

# 永安期货股份有限公司 2022 年半年度报告



## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

四、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）黄峥嵘声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

不适用

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告中涉及的未来规划、发展战略、经营计划等前瞻性描述，不构成公司对投资者的实际承诺，敬请投资者注意风险。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告内容的真实性、准确性和完整性

否

十、重大风险提示

国际及地区形势、经济周期、宏观经济政策走向、突发事件及不可抗力导致的不确定因素等引发的证券期货市场波动会影响期货行业的业务开展和收入水平，加大公司的经营风险，导致盈利状况出现波动。

公司已在本报告中详细描述了经营活动中面临的风险，主要包括市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、合规及法律风险、信息技术风险等。具体内容详见本报告“第三节 五、（一）可能面对的风险”相关说明。

十一、其他

适用 不适用

本报告中部分合计数与各单项数据之和在尾数上存在差异，系四舍五入原因造成。

## 目录

第一节	释义 .....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	管理层讨论与分析 .....	11
第四节	公司治理 .....	21
第五节	环境与社会责任.....	24
第六节	重要事项 .....	26
第七节	股份变动及股东情况.....	35
第八节	优先股相关情况.....	38
第九节	债券相关情况 .....	39
第十节	财务报告 .....	40
第十一节	期货公司信息披露 .....	143

备查文件目录	载有公司法定代表人签名并由公司盖章的公司2022年半年度报告正本 报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本 及公告的原稿 其他有关资料
--------	--

## 第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
公司、母公司、永安期货	指	永安期货股份有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
新永安金控	指	新永安国际金融控股有限公司
新永安期货	指	中国新永安期货有限公司
新永安资管	指	新永安国际资产管理有限公司
永安国际金融	指	永安国际金融（新加坡）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
永安全球基金	指	永安全球基金独立投资组合公司
永安国贸	指	永安（新加坡）国际贸易有限公司
财通证券	指	财通证券股份有限公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
省金控	指	浙江省金融控股有限公司
浙江东方	指	浙江东方金融控股集团股份有限公司
浙经建投	指	浙江省经济建设投资有限公司
永安国油	指	浙江永安国油能源有限公司
香港永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安投资咨询	指	浙江永安投资咨询有限公司
OSTC YONGAN	指	OSTC YONGAN TRADING CO. LIMITED
永安国富实业	指	浙江永安国富实业有限公司
永安有限	指	浙江省永安期货经纪有限公司
永安瑞萌	指	上海永安瑞萌商贸有限公司
永安国富	指	永安国富资产管理有限公司
永富物产	指	永富物产有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
阳富教育	指	阳富教育咨询服务（深圳）有限公司
玉皇山南	指	浙江玉皇山南投资管理有限公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
浙江证监局	指	中国证券监督管理委员会浙江监管局
香港证监会	指	香港证券及期货事务监察委员会
中期协	指	中国期货业协会
上交所	指	上海证券交易所
上期所	指	上海期货交易所
郑商所	指	郑州商品交易所
大商所	指	大连商品交易所
中金所	指	中国金融期货交易所
能源中心	指	上海国际能源交易中心
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
中华通	指	沪港通和深港通的统称
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《永安期货股份有限公司章程》
报告期内	指	2022 年 1 月-6 月
报告期末	指	2022 年 6 月 30 日

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

公司的中文名称	永安期货股份有限公司
公司的中文简称	永安期货
公司的外文名称	Yongan Futures Co., Ltd.
公司的外文名称缩写	Yongan Futures
公司的法定代表人	葛国栋
公司总经理	黄志明

备注：2022年8月19日，经公司第三届董事会第二十三次会议审议通过，聘任黄志明先生为公司总经理。

注册资本和净资产

单位：元币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	1,455,555,556	1,455,555,556
净资产	3,859,183,697.29	5,092,973,144.02

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

公司持有中国证监会核发的流水号为000000060648的《经营证券期货业务许可证》，核准的业务范围为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、基金销售。公司下属的26家分公司和18家营业部均持有中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。

公司全资子公司永安资本及其子公司开展的主要业务为风险管理业务，包括基差贸易、场外衍生品业务、做市业务等。

公司在香港设立全资子公司新永安金控，覆盖境外期货经纪业务、资产管理业务、证券业务、放贷业务等多个领域。

#### 1. 公司的专项期货业务经营资格

(1) 1994年11月3日，中国证监会出具《关于颁发〈期货经纪业务许可证〉的通知》（证监发字[1994]170号），核准了公司的期货经纪业务资格。

(2) 2007年11月3日，中国证监会出具《关于核准浙江省永安期货经纪有限公司金融期货经纪业务资格的批复》（证监期货字[2007]241号），核准了公司的金融期货经纪业务资格。

(3) 2007年11月3日，中国证监会出具《关于核准浙江省永安期货经纪有限公司金融期货全面结算业务资格的批复》（证监期货字[2007]242号），核准了公司的金融期货全面结算业务资格。

(4) 2011年8月12日，中国证监会出具《关于核准浙江省永安期货经纪有限公司期货投资咨询业务资格的批复》（证监许可〔2011〕1293号），核准了公司的期货投资咨询业务资格。

(5) 2012年11月15日，中国证监会出具《关于核准永安期货股份有限公司资产管理业务资格的批复》（证监许可〔2012〕1503号），核准了公司的资产管理业务资格。

(6) 2015年1月27日，上海证券交易所出具《关于永安期货股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》（上证函〔2015〕174号），同意公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人并开通股票期权经纪业务交易权限。

(7) 2015年1月28日，中国证券登记结算有限责任公司出具《关于结算参与人期权结算业务资格有关事宜的复函》（中国结算函字〔2015〕88号），同意公司关于结算参与人资格的申请。

(8) 2015年11月18日，浙江证监局出具《关于核准永安期货股份有限公司证券投资基金销售业务资格的批复》（浙证监许可〔2015〕39号），核准了公司的证券投资基金销售业务资格。

(9) 2019年12月6日, 深圳证券交易所出具《关于同意永安期货股份有限公司成为深圳证券交易所交易参与人的复函》(深证函〔2019〕734号), 同意公司成为深圳证券交易所股票期权交易参与人。

## 2. 境内子公司业务资质

(1) 2013年3月19日, 中期协《关于永安期货股份有限公司设立子公司开展以风险管理服务为主的业务试点备案申请的复函》(中期协函字〔2013〕50号), 针对公司提出的关于设立风险管理子公司开展以风险管理服务为主的业务试点予以备案, 备案试点业务为仓单服务、合作套保、定价服务和基差交易; 根据中期协《关于发布实施〈期货公司风险管理公司业务试点指引〉及配套文件的通知》(中期协字〔2019〕10号), 已备案的风险管理业务类型“基差交易”调整为“基差贸易”, “定价服务”调整为“场外衍生品业务”。

(2) 2017年1月4日, 中期协发布《关于浙江永安资本管理有限公司试点业务予以备案的通知》(中期协备字〔2017〕1号), 永安资本备案试点业务为做市业务。

(3) 2020年7月9日, 杭州市西湖区应急管理局向永安资本核发了《危险化学品经营许可证》(浙杭(西)安经字〔2020〕03000817号)。

(4) 2020年9月24日, 中国证监会出具《关于核准永安期货股份有限公司通过子公司浙江永安资本管理有限公司从事股票期权做市业务的批复》(证监许可〔2020〕2337号), 核准公司通过子公司永安资本从事股票期权做市业务。

(5) 2022年6月30日, 杭州市西湖区市场监督管理局向永安资本核发了《食品经营许可证》(编号JY13301060316413), 原《食品经营许可证》(编号JY13301060164219)于2022年5月21日过期。

## 3. 境外子公司业务资质

(1) 2006年, 中国证监会《关于同意浙江省永安期货经纪有限公司在香港设立分支机构的批复》(证监期货字〔2006〕40号)同意永安有限以在香港设立子公司的形式设立香港分支机构, 该分支机构可依据香港的法律申请及从事受香港证监会监管的业务活动。

(2) 2007年4月20日, 新永安期货获得香港证监会核发的中央编号为A0J411的牌照, 可进行“第2类: 期货合约交易”活动。

(3) 2014年6月25日, 新永安期货获得香港证监会核发的中央编号为A0J411的牌照, 可进行“第2类: 期货合约交易; 第5类: 就期货合约提供意见”活动。

(4) 2018年10月12日, 新永安证券获得香港证监会核发的中央编号为BNB381的牌照, 可进行“第1类: 证券交易”活动。

(5) 2018年11月9日, 新永安资管获得香港证监会核发的中央编号为BNC838的牌照, 可进行“第4类: 就证券提供意见; 第9类: 提供资产管理”活动。

(6) 2019年2月4日, 永安国际金融获得新加坡金融管理局(MAS)核发的资本市场服务牌照(Capital Market Services Licence), 允许开展资本市场产品交易(Dealing in capital market products)业务。

(7) 2019年8月22日, 中国证监会《关于核准新永安国际资产管理有限公司人民币合格境外机构投资者资格的批复》(证监许可〔2019〕1534号), 核准了新永安资管人民币合格境外机构投资者资格。

(8) 2019年10月18日, 新永安资管获得中国证监会核发的流水号为000000027527的《经营证券期货业务许可证》, 许可证核准的业务范围为“境内证券投资”。

(9) 2022年4月12日, 新永安实业获得香港Licensing Court(牌照法庭)签发的“Money Lenders Licence(放债人牌照)”, 牌照号码为“0227/2022”。

(10) 2022年5月27日, 新永安资管获得中国人民银行核发的全国银行间债券市场准入备案通知书, 2022年5月30日批准新永安资管可通过债券通(Bond Connect)交易中国银行间债券市场(China Interbank Bond Market)。

## 4. 公司及子公司取得的交易所会员资格及行业协会会员资格

- (1) 上期所会员
- (2) 郑商所会员
- (3) 大商所会员
- (4) 中金所全面结算会员

- (5) 能源中心会员
- (6) 中期协会员
- (7) 中国证券业协会会员
- (8) 中国证券投资基金业协会会员
- (9) 中国保险资产管理业协会联席会员
- (10) 中国银行间市场交易商协会会员
- (11) 中国上市公司协会第三届理事会会员常务理事
- (12) 公司子公司新永安证券为香港联交所的交易所参与者和中华通交易所参与者，以及香港交易及结算所有限公司的直接结算参与者和中华通结算参与者
- (13) 公司子公司新永安期货为香港期货交易所有限公司的交易参与者 and 香港期货结算有限公司的期货结算公司参与者
- (14) 公司子公司新永安期货为新加坡交易所 (SGX) 衍生品交易会员
- (15) 公司子公司新永安期货为欧洲期货交易所 (EUREX) 参与者
- (16) 公司子公司永安国际金融为新加坡交易所衍生品市场 (SGX-DT) 交易会员
- (17) 公司子公司永安国际金融为新加坡亚太交易所 (APEX) 综合会员和新加坡亚太交易所结算公司 (APEXClear) 综合清算会员

## 二、 联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	黄峥嵘	史雅文
联系地址	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦
电话	0571-88353525	0571-88375012
传真	0571-88388193	0571-88388193
电子信箱	yaqh_ir@yafco.com	syw2330@yafco.com

## 三、 基本情况变更简介

公司注册地址	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层
公司注册地址的历史变更情况	(1) 2012年9月29日，改制设立永安期货股份有限公司。注册地址为杭州市潮王路208号浙江协作大厦3、6-10楼； (2) 2013年12月17日注册地址变更为杭州市潮王路208号浙江协作大厦3、6-10、22楼； (3) 2014年5月23日注册地址变更为杭州市潮王路208号浙江协作大厦3、5-10、22楼； (4) 2016年8月9日注册地址变更为杭州市新业路200号华峰国际商务大厦16-17层，2603室、2702室； (5) 2018年6月6日注册地址变更为浙江省杭州市新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1104室、16-17层、2702室； (6) 2019年5月9日注册地址变更为浙江省杭州市新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层、2604室、2702室； (7) 2020年4月24日注册地址变更为浙江省杭州市江干区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1102室、1104室、16-17层、2604室；

	(8) 2020年11月11日注册地址变更为浙江省杭州市江干区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层； (9) 2022年3月1日注册地址变更为浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层。
公司办公地址	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层
公司办公地址的邮政编码	310016
公司网址	www.yafco.com
电子信箱	yaqh_ir@yafco.com
报告期内变更情况查询索引	《永安期货股份有限公司关于完成工商变更登记及换发营业执照的公告》（公告编号：2022-013） <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>

#### 四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	上海证券报： <a href="https://www.cnstock.com">https://www.cnstock.com</a> 中国证券报： <a href="https://www.cs.com.cn">https://www.cs.com.cn</a> 证券时报： <a href="http://www.stcn.com">http://www.stcn.com</a> 证券日报： <a href="http://www.zqrb.cn">http://www.zqrb.cn</a> 经济参考网： <a href="http://www.jjckb.cn">http://www.jjckb.cn</a>
登载半年度报告的网站地址	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
公司半年度报告备置地点	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦16楼董事会办公室

#### 五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A股	上海证券交易所	永安期货	600927	不适用

#### 六、其他有关资料

适用 不适用

#### 七、公司主要会计数据和财务指标

##### (一) 主要会计数据

单位：元币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	19,551,137,533.56	16,684,579,435.27	17.18
归属于母公司股东的净利润	316,015,105.58	739,645,964.41	-57.27
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	313,552,248.52	736,308,799.82	-57.42
经营活动产生的现金流量净额	3,355,665,470.90	4,155,603,121.45	-19.25
其他综合收益	51,082,148.85	-10,664,909.19	不适用
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年同期末增减 (%)

资产总额	71,732,781,426.01	64,971,771,432.68	10.41
负债总额	60,187,659,716.80	53,386,093,433.89	12.74
归属于母公司股东的权益	11,545,121,709.21	11,585,677,998.79	-0.35
所有者权益总额	11,545,121,709.21	11,585,677,998.79	-0.35

## (二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同 期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.22	0.56	-60.71
稀释每股收益(元/股)	0.22	0.56	-60.71
扣除非经常性损益后的基本每股 收益(元/股)	0.22	0.56	-60.71
加权平均净资产收益率(%)	2.69	9.06	减少6.37个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均 净资产收益率(%)	2.66	9.02	减少6.36个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

## (三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位:元币种:人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	3,859,183,697.29	5,092,973,144.02
净资本与风险资本准备总额的 比例(净资本/风险资本准备总 额)(%)	276	410
净资本与净资产的比例(%)	38	49
流动资产与流动负债的比例(%)	477	678
负债与净资产的比例(%)	16	15
结算准备金额	2,773,192,426.37	5,104,928,420.06

说明:“流动资产/流动负债”中的流动负债、“负债/净资产”中的负债为扣除了客户权益后的金额。

## 八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

## 九、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位:元币种:人民币

非经常性损益项目	金额	附注(如适用)
非流动资产处置损益	963,388.07	
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,但与 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	2,370,427.89	

除外		
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、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生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、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-48,195.02	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
减：所得税影响额	822,763.88	
少数股东权益影响额（税后）		
合计	2,462,857.06	

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

## 十、其他

适用 不适用

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

#### (一) 报告期内公司所处行业情况

##### 1. 《期货和衍生品法》正式实施，行业驶入健康发展快车道

2022年4月20日，第十三届全国人大常委会第三十四次会议审议通过了《期货和衍生品法》，并于8月1日正式施行，期货行业法治化建设迈出了历史性的一大步，具有里程碑意义。我国首次从法律的高度，系统地规定期货和衍生品领域的基本原则、基本参与主体及其基本职责分工、基本权利义务，是期货和衍生品领域的基本法。同时，明确将“国家支持期货市场健康发展，发挥发现价格、管理风险、配置资源的功能”写入法律条文，为期货和衍生品市场的高质量发展奠定坚实的法律基础、提供难得的历史性发展机遇，将极大地促进我国期货和衍生品行业发展。

##### 2. 市场规模增长，期货期权新品种上市提速

2022年上半年，受国内疫情反复、地缘政治风险外溢及全球流动性收紧影响，经济下行压力加大，大宗商品市场整体价格波动剧烈，国内期货市场活跃度有所降低，全国期货市场累计成交量为30.46亿手，累计成交额为257.48万亿元，同比分别下降18.04%和10.08%。与此同时，期货及衍生品市场的资金规模继续保持增长趋势，截至2022年7月末，全国期货公司客户权益为1.5万亿元，较年初增长26.76%。

2022年以来，国内衍生品新品种推出速度加快。中证1000股指期货和期权于2022年7月22日上市交易，成为了今年期货市场上市的首只新品种，也是自2015年4月推出上证50和中证500股指期货后，时隔7年再次推出新的股指期货品种。2022年7月末，证监会批准大连商品交易所开展黄大豆1号、黄大豆2号和豆油期权交易，并于2022年8月8日正式挂牌交易。2022年8月，证监会批准了菜籽油和花生期权交易，并将于2022年8月26日正式挂牌交易。截止本报告批准报出日，国内已累计批准101个期货期权产品，有效助力了大宗商品保供稳价和国民经济高质量发展。

##### 3. 期货公司资本实力增强，行业利润略有下降

中国期货业协会数据显示，截至2022年6月末，国内150家期货公司总资产15,765.10亿元，净资产1,753亿元，同比分别增长30.17%和19.42%，资本实力有所增强。上半年，共有15家期货公司完成增资，截至2022年6月末，共有5家期货公司注册资本超30亿元。2022年1-6月，全市场150家期货公司整体净利润为58.12亿元，同比下降4.59%。

##### 4. 风险管理功能更加凸显，服务实体经济成效显著

上半年，随着大宗商品价格波动加剧和风险管理意识的提升，实体经济借助衍生品工具进行避险的热情高涨，越来越多的上市公司通过期货工具进行套期保值，以市场化手段应对原材料和产品价格波动、汇率波动等风险。据不完全统计，截至2022年6月末，约有857家A股上市公司发布关于开展套期保值业务的公告，其中594家仅开展外汇套保，144家仅开展商品套保，119家同时开展外汇套保和商品套保。

#### (二) 报告期内公司从事的业务情况

本公司经营业务主要包括：期货经纪业务、基金销售业务、资产管理业务、风险管理业务、境外金融服务业务等。

##### 1. 期货经纪业务

期货经纪业务是指代理客户进行期货交易的中间业务，主要模式为客户通过公司的席位在交易所内进行期货交易，公司向客户收取手续费。根据客户服务类型不同，期货经纪业务可分为代理客户的经纪业务和代理客户的结算业务。代理客户的经纪业务，即期货公司接受客户委托代客户买卖商品期货和金融期货合约、办理结算和交割手续，其客户为期货投资者，包括个人投资者

和机构投资者；代理客户的结算业务主要指因中金所执行会员分级结算制度，公司作为中金所的全面结算会员，为交易会员提供代理结算业务。

### 2. 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。

### 3. 资产管理业务

资产管理业务是指公司非公开募集资金或者接受单一客户或特定多个客户的书面财产委托，设立私募资产管理计划并担任管理人，选定具有基金托管资格的托管机构担任托管人，依照法律法规和资产管理合同的约定，为投资者的利益，运用客户委托资产进行投资活动，并按照合同约定收取费用或者报酬的业务活动。公司设立的资产管理计划的投资方向包括期货、期权及其他金融衍生品、股票、债券及中国证监会认可的其他投资品种等。

### 4. 风险管理业务

公司通过永安资本及其子公司开展风险管理业务，主要包括基差贸易、场外衍生品业务和做市业务等风险管理服务以及其他与风险管理相关的服务，涵盖期货上市品种及其产业链相关品种的贸易、远期交易和期货交割等。公司风险管理业务以服务实体产业客户为宗旨，以基本面研究为基础，依靠期货、现货各方面的渠道资源，结合场内和场外两个市场，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。

### 5. 境外金融服务业务

公司通过新永安金控及其子公司开展境外金融服务业务。新永安金控下设有新永安期货、新永安实业、新永安资管、新永安证券、永安国际金融和永安全球基金，覆盖境外期货经纪业务、资产管理业务、证券业务、基金销售业务、放贷业务等多个领域，满足客户多样化的金融服务需求。

## 二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

### 1. 精准的战略定位

站在上市的新起点上，公司认真谋划好“十四五”发展战略规划，确立了“135”战略架构，即一个战略定位、三个战略目标、五条战略路径。以“大宗商品投行、大类资产配置专家、产融资源整合者”为战略目标，通过“五个永安”战略路径，打造行业领先、独具特色的衍生品投行，为建设高效率、有活力、开放型的期货市场贡献力量。

### 2. 完善高效的治理和风控体系

报告期内，公司加强风控、合规体系建设，强化预防、监督和控制，将权责明确落实到各责任单位。公司现已建立起规范的法人治理结构与合理的内部控制体系。同时，公司强调风险预警能力和执行能力，对规范业务发展、防范金融风险、保护资产安全等方面均起到了积极的作用。公司连续多年在中国证监会组织的期货行业分类监管评级中获得期货行业内的最高评级。

### 3. 经验丰富的管理团队

公司拥有一支经验丰富的管理团队，高级管理人员具有管理经验丰富、业务能力强等特点，对期货行业的发展趋势有着敏锐的洞察力，对期货市场变化和客户需求有着深刻的理解和认识，制定了适宜公司的发展战略，成功带领公司实现平稳、快速的成长。公司董事长葛国栋先生于2018年—2021年连续获得“中国期货公司年度最佳掌舵人”荣誉称号，第三批浙江省国有企业“五个一”人才工程杰出经理人，浙江金融创新人物，并在中期协、浙江期货行业协会等行业自律组织和郑商所、上期所等交易所兼任重要职务。

### 4. 领先的研究团队

研究能力是公司得以长期发展的核心竞争力。公司现设有期货研究中心、北京期货研究院两大研究机构，专业研究人员37名，覆盖宏观、黑色、能源、化工、有色、农产品六大板块，人员规模、品种范围、研究水平长期保持行业领先，屡获“最佳期货研究院”、“中国金牌期货研究所”等荣誉称号。两大研究机构传承了永安估值驱动的投资交易理论、宏观-产业-基差的品种分析方法，在单品种策略研究及多品种的对冲套利等方面既有科学理论指导，又有实战经验总结。

一方面，做精做透，深入产业链各环节，捕捉细节矛盾；另一方面，拓宽视角，站在全球宏观及大类资产配置的角度，把握资产轮动。研究机构的产品及服务包括研究报告、路演、调研、“钱潮会”“燕京会”等品牌会议以及定制化的投资咨询业务，独立打造了衍生品综合服务投研平台“源点资讯 App”，以数字化的形式，为投资者提供丰富资讯和优质服务。

### 5. 持续的创新力

公司具有较强的创新意识和与之匹配的创新力，始终以客户需求和行业发展趋势为导向，坚持业务创新、服务创新、模式创新，积极响应监管政策改革、切实回应市场与客户需求，持续引领行业变革升级。多年来，公司率先在行业内推出“一户一码交易”、“24 小时出金”承诺、期货电子化交易系统、保证金封闭管理等多项创新举措，推动了行业高质量发展。近年来，公司上线“源点资讯 App”、私募线上化交易等互联网服务平台，持续打造行业创新发展样本。

### 6. 良好的市场声誉与品牌价值

经过多年积累，凭借良好的业绩与规范的管理，公司获得了监管机构和期货行业的广泛认可，市场影响力不断提升。报告期内，公司主要获奖情况如下：

评选活动	获奖名称	颁发单位
-	2021 年度优秀会员金奖、钢材产业服务奖、有色产业服务奖、贵金属产业服务奖、能化产业服务奖、期权市场服务奖	上海期货交易所
-	2021 年度优秀会员金奖、优秀技术服务奖、优秀农产品产业服务奖、优秀能化产业服务奖、优秀钢铁原燃料产业服务奖、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	大连商品交易所
-	2021 年度优秀会员、产业服务优秀会员、机构服务优秀会员、国际市场服务奖、客户管理奖、农业产业服务奖、纺织产业服务奖、能化产业服务奖、建材产业服务奖	郑州商品交易所
-	烟台营业部获 2021 年度农业产业服务优秀营业部 河南分公司获 2021 年度纺织产业服务优秀营业部 绍兴分公司获 2021 年度能化产业服务优秀营业部 天津分公司获 2021 年度建材产业服务优秀营业部	
-	子公司永安资本获 2021 年度优秀期货做市商奖	
-	分析师姚沁源获评 2021 年度“玻璃高级分析师” 分析师王毅获评 2021 年度“苹果资深高级分析师”	
-	2021 年度优秀会员白金奖、风险管理服务奖（股指期货类、国债期货类）、技术管理奖、国债期货做市商优秀服务会员奖	中国金融期货交易所
-	2021 年度优秀会员奖	上海国际能源交易中心
-	子公司中国新永安期货有限公司获 2021 年境外中介机构突出市场贡献奖	
-	扶贫及乡村振兴工作考评连续六年获得行业第一	中国期货业协会
-	期货公司党建优秀案例	中国期货业协会
-	2020-2021 年全国金融系统思想政治工作优秀单位	中国金融思想政治工作研究会
第四届“郑商所杯”全国大学生金融模拟交易大赛	优秀组织奖	中国期货业协会 郑州商品交易所
2021 年金融支持江西经济高	赣州于都肉鸡饲料县域覆盖“保险+期货”项目获评“创新优秀项目”	中国人民银行南昌中心支行

