724.43
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-10,664,909.19	15,517,724.43
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		-10,664,909.19	15,517,724.43
（1）权益法下可转损益的其他综合收益		45,055.61	
（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		-10,709,964.80	15,517,724.43
（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		728,981,055.22	425,889,266.39
（一）归属于母公司所有者的综合收益总额		728,981,055.22	425,889,266.39
（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		0.56	0.31
（二）稀释每股收益		0.56	0.31

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	2021年1-6月	2020年1-6月
一、营业收入		939,248,529.88	699,830,833.69
手续费及佣金净收入	十（二）1	357,582,820.78	249,200,653.08
其中：经纪业务手续费收入		302,234,327.03	193,748,963.20
资产管理业务收入		6,921,032.89	34,196,973.12
投资咨询业务收入		310,891.92	676,776.14
代理销售金融产品收入		48,116,568.94	20,577,940.62
其他代理业务收入			
利息净收入		198,167,630.90	253,996,013.84
其中：利息收入		229,849,943.70	276,430,283.20
利息支出		31,682,312.80	22,434,269.36
投资收益（损失以“-”号填列）	十（二）2	640,844,430.89	313,642,259.30
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		238,091,562.64	75,849,780.36
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		2,132,477.03	1,983,913.81
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-278,791,558.17	-125,807,783.48
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-255.06	75.91
其他业务收入		19,312,543.67	6,744,734.87
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）		439.84	70,966.36
二、营业支出		346,405,323.93	321,506,243.52
提取期货风险准备金		15,111,716.42	9,687,448.23
税金及附加		4,522,364.67	1,980,625.66
业务及管理费		321,367,959.82	306,475,138.77
研发费用			
信用减值损失		-402,975.19	591,791.70
其他资产减值损失			
其他业务成本		5,806,258.21	2,771,239.16
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		592,843,205.95	378,324,590.17
加：营业外收入		16,552.55	59.87
减：营业外支出		1,208,456.91	2,149,696.97

四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		591,651,301.59	376,174,953.07
减：所得税费用		90,093,915.64	75,131,238.45
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		501,557,385.95	301,043,714.62
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		501,557,385.95	301,043,714.62
（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		501,557,385.95	301,043,714.62
八、每股收益：			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

（五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2021年1-6月	2020年1-6月
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			1,708,786,863.68
销售商品、提供劳务收到的现金		17,904,186,652.98	11,224,814,028.41
收取利息、手续费及佣金的现金		708,828,165.78	594,481,322.72
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	六（三）1	6,246,900,567.12	4,169,057,349.24
经营活动现金流入小计		24,859,915,385.88	17,697,139,564.05
为交易目的而持有的金融资产净增加额		151,004,561.71	
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		17,776,045,550.77	12,215,554,432.07
支付利息、手续费及佣金的现金		23,722,085.54	22,961,815.26
以现金支付的业务及管理费		148,163,356.50	153,450,597.03

支付给职工以及为职工支付的现金		420,310,805.13	330,241,961.94
支付的各项税费		186,938,445.31	258,201,985.76
支付其他与经营活动有关的现金	六（三）2	1,998,127,459.47	2,823,692,620.36
经营活动现金流出小计		20,704,312,264.43	15,804,103,412.42
经营活动产生的现金流量净额		4,155,603,121.45	1,893,036,151.63
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		57,729.20	
取得投资收益收到的现金		67,139,628.92	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		9,954.37	83,305.15
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金	六（三）3		4,160,214.71
投资活动现金流入小计		67,207,312.49	4,243,519.86
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		15,178,934.16	13,260,791.41
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金	六（三）4		1,180,909,746.80
投资活动现金流出小计		15,178,934.16	1,194,170,538.21
投资活动产生的现金流量净额		52,028,378.33	-1,189,927,018.35
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		2,583,813,593.10	687,300,000.00
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	六（三）5	270,756,558.94	65,000,000.00
筹资活动现金流入小计		2,854,570,152.04	752,300,000.00
偿还债务支付的现金		1,204,884,392.71	417,485,874.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		194,683,392.78	180,571,770.78
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	六（三）6	10,765,910.97	4,095,593.31
筹资活动现金流出小计		1,410,333,696.46	602,153,238.09
筹资活动产生的现金流量净额		1,444,236,455.58	150,146,761.91
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-11,091,243.17	15,979,414.79
五、现金及现金等价物净增加额		5,640,776,712.19	869,235,309.98
加：期初现金及现金等价物余额		19,546,642,778.83	15,969,616,524.14
六、期末现金及现金等价物余额		25,187,419,491.02	16,838,851,834.12

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2021年1-6月	2020年1-6月
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		420,806,478.58	21,984,465.95
销售商品、提供劳务收到的现金			
收取利息、手续费及佣金的现金		618,333,171.36	547,590,852.38
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		4,625,604,872.71	3,334,415,786.90
经营活动现金流入小计		5,664,744,522.65	3,903,991,105.23
为交易目的而持有的金融资产净增加额			
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		23,677,321.56	22,434,269.36
以现金支付的业务及管理费		56,314,586.12	73,839,118.36
支付给职工以及为职工支付的现金		312,830,127.91	247,087,061.53
支付的各项税费		147,309,391.85	207,605,990.23
支付其他与经营活动有关的现金		56,041,654.88	3,415,200,425.59
经营活动现金流出小计		596,173,082.32	3,966,166,865.07
经营活动产生的现金流量净额		5,068,571,440.33	-62,175,759.84
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		28,864.60	
取得投资收益收到的现金		62,708,000.00	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		8,193.73	80,888.01
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		62,745,058.33	80,888.01
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		13,925,580.54	8,586,027.73
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		13,925,580.54	8,586,027.73
投资活动产生的现金流量净额		48,819,477.79	-8,505,139.72
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计			
偿还债务支付的现金			

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		8,117,750.52	
筹资活动现金流出小计		165,317,750.52	157,200,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		-165,317,750.52	-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		4,952,073,167.60	-227,880,899.56
加：期初现金及现金等价物余额		17,273,869,782.32	15,488,253,132.19
六、期末现金及现金等价物余额		22,225,942,949.92	15,260,372,232.63

三、 财务报表附注

(一) 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	√是 □否	第三节 三
2. 半年度报告所采用的会计估计与上年度财务报表是否变化	□是 √否	
3. 是否存在前期差错更正	□是 √否	
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	□是 √否	
5. 存在控制关系的关联方是否发生变化	□是 √否	
6. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	√是 □否	第三节 六 (二)
7. 是否存在证券发行、回购和偿还情况	□是 √否	
8. 是否存在向所有者分配利润的情况	□是 √否	
9. 是否根据会计准则的相关规定披露分部报告	√是 □否	附注九 (一)
10. 是否存在半年度资产负债表日至半年度财务报告批准报出日之间的非调整事项	□是 √否	
11. 是否存在上年度资产负债表日以后所发生的或有负债和或有资产变化情况	□是 √否	
12. 是否存在企业结构变化情况	□是 √否	
13. 重大的长期资产是否转让或者出售	□是 √否	
14. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	□是 √否	
15. 是否存在重大的研究和开发支出	□是 √否	
16. 是否存在重大的资产减值损失	√是 □否	附注六 (二) 11
17. 是否存在预计负债	√是 □否	附注六 (一) 38

附注事项索引说明:

本期其他资产减值损失发生额 1.32 亿元,系公司计提的存货跌价损失,主要由公司风险管理子公司基差贸易等业务产生。该等业务的经营情况需要结合其他业务收入、其他业务支出、投资收益及公允价值变动等项目综合考虑,不能简单通过上述单个项目作出判断。

(二) 财务报表项目附注

永安期货股份有限公司

财务报表附注

2021 年 1-6 月

金额单位:人民币元

一、公司基本情况

永安期货股份有限公司(以下简称公司或本公司)前身系浙江省永安期货经纪有限公司,于 1992 年 9 月在工商行政管理局登记注册,总部位于浙江省杭州市。公司现持有统一社会信用代码为 9133000010002099X5 的营业执照以及中国证券监督管理委员会 32080000 号期货经纪业务许可证,注册

资本 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 19 家营业部及 25 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 8 月 25 日第三届第十四次董事会批准对外报出。

二、财务报表的编制基础

（一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

（二）持续经营能力评价

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

三、重要会计政策和会计估计

（一）遵循企业会计准则的声明

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

（二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表所载财务信息的会计期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

（三）营业周期

公司经营业务的营业周期为 12 个月。

（四）记账本位币

公司采用人民币为记账本位币。境外子公司以其经营所处主要经济环境中的货币为记账本位币，编制财务报表时折算为人民币。

（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折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

(九) 金融工具

1. 金融资产和金融负债的分类

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

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

2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

(1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

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

(2) 金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

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

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

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

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

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

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

(3) 金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

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

按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》相关规定进行计量。

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

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

4) 以摊余成本计量的金融负债

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

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

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

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

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

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

4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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

（2）第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观

察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

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

5. 金融工具减值

(1) 金融工具减值计量和会计处理

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
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和合同资产

1) 具体组合及计量预期信用损失的方法

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

2) 账龄组合的账龄与整个存续期预期信用损失率对照表

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

本公司持有存货系为期货交易而持有以备出售的商品。

2. 发出存货的计价方法

发出存货采用个别计价法。

3. 存货可变现净值的确定依据及存货跌价准备的计提方法

资产负债表日，存货采用成本与可变现净值孰低计量，按照存货类别成本高于可变现净值的差额计提存货跌价准备。本公司以该存货的估计售价减去估计的销售费用和相关税费后的金额确定其可变现净值，并与其对应的成本进行比较，确定存货跌价准备的计提或转回的金额。

4. 存货的盘存制度

存货的盘存制度为永续盘存制。

(十一) 营业部的资金管理、交易清算原则

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

(十二) 客户保证金的管理与核算方法

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

(十三) 质押品的管理与核算方法

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

(十四) 实物交割的管理与核算方法

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

(十五) 客户资产管理业务核算方法

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

(十六) 长期股权投资

1. 共同控制、重要影响的判断

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

2. 投资成本的确定

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

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

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

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

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

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

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

3. 后续计量及损益确认方法

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

4. 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。资产负债表日，有迹象表明投资性房地产发生减值的，按照账面价值高于可收回金额的差额计提相应的减值准备。

（十八）固定资产

1. 固定资产的确认条件

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

2. 各类固定资产的折旧方法

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

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

（十九）在建工程

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

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

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

（二十）无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。
2. 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体年限如下：

