



永安期货

NEEQ : 833840

永安期货股份有限公司

Yongan Futures Co.,Ltd.

年度报告

— 2019 —

公司年度大事记

2019年2月，永安国际金融(新加坡)有限公司获得新加坡资本市场服务(CMS)期货牌照。

2019年4月，新永安国际金融控股有限公司完成增资，下辖期货、资管、证券、实业等经营牌照，提升国际综合金融服务能力。

2019年6月，永安期货股份有限公司荣获2018-2019年度期货公司扶贫工作考评第一名，连续三年蝉联本项考评工作冠军。

2019年7月，永安期货股份有限公司荣获业内首家“AAA”主体信用评级。

2019年7月，永安期货股份有限公司荣获2019年中国优秀期货公司君鼎奖。

2019年8月，浙江永安资本管理有限公司获批成为大连商品交易所铁矿石品种指定交割仓库，服务实体经济能力进一步提升。

2019年10月，永安期货股份有限公司西安分公司开业。2019年，共有深圳、沈阳、郑州等9家营业部升级为分公司。现在全国共设有分公司15家，营业部28家。

2019年11月，由永安期货股份有限公司承办的第三届(2019)钱塘江论坛平行分会-中国大宗商品金融服务创新峰会在杭州举办，标志着全国性大宗商品金融服务创新中心在浙落地。

目 录

第一节	声明与提示.....	4
第二节	公司概况	8
第三节	会计数据和财务指标摘要	10
第四节	管理层讨论与分析.....	14
第五节	重要事项	50
第六节	股本变动及股东情况.....	54
第七节	融资及利润分配情况.....	57
第八节	董事、监事、高级管理人员及员工情况	58
第九节	行业信息	65
第十节	公司治理及内部控制.....	66
第十一节	财务报告	75

释义

释义项目	指	释义
公司、本公司、股份公司、永安期货	指	永安期货股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
财通证券	指	财通证券股份有限公司，系永安期货的第一大股东
省财开	指	浙江省财务开发公司
浙江产业基金	指	浙江省产业基金有限公司
浙江东方	指	浙江东方金融控股集团股份有限公司
经建设	指	浙江省经济建设投资有限公司
协作大厦	指	浙江省协作大厦有限公司
永安资本	指	浙江永安资本管理有限公司
上海瑞萌	指	上海永安瑞萌商贸有限公司
永安新加坡	指	永安（新加坡）国际贸易有限公司
鞍钢商贸	指	鞍钢永安商品贸易有限公司
中邦实业	指	浙江中邦实业发展有限公司
浙江国油能源	指	浙江国油能源有限公司
新永安控股	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
新永安实业	指	中国新永安实业有限公司
新永安资管	指	新永安国际资产管理有限公司
永安全球基金	指	永安全球基金独立投资组合公司
永安商贸	指	香港永安商贸有限公司
永安国际金融	指	YONGANINTERNATIONAL FINANCIAL (SINGAPORE) PTE. LTD
玉皇山南	指	浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司
永安国富	指	永安国富资产管理有限公司
公司章程	指	永安期货现行有效并经工商行政管理部门备案的章程
报告期	指	2019年1月1日-2019年12月31日
元、万元	指	人民币元、人民币万元

本年度报告中，部分合计数与加总数在尾数上可能略有差异，系四舍五入造成。

第一节 声明与提示

【声明】

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

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

中汇会计师事务所（特殊普通合伙）对公司更正前的财务报告出具了标准无保留意见审计报告。公司经过自查，针对发现的会计差错，出具了《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》。天健会计师事务所（特殊普通合伙）对《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》进行了专项审核，出具了《永安期货股份有限公司前期会计差错更正专项说明的审核报告》。经其审核，天健会计师事务所（特殊普通合伙）认为公司对相关会计差错更正的会计处理符合《企业会计准则第28号——会计政策、会计估计变更和差错更正》和全国中小企业股份转让系统有限责任公司《挂牌公司信息披露及会计业务问答（三）》的规定。

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

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

1、豁免披露事项及理由

由于行业竞争激烈，公开披露客户及供应商信息容易引起商业机密泄露，很有可能引发同行业恶性竞争。因此，永安期货特豁免披露 2019 年年度报告第四节销售部分主要客户的名称、经纪业务部分主要客户的名称以及主要供应商的名称，以及财务报表附注部分应收款项涉及的客户名称、预付款项涉及的供应商名称、期末应收风险损失款、其他应收款涉及的客户姓名。

【重要风险提示表】

重要风险事项名称	重要风险事项简要描述
1. 期货、期权经纪业务风险	经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日

	趋激烈，手续费率呈逐渐下降态势，公司期货经纪业务面临着竞争风险以及盈利能力下降风险。
2. 利息收入下滑风险	利息收入是期货公司营业收入的重要来源之一，公司利息收入包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。公司的客户保证金和自有资金规模保持稳定，利率水平的变化将影响公司的营业收入和净利润水平。如果利率水平出现大幅下降，或者客户保证金和自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。另外，随着市场竞争加剧、客户保证金规模持续上升、市场关注度提高，如果未来行业政策发生变化，公司的利息收入可能存在下滑风险。
3. 期货投资咨询业务风险	由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致营利性质的期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模推广，且公司未能在研究分析、市场推广、客户体验等方面做到进一步提高或突破，可能导致期货投资咨询业务收入仍难以取得实质性突破。同时，期货投资咨询业务依赖于投资咨询部门及工作人员的专业能力，客户根据公司对行情、风险等要素的判断进行交易，若投资策略出现重大失误或者员工出现违规行为，可能导致客户亏损或与公司产生纠纷，从而影响公司期货投资咨询业务的开展及公司声誉。
4. 资产管理业务风险	公司的资产管理业务面临证券公司、基金公司、保险公司、信托公司、银行及其他期货公司等金融机构类似产品的激烈竞争，同时期货行业专业投资人才相对缺乏。若公司不能在投资团队、产品设计、市场推广、投资绩效、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司资产管理业务的进一步拓展。此外，资产管理业务拓展过程中，可能存在投资团队建设和投资管理能力不足的风险，导致公司为客户设定的资产组合方案由于市场波动、投资决策失误、资产管理措施不当、人员操作失误等原因无法达到预期收益或遭受损失，从而导致公司资产管理规模的降低和收入的下降。
5. 基金销售业务风险	公司的基金销售业务面临证券公司、银行及其他三方销售机构等金融机构类似产品的激烈竞争。若公司不能在尽职调查、产品设计、市场推广、客户服务等方面保持竞争力，可能会影响公司基金销售业务的进一步拓展。
6. 业务创新风险	由于我国期货行业的创新业务尚处于发展期，公司在开展创新业务过程中可能存在因业务经验、人才储备和经营管理水平等不匹配，从而出现产品设计不合理、市场预测不准确、管理措施不到位、风险管理及内控措施不健全而导致的风险。同时，如果公司对创新业务风险的认识不全、评估不足、机制不健全、措施不完善或执行不力，可能发生较大规模的风险事件或出现严重亏损，从而造成公司经营业绩大幅下滑。
7. 投资风险	在风险可控的情况下，公司使用自有资金开展投资业务，配置范围包括私募基金、证券市场、基金、信托产品等金融产品。虽然公司对自有资金投资制定了相关管理制度，但仍面临较大的操作风险和市场风险，存在因自有资金投资收益大幅下降甚至亏损影响公司盈利能力的可能。

8. 合规风险	<p>金融行业属于国家特许经营行业，公司具体开展业务时需满足在净资本、风险管理、公司治理、人才储备、机构设置、合规运营等方面满足监管部门的要求。目前中国证监会根据监管需要，以期货公司风险管理能力为基础，结合公司市场影响力和持续合规状况，对期货公司进行分类评价，其分类结果是期货公司风险管理水平的审慎监管指标，如果公司未来获得的评级结果出现下调，将可能对公司现有业务开展、申请增加新业务或新业务试点范围等方面产生不利影响。</p>
9. 信息技术系统风险	<p>信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，信息系统的安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要，公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，并制定了完整的信息技术相关制度，确保信息技术系统稳定运行。然而由于各种原因，信息技术系统仍可能出现硬件故障、软件崩溃、通信线路中断、遭受病毒、黑客攻击、数据丢失与泄露等情况。公司向客户提供的交易系统主要来源于与外部公司合作，自主研发能力相对不足。如果公司遭受上述突发性事件，或信息技术系统未能及时、有效地改进或升级而发生障碍，可能对公司的声誉、竞争力和经营业绩造成不利影响。此外，随着业务量的不断扩大、创新业务的不断推出，公司信息技术系统的处理能力和功能模块需要不断升级和扩展，以适应业务发展需要。若信息技术系统不能得到相应提升，公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。</p>
10. 信用风险	<p>公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：（1）客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；（2）客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；（3）存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；（4）存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；（5）存放在银行的客户保证金不能提取的风险；（6）代理客户向期货交易所办理仓单充抵保证金业务过程中，由于客户违约需要变现仓单时不能变现的风险；（7）涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；（8）基差业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；（9）非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。</p>
11. 居间人管理风险	<p>居间人非期货公司的员工，而是与期货公司签订居间合同，为期货公司和客户提供订立期货经纪合同，并根据居间合同的约定取得手续费返佣的个人或法人，居间人独立承担基于居间关系产生的民事责任。期货公司与居间人合作拓宽了开发客户的渠道，是重要的营销补充方式。目前期货监管体系并未形成居间业务的统一规定。由于公司不能完全控制拥有丰富客户资源的居间人流动，管理难度较大，若公司的经纪业务开展较为依赖居间人，将对公司盈利情况产生不利影响。同时，居间人素质参差不齐，部分居间人可能采取私印名片、私设网点等方式冒充公司工作人</p>

