

证券代码：603093

证券简称：南华期货

# 南华期货股份有限公司

## 2021 年第三季度报告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容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。

### 重要内容提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

公司负责人、主管会计工作负责人及会计机构负责人（会计主管人员）保证季度报告中财务报表信息的真实、准确、完整。

第三季度财务报表是否经审计

是 否

### 一、主要财务数据

(一)主要会计数据和财务指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期	本报告期比上年同期增减变动幅度 (%)	年初至报告期末	年初至报告期末比上年同期增减变动幅度 (%)
营业收入	2,633,159,591.32	5.03	6,876,614,310.04	-12.13
归属于母公司股东的净利润	84,093,160.92	147.62	170,574,762.02	153.76

归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	83,946,201.78	183.47	171,973,096.21	206.90
经营活动产生的现金流量净额	不适用	不适用	4,790,647,955.57	123.36
基本每股收益(元/股)	0.1374	136.49	0.2831	137.70
稀释每股收益(元/股)	0.1374	136.49	0.2831	137.70
加权平均净资产收益率(%)	2.84	增加 1.48 个百分点	6.08	增加 3.33 个百分点
	本报告期末		上年度末	本报告期末比上年度末增减变动幅度(%)
总资产	30,523,158,801.64		22,313,912,410.32	36.79
归属于上市公司股东的所有者权益	2,995,689,628.68		2,475,877,176.86	21.00

注：“本报告期”指本季度初至本季度末 3 个月期间，下同。

## (二)非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期金额	年初至报告期末金额	说明
非流动性资产处置损益(包括已计提资产减值准备的冲销部分)			
越权审批,或无正式批准文件,或偶发性的税收返还、减免			
计入当期损益的政府补助(与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外)	217,419.10	988,290.81	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费			
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资			

时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益			
非货币性资产交换损益			
委托他人投资或管理资产的损益			
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备			
债务重组损益			
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等			
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益			
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益			
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益			
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益	200,822.00	227,077.25	
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回			
对外委托贷款取得的损益			
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益			
根据税收、会计等法			

律、法规的要求对当期损益进行一次调整对当期损益的影响			
受托经营取得的托管费收入			
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-55,492.73	-2,913,010.79	
其他符合非经常性损益定义的损益项目			
减：所得税影响额	90,687.09	-424,410.68	
少数股东权益影响额（税后）			
合计	146,959.14	-1,398,334.19	

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明

适用 不适用

(三)主要会计数据、财务指标发生变动的情况、原因

适用 不适用

项目名称	变动比例（%）	主要原因
货币资金	39.26	主要系经纪业务规模增加
应收质押保证金	78.49	主要系本期仓单质押增加
应收风险损失款	202.00	主要系本期应收穿仓客户风险损失款增加
应收票据	418.69	主要系本期以商业承兑汇票方式结算业务增加
应收账款	723.51	主要系期初余额较小，且期末数与基差贸易业务规模相比较小
应收款项融资	47.59	主要系本期以银行承兑汇票方式结算业务增加
预付款项	-38.66	主要系基差贸易业务配套现货贸易的往来款部分结算
长期股权投资	556.59	主要系实际认缴海港大宗股权 25%
应付货币保证金	40.49	主要系经纪业务规模增加
应付质押保证金	78.49	主要系本期仓单质押增加
交易性金融负债	-50.50	主要系风险管理子公司融券业务规模减小
应付账款	216.47	主要系部分基差贸易业务周期延长
合同负债	166.35	主要系待执行合同义务增加
卖出回购金融资产款	-31.06	主要系本期债券质押式回购金额减少
应交税费	510.86	主要系应交所得税增加
其他流动负债	-83.61	主要系基差业务被套期项目金额减少
预计负债	-100.00	主要系对海港大宗预计负债转入长期股权投资
递延所得税负债	53.51	主要系应纳税暂时性差异增加
资本公积	38.22	主要系公司增发新股
其他综合收益	-851.01	主要系外币报表折算差额扩大

利息支出	-48.32	主要系上年母公司次级债到期且风险管理子公司借款成本减少
投资收益	-72.00	主要系风险管理业务金融工具期货平仓损益减少
其他收益	-85.09	主要系政府补助款减少
公允价值变动收益	-109.02	主要系风险管理业务期货持仓损益减少
汇兑收益	704.72	主要系汇率变动带来的收益增加
提取期货风险准备金	45.53	主要系母公司代理手续费净收入增加
信用减值损失	95.72	主要系应收上手坏账计提金额增加
营业外收入	-96.90	主要系基差贸易业务配套现货贸易交易对手方违约金减少