项 目	摊销年限(年)
软 件	3
土地使用权	40

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

（二十一）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

期货投资者保障基金按照母公司代理交易额，依据期货公司分类评级结果对应的缴纳比例计提，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或服务；（3）公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

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

2. 收入计量原则

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

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

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

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

3. 收入确认的具体方法

本公司收入主要包括期货经纪业务收入、资产管理业务收入、利息收入、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

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

3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

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

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

（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）租赁

1. 公司作为承租人

在租赁期开始日，公司将租赁期不超过 12 个月，且不包含购买选择权的租赁认定为短期租赁；将单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁认定为低价值资产租赁。公司转租或预期转租租赁资产的，原租赁不认定为低价值资产租赁。

对于所有短期租赁和低价值资产租赁，公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁付款额计入相关资产成本或当期损益。

除上述采用简化处理的短期租赁和低价值资产租赁外，在租赁期开始日，公司对租赁确认使用权资产和租赁负债。

（1）使用权资产

使用权资产按照成本进行初始计量，该成本包括：① 租赁负债的初始计量金额；② 在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；③ 承租人发生的初始直接费用；④ 承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

公司按照直线法对使用权资产计提折旧。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，公司在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，公司在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。

（2）租赁负债

在租赁开始日，公司将尚未支付的租赁付款额的现值确认为租赁负债。计算租赁付款额现值时采用租赁内含利率作为折现率，无法确定租赁内含利率的，采用公司增量借款利率作为折现率。租赁付款额与其现值之间的差额作为未确认融资费用，在租赁期各个期间内按照确认租赁付款额现值的折现率确认利息费用，并计入当期损益。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额于实际发生时计入当期损益。

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结果或实际行权情况发生变化时，公司按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值，如使用权资产账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，将剩余金额计入当期损益。

2. 公司作为出租人

在租赁开始日，公司将实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁划分为融资租赁，除此之外的均为经营租赁。

(1) 经营租赁

公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁收款额确认为租金收入，发生的初始直接费用予以资本化并按照与租金收入确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。公司取得的与经营租赁有关的未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

(2) 融资租赁

在租赁期开始日，公司按照租赁投资净额(未担保余值和租赁期开始日尚未收到的租赁收款额按照租赁内含利率折现的现值之和)确认应收融资租赁款，并终止确认融资租赁资产。在租赁期的各个期间，公司按照租赁内含利率计算并确认利息收入。

公司取得的未纳入租赁投资净额计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

3. 售后租回

(1) 公司作为承租人

公司按照《企业会计准则第 14 号——收入》的规定，评估确定售后租回交易中的资产转让是否属于销售。

售后租回交易中的资产转让属于销售的，公司按原资产账面价值中与租回获得的使用权有关的部分，计量售后租回所形成的使用权资产，并仅就转让至出租人的权利确认相关利得或损失。

售后租回交易中的资产转让不属于销售的，公司继续确认被转让资产，同时确认一项与转让收入等额的金融负债，并按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》对该金融负债进行会计处理。

(2) 公司作为出租人

公司按照《企业会计准则第 14 号——收入》的规定，评估确定售后租回交易中的资产转让是否属于销售。

售后租回交易中的资产转让属于销售的，公司根据其他适用的企业会计准则对资产购买进行会计处理，并根据《企业会计准则第 21 号——租赁》对资产出租进行会计处理。

售后租回交易中的资产转让不属于销售的，公司不确认被转让资产，但确认一项与转让收入等额的金融资产，并按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》对该金融资产进行会计处理。

(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

本公司自 2021 年 1 月 1 日起执行经修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》(以下简称新租赁准则)。

公司作为承租人，根据新租赁准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新租赁准则与原准则的差异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。

执行新租赁准则对公司 2021 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2020 年 12 月 31 日	新租赁准则 调整影响	2021 年 1 月 1 日
使用权资产		90,407,315.27	90,407,315.27
一年内到期的非流动负债		59,305,425.75	59,305,425.75
租赁负债		24,423,360.37	24,423,360.37
其他流动资产	457,739,482.53	-4,035,652.01	453,703,830.52
预付账款	520,667,316.35	-2,642,877.14	518,024,439.21

四、税（费）项

(一) 主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	13%、9%、6%、3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%、5%、1%
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	25%、17%、16.5%、8.25%

(二) 不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率

永安新加坡	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	16.5%、8.25%[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。

五、企业合并、合并财务报表范围及在其他主体中的权益

(一) 合并范围增加

1. 报告期新纳入合并财务报表范围的子公司

本期无新纳入合并财务报表范围的子公司。

2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

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 3 号集合资产管理计划(以下简称永盈 3 号)	设立	2021 年 3 月	55,008,020.83 元	16.89%

(二) 合并范围减少

1. 本期无合并财务报表范围的子公司减少。

2. 本期无纳入合并财务报表范围的结构化主体减少

(三) 在子公司中的权益

1. 子公司的构成

基本情况

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
永安资本	杭州	杭州	商业	100.00		设立
中邦实业	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下企业合并
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
永安商贸	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. 纳入合并范围的结构化主体

截至 2021 年 6 月 30 日，永盈 1 号集合资产管理计划(以下简称永盈 1 号)和永盈 3 号因满足公司拥有实质权利、不能被其他投资者无条件罢免，且享有的可变回报为重大三个条件，故将上述结构化主体纳入公司合并财务报表范围。

(四) 在联营企业中的权益

1. 重要的联营企业

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
永安国富资产管理有限公司(以下简称永安国富公司)	杭州	杭州	金融业	31.35		权益法核算

2. 重要联营企业的主要财务信息

项目	永安国富	
	2021. 6. 30/2021 年 1-6 月	2020. 12. 31/2020 年度
流动资产	3,981,723,281.47	3,325,552,379.60
非流动资产	118,151,564.82	99,707,903.95
资产合计	4,099,874,846.29	3,425,260,283.55
流动负债	1,341,174,804.20	1,210,803,470.41
非流动负债	43,780,634.33	58,904,677.14
负债合计	1,384,955,438.53	1,269,708,147.55
少数股东权益		
归属于母公司所有者权益	2,714,919,407.76	2,155,552,136.00
按持股比例计算的净资产份额	851,233,638.54	675,850,075.90
对联营企业权益投资的账面价值	851,233,638.54	675,850,075.90

营业收入	3,623,601,711.49	4,280,356,532.96
净利润	759,367,271.76	735,407,409.27
归属于母公司所有者的净利润	759,367,271.76	735,407,409.27
其他综合收益		
综合收益总额	759,367,271.76	735,407,409.27
本期收到的来自联营企业的股利	62,708,000.00	

3. 不重要的联营企业的汇总财务信息

项 目	2021.6.30/ 2021年1-6月	2020.12.31/ 2020年度
联营企业		
投资账面价值合计	32,590,802.20	28,550,821.58
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	9,080,489.53	12,137,126.39
其他综合收益	-59,468.77	-402,003.96
综合收益总额	9,021,020.76	11,735,122.43

六、合并财务报表项目注释

(一) 合并资产负债表项目注释

1. 货币资金

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
库存现金	14,034.95	8,313.64
自有银行存款	3,156,893,091.80	1,869,350,605.88
期货保证金	21,876,961,163.42	17,653,414,687.86
证券经纪业务保证金	212,672,906.44	256,218,024.30
其他货币资金	519,389,357.01	232,949,598.73
合 计	25,765,930,553.62	20,011,941,230.41

(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 2,916,978.92	0.8321	2,427,218.16	HKD 3,035,532.39	0.8416	2,554,704.06
工商银行	JPY 783,825.00	0.0584	45,775.38	JPY 783,784.00	0.0632	49,535.15
工商银行	USD 2,837,633.84	6.4601	18,331,398.37	USD 853,110.02	6.5249	5,566,457.57
工商银行	RMB 1,949,031,420.21	1.0000	1,949,031,420.21	RMB 816,413,690.45	1.0000	816,413,690.45

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	SGD 14,747.46	4.8027	70,827.63	SGD 14,747.46	4.9314	72,725.62
工商银行	EUR			EUR		
光大银行	RMB 5,886,351.12	1.0000	5,886,351.12	RMB 5,530,334.42	1.0000	5,530,334.42
建设银行	RMB 30,247,425.80	1.0000	30,247,425.80	RMB 37,023,038.56	1.0000	37,023,038.56
交通银行	AUD			AUD		
交通银行	EUR 2,290,029.54	7.6862	17,601,625.05	EUR 397,065.59	8.0250	3,186,451.36
交通银行	HKD 381,815.76	0.8321	317,708.89	HKD 1,683,626.44	0.8416	1,416,940.01
交通银行	JPY 49,009,973.00	0.0584	2,862,182.42	JPY 26,221,810.00	0.0632	1,657,218.39
交通银行	RMB 5,396,571,053.30	1.0000	5,396,571,053.30	RMB 4,829,151,351.26	1.0000	4,829,151,351.26
交通银行	USD 16,103,356.15	6.4601	104,029,291.06	USD 9,987,930.40	6.5249	65,170,247.07
交通银行	GBP 43,862.83	8.9410	392,177.56	GBP 116,770.40	8.8903	1,038,123.89
民生银行	RMB 3,440,700,702.37	1.0000	3,440,700,702.37	RMB 3,081,179,357.39	1.0000	3,081,179,357.39
民生银行	HKD 6.80	0.8321	5.66	HKD 6.80	0.8416	5.72
民生银行	USD 24,044,328.79	6.4601	155,328,768.42	USD 16,085,612.89	6.5249	104,957,015.55
农业银行	RMB 1,525,337,053.96	1.0000	1,525,337,053.96	RMB 541,637,768.72	1.0000	541,637,768.72
浦发银行	RMB 3,192,896,765.78	1.0000	3,192,896,765.78	RMB 1,502,990,366.32	1.0000	1,502,990,366.32
兴业银行	RMB 3,441,966,963.09	1.0000	3,441,966,963.09	RMB 3,315,861,927.25	1.0000	3,315,861,927.25
兴业银行	HKD			HKD		
兴业银行	USD 60,302,004.93	6.4601	389,556,982.05	USD 89,420,807.64	6.5249	583,461,827.77
渣打银行	HKD 1,148,650.24	0.8321	955,791.86	HKD 1,088,643.69	0.8416	916,202.53
渣打银行	USD 3,221,584.76	6.4601	20,811,759.71	USD 891,086.54	6.5249	5,814,250.56
招商银行	RMB 5,437,444.40	1.0000	5,437,444.40	RMB 5,606,035.18	1.0000	5,606,035.18
招商银行	HKD 6,425,243.47	0.8321	5,346,445.09	HKD 2,552,219.47	0.8416	2,147,947.91
招商银行	USD 1,128,437.71	6.4601	7,289,820.45	USD 1,522,165.63	6.5249	9,931,978.52
中国银行	EUR 169,525.22	7.6862	1,303,004.75	EUR 2,169,515.97	8.0250	17,410,365.66
中国银行	HKD 133,005,778.58	0.8321	110,674,108.36	HKD 73,608,839.50	0.8416	61,949,199.32
中国银行	USD 71,150,929.45	6.4601	459,642,119.33	USD 37,158,790.49	6.5249	242,457,392.07
中国银行	JPY 47,828,551.00	0.0584	2,793,187.38	JPY 40,384,536.00	0.0632	2,552,302.68
中国银行	RMB 152,177,761.12	1.0000	152,177,761.12	RMB 60,607,112.22	1.0000	60,607,112.22
中国银行	SGD 500.47	4.8027	2,403.61	SGD 500.47	4.9314	2,468.02
中国银行	GBP 1,373.73	8.9410	12,282.52	GBP		
中信银行	RMB 6,171,602.92	1.0000	6,171,602.92	RMB 1,314,309,231.20	1.0000	1,314,309,231.20
平安银行	RMB 905,531,086.52	1.0000	905,531,086.52	RMB 507,174,255.24	1.0000	507,174,255.24
星展银行	RMB 522,919,362.16	1.0000	522,919,362.16	RMB 514,790,103.12	1.0000	514,790,103.12
星展银行	USD 50,388.81	6.4601	325,516.75	USD 1,200,334.78	6.5249	7,832,064.41
大华银行	USD 295,435.99	6.4601	1,908,546.04	USD 143,376.28	6.5249	935,515.89