	<p>员，可能给公司带来表见代理的诉讼风险。如果公司由于管理不当发生这类情形，可能被监管部门采取监管措施或处以行政处罚，亦有可能产生诉讼风险。</p>
12. 人才流失和储备不足风险	<p>期货行业是知识密集型行业，需要大批高素质专业人才。随着期货市场的发展，以及期货分支机构的大规模扩张，期货人才竞争日趋激烈。近年来金融衍生品推出的步伐加快，资产管理业务发展迅速，不但对期货人才提出了更高要求，也加剧了对期货人才尤其是复合型人才的需求和竞争。若公司流失部分关键优秀管理人员和专业人才，将会对公司的经营发展造成一定障碍。同时，面对各个金融子行业的竞争，公司存在人才流失和储备不足的风险。</p>
13. 政策风险	<p>公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家各种法律、法规及规范性文件的监管。如果国家关于期货行业的有关法律、法规和政策，如税收政策、业务许可、利率政策、业务收费标准及收费方式等发生变化，可能会引起期货市场的波动和期货行业发展环境的变化，进而对公司的各项业务产生影响。目前，随着期货市场的快速发展和期货法律法规的建设处于完善阶段，相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会对期货行业的经营模式和竞争方式产生影响，公司无法保证上述变化不会对公司的业务、经营业绩和财务状况产生重大不利影响，也无法保证能够及时调整以充分适应上述变化。如果公司未能完全遵守相关法律、法规、规章和其他规范性文件的变化，可能导致公司被罚款、暂停或取消业务资格，从而对公司的业务、经营业绩和财务状况产生不利影响。</p>
14. 重大诉讼、仲裁风险	<p>期货公司作为金融衍生品服务提供商，截至本年度末公司尚无重大诉讼和仲裁事项。但因金融行业的风险属性，受市场波动、业务经营及其他因素影响，如未来出现相关重大诉讼或仲裁，将可能对公司经营带来不利影响。</p>
15. 商标风险	<p>公司使用中的永安期货 YONGAN FUTURE 标识尚未取得商标专用权，上述商标使用过程中可能会使本公司产生法律纠纷，使本公司声誉遭到损害，并对本公司的业务开展及公司整体经营战略布局构成不利影响。</p>
本期重大风险是否发生重大变化：	否

第二节 公司概况

一、 基本信息

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

二、 联系方式

董事会秘书或信息披露事务负责人	马冬明
是否具备全国股转系统董事会秘书任职资格	是
电话	(0571)86672053
传真	(0571)88388193
电子邮箱	yaqh@yafco.com
公司网址	www.yafco.com
联系地址及邮政编码	杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼, 310016
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司年度报告备置地	公司董事会秘书办公室

三、 企业信息

股票公开转让场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1992 年 9 月 7 日
挂牌时间	2015 年 10 月 28 日
分层情况	创新层
行业（挂牌公司管理型行业分类）	J 金融业-67 资本市场服务-672 期货市场服务-6729 其他期货市场服务
主要产品与服务项目	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售、风险管理等
普通股股票转让方式	集合竞价转让
普通股总股本（股）	1,310,000,000
优先股总股本（股）	0
做市商数量	0
控股股东	无
实际控制人及其一致行动人	浙江省财政厅
期货公司最新分类评价结果	AA

四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	9133000010002099X5	否
注册地址	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。	是
注册资本	1,310,000,000 元	否

五、 中介机构

主办券商	中信证券
主办券商办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
报告期内主办券商是否发生变化	否
会计师事务所	中汇会计师事务所（特殊普通合伙）
签字注册会计师姓名	王其超、方立强
会计师事务所办公地址	杭州市江干区新业路 8 号华联时代大厦 A 幢 601 室

六、 自愿披露

适用 不适用

七、 报告期后更新情况

适用 不适用

第三节 会计数据和财务指标摘要

一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	22,757,609,299.75	15,763,889,406.71	44.37%
利润总额	1,251,049,171.82	1,113,033,385.76	12.40%
归属于挂牌公司股东的净利润	1,000,720,583.15	872,197,337.15	14.74%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	997,012,155.04	856,435,695.95	16.41%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	15.37%	14.92%	-
加权平均净资产收益率%（归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	15.32%	14.65%	-
基本每股收益	0.76	0.67	14.15%

二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	本期期初	增减比例%
资产总计	36,799,466,218.55	29,466,459,654.49	24.89%
负债总计	29,935,540,124.23	23,468,926,292.10	27.55%
归属于挂牌公司股东的净资产	6,863,926,094.32	5,997,533,362.39	14.45%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	5.24	4.58	14.45%
资产负债率%（母公司）	17.10%	14.85%	-
资产负债率%（合并）	41.98%	35.43%	-
流动比率	1.19	1.22	-

三、 营运情况

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
经营活动产生的现金流量净额	1,638,715,958.63	-1,091,342,393.69	-
应收账款周转率	3,506.53	14,768.53	-
存货周转率	16.18	13.36	-

四、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	25.03%	-3.54%	-
营业收入增长率%	44.37%	64.39%	-
净利润增长率%	14.74%	-5.41%	-

五、 股本情况

单位：股

	本期期末	本期期初	增减比例%
普通股总股本	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00	0.00%
计入权益的优先股数量	0	0	0.00%
计入负债的优先股数量	0	0	0.00%

六、 非经常性损益

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-25,157.03
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	7,725,687.60
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,172,796.58
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被合并单位可辨认净资产公允价值产生的收益	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-4,010,098.70
其他符合非经常性损益定义的损益项目	-
非经常性损益合计	4,863,228.45
所得税影响数	1,154,800.34
少数股东权益影响额（税后）	
非经常性损益净额	3,708,428.11

七、 其他主要会计数据和指标

单位：元

	本期期末	本期期初	增减比例%
净资本	1,512,371,088.41	1,535,953,835.89	-1.54%
风险资本准备总额	758,814,620.33	589,029,649.20	28.82%
净资本与风险资本准备总额的比例	199%	261%	-
净资本与净资产的比例	24%	29%	-

扣除客户保证金的流动资产	4,610,491,619.57	2,006,457,832.13	129.78%
扣除客户权益的流动负债	1,285,553,890.92	938,027,772.91	37.05%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	359%	214%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	21%	17%	-
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	17.10%	14.85%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	41.98%	35.43%	-
结算准备金额	1,673,944,727.36	1,556,982,936.98	7.51%

注：根据监管要求，数据口径为母公司口径，“扣除客户保证金的流动资产”不含报表列示的其他流动资产、应收股利，“扣除客户权益的流动负债”包含递延所得税负债。

八、 补充财务指标

适用 不适用

九、 预计负债情况

适用 不适用

（一） 明细情况

项目	本期期末	本期期初	增减比例%
未决诉讼	445,737.05	435,984.37	2.24%
合计	445,737.05	435,984.37	2.24%

（二） 重大项目的确认依据说明

2015年1月，新永安期货公司收到来自 Alterra International Holdings Limited 公司（以下简称 Alterra 公司）的律师函，要求赔偿其客户翁超颖诈骗的 588,600.00 欧元。2016年10月，Alterra 公司在塞浦路斯当地法院对新永安期货公司和交通银行提起诉讼，要求赔偿上述款项。截至资产负债表日，新永安公司已聘请香港律师和塞浦路斯当地律师进行处理，并就此事计提了预计负债 445,737.05 元。

十、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

会计政策变更 会计差错更正 其他原因 不适用

注：根据新金融工具准则，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在本期期初转入交易性金融负债。

十一、 业绩预告、业绩快报的差异说明

适用 不适用

公司年度报告中披露的财务数据与 2019 年年度业绩预告中披露的财务数据存在以下超过 10% 的差异：

1、本报告中营业利润 1,179,683,571.99 元，较 2019 年年度业绩预告中披露的 1,428,831,722.42 元下降 17.44%，主要系期后审计调整所致；

2、本报告中利润总额 1,251,049,171.82 元，较 2019 年年度业绩预告中披露的 1,470,635,270.65 元下降 14.93%，主要系期后审计调整所致。

此外，本报告中归属于挂牌公司股东的净利润 1,000,720,583.15 元，较 2019 年年度业绩预告中披露的 1,002,768,977.88 元下降 0.20%。

第四节 管理层讨论与分析

一、 业务概要

商业模式

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

1. 期货、期权经纪业务

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

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

2. 期货投资咨询业务

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

3. 资产管理业务

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

成。

4. 基金销售业务

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

5. 风险管理业务

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

6. 自有资金投资业务

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

核心竞争力分析：

适用 不适用

1. 行业地位优势明显

公司自成立以来，公司经营规模牢固占据浙江省第一，已连续二十二年年跻身全国期货公司十强行列，近年来经营规模稳居全国前三。公司在全国设有营业部 28 家、分公司 15 家，是国内营业网点最多的期货公司之一。作为中国期货行业领军者，公司在国内各交易所和行业自律机构中担任重要职务。根据中国证监会对期货公司分类评价结果，本公司的分类评级结果为行业内最高的 A 类 AA 级。

2. 公司治理完善高效

永安期货已建立起规范的法人治理结构与合理的内部控制体系。公司视合规经营、诚信自律为企业发展的第一生命线，坚持“一切只为客户”的发展理念，突出党建统领，强调党的领导和适应市场的经营决策机制，重视战略规划制定和完善，营造合作、分享、共赢的“伙伴文化”，最大限度地满足投资者的需求，努力实现客户、股东和员工的共赢，打造永安核心文化凝聚力。公司围绕体系与机制、制度与流程、专业技术、管理平台、专业队伍的工作策略，完善风险管理组织架构，构建公司风

险偏好体系，强化合规风控的绩效考核问责机制，紧密结合行业监管与业务发展需求，以“打造专业、高效的风险管控体系，使之成为与业务发展并行的核心竞争力”为方向，提高整体风险防范能力，为公司持续、稳定、健康发展保驾护航。

3. 经纪业务实现差异化竞争

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

4. 期货工具服务实体经济

以风险管理子公司为平台，公司打造形成服务实体经济的产业链服务模式，运用在市场纠偏、定向配送、向客户提供金融支持、为实体企业提供咨询服务、培育市场、成为客户安全可靠的交易对手、对不活跃月份合约提供远期连续报价、为上游生产企业锁定远期利润、为期货公司的投资咨询业务提供理论与实践支撑等多功能保障体系，帮助实体企业实现价格、产销、库存等多要素波动风险管理和产业转型优化升级，为实体经济注入发展动力。