## 二、股东信息

### (一) 普通股股东总数和表决权恢复的优先股股东数量及前十名股东持股情况表

单位：股

报告期末普通股股东总数	24,324	报告期末表决权恢复的优先股股东总数（如有）	-			
前 10 名股东持股情况						
股东名称	股东性质	持股数量	持股比例 (%)	持有有限售条件股份数量	质押、标记或冻结情况	
					股份状态	数量
横店集团控股有限公司	境内非国有法人	425,120,900	69.68	425,120,900	无	-
东阳市横华投资合伙企业（有限合伙）	其他	24,480,000	4.01	24,480,000	无	-
浙江横店进出口有限公司	境内非国有法人	10,000,000	1.64	10,000,000	无	-
横店集团东磁股份有限公司	境内非国有法人	10,000,000	1.64	10,000,000	无	-
深圳市建银南山投资有限公司	境内非国有法人	5,754,800	0.94	-	无	-
光大金控（天津）创业投资有限公司	境内非国有法人	5,279,977	0.87	-	无	-
杭州振源资产管理有限公司—振源鑫汇 10 号私募证券投资基金	未知	4,612,850	0.76	-	无	-
廖海成	境内自然人	4,118,616	0.68	-	无	-
JPMORGAN CHASE BANK, NATIONAL ASSOCIATION	境外法人	3,798,393	0.62	-	无	-

上海蓝墨投资管理有限公司—蓝墨曜文1号私募投资基金	未知	2,351,169	0.39	-	无	-
前10名无限售条件股东持股情况						
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量				
		股份种类	数量			
深圳市建银南山投资有限公司	5,754,800	人民币普通股	5,754,800			
光大金控(天津)创业投资有限公司	5,279,977	人民币普通股	5,279,977			
杭州振源资产管理有限公司—振源鑫汇10号私募证券投资基金	4,612,850	人民币普通股	4,612,850			
廖海成	4,118,616	人民币普通股	4,118,616			
JPMORGAN CHASE BANK, NATIONAL ASSOCIATION	3,798,393	人民币普通股	3,798,393			
上海蓝墨投资管理有限公司—蓝墨曜文1号私募投资基金	2,351,169	人民币普通股	2,351,169			
陆意祥	2,322,169	人民币普通股	2,322,169			
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	2,219,454	人民币普通股	2,219,454			
陆瑛	1,647,446	人民币普通股	1,647,446			
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	1,545,100	人民币普通股	1,545,100			
上述股东关联关系或一致行动的说明	横店控股是公司的控股股东；东阳横华是公司管理层的持股平台，横店控股为普通合伙人，并为东阳横华的执行事务合伙人；横店控股直接持有横店东磁50.59%股权；横店控股直接持有横店进出口74.00%股权。除上述关系外，未知前十名其他股东之间是否存在关联关系或属于一致行动人。					
前10名股东及前10名无限售股东参与融资融券及转融通业务情况说明(如有)	-					