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
大华银行	SGD 11,915.00	4.8027	57,224.17	SGD 12,000.00	4.9314	59,176.80
小计			21,876,961,163.42			17,653,414,687.86

(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 200,934,035.02	0.8321	167,197,210.54	HKD 214,340,681.35	0.8416	180,389,117.42
中国银行	RMB 4,497,066.48	1.0000	4,497,066.48	RMB 3,982,095.09	1.0000	3,982,095.09
中国银行	USD 5,077,850.98	6.4601	32,803,425.12	USD 10,781,807.92	6.5249	70,350,218.50
交通银行	HKD 8,678,287.41	0.8321	7,221,202.95	HKD 1,778,271.50	0.8416	1,496,593.29
交通银行	RMB 912,262.19	1.0000	912,262.19			
交通银行	USD 6,461.07	6.4601	41,739.16			
小计			212,672,906.44			256,218,024.30

(4) 使用受限的货币资金说明

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355,336,499.73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				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	1,043,379.51	100.00	6,485.45	0.62	1,036,894.06
合计	1,043,379.51	100.00	6,485.45	0.62	1,036,894.06

(续上表)

种类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	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

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	913,670.55			6,729,241.35		

业银行组合						
其他组合	129,708.96	6,485.45	5.00	130,984.21	6,548.32	5.00
小计	1,043,379.51	6,485.45	0.62	6,860,225.56	6,548.32	0.10

(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	1,043,379.51	6,485.45	1,036,894.06	6,860,225.56	6,548.32	6,853,677.24
小 计	1,043,379.51	6,485.45	1,036,894.06	6,860,225.56	6,548.32	6,853,677.24

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	1,476,044,343.47	300,697,185.23
减：减值准备	10,709,889.77	11,923,481.07
合 计	1,465,334,453.70	288,773,704.16

(2) 明细情况——按客户

项 目	期末数	期初数
个人	1,305,998,845.59	172,050,585.98
机构	170,045,497.88	128,646,599.25
减：减值准备	10,709,889.77	11,923,481.07
合 计	1,465,334,453.70	288,773,704.16

4. 应收货币保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	16,501,211,920.77	100.00	39,315,593.32	0.24	16,461,896,327.45
合 计	16,501,211,920.77	100.00	39,315,593.32	0.24	16,461,896,327.45

(续上表)

种 类	期初数		
	账面余额	坏账准备	账面价值

	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	15,847,388,115.54	100.00	29,932,435.44	0.19	15,817,455,680.10
合计	15,847,388,115.54	100.00	29,932,435.44	0.19	15,817,455,680.10

2) 采用组合计提坏账准备的应收货币保证金

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所和商业银行组合	15,714,900,054.34			15,248,739,406.74		
其他组合	786,311,866.43	39,315,593.32	5.00	598,648,708.80	29,932,435.44	5.00
小计	16,501,211,920.77	39,315,593.32	0.24	15,847,388,115.54	29,932,435.44	0.19

(2) 明细情况——按交易所/清算商

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,096,327,748.56	3,422,216,335.59
大连商品交易所	4,268,774,201.85	4,289,774,056.09
郑州商品交易所	2,343,246,212.16	1,976,831,487.78
中国金融期货交易所	4,447,315,922.41	4,138,518,349.95
上海国际能源交易中心	574,836,752.08	727,999,964.99
中国证券登记结算有限责任公司	735,134,262.58	519,275,158.03
香港期货交易所	244,284,038.62	154,257,111.73
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED	190,247,394.58	243,613,955.22
MAREX FINANCIAL Ltd	398,658,757.02	200,789,583.05
Philip Futures Pte Ltd	161,747,623.11	122,918,054.94
DBS Bank Ltd	4,082,528.28	18,862,746.37
R. J. O' Brien & Associates ,LLC	505,272.85	17,811,149.60
ADMIS SINGAPORE PTE LTD BANKING INSTRUCTION	18,220,147.67	6,625,162.85
GF Financial Markets (UK) Limited	8,965,181.52	3,384,308.72
Nissan Securities Co.,Ltd	2,555,046.57	2,453,718.61
CGS-CIMB Futures Sdn.Bhd.	5,238,971.65	873,631.70
Asia Pacific Exchange	540,858.79	546,018.59
VI INVESTMENT CORPORATION	158,022.00	163,348.85

KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd	15,449.46	15,795.26
其他	357,529.01	458,177.62
减值准备	39,315,593.32	29,932,435.44
合计	16,461,896,327.45	15,817,455,680.10

5. 应收质押保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	1,972,600,980.00	100.00			1,972,600,980.00
合计	1,972,600,980.00	100.00			1,972,600,980.00

(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	1,048,318,156.00	100.00			1,048,318,156.00
合计	1,048,318,156.00	100.00			1,048,318,156.00

2) 采用组合计提坏账准备的应收质押保证金

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收交易所组合	1,972,600,980.00			1,048,318,156.00		
小计	1,972,600,980.00			1,048,318,156.00		

(2) 明细情况——分交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	1,104,161,440.00	368,672,492.00
大连商品交易所	129,041,856.00	203,915,440.00
郑州商品交易所	398,685,748.00	140,938,784.00
上海国际能源交易中心	67,382,960.00	14,420,400.00
中国金融期货交易所	273,328,976.00	320,371,040.00
合计	1,972,600,980.00	1,048,318,156.00

(3) 质押物明细情况

质押物类别	质押品市值	折扣率	质押保证金
PTA	126,150,000.00	80.00%	100,920,000.00
短纤	70,880,000.00	80.00%	56,704,000.00
干制红枣	5,465,975.00	80.00%	4,372,780.00
国债 10 年期	240,516,220.00	80.00%	192,412,976.00
国债 5 年期	1,100,368,000.00	80.00%	880,294,400.00
国债 2 年期	302,955,400.00	80.00%	242,364,320.00
甲醇	25,391,010.00	80.00%	20,312,808.00
棉花一号	169,804,800.00	80.00%	135,843,840.00
白银	85,000,800.00	80.00%	68,000,640.00
沥青	108,350,600.00	80.00%	86,680,480.00
漂针浆	4,331,600.00	80.00%	3,465,280.00
铅	22,794,000.00	80.00%	18,235,200.00
铜	6,816,000.00	80.00%	5,452,800.00
橡胶	52,540,800.00	80.00%	42,032,640.00
20 号胶	47,173,000.00	80.00%	37,738,400.00
低硫燃料油	32,550,700.00	80.00%	26,040,560.00
原油	4,505,000.00	80.00%	3,604,000.00
丙烯	40,607,240.00	80.00%	32,485,792.00
焦炭	2,816,000.00	80.00%	2,252,800.00
液化石油气	16,734,080.00	80.00%	13,387,264.00
合 计	2,465,751,225.00		1,972,600,980.00

6. 存出保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	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	868,340.45	100.00	32,307.11	3.72	836,033.34

合 计	868,340.45	100.00	32,307.11	3.72	836,033.34
-----	------------	--------	-----------	------	------------

(续上表)

种 类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	1,246,320.40	100.00	32,620.00	2.62	1,213,700.40
合 计	1,246,320.40	100.00	32,620.00	2.62	1,213,700.40

2) 采用组合计提坏账准备的存出保证金

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所和商业 银行组合	222,198.16			593,920.50		
其他组合	646,142.29	32,307.11	5.00	652,399.90	32,620.00	5.00
小 计	868,340.45	32,307.11	3.72	1,246,320.40	32,620.00	2.62

7. 应收账款

(1) 明细情况

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	124,127,394.75	100.00	6,322,698.30	5.09	117,804,696.45
其中：应收佣金	3,567,300.29	2.87	292,919.19	8.21	3,274,381.10
应收货款	120,560,094.46	97.13	6,029,779.11	5.00	114,530,315.35
合 计	124,127,394.75	100.00	6,322,698.30	5.09	117,804,696.45

(续上表)

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

(2) 采用组合计提坏账准备的应收账款

账 龄	期末数
-----	-----

	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1 年以内	123,999,713.89	6,199,985.70	5.00
1-2 年			
2-3 年	7,097.52	2,129.26	30.00
3-4 年			
4 年以上	120,583.34	120,583.34	100.00
小 计	124,127,394.75	6,322,698.30	5.09

(续上表)

账 龄	期初数		
	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
2-3 年			
3-4 年			
4 年以上	120,583.34	120,583.34	100.00
小 计	52,702,744.35	2,804,443.35	5.32

(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	
按组合计提坏账准备	2,804,443.35	3,529,665.90		-11,410.95				6,322,698.30
小 计	2,804,443.35	3,529,665.90		-11,410.95				6,322,698.30