5. 资产配置助力公司发展

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

6. 研发团队领先同业

作为塑造核心竞争力、发展各类新兴业务与创新业务的基础，公司始终重视研究能力的提升。公司现设有杭州研究中心、北京研究院两大投研机构，专业研究人员多具有知名高等院校或海外留学教育背景，整体规模、研究范围、综合实力均居于业内领先地位。其中杭州研究中心侧重相对价格和大

类资产的研究，通过深入产业生态圈各环节，为套期保值和期货投资提供基础性和应用性研究，并依托公司旗下的投资管理业务、期现结合业务和新永安期货的境外期货交易平台，实行全球交易活跃的品种全覆盖的研究战略，为投资者提供丰富资讯和优质服务。北京研究院建立了基本面量化的估值驱动研究体系，形成系列产品线包括基础报告、调研报告、深度报道等，开创了投资咨询、产业基金、基差交易、场外期权（期权+保险）、合作套保以及仓单服务等多种客户服务模式，有效提升了客户服务的质量与附加价值。公司卓越的研究实力业已得到社会各界的高度认可。公司研究团队屡获“最佳期货研究院”、“中国金牌期货研究所”等荣誉称号，公司连续多年获得各大交易所设立的种类奖项，涌现出一大批荣获由期货日报、和讯网等主流媒体颁发的“最佳分析师”、“优秀分析师”等奖项的优秀研究人员。

报告期内变化情况：

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

二、 经营情况回顾

（一） 经营计划

2019年是宏观经济跌宕起伏的一年，是新中国成立70周年，是期货市场的品种大年、上市大年和开放大年，也是永安期货成立25周年。面对纷繁复杂的市场环境，公司坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为统领，牢记“服务实体、创造价值”的初心和使命，秉持“四个敬畏”行为准则，紧紧围绕公司发展规划，加强了核心队伍、核心能力和核心业务的生态系统建设，净利润、客户权益等多项关键指标再创新高，分类监管、社会责任担当继续走在前列，3A信用评级成为行业唯一，头部优质企业的品牌形象更加全面、稳固、突出。

报告期内，公司经营情况良好，实现营业收入22,757,609,299.75元，同比增长44.37%；净利润1,000,720,583.15元，同比增长14.74%；加权平均净资产收益率（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）15.37%，较上年同比增长0.45个百分点，公司盈利能力稳定。截止本期期末，公司归属于母公司所有者的权益6,863,926,094.32元，同比增长14.45%，资产规模进一步增大。

公司（母公司本级）自 2011 年起监管评级保持 A 类 AA 级，各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截止本期末，公司净资本为 15.12 亿元，风险资本准备总额为 7.59 亿元，净资本与风险资本准备总额的比例为 199%，净资产为 62.32 亿元，净资本与净资产的比例为 24.27%，流动资产与流动负债的比例为 359%，负债与净资产的比例为 21%，各项风险监管指标数据按照《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令【第 131 号】）、《期货公司风险监管报表编制与报送指引》（证监会公告[2017]8 号）的要求计算，持续符合监管标准。

（二） 行业情况

我国现代期货市场起步于二十世纪九十年代初期，经过近 30 年的探索发展，中国期货市场逐步进入了稳定健康发展、经济功能日益显现的良性轨道，上市品种日益丰富，创新品种加快推出，市场规模稳步扩大。截至 2019 年末，我国共设有 3 家商品期货交易所（上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所）和 1 家金融期货交易所（中国金融期货交易所），已上市期货品种 76 个，其中商品期货 58 个、金融期货 6 个、商品期权 11 个、金融期权 1 个，基本形成了覆盖农业、金属、能源、化工以及金融等国民经济主要领域的产品体系，每个商品期货品种都连接着一个实体产业链，与实体经济密切相关，期货市场已经成为现代金融体系的重要组成部分。2019 年，我国商品期货成交量已经连续十年位居世界前列，金融期货重要作用不断显现，市场运行质量不断提升，对外开放深入推进，国际影响力更加凸显。期货市场发展在我国深入推进供给侧结构性改革的新形势下，围绕服务实体经济需求，创新服务“三农”模式，助力产业结构调整和企业转型，服务国家“一路一带”战略和脱贫攻坚战略，稳妥推进品种创新，保险+期货”、仓单服务、合作套保、基差贸易、场外衍生品业务等风险管理业务模式日益清晰，做市业务发展迅速，市场核心竞争力不断增强，我国期货市场正逐步发展成为全球重要的风险管理市场。

目前我国期货行业形成了以中国证监会依法进行集中统一监督管理为主，中国期货业协会、期货交易所和中国期货保证金监控中心等自律性组织对期货行业会员实施自律管理的管理体制，期货公司正朝着风险管理服务和财富管理服务等方向加快创新发展，坚持“四个敬畏”“一个合力”，健全法律法规体系，完善内控制度建设，深化对外不断开放，增加品种有效供给，强化风险防范意识，提升风险管控能力，保护投资者合法权益，充分发挥期货经营机构作为期货及衍生品服务供应商的专业能力，促进期货市场持续健康稳定发展。

(三) 财务分析

1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		本期期初		本期期末与 本期期初金 额变动比 例%
	金额	占总资产 的比重%	金额	占总资产 的比重%	
货币资金	17,277,242,747.04	46.95%	15,100,136,062.53	51.25%	14.42%
应收货币保证金	11,325,661,929.26	30.78%	8,634,466,301.81	29.30%	31.17%
应收质押保证金	621,717,032.00	1.69%	453,138,812.00	1.54%	37.20%
存出保证金	841,892.55	0.00%			
交易性金融资产	4,130,938,590.83	11.23%	2,889,231,564.30	9.81%	42.98%
应收票据	-	0.00%	-	0.00%	
应收账款	11,013,567.11	0.03%	651,510.76	0.00%	1,590.47%
预付款项	302,040,051.78	0.82%	176,585,144.04	0.60%	71.04%
应收款项融资	1,793,095.85	0.00%			
应收结算担保金	34,593,853.25	0.09%	25,513,880.92	0.09%	35.59%
应收风险损失款	17,004.09	0.00%	62,322.49	0.00%	-72.72%
应收佣金	13,861,553.98	0.04%	2,345,603.23	0.01%	490.96%
其他应收款	88,317,675.95	0.24%	93,487,921.96	0.32%	-5.53%
存货	1,531,314,799.31	4.16%	973,484,388.78	3.30%	57.30%
其他流动资产	266,098,144.02	0.72%	165,645,006.09	0.56%	60.64%
长期股权投资	486,824,372.27	1.32%	326,610,079.92	1.11%	49.05%
其他权益工具投资	26,845,000.00	0.07%	27,540,000.00	0.09%	-2.52%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.00%	1,400,000.00	0.00%	0.00%
投资性房地产	10,035,071.69	0.03%	3,602,959.06	0.01%	178.52%
固定资产	232,130,750.50	0.63%	102,603,824.08	0.35%	126.24%
在建工程	-	0.00%	87,245,315.29	0.30%	-100.00%
无形资产	233,733,432.01	0.64%	241,219,290.44	0.82%	-3.10%
长期待摊费用	9,454,316.78	0.03%	14,308,002.80	0.05%	-33.92%
递延所得税资产	193,591,338.28	0.53%	147,181,663.99	0.50%	31.53%
短期借款	562,544,509.00	1.53%	428,612,626.00	1.45%	31.25%
长期借款					
应付货币保证金	24,535,428,916.12	66.67%	19,952,524,955.66	67.71%	22.97%
应付质押保证金	434,089,168.00	1.18%	225,137,938.00	0.76%	92.81%
交易性金融负债	1,783,215,819.12	4.85%	1,056,552,059.55	3.59%	68.78%
期货风险准备金	232,191,214.15	0.63%	213,203,152.39	0.72%	8.91%
应付账款	107,960,512.29	0.29%	16,818,922.30	0.06%	541.90%
预收账款	741,569,234.77	2.02%	406,991,421.73	1.38%	82.21%
应付期货投资者保障 基金	671,681.51	0.00%	547,449.15	0.00%	22.69%
应付手续费及佣金	840,649.07	0.00%	1,023,763.63	0.00%	-17.89%
应付职工薪酬	783,931,911.56	2.13%	534,545,299.95	1.81%	46.65%

应交税费	168,563,751.51	0.46%	145,792,896.46	0.49%	15.62%
其他应付款	453,060,831.14	1.23%	460,403,915.82	1.56%	-1.59%
预计负债	445,737.05	0.00%	435,984.37	0.00%	2.24%
递延所得税负债	87,529,106.96	0.24%	26,335,907.09	0.09%	232.36%
资产总计	36,799,466,218.55	100.00%	29,466,459,654.49	100.00%	24.89%

资产负债项目重大变动原因：

- 1、货币资金：期末较期初增长 14.42%，主要系本期公司客户权益增幅超过 20%，期货保证金存款增加；
- 2、应收货币保证金：期末较期初增长 31.17%，主要系客户持仓量升高，持仓占用保证金金额增加所致；
- 3、应收质押保证金：期末较期初增长 37.20%，主要系本期客户质押业务增加，公司在交易所质押的仓单增加；
- 4、交易性金融资产：期末较期初增长 42.98%，主要系期末并表产品投资的交易性金融资产较期初增加；
- 5、应收账款：期末较期初增长 1590.47%，主要系主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，应收账款相应增加；
- 6、预付账款：期末较期初增长 71.04%，主要系子公司永安资本现货贸易规模扩大，预付的货款相应增加；
- 7、应收结算担保金：期末较期初增长 35.59%，主要系新增中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司结算担保金；
- 8、应收风险损失款：期末较期初下降 72.72%，主要系部分穿仓客户已逾三年，公司使用期货风险准备金抵补；
- 9、应收佣金：期末较期初增长 490.96%，主要系应收资产管理业务佣金较上期期末增加；
- 10、存货：期末较期初增长 57.30%，主要系子公司现货贸易规模扩大，用于交易的存货相应增加；
- 11、其他流动资产：期末较期初增长 60.64%，主要系子公司待抵扣增值税增加；
- 12、长期股权投资：期末较期初增长 49.05%，主要系公司权益法下确认的投资损益增加；
- 13、投资性房地产：期末较期初增长 178.52%，主要系本期公司福州营业部将部分自有房产用于出租；
- 14、固定资产：期末较期初增长 126.24%，主要系公司办公大楼已完工，由在建工程转入固定资产；
- 15、在建工程：期末较期初下降 100%，主要系公司办公大楼已完工，由在建工程转入固定资产；
- 16、长期待摊费用：期末较期初下降 33.92%，主要系公司存续装修费按期正常摊销，且本期未新增大