### 三、其他提醒事项

需提醒投资者关注的关于公司报告期经营情况的其他重要信息

适用 不适用

### 四、季度财务报表

#### (一) 审计意见类型

适用 不适用

## (二) 财务报表

## 合并资产负债表

2021年9月30日

编制单位:南华期货股份有限公司

单位:元 币种:人民币 审计类型:未经审计

项目	2021年9月30日	2020年12月31日
<b>资产:</b>		
货币资金	16,097,444,238.88	11,559,097,917.78
其中:客户资金存款	13,962,715,215.29	9,696,422,597.86
结算备付金	68,170,628.51	66,357,789.04
应收货币保证金	7,918,684,874.85	6,139,316,685.88
应收质押保证金	3,398,147,792.00	1,903,874,616.00
应收结算担保金	43,347,163.89	35,148,161.07
应收风险损失款	346,214.04	114,640.68
应收票据	26,567,953.09	5,122,152.44
应收账款	19,367,533.10	2,351,838.76
应收款项融资	4,420,000.00	2,994,789.00
预付款项	70,947,069.45	115,665,190.80
其他应收款	104,731,082.25	100,959,416.60
<b>金融投资:</b>		
交易性金融资产	1,912,837,974.63	1,524,036,067.89
其他权益工具投资	11,808,007.58	11,913,793.25
存货	306,431,932.34	325,319,719.60
发放贷款及垫款	14,416,039.36	14,543,494.27
长期股权投资	22,671,774.12	3,452,973.94
期货会员资格投资	33,746,993.70	33,454,452.69
投资性房地产	332,133.01	390,505.21
固定资产	32,937,439.75	27,336,442.89
在建工程	170,597,765.06	143,578,754.19
无形资产	171,585,328.13	175,261,922.62
递延所得税资产	6,064,713.04	
其他资产	87,554,150.86	123,621,085.72
资产总计	30,523,158,801.64	22,313,912,410.32
<b>负债:</b>		
短期借款	740,452,476.82	822,551,461.75
应付货币保证金	21,797,326,821.97	15,515,581,781.60
应付质押保证金	3,398,147,792.00	1,903,874,616.00
交易性金融负债	198,468,487.86	400,912,339.77
期货风险准备金	164,731,874.29	150,539,212.94
应付票据	100,000,000.00	100,000,000.00

## 2021年第三季度报告

应付账款	68,603,908.41	21,678,157.23
合同负债	90,500,544.72	33,978,465.36
卖出回购金融资产款	363,990.76	527,994.72
应付期货投资者保障基金	507,317.73	551,481.32
应付职工薪酬	68,746,523.75	66,902,350.32
应交税费	41,166,673.23	6,739,133.49
其他应付款	601,058,804.89	510,001,461.06
代理买卖证券款	247,801,382.94	249,897,740.76
其他流动负债	6,370,221.81	38,874,695.16
预计负债		13,325,227.52
递延所得税负债	3,222,351.78	2,099,114.46
负债合计	27,527,469,172.96	19,838,035,233.46
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>		
实收资本（或股本）	610,065,893.00	580,000,000.00
资本公积	1,190,694,767.52	861,458,889.32
其他综合收益	-10,481,907.84	-1,102,191.00
盈余公积	82,648,458.54	82,648,458.54
一般风险准备	108,902,150.24	107,261,459.78
未分配利润	995,333,344.76	826,399,273.20
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	2,977,162,706.22	2,456,665,889.84
少数股东权益	18,526,922.46	19,211,287.02
所有者权益（或股东权益）合计	2,995,689,628.68	2,475,877,176.86
负债和所有者权益（或股东权益）总计	30,523,158,801.64	22,313,912,410.32

公司负责人：罗旭峰

主管会计工作负责人：王力

会计机构负责人：夏海波

## 合并利润表

2021年1—9月

编制单位：南华期货股份有限公司

单位：元 币种：人民币 审计类型：未经审计

项目	2021年前三季度（1-9月）	2020年前三季度（1-9月）
一、营业总收入	6,876,614,310.04	7,825,629,032.21
手续费及佣金净收入	361,158,314.53	278,849,085.19
利息净收入	167,404,515.11	141,490,246.03
其中：利息收入	189,010,520.29	183,300,194.52
利息支出	21,606,005.18	41,809,948.49
投资收益（损失以“-”号填列）	55,234,673.02	197,260,226.43
其中：对联营企业和合营企业	-712,338.64	-145,869.16



的投资收益		
其他收益	982,513.95	6,588,529.18
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,871,310.11	20,740,298.39
汇兑收益（损失以“-”号填列）	4,253,404.59	-703,370.69
其他业务收入	6,289,452,947.77	7,181,404,017.68
资产处置收益（损失以“-”号填列）	-748.82	
二、营业总支出	6,647,378,780.83	7,739,393,629.57
提取期货风险准备金	14,308,572.41	9,832,171.01
税金及附加	3,221,150.15	3,174,322.77
业务及管理费	431,600,062.23	362,795,578.94
研发支出	14,170,536.37	
信用减值损失	12,673,611.47	6,475,338.19
资产减值损失		-1,220,168.79
其他业务成本	6,171,404,848.20	7,358,336,387.45
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	229,235,529.21	86,235,402.64
加：营业外收入	250,461.75	8,083,741.45
减：营业外支出	3,163,472.54	1,204,803.57
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	226,322,518.42	93,114,340.52
减：所得税费用	56,463,868.60	26,807,019.01
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	169,858,649.82	66,307,321.51
（一）按经营持续性分类		
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	169,858,649.82	66,307,321.51
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. 归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）	170,574,762.02	67,217,747.62
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）	-716,112.20	-910,426.11
六、其他综合收益的税后净额	-10,704,371.53	-3,103,496.32
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	-10,720,245.35	-3,346,300.20
（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	361,421.72	3,275,085.11