(4) 应收账款金额前 5 名情况

单位名称	账面余额	占应收账款余额的比例(%)	坏账准备
第一名	17,417,665.72	14.03	870,883.29
第二名	16,084,565.25	12.96	804,228.26
第三名	10,446,224.53	8.42	522,311.23
第四名	9,295,593.10	7.49	464,779.66
第五名	6,983,401.69	5.63	349,170.08
小 计	60,227,450.29	48.53	3,011,372.52

8. 应收款项融资

项 目	期末数					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值 变动	账面价值	减值准备
银行承兑汇票	95,491,034.89				95,491,034.89	
合 计	95,491,034.89				95,491,034.89	

(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
银行承兑汇票	49,147,244.81				49,147,244.81	
合 计	49,147,244.81				49,147,244.81	

9. 预付款项

(1) 账龄分析

账 龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	1,406,371,963.99	99.09		1,406,371,963.99
1-2年	12,843,541.62	0.90		12,843,541.62
2-3年	40,920.03	0.01		40,920.03
3-4年	16,000.00	0.00		16,000.00
合 计	1,419,272,425.64	100.00		1,419,272,425.64

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	520,600,237.72	99.99		520,600,237.72
1-2年	51,078.63	0.01		51,078.63
2-3年	16,000.00	0.00		16,000.00
3-4年				
合 计	520,667,316.35	100.00		520,667,316.35

(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(%)
第一名	142,130,183.51	10.01

第二名	81,380,236.09	5.73
第三名	75,688,729.56	5.33
第四名	67,034,737.09	4.72
第五名	46,521,780.28	3.28
小 计	412,755,666.53	29.08

10. 应收结算担保金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	84,822,043.30	100.00			84,822,043.30
合 计	84,822,043.30	100.00			84,822,043.30

(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	69,440,425.56	100.00			69,440,425.56
合 计	69,440,425.56	100.00			69,440,425.56

2) 采用组合计提坏账准备的应收结算担保金

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所组合	84,822,043.30			69,440,425.56		
小 计	84,822,043.30			69,440,425.56		

(2) 明细情况——分客商

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	70,663,813.27	55,293,060.51
中国证券登记结算有限责任公司	10,924,589.05	10,882,875.08
Asia Pacific Exchange	3,233,640.98	3,264,489.97
合 计	84,822,043.30	69,440,425.56

11. 应收风险损失款

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
1-2 年	676,263.93	100.00		676,263.93				
2-3 年								
合 计	676,263.93	100.00		676,263.93	676,263.93	100.00		676,263.93

12. 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	91,200,510.12	8.21	4,767,544.56	5.23	86,432,965.56
其中：其他应收款	91,200,510.12	8.21	4,767,544.56	5.23	86,432,965.56
按组合计提坏账准备	1,019,447,613.75	91.79	54,075,617.67	5.30	965,371,996.08
其中：应收利息	111,533.21	0.01			111,533.21
应收股利	24,599.31	0.00			24,599.31
其他应收款	1,019,311,481.23	91.78	54,075,617.67	5.31	965,235,863.56
合 计	1,110,648,123.87	100.00	58,843,162.23	5.30	1,051,804,961.64

(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	138,224,665.59	29.28	1,149,528.63	0.83	137,075,136.96
其中：其他应收款	138,224,665.59	29.28	1,149,528.63	0.83	137,075,136.96
按组合计提坏账准备	333,813,398.46	70.72	20,188,476.95	6.05	313,624,921.51
其中：应收利息	1,503,283.61	0.32			1,503,283.61
应收股利					
其他应收款	332,310,114.85	70.40	20,188,476.95	6.08	312,121,637.90
合 计	472,038,064.05	100.00	21,338,005.58	4.52	450,700,058.47

2) 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
BOCHK short term cash mgt fund	38,768,537.52			理财产品认购款
境外证券业务清算及认购款	25,060,876.39			证券业务清算及认购款
客户 a	12,922,845.84	646,142.29	5.00	该客户以在本公司享有的权益等为担保
客户 b	9,847,208.53	492,360.43	5.00	该客户以在本公司享有的权益等为担保
客户 c	3,629,041.84	3,629,041.84	100.00	预计无法收回
凯普乐5号证券投资私募基金	972,000.00			理财产品清算款
小 计	91,200,510.12	4,767,544.56	5.23	

3) 采用组合计提坏账准备的其他应收款

账 龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收利息	111,533.21		
应收股利	24,599.31		
其他应收款账龄组合	1,019,311,481.23	54,075,617.67	5.31
其中：1 年以内	1,009,330,242.95	50,466,512.15	5.00
1-2 年	5,403,664.66	1,080,732.93	20.00
2-3 年	1,006,399.32	301,919.79	30.00
3-4 年	2,241,202.52	896,481.02	40.00
4 年以上	1,329,971.78	1,329,971.78	100.00
小 计	1,019,447,613.75	54,075,617.67	5.30

(续上表)

账 龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收利息	1,503,283.61		
应收股利			
其他应收款账龄组合	332,310,114.85	20,188,476.95	6.08
其中：1 年以内	324,913,319.12	16,245,665.95	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

合 计	333,813,398.46	20,188,476.95	6.05
-----	----------------	---------------	------

(2) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合 计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期信 用损失(未发生信 用减值)	整个存续期预期 信用损失(已发生 信用减值)	
期初数	17,395,194.58	415,571.63	3,527,239.37	21,338,005.58
期初数在本期	---	---	---	
--转入第二阶段	-317,074.69	317,074.69		
--转入第三阶段		-122,613.70	122,613.70	
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提	34,542,235.61	471,727.62	2,509,456.26	37,523,419.49
本期收回				
本期转回				
本期核销				
其他变动	-15,340.63	-1,027.31	-1,894.90	-18,262.84
期末数	51,605,014.87	1,080,732.93	6,157,414.43	58,843,162.23

(3) 应收股利明细情况

单位名称	期末数	期初数
其他零星股利	24,599.31	
合 计	24,599.31	

(4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余 额的比例(%)	坏账准备
第一名	场外业务应收款	226,489,981.10	1 年以内	20.40	11,324,499.05
第二名	场外业务应收款	219,000,000.78	1 年以内	19.72	10,950,000.04
第三名	场外业务应收款	92,300,000.00	1 年以内	8.31	4,615,000.00
第四名	场外业务应收款	69,395,804.06	1 年以内	6.25	3,469,790.20
第五名	场外业务应收款	60,257,901.75	1 年以内	5.43	3,012,895.09
小 计		667,443,687.69		60.11	33,372,184.38

13. 存货

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	1,722,005,340.15	45,508,217.06	1,676,497,123.09
发出商品	230,382,566.82	7,994,759.20	222,387,807.62
合 计	1,952,387,906.97	53,502,976.26	1,898,884,930.71

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	1,450,910,879.36	17,096,345.48	1,433,814,533.88
发出商品	53,828,586.75	124,008.06	53,704,578.69
合 计	1,504,739,466.11	17,220,353.54	1,487,519,112.57

(2) 存货跌价准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少		期末数
			转 回	转 销	
存货	17,220,353.54	131,874,091.89	95,591,469.17		53,502,976.26
小 计	17,220,353.54	131,874,091.89	95,591,469.17		53,502,976.26

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	4,681,156,410.12	3,948,448,688.50
其中：债务工具投资	530,783.09	1,886,169.06
权益工具投资	3,863,454,619.51	3,651,359,979.42
衍生金融资产	817,171,007.52	295,202,540.02
合 计	4,681,156,410.12	3,948,448,688.50

(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2021年6月30日，公司持有的期货合约浮盈为13,234,015.09元，浮亏为39,243,336.86元。截至2020年12月31日，本公司持有的期货合约浮盈为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			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	25,780,900.94			战略投资
合计	25,780,900.94			

(续上表)

项目	期初数			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	25,838,630.14			战略投资
合计	25,838,630.14			

16. 长期股权投资

(1) 明细情况

项目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	883,824,440.74		883,824,440.74
合计	883,824,440.74		883,824,440.74

(续上表)

项目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	704,400,897.48		704,400,897.48
合计	704,400,897.48		704,400,897.48

(2) 对联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
玉皇山南公司	19,535,956.78			4,541,780.44	45,055.61
永安国富公司	675,850,075.90			238,091,562.64	
OSTC Yongan Trading Co., Limited	9,014,864.80			4,538,709.09	-104,524.38
合计	704,400,897.48			247,172,052.17	-59,468.77

(续上表)

被投资	本期增减变动	期末数	减值准备
-----	--------	-----	------

单位	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		期末余额
玉皇山南公司	-549,411.22				23,573,381.61	
永安国富公司		62,708,000.00			851,233,638.54	
OSTC Yongan Trading Co., Limited		4,431,628.93			9,017,420.59	
合计	-549,411.22	67,139,628.93			883,824,440.74	

17. 期货会员资格投资

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

18. 投资性房地产

(1) 明细情况

账面原值

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	140,632,185.56			140,632,185.56
土地使用权	247,084,504.10			247,084,504.10
小计	387,716,689.66			387,716,689.66

累计折旧和累计摊销

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	7,670,058.80	3,088,556.28		10,758,615.08
土地使用权	40,998,094.08	2,260,866.42		43,258,960.50
小计	48,668,152.88	5,349,422.70		54,017,575.58

账面价值

项目	期初数	期末数
房屋及建筑物	132,962,126.76	129,873,570.48
土地使用权	206,086,410.02	203,825,543.60
合计	339,048,536.78	333,699,114.08

(2) 期末无投资性房地产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的投资性房地产的情况说明如下：

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
福州中盛大厦7层701室	8,980,669.14	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	104,818.91	因历史遗留原因至今未办理不动产权证

小 计	9,085,488.05	
-----	--------------	--

19. 固定资产

(1) 明细情况

项 目	房屋及建筑物	电子设备及其他	运输工具	合 计
账面原值				
期初数	116,791,990.03	77,477,638.95	15,503,730.37	209,773,359.35
本期增加金额		2,601,220.15	377,140.82	2,978,360.97
购置		2,601,220.15	377,140.82	2,978,360.97
本期减少金额		845,562.26		845,562.26
处置或报废		845,562.26		845,562.26
外币报表折算差额		-91,717.38		-91,717.38
期末数	116,791,990.03	79,141,579.46	15,880,871.19	211,814,440.68
累计折旧				
期初数	35,738,009.73	62,158,914.48	13,534,751.37	111,431,675.58
本期增加金额	1,828,276.86	2,997,358.34	355,296.69	5,180,931.89
计提	1,828,276.86	2,997,358.34	355,296.69	5,180,931.89
本期减少金额		816,520.32		816,520.32
处置或报废		816,520.32		816,520.32
外币报表折算差额		-73,873.75		-73,873.75
期末数	37,566,286.59	64,265,878.75	13,890,048.06	115,722,213.40
账面价值				
期末账面价值	79,225,703.44	14,875,700.71	1,990,823.13	96,092,227.28
期初账面价值	81,053,980.30	15,318,724.47	1,968,979.00	98,341,683.77