额装修费用；

17、短期借款：期末较期初增长 31.25%，主要系永安资本因业务发展需要新增银行贷款；

18、应付货币保证金：期末较期初增长 22.97%，主要系客户权益增长所致；

19、应付质押保证金：期末较期初增长 92.81%，主要系本期客户质押业务增加；

20、交易性金融负债：期末较期初增长 68.78%，主要系期末结构化主体其他投资者享有的份额增加；

21、应付账款：期末较期初增长 541.90%，主要系子公司现货贸易规模扩大，应付供应商货款较期初增加；

22、预收款项：期末较期初增长 82.21%，主要系永安资本等子公司业务规模扩大，预收的货款及衍生品交易保证金增加；

23、应付职工薪酬：期末较期初增长 46.65%，主要系本期计提未发放职工薪酬增加；

24、递延所得税负债：期末较期初增长 232.36%，主要系交易性金融资产公允价值变动确认递延负债大幅增长。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
一、营业收入	22,757,609,299.75	-	15,763,889,406.71	-	44.37%
手续费及佣金净收入	516,308,160.73	2.27%	534,254,965.29	3.39%	-3.36%
其中：经纪业务手续费收入	427,857,510.01	1.88%	473,267,701.94	3.00%	-9.60%
资产管理业务收入	35,929,709.16	0.16%	10,572,215.13	0.07%	239.85%
投资咨询业务收入	2,912,778.01	0.01%	6,291,242.47	0.04%	-53.70%
代理销售金融产品收入	49,608,163.55	0.22%	44,123,805.75	0.28%	12.43%
其他手续费及佣金收入	-	0.00%	-	0.00%	
利息净收入	552,305,587.41	2.43%	569,688,435.51	3.61%	-3.05%
投资收益	712,152,946.29	3.13%	921,167,244.16	5.84%	-22.69%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	212,858,720.40	0.94%	153,509,885.56	0.97%	38.66%
公允价值变动收益	438,751,993.31	1.93%	46,332,896.52	0.29%	846.96%
汇兑收益	-3,233,184.93	-0.01%	2,953,804.50	0.02%	-
其他业务收入	20,533,367,550.92	90.23%	13,684,164,075.39	86.81%	50.05%
其中：风险管理业务收入	20,512,110,273.07	90.13%	13,671,612,382.29	86.73%	50.03%

其他收益	7,922,956.41	0.03%	4,980,332.24	0.03%	59.08%
资产处置收益	33,289.61	0.00%	347,653.10	0.00%	-90.42%
二、营业成本	21,577,925,727.76	94.82%	14,652,062,489.53	92.95%	47.27%
提取期货风险准备金	19,051,965.16	0.08%	21,395,264.59	0.14%	-10.95%
税金及附加	8,564,808.13	0.04%	5,566,520.89	0.04%	53.86%
业务及管理费	1,095,510,076.60	4.81%	875,955,401.11	5.56%	25.06%
研发费用	-	0.00%	-	0.00%	-
信用减值损失	3,243,087.24	0.01%	-	0.00%	-
资产减值损失	-	0.00%	270,021,886.07	1.71%	-100.00%
其他资产减值损失	354,745,444.10	1.56%	-	0.00%	
其他业务成本	20,096,810,346.53	88.31%	13,479,123,416.87	85.51%	49.10%
三、营业利润	1,179,683,571.99	5.18%	1,111,826,917.18	7.05%	6.10%
营业外收入	77,097,898.60	0.34%	24,367,583.02	0.15%	216.40%
营业外支出	5,732,298.77	0.03%	23,161,114.44	0.15%	-75.25%
四、利润总额	1,251,049,171.82	5.50%	1,113,033,385.76	7.06%	12.40%
五、净利润	1,000,720,583.15	4.40%	872,197,337.15	5.53%	14.74%

项目重大变动原因：

- 1、资产管理业务收入：本期较上期增长 239.85%，主要系本期资产管理业务较上年同期有所增加；
- 2、投资咨询业务收入：本期较上期下降 53.70%，主要系本期投资咨询业务较上年同期减少；
- 3、公允价值变动收益：本期较上期增长 846.96%，主要系本期公司开始执行新金融准则将理财产品持有期间损益计入公允价值变动损益；
- 4、汇兑损益：本期为-3,233,184.93 较上期减少 6,186,989.43，主要受外汇汇率波动影响；
- 5、其他业务收入：本期较上期增长 50.05%，主要系永安资本等子公司现货业务规模扩大；
- 6、其他收益：本期较上期增长 59.08%，主要系公司及子公司收到政府补助增加；
- 7、资产处置收益：本期较上期下降 90.42%，主要系上期因公车改革处置若干车辆，本期此类情况减少；
- 8、税金及附加：本期较上期增长 53.86%，主要系公司大楼建成，计提并缴纳房产税约 200 万元；
- 9、其他业务成本：本期较上期增长 49.10%，主要系永安资本等子公司现货业务规模扩大；
- 10、营业外收入：本期较上期增长 216.40%，主要系本期子公司收到客户违约赔款增加。
- 11、营业外支出：本期较上期下降 75.25%，主要系公司基差业务相关合同浮亏本期反映在公允价值变动损益科目，该会计政策变更不调整可比期间报表。

(2) 收入构成

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

报告期内，公司实现经纪业务手续费收入 427,857,510.01 元，同比下降 9.60%；资产管理业务收入 35,929,709.16 元，同比增长 239.85%；投资咨询业务收入 2,912,778.01 元，同比下降 53.70%；基金销售业务收入 49,608,163.55 元，同比增长 12.43%；利息净收入 552,305,587.41 元，同比下降 3.05%；投资收益 712,152,946.29 元，同比下降 22.69%；公允价值变动收益 438,751,993.31 元，同比增长 846.96%；汇兑收益-3,233,184.93 元，同比下降 209.46%；其他业务收入 20,677,794,835.72 元，同比增长 50.40%；资产处置收益 33,289.61 元，同比下降 90.42%；其他收益 7,922,956.41 元，同比增长 59.08%。

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
手续费收入	516,308,160.73	534,254,965.29	-3.36%
利息净收入	552,305,587.41	569,688,435.51	-3.05%
投资收益	712,152,946.29	921,167,244.16	-22.69%
公允价值变动收益	438,751,993.31	46,332,896.52	846.96%
汇兑收益	-3,233,184.93	2,953,804.50	-209.46%
资产处置收益	33,289.61	347,653.10	-90.42%
其他收益	7,922,956.41	4,980,332.24	59.08%
其他业务收入	20,533,367,550.92	13,684,164,075.39	50.05%

1) 手续费收入

① 期货经纪业务的经营情况

项目		代理交易量（手）			代理交易金额（万元）		
交易所	品种	本期	上期	增减百分比%	本期	上期	增减百分比%
郑州商品交易所	苹果	1,195,240	2,767,703	-56.81%	10,766,394.62	26,675,261.82	-59.64%
郑州商品交易所	棉花一号	2,741,493	3,804,862	-27.95%	18,880,542.65	31,805,107.01	-40.64%
郑州商品交易所	棉花期权	180,409			20,397.18		
郑州商品交易所	干制红枣	811,918			4,175,144.78		

郑州商品交易所	棉纱	43,763	42,549	2.85%	469,508.24	560,937.75	-16.30%
郑州商品交易所	玻璃	2,778,220	2,000,257	38.89%	7,940,426.07	5,588,068.26	42.10%
郑州商品交易所	粳稻	140	603	-76.78%	807.85	3,673.18	-78.01%
郑州商品交易所	晚籼稻	1,302	35,402	-96.32%	6,939.23	202,684.29	-96.58%
郑州商品交易所	甲醇 N	13,821,090	9,350,489	47.81%	31,717,278.83	26,478,351.41	19.79%
郑州商品交易所	甲醇期权	4,782			258.15		
郑州商品交易所	菜籽油 N	986,190	1,474,303	-33.11%	6,983,387.82	9,783,963.68	-28.62%
郑州商品交易所	普麦	5	15	-66.67%	58.70	181.62	-67.68%
郑州商品交易所	早籼稻 N	58	2,040	-97.16%	275.79	10,498.57	-97.37%
郑州商品交易所	菜籽粕	4,178,455	3,030,624	37.87%	9,664,648.61	7,363,033.69	31.26%
郑州商品交易所	油菜籽	2,063	18	11,361.11%	8,270.51	95.86	8,527.70%
郑州商品交易所	纯碱	98,552			320,219.43		
郑州商品交易所	硅铁	363,711	639,647	-43.14%	1,084,014.56	2,105,264.70	-48.51%
郑州商品交易所	锰硅	456,010	644,749	-29.27%	1,601,558.48	2,572,656.15	-37.75%
郑州商品交易所	白糖	3,647,754	2,400,585	51.95%	19,211,610.26	12,577,409.63	52.75%
郑州商品交易所	白糖期权	523,060	500,080	4.60%	35,193.91	33,779.62	4.19%
郑州商品交易所	PTA	18,192,776	13,501,467	34.75%	51,958,668.54	43,804,077.05	18.62%
郑州商品交易所	PTA 期权	7,850			374.28		
郑州商品交易所	尿素	323,862			1,127,059.11		
郑州商品交易所	强麦 N	4,056	13,257	-69.40%	19,558.13	68,141.92	-71.30%
郑州商品交易所	新动力煤	1,265,105	2,543,739	-50.27%	7,343,616.46	15,667,817.15	-53.13%
大连商品交易所	黄大豆	724,623	943,999	-23.24%	2,525,718.50	3,451,790.56	-26.83%
大连商品交易所	豆二	497,708	333,801	49.10%	1,517,382.83	1,140,553.27	33.04%
大连商品交易所	玉米	6,462,515	4,528,698	42.70%	12,305,798.55	8,408,266.84	46.35%
大连商品交易所	玉米期权	1,008,603			21,329.99		