评选活动	获奖名称	颁发单位
质量发展 创新优秀 项目评展 活动		江西省人民政府 金融工作办公室
-	吉林辖区 2021 年度“保险+期货”项目贡献奖	吉林省证券业协会 “保险+期 货”服务站
-	2021 年度卓越品牌力企业	经济观察报

### 7. 较强的区位优势与科学的网点布局

公司总部设在杭州，形成了以浙江省为中心，以全国各主要城市与产业密集区为重点、以中西部地区为培育对象的全国网点布局规划。

#### (1) 区域优势明显

浙江省是中国最富庶的地区之一，综合经济实力位居全国前列。报告期内，浙江省 GDP 为 3.62 万亿元，同比增长 2.5%，在疫情直接冲击下增速依然与全国持平，城镇和农村居民人均可支配收入均位居全国前列。浙江省作为我国重要的制造业中心，为公司带来了丰富的行业机会。近年来，浙江省陆续出台一系列政策促进地区经济发展，尤其是金融服务行业的发展，为公司发展打下了坚实的区域基础。

#### (2) 网点布局科学合理

公司营业网点具有数量多、质量突出的特点。截至报告期末，公司在境内共设有 26 家分公司和 18 家营业部，是境内营业网点最多的期货公司之一，在北京、上海、广州、深圳等国内一线城市以及工业产业发达的地区（如环渤海地区）设有多家分支机构。

### 8. 完善的投资者教育平台

期货和衍生品作为复杂的金融工具，对投资者的专业性要求较高。公司已建立完善的投资者教育平台，为投资者提供以投资者教育为中心的增值服务，增强客户粘性。针对机构客户与专业投资客户，公司通过组织高端沙龙、搭建沟通平台，促进公司与客户、客户与客户之间的沟通交流；针对产业客户，公司通过品种推介会、套保专题培训、上门授课等形式，引导产业客户树立成熟的风控理念，同时协助产业客户建立套期保值制度，并指导其进行套期保值交易操作；针对中小投资者，公司重点培育客户的风险管理能力、资金管理能力和交易技术等。

## 三、经营情况的讨论与分析

上半年，受疫情反复、俄乌冲突、全球通货膨胀高企等因素影响，金融市场下行压力加大，公司相关金融资产投资收益（含公允价值变动收益，下同）较上年同期出现一定幅度的下滑，公司整体业绩出现一定程度的波动。上半年，公司营业收入 195.51 亿元，同比增长 17.18%；归属于母公司股东的净利润 3.16 亿元，同比下降 57.27%。截至 2022 年 6 月末，公司净资产和净资本分别达到 115.45 亿元和 38.59 亿元。从单季度看，公司第二季度实现归属于母公司股东的净利润 2.83 亿元，较第一季度环比增长 7.7 倍，在前期市场风险逐步释放的基础上，公司业绩呈现增长态势。

上半年，公司正式发布“十四五”战略规划，锚定行业领先、独具特色的衍生品投行战略目标，通过“五个永安”战略路径，打造大宗商品投行、大类资产配置专家、产融资源整合者，支撑公司多元化的业务增长，更好服务实体经济稳健发展，力争实现上市后的“二次飞跃”。

#### 1. 期货经纪业务

报告期内，公司期货经纪成交量和成交金额随市场有所下降。以双边计算，公司境内期货代理交易成交手数 0.94 亿手，成交金额 7.85 万亿元。截至报告期末，客户权益达到 492.32 亿元，继续保持快速增长。

面对大幅波动的市场行情，公司进一步优化合规风控体系、强化数字系统建设、保持和客户的高效沟通，有效防范了业务风险。在客户服务方面，公司结合博士后工作站和杭州、北京两大

研究机构，持续打造投资、研究、服务三位一体平台，提升投研服务水平和能力；聚焦大宗商品热点行情，举办“钱潮会”、“西子汇”黑色投资论坛、“金陵汇”资产配置财富沙龙等 120 场活动，覆盖金融期货期权、黑色、生猪等多个热点品种，形成品牌效应；公司投研平台“源点资讯 App”重磅推出产业链中心，新增注册用户 1,718 户，新增点击量 129.45 万次。

## 2. 基金销售业务

报告期内，公司基金销售业务受多重因素影响，总体销售规模有所下降。公司严守产品质量关、业务风控关、客户服务关，提升宏观研究能力，适度扩展产品标的，最大程度减少产品净值回撤的不利影响。报告期内，基金销售业务分部实现收入为 0.75 亿元。

在拓展大类资产配置能力方面，公司依托财富生态圈的平台资源优势，持续加快推进“鲲鹏私募成长计划”，广泛挖掘优秀私募基金管理人，为客户精选多层次、多元化的资产标的。截至 2022 年 6 月末，参与报名的客户接近 550 家，管理人覆盖北上广等 20 个地区，54 家私募机构进入公司代销管理人序列。

## 3. 资产管理业务

报告期内，公司资产管理业务严格遵循“资管新规”要求开展业务。以产品安全、风险可控、稳健盈利为目标，坚持投研赋能理念，在深耕商品与金融衍生品市场的基础上，打造风险可控、盈利能力较强的资管产品。目前，公司已经打造了“永盈系列”、“永致系列”等主动管理系列产品 and “CTA 联盟”、“混合优选”等 FOF 系列产品。

报告期内，资产管理业务分部实现收入 1,751.70 万元。

## 4. 风险管理业务

公司主要通过子公司永安资本开展风险管理业务。公司紧抓发展机遇，向永安资本增资 8 亿元，助推大宗商品投行建设。报告期内，公司风险管理业务分部实现营业收入 189.81 亿元，营业利润 2.08 亿元，同比分别增长 21.14% 和 14.71%。

### (1) 基差贸易业务

报告期内，基差贸易业务经受住了复杂宏观环境、疫情阻断物流等考验，持续保持强劲、稳定的盈利能力，同时持续推进贸易商厂库，钢材进出口、化工含权贸易，加工费套保等业务模式创新，积极布局广期所创新品种，上海区域业务板块积极利用数字化手段，确保了业务的平稳开展。在产品方面，化工、黑色和农产品三足鼎立的业务板块格局进一步巩固。截至报告期末，贸易商厂库合计达到 12 个，成为助力实体企业“采购、销售、仓储、物流”一体化风险管理新抓手。报告期内，基差贸易销售规模达到 185 亿元，同比增长 19%。

### (2) 场外衍生品业务

报告期内，场外衍生品业务克服权益市场单边下跌行情，努力控制业务回撤影响，共开展场外衍生品交易 4,693 笔，交易类型包含场外期权、收益互换、掉期等，累计开仓名义金额 586 亿元，较去年同期增长 1.73%。

### (3) 做市业务

报告期内，永安资本有效提升做市管理能力，逐步形成投研成果持续转化机制，建立“模型研究-需求设计-技术开发-策略测试-发布上线-维护分析”流程，提升团队自主创新能力。上半年，做市业务共参与期货做市品种 19 个，期权做市品种 5 个。得益于系统迭代、策略创新及风控完善，做市业务在报告期内利润率有较大提升。

## 5. 境外金融服务业务

公司主要通过新永安金控及其子公司开展境外业务。报告期内，新永安金控及其子公司积极应对海外疫情等不利影响，做大业务规模，拓宽业务领域，保持境外业务的盈利能力，持续提高境外综合金融服务能力。

境外经纪业务规模保持增长，期货经纪业务累计成交 246 万手期货期权合约，期末客户权益达到 4.15 亿美元，较上年末增长 11.84%。积极开展证券业务，为客户提供咨询、融资等增值服务，累计成交金额达到 33.73 亿港元。境外财富管理业务日益成熟，产品端覆盖大类资产配置、结构化/固收策略、期货 CTA 策略、主观/量化权益类等四条产品线；客户端实现结构多元化，涵盖高净值客户、家族办公室、金融机构以及产业机构，共代销基金产品 11 个，新增基金销售 3,909 万美元，打开了为高净值客户提供全球资产配置服务的空间。境外风险管理业务稳步开拓，新永安实业继续推进合作保值、代理采购和贸易融资三大业务模式，设计并推广合作保值及人民币汇率对冲等创新方案。

报告期内公司经营情况的重大变化，以及报告期内发生的对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项

适用 不适用

#### 四、报告期内主要经营情况

##### (一) 主营业务分析

##### 1 财务报表相关科目变动分析表

单位：元币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	19,551,137,533.56	16,684,579,435.27	17.18
营业成本	19,159,303,463.54	15,892,444,841.42	20.56
经营活动产生的现金流量净额	3,355,665,470.90	4,155,603,121.45	-19.25
投资活动产生的现金流量净额	55,655,721.49	52,028,378.33	6.97
筹资活动产生的现金流量净额	-913,825,168.79	1,444,236,455.58	-163.27

营业收入变动原因说明：公司本期营业收入 195.51 亿元，同比上升 17.18%，主要系风险管理业务规模增加，详情请参见本报告“第十节 十九、6、分部信息”。

营业成本变动原因说明：公司本期营业成本 191.59 亿元，同比上升 20.56%，主要系风险管理业务规模增加，详情请参见本报告“第十节 十九、6、分部信息”。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：公司本期经营活动产生的现金流量净额 33.56 亿元，同比下降 19.25%，主要系购买交易性金融资产支付的现金增加 7.15 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：公司本期投资活动产生的现金流量净额 0.56 亿元，同比增长 6.97%，主要系购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金减少。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：公司本期筹资活动产生的现金流量净额-9.14 亿元，上年同期数 14.44 亿元，主要系取得借款所收到的现金减少 12.07 亿元，偿还债务支付的现金增加 9.09 亿元。

##### 2 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

##### (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

##### (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

##### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上年期末数	上年期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上年期末变动比例 (%)	情况说明
融出资金	99,846,759.40	0.14	169,641,765.76	0.26	-41.14	主要系孖展融资规模减少
应收款项	376,759,700.34	0.53	216,781,470.18	0.33	73.80	主要系基差贸

						易业务规模扩大所致
应收款项融资	7,827,887.49	0.01	22,178,136.39	0.03	-64.70	主要系票据流转速度加快,导致期末余额减少
预付款项	997,638,428.66	1.39	381,942,375.25	0.59	161.20	主要系基差贸易规模增加,现货贸易量增加所致
应收风险损失款	2,209,209.78	0.00	5,008,178.05	0.01	-55.89	主要系本期收回部分应收风险损失款
其他应收款	1,887,532,211.29	2.63	1,134,893,873.37	1.75	66.32	主要系场外衍生品业务规模增加
存货	2,156,125,165.59	3.01	1,478,205,884.40	2.28	45.86	主要系基差贸易业务规模扩大所致
债权投资	20,010,915.07	0.03			不适用	系本期新增投资公司债
其他债权投资			50,061,273.97	0.08	-100.00	系上期末可转让定期存单本期赎回
使用权资产	128,685,660.87	0.18	95,568,951.69	0.15	34.65	主要系本期续签房租合同所致
递延所得税资产	452,700,278.85	0.63	278,735,865.22	0.43	62.41	主要系公允价值变动导致
其他资产	63,805,673.29	0.09	99,091,092.13	0.15	-35.61	主要系预付税金减少
合同负债	1,035,523,823.78	1.44	760,955,019.66	1.17	36.08	主要系基差贸易规模增加,现货贸易量增加所致
应付期货投资者保障基金	429,993.26	0.00	1,015,640.53	0.00	-57.66	主要系本期上缴各交易所投资者保障基金
应交税费	185,403,906.18	0.26	335,888,964.10	0.52	-44.80	主要系应交企业所得税减少
其他应付款	3,960,814,870.06	5.52	2,731,220,424.71	4.20	45.02	主要系场外衍生品业务规模增加和计提应付股利
应付债券			301,378,356.16	0.46	-100.00	系全额赎回公司次级债
租赁负债	121,611,046.22	0.17	91,920,041.43	0.14	32.30	主要系本期续签房租合同所致
递延所得税负债	265,459,952.67	0.37	133,180,625.00	0.20	99.32	主要系公允价值

						值变动导致
其他负债	133,786,767.53	0.19	81,535,287.37	0.13	64.08	主要系待转销项税额增加

其他说明  
无

## 2. 境外资产情况

适用  不适用

### (1) 资产规模

其中：境外资产 4,491,155,404.82（单位：元币种：人民币），占总资产的比例为 6.26%。

### (2) 境外资产占比较高的相关说明

适用  不适用

## 3. 截至报告期末主要资产受限情况

适用  不适用

单位：元

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	238,660,804.52	保函保证金、票据保证金、信用证保证金、ETC 押金冻结等
存货	358,466,127.21	质押
交易性金融资产	1,299,300,296.14	融券担保品
合计	1,896,427,227.87	

## 4. 其他说明

适用  不适用

### (四) 投资状况分析

#### 1、 对外股权投资总体分析

适用  不适用

(1) 报告期内发生对外股权投资变动：

1) 2022 年 1 月 26 日，公司召开第三届董事会第十九次会议，为进一步提升全资子公司永安资本的资本实力，结合公司战略发展规划，同意公司向永安资本增资 8 亿元，已于 2 月 11 日完成增资事项并办妥工商变更登记。

2) 2022 年 3 月 20 日，公司召开第三届董事会第二十次会议，同意永安资本通过浙江产权交易所公开挂牌转让其持有的阳富教育咨询服务（深圳）有限公司 10% 的股权，截至本报告批准报出日，该事项仍在推进中。

(2) 报告期末，公司合并报表口径长期股权投资为 938,110,428.50 元，包括永安国富期末账面价值 903,445,757.99 元，玉皇山南期末账面价值 27,046,562.45 元及 OSTC YONGAN 期末账面价值 7,618,108.06 元。

#### (1) 重大的股权投资

适用  不适用

**(2) 重大的非股权投资**

适用 不适用

**(3) 以公允价值计量的金融资产**

适用 不适用

详见本报告“第十节 十三、公允价值的披露”之说明。

**(五) 重大资产和股权出售**

适用 不适用

**(六) 主要控股参股公司分析**

适用 不适用

1. 永安资本，注册资本 21.00 亿元，永安期货持有其 100% 股权。截止报告期末，永安资本总资产 1,190,456.55 万元，净资产 330,339.71 万元；报告期内实现营业收入 1,852,228.90 万元，净利润 16,671.74 万元。

永安资本的主营业务包括以自有资金从事投资活动；信息咨询服务(不含许可类信息咨询服务)；普通货物仓储服务(不含危险化学品等需许可审批的项目)；国内贸易代理；食用农产品批发；棉、麻销售；针纺织品及原料销售；纸制品制造；文具用品批发；金属矿石销售；贵金属冶炼；非金属矿及制品销售；金属制品销售；金属材料销售；高性能有色金属及合金材料销售；五金产品批发；煤炭及制品销售；建筑材料销售；肥料销售；谷物销售；橡胶制品销售；高品质合成橡胶销售；塑料制品销售；功能玻璃和新型光学材料销售；日用品销售；合成材料销售；五金产品零售；再生资源加工；再生资源销售；石油制品销售(不含危险化学品)；化工产品销售(不含许可类化工产品)；货物进出口；畜禽收购；牲畜销售；食品销售(仅销售预包装食品)(除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动)；危险化学品经营；道路货物运输(不含危险货物)；食品销售(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以审批结果为准)。

2. 中邦实业，注册资本 22,000.00 万元，永安期货持有其 100% 股权。截止报告期末，中邦实业总资产 33,179.16 万元，净资产 30,331.65 万元；报告期内实现净利润 268.43 万元。

中邦实业的主营业务包括食品经营(凭许可证经营)，金属材料、建材、化工产品为原料(不含危险品及易制毒化学品)、橡胶及制品、轻纺产品、纸张及纸浆、初级食用农产品、饲料、燃料油、焦炭、棉花、煤炭(无储存)、贵金属的销售，商品信息服务，投资管理，投资咨询，经营进出口业务。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)。

3. 新永安金控，注册资本 55,950.00 万港元，永安期货持有其 100% 股权。截止报告期末，新永安金控总资产折合人民币 378,835.20 万元，净资产折合人民币 74,068.55 万元；报告期内实现营业收入折合人民币 7,121.57 万元，净利润折合人民币 1,026.54 万元。

新永安金控的主营业务为投资控股，通过其子公司覆盖境外期货经纪业务、资产管理业务、证券业务、放贷业务等多个领域。

4. 永安国富，注册资本 10,000.00 万元，永安期货持股比例 31.35%。截止报告期末，永安国富总资产 373,865.80 万元，净资产 288,144.33 万元；报告期内实现营业收入 155,332.17 万元，净利润 9,609.03 万元。

永安国富的主营业务包括投资管理，资产管理。(未经金融等监管部门批准，不得从事向公众融资存款、融资担保、代客理财等金融服务)(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)。

**(七) 公司控制的结构化主体情况**

适用 不适用

截止报告期末，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、永盈 3 号集合资产管理计划和永盈 7 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。

## 五、其他披露事项

### (一) 可能面对的风险

√适用 □不适用

#### 1. 可能面对的风险

公司经营中面临的风险主要有：市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、合规及法律风险、信息技术风险等。

##### (1) 市场风险

市场风险是指因市场价格的不利变动而使公司可能发生损失的风险，市场价格包括但不限于利率、汇率、股票价格和商品价格等。市场风险使得公司可能面临经纪业务手续费持续下降、客户流失及客户保证金减少，管理或代销的资产管理产品收益降低、甚至遭受损失，公司持有的各类资产发生亏损等不利情形，从而影响公司的经营业绩和财务情况。

##### (2) 信用风险

信用风险一般是指因交易对手方、客户未履行合同所规定的义务从而导致损失的可能性。信用风险使得公司可能面临客户保证金透支或穿仓、资管产品投资标的因信用情况恶化导致收益降低、风险管理业务中交易对手发生违约等不利情形，致使公司承担经济损失、甚至引起法律诉讼。

##### (3) 操作风险

操作风险是指由不完善或失效的内部程序、人员操作失误或不当行为和系统或外部事件导致损失的风险。公司各个业务环节均有可能产生操作风险，使得公司可能面临客户投诉、监管处罚或遭受财产损失。

##### (4) 流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

##### (5) 合规及法律风险

合规及法律风险是指公司因不合规行为而遭受法律制裁、监管处罚、声誉损失的风险。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。如果公司因为存在不遵守相关法律法规及监管政策要求而面临承担法律风险、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及声誉造成损失。

##### (6) 信息技术风险

信息技术风险是指公司经营及业务开展过程中所依赖的电子信息系统可能会面临软硬件故障、通讯线路故障、恶意入侵等不可预料事件带来的信息系统风险隐患。具体表现在以下几个方面：一是因自然灾害、战争或恐怖主义、火灾、停电、硬件或软件故障或缺陷、数据丢失或泄漏、故意破坏、计算机病毒、垃圾邮件攻击、未经授权存取、客户失误或使用不当等类似事件而导致中断的风险；二是公司信息技术系统受到通讯网络运营商、交易所等的 IT 系统运行状况影响而出现的风险；三是公司自研系统与外部采购系统兼容可能出现的风险；四是对因互联网、区块链、AI 技术等运用受到政策影响可能被暂停、更换的风险等。上述风险的发生可能会对公司业务开展、客户服务、风险管理及公司的声誉和形象带来负面影响，进而对公司经营业绩和财务状况造成不利影响。

#### 2. 主要风险的防范对策和措施

##### (1) 市场风险

期货经纪业务方面，公司结合国内外宏观经济和市场情况进行分析，遵照交易所规则与窗口指导意见，根据公司内部风控制度，通过适当调整公司保证金水平和风控策略，对客户的资金风险与持仓风险进行监控与管理，以抵御市场剧烈波动导致的风险。公司定期与不定期对风险监管指标进行压力测试和敏感性测试，并根据测试结果及时采取相关措施。公司重视对投资者的教育，及时了解客户动态，掌握客户抵御风险的能力水平，尽可能地避免客户因市场波动导致违约。

资产管理业务方面，公司通过提升投研水平，有效识别标的风险，实时监控资产管理产品的各项风控指标，设置相应的杠杆水平，控制投资仓位，及时进行风险警示及处理。

基金销售业务方面，公司加强了产品准入审核，严格落实净值管控，及时预警发生风险的产品，以防止产品净值发生大幅波动。

风险管理业务方面，公司根据实际业务情况制定相应的交易风险指标管理制度，设置风险敞口、最大亏损、期权希腊值等交易风险指标，对各项指标进行严密监控，积极防范和处置市场风险。

自有资金投资方面，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，设立科学合理的风险监控指标，强化对投资项目的市场风险管控。

### （2）信用风险

期货经纪业务方面，公司通过严格落实客户实名制原则，加强投资者适当性管理，有效识别客户身份，了解客户信用状况、财务状况及风险承受能力等信息；严格落实客户保证金管理制度及风险控制制度，确保风控执行的合规性及有效性；建立风险处置预案，构建风险防控网，以有效应对客户信用风险。

资产管理业务方面，公司在全面研究以及风险评估的基础上进行投资，构建股票打分和债券信用评价体系，设置可投资股票池、债券池并进行长期分级、维护与跟踪。

风险管理业务方面，公司加强客户管理，建立客户准入制度。同时，对场外衍生品业务客户开展投资者适当性评级、匹配、回访等相关工作，严格执行客户履约保证金制度，制定相应风险控制流程，降低客户违约的可能性。

### （3）操作风险

公司持续健全和完善内部管理制度和业务流程，提升系统自动化水平，对员工在上岗前进行全面的操作流程培训，持续提升员工专业能力。公司各部门、分支机构及子公司主动识别存在于内部制度、流程、员工行为、信息技术系统等方面面临的操作风险，建立应急预案、定期监督检查，从而降低操作风险发生的可能性。

### （4）流动性风险

公司一方面持续加强与银行合作，扩大公司授信，保持授信规模稳定；另一方面，通过日常流动性跟踪、大额资金需求预约管理等机制，拟定融资策略并进行动态调整，拓展多元化的融资渠道，定期评估融资的结构和规模对流动性风险的影响，持续改善公司负债结构。

### （5）合规及法律风险

公司牢固树立合规经营的理念，将“合规创造价值”引入考核指标体系，已建立了符合监管规定的、较为完善的合规管理制度。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经营管理各环节开展事前、事中、事后的内部监督。公司加强企业文化和法制教育，“坚持合法合规”的企业文化深入人心。公司稽核督查总部协助首席风险官工作，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。同时，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。

### （6）信息技术风险

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；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。

## （二）其他披露事项

适用 不适用

## 第四节 公司治理

### 一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
------	------	----------------	-----------	------

2022 年第一次临时股东大会	2022 年 2 月 14 日	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)	2022 年 2 月 15 日	审议通过《关于变更公司注册资本、公司类型并相应修订公司章程的议案》等议案(详见编号 2022-011 之公告)
2022 年第二次临时股东大会	2022 年 4 月 6 日	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)	2022 年 4 月 7 日	审议通过《关于调整金融资产投资额度的议案》等议案(详见编号 2022-019 之公告)
2021 年年度股东大会	2022 年 6 月 21 日	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)	2022 年 6 月 22 日	审议通过《2021 年度董事会工作报告》等议案(详见编号 2022-033 之公告)

#### 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

#### 股东大会情况说明

适用 不适用

1. 公司 2022 年第一次临时股东大会于 2022 年 2 月 14 日在杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 2219 会议室召开。会议采取现场投票与网络投票相结合的方式,审议通过了《关于变更公司注册资本、公司类型并相应修订公司章程的议案》《关于同意提前偿还公司次级债的议案》《关于变更公司董事的议案》《关于变更公司监事的议案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于为公司和董事、监事、高级管理人员购买责任保险的议案》。该次股东大会由公司董事会召集,葛国栋先生主持。

2. 公司 2022 年第二次临时股东大会于 2022 年 4 月 6 日在杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 2219 会议室召开。会议采取现场投票与网络投票相结合的方式,审议通过了《关于调整金融资产投资额度的议案》《关于增加为浙江永安资本管理有限公司提供担保额度的议案》《关于变更公司监事的议案》。该次股东大会由公司董事会召集,葛国栋先生主持。

3. 公司 2021 年年度股东大会于 2022 年 6 月 21 日在杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 2219 会议室召开。会议采取现场投票与网络投票相结合的方式,审议通过了《2021 年度董事会工作报告》《2021 年度监事会工作报告》《2021 年年度报告及摘要》《2021 年度财务决算报告》《关于 2021 年度利润分配的议案》《关于确认 2021 年度关联交易的议案》《关于预计 2022 年度日常关联交易的议案》《2021 年度风险监管指标专项报告》,会议还听取了《2021 年度独立董事述职报告》。该次股东大会由公司董事会召集,葛国栋先生主持。