(2) 期末中无固定资产用于担保。

(3) 未办妥产权证书的固定资产的情况说明

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
浙江协作大厦 6-8 楼（不含 8 楼 801-805 室）	510,406.41	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	7,143,432.92	未通过房地产主管部门的竣工验收备案
小计	7,653,839.33	

20. 使用权资产

项 目	房屋及建筑物	合 计
成本		
期初数	90,407,315.27	90,407,315.27

本期增加金额	16,529,165.14	16,529,165.14
本期减少金额		
期末数	106,936,480.41	106,936,480.41
累计折旧		
期初数		
本期增加金额	15,313,386.83	15,313,386.83
计提	15,313,386.83	15,313,386.83
本期减少金额		
期末数	15,313,386.83	15,313,386.83
账面价值		
期末账面价值	91,623,093.58	91,623,093.58
期初账面价值	90,407,315.27	90,407,315.27

21. 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	14,831,417.62	55,599,643.32	70,431,060.94
本期增加金额		942,014.26	942,014.26
购置		942,014.26	942,014.26
本期减少金额		1,892,497.34	1,892,497.34
处置		1,892,497.34	1,892,497.34
外币报表折算差额		-20,608.56	-20,608.56
期末数	14,831,417.62	54,628,551.68	69,459,969.30
累计摊销			
期初数	2,460,938.88	44,014,928.80	46,475,867.68
本期增加金额	185,392.74	2,913,402.25	3,098,794.99
计提	185,392.74	2,913,402.25	3,098,794.99
本期减少金额		1,892,497.34	1,892,497.34
处置		1,892,497.34	1,892,497.34
外币报表折算差额		-18,703.88	-18,703.88
期末数	2,646,331.62	45,017,129.83	47,663,461.45
账面价值			

期末账面价值	12,185,086.00	9,611,421.85	21,796,507.85
期初账面价值	12,370,478.74	11,584,714.52	23,955,193.26

(2) 期末无无形资产用于担保。

22. 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	603,550,091.12	150,887,522.78	600,590,370.23	150,147,592.56
存货跌价准备	52,972,435.06	13,243,108.77	12,627,551.60	3,156,887.90
坏账准备	61,629,741.46	15,407,435.36	21,526,904.91	5,381,726.24
期货风险准备金	7,508,020.48	1,877,005.12	7,508,020.48	1,877,005.12
公允价值变动浮亏	704,394,372.10	176,098,593.03	351,983,171.79	87,995,792.95
应付期货投资者保障基金	479,974.64	119,993.66	780,245.96	195,061.49
其他	15,371,700.68	3,842,925.17	14,726,351.89	3,681,587.97
合 计	1,445,906,335.54	361,476,583.89	1,009,742,616.86	252,435,654.23

(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	908,780,916.48	227,195,229.12	755,230,001.14	188,807,500.29
合 计	908,780,916.48	227,195,229.12	755,230,001.14	188,807,500.29

(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	29,722,683.85	25,033,368.92
可抵扣亏损	19,804,355.04	16,181,529.04
小 计	49,527,038.89	41,214,897.96

23. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	41,433,898.69	131,877,227.80
长期待摊费用	10,820,178.51	11,508,050.85
待摊费用	12,099,814.65	18,222,067.00

买入返售金融资产	13,922,044.92	7,100,000.00
预缴所得税	460,694.66	11,823,446.33
其他	3,005,381.57	189,360.00
合 计	81,742,013.00	180,720,151.98

24. 短期借款

项 目	期末数	期初数
质押借款[注]	41,605,000.00	
质押借款利息	11,395.78	
保证借款本金	2,634,669,310.00	1,110,216,510.00
保证借款应付利息	6,323,075.01	3,844,982.89
进口押汇本金	339,576,235.47	123,276,146.66
进口押汇应付利息	974,742.05	285,074.19
保理借款	9,295,593.10	
合 计	3,032,455,351.41	1,237,622,713.74

[注]截至 2021 年 6 月 30 日，新永安证券根据客户协议授权，以客户股票作为质押物取得借款 41,605,000.00 元

25. 代理买卖证券款

项 目	期末数	期初数
经纪业务	209,236,928.29	244,053,509.54
其中：个人	133,834,982.01	164,258,155.23
机构	75,401,946.28	79,795,354.31
合 计	209,236,928.29	244,053,509.54

26. 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	124,514	11,077,015,285.19	119,888	10,292,916,318.69
法人	7,710	25,018,384,229.16	7,189	20,254,277,887.78
非结算客户	1	50,493,734.03	2	112,323,836.92
合 计	132,225	36,145,893,248.38	127,079	30,659,518,043.39

27. 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	22	1,471,250,596.00	17	857,391,364.00
合 计	22	1,471,250,596.00	17	857,391,364.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数
上海期货交易所	990,577,760.00
郑州商品交易所	102,522,260.00
中国金融期货交易所	273,328,976.00
大连商品交易所	83,168,800.00
上海国际能源交易中心	21,652,800.00
合 计	1,471,250,596.00

28. 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	935,960,782.27	715,697,952.48
其中：衍生金融工具	582,922,444.33	271,358,561.32
融券	353,038,337.94	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	321,337,022.11	43,006,240.09
其中：结构化主体其他投资者享有的权益	321,337,022.11	43,006,240.09
合 计	1,257,297,804.38	758,704,192.57

29. 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	256,567,983.48	15,111,716.42		271,679,699.90
合 计	256,567,983.48	15,111,716.42		271,679,699.90

(2) 本期风险准备金计提方法和比例说明

按本期母公司代理手续费净收入的 5% 计提期货风险准备金。

(3) 本期动用风险准备金说明

本期无动用风险准备金的情况。

30. 应付票据

项 目	期末数
银行承兑汇票	50,000,000.00
合 计	50,000,000.00

31. 应付账款

项 目	期末数	期初数
货款	187,744,458.38	92,533,817.44
小 计	187,744,458.38	92,533,817.44

32. 预收账款

项 目	期末数	期初数
预收房租	7,338,417.86	7,217,084.50
合 计	7,338,417.86	7,217,084.50

33. 合同负债

项 目	期末数	期初数
预收货款	1,021,402,930.32	478,838,478.88
投资咨询费	346,626.63	317,895.92
基金销售业务收入	1,697,162.20	66,094.34
合 计	1,023,446,719.15	479,222,469.14

34. 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	827,060.73	508,084.85	826,372.45	508,773.13
合 计	827,060.73	508,084.85	826,372.45	508,773.13

(2) 本期计提方法和比例说明

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

35. 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	848,568,031.14	383,235,165.57	392,952,720.62	838,850,476.09
离职后福利—设定提存计划	28,800,000.00	26,481,834.81	40,211,628.51	15,070,206.30
辞退福利		67,042.16	67,042.16	
合 计	877,368,031.14	409,784,042.54	433,231,391.29	853,920,682.39

(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	816,058,926.53	338,444,852.50	336,264,017.83	818,239,761.20
职工福利费	8,400.00	9,257,217.81	9,265,617.81	
社会保险费	18,586,667.26	17,648,004.46	26,767,983.37	9,466,688.35
其中：基本医疗保险费	586,652.26	8,103,313.48	8,232,536.61	457,429.13
工伤保险	18,000,015.00	9,022,383.80	18,022,383.80	9,000,015.00
生育保险费		162,357.24	153,113.02	9,244.22
补充医疗保险		134,689.80	134,689.80	
其 他		225,260.14	225,260.14	
住房公积金	796,909.00	12,358,078.27	12,434,444.27	720,543.00
工会经费和职工教育经费	13,117,128.35	5,527,012.53	8,220,657.34	10,423,483.54
小 计	848,568,031.14	383,235,165.57	392,952,720.62	838,850,476.09

(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		11,660,777.62	11,013,681.88	647,095.74
失业保险费		421,057.19	397,946.63	23,110.56
补充养老保险	28,800,000.00	14,400,000.00	28,800,000.00	14,400,000.00
小 计	28,800,000.00	26,481,834.81	40,211,628.51	15,070,206.30

36. 应交税费

项 目	期末数	期初数
企业所得税	199,331,299.24	133,414,878.61
增值税	45,534,233.91	11,614,507.91
代扣代缴个人所得税	2,914,465.65	2,582,678.04

城市维护建设税	594,482.87	849,843.39
教育费附加	254,778.33	364,218.55
地方教育附加	169,960.80	242,812.36
印花税	310,557.60	519,590.80
代扣代缴税金	182,854.45	2,404,174.65
房产税		3,942,785.91
土地使用税		28,540.00
商品及服务税		215,153.62
合 计	249,292,632.85	156,179,183.84

37. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付股利		157,200,000.00
其他应付款	2,810,921,419.85	1,173,744,910.46
合 计	2,810,921,419.85	1,330,944,910.46

(2) 应付股利

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

(3) 其他应付款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付佣金	1,236,966.13	1,153,012.55
经营层风险金	13,112,207.20	9,044,635.20
交易所质押款	501,350,384.00	190,926,792.00
场外业务应付款	2,232,041,668.93	924,121,865.04
暂估工程款	8,072,259.95	14,107,034.90
其 他	55,107,933.64	34,391,570.77
合 计	2,810,921,419.85	1,173,744,910.46

2) 其他应付款金额前 5 名情况

单位名称	期末数	款项性质
------	-----	------

第一名	408,640,551.13	场外业务应付款
第二名	296,163,488.00	交易所质押款
第三名	167,000,000.00	场外业务应付款
第四名	137,000,000.00	场外业务应付款
第五名	115,000,000.00	场外业务应付款
小 计	1,123,804,039.13	

38. 预计负债

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
未决诉讼	414,040.85	418,767.91
合 计	414,040.85	418,767.91

(2) 其他说明

2015年1月，新永安期货收到来自 Alterra International Holdings Limited 公司（以下简称 ALterra 公司）的律师函，要求赔偿其客户翁超颖诈骗的 588,600.00 欧元。2016年10月，Alterra 公司在塞浦路斯当地法院对新永安期货和交通银行提起诉讼，要求赔偿上述款项。截至本期末，新永安公司已聘请香港律师和塞浦路斯当地律师进行处理，并就此事在 2017 年度计提了预计负债折合人民币 417,623.47 元，期末余额的变化系外币报表折算。