大连商品交易所	铁矿石	20,829,745	12,212,701	70.56%	140,404,081.84	60,188,508.82	133.27%
大连商品交易所	铁矿石期权	6,105			1,291.33		
大连商品交易所	焦炭	3,023,841	4,370,516	-30.81%	60,468,956.40	94,604,162.29	-36.08%
大连商品交易所	聚乙烯	3,936,729	3,056,884	28.78%	15,221,053.05	14,199,842.75	7.19%
大连商品交易所	豆粕	10,814,046	15,534,254	-30.39%	30,155,771.13	47,635,038.27	-36.69%
大连商品交易所	豆粕期权	2,624,604	1,935,467	35.61%	97,590.88	137,829.39	-29.19%
大连商品交易所	棕榈油	4,690,313	2,067,258	126.89%	24,384,918.99	10,093,501.34	141.59%
大连商品交易所	聚氯乙烯	2,689,387	3,251,877	-17.30%	8,911,801.96	10,895,444.91	-18.21%
大连商品交易所	豆油	3,898,616	2,750,836	41.72%	23,201,624.43	15,774,266.68	47.09%
大连商品交易所	胶合板	16	10	60.00%	125.34	66.9	87.35%
大连商品交易所	玉米淀粉	649,063	914,493	-29.02%	1,492,498.18	2,047,648.09	-27.11%
大连商品交易所	苯乙烯	242,359			881,072.26		
大连商品交易所	乙二醇	4,042,475	101,990	3,863.60%	19,013,576.61	553,669.85	3,334.10%
大连商品交易所	纤维板	53,802	2,192	2,354.47%	108,175.58	9,280.67	1,065.60%
大连商品交易所	鸡蛋	1,452,287	949,077	53.02%	6,102,627.89	3,713,689.32	64.33%
大连商品交易所	焦煤	1,376,168	2,536,116	-45.74%	10,704,600.65	19,351,694.34	-44.68%
大连商品交易所	聚丙烯	5,676,759	4,408,934	28.76%	23,620,273.57	20,484,041.85	15.31%
大连商品交易所	粳米	17,838			64,868.80		
上海期货交易所	白银	4,431,290	1,458,254	203.88%	27,814,347.93	8,048,898.64	245.57%
上海期货交易所	铝	870,435	1,207,877	-27.94%	6,055,351.32	8,677,660.71	-30.22%
上海期货交易所	黄金	769,441	406,809	89.14%	24,845,660.83	11,155,254.64	122.73%
上海期货交易所	黄金期权	1,543			1,325.99		
上海期货交易所	沥青	4,923,443	3,943,951	24.84%	15,799,003.61	12,327,932.72	28.16%

上海期货交易所	铜	1,209,632	1,894,440	-36.15%	28,922,596.02	48,223,234.15	-40.02%
上海期货交易所	铜期权	56,437	15,233	270.49%	9,157.81	8,256.07	10.92%
上海期货交易所	燃料油	5,107,755	1,106,582	361.58%	12,330,488.44	3,382,059.06	264.59%
上海期货交易所	热轧卷板	4,092,488	6,030,183	-32.13%	14,778,128.71	22,827,697.91	-35.26%
上海期货交易所	镍	4,376,741	5,635,708	-22.34%	49,313,576.49	58,770,093.47	-16.09%
上海期货交易所	铅	282,446	354,267	-20.27%	2,330,509.11	3,338,765.61	-30.20%
上海期货交易所	螺纹	30,215,630	34,468,284	-12.34%	110,056,856.66	130,373,988.05	-15.58%
上海期货交易所	橡胶	1,872,023	2,633,597	-28.92%	22,337,475.96	31,397,152.80	-28.86%
上海期货交易所	天胶期权	78,596			28,043.56		
上海期货交易所	锡	59,280	77,222	-23.23%	833,148.42	1,141,819.38	-27.03%
上海期货交易所	漂针浆	1,726,371	347,831	396.32%	8,351,531.63	1,781,337.34	368.83%
上海期货交易所	不锈钢	34,473			254,454.01		
上海期货交易所	线材	3,350	6,594	-49.20%	12,989.48	25,058.99	-48.16%
上海期货交易所	锌	2,553,059	2,883,320	-11.45%	25,976,778.44	32,595,491.57	-20.31%
中国金融期货交易所	国债 10 年期	371,638	397,293	-6.46%	36,361,138.49	37,641,713.71	-3.40%
中国金融期货交易所	中证 500	766,046	198,671	285.59%	76,427,099.30	20,219,631.94	277.98%
中国金融期货交易所	沪深 300	760,670	284,602	167.28%	85,702,620.74	29,701,307.32	188.55%
中国金融期货交易所	上证 50	372,346	144,638	157.43%	31,709,790.43	11,357,324.68	179.20%
中国金融期货交易所	沪深 300 期权	2,365			3,096.91		
中国金融期货交易所	国债 5 年期	132,857	88,647	49.87%	13,227,525.01	8,621,644.48	53.42%
中国金融期货交易所	国债 2 年期	455,176	2,723	16,615.98%	91,244,564.65	542,458.84	16,720.55%
上海国际能源交易中心	20 号胶	70,754			747,781.59		
上海国际能源交易中心	原油	554,422	339,434	63.34%	24,733,174.53	16,252,368.71	52.18%

合计	-	192,496,173	166,577,652	15.56%	1,264,749,567.02	996,401,450.29	26.93%
----	---	-------------	-------------	--------	------------------	----------------	--------

② 明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
期货经纪手续费	139,313,381.01	0.61%	166,404,906.18	1.06%
交易所返还减收手续费	288,544,129.00	1.27%	306,862,795.76	1.95%
资产管理业务收入	35,929,709.16	0.16%	10,572,215.13	0.07%
投资咨询业务收入	2,912,778.01	0.01%	6,291,242.47	0.04%
代理销售金融产品收入	49,608,163.55	0.22%	44,123,805.75	0.28%
合计	516,308,160.73	2.27%	534,254,965.29	3.39%

③分行政区域营业部及手续费收入情况

单位：元

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额	占营业收入比例%
杭州本部		414,657,754.85	1.82%
香港特别行政区[注]		29,602,641.60	0.13%
浙江省(不含杭州本部)	14	29,615,193.90	0.13%
辽宁省	3	5,634,252.25	0.02%
山东省	7	6,266,056.95	0.03%
北京市	1	2,640,590.21	0.01%
广东省	2	4,100,024.44	0.02%
上海市	1	4,610,797.07	0.02%
福建省	2	2,080,165.93	0.01%
河南省	1	1,969,212.09	0.01%
江苏省	2	1,674,477.50	0.01%
吉林省	1	2,763,956.17	0.01%
天津市	1	1,856,158.61	0.01%
重庆市	1	1,377,309.95	0.01%
河北省	2	1,958,012.51	0.01%
湖北省	1	1,270,965.82	0.01%
四川省	1	1,658,874.84	0.01%
湖南省	1	1,666,923.12	0.01%
江西省	1	802,271.97	0.00%
陕西省	1	102,520.95	0.00%
合计	43	516,308,160.73	2.28%

[注]香港特别行政区营业部系指公司子公司新永安期货。

2) 利息净收入

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
利息收入	618,496,985.72	2.72%	639,545,275.16	4.06%
其中：境内保证金利息收入	579,363,001.64	2.55%	585,437,094.25	3.71%
境外利息收入	30,901,144.79	0.14%	27,248,295.02	0.17%
境内其他利息收入	8,232,839.29	0.04%	26,859,885.89	0.17%
利息支出	66,191,398.31	0.29%	69,856,839.65	0.44%
合计	552,305,587.41	2.43%	569,688,435.51	3.61%

3) 投资收益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
权益法核算的长期股权投资收益	212,858,720.40	0.94%	153,476,025.51	0.97%
金融工具投资收益	709,474,168.89	3.12%	855,289,253.05	5.43%
其中：持有期间取得的收益	150,205,699.14	0.66%	356,701,506.88	2.26%
其中：交易性金融资产	150,205,699.14	0.66%	8,306,722.37	0.05%
可供出售金融资产	-	0.00%	348,394,784.51	2.21%
处置金融工具取得的收益	559,268,469.75	2.46%	498,553,886.12	3.16%
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	0.00%	500,535,941.85	3.18%
交易性金融资产	559,268,469.75	2.46%	-	0.00%
可供出售金融资产	-	0.00%	-1,982,055.73	-0.01%
扣除结构化主体其他投资者享有的损益	-210,179,943.00	-0.92%	-87,598,034.40	-0.56%
合计	712,152,946.29	3.13%	921,167,244.16	5.84%

4) 公允价值变动损益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债	438,751,993.31	1.93%	46,332,896.52	0.29%

其中：衍生金融工具产生的公允价值变动收益[注]	-87,440,139.15	-0.38%	64,690,410.51	0.41%
合计	438,751,993.31	1.93%	46,332,896.52	0.29%

5) 汇兑收益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
汇兑收益	- 3,233,184.93	-0.01%	2,953,804.50	0.02%
合计	- 3,233,184.93	-0.01%	2,953,804.50	0.02%

6) 资产处置收益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
非流动资产处置收益	33,289.61	0.00%	347,653.10	0.00%
合计	33,289.61	0.00%	347,653.10	0.00%

7) 其他收益

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
财政补助	7,725,687.60	0.03%	3,824,232.17	0.02%
个税手续费返还	197,268.81	0.00%	1,156,100.07	0.01%
合计	7,922,956.41	0.03%	4,980,332.24	0.03%

8) 其他业务收入

明细情况

单位：元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
销售货物收入	20,512,110,273.07	90.13%	13,671,612,382.29	86.73%
租赁收入	302,433.99	0.00%	228,963.13	0.00%
其他	20,954,843.86	0.09%	12,322,729.97	0.08%
合计	20,533,367,550.92	90.23%	13,684,164,075.39	86.81%