## 二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

姓名	担任的职务	变动情形
方铁道	董事长	离任
金朝萍	董事	离任

王正甲	董事	选举
胡慧珺	监事	离任
胡海涛	监事	选举
邵珺	监事会主席	离任
韩伟锋	监事会主席	选举
吕仙英	监事	离任
吴晓峰	监事	选举
葛国栋	总经理	离任
黄志明	副总经理	离任
石春生	副总经理	离任
陈敏	首席风险官	离任
葛国栋	董事长	选举
黄志明	总经理	聘任
黄峥嵘	副总经理	聘任
马志伟	副总经理	聘任
杨敏	副总经理	聘任
吕仙英	首席风险官	聘任

#### 公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

√适用 □不适用

1. 董事会于 2022 年 1 月 25 日收到方铁道先生递交的《辞职报告》。方铁道先生因组织调动原因申请辞去公司董事、董事会战略发展委员会委员及董事长职务。

2. 2022 年 1 月 26 日，公司第三届董事会第十九次会议审议通过了《关于变更公司董事的议案》，同意王正甲先生为公司第三届董事会非独立董事候选人。经公司 2022 年第一次临时股东大会审议通过，选举王正甲先生为第三届董事会董事。同时，金朝萍女士不再担任董事职务。

3. 2022 年 1 月 26 日，公司第三届监事会第十四次会议审议通过了《关于变更公司监事的议案》，同意胡海涛女士为公司第三届监事会监事候选人。经公司 2022 年第一次临时股东大会审议通过，选举胡海涛女士为第三届监事会监事。同时，胡慧珺女士不再担任监事职务。

4. 2022 年 3 月 20 日，公司第三届监事会第十五次会议审议通过了《关于变更公司监事的议案》，同意韩伟锋先生为公司第三届监事会监事候选人。经公司 2022 年第二次临时股东大会审议通过，选举韩伟锋先生为第三届监事会监事。同时，邵珺女士不再担任监事职务。公司第三届监事会第十六次会议选举韩伟锋先生为监事会主席。

5. 2022 年 7 月 20 日，公司第三届董事会第二十二次会议审议通过了《关于选举董事长的议案》，选举葛国栋先生担任公司董事长，任期自本次董事会选举通过之日起至第三届董事会成员任期届满之日止。

6. 2022 年 8 月 9 日，公司召开第三届职工代表大会 2022 年第二次会议，选举吴晓峰先生为第三届监事会职工监事，任期自职工代表大会选举通过之日起至第三届监事会成员任期届满之日止。同时，吕仙英女士不再担任职工监事职务。

7. 2022 年 8 月 19 日，公司召开第三届董事会第二十三次会议，审议通过了《关于聘任公司高级管理人员的议案》。同意聘任黄志明先生为公司总经理，同意聘任黄峥嵘先生、马志伟先生、杨敏女士为公司副总经理，同意聘任吕仙英女士为公司首席风险官。同时，葛国栋先生不再担任总经理职务，黄志明先生不再担任副总经理职务。石春生先生和陈敏女士分别辞去副总经理和首席风险官职务。根据相关监管规定，陈敏女士履职至 2022 年 9 月 17 日，吕仙英女士自 2022 年 9 月 18 日起正式履职。

### 三、利润分配或资本公积金转增预案

#### 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
每 10 股送红股数（股）	不适用

每 10 股派息数(元) (含税)	不适用
每 10 股转增数 (股)	不适用
利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明	
不适用	

#### 四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

##### (一) 相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

##### (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

## 第五节 环境与社会责任

### 一、环境信息情况

#### (一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其主要子公司的环保情况说明

适用 不适用

#### (二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

#### (三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

#### (四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

#### (五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

公司坚持绿色共享、节能环保的运营理念，倡导绿色运营办公，切实履行环境保护主体责任。公司最大程度上利用信息技术等手段，通过 OA 办公系统、视频与电话会议系统等多种软件，以电子流转的方式进行业务审批，推行无纸化办公，最大程度地减少纸质文件的使用，合理利用办公资源，减少不必要的资源浪费。公司强化公车管理，合理安排公车资源，节省用车成本，鼓励员工节约社会与自然资源，保护环境，减少污染，提倡可持续发展，呵护地球环境。

报告期内，公司不存在因违反环保方面的法律法规而受到处罚的情况。

## 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

√适用 □不适用

报告期内，公司投入乡村振兴专项帮扶资金约 139 万元，同时公司工会投入消费帮扶资金约 67 万元，连续 6 年获得中国期货业协会组织的期货公司扶贫（乡村振兴）工作情况考评第一名。

公司坚持以党建引领乡村振兴工作，其中《永安期货：“七个一”工作法打造期货行业“助力共同富裕红色典范”》入选中国期货业协会评选的 15 个期货公司党建优秀案例之一。

公司坚持发挥专业优势服务“三农”，上半年开展了 70 多个“保险+期货”项目，覆盖全国 15 个省份，涉及 8 个农产品期货品种，承保现货超过 8 万多吨，为助力乡村振兴和农户增收发挥了重要作用。

公司坚持关心和支持下一代成长，2022 年 4 月在国家乡村振兴重点帮扶县甘肃省积石山自治县和靖远县顺利完成“班班有个图书角”项目，共在两县建成图书角 402 个，每个图书角包含 70 本经典书目，目前已累计在全国建成班级图书角 1,014 个，为乡村孩子营造了高品质阅读环境；2022 年 5 月，公司赴国家乡村振兴重点帮扶县四川省石渠县开展“永安助学筑梦未来”帮扶行动，将在 3 年内投入 63.6 万元帮助中小学生和大学生，已向首批 81 名困难学生发放助学金。

公司积极助力浙江共同富裕示范区建设，相继出台了《关于期货赋能山区 26 县跨越式高质量发展助力共同富裕示范区建设的实施意见》和《关于期货支持浙江高质量发展建设共同富裕示范区的实施意见》。公司还联合各类金融机构在衢州市推进生猪“保险+期货+融资+订单收购”创新试点，帮助养殖户应对生猪价格波动带来的风险，助力生猪稳产保供。

## 第六节 重要事项

### 一、承诺事项履行情况

#### (一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开发行相关的承诺	解决关联交易	财通证券、浙江产业基金、省金控、浙江东方、浙经建投	减少和规范关联交易的承诺	长期	否	是	不适用	不适用
	股份限售	财通证券、浙江产业基金、省金控	股份流通限制及自愿锁定股份的承诺	自公司股票上市之日起三十六个月内	是	是	不适用	不适用
	股份限售	浙江东方、浙经建投	股份流通限制及自愿锁定股份的承诺	自公司股票上市之日起十二个月内	是	是	不适用	不适用
	股份限售	非独立董事、高级管理人员	股份流通限制及自愿锁定股份的承诺	自公司股票上市之日起十二个月内	是	是	不适用	不适用
	股份限售	监事	股份流通限制及自愿锁	自公司股票上市之日起十二个月内	是	是	不适用	不适用

			定股份的承 诺					
股份限售	财通证券、 浙江产业基 金、省金 控、浙江东 方、浙经建 投	持股意向及 减持意向的 承诺	长期	否	是	不适用	不适用	
其他	公司、董事 (不含独立 董事及未在 公司领取薪 酬的董事) 及高级管理 人员	稳定股价的 承诺	自公司股票 上市之日起 三年内	是	是	不适用	不适用	
其他	公司董事、 高级管理人 员	填补摊薄即 期回报措施 的承诺	长期	否	是	不适用	不适用	
其他	公司、财通 证券、浙江 产业基金、 省金控、浙 江东方、浙 经建投、董 事、监事、 高级管理人 员	未履行承诺 的约束措施	长期	否	是	不适用	不适用	

注 1：持有本公司 5%以上股份的股东出具了《关于减少和规范关联交易的承诺函》，具体如下：“（1）截止本承诺出具日，除永安期货已经披露的情形之外，本公司及本公司控制的公司与永安期货不存在其他未披露的关联交易事项。（2）本公司不会实施影响永安期货独立性的行为，并将保障永安期货在资产、人员、财务、业务和机构等方面的独立性。（3）本公司将尽量避免与永安期货之间发生关联交易事项，对于不可避免发生的关联交易，本公司将促使此等交易在平等、自愿的基础上，按照公平、公允和等价有偿的原则进行，交易价格将按照市场公认的合理价格确定。（4）本公司将严格遵

守有关法律法规、永安期货公司章程及关联交易决策制度等相关制度中的有关规定，依法履行关联交易的审议和决策程序，并及时对关联交易事项进行信息披露。（5）本公司保证不会利用关联交易转移永安期货的利润，不会通过影响永安期货的经营及财务决策来损害永安期货及其他股东的合法权益。

（6）本公司及本公司控制的公司不以借款、代偿债务、代垫款项或者其他任何方式占用永安期货资金，也不会要求永安期货违规提供担保。”

注 2：公司实际控制人控制的公司财通证券、浙江产业基金、省金控关于股份流通限制及自愿锁定股份的承诺：“自永安期货股票上市之日起三十六个月内，不转让或者委托他人管理本公司直接或间接持有的永安期货本次公开发行股票前已发行的股份，也不由永安期货回购该部分股份；但本公司与受让方存在控制关系，或者均受同一实际控制人控制的，自永安期货股票上市之日起一年后，经实际控制人申请并经证券交易所同意，可豁免遵守该承诺。本公司作为永安期货的实际控制人控制之公司或持股 5% 以上的主要股东身份，不会从事将持有的永安期货股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内买入的行为，否则由此所得收益归永安期货所有。相关法律法规和规范性文件对股份锁定期安排有特别要求的，以相关法律法规和规范性文件为准。在锁定期满后，本公司在减持永安期货股票时将遵守《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律法规和规范性文件，并履行必要的备案、公告程序。若上述锁定期与证券监督管理机构的最新监管要求不相符，本公司同意根据证券监督管理机构的最新监管要求进行相应调整，锁定期届满后按证券监督管理机构的有关规定执行。”

注 3：公司持股 5% 以上股东浙江东方、浙建投关于股份流通限制及自愿锁定股份的承诺：“自永安期货股票上市之日起十二个月内，不转让或者委托他人管理本公司直接或间接持有的永安期货本次公开发行股票前已发行的股份，也不由永安期货回购该部分股份。本公司作为持股 5% 以上的主要股东身份，不会从事将持有的永安期货股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内买入的行为，否则由此所得收益归永安期货所有。相关法律法规和规范性文件对股份锁定期安排有特别要求的，以相关法律法规和规范性文件为准。在锁定期满后，本公司在减持永安期货股票时将遵守《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律法规和规范性文件，并履行必要的备案、公告程序。若上述锁定期与证券监督管理机构的最新监管要求不相符，本公司同意根据证券监督管理机构的最新监管要求进行相应调整，锁定期届满后按证券监督管理机构的有关规定执行。”

注 4：公司非独立董事、高级管理人员关于股份流通限制及自愿锁定股份的承诺：“自永安期货股票上市之日起十二个月内，不转让或者委托他人管理本人直接或间接持有的永安期货本次公开发行股票前已发行的股份，也不由永安期货回购该部分股份；除前述锁定期外，在本人就任时确定的任期内和任期届满后六个月内每年转让的股份不超过本人所直接或间接持有的公司股份总数的 25%，离职后半年内不转让本人所直接或间接持有的公司股份。在永安期货股票上市后六个月内如永安期货股票连续二十个交易日的收盘价均低于发行价，或者上市后六个月期末（如该日不是交易日，则为该日后第一个交易日）收盘价低于发行价，本人持有永安期货股票的锁定期自动延长六个月。如果本人在锁定期满后两年内减持永安期货股票的，减持价格不低于发行价。自永安期货股票上市至减持期间，永安期货如有权益分派、公积金转增股本、配股等除权除息事项，则相关价格将进行相应调整。本人作为董事/高级管理人员身份，不会从事将持有的永安期货股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内买入的行为，否则由此所得收益归永安期货所有。相关法律法规和规范性文件对股份锁定期安排有特别要求的，以相关法律法规和规范性文件为准。在锁定期满后，本人在减持永安期货股票时将遵守《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律法规和规范性文件，并履行必要的备案、公告程序。若上述锁定期与证券监督管理机构的最新监管要求不相符，本人同意根据证券监督管理机构的最新监管要求进行相应调整，锁定期届满后按证券监督管理机构的有关规定执行。本人不因职务变更、离职等原因放弃履行上述承诺。”

注 5：公司监事关于股份流通限制及自愿锁定股份的承诺：“自永安期货股票上市之日起十二个月内，不转让或者委托他人管理本人直接或间接持有的永安期货本次公开发行股票前已发行的股份，也不由永安期货回购该部分股份；除前述锁定期外，在本人就任时确定的任期内和任期届满后六个月

内每年转让的股份不超过本人所直接或间接持有的公司股份总数的 25%，离职后半年内不转让本人所直接或间接持有的公司股份。本人作为监事身份，不会从事将持有的永安期货股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内买入的行为，否则由此所得收益归永安期货所有。相关法律法规和规范性文件对股份锁定期安排有特别要求的，以相关法律法规和规范性文件为准。在锁定期满后，本人在减持永安期货股票时将遵守《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律法规和规范性文件，并履行必要的备案、公告程序。若上述锁定期与证券监督管理机构的最新监管要求不相符，本人同意根据证券监督管理机构的最新监管要求进行相应调整，锁定期届满后按证券监督管理机构的有关规定执行。本人不因职务变更、离职等原因放弃履行上述承诺。”

注 6：公司持股 5%以上股东财通证券、浙江产业基金、省金控、浙江东方、浙经建投关于持股意向及减持意向的承诺：“减持永安期货股份应符合相关法律法规和规范性文件的规定，具体方式包括但不限于交易所集中竞价交易方式、大宗交易方式、协议转让方式等。减持价格将遵守相关法律法规和规范性文件的规定。每次减持时，应提前 3 个交易日通知永安期货本次减持的数量、减持价格区间、减持时间区间等，并配合永安期货按照证券交易所的规则及时、准确地履行信息披露义务。计划通过证券交易所集中竞价交易减持股份的，应当在首次卖出的 15 个交易日前向证券交易所报备减持计划并公告。减持计划的内容应当包括但不限于：拟减持股份的数量、来源、减持时间区间、方式、价格区间、减持原因等，每次披露的减持时间区间不得超过 6 个月。在锁定期满后，本公司在减持永安期货股票时将遵守《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律法规和规范性文件，并履行必要的备案、公告程序。若上述减持承诺与证券监督管理机构的最新监管要求不相符，本公司同意根据证券监督管理机构的最新监管要求进行相应调整。”

注 7：公司、董事（不含独立董事及未在公司领取薪酬的董事）及高级管理人员关于稳定股价的承诺：

#### 1. 稳定股价措施的启动和停止条件

##### 1.1 启动条件

公司股票上市后三年内，若公司股票收盘价连续 20 个交易日均低于公司最近一期末经审计的每股净资产（若因除权除息等事项致使上述股票收盘价与公司最近一期末经审计的每股净资产不具有可比性的，上述每股净资产应做相应调整，下同），且同时满足相关回购、增持公司股份等行为的法律、法规和规范性文件的规定，则触发公司、董事（不含独立董事及未在永安期货领取薪酬的董事）及高级管理人员履行稳定公司股价措施。

##### 1.2 停止条件

实施期间，若出现以下任一情形，则视为本次稳定股价措施实施完毕及承诺履行完毕，已公告的稳定股价方案停止执行：（1）公司股票连续 5 个交易日的收盘价均高于公司最近一期末经审计的每股净资产。（2）继续回购或增持公司股份将导致公司股权分布不符合上市条件。

#### 2. 稳定股价的具体措施

##### 2.1 公司回购

（1）在稳定股价措施的启动条件成就之日（以下简称“触发日”）起 15 个工作日内，除第一大股东可以选择增持公司 A 股股份外，公司应根据法律、法规及公司章程的规定召开董事会，董事会应制定明确、具体的回购方案，方案内容应包括但不限于拟回购本公司股份的种类、数量区间、价格区间、实施期限等内容，并提交公司股东大会审议，回购方案经公司股东大会审议通过后生效。但如果股份回购方案实施前或实施过程中公司股价已经不再满足启动稳定公司股价措施条件的，可不再继续实施该方案。（2）在股东大会审议通过股份回购方案后，公司将依法通知债权人，并向证券监督管理部门、证券交易所等主管部门报送相关材料，办理审批或备案手续。本公司回购价格不高于公司最近一期末经审计的每股净资产，回购股份的方式为集中竞价交易方式、要约方式或证券监督管理部门认可的其他方式。（3）若某一会计年度内公司股价多次触发上述股价稳定措施启动条件的，公司将继续按

照上述股份回购方案执行，但应遵循以下原则：①单次用于回购股份的资金金额不高于上一个会计年度经审计的归属于母公司股东净利润的 10%；②单一会计年度用以稳定股价的回购资金合计不超过上一会计年度经审计的归属于母公司股东净利润的 30%。超过上述标准的，有关稳定股价措施在当年度不再继续实施。但如果下一会计年度继续出现需启动稳定股价措施的情形时，公司将继续按照上述原则执行稳定股价措施。

## 2.2 董事（不含独立董事及未在永安期货领取薪酬的董事）、高级管理人员增持

若公司需公告前述具体稳定股价措施却未如期公告，或明确表示未有股价稳定措施，且公司第一大股东在触发日起的 15 个交易日内未选择采取稳定股价措施并由公司公告，在符合有关法律法规和公司上市地上市规则的情况下，公司董事（不含独立董事及未在永安期货领取薪酬的董事）、高级管理人员应在触发日起的第 15 个交易日后的 10 个交易日内，制定增持公司 A 股股份计划，并由公司公告。公司董事、高级管理人员用于单次及/或连续十二个月增持本公司股份的货币资金不超过该等董事、高级管理人员上一会计年度从公司领取薪酬总和（税前）。

## 2.3 未能履行稳定股价义务的约束措施

自触发日起，公司董事会未如期公告 A 股股份回购方案的，或公司董事会、股东大会审议通过的稳定股价措施方案要求公司回购 A 股股份但未实际履行的，公司将在股东大会及中国证监会指定报刊上公开说明未履行的具体原因并向股东和社会公众投资者道歉；同时，公司董事及高级管理人员未履行关于及时制定股价稳定措施并提交股东大会审议等职责的，相关董事、高级管理人员将被暂停自公司处领取薪酬，直至确实履行相关责任为止。

注 8：公司董事、高级管理人员关于填补摊薄即期回报的措施及承诺：

### 1. 填补摊薄即期回报的措施

#### 1.1 不断完善公司治理，为公司发展提供制度保障

公司将严格遵循《公司法》《证券法》《上市公司治理准则》等法律法规和规范性文件的要求，不断完善公司治理结构，确保股东能够充分行使权利，董事会能够按照法律法规和公司章程的规定行使职权，做出科学、严谨的决策，确保独立董事能够认真履行职责，维护公司整体利益，尤其是中小股东的合法权益，为公司发展提供制度保障。

#### 1.2 进一步提升公司管理水平，提高资产运营效率

公司将继续重视内部控制，实行全面预算管理，有效控制经营风险。公司将通过加强现金流管理及投资管理能力体系建设，提高资产运营效率。

#### 1.3 继续巩固并拓展公司主营业务，提高公司持续盈利能力

公司将继续巩固期货行业的龙头地位，不断拓展公司主营业务，建立以经纪业务为基础，以风险管理业务和财富管理业务为两翼，以境外业务、期权衍生品业务和投资业务为驱动的“一体两翼，三轮驱动”业务体系，不断提升公司主动管理能力，全面推进数字化转型，不断提高公司持续盈利能力。

#### 1.4 强化募集资金管理，提高募集资金使用效率

公司已制定《募集资金管理办法（上市后适用）》，规定募集资金到位后将存放于董事会指定的专项账户中。公司将定期检查募集资金使用情况，确保募集资金得到合法合规使用。公司将通过有效运用本次募集资金，改善融资结构，提升盈利水平，进一步提升经营效益，增厚未来收益，增强可持续发展能力，以填补股东即期回报下降的影响。同时，公司将提示投资者：公司制定填补回报措施不等同于对公司未来利润作出保证。

### 2. 填补摊薄即期回报的承诺

为使公司首次公开发行股票摊薄即期回报填补措施能够得到切实履行，公司董事、高级管理人员承诺：“（1）承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益。（2）承诺对个人的职务消费行为进行约束。（3）承诺不动用公司资产从事与履行职责无关的投资、消费活动。（4）承诺由董事会或提名与薪酬考核委员会制订的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。（5）承诺若公司实施股权激励，

拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。(6) 承诺若未能履行上述承诺,将在股东大会及中国证监会指定的报刊上公开说明未履行上述承诺的具体原因并向股东和社会公众投资者道歉,因违反上述承诺而给公司或者股东造成损失的,承诺将依法承担赔偿责任。”

注 9:公司、财通证券、浙江产业基金、省金控、浙江东方、浙经建投、董事、监事、高级管理人员关于未履行承诺的约束措施:

1. 公司关于未履行承诺的约束措施的承诺

如果本公司未履行招股说明书披露的承诺事项,本公司将在股东大会及中国证监会指定报刊上公开说明未履行承诺的具体原因,并向股东和社会公众投资者道歉。如果因本公司未履行相关承诺事项,致使投资者在证券交易中遭受损失的,本公司将依法向投资者赔偿相关损失。

2. 公司持股 5%以上股东关于未履行承诺的约束措施的承诺

如果因本公司未履行相关承诺事项,致使永安期货、投资者遭受损失的,本公司将依法承担赔偿责任。

3. 公司全体董事、监事、高级管理人员关于未履行承诺的约束措施的承诺:

“如果本人未履行招股说明书披露的承诺事项,本人将在公司股东大会及中国证监会指定报刊上公开说明未履行承诺的具体原因,并向公司股东和社会公众投资者道歉。如果本人未履行招股说明书披露的承诺事项,本人将在前述事项发生之日起停止领取薪酬或津贴,直至本人履行相关承诺事项。如果因本人未履行相关承诺事项,致使公司、投资者遭受损失的,本人将依法承担赔偿责任。”

## 二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

## 三、违规担保情况

适用 不适用

#### 四、半年报审计情况

适用 不适用

#### 五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

#### 六、破产重整相关事项

适用 不适用

#### 七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过人民币 1,000 万元并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10%以上的重大诉讼、仲裁事项。

#### 八、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人涉嫌违法违规、受到处罚及整改情况

适用 不适用

#### 九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

#### 十、重大关联交易

##### (一) 与日常经营相关的关联交易

##### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

##### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

##### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

##### (二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

##### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

##### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

##### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

##### 4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

**(三) 共同对外投资的重大关联交易**

**1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**

适用 不适用

**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**

适用 不适用

**3、临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(四) 关联债权债务往来**

**1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**

适用 不适用

**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**

适用 不适用

**3、临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(五) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务**

适用 不适用

**(六) 其他重大关联交易**

适用 不适用

**(七) 其他**

适用 不适用

公司严格按照《上海证券交易所股票上市规则》、公司《信息披露事务管理制度》和《关联交易管理制度》开展关联交易，公司关联交易遵循公平、公正、公开的原则。

报告期内，公司日常关联交易按照公司 2021 年年度股东大会审议通过的《关于预计 2022 年度日常关联交易的议案》执行，具体信息详见本报告“第十节 十四、关联方及关联交易”之说明。

**十一、 重大合同及其履行情况**

**1 托管、承包、租赁事项**

适用 不适用

**2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）															
担保方	担保人与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期（协议签署日）	担保起始日	担保到期日	担保类型	主债务情况	担保物（如有）	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	反担保情况	是否为关联方担保	关联关系
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）															
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）															
公司对子公司的担保情况															
报告期内对子公司担保发生额合计							1,450,000,000.00								
报告期末对子公司担保余额合计（B）							2,326,642,263.07								
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）															
担保总额（A+B）							2,326,642,263.07								
担保总额占公司净资产的比例（%）							20.15								
其中：															
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）															
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）							2,326,642,263.07								
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）															
上述三项担保金额合计（C+D+E）							2,326,642,263.07								
未到期担保可能承担连带清偿责任说明															
担保情况说明							担保金额中美元金额已根据外汇管理局2022年6月30日美元对人民币中间汇率进行换算。								

**3 其他重大合同**
 适用  不适用

**十二、 其他重大事项的说明**
 适用  不适用

## 第七节 股份变动及股东情况

### 一、股本变动情况

#### (一) 股份变动情况表

##### 1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2、股份变动情况说明

适用 不适用

##### 3、报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

适用 不适用

##### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### (二) 限售股份变动情况

适用 不适用

### 二、股东情况

#### (一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数(户)	55,244
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用

#### (二) 截至报告期末前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内 增减	期末持股数 量	比例 (%)	持有有限售 条件股份数 量	质押、标记或冻结 情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
财通证券股份 有限公司	0	439,347,825	30.18	439,347,825	无		国有法人
浙江省产业 基金有限公 司	0	350,000,000	24.05	350,000,000	无		国有法人
浙江东方金 融控股集团 股份有限公 司	0	166,427,690	11.43	166,427,690	无		国有法人
浙江省经济 建设投资有 限公司	0	138,689,727	9.53	138,689,727	质押	26,540,000	国有法人