39. 租赁负债

项 目	期末数
尚未支付的租赁付款额	101,510,835.26
减：未确认融资费用	10,122,225.72
合 计	91,388,609.54

40. 其他负债

项 目	期末数	期初数
次级债券	307,828,356.16	301,378,356.16
待转销项税额	123,660,450.99	70,350,966.58
拆入资金	67,032,382.60	60,042,907.25
合 计	498,521,189.75	431,772,229.99

41. 股本

(1) 增减变动

项目	期初数	本期增减变动					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	1,310,000,000.00						1,310,000,000.00

(2) 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	陆建强	主要从事证券经纪业务、投资银行业务、资产管理业务、证券自营业务、证券信用业务以及研究业务。	资本市场服务	35.89 亿元
浙江省产业基金有限公司	顾祥寿	实业投资，投资管理。	其他金融业	200 亿元
浙江东方金融控股集团股份有限公司	金朝萍	资产管理；实业投资、私募股权投资及投资管理；企业管理咨询。	其他金融业	28.96 亿元
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 亿元
浙江省经济建设投资有限公司	麻亚峻	经济建设项目的投资、开发、经营，房地产的投资；金属材料，化工原料及产品(不含危险品)，建筑材料，纺织原料，橡胶及制品，木材，胶合板，造纸原料，矿产品，机电设备的销售。	商务服务业	15 亿元

42. 资本公积

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	1,489,444,325.01			1,489,444,325.01
其他资本公积	12,177,464.20		549,411.22	11,628,052.98
合计	1,501,621,789.21		549,411.22	1,501,072,377.99

43. 其他综合收益

项目	期初数	期初调整数	本期发生额	
			本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益
将重分类进损益的其他综合收益	-14,700,285.08		-10,664,909.19	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-1,220,053.50		45,055.61	
外币财务报表折算差额	-13,480,231.58		-10,709,964.80	
其他综合收益合计	-14,700,285.08		-10,664,909.19	

(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		-10,664,909.19		-25,365,194.27
其中：权益法下可转损益的其他综合收益		45,055.61		-1,174,997.89
外币财务报表折算差额		-10,709,964.80		-24,190,196.38
其他综合收益合计		-10,664,909.19		-25,365,194.27

44. 盈余公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	489,739,107.05			489,739,107.05
合 计	489,739,107.05			489,739,107.05

45. 一般风险准备

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
一般风险准备	549,630,120.98			549,630,120.98
合 计	549,630,120.98			549,630,120.98

46. 未分配利润

项 目	金 额
期初未分配利润	3,961,754,712.82
调整期初未分配利润合计数（调增+， 调减-）	
调整后期初未分配利润	3,961,754,712.82
加：本期归属于母公司所有者的净利润	739,645,964.41
期末未分配利润	4,701,400,677.23

（二）合并利润表项目注释

1. 手续费收入

（1）明细情况

项 目	本期数	上年同期数
经纪手续费净收入	95,065,028.54	71,749,088.28
交易所减收手续费收入	272,856,239.59	152,439,548.63
资产管理业务收入	5,973,652.28	30,052,884.30

投资咨询收入	868,253.58	1,196,870.48
基金销售业务收入	48,116,568.94	20,577,940.62
合计	422,879,742.93	276,016,332.31

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部		346,442,058.06
香港特别行政区[注]		26,417,722.73
浙江省(不含杭州本部)	15	20,010,564.60
辽宁省	3	2,597,574.75
山东省	7	5,264,482.85
北京市	1	2,311,127.54
广东省	2	3,718,391.85
上海市	1	1,361,812.72
福建省	2	2,079,499.31
河南省	1	2,020,731.82
江苏省	2	1,915,618.38
吉林省	1	1,517,671.35
天津市	1	857,666.37
重庆市	1	938,916.58
河北省	2	1,266,626.86
湖北省	1	769,836.08
四川省	1	1,300,551.57
湖南省	1	1,014,028.92
江西省	1	710,567.21
陕西省	1	364,293.38
合计	44	422,879,742.93

[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
利息收入	255,787,318.68	296,951,486.77
其中：境内保证金存款利息	206,135,779.90	275,582,977.83

收入		
境外利息收入	19,955,810.42	17,643,426.65
境内其他利息收入	29,695,728.36	3,725,082.29
利息支出	72,731,287.09	42,419,174.45
合 计	183,056,031.59	254,532,312.32

3. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	247,172,052.17	84,842,316.48
金融工具持有期间的投资收益	382,349,018.29	245,249,995.78
处置金融工具取得的投资收益	134,004,749.34	405,080,207.54
减：结构化主体其他投资者享有的收益	7,574,223.08	-9,381,719.66
合 计	755,951,596.72	744,554,239.46

4. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数
政府补助	5,143,786.11	5,865,833.06
个税手续费返还	1,099,334.53	1,880,618.29
合 计	6,243,120.64	7,746,451.35

本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注六(四)之政府补助说明。

5. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产(以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)	135,920,415.09	-79,848,059.22
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	443,502,056.48	119,301,545.19
交易性金融负债(以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债)	-358,790,093.22	-54,998,854.50
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	-311,055,379.90	-54,998,854.50
合 计	-222,869,678.13	-134,846,913.72

6. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
销售货物收入	15,516,932,559.13	9,939,995,024.09

租赁收入	10,994,080.06	5,494,734.77
交易所课题费、活动费等收入	7,926,010.84	
其他	3,522,906.55	3,307,454.74
合计	15,539,375,556.58	9,948,797,213.60

7. 资产处置收益

项目	本期数	上年同期数
非流动资产处置收益	439.84	70,966.36
合计	439.84	70,966.36

8. 税金及附加

项目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	1,487,780.53	911,389.07
教育费附加	637,567.38	390,595.39
地方教育附加	425,153.50	260,312.58
印花税	1,856,874.80	1,034,432.80
房产税	1,963,550.88	385,852.52
土地使用税	21,232.91	13,474.55
车船税	10,200.00	18,716.50
合计	6,402,360.00	3,014,773.41

9. 业务及管理费

业务及管理费金额前 10 名明细项目情况

项目	本期数	上年同期数
工资薪金和社会保险费等	409,784,042.54	321,805,684.56
仓储费	41,614,735.67	43,757,709.46
租赁费	20,641,180.93	20,159,965.14
运输费	12,665,618.24	6,899,312.87
通讯费	6,379,853.56	6,112,702.18
业务招待费	5,382,904.42	3,336,737.11
IB 费用	5,183,957.92	3,427,010.49
折旧费	5,180,931.89	6,369,774.60

电子设备运转费	5,140,391.13	4,845,624.76
货运代理费	5,131,122.13	3,214,511.49
小 计	517,104,738.43	419,929,032.66

10. 信用减值损失

项 目	本期数	上年同期数
融出资金减值损失	-1,078,998.77	6,458,133.51
坏账损失	41,053,085.39	7,707,394.22
存出保证金减值损失	55.34	-169.89
结算备付金减值损失	11.05	68,810.38
应收货币保证金减值损失	9,719,189.65	6,716,324.70
合 计	49,693,342.66	20,950,492.92

11. 其他资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
存货跌价损失	131,874,091.89	418,046,162.62
合 计	131,874,091.89	418,046,162.62

12. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
销售货物成本	15,109,439,046.86	9,742,824,659.56
租赁成本	5,349,422.70	2,771,239.16
其他	456,835.51	
合 计	15,115,245,305.07	9,745,595,898.72

13. 营业外收入

项 目	本期数	上年同期数
合同违约金收入	104,473,287.64	117,976,522.26
非流动资产毁损报废利得	6.49	59.26
其他	16,546.06	0.61
合 计	104,489,840.19	117,976,582.13

14. 营业外支出

项 目	本期数	上年同期数
捐赠支出	816,800.00	2,135,600.00
残疾人就业保障基金		1,988.88
赔偿款	908,888.97	
非流动资产毁损报废损失	19,533.90	9,256.77
地方水利建设基金	1,547.52	1,542.49
罚款及滞纳金	1,959.72	8,832.96
其 他	2,285.79	25,292.05
合 计	1,751,015.90	2,182,513.15

15. 所得税费用

项目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	225,880,654.56	137,154,863.34
递延所得税费用	-70,653,200.83	-20,543,573.62
合 计	155,227,453.73	116,611,289.72

16. 其他综合收益的税后净额

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

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
客户保证金净额	5,495,928,946.99	3,464,075,329.86
违约金及保险赔付收入	104,473,287.64	117,976,522.26
保证金及定期存款减少		240,184,553.37
往来款净额	614,172,253.51	241,131,109.49
收到的税费返还	1,214,403.24	
代理买卖证券款净流入		88,983,859.65
其他现金流入	31,111,675.74	16,705,974.61
合计	6,246,900,567.12	4,169,057,349.24

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	663,377,547.23	2,622,306,712.12
保证金及定期存款等增加	113,212,611.02	
融出资金	1,175,347,158.24	178,546,802.43
应收结算担保金和结算备付金增加	9,564,771.69	17,676,225.04
其他现金流出	1,808,790.04	5,162,880.77
代理买卖证券款净流出	34,816,581.25	
合 计	1,998,127,459.47	2,823,692,620.36

3. 收到其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
对外拆借款收回		4,160,214.71
合 计		4,160,214.71

4. 支付其他与投资活动有关的现金

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

5. 收到其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
纳入合并范围的结构化主体收到的现金	270,756,558.94	
借款保证金的减少		65,000,000.00
合计	270,756,558.94	65,000,000.00

6. 支付其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
纳入合并范围的结构化主体清算支付的现金		4,095,593.31
使用权资产的增加	10,765,910.97	

合计	10,765,910.97	4,095,593.31
----	---------------	--------------

7. 现金流量表补充资料

补充资料	2021年1-6月	2020年1-6月
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	739,645,964.41	410,371,541.96
加: 提取期货风险准备金	15,111,716.42	9,687,448.23
资产减值准备	181,567,434.55	438,996,655.54
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	10,530,354.59	9,141,013.76
使用权资产折旧摊销	15,313,386.83	
无形资产摊销	3,098,794.99	5,570,263.29
长期待摊费用摊销	2,387,627.28	1,881,279.67
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)	-439.84	-70,966.36
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	19,527.41	9,197.51
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	222,869,678.13	134,846,913.72
财务费用(收益以“-”号填列)	47,112,548.54	19,457,359.19
投资损失(收益以“-”号填列)	-239,597,829.09	-94,224,036.14
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	-109,040,929.66	-24,496,175.40
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	38,387,728.83	3,944,869.83
存货的减少(增加以“-”号填列)	-543,239,910.03	-917,090,192.52
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-4,117,971,588.54	-2,170,368,799.97
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	7,889,409,056.63	4,065,379,779.32
经营活动产生的现金流量净额	4,155,603,121.45	1,893,036,151.63
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	25,187,419,491.02	16,838,851,834.12
减: 现金的期初余额	19,546,642,778.83	15,969,616,524.14