收入构成变动的原因：

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

(3) 主要客户情况

1) 销售部分

单位：元

序号	客户名称	销售金额	收入占比	是否存在关联关系
1	客户 1	683,272,132.88	3.00%	否
2	客户 2	499,297,459.04	2.19%	否
3	客户 3	349,935,635.00	1.54%	是
4	客户 4	307,038,205.51	1.35%	否
5	客户 5	300,774,990.88	1.32%	否
合计		2,140,318,423.31	9.40%	-

2) 经纪业务部分

单位：元

序号	客户名称	经纪金额	收入占比	是否存在关联关系
1	第一大	3,959,209.16	0.02%	否
2	第二大	2,470,091.10	0.01%	否
3	第三大	1,733,496.84	0.01%	是
4	第四大	1,630,312.29	0.01%	否
5	第五大	1,505,799.28	0.01%	否
合计		11,298,908.67	0.06%	-

(4) 主要供应商情况

单位：元

序号	供应商名称	采购金额	年度采购占比	是否存在关联关系
1	供应商 1	1,008,948,569.40	4.77%	否
2	供应商 2	891,169,897.25	4.21%	否
3	供应商 3	554,637,148.29	2.62%	否
4	供应商 4	543,114,887.73	2.57%	否
5	供应商 5	487,886,872.00	2.31%	否
合计		3,485,757,374.67	16.48%	-

3. 现金流量状况

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例
经营活动产生的现金流量净额	1,638,715,958.63	-1,091,342,393.69	-
投资活动产生的现金流量净额	8,527,609.62	52,236,579.19	-83.68%
筹资活动产生的现金流量净额	379,814,890.80	-39,435,516.46	--

现金流量分析:

1. 经营活动产生的现金流量净额: 本期较上期增加约 27.30 亿元, 主要系本期公司在交易所保证金及客户保证金净流入 18.9 亿, 上期为净流出 9.82 亿;

2. 投资活动产生的现金流量净额: 本期较上期减少约 0.44 亿元, 主要系本期理财产品投资较上期减少;

3. 筹资活动产生的现金流量净额: 本期较上期增加约 4.19 亿元, 主要系本期借入的短期借款较上期增加, 偿还的短期借款较上期减少;

4. 本期经营活动产生的现金流量净额较本期净利润金额多约 6.37 亿元, 主要系公司客户权益的变动体现在现金流量中, 而不体现在净利润中所致。

(四) 投资状况分析

1、 主要控股子公司、参股公司情况

永安资本为公司全资子公司, 注册资本 10 亿元人民币, 2019 年营业收入 20,065,957,760.88 元, 较 2018 年同期收入 12,898,345,085.45 元增长 55.57%; 2019 年营业成本 20,279,684,123.91 元, 较 2018 年同期营业成本 13,171,038,334.13 元增长 53.97%; 2019 年净利润 135,867,556.64 元, 较 2018 年同期净利润 145,140,682.43 元下降 6.39%; 永安资本公司 2019 年度净利润占公司合并报表净利润的 13.58%。永安资本公司坚持服务实体经济, 加强产业链上下游合作交流, 促进产融结合, 业务规模发展迅速, 优势品种不断做强。

永安国富为公司联营企业, 成立于 2015 年 1 月, 本期注册资本由 8,000 万元增加至 8,420 万元。2019 年营业收入 1,041,569,096.79 元, 较 2018 年同期营业收入 1,281,525,686.40 元下降 18.72%; 2019 年净利润 648,887,520.00 元, 较 2018 年同期净利润 466,927,159.57 元增长 38.97%。2019 年度, 公司确认投资收益 211,509,024.65 元, 永安国富向公司发放现金股利 52,800,000.00 元。永安国富积极强化后台建设, 提升服务品质, 开辟投资理财新思路; 本期成立全资子公司永富物产有限公司, 目前下设浙江永安国富实业有限公司、永富物产有限公司两家全资子公司, 业务范围进一步扩大。

2、 委托理财及衍生品投资情况

公司本级无委托理财及衍生品投资, 部分子公司因业务开展需要, 存在期货、期权、远期、场外衍生品等交易。

3、 主要分公司、营业部情况

截至本期末，本公司下设北京、上海、广州、山东、杭州、辽宁、深圳、宁波、绍兴、温州、天津、大连、吉林、河南、西安 15 家分公司，福州、台州、嘉兴、义乌、余姚、金华、无锡、萧山、济南、青岛、长沙、石家庄、瑞安、南昌、鞍山、重庆、淄博、武汉、舟山、杭州潮王路、潍坊、成都、诸暨、厦门、烟台、日照、南京、唐山 28 家营业部。

本报告期，公司下属 9 家营业部变更为分公司，分别是：“永安期货股份有限公司沈阳营业部”变更为“永安期货股份有限公司辽宁分公司”、“永安期货股份有限公司深圳营业部”变更为“永安期货股份有限公司深圳分公司”、“永安期货股份有限公司宁波营业部”变更为“永安期货股份有限公司宁波分公司”、“永安期货股份有限公司绍兴营业部”变更为“永安期货股份有限公司绍兴分公司”、“永安期货股份有限公司温州营业部”变更为“永安期货股份有限公司温州分公司”、“永安期货股份有限公司天津营业部”变更为“永安期货股份有限公司天津分公司”、“永安期货股份有限公司大连营业部”变更为“永安期货股份有限公司大连分公司”、“永安期货股份有限公司长春营业部”变更为“永安期货股份有限公司吉林分公司”、“永安期货股份有限公司郑州营业部”变更为“永安期货股份有限公司河南分公司”。

本报告期，公司新设西安分公司。

4、 重大的资产处置、置换、剥离情况

无

5、 合规情况

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

(五) 研发情况

√适用 □不适用

研发支出情况：

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

研发人员情况：

教育程度	期初人数	期末人数
博士	0	0
硕士	0	0

本科以下	0	0
研发人员总计	0	0
研发人员占员工总量的比例	0%	0%

专利情况:

项目	本期数量	上期数量
公司拥有的专利数量	0	0
公司拥有的发明专利数量	0	0

研发项目情况:

本期无研发支出。

(六) 审计情况

1. 非标准审计意见说明

适用 不适用

2. 关键审计事项说明:

适用 不适用

以下内容摘自审计报告正文:

“关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不对这些事项单独发表意见。我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

(一) 手续费收入的确认

1. 事项描述

永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询业务收入、基金代销业务收入及资产管理业务收入。如附注三(二十八)所述，期货经纪业务收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认；投资咨询业务、基金代销业务和资产管理业务收入在业务提供的相关服务已经完成，收到价款或取得收取款项的凭据时确认。

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

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括:

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

(2) 针对处理与手续费收入相关交易的关键信息技术系统，我们利用本所内部信息技术专家的工作，评价和测试该系统关于信息系统应用的关键内部控制的设计和运行有效性。

(3) 对于期货经纪业务收入，将公司记录的交易量与从中国期货业协会网站获取的同期交易数据进行核对，并将财务账面记录的手续费收入与交易运作总部业务系统中记录的数据进行核对。

(4) 对于投资咨询业务和基金代销业务收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同，核实相关收入确认与合同条款是否一致，并评价相关收入确认是否符合公司关于收入确认的会计政策。

(5) 对于资产管理业务收入，抽取样本，核对管理费和业绩报酬的费率与合同约定是否一致，并复核管理费和业绩报酬的计算过程。

(二) 结构化主体是否纳入合并范围

1. 事项描述

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

由于相关结构化主体是否纳入合并范围可能对财务报表产生重大影响，且涉及重大管理层判断，因此，我们将结构化主体是否纳入合并范围确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解管理层确定结构化主体纳入合并财务报表范围的评估过程。

(2) 获取结构化主体的相关合同，分析永安期货公司在结构化主体决策中拥有的权利和义务。

(3) 复核永安期货公司在结构化主体中享有的收益情况并判断享有的可变回报是否重大，包括因持有权益份额应当享有的收益和作为管理人应当收取的管理费和业绩报酬。

(4) 评估结构化主体是否符合纳入合并财务报表范围的条件。”

(七) 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

适用 不适用

一、会计政策变更

1. 重要会计政策变更

会计政策变更的内容和原因	备注
财政部于 2017 年 3 月 31 日分别发布了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(2017 年修订)》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(2017 年修订)》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号——套期会计(2017 年修订)》(财会[2017]9 号), 于 2017 年 5 月 2 日发布了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(2017 年修订)》(财会[2017]14 号)(上述准则以下统称“新金融工具准则”), 要求境内上市企业自 2019 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。	[注 1]
财务报表格式要求变化	[注 2]
财政部于 2019 年 5 月 9 日发布《关于印发修订〈企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换〉的通知》(财会[2019]8 号, 以下简称“新非货币性资产交换准则”), 自 2019 年 6 月 10 日起执行。	[注 3]
财政部于 2019 年 5 月 16 日发布《关于印发修订〈企业会计准则第 12 号——债务重组〉的通知》(财会[2019]9 号, 以下简称“新债务重组准则”), 自 2019 年 6 月 17 日起施行。	[注 4]

[注 1]新金融工具准则改变了原准则下金融资产的分类和计量方式, 将金融资产分为三类: 按摊余成本计量、按公允价值计量且其变动计入其他综合收益、按公允价值计量且其变动计入当期损益。本公司考虑金融资产的合同现金流量特征和自身管理金融资产的业务模式进行上述分类。权益类投资需按公允价值计量且其变动计入当期损益, 但对非交易性权益类投资, 在初始确认时可选择按公允价值计量且其变动计入其他综合收益, 该等金融资产终止确认时累计利得或损失从其他综合收益转入留存收益, 不计入当期损益。

新金融工具准则将金融资产减值计量由原准则下的“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”, 适用于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、租赁应收款及财务担保合同。

本公司按照新金融工具准则的相关规定, 对比较期间财务报表不予调整, 首次执行日执行新准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初留存收益或其他综合收益。调整情况详见本附注三(三十三)3、4 之说明。

[注 2] 根据财政部《关于修订印发 2018 年度金融企业财务报表格式的通知》(财会〔2018〕36 号), 本公司对部分资产负债表和利润表的列报项目进行了修订, 新增了“交易性金融资产”、“其他权益工具投资”、“信用减值损失”、“其他资产减值损失”等科目, 删除了“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”、“可供出售金融资产”、“持有至到期投资”、“应收利息”、“应付利息”等科目, “利息净收入”包含分类为以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产按照实际利率法计算的利息收入。对于上述列报项目的变更, 公司采用未来适用法进行