浙江省金融控股有限公司	0	138,689,727	9.53	138,689,727	无		国有法人
物产中大集团股份有限公司	0	27,500,000	1.89	27,500,000	无		国有法人
方继方	0	5,842,000	0.40	5,842,000	无		境内自然人
南通金玖惠通三期创业投资基金合伙企业(有限合伙)	0	4,795,000	0.33	4,795,000	无		其他
江苏柏博产业基金管理有限公司—南京柏载投资合伙企业(有限合伙)	0	3,393,000	0.23	3,393,000	无		其他
浙江省经协集团有限公司	0	3,020,000	0.21	3,020,000	无		境内非国有法人
前十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			
				种类	数量		
陈俊	950,100			人民币普通股	950,100		
中国农业银行股份有限公司—中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	923,000			人民币普通股	923,000		
诸丽萍	863,400			人民币普通股	863,400		
谢建和	581,100			人民币普通股	581,100		
程进通	549,000			人民币普通股	549,000		
中信证券股份有限公司	534,160			人民币普通股	534,160		
卜晓华	478,591			人民币普通股	478,591		
薛海皋	451,500			人民币普通股	451,500		
曹天强	407,000			人民币普通股	407,000		
徐幼君	403,300			人民币普通股	403,300		
前十名股东中回购专户情况说明	不适用						
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	不适用						
上述股东关联关系或一致行动的说明	截至报告期末，公司股东财通证券、浙江产业基金和省金控同受浙江省财政厅控制。						

表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用
---------------------	-----

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件  
 ✓适用 □不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	财通证券股份有限公司	439,347,825	2024年12月23日	0	自上市之日起三十六个月内
2	浙江省产业基金有限公司	350,000,000	2024年12月23日	0	自上市之日起三十六个月内
3	浙江东方金融控股集团股份有限公司	166,427,690	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内
4	浙江省经济建设投资有限公司	138,689,727	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内
5	浙江省金融控股有限公司	138,689,727	2024年12月23日	0	自上市之日起三十六个月内
6	物产中大集团股份有限公司	27,500,000	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内
7	方继方	5,842,000	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内
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	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内
9	江苏柏博产业基金管理有限公司—南京柏载投资合伙企业（有限合伙）	3,393,000	2022年12月23日	0	自上市之日起十二个月内

10	浙江省经协集团有限公司	3,020,000	2022 年 12 月 23 日	0	自上市之日起十二个月内
上述股东关联关系或一致行动的说明		截至报告期末，公司股东财通证券、浙江产业基金和省金控同受浙江省财政厅控制。			

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用  不适用

三、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用  不适用

单位：股

姓名	职务(注)	期初持股数	期末持股数	报告期内股份增减变动量	增减变动原因
石春生	高管	0	1,500	1,500	二级市场买入

其它情况说明

适用  不适用

公司副总经理石春生先生已于 2022 年 8 月提交辞职报告，申请辞去副总经理职务。

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用  不适用

(三) 其他说明

适用  不适用

四、控股股东或实际控制人变更情况

适用  不适用

## 第八节 优先股相关情况

适用  不适用

## 第九节 债券相关情况

### 一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

适用 不适用

2020 年 11 月 23 日，公司发行次级债人民币 3 亿元，票面利率 4.30%，期限 3 年期，并于 2020 年 11 月 27 日在上海证券交易所挂牌，债券全称为永安期货股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券（第一期），债券代码为 167934.SH。

公司在上海证券交易所主板上市后，资本金相对宽裕，综合考虑监管指标、资金成本等因素后，为降低公司财务费用，保护投资者利益，永安期货股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券（第一期）于 2022 年 4 月 28 日提前偿还（兑付）并摘牌。

### 二、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 第十节 财务报告

### 一、审计报告

□适用 √不适用

### 二、财务报表

#### 合并资产负债表

2022 年 6 月 30 日

编制单位：永安期货股份有限公司

单位：元币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金	七 1	34,409,245,457.37	33,255,005,328.00
其中：期货保证金存款		32,208,211,258.61	29,785,777,559.96
结算备付金	七 2	1,001,262.29	1,325,505.95
融出资金	七 5	99,846,759.40	169,641,765.76
应收货币保证金	七 7	18,784,543,575.72	17,007,812,526.39
应收质押保证金	七 8	3,814,732,728.00	3,721,533,324.00
存出保证金	七 9	808,438.47	1,033,302.09
应收票据			
应收账款	七 10	376,759,700.34	216,781,470.18
应收款项融资	七 11	7,827,887.49	22,178,136.39
预付款项	七 13	997,638,428.66	381,942,375.25
应收结算担保金	七 14	72,372,467.44	80,656,252.19
应收风险损失款	七 15	2,209,209.78	5,008,178.05
其他应收款	七 16	1,887,532,211.29	1,134,893,873.37
买入返售金融资产	七 17	7,385,013.14	7,489,003.82
存货	七 20	2,156,125,165.59	1,478,205,884.40
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	七 19	7,024,867,561.48	5,497,651,682.93
债权投资	七 21	20,010,915.07	
其他债权投资	七 22		50,061,273.97
其他权益工具投资	七 23	25,217,355.94	25,780,900.94
长期股权投资	七 24	938,110,428.50	972,070,813.77
期货会员资格投资	七 25	1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产	七 26	323,477,117.10	328,705,090.32
固定资产	七 27	103,581,098.85	104,371,493.32
在建工程			
使用权资产	七 29	128,685,660.87	95,568,951.69
无形资产	七 30	21,996,395.19	23,121,827.40
商誉			
长期待摊费用	七 31	10,900,635.89	11,705,515.15
递延所得税资产	七 33	452,700,278.85	278,735,865.22
其他资产	七 34	63,805,673.29	99,091,092.13
资产总计		71,732,781,426.01	64,971,771,432.68

<b>负债：</b>			
短期借款	七 38	1,757,094,903.02	1,700,904,095.68
代理买卖证券款	七 48	223,690,282.55	231,177,278.14
应付货币保证金	七 39	45,984,644,846.14	40,495,833,719.78
应付质押保证金	七 40	3,402,046,320.00	3,515,546,843.72
交易性金融负债	七 43	1,699,752,218.13	1,486,806,168.05
期货风险准备金	七 44	302,169,622.52	289,003,655.90
应付票据	七 45	200,424,931.22	182,251,644.00
应付账款	七 46	114,238,492.71	109,504,128.94
预收款项	七 50	7,360,482.21	7,276,874.75
合同负债	七 55	1,035,523,823.78	760,955,019.66
应付期货投资者保障基金	七 51	429,993.26	1,015,640.53
应付职工薪酬	七 52	792,781,728.50	930,287,840.11
应交税费	七 53	185,403,906.18	335,888,964.10
其他应付款	七 56	3,960,814,870.06	2,731,220,424.71
持有待售负债			
预计负债	七 58	425,530.10	406,825.86
长期借款			
应付债券	七 60		301,378,356.16
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	七 61	121,611,046.22	91,920,041.43
递延收益			
递延所得税负债	七 33	265,459,952.67	133,180,625.00
其他负债	七 63	133,786,767.53	81,535,287.37
负债合计		60,187,659,716.80	53,386,093,433.89
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	七 64	1,455,555,556.00	1,455,555,556.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	七 66	3,862,641,037.66	3,862,739,025.99
减：库存股			
其他综合收益	七 68	10,787,259.03	-40,294,889.82
盈余公积	七 69	569,827,332.58	569,827,332.58
一般风险准备	七 70	629,718,346.51	629,718,346.51
未分配利润	七 71	5,016,592,177.43	5,108,132,627.53
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		11,545,121,709.21	11,585,677,998.79
少数股东权益			
所有者权益（或股东权益）合计		11,545,121,709.21	11,585,677,998.79
负债和所有者权益（或股东权益）总计		71,732,781,426.01	64,971,771,432.68

公司负责人：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

### 母公司资产负债表

2022 年 6 月 30 日

编制单位：永安期货股份有限公司

单位：元币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金		30,699,971,000.51	28,934,996,196.81
其中：期货保证金存款		30,444,577,702.86	28,404,318,829.88
结算备付金			
融出资金			
应收货币保证金		17,793,251,522.73	16,358,835,362.03
应收质押保证金		3,814,732,728.00	3,721,533,324.00
存出保证金			
应收票据			
应收账款		33,700,526.61	3,988,297.81
应收款项融资			
预付款项		4,282,425.74	3,649,123.83
应收结算担保金		69,018,493.29	77,464,142.66
应收风险损失款		2,209,209.78	5,008,178.05
其他应收款		6,335,729.27	4,291,358.42
买入返售金融资产		6,000,000.00	7,000,000.00
存货			
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		3,851,903,250.90	2,472,821,947.31
债权投资		20,010,915.07	
其他债权投资			
其他权益工具投资		18,536,362.90	18,818,135.40
长期股权投资	二十一	3,734,419,860.18	2,966,999,793.27
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产		323,477,117.10	328,705,090.32
固定资产		101,114,742.74	101,636,343.94
在建工程			
使用权资产		104,398,534.11	77,214,612.17
无形资产		20,751,271.57	22,502,668.56
商誉			
长期待摊费用		8,924,961.78	9,582,389.79
递延所得税资产		208,393,813.43	136,314,515.22
其他资产		16,584,351.09	15,843,766.15
资产总计		60,839,416,816.80	55,268,605,245.74
<b>负债：</b>			
短期借款			
代理买卖证券款			
应付货币保证金		45,419,952,721.44	39,655,242,794.53
应付质押保证金		3,814,732,728.00	3,721,533,324.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		302,169,622.52	289,003,655.90
应付票据			

应付账款			
预收款项		7,360,482.21	7,276,874.75
合同负债		1,196,266.70	840,662.11
应付期货投资者保障基金		429,993.26	1,015,640.53
应付职工薪酬		636,580,802.66	732,821,406.23
应交税费		54,110,204.09	148,921,054.50
其他应付款		475,312,847.95	37,399,125.89
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券			301,378,356.16
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		99,914,457.24	74,270,156.95
递延收益			
递延所得税负债			
其他负债		71,776.00	50,439.72
负债合计		50,811,831,902.07	44,969,753,491.27
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		1,455,555,556.00	1,455,555,556.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		3,864,570,950.10	3,864,570,950.10
减：库存股			
其他综合收益		-1,220,053.50	-1,220,053.50
盈余公积		569,827,332.58	569,827,332.58
一般风险准备		629,718,346.51	629,718,346.51
未分配利润		3,509,132,783.04	3,780,399,622.78
所有者权益（或股东权益）合计		10,027,584,914.73	10,298,851,754.47
负债和所有者权益（或股东权益）总计		60,839,416,816.80	55,268,605,245.74

公司负责人：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

### 合并利润表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入		19,551,137,533.56	16,684,579,435.27
手续费净收入	七 73	422,992,763.90	422,879,742.93
佣金净收入			
利息净收入	七 72	271,703,188.83	183,056,031.59
其中：利息收入		391,629,964.25	255,787,318.68
利息支出		119,926,775.42	72,731,287.09
投资收益（损失以“-”号填列）	七 74	259,965,540.97	755,951,596.72

其中：对联营企业和合营企业的投资收益		31,704,913.10	247,172,052.17
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	七 76	3,802,994.69	6,243,120.64
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	七 77	53,535,304.09	-222,869,678.13
汇兑收益（损失以“-”号填列）	七 78	-17,646,646.19	-57,374.90
其他业务收入	七 79	18,555,807,382.23	15,539,375,556.58
资产处置收益（损失以“-”号填列）	七 80	977,005.04	439.84
二、营业总支出		19,159,303,463.54	15,892,444,841.42
提取期货风险准备金	七 81	13,615,717.18	15,111,716.42
税金及附加	七 82	6,813,829.46	6,402,360.00
业务及管理费	七 83	452,769,659.76	574,118,025.38
信用减值损失	七 84	52,904,225.68	49,693,342.66
其他资产减值损失	七 85	364,168,816.32	131,874,091.89
其他业务成本	七 86	18,269,031,215.14	15,115,245,305.07
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		391,834,070.02	792,134,593.85
加：营业外收入	七 87	7,394,248.03	104,489,840.19
减：营业外支出	七 88	1,507,453.96	1,751,015.90
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		397,720,864.09	894,873,418.14
减：所得税费用	七 89	81,705,758.51	155,227,453.73
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		316,015,105.58	739,645,964.41
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		316,015,105.58	739,645,964.41
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）		316,015,105.58	739,645,964.41
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额	七 90	51,082,148.85	-10,664,909.19
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		51,082,148.85	-10,664,909.19
（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		51,082,148.85	-10,664,909.19
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		51,082,148.85	-10,709,964.80
7. 其他			
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		367,097,254.43	728,981,055.22
归属于母公司所有者的综合收益总额		367,097,254.43	728,981,055.22
归属于少数股东的综合收益总额			
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.22	0.56
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.22	0.56

公司负责人：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

### 母公司利润表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入		462,353,773.87	939,248,529.88
手续费净收入	二十 4	365,764,726.51	357,582,820.78
佣金净收入			
利息净收入		280,745,105.74	198,167,630.90
其中：利息收入		368,266,326.44	229,849,943.70
利息支出		87,521,220.70	31,682,312.80
投资收益（损失以“-”号填列）	二十 5	50,982,612.92	640,844,430.89
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		30,128,066.91	238,091,562.64
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		1,882,738.05	2,132,477.03
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-249,361,716.35	-278,791,558.17
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,623.41	-255.06
其他业务收入		11,368,925.37	19,312,543.67
资产处置收益（损失以“-”号填列）		977,005.04	439.84
二、营业总支出		288,552,873.76	346,405,323.93

提取期货风险准备金		13,615,717.18	15,111,716.42
税金及附加		4,448,668.28	4,522,364.67
业务及管理费		263,359,198.50	321,367,959.82
信用减值损失		1,901,316.58	-402,975.19
其他资产减值损失			
其他业务成本		5,227,973.22	5,806,258.21
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		173,800,900.11	592,843,205.95
加：营业外收入		3,675.00	16,552.55
减：营业外支出		1,504,458.62	1,208,456.91
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		172,300,116.49	591,651,301.59
减：所得税费用		36,011,400.55	90,093,915.64
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		136,288,715.94	501,557,385.95
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		136,288,715.94	501,557,385.95
（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		136,288,715.94	501,557,385.95
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
（二）稀释每股收益(元/股)			

公司负责人：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

### 合并现金流量表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2022年半年度	2021年半年度
----	----	----------	----------

<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金		21,038,973,455.96	17,904,186,652.98
处置交易目的而持有的金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		772,517,278.77	708,828,165.78
代理买卖证券收到的现金净额			
收到其他与经营活动有关的现金	七 91	8,141,051,595.79	6,246,900,567.12
经营活动现金流入小计		29,952,542,330.52	24,859,915,385.88
购买商品、接受劳务支付的现金		21,597,894,374.02	17,776,045,550.77
为交易目的而持有的金融资产净增加额		865,779,423.77	151,004,561.71
代理买卖证券支付的现金净额		7,486,995.59	34,816,581.25
支付利息、手续费及佣金的现金		81,908,538.57	23,722,085.54
支付给职工及为职工支付的现金		427,698,120.05	420,310,805.13
以现金支付的业务及管理费		143,804,958.76	148,163,356.50
支付的各项税费		364,862,392.15	186,938,445.31
支付其他与经营活动有关的现金	七 91	3,107,442,056.71	1,963,310,878.22
经营活动现金流出小计		26,596,876,859.62	20,704,312,264.43
经营活动产生的现金流量净额		3,355,665,470.90	4,155,603,121.45
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		563,545.00	57,729.20
取得投资收益收到的现金		65,279,213.85	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		1,262,818.87	9,954.37
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		67,105,577.72	67,207,312.49
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		11,449,856.23	15,178,934.16
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		11,449,856.23	15,178,934.16
投资活动产生的现金流量净额		55,655,721.49	52,028,378.33
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		1,376,749,800.50	2,583,813,593.10
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	七 91		270,756,558.94
筹资活动现金流入小计		1,376,749,800.50	2,854,570,152.04
偿还债务支付的现金		2,113,752,882.64	1,204,884,392.71
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		37,682,779.10	194,683,392.78

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	七 91	139,139,307.55	10,765,910.97
筹资活动现金流出小计		2,290,574,969.29	1,410,333,696.46
筹资活动产生的现金流量净额		-913,825,168.79	1,444,236,455.58
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		35,488,437.35	-11,091,243.17
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		2,532,984,460.95	5,640,776,712.19
加：期初现金及现金等价物余额		31,601,584,871.00	19,546,642,778.83
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		34,134,569,331.95	25,187,419,491.02

公司负责人：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

### 母公司现金流量表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2022年半年度	2021年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置交易目的而持有的金融资产净增加额			420,806,478.58
收取利息、手续费及佣金的现金		694,217,665.65	618,333,171.36
代理买卖证券收到的现金净额			
收到其他与经营活动有关的现金		6,295,132,099.50	4,625,604,872.71
经营活动现金流入小计		6,989,349,765.15	5,664,744,522.65
购买商品、接受劳务支付的现金			
为交易目的而持有的金融资产净增加额		1,607,588,473.93	
支付利息、手续费及佣金的现金		81,646,943.14	23,677,321.56
支付给职工及为职工支付的现金		291,723,554.19	312,830,127.91
以现金支付的业务及管理费		52,289,133.89	56,314,586.12
支付的各项税费		226,444,004.16	147,309,391.85
支付其他与经营活动有关的现金		1,934,288,881.74	56,041,654.88
经营活动现金流出小计		4,193,980,991.05	596,173,082.32
经营活动产生的现金流量净额		2,795,368,774.10	5,068,571,440.33
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		281,772.50	28,864.60
取得投资收益收到的现金		62,708,000.00	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		1,260,384.84	8,193.73
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		64,250,157.34	62,745,058.33
投资支付的现金		800,000,000.00	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		6,683,677.15	13,925,580.54

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		806,683,677.15	13,925,580.54
投资活动产生的现金流量净额		-742,433,519.81	48,819,477.79
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
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		300,000,000.00	
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		5,513,400.00	157,200,000.00
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		18,433,121.49	8,117,750.52
筹资活动现金流出小计		323,946,521.49	165,317,750.52
筹资活动产生的现金流量净额		-323,946,521.49	-165,317,750.52
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		1,728,988,732.80	4,952,073,167.60
加：期初现金及现金等价物余额		28,934,949,946.81	17,273,869,782.32
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		30,663,938,679.61	22,225,942,949.92

公司负责人：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

## 合并所有者权益变动表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	2022 年半年度											
	归属于母公司所有者权益									少数 股东 权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股 本)	其他权益 工具			资本公积	减： 库存 股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优 先 股	永 续 债	其 他									
一、上年期末余额	1,455,555,556.00				3,862,739,025.99		-40,294,889.82	569,827,332.58	629,718,346.51	5,108,132,627.53		11,585,677,998.79
加：会计政策变更												
前期差错更正												
同一控制下企业合并												
其他												
二、本年期初余额	1,455,555,556.00				3,862,739,025.99		-40,294,889.82	569,827,332.58	629,718,346.51	5,108,132,627.53		11,585,677,998.79
三、本期增减变动金额（减少 以“-”号填列）					-97,988.33		51,082,148.85			-91,540,450.10		-40,556,289.58
（一）综合收益总额							51,082,148.85			316,015,105.58		367,097,254.43
（二）所有者投入和减少资本												
1. 所有者投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
（三）利润分配										-407,555,555.68		-407,555,555.68
1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准备												
3. 对所有者（或股东）的分配										-407,555,555.68		-407,555,555.68
4. 其他												

(四) 所有者权益内部结转										
1. 资本公积转增资本(或股本)										
2. 盈余公积转增资本(或股本)										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益										
6. 其他										
(五) 其他					-97,988.33					-97,988.33
四、本期期末余额	1,455,555,556.00				3,862,641,037.66	10,787,259.03	569,827,332.58	629,718,346.51	5,016,592,177.43	11,545,121,709.21

项目	2021 年半年度											
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,501,621,789.21		-14,700,285.08	489,739,107.05	549,630,120.98	3,961,754,712.82		7,798,045,444.98
加：会计政策变更												
前期差错更正												
同一控制下企业合并												
其他												
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,501,621,789.21		-14,700,285.08	489,739,107.05	549,630,120.98	3,961,754,712.82		7,798,045,444.98
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)					-549,411.22		-10,664,909.19			739,645,964.41		728,431,644.00
(一) 综合收益总额							-10,664,909.19			739,645,964.41		728,981,055.22
(二) 所有者投入和减少资本												
1. 所有者投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												

3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配											
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											
3. 对所有者(或股东)的分配											
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本(或股本)											
2. 盈余公积转增资本(或股本)											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
(五) 其他					-549,411.22						-549,411.22
四、本期期末余额	1,310,000,000.00				1,501,072,377.99	-25,365,194.27	489,739,107.05	549,630,120.98	4,701,400,677.23		8,526,477,088.98

公司负责人：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

### 母公司所有者权益变动表

2022 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

项目	2022 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	1,455,555,556.00				3,864,570,950.10		-1,220,053.50	569,827,332.58	629,718,346.51	3,780,399,622.78	10,298,851,754.47

加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	1,455,555,556.00			3,864,570,950.10		-1,220,053.50	569,827,332.58	629,718,346.51	3,780,399,622.78	10,298,851,754.47	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）									-271,266,839.74	-271,266,839.74	
（一）综合收益总额									136,288,715.94	136,288,715.94	
（二）所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
（三）利润分配									-407,555,555.68	-407,555,555.68	
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											
3. 对所有者（或股东）的分配									-407,555,555.68	-407,555,555.68	
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											

5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
(五) 其他											
四、本期期末余额	1,455,555,556.00				3,864,570,950.10		-1,220,053.50	569,827,332.58	629,718,346.51	3,509,132,783.04	10,027,584,914.73

项目	2021 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,502,904,302.10		-1,220,053.50	489,739,107.05	549,630,120.98	3,139,693,818.55	6,990,747,295.18
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,502,904,302.10		-1,220,053.50	489,739,107.05	549,630,120.98	3,139,693,818.55	6,990,747,295.18
三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列)										501,557,385.95	501,557,385.95
(一) 综合收益总额										501,557,385.95	501,557,385.95
(二) 所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配											
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											

3. 对所有者（或股东）的分配											
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
（五）其他											
四、本期期末余额	1,310,000,000.00				1,502,904,302.10		-1,220,053.50	489,739,107.05	549,630,120.98	3,641,251,204.50	7,492,304,681.13

公司负责人：葛国栋 主管会计工作负责人：黄峥嵘 会计机构负责人：黄峥嵘

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用 □不适用

永安期货股份有限公司(以下简称公司或本公司)前身系浙江省永安期货经纪有限公司,于1992年9月在工商行政管理局登记注册,总部位于浙江省杭州市。公司现持有统一社会信用代码为9133000010002099X5的营业执照,注册资本1,455,555,556.00元,股份总数1,455,555,556股(每股面值1元)。其中,有限售条件的流通股份A股1,310,000,000股;无限售条件的流通股份A股145,555,556股。公司股票已于2021年12月23日在上海证券交易所挂牌交易。

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18家营业部及26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。

本财务报表业经公司2022年8月24日第三届董事会第二十四次会议批准对外报出。

#### 2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

本公司纳入报告期合并财务报表范围的子公司和结构化主体情况详见本节“九、合并范围的变更”和“十、其他主体中的权益”之说明。

### 四、财务报表的编制基础

#### 1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

#### 2. 持续经营

√适用 □不适用

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。

### 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示:

√适用 □不适用

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

#### 1. 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、完整地反映了公司的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

#### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

#### 3. 营业周期

√适用 □不适用

本公司为金融企业,不具有明显可识别的营业周期。

#### 4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

#### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

√适用 □不适用

##### (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。

#### 6. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

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

#### 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

□适用 √不适用

#### 8. 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。

#### 9. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

##### (1) 外币业务折算

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

##### (2) 外币财务报表折算

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

#### 10. 金融工具

##### 金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

√适用 □不适用

##### (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：a 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；b 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：

a 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

b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。

对于租赁应收款、由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

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

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

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

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

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

2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

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

		测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
其他应收款——账龄组合	账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
其他应收款——合并范围内关联方组合	合并范围内关联方	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失