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	5,640,776,712.19	869,235,309.98

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	期末数	期初数
1) 现金	25,187,419,491.02	19,546,642,778.83
其中：库存现金	14,034.95	8,313.64
可随时用于支付的银行存款	25,007,816,282.50	19,450,141,319.34
可随时用于支付的其他货币资金	179,589,173.57	96,493,145.85
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	25,187,419,491.02	19,546,642,778.83
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

2021年6月末、2020年末，货币资金中定期存款、保函保证金、信用证保证金和场外衍生品保证金等合计金额分别为578,511,062.60元和465,298,451.58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	账面价值	受限原因
货币资金	355,336,499.73	融券保证金、保函保证金、信用证保证金和场外衍生品保证金等
应收账款	9,295,593.10	保理
存货	391,891,225.82	质押
交易性金融资产	535,676,425.10	融券担保品
合 计	1,292,199,743.75	

2. 外币货币性项目

项 目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
货币资金			2,005,612,119.12
其中：美元	238,033,525.62	6.4601	1,537,720,378.86
港币	496,102,999.77	0.8321	412,807,306.11
新加坡元	6,091,437.63	4.8027	29,255,347.51
欧元	2,506,961.21	7.6862	19,269,005.25
日元	103,467,860.00	0.0584	6,042,523.02
英镑	57,885.96	8.9410	517,558.37
结算备付金			129,682.54
其中：美元	19,979.00	6.4601	129,066.34
港币	740.53	0.8321	616.20
融出资金			1,469,466,485.19
其中：美元	505,596.10	6.4601	3,266,201.37
港币	1,762,048,171.88	0.8321	1,466,200,283.82
应收货币保证金			969,371,803.92
其中：美元	113,577,509.48	6.4601	733,722,068.99
港币	250,800,731.22	0.8321	208,691,288.45
新加坡元	20,019.53	4.8027	96,147.80
欧元	1,417,105.78	7.6862	10,892,158.45
日元	60,199,492.00	0.0584	3,515,650.33
英镑	197,138.99	8.9410	1,762,619.71
马来西亚币	16,441,121.61	0.6427	10,566,708.86
韩元	21,579,539.00	0.0058	125,161.33
存出保证金			868,208.16
其中：美元	100,000.00	6.4601	646,010.00
港币	267,033.00	0.8321	222,198.16
应收账款			57,827,167.39
其中：美元	8,951,435.33	6.4601	57,827,167.39
应收结算担保金			3,230,050.00
其中：美元	500,000.00	6.4601	3,230,050.00
其他应收款			89,352,966.56
其中：美元	3,548,163.26	6.4601	22,921,489.48
港币	79,139,528.01	0.8321	65,852,001.26

新加坡元	120,656.26	4.8027	579,475.82
交易性金融资产			37,634,197.67
其中：美元	4,745,791.16	6.4601	30,658,285.47
港币	8,383,502.22	0.8321	6,975,912.20
短期借款			1,546,121,235.47
其中：美元	52,565,167.02	6.4601	339,576,235.47
港币	1,450,000,000.00	0.8321	1,206,545,000.00
代理买卖证券款			203,826,895.30
其中：美元	5,757,748.73	6.4601	37,195,632.57
港币	200,253,891.04	0.8321	166,631,262.73
应付货币保证金			2,247,478,825.12
其中：美元	290,120,740.62	6.4601	1,874,208,996.48
港币	386,135,306.86	0.8321	321,303,188.84
新加坡元	20,533.80	4.8027	98,617.68
欧元	3,876,722.40	7.6862	29,797,263.71
日元	157,811,134.50	0.0584	9,216,170.25
英镑	242,375.51	8.9410	2,167,079.43
马来西亚币	16,437,767.93	0.6427	10,564,553.45
韩元	21,571,101.00	0.0057	122,955.28
交易性金融负债			25,656,023.56
其中：美元	3,590,847.20	6.4601	23,197,232.00
其中：港币	2,954,923.16	0.8321	2,458,791.56
应付职工薪酬			4,184,070.40
其中：港币	4,973,102.00	0.8321	4,138,118.17
新加坡元	9,568.00	4.8027	45,952.23
应交税费			3,440,723.82
其中：美元	293,331.88	6.4601	1,894,953.28
港币	1,857,674.00	0.8321	1,545,770.54
其他应付款			11,493,248.23
其中：美元	1,400,560.78	6.4601	9,047,762.69
港币	2,603,658.09	0.8321	2,166,503.90
新加坡元	58,088.50	4.8027	278,981.64
其他负债			67,032,382.60

其中：港币	80,558,085.09	0.8321	67,032,382.60
-------	---------------	--------	---------------

3. 政府补助

(1) 与收益相关,且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项目	金额	列报项目	说明
就业补助	178,664.26	其他收益	杭州市人社局发放的以工代训补贴、新加坡就业支持计划(JSS)资金、长沙市政府残疾人就业保障基金返还
出疆棉花运费补贴	3,774,700.00	其他收益	新疆维吾尔自治区财政对出疆棉花的运费补贴
稳岗补贴	640,421.85	其他收益	对稳定就业企业给予失业保险金返还
政府考评奖励	550,000.00	其他收益	大连、辽宁等分支机构政府考评奖
小计	5,143,786.11		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 5,143,786.11 元。

七、关联方关系及其交易

(一) 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本公司 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)及浙江省财务开发有限责任公司 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五第三项之说明。

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五第四项之说明。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
鞍钢永安商品贸易有限公司（以下简称鞍钢永安）	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
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
浙江东方金融控股集团股份有限公司	持股 5%以上股东

(二) 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	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月
鞍钢永安	采购货物		30,515,858.63
永富物产	采购货物	91,811,506.70	12,011,933.62
财通证券	接受 IB 业务服务	5,183,957.92	3,427,010.49
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		943,396.23

[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	2021年1-6月	2020年1-6月
永富物产	销售货物	26,167,388.11	5,846,966.14
永安国富	提供资产管理产品代销服务	16,353,190.84	5,423,173.87
玉皇山南	提供资产管理产品代销服务		12,867.24
财通资管	提供资产管理产品代销服务	11.81	

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]	2021.6.30 权益	2021年1-6月手续费净收入
财通证券	187,873,943.91	29,691.65
永安国富实业	85,033,395.99	27,058.50
永富物产	20,967,869.53	11,112.81
永安投资咨询	1,011.00	
财通资管	13,262,499.16	10,234.61
永安国富	2,734,891,015.64	884,736.96
小 计	3,042,029,735.23	962,834.53

[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	2021.6.30 账面价值
永安国富-永富1号资产管理计划	永安国富	8,658,048.15
永安国富-永富3号资产管理计划	永安国富	775,673,164.59
永安国富-永富10号私募证券投资基金	永安国富	251,880,200.06
永安国富-F0F1号私募投资基金	永安国富	80,524,800.00
永安国富-稳健5号私募投资基金	永安国富	53,555,885.85
永安国富-稳健6号私募基金	永安国富	388,290,020.00
永安国富-永富12号私募基金	永安国富	8,273,844.42
永安国富-永富15号私募基金	永安国富	7,768,000.00
山南敦和私募资产配置基金	玉皇山南	10,310,000.00
财通资管鸿福短债债券C	财通资管	2,507,010.00
财通资管鸿福短债债券A	财通资管	40,095,334.42
小 计		1,627,536,307.49

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	2021.6.30 持有份额
混合优选 FOF 二号集合资产管理计划	浙江东方金融控股集团股份有限公司	100,004,861.11
	永安国富	5,000,486.11
京财赢 FOF1 号集合资产管理计划	财通证券	10,002,430.56
永庆 1 号集合资产管理计划	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	5,000,388.89
永盈 1 号集合资产管理计划		1,000,194.44
永盈 3 号集合资产管理计划		2,500,607.64
小 计		123,508,968.75

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	2021.6.30 资金余额	2021 年 1-6 月证券交易费
本公司	24,678.63	4,880.72
永安资本	13,155.55	7,099.25
合 计	37,834.18	11,979.97

(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	2021 年 1-6 月
财通证券	819,471.98

6. 关联租赁情况

承租方名称	租赁资产种类	2021 年 1-6 月确认的租赁收入
财通证券	房屋租赁	10,807,626.76

7. 永安资本与关联方发生场外衍生品交易，取得投资收益明细如下：

关联方	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月
财通证券	-37,647,405.06	101,089.87
鞍钢永安		2,829,267.50

8. 其他关联交易

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，截至 2021 年 6 月 30 日，财通资管管理的产品持有 49,000,000.00 元次级债，累计计提利息 1,278,631.51 元。

截至 2021 年 6 月 30 日，永安资本与财通证券签订的场外衍生品合约浮盈 15,562,648.88 元。

9. 关键管理人员报酬

项 目	本期数
关键管理人员报酬	1,849.74 万元

(三) 关联方往来余额

1. 应收关联方款项

项目名称	关联方	2021. 6. 30		2020. 12. 31	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
预付款项					
	永富物产	14,240,141.92			
小 计		14,240,141.92			
其他应收款					
	财通证券	2,000,000.00	100,000.00	33,335,010.00	1,666,750.50
小 计		2,000,000.00	100,000.00	33,335,010.00	1,666,750.50

2. 应付关联方款项

项目名称	关联方	2021. 6. 30	2020. 12. 31
合同负债			
	永富物产	733.50	1,037,542.24
小 计		733.50	1,037,542.24
其他负债			
	永富物产	66.01	93,378.80
小 计		66.01	93,378.80
预收款项			
	财通证券	7,205,084.51	7,205,084.50
小 计		7,205,084.51	7,205,084.50
其他应付款			
	财通证券	108,372,521.40	934,381.16
小 计		108,372,521.40	934,381.16