会计处理，未对上年比较数据进行重新列报。

[注 3] 新非货币性资产交换准则规定对 2019 年 1 月 1 日至本准则施行日之间发生的非货币性资产交换根据本准则进行调整，对 2019 年 1 月 1 日之前发生的非货币性资产交换，不需要进行追溯调整。

本公司按照规定自 2019 年 6 月 10 日起执行新非货币性资产交换准则，对 2019 年 1 月 1 日存在的非货币性资产交换采用未来适用法处理。

[注 4] 新债务重组准则规定对 2019 年 1 月 1 日至本准则施行日之间发生的债务重组根据本准则进行调整，对 2019 年 1 月 1 日之前发生的债务重组，不需要进行追溯调整。

2. 会计估计变更说明

本期公司无会计估计变更事项。

3. 首次执行新金融工具准则对公司 2019 年 1 月 1 日财务报表的主要影响情况

项 目	资产负债表		
	2018 年 12 月 31 日	新金融工具准则调整影响	2019 年 1 月 1 日
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	251,501,334.99	-251,501,334.99	
交易性金融资产		2,889,231,564.30	2,889,231,564.30
可供出售金融资产	2,631,966,620.73	-2,631,966,620.73	
其他权益工具投资		27,540,000.00	27,540,000.00
其他应付款	462,040,305.45	-612,626.00	461,427,679.45
短期借款	428,000,000.00	612,626.00	428,612,626.00
交易性金融负债		1,056,552,059.55	1,056,552,059.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	988,122,622.02	-988,122,622.02	
预计负债	68,865,421.90	-68,429,437.53	435,984.37
递延所得税负债	18,398,329.89	7,937,577.20	26,335,907.09
其他综合收益	-59,662,853.60	77,533,213.44	17,870,359.84
未分配利润	2,567,087,497.43	-52,167,182.06	2,514,920,315.37

4. 首次执行新金融工具准则调整信息

(1)本公司金融资产在首次执行日按照修订前后金融工具确认计量准则的规定进行分类和计量结果对比如下：

项 目	原金融工具准则		新金融工具准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
货币资金	摊余成本(贷款和应收款项)	15,100,136,062.53	摊余成本	15,100,136,062.53
应收货币保证金	摊余成本(贷款和应收款项)	8,634,466,301.81	摊余成本	8,634,466,301.81
应收质押保证金	摊余成本(贷款和应收款项)	453,138,812.00	摊余成本	453,138,812.00
应收账款	摊余成本(贷款和应收款项)	2,997,113.99	摊余成本	2,997,113.99
应收结算担保金	摊余成本(贷款和应收款项)	25,513,880.92	摊余成本	25,513,880.92
应收风险损失款	摊余成本(贷款和应收款项)	62,322.49	摊余成本	62,322.49
其他应收款	摊余成本(贷款和应收款项)	93,487,921.96	摊余成本	93,487,921.96
金融工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益(交易性)	251,501,334.99	以公允价值计量且其变动计入当期损益(准则要求)	2,889,231,564.30
	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益(可供出售类资产)	2,604,426,620.73		
	以成本计量(可供出售类资产)	27,540,000.00	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益(指定)	27,540,000.00
短期借款	摊余成本	428,000,000.00	摊余成本	428,612,626.00
应付货币保证金	摊余成本	19,952,524,955.66	摊余成本	19,952,524,955.66
应付质押保证金	摊余成本	225,137,938.00	摊余成本	225,137,938.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	988,122,622.02	以公允价值计量且其变动计入当期损益	1,056,552,059.55
应付账款	摊余成本	16,818,922.30	摊余成本	16,818,922.30
其他应付款	摊余成本	462,040,305.45	摊余成本	461,427,679.45

(2)本公司金融资产在首次执行日原账面价值调整为按照修订后金融工具确认计量准则的规定进行分

类和计量的新账面价值的调节表：

项目	按原金融工具准则 列示的账面价值 (2018年12月31 日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则 列示的账面价值 (2019年1月1 日)
(1) 金融资产				
1) 摊余成本				
货币资金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	15,100,136,062.53			15,100,136,062.53
应收货币保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	8,634,466,301.81			8,634,466,301.81
应收质押保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	453,138,812.00			453,138,812.00
应收账款				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	2,997,113.99			2,997,113.99
应收结算担保金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	25,513,880.92			25,513,880.92
应收风险损失款				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	62,322.49			62,322.49
其他应收款				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	93,487,921.96			93,487,921.96
以摊余成本计量的总金融资 产	24,309,802,415.70			24,309,802,415.70
2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益				
交易性金融资产				
按原 CAS22 列示的余额	251,501,334.99			
加：自可供出售类（原 CAS22）转入		2,604,426,620.73		
重新计量：公允价值变动			33,303,608.58	

按新 CAS22 列示的余额				2,889,231,564.30
以公允价值计量且其变动计入当期损益的总金融资产	251,501,334.99	2,604,426,620.73	33,303,608.58	2,889,231,564.30
3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益				
可供出售金融资产				
按原 CAS22 列示的余额	2,631,966,620.73			
减：转出至以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		-2,604,426,620.73		
减：转出至以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产		-27,540,000.00		
按新 CAS22 列示的余额				
其他权益工具投资				
按原 CAS22 列示的余额				
加：自可供出售类（原 CAS22）转入		27,540,000.00		
按新 CAS22 列示的余额				27,540,000.00
以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的总金融资产	2,631,966,620.73	-2,604,426,620.73		27,540,000.00
(2) 金融负债				
1) 摊余成本				
短期借款				
按原 CAS22 列示的余额	428,000,000.00			
加：自应付利息转入		612,626.00		
按新 CAS22 列示的余额				428,612,626.00
应付货币保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按新 CAS22 列示的余额	19,952,524,955.66			19,952,524,955.66
应付质押保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按新 CAS22 列示的余额	225,137,938.00			225,137,938.00
应付款项				
按原 CAS22 列示的余额和按	16,818,922.30			16,818,922.30

新 CAS22 列示的余额				
其他应付款				
按原 CAS22 列示的余额	462,040,305.45			
减：转出至短期借款		-612,626.00		
按新 CAS22 列示的余额				461,427,679.45
以摊余成本计量的总金融负债	21,084,522,121.41			21,084,522,121.41

2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益

交易性金融负债				
按原 CAS22 列示的余额				
加：自以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债转入		988,122,622.02		
加：自预计负债转入		68,429,437.53		
按新 CAS22 列示的余额				1,056,552,059.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债				
按原 CAS22 列示的余额	988,122,622.02			
减：转出至交易性金融负债		-988,122,622.02		
按新 CAS22 列示的余额				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的总金融负债	988,122,622.02	68,429,437.53		1,056,552,059.55

(3)本公司在首次执行日原金融资产减值准备期末金额调整为按照修订后金融工具准则的规定进行分类和计量的新损失准备调节表：

项 目	按原金融工具准则计提损失准备/按或有事项准则确认的预计负债 (2018年12月31日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则计提损失准备 (2019年1月1日)
应收货币保证金	17,033,680.29			17,033,680.29
应收账款	570,083.27			570,083.27
其他应收款	12,229,844.15			12,229,844.15

(八) 合并报表范围的变化情况

√适用 □不适用

本公司 2019 年度纳入合并范围的子公司共 16 家，其中包括 13 家全资子公司分别为浙江永安资本管理有限公司、浙江中邦实业发展有限公司、上海瑞萌商贸有限公司、香港永安商贸有限公司、永安(新加坡)国际贸易有限公司、浙江国油能源有限公司、新永安国际金融控股有限公司、中国新永安期货有限公司、中国新永安实业有限公司、新永安国际证券有限公司、新永安国际资产管理有限公司、永安国际金融（新加坡）有限公司和永安全球基金独立投资组合公司，3 家结构化主体分别为永利 1 号资产管理计划、永屹 1 号资产管理计划、永利 2 号资产管理计划。

(一) 合并范围的增加

1. 以直接设立或投资等方式增加的子公司

公司名称	股权取得方式	股权取得时点	实际出资额	出资比例
浙江国油能源有限公司	设立	2019 年 2 月	10,000 万人民币	100.00%
永安全球基金独立投资组合公司	设立	2019 年 6 月	3,879,577.81 美元	100.00%

2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

本期无新纳入合并范围的结构化主体。

(二) 合并范围的减少

1. 本期无合并财务报表范围的子公司减少。

2. 本期不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的七禾言起 2 号资产管理计划因本期全额赎回，故自赎回日起不再纳入合并范围；本公司管理的永进 1 号资产管理计划因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

3. 本期未发生吸收合并的情况。

合并财务报表的合并范围内是否包含私募基金管理人

□是 √否

(九) 企业社会责任

1. 精准扶贫工作情况

√是 □否

永安期货深刻领会期货行业服务国家脱贫攻坚战略要义，通过采取积极有效举措，发挥专业优势和引领作用，充分发挥期货行业风险管理专长，切实将精准扶贫与服务实体经济发展有机结合，把助力国家脱贫攻坚战略作为公司崇高的政治责任与社会责任。2019 年，公司共投入扶贫资金 418.75 万元，积极参与省内乡村振兴战略、省外产业扶贫和“保险+期货”专业扶贫工作，其中帮助常山县客弄

村增加集体经济收入 10 余万元；安排扶贫资金，分别与安徽太湖县、新疆麦盖提县、陕西延长县、河南桐柏县等签订结对帮扶协议开展产业帮扶活动；安排 2500 万元资金参加交易所及商业化 27 个“保险+期货”项目开展专业扶贫；积极响应国家号召开展消费扶贫，帮助贫困地区拓宽农特产品的销路；安排 76 万元资金在江西省万安县、陕西延长县开展“班班有个图书角”阅读助学项目的教育扶贫，共捐建 380 个班级图书角，直接惠及 16000 余名小学生。