## 3) 按组合计量预期信用损失的应收款项

## ① 具体组合及计量预期信用损失的方法

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

## ② 账龄组合的账龄与整个存续期预期信用损失率对照表

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

## (6) 金融资产和金融负债的抵销

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

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

## 11. 存货

### (1) 存货的分类

本公司持有存货系持有以备出售的商品。

### (2) 发出存货的计价方法

发出存货采用个别计价法。

### (3) 存货可变现净值的确定依据

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

### (4) 存货的盘存制度

存货的盘存制度为永续盘存制。

## 12. 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。

## 13. 客户保证金的管理与核算方法

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

## 14. 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。

## 15. 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。

## 16. 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。

## 17. 贵金属

适用 不适用

## 18. 应收款项

### 应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见第 10 项金融工具

## 19. 应收款项融资

适用 不适用

详见第 10 项金融工具

## 20. 合同资产

### (1). 合同资产的确认方法及标准

√适用 □不适用

详见第 48 项合同资产、合同负债

### (2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

详见第 10 项金融工具

## 21. 持有待售资产

□适用 √不适用

## 22. 债权投资

### 债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

详见第 10 项金融工具

## 23. 其他债权投资

### 其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

详见第 10 项金融工具

## 24. 长期股权投资

√适用 □不适用

### (1) 共同控制、重大影响的判断

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

### (2) 投资成本的确定

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

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

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

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

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

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

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

#### (3) 后续计量及损益确认方法

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

#### (4) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

##### 1) 个别财务报表

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

##### 2) 合并财务报表

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

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

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

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

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

## 25. 投资性房地产

### (1). 如果采用成本计量模式的

#### 折旧或摊销方法

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。

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。

## 26. 固定资产

### (1). 确认条件

适用  不适用

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). 折旧方法**
 适用  不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	30	3.00%	3.23%
电子设备及其他	年限平均法	5	3.00%	19.40%
运输工具	年限平均法	8	3.00%	12.13%

**(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法**
 适用  不适用

**27. 在建工程**
 适用  不适用

**28. 借款费用**
 适用  不适用

**29. 使用权资产**
 适用  不适用

详见本节“五、50、(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”

**30. 无形资产**
**(1). 计价方法、使用寿命、减值测试**
 适用  不适用

1) 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。

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

项目	摊销年限(年)
土地使用权	40
软件	3

**(2). 内部研究开发支出会计政策**
 适用  不适用

**31. 长期资产减值**
 适用  不适用

**32. 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、在建工程和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。

### 33. 长期待摊费用

√适用 □不适用

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

### 34. 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。

### 35. 附回购条件的资产转让

□适用 √不适用

### 36. 合同负债

#### 合同负债的确认方法

√适用 □不适用

详见第 48 项合同资产、合同负债

### 37. 职工薪酬

#### (1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

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。

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。

#### (2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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。

### (3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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。

### (4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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。

### 38. 期货投资者保障基金确认

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

### 39. 预计负债

√适用 □不适用

(1) 因对外提供担保、诉讼事项、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。

### 40. 租赁负债

√适用 □不适用

详见本节“五、50、(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”

### 41. 股份支付

□适用 √不适用

### 42. 优先股、永续债等其他金融工具

□适用 √不适用

### 43. 回购本公司股份

□适用 √不适用

### 44. 收入

#### (1)、收入确认和计量所采用的会计政策

√适用 □不适用

##### 1) 收入确认原则

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

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

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

#### 2) 收入计量原则

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

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

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

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

#### 3) 收入确认的具体方法

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

##### ①期货经纪业务收入

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

##### ②资产管理业务收入

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

##### ③利息收入

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

##### ④商品销售收入

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

##### ⑤基金销售业务收入

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

##### ⑥其他收入

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

## (2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

**45. 合同成本**

适用 不适用

**46. 利润分配**

适用 不适用

资产负债表日后，经审议批准的利润分配方案中拟分配的利润，不确认为资产负债表日的负债，在资产负债表日后事项附注中单独披露。

**47. 政府补助****(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法**

适用 不适用

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。

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

**(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法**

适用 不适用

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

**(3)、与公司日常经营活动相关的政府补助**

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。

**48. 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。

**49. 递延所得税资产/递延所得税负债**

适用 不适用

(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。

## 50. 租赁

### (1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

详见本节“五、50、(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”

### (2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

详见本节“五、50、(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”

### (3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

#### 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。

## 51. 一般风险准备的提取和使用核算方法

(1) 一般风险准备按照母公司当期实现净利润的 10% 提取。

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

## 52. 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。

## 53. 融资融券业务

适用  不适用

**54. 资产证券化业务**
 适用  不适用

**55. 其他重要的会计政策和会计估计**
 适用  不适用

**56. 重要会计政策和会计估计的变更**
**(1)、重要会计政策变更**
 适用  不适用

**(2)、重要会计估计变更**
 适用  不适用

**57. 其他**
 适用  不适用

**六、税项**
**1. 主要税种及税率**

主要税种及税率情况

 适用  不适用

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%、5%、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%
商品及服务税[注 1]	实际缴纳的流转税税额	7%
企业所得税	应纳税所得额	25%、17%、16.5%、8.25%

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

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

 适用  不适用

纳税主体名称	所得税税率（%）
永安国贸	17
永安国际金融	17
香港永安商贸	16.5
新永安金控	16.5
新永安期货	16.5
新永安实业	16.5
新永安证券	8.25、16.5[注 1]
新永安资管	16.5

永安全球基金	[注 2]
除上述以外的其他纳税主体	25

[注 1] 新永安证券 2022 年半年度缴纳企业所得税(利得税)适用两级制税率, 应纳税所得额不超过 2,000,000 港币的部分适用税率 8.25%, 超过 2,000,000 港币的部分适用税率 16.5%。

[注 2] 永安全球基金注册地在开曼群岛, 免缴企业所得税。

## 2. 税收优惠

适用  不适用

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

(2) 根据财政部、国家税务总局《关于证券行业准备金支出企业所得税税前扣除有关政策问题的通知》(财税〔2017〕23 号)《关于延长部分税收优惠政策执行期限的公告》(财政部、税务总局公告 2021 年第 6 号), 2016 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日, 期货公司依据《期货公司管理办法》(证监会令第 43 号)和《商品期货交易财务管理暂行规定》(财商字〔1997〕44 号)的有关规定, 从其收取的交易手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5%提取的期货公司风险准备金在企业所得税税前扣除。

## 3. 其他

适用  不适用

## 七、合并财务报表项目注释

### 1、货币资金

单位: 元

#### (1) 类别明细

项目	期末数	期初数
库存现金	12,127.02	10,490.46
银行存款	1,759,133,612.23	2,669,081,712.68
期货保证金存款	32,208,211,258.61	29,785,777,559.96
证券经纪业务保证金	221,406,629.77	231,770,304.49
其他货币资金	220,481,829.74	568,365,260.41
合计	34,409,245,457.37	33,255,005,328.00
其中: 存放在境外的款项总额	2,587,166,275.79	2,226,766,877.45

#### (2) 其他说明

期末货币资金中有保函保证金、信用证保证金等合计金额为 238,660,804.52 元, 其使用受限。

## 2、 结算备付金

√适用 □不适用

单位：元

### (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	1,009,059.92	100.00	7,797.63	0.77	1,001,262.29
合计	1,009,059.92	100.00	7,797.63	0.77	1,001,262.29

(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	1,331,835.59	100.00	6,329.64	0.48	1,325,505.95
合计	1,331,835.59	100.00	6,329.64	0.48	1,325,505.95

#### 2) 采用组合计提坏账准备的结算备付金

项目	期末数			期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收交易所和商业银行等组合	853,107.22			1,205,242.89		
其他组合	155,952.70	7,797.63	5.00	126,592.70	6,329.64	5.00
小计	1,009,059.92	7,797.63	0.77	1,331,835.59	6,329.64	0.48

### (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	1,009,059.92	7,797.63	1,001,262.29	1,331,835.59	6,329.64	1,325,505.95
小计	1,009,059.92	7,797.63	1,001,262.29	1,331,835.59	6,329.64	1,325,505.95

### (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[注]	转回	核销	其他	
结算备付金	6,329.64	1,176.98		291.01				7,797.63
小计	6,329.64	1,176.98		291.01				7,797.63

坏账变动说明：报告期期末，结算备付金余额属于第一阶段。

[注]其他系外币报表折算差异

结算备付金的说明：

无

**3、 贵金属**
 适用  不适用

**4、 拆出资金**
 适用  不适用

**5、 融出资金**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内		
其中：个人		
机构		
减：减值准备		
账面价值小计		
境外	104,819,113.66	178,570,279.75
其中：个人	70,074,945.64	78,993,099.91
机构	34,744,168.02	99,577,179.84
减：减值准备	4,972,354.26	8,928,513.99
账面价值小计	99,846,759.40	169,641,765.76
账面价值合计	99,846,759.40	169,641,765.76

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
债券		1,711,575.25
股票	395,418,995.43	835,320,241.30
基金		4,631,739.99
合计	395,418,995.43	841,663,556.54

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

 适用  不适用

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	8,928,513.99			8,928,513.99
本期计提	-4,366,657.32			-4,366,657.32
本期收回				
本期转回				
本期核销				
其他变动[注]	410,497.59			410,497.59
期末数	4,972,354.26			4,972,354.26

[注]其他变动系外币报表折算差异

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

√适用 □不适用

见上表

融出资金的说明：

√适用 □不适用

本期融资融券业务累计发生强制平仓 22 次，经强制平仓期末仍未收回的债权金额为 1,320,571.54 元。

## 6、衍生金融工具

□适用 √不适用

## 7、应收货币保证金

单位：元币种：人民币

### (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	18,822,165,990.18	100	37,622,414.46	0.20	18,784,543,575.72
合计	18,822,165,990.18	100	37,622,414.46	0.20	18,784,543,575.72

(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	17,032,750,238.30	100.00	24,937,711.91	0.15	17,007,812,526.39
合计	17,032,750,238.30	100.00	24,937,711.91	0.15	17,007,812,526.39

#### 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等组合	18,069,717,701.07			16,533,996,000.02		
其他组合	752,448,289.11	37,622,414.46	5.00	498,754,238.28	24,937,711.91	5.00
小计	18,822,165,990.18	37,622,414.46	0.20	17,032,750,238.30	24,937,711.91	0.15

坏账变动说明：应收货币保证金余额均属于第一阶段。

#### (2) 明细情况——按交易所/清算商

交易所/清算商名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,160,932,699.38	2,151,099,197.75
大连商品交易所	4,690,214,624.04	4,331,967,262.88
郑州商品交易所	2,513,282,770.62	2,489,763,846.25
中国金融期货交易所	5,968,543,771.39	6,195,737,430.39

上海国际能源交易中心	848,662,341.62	516,466,058.96
中国证券登记结算有限责任公司	611,615,315.68	673,801,565.80
香港期货交易所	225,897,123.83	170,659,160.79
G. H. FINANCIALS (HONGKONG) LIMITED	228,698,236.64	210,654,107.65
MAREX FINANCIAL LTD	230,903,553.04	140,193,319.53
PHILIP FUTURES PTE LTD	264,924,767.21	111,159,435.25
DBS BANK LTD	26,747,844.21	4,429,213.52
R. J. O' BRIEN & ASSOCIATES, LLC	514,606.20	498,482.02
ADMIS SINGAPORE PTE LTD BANKING INSTRUCTION	16,802,649.20	13,871,415.97
GF FINANCIAL MARKETS (UK) LIMITED	3,994,899.01	14,882,434.44
NISSAN SECURITIES CO., LTD	2,341,348.79	2,565,151.23
CGS-CIMB FUTURES SDN. BHD.	4,105,964.41	4,764,493.23
ASIA PACIFIC EXCHANGE	146,256.73	
VI INVESTMENT CORPORATION		150,157.14
KGI ONG CAPITAL PTE. LTD	15,943.00	15,241.81
北京首创期货有限责任公司	23,554,544.60	0.31
其他	266,730.58	72,263.38
减:坏账准备	37,622,414.46	24,937,711.91
合计	18,784,543,575.72	17,007,812,526.39

## 8、 应收质押保证金

单位:元币种:人民币

### (1) 明细情况

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	2,781,994,016.00	2,797,236,264.00
大连商品交易所	376,994,128.00	341,552,944.00
郑州商品交易所	474,141,864.00	266,681,540.00
上海国际能源交易中心	100,326,720.00	192,784,016.00
中国金融期货交易所	81,276,000.00	123,278,560.00
合计	3,814,732,728.00	3,721,533,324.00

### (2) 质押物明细情况

质押物类别	质押时市值	折扣率	期末市值
20号胶	24,908,400.00	80%	19,926,720.00
白银	21,565,170.00	80%	17,252,136.00
丙烯	29,081,300.00	80%	23,265,040.00
不锈钢	22,242,000.00	80%	17,793,600.00
干制红枣	31,156,650.00	80%	24,925,320.00
国债	3,945,544,980.00	80%	3,156,435,984.00
聚氯	16,583,400.00	80%	13,266,720.00
卷板	43,619,400.00	80%	34,895,520.00
螺纹	13,503,000.00	80%	10,802,400.00
锰硅	11,068,400.00	80%	8,854,720.00
棉花	148,386,000.00	80%	118,708,800.00
漂针浆	23,306,400.00	80%	18,645,120.00
塑料	14,280,000.00	80%	11,424,000.00

铜	151,034,500.00	80%	120,827,600.00
橡胶	28,078,050.00	80%	22,462,440.00
锌	36,180,000.00	80%	28,944,000.00
乙二醇	94,320,500.00	80%	75,456,400.00
玉米	104,512,760.00	80%	83,610,208.00
玉米淀粉	9,045,000.00	80%	7,236,000.00
合计	4,768,415,910.00		3,814,732,728.00

## 9、存出保证金

√适用 □不适用

单位：元

### (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	841,985.86	100.00	33,547.39	3.98	808,438.47
合计	841,985.86	100.00	33,547.39	3.98	808,438.47

(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	1,065,175.00	100.00	31,872.91	2.99	1,033,302.09
合计	1,065,175.00	100.00	31,872.91	2.99	1,033,302.09

### (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 银行等组合	171,038.00			427,716.81		
其他组合	670,947.86	33,547.39	5.00	637,458.19	31,872.91	5.00
小计	841,985.86	33,547.39	3.98	1,065,175.00	31,872.91	2.99

坏账变动说明：存出保证金余额均属于第一阶段。

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的存出保证金余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

存出保证金的说明：

无

## 10、应收账款

### (1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

#### 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	396,660,829.91	100.00	19,901,129.57	5.02	376,759,700.34

其中：应收货款	361,186,591.37	91.06	18,127,417.64	5.02	343,059,173.73
其他	35,474,238.54	8.94	1,773,711.93	5.00	33,700,526.61
合计	396,660,829.91	100.00	19,901,129.57	5.02	376,759,700.34

(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	228,476,919.22	100.00	11,695,449.04	5.12	216,781,470.18
其中：应收货款	225,459,424.02	98.68	11,544,574.28	5.12	213,914,849.74
其他	3,017,495.20	1.32	150,874.76	5.00	2,866,620.44
合计	228,476,919.22	100.00	11,695,449.04	5.12	216,781,470.18

2) 采用组合计提坏账准备的应收账款  
采用账龄组合计提坏账准备的应收账款

账龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1 年以内	396,206,909.41	19,810,345.47	5.00
1-2 年	453,920.50	90,784.10	20.00
小计	396,660,829.91	19,901,129.57	5.02

## (2) 坏账准备变动情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初数	本期增加			本期减少			期末数
		计提	收回	其他[注]	转回	核销	其他	
按组合计提坏账准备	11,695,449.04	8,173,838.27		39,842.26		8,000.00		19,901,129.57
小计	11,695,449.04	8,173,838.27		39,842.26		8,000.00		19,901,129.57

[注]其他系外币报表折算差异

## (3) 应收账款金额前 5 名情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

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	122,207,693.67	30.81	6,110,384.68
第二名	34,568,946.46	8.71	1,728,447.32
第三名	27,846,187.56	7.02	1,392,309.38
第四名	27,831,737.26	7.02	1,391,586.86
第五名	24,901,169.89	6.28	1,245,058.49
小计	237,355,734.84	59.84	11,867,786.73

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用  不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明：

适用  不适用

## 11、应收款项融资

适用  不适用

### 1) 类别明细

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收票据	7,827,887.49	22,178,136.39
合计	7,827,887.49	22,178,136.39

### 2) 采用组合计提减值准备的应收款项融资

项目	期末数		
	账面余额	减值准备	计提比例(%)
银行承兑汇票组合	7,827,887.49		
小计	7,827,887.49		

### (2) 期末公司已背书或贴现且在资产负债表日尚未到期的应收票据情况

项目	期末终止确认金额	期初终止确认金额
银行承兑汇票	80,840,876.01	133,183,688.47
小计	80,840,876.01	133,183,688.47

应收款项融资本期增减变动及公允价值变动情况：

适用  不适用

如按预期信用损失一般模型计提坏账准备，请参照其他应收款披露：

适用  不适用

其他说明：

适用  不适用

## 12、合同资产

### (1). 合同资产情况

适用  不适用

### (2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用  不适用

### (3). 本期合同资产计提减值准备情况

适用  不适用

其他说明：

适用  不适用

## 13、预付款项

单位：元币种：人民币

## (1) 账龄分析

账龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	995,287,262.66	99.76		995,287,262.66	380,936,383.36	99.74		380,936,383.36
1-2年	2,343,166.00	0.24		2,343,166.00	989,991.89	0.26		989,991.89
2-3年								
3-4年					16,000.00	0.00		16,000.00
4-5年	8,000.00	0.00		8,000.00				
合计	997,638,428.66	100.00		997,638,428.66	381,942,375.25	100.00		381,942,375.25

## (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	81,502,498.87	8.17
第二名	54,586,677.31	5.47
第三名	51,155,944.83	5.13
第四名	35,974,399.41	3.61
第五名	29,726,219.51	2.98
小计	252,945,739.93	25.36

## 14、应收结算担保金

单位：元币种：人民币

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	58,009,213.02	66,497,265.74
中国证券登记结算有限责任公司	11,009,280.27	10,966,876.92
AsiaPacificExchange	3,353,974.15	3,192,109.53
合计	72,372,467.44	80,656,252.19

## 15、应收风险损失款

单位：元币种：人民币

## (1) 账龄分析

账龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	1,785,384.92	80.82		1,785,384.92	4,559,413.68	91.04		4,559,413.68
1-2年					448,764.37	8.96		448,764.37
2-3年	423,824.86	19.18		423,824.86				
合计	2,209,209.78	100.00		2,209,209.78	5,008,178.05	100.00		5,008,178.05

## (2) 应收风险损失款金额前 5 名情况

单位名称	账面余额
第一名	698,865.48
第二名	467,559.45

第三名	329,478.41
第四名	240,323.52
第五名	126,922.03
小计	1,863,148.89

## 16、其他应收款

单位:元币种:人民币

### (1) 明细情况

项目	期末数	期初数
应收利息	1,515,381.93	328,881.49
应收股利	36,829.05	83,096.63
其他应收款	1,885,980,000.31	1,134,481,895.25
合计	1,887,532,211.29	1,134,893,873.37

### (2) 应收利息

项目	期末数	期初数
定期存款	1,515,381.93	328,881.49
小计	1,515,381.93	328,881.49

### (3) 应收股利

项目	期末数	期初数
其他零星股利	36,829.05	83,096.63
小计	36,829.05	83,096.63

### (4) 其他应收款

#### 1) 明细情况

##### ① 类别明细情况

种类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	60,715,359.81	3.05	1,024,854.88	1.69	59,690,504.93
按组合计提坏账准备	1,927,777,656.37	96.95	101,488,160.99	5.26	1,826,289,495.38
合计	1,988,493,016.18	100.00	102,513,015.87	5.16	1,885,980,000.31

(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(%)	
单项计提坏账准备	23,398,856.29	1.95	4,620,407.04	19.75	18,778,449.25
按组合计提坏账准备	1,179,049,018.67	98.05	63,345,572.67	5.37	1,115,703,446.00
合计	1,202,447,874.96	100.00	67,965,979.71	5.65	1,134,481,895.25

##### ② 期末单项计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
客户 a	13,418,957.33	670,947.87	5.00	该客户以在本公司享有的权益等为担保
客户 b	353,907.01	353,907.01	100.00	预计无法收回
客户 c	46,942,495.46			证券业务清算及认购款
小计	60,715,359.80	1,024,854.88	1.69	

## 2) 采用组合计提坏账准备的其他应收款

组合名称	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
账龄组合	1,927,777,656.37	101,488,160.99	5.26
其中：1 年以内	1,913,481,046.49	95,708,029.17	5.00
1-2 年	8,446,397.03	1,689,279.41	20.00
2-3 年	2,113,988.29	634,196.49	30.00
3-4 年	465,947.73	186,379.09	40.00
4 年以上	3,270,276.83	3,270,276.83	100.00
小计	1,927,777,656.37	101,488,160.99	5.26

## 3) 账龄情况

项目	期末账面余额
1 年以内	1,974,196,406.29
1-2 年	8,446,397.03
2-3 年	2,113,988.29
3-4 年	465,947.74
4 年以上	3,270,276.83
小计	1,988,493,016.18

## 4) 坏账准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失(未发生 信用减值)	整个存续期预期 信用损失(已发生 信用减值)	
期初数	58,985,420.32	1,624,744.64	7,355,814.75	67,965,979.71
期初数在本期	---	---	---	
--转入第二阶段	-109,146.69	109,146.69		
--转入第三阶段		-208,453.29	208,453.29	
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提	37,480,615.38	157,505.83	-76,531.98	37,561,589.23
本期收回				
本期转回				
本期核销			3,057,318.00	3,057,318.00
其他变动[注]	38,737.72	-2,189.85	6,217.06	42,764.93
期末数	96,395,626.73	1,680,754.02	4,436,635.12	102,513,015.87

[注]其他变动系外币报表折算差异

## 5) 本期实际核销的其他应收款情况

对方单位名称	款项性质及内容	核销金额	核销原因	履行的核销程序	是否因关联交易产生(是/否)
客户 1	仓储、物流、运输	3,057,318.00	无法收回		否
合计		3,057,318.00			

## 6) 其他应收款项性质分类情况

款项性质	期末数	期初数
押金保证金	241,176,575.57	177,607,955.66
对外拆出款	13,418,957.33	12,749,163.84
境外证券业务清算及认购款	46,942,495.46	6,666,743.60

场外业务应收款	1,658,462,901.04	991,500,259.41
其他	28,492,086.78	13,923,752.45
合计	1,988,493,016.18	1,202,447,874.96

## 7) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例(%)	坏账准备
第一名	场外业务应收款	410,110,245.51	1 年以内	20.62	20,505,512.28
第二名	场外业务应收款	295,035,921.51	1 年以内	14.84	14,751,796.07
第三名	场外业务应收款	267,150,618.19	1 年以内	13.43	13,357,530.91
第四名	押金保证金	136,887,523.00	1 年以内	6.88	6,844,376.15
第五名	场外业务应收款	102,507,880.24	1 年以内	5.16	5,125,394.01
小计		1,211,692,188.45		60.93	60,584,609.42

## 17、买入返售金融资产

## (1) 按业务类别

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券质押式回购	7,385,013.14	7,489,003.82
减：减值准备		
账面价值合计	7,385,013.14	7,489,003.82

## (2) 按金融资产种类

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	7,385,013.14	7,489,003.82
减：减值准备		
买入返售金融资产账面价值	7,385,013.14	7,489,003.82

## (3) 担保物金额

 适用  不适用

## (4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	7,385,013.14	7,489,003.82
合计	7,385,013.14	7,489,003.82

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

 适用  不适用

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

 适用  不适用

买入返售金融资产的说明：

 适用  不适用

**18、持有待售资产**
 适用  不适用

**19、交易性金融资产**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

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	7,024,867,561.48	5,497,651,682.93
其中：债务工具投资	25,143,318.53	19,583,210.97
权益工具投资	6,184,077,637.31	5,003,329,509.82
衍生金融资产	815,646,605.64	474,738,962.14
合计	7,024,867,561.48	5,497,651,682.93

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的描述性说明

 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

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 2022 年 6 月 30 日，公司持有的期货合约浮盈为 59,452,420.00 元，浮亏为 15,992,245.00 元。

**20、存货**

单位：元币种：人民币

## (1) 明细情况

项目	期末数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
在途物资			
库存商品	2,299,069,816.82	196,159,841.71	2,102,909,975.11
发出商品	55,970,401.80	2,755,211.32	53,215,190.48
合计	2,355,040,218.62	198,915,053.03	2,156,125,165.59

## (续上表)

项目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
在途物资	204,981,093.07	25,903,790.72	179,077,302.35
库存商品	1,178,545,378.81	36,373,066.87	1,142,172,311.94
发出商品	158,635,335.56	1,679,065.45	156,956,270.11
合计	1,542,161,807.44	63,955,923.04	1,478,205,884.40

## (2) 存货跌价准备

## 1) 明细情况

项目	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	转回或转销	其他	
存货	63,955,923.04	364,168,816.32		229,209,686.33		198,915,053.03
小计	63,955,923.04	364,168,816.32		229,209,686.33		198,915,053.03

## 2) 确定可变现净值的具体依据、本期转回或转销存货跌价准备的原因

项目	确定可变现净值的具体依据	转回存货跌价准备的原因	转销存货跌价准备的原因
存货	以该存货的估计售价减去估计的销售费用和相关税费后的金额确定其可变现净值	前期计提存货跌价准备的存货可变现净值上升	前期计提存货跌价准备的存货对外出售