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

公司存在的信用风险主要包括：

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

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

（二）流动性风险

流动性风险，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。流动性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，本公司综合运用票据结算、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	2021. 6. 30				
	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	3,032,455,351.41	3,059,255,717.62	3,059,255,717.62		
代理买卖证券款	209,236,928.29	209,236,928.29	209,236,928.29		
应付货币保证金	36,145,893,248.38	36,145,893,248.38	36,145,893,248.38		
应付质押保证金	1,471,250,596.00	1,471,250,596.00	1,471,250,596.00		
交易性金融负债	1,257,297,804.38	1,257,297,804.38	1,257,297,804.38		
应付账款	187,744,458.38	187,744,458.38	187,744,458.38		
应付票据	50,000,000.00	50,000,000.00	50,000,000.00		

其他应付款	2,810,921,419.85	2,810,921,419.85	2,810,921,419.85		
其他负债	374,860,738.76	405,842,593.16	74,882,593.16	330,960,000.00	
租赁负债	91,388,609.54	101,510,835.26	32,164,100.83	29,821,219.73	39,525,514.70
小计	45,631,049,154.99	45,698,953,601.32	45,298,646,866.89	360,781,219.73	39,525,514.70

(续上表)

项 目	2020.12.31				
	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		
应付票据					
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	
租赁负债					
小计	35,542,189,814.55	35,598,779,119.82	35,261,422,133.52	337,356,986.30	

(三) 市场风险

市场风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险。市场风险主要包括利率风险、外汇风险和价格风险。针对市场风险，公司已建立了风险提示和预警机制，并定期或不定期的通过敏感性分析和压力测试对公司的市场风险承受能力进行评估；通过对客户保证金水平的动态检测，实时跟踪客户实际交易风险，对存在交易市场风险的客户及时采取要求追加保证金、甚至强制平仓的应对措施。通过实时检测客户交易品种的集中度，提示和引导交易客户持仓和交易品种的合理化。此外，公司还建立了市场风险隔离墙制度，对公司各业务的人员、信息、物理、财务账户等进行隔离，防止市场风险蔓延到公司其他业务模块。

1. 利率风险

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

截至2021年6月30日，本公司以浮动利率计息的银行借款人民币为0元(2020年12月31日：人民币0元)，在其他变量不变的假设下，假定利率变动50个基准点，不会对本公司的利润总额和股东权益产生重大的影响。

2. 外汇风险

外汇风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本公司面临的汇率变动的风险主要与本公司外币货币性资产和负债有关。对于外币资产和负债，如果出现短期的

失衡情况，本公司会在必要时按市场汇率买卖外币，以确保将净风险敞口维持在可接受的水平。

3. 价格风险

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

九、其他重要事项

（一）分部报告

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

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	884,169,323.01	6,962,637.93	48,116,568.94	15,703,939,151.52
营业支出	322,333,035.32	4,019,037.10	20,053,251.51	15,522,864,389.29
营业利润	561,836,287.69	2,943,600.83	28,063,317.43	181,074,762.23
资产总额	45,498,481,210.89	3,708,190.97	47,437,406.14	9,804,526,530.60
负债总额	38,037,183,448.02	764,590.14	19,374,088.71	7,418,597,582.76

(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	73,480,991.05	10,500,817.59	-42,590,054.77	16,684,579,435.27
营业支出	55,306,795.96	1,850,049.44	-33,981,717.20	15,892,444,841.42
营业利润	18,174,195.09	8,650,768.15	-8,608,337.57	792,134,593.85
资产总额	4,944,237,127.77	384,416,781.49	-3,767,824,357.65	56,914,982,890.21
负债总额	4,265,055,491.35	1,211,831.26	-1,353,681,231.01	48,388,505,801.23

（二）承诺及或有事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的承诺及或有事项。

（三）资产负债表日后事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的资产负债表日后事项。

（四）以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

项目	公允价值
----	------

	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
持续的公允价值计量				
1. 交易性金融资产和其他非流动资产	1,682,512,601.49	3,011,877,823.72		4,694,390,425.21
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	1,682,512,601.49	3,011,877,823.72		4,694,390,425.21
债务工具投资	530,783.09			530,783.09
权益工具投资	1,662,792,528.31	2,200,662,091.20		3,863,454,619.51
衍生金融资产	19,189,290.09	811,215,732.52		830,405,022.61
2. 其他权益工具投资			25,780,900.94	25,780,900.94
持续以公允价值计量的资产总额	1,682,512,601.49	3,011,877,823.72	25,780,900.94	4,720,171,326.15
3. 交易性金融负债	400,325,325.80	896,215,815.44		1,296,541,141.24
(1) 交易性金融负债	400,325,325.80	574,878,793.33		975,204,119.13
衍生金融负债	47,286,987.86	574,878,793.33		622,165,781.19
融券	353,038,337.94			353,038,337.94
(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		321,337,022.11		321,337,022.11
结构化主体其他投资者享有的权益		321,337,022.11		321,337,022.11
持续以公允价值计量的负债总额	400,325,325.80	896,215,815.44		1,296,541,141.24

说明：

1. 持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据：根据二级市场公开报价确认该计量项目的市价。

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

3. 持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息：采用特定估值技术确定公允价值，采用的重要参数包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的股票波动率、使用自身数据作出的财务预测等。

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

(五) 租赁

1. 公司作为承租人

(1) 使用权资产相关信息详见本财务报表附注六(一)20之说明；

(2) 公司对短期租赁和低价值资产租赁的会计政策详见本财务报表附注三(三十一)之说明。本期计入当期损益的短期租赁费用和低价值资产租赁费用金额如下：

项 目	2021 年 1-6 月
短期租赁费用	5,274,490.08
低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	53,304.02
合 计	5,327,794.10

(3) 与租赁相关的当期损益及现金流

项 目	2021 年 1-6 月
租赁负债的利息费用	1,896,653.01
与租赁相关的总现金流出	16,093,705.07

(4) 租赁负债的到期期限分析和相应流动性风险管理详见本财务报表附注八(二)之说明。

2. 公司作为出租人

经营租赁

(1) 租赁收入

项 目	2021 年 1-6 月
租赁收入	10,994,080.06
其中：未纳入租赁收款额计量的可变租赁付款额相关收入	

(2) 经营租赁资产

项 目	2021. 6. 30
投资性房地产	333,699,114.08
小 计	333,699,114.08

(3) 根据与承租人签订的租赁合同，不可撤销租赁未来将收到的未折现租赁收款额

剩余期限	2021. 6. 30
1 年以内	23,952,178.33
1-2 年	23,893,810.33
2-3 年	23,840,626.33
3-4 年	19,773,855.28
合 计	91,460,470.27

(六) 其他事项

2021 年 6 月末，公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有公司数量为 2,654 万股的股份出质。

十、母公司财务报表主要项目注释

(一) 母公司资产负债表项目注释

1. 长期股权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	2,030,974,102.19		2,030,974,102.19
对联营企业投资	851,233,638.54		851,233,638.54
合 计	2,882,207,740.73		2,882,207,740.73

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	2,030,974,102.19		2,030,974,102.19
对联营企业投资	675,850,075.90		675,850,075.90
合 计	2,706,824,178.09		2,706,824,178.09

(2) 对子公司投资

被投资单位名称	持股比例(%)	表决权比例(%)	期末数
新永安金控	100.00	100.00	251,984,002.19
永安资本	100.00	100.00	1,300,000,000.00
中邦实业	100.00	100.00	478,990,100.00
小 计			2,030,974,102.19

(3) 对联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
永安国富	675,850,075.90			238,091,562.64	
合 计	675,850,075.90			238,091,562.64	

(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		62,708,000.00			851,233,638.54	
合 计		62,708,000.00			851,233,638.54	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
经纪手续费净收入	69,578,993.34	53,221,326.07
交易所减收手续费收入	232,655,333.69	140,527,637.13
投资咨询收入	310,891.92	676,776.14
资产管理业务收入	6,921,032.89	34,196,973.12
基金销售业务收入	48,116,568.94	20,577,940.62
合 计	357,582,820.78	249,200,653.08

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额
杭州本部		307,562,858.64
浙江省(不含杭州本部)	15	20,010,564.60
辽宁省	3	2,597,574.75
山东省	7	5,264,482.85
北京市	1	2,311,127.54
广东省	2	3,718,391.85
上海市	1	1,361,812.72
福建省	2	2,079,499.31
河南省	1	2,020,731.82
江苏省	2	1,915,618.38
吉林省	1	1,517,671.35
天津市	1	857,666.37
重庆市	1	938,916.58
河北省	2	1,266,626.86
湖北省	1	769,836.08
四川省	1	1,300,551.57
湖南省	1	1,014,028.92
江西省	1	710,567.21
陕西省	1	364,293.38
合 计	44	357,582,820.78

2. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
-----	-----	-------

权益法核算的长期股权投资收益	238,091,562.64	75,849,780.36
金融工具持有期间的投资收益	377,864,322.98	238,585,283.19
处置金融工具取得的投资收益	24,888,545.27	-792,804.25
合计	640,844,430.89	313,642,259.30

十一、其他补充资料

(一) 非经常性损益

项目	金额
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-19,087.57
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	5,143,786.11
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-614,053.89
小计	4,510,644.65
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	1,173,480.06
少数股东权益影响额(税后)	
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	3,337,164.59

(二) 净资产收益率及每股收益

1. 明细情况

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益(元/股)	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	9.06	0.56	0.56
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	9.02	0.56	0.56

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	739,645,964.41
非经常性损益	B	3,337,164.59
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	736,308,799.82
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	7,798,045,444.98
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	

项 目	序号	本期数
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	F	
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	G	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H	
其他	权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	45,055.61
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	3
	可供出售金融资产公允价值变动	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	
	外币报表折算差额变动	-10,709,964.80
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	3
	其他	-549,411.22
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	3
报告期月份数	K	6
加权平均净资产	$L = \frac{D+A/2+E \times F/K - G \times H/K \pm I \times J/K}{K}$	8,162,261,266.98
加权平均净资产收益率	$M=A/L$	9.06%
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	$N=C/L$	9.02%

3. 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

(1) 基本每股收益的计算过程

项 目	序号	本期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	739,645,964.41
非经常性损益	B	3,337,164.59
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	$C=A-B$	736,308,799.82
期初股份总数	D	1,310,000,000.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E	
发行新股或债转股等增加股份数	F	
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G	
因回购等减少股份数	H	
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I	
报告期缩股数	J	

报告期月份数	K	6
发行在外的普通股加权平均数	$L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.56
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.56

(2) 稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

永安期货股份有限公司
二〇二一年八月二十五日

第八节 备查文件目录

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

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

文件备置地址：

永安期货股份有限公司董事会办公室