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	361,421.72	3,275,085.11
4. 企业自身信用风险公允价值变动		
(二) 将重分类进损益的其他综合收益	-11,081,667.07	-6,621,385.31
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	-11,081,667.07	-6,621,385.31
7. 其他		
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	15,873.82	242,803.88
七、综合收益总额	159,154,278.29	63,203,825.19
归属于母公司所有者的综合收益总额	159,854,516.67	63,871,447.42
归属于少数股东的综合收益总额	-700,238.38	-667,622.23
八、每股收益：		
(一) 基本每股收益(元/股)	0.2831	0.1191
(二) 稀释每股收益(元/股)	0.2831	0.1191

公司负责人：罗旭峰

主管会计工作负责人：王力

会计机构负责人：夏海波

## 合并现金流量表

2021 年 1—9 月

编制单位：南华期货股份有限公司

单位：元 币种：人民币 审计类型：未经审计

项目	2021年前三季度 (1-9月)	2020年前三季度 (1-9月)
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>		
收取利息、手续费及佣金的现金	463,283,095.88	326,496,761.22
销售商品、提供劳务收到的现金	6,609,034,345.03	7,993,205,804.70

客户贷款及垫款净减少额		10,899,844.25
代理买卖证券收到的现金净额	876,228.70	88,467,206.13
收到的税费返还	2,995,112.41	
收到其他与经营活动有关的现金	6,695,782,026.62	4,863,256,159.44
经营活动现金流入小计	13,771,970,808.64	13,282,325,775.74
购买商品、接受劳务支付的现金	6,464,761,168.75	8,157,880,171.59
支付利息、手续费及佣金的现金	27,169,537.82	28,759,083.26
支付给职工及为职工支付的现金	237,442,067.77	172,647,369.47
以现金支付的业务及管理费	196,454,479.74	133,768,441.71
支付的各项税费	57,126,119.45	38,681,618.87
代理买卖证券支付的现金净额	2,972,586.52	
支付其他与经营活动有关的现金	1,995,396,893.02	2,605,756,288.39
经营活动现金流出小计	8,981,322,853.07	11,137,492,973.29
经营活动产生的现金流量净额	4,790,647,955.57	2,144,832,802.45
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>		
收回投资收到的现金	1,930,196,313.33	3,678,975,406.16
取得投资收益收到的现金	1,987,416.95	206,725,638.69
收到其他与投资活动有关的现金	1,722,058,938.93	4,357,598,605.82
投资活动现金流入小计	3,654,242,669.21	8,243,299,650.67
投资支付的现金	3,060,939,355.32	3,051,935,524.09
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	35,975,940.75	46,137,364.35
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	33,333,333.00	
支付其他与投资活动有关的现金	5,200,861,241.12	6,503,752,751.31
投资活动现金流出小计	8,331,109,870.19	9,601,825,639.75
投资活动产生的现金流量净额	-4,676,867,200.98	-1,358,525,989.08
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>		
吸收投资收到的现金	361,149,941.02	7,816,936.18
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		7,816,936.18
取得借款收到的现金	245,400,000.00	702,948,472.00
筹资活动现金流入小计	606,549,941.02	710,765,408.18
偿还债务支付的现金	335,424,000.00	854,400,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	18,643,823.46	74,812,911.05
支付其他与筹资活动有关的现金	57,659,993.64	296,881,072.00
筹资活动现金流出小计	411,727,817.10	1,226,093,983.05
筹资活动产生的现金流量净额	194,822,123.92	-515,328,574.87
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>	-22,277,944.60	4,560,919.18
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	286,324,933.91	275,539,157.68
加：期初现金及现金等价物余额	2,652,861,972.40	2,058,240,897.73
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	2,939,186,906.31	2,333,780,055.41

公司负责人：罗旭峰

主管会计工作负责人：王力

会计机构负责人：夏海波

(三)2021 年起首次执行新租赁准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

适用 不适用

特此公告。

南华期货股份有限公司董事会

2021 年 10 月 21 日