注：公司持有的存货主要为风险子公司基于基差贸易业务而持有的大宗商品。本期末，公司持有存货的商业模式和以前年度未发生重大变化。基差贸易的损益源自于包括衍生品业务损益、现货贸易损益在内的业务组合的综合结果。

## 21、债权投资

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	20,000,000.00	10,915.07		20,010,915.07				
合计	20,000,000.00	10,915.07		20,010,915.07				

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

 适用  不适用

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

 适用  不适用

其他说明：

无

## 22、其他债权投资

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
可转让定期存单[注]						50,000,000.00	61,273.97		50,061,273.97	
合计						50,000,000.00	61,273.97		50,061,273.97	

[注]上述可转让定期存单存续期限超过一年，公司以收取合同现金流量和转让为目的而持有。  
按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：  
适用 不适用

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：  
适用 不适用

其他说明：  
无

### 23、其他权益工具投资

#### (1). 按项目披露

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末数	期初数	本期股利收入	本期从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失	
				金额	原因
股权投资	25,217,355.94	25,780,900.94			
小计	25,217,355.94	25,780,900.94			

#### (2). 本期终止确认的其他权益工具

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

### 24、长期股权投资

适用 不适用

单位：元币种：人民币

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	24,395,700.46			2,748,850.32	
永安国富	936,025,691.08			30,128,066.91	
OSTC YONGAN	11,649,422.23			-1,172,004.13	-288,096.19
合计	972,070,813.77			31,704,913.10	-288,096.19

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
玉皇山南	-97,988.33				27,046,562.45	
永安国富		-62,708,000.00			903,445,757.99	
OSTC YONGAN		-2,571,213.85			7,618,108.06	
合计	-97,988.33	-65,279,213.85			938,110,428.50	

## 按项目分类

项目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	938,110,428.50		938,110,428.50	972,070,813.77		972,070,813.77
合计	938,110,428.50		938,110,428.50	972,070,813.77		972,070,813.77

其他说明

无

## 25、期货会员资格投资

单位：元币种：人民币

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

## 26、投资性房地产

投资性房地产计量模式

## (1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	土地使用权	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	146,983,251.36	247,084,504.10	394,067,755.46
2. 本期增加金额			
(1) 固定资产/无形资产转入			
3. 本期减少金额			
4. 期末余额	146,983,251.36	247,084,504.10	394,067,755.46
二、累计折旧和累计摊销			
1. 期初余额	18,187,458.50	47,175,206.64	65,362,665.14
2. 本期增加金额	2,139,416.94	3,088,556.28	5,227,973.22
(1) 计提或摊销	2,139,416.94	3,088,556.28	5,227,973.22
(2) 固定资产/无形资产转入			
3. 本期减少金额			
4. 期末余额	20,326,875.44	50,263,762.92	70,590,638.36
三、账面价值			
1. 期末账面价值	126,656,375.92	196,820,741.18	323,477,117.10
2. 期初账面价值	128,795,792.86	199,909,297.46	328,705,090.32

**(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况:**

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

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	8,626,590.96	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 室以及 6、7 层	364,403.13	因历史遗留原因至今未办理不动产权证
小计	8,990,994.09	

其他说明

□适用 √不适用

**27、固定资产**
**(1). 固定资产情况**

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	房屋及建筑物	电子设备及其他	运输工具	合计
<b>一、账面原值:</b>				
1. 期初余额	110,440,924.23	91,448,906.54	15,880,871.19	217,770,701.96
2. 本期增加金额		5,453,384.29		5,453,384.29
(1) 购置		5,453,384.29		5,453,384.29
3. 本期减少金额		1,186,494.55	7,457,576.91	8,644,071.46
(1) 处置或报废		1,186,494.55	7,457,576.91	8,644,071.46
(2) 其他转出				
4. 外币报表折算差额		255,102.16		255,102.16
5. 期末余额	110,440,924.23	95,970,898.44	8,423,294.28	214,835,116.95
<b>二、累计折旧</b>				
1. 期初余额	33,400,575.27	65,797,459.11	14,201,174.26	113,399,208.64
2. 本期增加金额	1,954,762.38	3,743,199.45	259,736.53	5,957,698.36
(1) 计提	1,954,762.38	3,743,199.45	259,736.53	5,957,698.36
3. 本期减少金额		1,130,451.57	7,215,870.35	8,346,321.92
(1) 处置或报废		1,130,451.57	7,215,870.35	8,346,321.92
(2) 其他转出				
4. 外币报表折算差额		243,433.02		243,433.02
5. 期末余额	35,355,337.65	68,653,640.01	7,245,040.44	111,254,018.10
<b>三、减值准备</b>				
1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置或报废				
4. 期末余额				
<b>四、账面价值</b>				
1. 期末账面价值	75,085,586.58	27,317,258.43	1,178,253.84	103,581,098.85
2. 期初账面价值	77,040,348.96	25,651,447.43	1,679,696.93	104,371,493.32

**(2). 暂时闲置的固定资产情况**
 适用  不适用

**(3). 通过融资租赁租入的固定资产情况**
 适用  不适用

**(4). 通过经营租赁租出的固定资产**
 适用  不适用

**(5). 未办妥产权证书的固定资产情况**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
福州中盛大厦 702 号房屋	6,863,526.02	未通过房地产主管部门的竣工验收备案
浙江协作大厦 8 楼北半层	100,256.15	因历史遗留原因至今未办理不动产权证
小计	6,963,782.17	

其他说明：

 适用  不适用

**28、在建工程**
**(1). 在建工程情况**
 适用  不适用

**(2). 重要在建工程项目本期变动情况**
 适用  不适用

**(3). 本期计提在建工程减值准备情况**
 适用  不适用

其他说明

 适用  不适用

**29、使用权资产**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	128,978,300.38	128,978,300.38
2. 本期增加金额	53,103,859.89	53,103,859.89
(1) 租入	53,103,859.89	53,103,859.89
3. 本期减少金额	15,243,763.53	15,243,763.53
4. 期末余额	166,838,396.74	166,838,396.74
二、累计折旧		

1. 期初余额	33,409,348.69	33,409,348.69
2. 本期增加金额	19,873,220.73	19,873,220.73
(1) 计提	19,873,220.73	19,873,220.73
3. 本期减少金额	15,129,833.55	15,129,833.55
4. 期末余额	38,152,735.87	38,152,735.87
三、账面价值		
1. 期末账面价值	128,685,660.87	128,685,660.87
2. 期初账面价值	95,568,951.69	95,568,951.69

其他说明：

无

### 30、无形资产

#### (1). 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	土地使用权	软件	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	14,831,417.62	59,138,242.94	73,969,660.56
2. 本期增加金额		2,347,520.11	2,347,520.11
(1) 购置		2,347,520.11	2,347,520.11
3. 本期减少金额			
(1) 处置			
4. 外币报表折算差额		75,578.23	75,578.23
5. 期末余额	14,831,417.62	61,561,341.28	76,392,758.90
二、累计摊销			
1. 期初余额	2,831,724.36	48,016,108.80	50,847,833.16
2. 本期增加金额	185,392.74	3,288,556.74	3,473,949.48
(1) 计提	185,392.74	3,288,556.74	3,473,949.48
3. 本期减少金额			
(1) 处置			
4. 外币报表折算差额		74,581.07	74,581.07
5. 期末余额	3,017,117.10	51,379,246.61	54,396,363.71
三、账面价值			
1. 期末账面价值	11,814,300.52	10,182,094.67	21,996,395.19
2. 期初账面价值	11,999,693.26	11,122,134.14	23,121,827.40

#### (2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**31、长期待摊费用**

明细情况

单位：元币种：人民币

项目	期初数	本期增加	本期摊销	其他减少	期末数
装修费	10,045,016.10	1,068,571.51	2,129,513.86		8,984,073.75
其他	1,660,499.05	491,150.44	235,087.35		1,916,562.14
合计	11,705,515.15	1,559,721.95	2,364,601.21		10,900,635.89

**32、商誉**
**(1). 商誉账面原值**
 适用  不适用

**(2). 商誉减值准备**
 适用  不适用

**(3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息**
 适用  不适用

**(4). 说明商誉减值测试过程、关键参数（例如预计未来现金流量现值时的预测期增长率、稳定期增长率、利润率、折现率、预测期等，如适用）及商誉减值损失的确认方法**

 适用  不适用

**(5). 商誉减值测试的影响**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**33、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**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	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	649,788,388.00	162,447,097.00	607,835,474.93	151,958,868.73
存货跌价准备	197,515,875.26	49,378,968.82	63,955,923.04	15,988,980.76
坏账准备	121,832,814.55	30,399,567.64	78,589,832.29	19,598,379.86
期货风险准备金	6,692,009.90	1,673,002.48	7,141,760.47	1,785,440.12
公允价值变动浮亏	819,526,429.05	204,881,607.27	336,885,486.87	84,221,371.72

应付期货投资者保障基金	405,430.64	101,357.66	958,151.45	239,537.86
其他	15,274,711.91	3,818,677.98	19,773,144.64	4,943,286.17
合计	1,811,035,659.31	452,700,278.85	1,115,139,773.69	278,735,865.22

**(2). 未经抵销的递延所得税负债**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	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	1,061,839,810.65	265,459,952.67	532,722,500.00	133,180,625.00
合计	1,061,839,810.65	265,459,952.67	532,722,500.00	133,180,625.00

**(3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债**
 适用  不适用

**(4). 未确认递延所得税资产明细**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异	43,318,029.42	33,745,209.20
可抵扣亏损	20,876,083.80	18,047,489.36
合计	64,194,113.22	51,792,698.56

**(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**34. 其他资产**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
待抵扣进项税	34,155,132.06	35,770,167.76
待摊费用	13,084,351.09	15,843,766.15
预付税金	11,919,310.62	47,293,192.47
其他	4,646,879.52	183,965.75
合计	63,805,673.29	99,091,092.13

其他应收款按款项性质列示：

 适用  不适用

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

 适用  不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他资产的说明：

无

### 35、 融券业务情况

适用 不适用

### 36、 资产减值准备变动表

适用 不适用

### 37、 金融工具及其他项目预期信用损失准备表

适用 不适用

### 38、 短期借款

#### (1). 短期借款分类

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
保证借款本金	1,427,335,000.00	1,114,800,000.00
保证借款应付利息	1,518,051.38	1,290,934.96
质押借款		40,880,000.00
进口押汇本金	327,264,209.77	542,491,331.20
进口押汇应付利息	977,641.87	1,441,829.52
合计	1,757,094,903.02	1,700,904,095.68

短期借款分类的说明：

无

#### (2). 已逾期未偿还的短期借款情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

### 39、 应付货币保证金

单位：元币种：人民币

明细情况——按客户类别

项目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	131,702	11,734,459,224.53	128,226	11,365,653,443.48
法人	8,439	34,159,617,488.50	8,102	29,055,258,985.53
非结算客户	1	90,568,133.11	1	74,921,290.77
合计	140,142	45,984,644,846.14	136,329	40,495,833,719.78

**40、 应付质押保证金**

单位：元币种：人民币

(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	24	3,402,046,320.00	29	3,515,546,843.72
合计	24	3,402,046,320.00	29	3,515,546,843.72

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	2,704,664,456.00	2,728,413,464.00
郑州商品交易所	345,962,904.00	259,591,140.00
中国金融期货交易所	81,276,000.00	192,784,016.00
大连商品交易所	189,742,960.00	245,125,600.00
上海国际能源交易中心	80,400,000.00	89,632,623.72
合计	3,402,046,320.00	3,515,546,843.72

**41、 应付短期融资款**
 适用  不适用

**42、 拆入资金**
 适用  不适用

**43、 交易性金融负债**

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

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	1,289,369,295.43	995,497,621.29
其中：衍生金融工具	547,918,373.50	310,759,779.04
融券	741,450,921.93	684,737,842.25
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	410,382,922.70	491,308,546.76
其中：结构化主体其他投资者享有的权益	410,382,922.70	491,308,546.76
合计	1,699,752,218.13	1,486,806,168.05

对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描述性说明：

 适用  不适用

(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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益

 适用  不适用

(3) 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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

#### 44、 期货风险准备金

单位：元币种：人民币

(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	289,003,655.90	13,615,717.18	449,750.56	302,169,622.52
合计	289,003,655.90	13,615,717.18	449,750.56	302,169,622.52

(2) 本期风险准备金计提方法和比例说明

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。

(3) 本期动用风险准备金说明

本期公司动用期货风险准备金用于核销穿仓损失。

#### 45、 应付票据

单位：元币种：人民币

项目	期末数	期初数
银行承兑汇票	200,424,931.22	182,251,644.00
合计	200,424,931.22	182,251,644.00

#### 46、 应付账款

单位：元币种：人民币

项目	期末数	期初数
货款	114,238,492.71	109,504,128.94
合计	114,238,492.71	109,504,128.94

#### 47、 卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别

适用 不适用

(2) 按金融资产种类

适用 不适用

(3) 担保物金额

适用 不适用

**(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类**
 适用  不适用

卖出回购金融资产款的说明：

 适用  不适用

**48、代理买卖证券款**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
经纪业务		
其中：个人	82,708,116.12	104,223,705.50
机构	140,982,166.43	126,953,572.64
合计	223,690,282.55	231,177,278.14

代理买卖证券款的说明：

无

**49、代理承销证券款**
 适用  不适用

**50、预收款项**

单位：元币种：人民币

项目	期末数	期初数
预收房租	7,360,482.21	7,276,874.75
合计	7,360,482.21	7,276,874.75

**51、应付期货投资者保障基金**

(1) 明细情况

单位：元币种：人民币

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	1,015,640.53	429,993.26	1,015,640.53	429,993.26
合计	1,015,640.53	429,993.26	1,015,640.53	429,993.26

(2) 应付期货投资者保障基金计提方法和比例说明

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

**52、应付职工薪酬**

(1). 应付职工薪酬列示

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	891,144,872.71	256,841,969.25	380,323,913.74	767,662,928.22
二、离职后福利-设定提存计划	39,142,967.40	31,891,187.35	45,915,354.47	25,118,800.28
三、辞退福利				
合计	930,287,840.11	288,733,156.60	426,239,268.21	792,781,728.50

**(2). 短期薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	851,550,113.91	208,236,415.56	330,361,557.79	729,424,971.68
二、职工福利费	136,602.68	9,090,524.81	9,227,127.49	
三、社会保险费	24,885,477.48	19,861,439.01	14,591,743.78	30,155,172.71
其中：医疗保险费	541,297.01	9,449,697.54	9,503,014.35	487,980.20
补充医疗保险	24,333,241.08	9,801,761.46	4,477,688.05	29,657,314.49
工伤保险费	10,939.39	204,490.33	205,551.70	9,878.02
生育保险费		111,297.41	111,297.41	
其他保险		294,192.27	294,192.27	
四、住房公积金	865,183.00	14,015,973.10	14,104,467.10	776,689.00
五、工会经费和职工教育经费	13,707,495.64	3,616,525.46	10,017,926.27	7,306,094.83
六、非货币性福利		241,547.13	241,547.13	
七、其他短期薪酬		1,779,544.18	1,779,544.18	
合计	891,144,872.71	256,841,969.25	380,323,913.74	767,662,928.22

**(3). 设定提存计划列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	765,757.30	15,768,789.76	15,790,412.88	744,134.18
2、失业保险费	27,348.47	522,397.59	524,941.59	24,804.47
3、补充养老保险	38,349,861.63	15,600,000.00	29,600,000.00	24,349,861.63
合计	39,142,967.40	31,891,187.35	45,915,354.47	25,118,800.28

其他说明：

□适用 √不适用

**53、 应交税费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	101,170,111.75	53,235,736.20
企业所得税	81,342,672.51	277,188,445.67
代扣代缴个人所得税	1,848,973.24	3,007,541.75
城市维护建设税	366,595.44	739,832.32
土地使用税		28,540.00
教育费附加	170,181.48	319,421.54
地方教育附加	113,573.94	213,067.36
印花税	305,560.00	251,175.40
代扣代缴税金	86,237.82	428,653.89
房产税		291,752.04
商品及服务税		184,797.93
合计	185,403,906.18	335,888,964.10

其他说明：

无

**54、应付款项**
**(1). 应付款项列示**
 适用  不适用

**(2). 应付票据**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**55、合同负债**
**(1). 合同负债情况**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
预收货款	1,034,327,557.08	760,114,357.55
投资咨询费	1,193,286.20	799,984.34
基金销售业务收入	2,980.50	40,677.77
合计	1,035,523,823.78	760,955,019.66

**(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**56、其他应付款**

单位：元币种：人民币

**(1) 明细情况**

项目	期末数	期初数
应付股利	407,555,555.68	
其他应付款	3,553,259,314.38	2,731,220,424.71
小计	3,960,814,870.06	2,731,220,424.71

**(2) 应付股利**

项目	期末数	期初数
普通股股利	407,555,555.68	
小计	407,555,555.68	

**(3) 其他应付款**

	期末数	期初数
应付佣金	794,453.18	1,024,562.57
经营层风险金	7,980,873.04	12,226,556.70
交易所质押款	412,686,408.00	205,987,104.00

场外业务应付款	3,059,078,238.46	2,470,837,769.09
暂估工程款	1,129,788.04	5,024,706.04
其他	71,589,553.66	36,119,726.31
合计	3,553,259,314.38	2,731,220,424.71

### 57、持有待售负债

适用 不适用

### 58、预计负债

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
未决诉讼	425,530.10	406,825.86
合计	425,530.10	406,825.86

其他说明，包括重要预计负债的相关重要假设、估计说明：

无

### 59、长期借款

#### (1). 长期借款分类

适用 不适用

其他说明，包括利率区间：

适用 不适用

### 60、应付债券

适用 不适用

单位：元币种：人民币

债券类型	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
永安期货股份有限公司 2020 年次级债券	100.00	2020/11/23	3 年	300,000,000.00	4.30	301,378,356.16	4,135,043.84	305,513,400.00	

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

无

### 61、租赁负债

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
尚未支付的租赁付款额	135,029,151.21	103,378,759.49
减：未确认融资费用	13,418,104.99	11,458,718.06
合计	121,611,046.22	91,920,041.43

其他说明：

无

**62、递延收益**
 适用  不适用

**63、其他负债**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
待转销项税额	133,786,767.53	81,535,287.37
合计	133,786,767.53	81,535,287.37

其他应付款按款项性质列示：

 适用  不适用

其他负债的说明：

无

**64、股本**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	1,455,555,556.00						1,455,555,556.00

其他说明：

无

**65、其他权益工具**
**(1) 其他金融工具划分至其他权益工具的基本情况（划分依据、主要条款和股利或利息的设定机制等）**
 适用  不适用

**(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表**
 适用  不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**66、资本公积**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	3,851,110,973.01			3,851,110,973.01
其他资本公积	11,628,052.98		97,988.33	11,530,064.65
合计	3,862,739,025.99		97,988.33	3,862,641,037.66

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期其他资本公积变动系公司对联营企业玉皇山南除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动按持股比例计算应享有的份额-97,988.33 元，计入其他资本公积。

#### 67、 库存股

适用 不适用

**68、其他综合收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额						期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司	
一、不能重分类进损益的其他综合收益								
二、将重分类进损益的其他综合收益	-40,294,889.82	51,082,148.85				51,082,148.85	51,082,148.85	10,787,259.03
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-1,220,053.50							-1,220,053.50
外币财务报表折算差额	-39,074,836.32	51,082,148.85				51,082,148.85	51,082,148.85	12,007,312.53
其他综合收益合计	-40,294,889.82	51,082,148.85				51,082,148.85	51,082,148.85	10,787,259.03

其他综合收益说明：

无

## 69、 盈余公积

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	569,827,332.58			569,827,332.58
合计	569,827,332.58			569,827,332.58

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

## 70、 一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	629,718,346.51				629,718,346.51
合计	629,718,346.51				629,718,346.51

一般风险准备的说明

无

## 71、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	5,108,132,627.53	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	5,108,132,627.53	3,961,754,712.82
加：本期归属于母公司所有者的净利润	316,015,105.58	1,306,554,365.77
减：提取法定盈余公积		80,088,225.53
提取一般风险准备		80,088,225.53
应付普通股股利	407,555,555.68	
期末未分配利润	5,016,592,177.43	5,108,132,627.53

调整期初未分配利润明细：

- 1、由于《企业会计准则》及其相关新规定进行追溯调整，影响期初未分配利润 0 元。
- 2、由于会计政策变更，影响期初未分配利润 0 元。
- 3、由于重大会计差错更正，影响期初未分配利润 0 元。
- 4、由于同一控制导致的合并范围变更，影响期初未分配利润 0 元。
- 5、其他调整合计影响期初未分配利润 0 元。

## 72、 利息净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	391,629,964.25	255,787,318.68
利息支出	119,926,775.42	72,731,287.09
利息净收入	271,703,188.83	183,056,031.59

利息净收入的说明：  
无

### 73、手续费及佣金净收入

#### (1) 手续费及佣金净收入情况

适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
经纪手续费净收入	340,874,308.79	367,921,268.13
资产管理业务收入	5,994,937.85	5,973,652.28
投资咨询收入	678,309.07	868,253.58
基金销售业务收入	75,445,208.19	48,116,568.94
合计	422,992,763.90	422,879,742.93

#### (2) 分行政区域分支机构及手续费净收入情况

单位：元币种：人民币

行政区域名称	分支机构家数	手续费净收入金额
杭州本部		363,461,694.94
香港特别行政区[注]		21,141,891.29
浙江省(不含杭州本部)	16	14,322,960.48
山东省	6	4,004,102.78
辽宁省	3	1,621,825.23
北京市	1	2,031,308.64
上海市	1	1,568,207.06
广东省	2	3,115,068.95
江苏省	2	1,748,410.65
福建省	2	1,125,123.01
吉林省	1	774,902.37
天津市	1	743,727.47
河北省	2	1,060,601.11
河南省	1	1,839,442.17
湖北省	1	758,080.83
江西省	1	626,884.94
重庆市	1	880,744.32
湖南省	1	692,065.61
四川省	1	1,140,790.84
陕西省	1	334,931.21
合计	44	422,992,763.90

[注]香港特别行政区业务通过子公司新永安期货、新永安证券、新永安资管和永安国际金融开展。

#### (3) 财务顾问业务净收入

适用  不适用

**(4) 代理销售金融产品业务**
 适用  不适用

**(5) 资产管理业务**
 适用  不适用

手续费及佣金净收入的说明：

 适用  不适用

**74、投资收益**
**(1) 投资收益情况**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	31,704,913.10	247,172,052.17
金融工具持有期间的投资收益	86,066,600.74	382,349,018.29
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	86,066,600.74	382,349,018.29
其他权益工具投资		
处置金融工具取得的投资收益	177,855,334.26	134,004,749.34
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	177,855,334.26	134,004,749.34
减：结构化主体其他投资者享有的收益	35,661,307.13	7,574,223.08
合计	259,965,540.97	755,951,596.72

**(2) 交易性金融工具投资收益明细表**
 适用  不适用

**75、净敞口套期收益**
 适用  不适用

**76、其他收益**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
与收益相关的政府补助	2,370,427.89	5,143,786.11
代扣个人所得税手续费返还	1,432,566.80	1,099,334.53
合计	3,802,994.69	6,243,120.64

其他说明：

本期计入其他收益的政府补助情况详见本节“七、97、政府补助”之说明。

**77、公允价值变动收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	159,727,984.48	135,920,415.09
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	387,898,521.17	443,502,056.48
交易性金融负债	-106,192,680.39	-358,790,093.22
其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益	-225,896,469.21	-311,055,379.90
合计	53,535,304.09	-222,869,678.13

其他说明：

无

**78、汇兑收益**

单位：元币种人民币

项目	本期发生额	上期发生额
汇兑收益	-17,646,646.19	-57,374.90
合计	-17,646,646.19	-57,374.90

**79、其他业务收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
销售货物收入	18,536,794,171.39	15,516,932,559.13
租赁收入	11,050,290.42	10,994,080.06
交易所课题费、活动费等收入	123,190.58	7,926,010.84
其他	7,839,729.84	3,522,906.55
合计	18,555,807,382.23	15,539,375,556.58

其他业务收入说明：

无

**80、资产处置收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
固定资产处置收益	977,005.04	439.84
合计	977,005.04	439.84

其他说明：

□适用 √不适用

**81、提取期货风险准备金**

单位：元币种人民币

项目	本期发生额	上期发生额
提取期货风险准备金	13,615,717.18	15,111,716.42
合计	13,615,717.18	15,111,716.42

**82、税金及附加**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	1,174,404.51	1,487,780.53
教育费附加	521,694.09	637,567.38
地方教育附加	347,796.03	425,153.50
印花税	2,802,232.60	1,856,874.80
房产税	1,940,668.32	1,963,550.88
其他	27,033.91	31,432.91
合计	6,813,829.46	6,402,360.00

其他说明：

无

**83、业务及管理费**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
工资奖金	208,236,415.56	338,511,894.66
非工资奖金薪酬	80,496,741.04	71,272,147.88
仓储费	36,428,827.16	41,614,735.67
租赁费（含使用权资产摊销）	22,644,298.88	20,641,180.93
运输费	29,589,049.83	12,665,618.24
通讯费	2,713,029.94	6,379,853.56
业务招待费	3,897,915.22	5,382,904.42
折旧费	5,957,698.36	5,180,931.89
数据业务费	3,928,530.52	5,140,391.13
无形资产摊销	3,473,949.48	3,098,794.99
信息咨询费	5,547,245.83	3,563,782.63
广告宣传费	5,447,344.77	3,029,228.10
IB业务费	4,001,661.24	5,183,957.92
差旅费	1,968,922.78	4,204,685.29
其他	38,438,029.15	48,247,918.07
合计	452,769,659.76	574,118,025.38

其他说明：

无

**84、信用减值损失**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	-4,366,657.32	-1,078,998.77
坏账损失	45,735,427.50	41,053,085.39
存出保证金减值损失	209.09	55.34
结算备付金减值损失	1,176.98	11.05
应收货币保证金减值损失	11,534,069.43	9,719,189.65
合计	52,904,225.68	49,693,342.66

其他说明：

无

**85、其他资产减值损失**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
存货跌价损失	364,168,816.32	131,874,091.89
合计	364,168,816.32	131,874,091.89

其他说明：

详见本节“七、20、存货”之说明。

**86、其他业务成本**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
销售货物成本	18,263,803,241.92	15,109,439,046.86
租赁成本	5,227,973.22	5,349,422.70
其他		456,835.51
合计	18,269,031,215.14	15,115,245,305.07

其他说明：

无

**87、营业外收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
合同违约金收入	7,390,571.67	104,473,287.64	
非流动资产毁损报废利得		6.49	
其他	3,676.36	16,546.06	3,676.36
合计	7,394,248.03	104,489,840.19	3,676.36

计入当期损益的政府补助

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

## 88、营业外支出

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
捐赠支出	1,395,259.19	816,800.00	1,395,259.19
违约金	1,627.91	908,888.97	1,627.91
非流动资产毁损报废损失	11,935.71	19,533.90	11,935.71
地方水利建设基金	9,398.81	1,547.52	
罚款及滞纳金	89,113.59	1,959.72	89,113.59
其他	118.75	2,285.79	118.75
合计	1,507,453.96	1,751,015.90	1,498,055.15

营业外支出的说明：

无

## 89、所得税费用

### (1) 所得税费用表

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	123,390,844.47	225,880,654.56
递延所得税费用	-41,685,085.96	-70,653,200.83
合计	81,705,758.51	155,227,453.73

### (2) 会计利润与所得税费用调整过程

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	397,720,864.09
按母公司适用税率计算的所得税费用	99,430,216.02
子公司适用不同税率的影响	-4,772,422.92
调整以前期间所得税的影响	851,306.73
非应税收入的影响	-4,923,544.87
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	340,722.31
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-9,244,032.94
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	23,514.18
所得税费用	81,705,758.51

其他说明：

适用  不适用

## 90、其他综合收益

适用  不适用

详见本节“七、68、其他综合收益”之说明。

## 91、现金流量表项目

### (1). 收到的其他与经营活动有关的现金

适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
客户保证金净额	6,631,508,865.52	5,495,928,946.99
违约金及保险赔付收入	7,390,571.67	104,473,287.64
保证金及定期存款减少	1,414,759,652.48	
融出资金净减少	73,751,166.09	
应收结算担保金和结算备付金减少	8,606,560.42	
往来款净额		614,172,253.51
收到的税费返还		1,214,403.24
其他现金流入	5,034,779.61	31,111,675.74
合计	8,141,051,595.79	6,246,900,567.12

收到的其他与经营活动有关的现金说明：

无

### (2). 支付的其他与经营活动有关的现金

适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易所保证金净额	2,929,314,522.77	663,377,547.23
保证金及定期存款增加		113,212,611.02
融出资金净增加		1,175,347,158.24
应收结算担保金和结算备付金增加		9,564,771.69
往来款净额	176,191,663.94	
其他现金流出	1,935,870.00	1,808,790.04
合计	3,107,442,056.71	1,963,310,878.22

支付的其他与经营活动有关的现金说明：

无

### (3). 收到的其他与投资活动有关的现金

适用  不适用

**(4). 支付的其他与投资活动有关的现金**
 适用  不适用

**(5). 收到的其他与筹资活动有关的现金**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
纳入合并范围的结构化主体收到的现金		270,756,558.94
合计		270,756,558.94

收到的其他与筹资活动有关的现金说明：

无

**(6). 支付的其他与筹资活动有关的现金**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
纳入合并范围的结构化主体清算支付的现金	116,586,931.19	
使用权资产的增加	22,552,376.36	10,765,910.97
合计	139,139,307.55	10,765,910.97

支付的其他与筹资活动有关的现金说明：

无

**92、现金流量表补充资料**
**(1) 现金流量表补充资料**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	316,015,105.58	739,645,964.41
加：资产减值准备	417,073,042.00	181,567,434.55
提取期货风险准备金	13,615,717.18	15,111,716.42
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	11,185,671.58	10,530,354.59
无形资产摊销	3,473,949.48	3,098,794.99
使用权资产摊销	19,873,220.73	15,313,386.83
长期待摊费用摊销	2,364,601.21	2,387,627.28
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）	-977,005.04	-439.84
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	11,935.71	19,527.41

公允价值变动损失（收益以“－”号填列）	-53,535,304.09	222,869,678.13
财务费用（收益以“－”号填列）	53,713,997.90	47,112,548.54
投资损失（收益以“－”号填列）	3,956,394.03	-239,597,829.09
递延所得税资产减少（增加以“－”号填列）	-173,964,413.63	-109,040,929.66
递延所得税负债增加（减少以“－”号填列）	132,279,327.67	38,387,728.83
存货的减少（增加以“－”号填列）	-1,042,088,097.51	-543,239,910.03
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-4,315,114,955.29	-4,117,971,588.54
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	7,967,782,283.39	7,889,409,056.63
经营活动产生的现金流量净额	3,355,665,470.90	4,155,603,121.45
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
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		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>		
现金的期末余额	34,134,569,331.95	25,187,419,491.02
减：现金的期初余额	31,601,584,871.00	19,546,642,778.83
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	2,532,984,460.95	5,640,776,712.19

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

适用 不适用

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

适用 不适用

(4) 现金和现金等价物的构成

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	34,134,569,331.95	31,601,584,871.00
其中：库存现金	12,127.02	10,490.46
可随时用于支付的银行存款	34,106,586,552.54	31,547,133,909.45
可随时用于支付的其他货币资金	27,970,652.39	54,440,471.09
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		
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		

三、期末现金及现金等价物余额	34,134,569,331.95	31,601,584,871.00
其中：母公司或集团内子公司使用受限的现金和现金等价物		

其他说明：

适用  不适用

期末货币资金中定期存款、保函保证金、信用证保证金等合计金额为 274,676,125.42 元，不作为现金及现金等价物反映。

### 93、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

适用  不适用

### 94、所有权或使用权受到限制的资产

适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	238,660,804.52	保函保证金、票据保证金、信用证保证金、ETC 押金冻结等
存货	358,466,127.21	质押
交易性金融资产	1,299,300,296.14	融券担保品
合计	1,896,427,227.87	

其他说明：

无

### 95、外币货币性项目

#### (1). 外币货币性项目：

适用  不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			3,011,366,635.42
其中：美元	385,953,252.64	6.7114	2,590,286,659.77
港币	440,272,635.15	0.8552	376,521,157.58
新加坡元	6,064,130.44	4.8170	29,210,916.33
欧元	1,680,950.51	7.0084	11,780,773.55
日元	65,604,343.00	0.0491	3,221,173.24
英镑	42,518.89	8.1365	345,954.95
结算备付金			155,991.34
其中：美元	19,979.00	6.7114	134,087.06
港币	25,613.05	0.8552	21,904.28
融出资金			74,672,996.37
其中：美元	338,757.95	6.7114	2,273,540.11
港币	84,657,923.60	0.8552	72,399,456.26
应收货币保证金			835,764,669.01
其中：美元	90,866,308.15	6.7114	609,840,140.52
港币	203,936,665.27	0.8552	174,406,636.14

欧元	3,907,808.65	7.0084	27,387,486.14
日元	81,508,143.00	0.0491	4,002,049.82
英镑	108,359.14	8.1365	881,664.14
马来西亚币	29,181,758.42	0.6557	19,134,479.00
韩元	21,579,471.00	0.0052	112,213.25
存出保证金			842,180.00
其中：美元	100,000.00	6.7114	671,140.00
港币	200,000.00	0.8552	171,040.00
应收账款			6,487,533.20
其中：美元	966,643.80	6.7114	6,487,533.20
应收结算担保金			3,355,700.00
其中：美元	500,000.00	6.7114	3,355,700.00
其他应收款			43,584,153.76
其中：美元	2,818,052.62	6.7114	18,913,078.35
港币	28,542,912.85	0.8552	24,409,899.07
新加坡元	54,219.71	4.8170	261,176.34
交易性金融资产			70,306,933.85
其中：美元	10,475,747.81	6.7114	70,306,933.85
短期借款			329,484,299.33
其中：美元	49,093,229.33	6.7114	329,484,299.33
代理买卖证券款			209,102,248.12
其中：美元	19,865,392.23	6.7114	133,324,593.41
港币	88,608,108.87	0.8552	75,777,654.71
交易性金融负债			13,491,708.70
其中：美元	2,010,267.41	6.7114	13,491,708.70
应付职工薪酬			4,161,066.01
其中：港币	4,800,000.00	0.8552	4,104,960.00
新加坡元	11,647.50	4.8170	56,106.01
应交税费			7,759,623.94
其中：美元	975,222.62	6.7114	6,545,109.09
港币	1,420,153.00	0.8552	1,214,514.85
其他应付款			2,338,687.39
其中：美元	143,950.18	6.7114	966,107.24
港币	1,549,706.22	0.8552	1,325,308.76
新加坡元	9,813.45	4.8170	47,271.39
应付货币保证金			2,451,380,741.48
其中：欧元	5,536,022.63	7.0084	38,798,661.00
英镑	129,238.66	8.1365	1,051,550.36
港币	295,838,009.70	0.8552	253,000,665.90
日元	142,320,628.00	0.0491	6,987,942.83
韩元	21,571,101.00	0.0052	112,169.73
马来西亚币	29,272,181.47	0.6557	19,193,769.39
新加坡元	500.47	4.8170	2,410.76
美元	317,703,246.94	6.7114	2,132,233,571.51
应付账款			2,439,478.46
其中：美元	363,482.80	6.7114	2,439,478.46

其他说明：

无

(2). 境外经营实体说明，包括对于重要的境外经营实体，应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据，记账本位币发生变化的还应披露原因。

√适用 □不适用

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

## 96、套期

□适用 √不适用

## 97、政府补助

### 1. 政府补助基本情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

种类	金额	列报项目	说明
就业补助	269,936.10	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、
稳岗补贴	1,112,058.46	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	33,333.33	其他收益	台州分公司政府考评奖
财政扶持资金	279,800.00	其他收益	上海自由贸易试验区临港新片区财政扶持资金
出疆棉花运费补贴	675,300.00	其他收益	新疆维吾尔自治区财政对出疆棉花的运费补贴
小计	2,370,427.89		

### 2. 政府补助退回情况

□适用 √不适用

其他说明

无

## 98、其他

□适用 √不适用

## 八、资产证券化业务的会计处理

适用  不适用

## 九、合并范围的变更

### 1、非同一控制下企业合并

适用  不适用

### 2、同一控制下企业合并

适用  不适用

### 3、反向购买

适用  不适用

### 4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用  不适用

### 5、其他原因的合并范围变动

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：

适用  不适用

### 6、其他

适用  不适用

## 十、在其他主体中的权益

### 1、在子公司中的权益

#### (1) 企业集团的构成

适用  不适用

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	
中邦实业	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下企业合并
永安资本	杭州	杭州	商业	100.00		设立
永安瑞萌	上海	上海	商业		100.00	设立
香港永安商贸	香港	香港	商业		100.00	设立
永安国贸	新加坡	新加坡	商业		100.00	设立
永安国油	舟山	舟山	商业		100.00	设立
新永安金控	香港	香港	金融业	100.00		设立
新永安期货	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安实业	香港	香港	商业		100.00	设立
新永安资管	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安证券	香港	香港	金融业		100.00	设立
永安国际金融	新加坡	新加坡	金融业		100.00	设立
永安全球基金	香港	开曼	金融业		100.00	设立

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：  
无

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位、以及持有半数以上表决权但不控制被投资单位的依据：  
无

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

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

截至 2022 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、永盈 3 号集合资产管理计划和永盈 7 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。

确定公司是代理人还是委托人的依据：

1) 存在单独一方拥有实质性权利可以无条件罢免决策者的，该为代理人；

2) 除 1) 以外的情况下，综合考虑决策者对被投资方的决策权范围、其他方享有的实质性权利、决策者的薪酬水平、决策者因持有被投资方中的其他权益所承担可变回报的风险等相关因素进行判断。

其他说明：  
无

**(2). 重要的非全资子公司**

适用 不适用

**(3). 重要非全资子公司的主要财务信息**

适用 不适用

**(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制：**

适用 不适用

**(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持：**

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**2、 在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易**

适用 不适用

**3、 在合营企业或联营企业中的权益**

适用 不适用

**(1). 重要的合营企业或联营企业**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

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

在合营企业或联营企业的持股比例不同于表决权比例的说明：

无

持有 20%以下表决权但具有重大影响，或者持有 20%或以上表决权但不具有重大影响的依据：

无

**(2). 重要合营企业的主要财务信息**

□适用 √不适用

**(3). 重要联营企业的主要财务信息**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	期末余额/本期发生额	期初余额/上期发生额
	永安国富	永安国富
流动资产	3,590,482,109.94	4,238,063,180.44
非流动资产	148,175,874.22	156,384,350.36
资产合计	3,738,657,984.16	4,394,447,530.80
流动负债	840,988,031.76	1,392,867,852.38
非流动负债	16,226,660.51	16,226,660.51
负债合计	857,214,692.27	1,409,094,512.89
归属于母公司股东权益	2,881,443,291.89	2,985,353,017.91
按持股比例计算的净资产份额	903,445,757.99	936,025,691.08
对联营企业权益投资的账面价值	903,445,757.99	936,025,691.08
营业收入	1,553,321,747.62	3,623,601,711.49
净利润	96,090,273.98	759,367,271.76
归属于母公司所有者的净利润	96,090,273.98	759,367,271.76
综合收益总额	96,090,273.98	759,367,271.76
本年度收到的来自联营企业的股利	62,708,000.00	62,708,000.00

其他说明：

无

**(4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

	期末余额/本期发生额	期初余额/上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	34,664,670.51	36,045,122.69
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	13,567,328.17	9,080,489.53
--其他综合收益	-288,096.19	-59,468.77
--综合收益总额	13,279,231.98	9,021,020.76

其他说明：

无

**(5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：**
 适用  不适用

**(6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损**
 适用  不适用

**(7). 与合营企业投资相关的未确认承诺**
 适用  不适用

**(8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债**
 适用  不适用

**4、重要的共同经营**
 适用  不适用

**5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益**

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

 适用  不适用

截至 2022 年 6 月 30 日，与公司相关联、但未纳入公司合并财务报表范围的结构化主体系公司发起设立的资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要是通过管理这些结构化主体赚取管理费收入及业绩报酬提成。

截至 2022 年 6 月 30 日，与本公司相关联、但未纳入本公司合并财务报表范围的结构化主体主要从事证券投资业务。这类结构化主体 2022 年 6 月 30 日的资产总额为 8.36 亿元。

**6、其他**
 适用  不适用

**十一、与金融工具相关的风险**
 适用  不适用

详见本节“十八、风险管理”。

## 十二、 净资产

2022 年半年度本公司按照中国证券监督管理委员会《期货公司风险监管指标管理办法》(证监会令[第 131 号])的要求计算净资产, 母公司净资产为 3,859,183,697.29 元。

## 十三、 公允价值的披露

### 1、 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用 □不适用

单位: 元币种: 人民币

项目	期末公允价值			合计
	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	
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一) 交易性金融资产和其他非流动金融资产	4,695,721,669.38	2,388,598,312.10		7,084,319,981.48
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	4,695,721,669.38	2,388,598,312.10		7,084,319,981.48
(1) 债务工具投资	25,143,318.53			25,143,318.53
(2) 权益工具投资	4,002,806,954.68	2,181,270,682.63		6,184,077,637.31
(3) 衍生金融资产	667,771,396.17	207,327,629.47		875,099,025.64
(二) 应收款项融资			7,827,887.49	7,827,887.49
(三) 其他债权投资				
(四) 其他权益工具投资			25,217,355.94	25,217,355.94
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	4,695,721,669.38	2,388,598,312.10	33,045,243.43	7,117,365,224.91
(五) 交易性金融负债	1,198,382,688.90	517,361,774.23		1,715,744,463.13
1. 交易性金融负债	1,198,382,688.90	106,978,851.53		1,305,361,540.43
衍生金融负债[注]	456,931,766.97	106,978,851.53		563,910,618.50
融券	741,450,921.93			741,450,921.93
2. 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		410,382,922.70		410,382,922.70
结构化主体其他投资者享有的权益		410,382,922.70		410,382,922.70
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	1,198,382,688.90	517,361,774.23		1,715,744,463.13

[注] 衍生金融资产、衍生金融负债中含期货合约持仓损益, 相关说明见本节“七、19、交易性金融资产”之说明。

### 2、 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

√适用 □不适用

根据二级市场公开报价确认该计量项目的市价。

**3、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**
 适用  不适用

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。

**4、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**
 适用  不适用

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。

**5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析**
 适用  不适用

**6、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策**
 适用  不适用

**7、本期内发生的估值技术变更及变更原因**
 适用  不适用

**8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况**
 适用  不适用

**9、其他**
 适用  不适用

**十四、关联方及关联交易**
**1、本企业的母公司情况**
 适用  不适用

**2、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	股本 (截至 2022 年 6 月 30 日)	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	464,373 万元	30.18	30.18

(2) 本公司最终控制方是浙江省财政厅。

浙江省财政厅间接控制永安期货 63.76% 的股权：1) 浙江省财政厅通过直接持有省金控 100.00% 股权和浙江省财务开发有限责任公司（以下简称省财开）100.00% 股权，间接控制财通证券 32.40%

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 24.05%的股权；3) 省金控直接持有本公司 9.53%的股权。

### 3、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

适用  不适用

本企业的子公司情况详见本节“十、在其他主体中的权益”之说明。

### 4、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

适用  不适用

本企业的子公司情况详见本节“十、在其他主体中的权益”之说明。

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

适用  不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
OSTC YONGAN	香港永安商贸之联营企业
玉皇山南	永安资本之联营企业

其他说明：

适用  不适用

### 5、其他关联方情况

适用  不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
永安国富实业	永安国富之子公司
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
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
永安投资咨询	OSTC YONGAN 之子公司
浙江东方	持股 5%以上股东
浙江济海贸易发展有限公司	浙江东方的子公司
物产中大集团股份有限公司(以下简称物产中大)	关联自然人担任高级管理人员的企业
物产中大金属集团有限公司	物产中大之子公司
物产中大国际贸易集团有限公司	物产中大之子公司
上海欧泰实业有限公司	物产中大之孙公司
浙江物产道富有限公司	物产中大之孙公司
浙江物产中扬供应链服务有限公司	物产中大之孙公司
舟山瑞鸿通国际贸易有限公司	物产中大之孙公司
物产中大化工集团有限公司	物产中大之子公司
浙江物产氯碱化工有限公司	物产中大之孙公司
物产中大(海南)发展有限公司	物产中大之孙公司
宁波浙金钢材有限公司	物产中大之孙公司
天津茂高实业有限公司	物产中大之孙公司

物产化工(浙江自贸区)有限公司	物产中大之孙公司
物产中大元通齐达(浙江)贸易有限公司	物产中大之孙公司
物产中大欧泰有限公司	物产中大之子公司
山东新豪克轮胎有限公司	物产中大化工集团有限公司之孙公司
青岛赛橡国际贸易有限公司	物产中大之孙公司
物产中大丰盛国际贸易有限公司	物产中大之孙公司
浙江物产永利实业有限公司	物产中大之孙公司
宁波市镇海宏道贸易有限公司	物产中大之孙公司
舟山聚能能源有限公司	物产中大之孙公司
杭州中大君悦投资有限公司	物产中大之孙公司
浙江物产环保能源股份有限公司	物产中大之子公司
浙江物产化工集团宁波有限公司	物产中大之孙公司
物产中大(海南)资源有限公司	浙江物产中扬供应链服务有限公司之子公司
上海茂高物产贸易有限公司	物产中大之孙公司

其他说明:

本公司按照《企业会计准则》及《上海证券交易所股票上市规则》确定关联方。

## 6、关联交易情况

### (1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

√适用 □不适用

单位: 元币种: 人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
永富物产	采购货物	12,333,320.36	91,811,506.70
浙江济海贸易发展有限公司	采购货物	5,547,598.39	
物产中大金属集团有限公司	采购货物	124,012,465.96	
物产中大国际贸易集团有限公司	采购货物	84,842,468.24	
上海欧泰实业有限公司	采购货物	663,451.33	
浙江物产道富有限公司	采购货物	101,146,075.08	
浙江物产中扬供应链服务有限公司	采购货物	30,255,912.36	
舟山瑞鸿通国际贸易有限公司	采购货物	4,246,079.65	
物产中大化工集团有限公司	采购货物	44,357,715.04	
浙江物产氯碱化工有限公司	采购货物	121,898.23	
物产中大(海南)发展有限公司	采购货物	3,021,688.08	
宁波浙金钢材有限公司	采购货物	3,706,146.73	
天津茂高实业有限公司	采购货物	4,414,729.38	
物产化工(浙江自贸区)有限公司	采购货物	784,070.80	
物产中大元通齐达(浙江)贸易有限公司	采购货物	7,948,984.64	
物产中大欧泰有限公司	采购货物	4,647,504.42	
财通证券	接受 IB 业务服务	4,001,661.24	5,183,957.92

## 出售商品/提供劳务情况表

 适用  不适用

单位：元币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
永富物产	销售货物	8,391,940.13	26,167,388.11
山东新豪克轮胎有限公司	销售货物	4,728,798.75	
青岛赛橡国际贸易有限公司	销售货物	4,864,100.57	
物产中大金属集团有限公司	销售货物	190,125,551.10	
物产中大国际贸易集团有限公司	销售货物	93,340,590.10	
浙江物产道富有限公司	销售货物	85,899,746.27	
物产中大富盛国际贸易有限公司	销售货物	23,874,714.52	
物产中大化工集团有限公司	销售货物	83,237,552.89	
浙江物产永利实业有限公司	销售货物	11,713,522.12	
浙江物产中扬供应链服务有限公司	销售货物	17,309,776.15	
宁波市镇海宏道贸易有限公司	销售货物	497,876.11	
上海欧泰实业有限公司	销售货物	4,706,378.76	
舟山聚能能源有限公司	销售货物	327,823.01	
永安国富	提供资产管理产品代销服务	8,062,596.78	16,353,190.84
财通资管	提供资产管理产品代销服务	14,309.16	11.81

## 购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

 适用  不适用

## (2). 部分关联方在本公司开设期货账户从事期货交易情况

单位：元币种：人民币

客户名称[注]	权益	手续费净收入
财通证券	238,830,876.28	16,354.21
永安国富实业	57,600,344.25	4,251.61
永富物产	12,197,758.02	8,015.94
永安投资咨询	721.00	
财通基金	368,876,059.93	732.71
财通资管	3,206,179.79	165.71
永安国富	2,208,415,981.31	341,546.03
杭州中大君悦投资有限公司	1,001.00	
浙江物产道富有限公司	7,865.46	
物产中大化工集团有限公司	10,946,200.90	3,453.49
浙江物产氯碱化工有限公司	88,192.20	
浙江物产环保能源股份有限公司	36,943,711.35	2,200.08
浙江物产化工集团宁波有限公司	10,606,165.10	6,447.08
物产中大金属集团有限公司	10.00	
物产中大欧泰有限公司	9,576,011.21	2,400.29
小计	2,957,297,077.80	385,567.15

[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

单位:元币种:人民币

管理人	资管产品账面价值
永安国富	1,230,673,514.58
财通资管	677,940,332.39
财通基金	880,085,445.23
小计	2,788,699,292.20

(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

持有人	持有份额
浙江东方	310,015,069.44
永安国富	34,027,745.47
本公司董监高及其关系密切的家庭成员、直接或间接控制本公司的法人的董监高	2,600,437.50
小计	346,643,252.41

(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:

单位:元币种:人民币

公司	资金余额	证券交易费
本公司	279,533.47	8,731.14
永安资本	1,056,659.91	5,335.25
合计	1,336,193.38	14,066.39

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:

单位:元币种:人民币

关联方	本期数	上年同期数
财通证券	318,509.91	819,471.99

(6). 永安资本与关联方发生场外期权交易, 取得投资收益明细如下:

关联方	本期数	上年同期数
财通证券	-1,678,594.52	-37,647,405.06
浙江物产道富有限公司	1,264,650.00	
永富物产	-206,000.00	

(7). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表:

适用 不适用

关联托管/承包情况说明:

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表:

适用 不适用

关联管理/出包情况说明:

适用 不适用

#### (8). 关联租赁情况

本公司作为出租方:

适用 不适用

单位: 元币种: 人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
财通证券	房屋租赁	10,807,626.76	10,807,626.76

本公司作为承租方:

适用 不适用

关联租赁情况说明

#### (9). 关联担保情况

本公司作为担保方

适用 不适用

本公司作为被担保方

适用 不适用

关联担保情况说明

适用 不适用

#### (10). 关联方资金拆借

适用 不适用

#### (11). 关联方资产转让、债务重组情况

适用 不适用

#### (12). 关键管理人员报酬

适用 不适用

单位: 万元币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	1,646.63	1,849.74

#### (13). 其他关联交易

适用 不适用

1) 2020 年 11 月公司发行永安期货股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期) 3 亿元, 期限为 2020 年 11 月 23 日至 2023 年 11 月 23 日。2022 年 4 月 28 日, 该债券提前偿还(兑付)并摘牌, 公司支付财通资管次级债本金及利息 65,176,192.00 元(其中利息 1,176,192.00 元)。

2) 截至 2022 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 622,237.48 元。

3) 截至 2022 年 6 月 30 日, 永安资本与永富物产签订的场外衍生品合约浮亏 2,029.50 元。

4) 截至 2022 年 6 月 30 日, 永安资本与物产中大金属集团有限公司签订的场外衍生品合约浮亏 97,900.00 元。

- 5)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与浙江物产道富有限公司签订的场外衍生品合约浮盈 1,515,630.14 元。
- 6)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与物产中大金属集团有限公司签订的远期合约浮盈 2,243,362.84 元。
- 7)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与舟山瑞鸿通国际贸易有限公司签订的远期合约浮盈 194,690.27 元。
- 8)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与物产中大化工集团有限公司签订的远期合约浮盈 8,030.97 元。
- 9)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与物产中大国际贸易集团有限公司签订的远期合约浮亏 3,465,486.72 元。
- 10)截至 2022 年 6 月 30 日,永安资本与物产中大欧泰有限公司签订的远期合约浮亏 58,374.80 元。
- 11)截至 2022 年 6 月 30 日,永安国贸与青岛赛橡国际贸易有限公司签订的远期合约浮亏 90,357.72 元。
- 12)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与永富物产签订的远期合约浮盈 46,136.07 元。
- 13)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与物产中大化工集团有限公司签订的远期合约浮亏 22,943.15 元。
- 14)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与上海欧泰实业有限公司签订的远期合约浮盈 22,566.37 元。
- 15)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与物产中大国际贸易集团有限公司签订的远期合约浮盈 796,460.18 元。
- 16)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与物产中大金属集团有限公司签订的远期合约浮盈 2,993,194.75 元。
- 17)截至 2022 年 6 月 30 日,永安瑞萌与舟山瑞鸿通国际贸易有限公司签订的远期合约浮盈 106,194.69 元。

## 7、关联方应收应付款项

### (1). 应收项目

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
预付账款	物产中大金属集团有限公司	9,708,841.70			
预付账款	物产中大国际贸易集团有限公司	19,528,515.30			
预付账款	浙江物产道富有限公司	1,083,487.73			
预付账款	上海欧泰实业有限公司	86,248.67			
预付账款	浙江物产中扬供应链服务有限公司	1,425,700.50			
预付账款	舟山瑞鸿通国际贸易有限公司	2,363,990.35			
预付账款	物产中大化工集团有限公司	142,230.01			

预付账款	物产中大元通齐达(浙江)贸易有限公司	858,480.60			
------	--------------------	------------	--	--	--

**(2). 应付项目**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
合同负债	永富物产		276,958.80
合同负债	物产中大金属集团有限公司	24,226,642.89	
合同负债	物产中大国际贸易集团有限公司	7,373,672.57	
合同负债	物产中大(海南)资源有限公司	1,781,327.43	
其他负债	永富物产		36,004.64
其他负债	物产中大金属集团有限公司	3,149,463.58	
其他负债	物产中大国际贸易集团有限公司	958,577.43	
其他负债	物产中大(海南)资源有限公司	231,572.57	
预收款项	财通证券	7,205,084.51	7,205,084.50
其他应付款	财通证券	26,864,523.36	30,864,334.33
其他应付款	永富物产	206,000.00	
其他应付款	浙江物产道富有限公司	3,328,786.97	
应付账款	浙江济海贸易发展有限公司	0.01	
应付账款	上海茂高物产贸易有限公司	0.05	

**8、关联方承诺**
 适用  不适用

**9、其他**
 适用  不适用

**十五、 股份支付**
**1、 股份支付总体情况**
 适用  不适用

**2、 以权益结算的股份支付情况**
 适用  不适用

**3、 以现金结算的股份支付情况**
 适用  不适用

#### 4、 股份支付的修改、终止情况

适用 不适用

#### 5、 其他

适用 不适用

### 十六、 承诺及或有事项

#### 1、 重要承诺事项

适用 不适用

#### 2、 或有事项

##### (1). 资产负债表日存在的重要或有事项

适用 不适用

未决诉讼仲裁形成的或有负债及其财务影响

1) 2021 年 6-7 月，与永安瑞萌开展基差贸易业务的杭州荆城物资有限公司（以下简称杭州荆城）、郑州东铁商贸有限公司（以下简称郑州东铁）、郑州龙马商贸有限公司（以下简称郑州龙马）、郑州同之润商贸有限公司（以下简称郑州同之润）和郑州云途商贸有限公司（以下简称郑州云途），分别向上海市浦东新区人民法院提起诉讼，请求法院确认双方签订的购销合同无效，涉诉总金额为 10,182,256.88 元。

2022 年 6 月，与永安瑞萌开展基差贸易业务的安阳市牛丁商贸有限公司（以下简称安阳牛丁）向上海市浦东新区人民法院提起诉讼，请求法院确认双方签订的购销合同无效，涉诉金额为 1,309,682.00 元。

本财务报表批准报出日，永安瑞萌在与郑州龙马的案件中一审胜诉，双方均未上诉，一审判决已生效，该案已结案；永安瑞萌在与郑州云途的案件中一审和二审均胜诉，终审判决已生效，该案已结案。

永安瑞萌在与郑州同之润的案件中一审胜诉，郑州同之润已提起上诉，案件进入二审程序，仍在诉讼中；永安瑞萌与杭州荆城、郑州东铁、安阳牛丁的案件仍在诉讼中；上述未决诉讼合计涉诉金额为 7,070,438.88 元。因尚未判决案件与已胜诉案件性质相似，公司认为无须对上述未决诉讼事项计提相关损失。

2) 2021 年 7 月，与永安资本开展基差贸易业务的湖北晶通钢铁供应链有限公司向杭州市上城区人民法院提起诉讼，请求法院确认双方签订的购销合同无效，涉诉金额为 4,558,479.84 元。

2022 年 1 月，永安资本起诉与其有仓储保管合同关系的青岛港董家口矿石码头有限公司主张焦炭货物，涉案焦炭货物共计 4,670 吨（货值约 869.50 万元）。

截至本财务报表批准报出日，永安资本在上述与湖北晶通钢铁供应链有限公司的案件中一审已胜诉，湖北晶通钢铁供应链有限公司已提起上诉，案件进入二审程序，仍在诉讼中；永安资本与青岛港董家口矿石码头有限公司的案件仍在诉讼中。

##### (2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

#### 3、 其他

适用 不适用

## 十七、 资产负债表日后事项

### 1、 重要的非调整事项

适用 不适用

### 2、 利润分配情况

适用 不适用

### 3、 销售退回

适用 不适用

### 4、 其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

## 十八、 风险管理

### 1、 风险管理政策及组织架构

#### (1). 风险管理政策

适用 不适用

##### 1) 风险管理制度安排

公司制定了较完备的风险管理及内控制度，以《风险管理基本制度》作为根本指导，按风险类别划分，主要涵盖了合规风险、信用风险、操作风险及员工道德风险等各类型的风险管理；按业务类型划分，主要涵盖了经纪业务类、期货投资咨询类、资产管理类、基金销售类、风险管理业务等各业务类型的风险管理；按部门设置划分，主要涵盖了信息技术管理类、财务管理类、人力资源类、信息咨询类、反洗钱及合规管理类、纪检监察类、综合管理类、分支机构及子公司管理类等各部门的风险管理。公司从制度安排上规范公司管理，形成了较为完善的风险管理制度体系。报告期内，公司制定或修订的风险管理制度包括：《期货风险准备金管理办法》《反洗钱和反恐怖融资基本内控制度》等。

##### 2) 风险管理控制流程

公司在健全风险管理制度的同时，也加强风险管理组织架构的完善，以便更好地衔接风险管理各环节。公司的风险管理控制流程包括：风险识别、风险评估、风险监测与控制、风险报告，具体情况如下：

①风险识别：公司通过系统性地梳理和比对各部门、各业务流程及对应业务人员的实际工作运转状况与公司已制定的风险内控制度的匹配性，分析公司业务范畴内的风险节点及其变化规律，重点关注由于环境变化、人为因素等可能产生的风险。

②风险评估：公司通过较为成熟的风险评估方法，对固有风险、已采取控制的风险或控制失效的风险以及剩余风险进行内部衡量与评估。

③风险监测与控制：公司建立了内部信息技术系统，包括 OA 办公系统、反洗钱系统、交易风控系统、开户系统、合规管理系统等，实现对业务流程的风险监测，并采用隔离重大风险机制，以加强对风险的整体监测与统一控制。

④风险报告：公司对已实施风控制度文件的落实情况进行阶段性检测并评估效果，逐步完善风险预警指标体系，评价风险管理的效果，报告风险管理结果。

##### 3) 风险管理措施

公司制定了《员工培训与学习管理办法（试行）》《从业人员后续职业培训管理办法》等培训管理办法，内容涉及国家政策与法规、交易所规章制度等；同时通过编制合规学习手册、微信公众号等方式及时向员工与客户传达行业监管要求和公司最新情况，旨在规范员工的执业行为和执业道德，不断提高公司员工和客户的素质，将合规规则内化为合规意识，促进公司员工合规习惯的养成。

公司建立了基于各业务条线的风险管理架构，全面覆盖公司各项业务及重要环节，有效地识别、评估、追踪和管理各类风险。按业务条线划分的风险管理措施如下：

①期货经纪业务风险管理措施包括：a 公司实行“集中负责、分级管理”的风险控制措施，交易运作总部负责公司整体交易风险控制，各业务部门配合交易运作总部做好风险控制工作；b 指定专门的风险控制人员进行日常交易风险的控制，风险控制人员负责强行平仓通知的初始发出和强行平仓的最终执行；c 各业务部门及分支机构设置风险控制协助人员，协助风险控制人员进行各自部门的风险控制，及时联系客户本人，监控客户交易风险等。

②期货投资咨询业务风险管理措施包括：a 加强对期货投资咨询业务的规范化管理，通过优化审核流程、客户定期回访等方式强化风险管理；b 公司稽核督查总部进行定期或不定期合规检查，检查内容包括但不限于业务规定、人员资格管理、公示管理等内容；c 加强员工内部管理，杜绝禁止行为的发生。

③资产管理业务风险管理措施包括：a 对资产管理业务进行集中管理，其人员、账户、资金、信息等方面与其他业务部门互相独立，经营场地严格分离；b 交易策略制定、交易执行、风险控制岗位相互独立，并配备专职人员，不得互相兼任；c 设置资产管理业务审核委员会，负责统筹管理公司资产管理业务的风险管理事务，包括审议风险控制方案与风险处置预案、拟定突发事件处置方案等；d 签订资产管理合同前，资产管理总部运维支持部制定风控模板、设计风控方案，定期或不定期对风控模板进行调整；e 根据已签署的资产管理合同等文件在系统中具体设置相应的风控参数，履行实时风险监控、风控通知的义务，并及时通过采取权限控制、强行减仓或平仓等方式实施风险控制等。

④基金销售业务风险管理措施包括：a 财富管理服务中心制定管理人遴选标准、尽职调查方案和操作流程，对管理人进行持续跟踪、定期回溯，并与管理人建立后续反馈交流机制；b 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；c 在销售基金产品过程中严格遵守投资者适当性管理规则，根据投资者的风险承受能力销售不同风险等级的产品；d 禁止夸大宣传、虚假宣传等方式误导客户购买基金产品，禁止采取抽奖等方式诱导客户购买基金产品等。

⑤风险管理业务风险管理措施包括：a 永安资本通过制定期货交易的具体制度，以实现对各业务部门参与期货交易的规范与监控；b 加强账号管理，对账号的申请、注销予以登记，并完整记录各类账号信息，做好账号之间的信息隔离，防止内部道德风险；c 建立交易委托流程，妥善保存交易记录，加强对交割货物出入库管理；d 制定现货贸易流程，建立现货贸易相关制度，加强对现货贸易的风险控制等。

⑥境外业务风险管理措施包括：a 公司境外子公司按照当地监管要求设置风险管理架构，在所拥有的牌照经营范围内开展业务；b 针对具体业务，境外子公司制定了业务流程指引，通过部门及流程分离，实现部门间有效监督；c 通过培训强化员工职业操守，防止欺诈等事项的发生。

## (2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

公司持续建立健全符合层级分明、职权分明、相互制约的要求并形成相对稳定的组织架构体系的风险管理框架，自上至下形成以股东大会、董事会、监事会、经营管理层、首席风险官以及职能管理部门为主体的三层三角形构架的稳固形态，同时强化员工风险意识，建立各类风险的“识别、评估、控制”机制，实现事前防范、事中监控、事后稽核和纠正的动态风险管理体系。

## 2、信用风险

√适用 □不适用

(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) 存放在期货交易所等的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；

(5) 存放在银行的客户保证金不能提取的风险；

(6) 代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；

(7) 涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；

(8) 基差贸易业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；

(9) 场外衍生品业务中，客户在交易和结算的过程中不能或不愿意履行合同承诺的风险。

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

### 3、流动风险

√适用 □不适用

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

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

金融负债按剩余到期日分类

项目	期末数				
	账面价值	未折现合同金额	1 年以内	1-3 年	3 年以上
银行借款	1,757,094,903.02	1,807,552,533.02	1,807,552,533.02		
代理买卖证券款	223,690,282.55	223,690,282.55	223,690,282.55		
应付货币保证金	45,984,644,846.14	45,984,644,846.14	45,984,644,846.14		
应付质押保证金	3,402,046,320.00	3,402,046,320.00	3,402,046,320.00		
交易性金融负债	1,699,752,218.13	1,699,752,218.13	1,699,752,218.13		
应付票据	200,424,931.22	200,424,931.22	200,424,931.22		
应付账款	114,238,492.71	114,238,492.71	114,238,492.71		
其他应付款	3,960,814,870.06	3,960,814,870.06	3,960,814,870.06		
租赁负债	121,611,046.22	135,029,151.21	44,782,671.95	64,490,189.76	25,756,289.50
小计	57,464,317,910.05	57,528,193,645.04	57,437,947,165.78	64,490,189.76	25,756,289.50

(续上表)

项目	上年年末数				
	账面价值	未折现合同金额	1 年以内	1-3 年	3 年以上
银行借款	1,700,904,095.68	1,715,941,873.07	1,715,941,873.07		
代理买卖证券款	231,177,278.14	231,177,278.14	231,177,278.14		
应付货币保证金	40,495,833,719.78	40,495,833,719.78	40,495,833,719.78		
应付质押保证金	3,515,546,843.72	3,515,546,843.72	3,515,546,843.72		
交易性金融负债	1,486,806,168.05	1,486,806,168.05	1,486,806,168.05		
应付票据	182,251,644.00	182,251,644.00	182,251,644.00		
应付账款	109,504,128.94	109,504,128.94	109,504,128.94		

其他应付款	2,731,220,424.71	2,731,220,424.71	2,731,220,424.71		
应付债券	301,378,356.16	325,800,000.00	14,278,356.16	311,521,643.84	
租赁负债	91,920,041.43	103,378,759.49	24,162,451.46	46,589,396.40	32,626,911.63
小计	50,846,542,700.61	50,897,460,839.90	50,506,722,888.03	358,111,040.24	32,626,911.63

#### 4、市场风险

适用  不适用

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

针对市场风险，公司已建立了风险提示和预警机制，并定期或不定期地通过敏感性分析和压力测试对公司的市场风险承受能力进行评估；通过对客户保证金水平的动态检测，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。

报告期末，公司对外借款、发行债券均为固定利率且以摊余成本计量，利率波动不会对公司的利润总额和股东权益产生重大的影响。

##### (2) 外汇风险

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

##### (3) 价格风险

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

### 十九、其他重要事项

#### 1、前期会计差错更正

##### (1). 追溯重述法

适用  不适用

##### (2). 未来适用法

适用  不适用

#### 2、债务重组

适用  不适用

#### 3、资产置换

##### (1). 非货币性资产交换

适用  不适用

##### (2). 其他资产置换

适用  不适用

4、 年金计划

适用 不适用

5、 终止经营

适用 不适用

6、 分部信息

(1). 报告分部的确定依据与会计政策

适用 不适用

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**

√适用 □不适用

1. 2022 年 1-6 月

单位：元 币种：人民币

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	境外业务	结构化主体	分部间抵销	合计
营业收入	369,485,135.14	17,517,003.21	75,351,635.52	18,981,448,043.64	106,886,202.37	55,677,579.94	-55,228,066.26	19,551,137,533.56
营业支出	239,394,179.04	9,962,917.14	39,195,777.58	18,773,734,300.35	96,620,849.87	12,877,371.37	-12,481,931.81	19,159,303,463.54
营业利润	130,090,956.10	7,554,086.07	36,155,857.94	207,713,743.29	10,265,352.50	42,800,208.57	-42,746,134.45	391,834,070.02
资产总额	60,727,304,946.13	12,272,459.90	99,839,410.77	12,236,357,082.17	3,788,352,018.59	495,174,938.80	-5,626,519,430.35	71,732,781,426.01
负债总额	50,743,429,975.41	4,718,373.83	63,683,552.83	8,629,643,461.94	3,047,666,542.94	1,404,715.66	-2,302,886,905.81	60,187,659,716.80

2. 2021 年 1-6 月

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	境外业务	结构化主体	分部间抵销	合计
营业收入	884,169,578.07	6,962,637.93	48,116,568.94	15,669,642,236.35	73,480,991.05	10,692,285.72	-8,484,862.79	16,684,579,435.27
营业支出	322,333,290.38	4,019,037.10	20,053,251.51	15,488,567,474.12	55,306,795.96	2,041,517.57	123,474.78	15,892,444,841.42
营业利润	561,836,287.69	2,943,600.83	28,063,317.43	181,074,762.23	18,174,195.09	8,650,768.15	-8,608,337.57	792,134,593.85
资产总额	45,498,481,210.89	3,708,190.97	47,437,406.14	9,804,526,530.60	4,944,237,127.77	384,416,781.49	-3,767,824,357.65	56,914,982,890.21
负债总额	38,037,183,448.02	764,590.14	19,374,088.71	7,418,597,582.76	4,265,055,491.35	1,211,831.26	-1,353,681,231.01	48,388,505,801.23

(3). 公司无报告分部的，或者不能披露各报告分部的资产总额和负债总额的，应说明原因

适用 不适用

(4). 其他说明

适用 不适用

## 7、 租赁

适用 不适用

### 1. 公司作为承租人

(1)使用权资产相关信息详见本节“七、29、使用权资产”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节“五、50、租赁”之说明。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：

单位：元币种：人民币

项目	本期数
短期租赁费用	2,771,078.15
合计	2,771,078.15

### (3)与租赁相关的当期损益及现金流

单位：元币种：人民币

项目	本期数
租赁负债的利息费用	1,950,885.14
与租赁相关的总现金流出	25,323,454.51

(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节“十八、3、流动风险”之说明。

### 2. 公司作为出租人

(1)经营租赁

#### 1) 租赁收入

单位：元币种：人民币

项目	本期数
租赁收入	11,050,290.42
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

单位：元币种：人民币

项目	期末数
投资性房地产	323,477,117.10
小计	323,477,117.10

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

单位：元币种：人民币

剩余期限	期末数
1 年以内	24,065,723.83
1-2 年	23,997,666.02
2-3 年	19,627,186.22
合计	67,690,576.07

#### 8、期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用  不适用

#### 9、以公允价值计量的资产和负债

适用  不适用

#### 10、金融工具项目计量基础分类表

##### (1). 金融资产计量基础分类表

适用  不适用

##### (2). 金融负债计量基础分类表

适用  不适用

#### 11、外币金融资产和金融负债

适用  不适用

#### 12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

适用  不适用

#### 13、其他

适用  不适用

### 二十、 母公司财务报表主要项目注释

#### 1、 长期股权投资

适用  不适用

(1) 明细情况

单位：元币种：人民币

项目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	2,830,974,102.19		2,830,974,102.19
对联营、合营企业投资	903,445,757.99		903,445,757.99
合计	3,734,419,860.18		3,734,419,860.18

(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、合营企业投资	936,025,691.08		936,025,691.08
合计	2,966,999,793.27		2,966,999,793.27

(2) 对子公司投资

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	本期计提减值准备	减值准备期末数
中邦实业	251,984,002.19			251,984,002.19		
永安资本	1,300,000,000.00	800,000,000.00		2,100,000,000.00		
新永安金控	478,990,100.00			478,990,100.00		
小计	2,030,974,102.19	800,000,000.00		2,830,974,102.19		

(3) 对联营、合营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
永安国富	936,025,691.08			30,128,066.91	
合计	936,025,691.08			30,128,066.91	

(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			903,445,757.99	
合计		62,708,000.00			903,445,757.99	

其他说明：

无

## 2、应付职工薪酬

### (1). 应付职工薪酬列示

 适用  不适用

### (2). 短期薪酬列示

 适用  不适用

### (3). 设定提存计划列示

 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

## 3、利息净收入

 适用  不适用

#### 4、手续费及佣金净收入

##### (1). 手续费及佣金净收入情况

适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
经纪手续费净收入	272,314,341.13	302,234,327.03
投资咨询收入	644,434.01	310,891.92
资产管理业务收入	17,454,315.85	6,921,032.89
基金销售业务收入	75,351,635.52	48,116,568.94
合计	365,764,726.51	357,582,820.78

##### 2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

行政区域名称	分支机构家数	手续费净收入金额
杭州本部		327,375,548.84
浙江省(不含杭州本部)	16	14,322,960.48
山东省	6	4,004,102.78
辽宁省	3	1,621,825.23
北京市	1	2,031,308.64
上海市	1	1,568,207.06
广东省	2	3,115,068.95
江苏省	2	1,748,410.65
福建省	2	1,125,123.01
吉林省	1	774,902.37
天津市	1	743,727.47
河北省	2	1,060,601.11
河南省	1	1,839,442.17
湖北省	1	758,080.83
江西省	1	626,884.94
重庆市	1	880,744.32
湖南省	1	692,065.61
四川省	1	1,140,790.84
陕西省	1	334,931.21
合计	44	365,764,726.51

##### (2). 财务顾问业务净收入

适用  不适用

##### (3). 代理销售金融产品业务

适用  不适用

##### (4). 资产管理业务

适用  不适用

手续费及佣金净收入的说明：

适用  不适用

**5、投资收益**
**(1). 投资收益情况**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	30,128,066.91	238,091,562.64
成本法核算的长期股权投资收益		
金融工具持有期间的投资收益	21,205,553.19	377,864,322.98
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,205,553.19	377,864,322.98
处置金融工具取得的投资收益	-351,007.18	24,888,545.27
其中：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	-351,007.18	24,888,545.27
合计	50,982,612.92	640,844,430.89

**(2). 交易性金融工具投资收益明细表**
 适用  不适用

**6、公允价值变动收益**
 适用  不适用

**7、业务及管理费**
 适用  不适用

**8、其他**
 适用  不适用

**二十一、补充资料**
**1、当期非经常性损益明细表**
 适用  不适用

单位：元币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	963,388.07	
越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	2,370,427.89	
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、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生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、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-48,195.02	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
减：所得税影响额	822,763.88	
少数股东权益影响额（税后）		
合计	2,462,857.06	

对公司根据《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》定义界定的非经常性损益项目，以及把《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的项目，应说明原因。

适用 不适用

## 2、净资产收益率及每股收益

适用 不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	每股收益	
		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	2.69	0.22	0.22
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	2.66	0.22	0.22

3、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

4、 其他

适用 不适用

董事长：葛国栋

董事会召开日期：2022 年 8 月 24 日

修订信息

适用 不适用

## 第十一节 期货公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

适用 不适用

二、 监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

2021 年公司分类评价结果如下：

期货公司	2021 年评级
永安期货	AA