2020 年，公司将继续全面贯彻党的十九大和十九届二中、三中、四中全会精神，以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，充分发挥政治优势和制度优势，坚持精准扶贫精准脱贫基本方略，坚持党委直接领导扶贫工作的机制，坚持大扶贫工作格局，突出问题导向，优化制度建设，为打赢脱贫攻坚战和实施乡村振兴战略作出贡献：一是坚持党的领导，提高扶贫工作思想认识。充分发挥公司党组织的领导作用，深刻认识金融企业开展精准扶贫的重大意义，动员公司一切力量开展精准扶贫工作，持续加大扶贫工作投入力度，坚持脱贫不脱政策、脱贫不脱帮扶、脱贫不脱责任，不断巩固脱贫成果。二是健全扶贫工作机制，保障扶贫工作开展。建立人员保障机制，切实履行好扶贫领导小组和扶贫工作小组职责。建立财务保障和工作监督机制，做好资金落实和使用监督工作。完善工作考核机制，做好扶贫项目过程管理。三是以公司专业优势为依托，强化自身责任感、使命感和紧迫感，坚持因地制宜、分类施策的扶贫理念，加强同政府部门、股东单位、金融机构、合作企业等合作，形成优势互补，充分利用公司风险管理和财富管理专长，建立长效帮扶机制，切实将精准扶贫和服务“三农”与服务实体产业相结合，形成“专业为主、产业为辅”的帮扶思路。

2. 其他社会责任履行情况

作为国内首批开展“保险+期货”试点业务的期货公司，永安期货试点项目品种范围涵盖国内三大商品期货交易所，为“保险+期货”写入中央一号文件提供实践经验。2019 年，公司开展 27 个“保险+期货”项目，承保现货 30 万吨，覆盖种植面积 95 万亩，项目覆盖新疆、云南、广西等 10 省份 15 个县区 55532 户农户。

三、持续经营评价

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

报告期内，公司实现营业收入 22,935,227,415.14 元，同比增长 44.90%；利润总额 1,306,222,513.73 元，同比增长 16.92%；净利润 1,039,191,863.41 元，同比增长 16.91%，公司盈利水平处于行业领先地位，各项风险监管指标均符合监管部门要求，内部治理结构合理、稳定，具备良

好的持续经营能力。

四、 未来展望

√适用 □不适用

(一) 行业发展趋势

经过近三十年的发展，期货业已成为我国现代金融业的重要组成部分。在新品种快速推出、市场规模稳步增加、场外业务迅速发展的情况下，期货市场规模保持稳定增长，服务实体经济的能力不断增强，合规风控能力显著提升，业务范围从期货经纪业务，向资产管理、风险管理、投资咨询等多领域拓展，期货上市品种供给进一步加大，衍生品工具体系日益完善，遵循市场化法制化国际化的方向，推动期货经营机构实施差异化、特色化、专业化发展。在健全市场法治建设方面，健全的法治是期货市场健康发展的基石。作为中国期货市场最为重要的法律《期货法》的立法进程加快推进，《期货法》的出台将保障期货市场在法制化的道路上迈上新台阶。在加大市场供给方面，符合实体经济发展需求的商品期货将加快研发，更多金融期货期权产品也将适时推出，为各类机构投资者提供更为有效和精细化的避险工具。在支持服务实体经济方面，经过多年的探索和实践，期货风险管理子公司作为期货公司从事风险管理业务的平台将在服务供给侧结构性改革、推进“一路一带”国家战略、促进实体企业转型升级上发挥更强作用。在精准扶贫、服务“三农”方面，深耕“保险+期货”等创新模式，把扶贫助农做精、做细、做实。而风险管理业务、财富管理业务随着我国经济的发展发展潜力和空间巨大，期货公司凭借自身专业能力和资源，综合实力和核心竞争力将显著提升。未来，随着期货公司外资股比限制取消，具有良好国际声誉和经营业绩的境外金融机构将加快进入，我国期货品种、机构、投资者的国际化水平也将加速推进，期货市场竞争活力将进一步释放，在服务经济高质量发展和国家重大战略方面发挥更大的作用。

(二) 公司发展战略

公司立足于大资本市场，以服务实体经济为宗旨，深化供给侧结构性改革、融入“一路一带”战略，抓住加快对外开放的历史性机遇，以永安文化为精神引领，构筑风险管理和财富管理两大核心竞争力，以专业的产业服务能力、投资管理能力、策略研究能力、金融衍生工具综合运用能力为支撑，全面推进业务创新，打造期现结合、混业经纪、私募资管、场外交易、跨境服务等平台，促进期货市场功能发挥。同时适时开展重大战略重组，优化治理结构和激励机制，实现向具有国际竞争力的衍生品综合金融集团迈进。

(三) 经营计划或目标

公司将秉承持续创新的理念，以金融市场风险管理和财富管理为突破口，致力于为实体经济转型升级、国内外投资提供全球资产配置的优质服 务，朝着国内第一，国际一流的衍生品综合服务商不断努力。

(四) 不确定性因素

参见“第四节管理层讨论与分析”之“五、风险因素”。

五、 风险因素

(一) 持续到本年度的风险因素

1. 期货、期权经纪业务风险

经纪业务手续费收入是期货公司主要收入来源，手续费收入水平主要取决于客户交易规模和手续费率等因素。随着市场竞争的日趋激烈，手续费率呈逐渐下降态势，公司期货经纪业务面临着竞争风险以及盈利能力下降风险。

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

2. 利息收入下滑风险

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

应对措施：公司已与多家保证金存管银行开展业务合作，存款利率由各银行报价，按竞争报价原则协定存款；自有资金关注证券等金融机构稳定的固收产品，往往会高于存款利率。这些措施一定程度对冲利率下行风险。

3. 期货投资咨询业务风险

由于客户习惯于接受免费的咨询服务，导致营利性质的期货投资咨询业务的盈利模式难以大规模

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

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

4. 资产管理业务风险

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

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

5. 基金销售业务风险

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

应对措施：公司将加强基金销售在技术上的互联网化，特别是移动端的开发使用。对于潜在经营风险，公司将根据基金产品尽职调查及风险评估制度对所销售产品的风险状况进行审慎评估，并据此划分其风险等级，确定适合购买的客户类别和范围；同时根据基金销售适用性管理制度，向客户推介基金产品之前，了解客户的身份、财产和收入状况、金融知识和投资经验、投资目标、风险偏好等基本情况，评估其购买基金产品的适当性；此外，公司 CRM 系统已经上线，其作用是整理公司基金产品直销、代销数据，明确业务人员和客户归属关系，完善客户资产信息，统一业务流程，有助于公司进一步提高业务人员的服务效率。

6. 业务创新风险

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

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

7. 投资风险

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

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

8. 合规风险

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

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

9. 信息技术系统风险

信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，信息系统的安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要，公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，

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

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

10. 信用风险

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

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

11. 居间人管理风险

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

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

12. 人才流失和储备不足风险

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

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

13. 政策风险

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

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

14. 重大诉讼、仲裁风险

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

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

15. 商标风险

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

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

(二) 报告期内新增的风险因素

无

第五节 重要事项

一、 重要事项索引

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

二、 重要事项详情（如事项存在选择以下表格填列）

（一） 重大诉讼、仲裁事项：

1、 报告期内发生的诉讼、仲裁事项

报告期内发生的诉讼、仲裁事项涉及的累计金额是否占净资产 10%及以上

是 否

单位：元

性质	累计金额		合计	占期末净资产比例%
	作为原告/申请人	作为被告/被申请人		
诉讼或仲裁	0	0	0	0%

2、 以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

3、 以临时公告形式披露且在报告期内结案的重大诉讼、仲裁事项

适用 不适用

（二） 报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
1. 购买原材料、燃料、动力	5,000,000,000.00	120,706,616.55
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托，委托或者受托销售	350,000,000.00	25,842,723.89

3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	4,500,000,000.00	2,662,080,439.97
4. 财务资助（挂牌公司接受的）		
5. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	40,335,000,000.00	14,309,557.06
6. 其他		
总计	50,185,000,000.00	2,822,939,337.47

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

事项类型	协议签署时间	临时公告披露时间	交易对方	交易/投资/合并标的	交易/投资/合并对价	对价金额	是否构成关联交易	是否构成重大资产重组
对外投资	2019年4月24日	2019年1月23日	新永安国际金融控股有限公司	增资	现金	港币 3.5 亿元	否	否

事项详情及对公司业务连续性、管理层稳定性及其他方面的影响：

为落实公司国际化战略，推动香港子公司各项业务开展，公司对已在香港设立的全资子公司新永安国际金融控股有限公司进行增资，增资金额为 3.5 亿港元，即将新永安金控注册资本由 2.095 亿港元增加至 5.595 亿港元。增资后，公司对新永安金控的持股比例仍为 100%。本次增资将进一步增强境外子公司的资本实力，有助于提升其经营能力及抗风险能力，对公司未来战略布局和业绩提升具有积极影响。

(四) 承诺事项的履行情况

承诺主体	承诺开始日期	承诺结束日期	承诺来源	承诺类型	承诺具体内容	承诺履行情况
其他	-	-	挂牌	同业竞争承诺	2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券，实际控制人浙江省财政厅控制的省财开、省金控，其他持股5%以上股东及董事、监事、高级管理人员承诺现时及将来均不会以任何方式从事与公司的业务有竞争或可能构成竞争的业务或活动	正在履行中
其他	-	-	挂牌	限售承诺	2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券在挂牌前直接或间接持有的股票分三批解	正在履行中

					除转让限制，每批解除转让限制的数量均为其挂牌前所持股票的三分之一，解除转让限制的时间分别为挂牌之日、挂牌期满一年和两年”的规定进行股票交易，也不要求公司回购该部分股份	
其他	2019年 4月22日	2020年 10月23日	其他 (请自行 填写)	一致行 动承诺	财通证券与浙江产业基金在处理有关永安期货经营发展且根据《中华人民共和国公司法》等有关法律法规和公司章程需要由公司股东大会、董事会作出决议的事项时均应采取一致行动；本协议有效期内，在任一方拟就永安期货经营发展的重大事项向股东大会、董事会提出议案之前，或在行使股东大会或董事会等事项的表决权之前，以甲方（财通证券）的意见为准，作为双方的一致意见	正在履行中
其他	2019年 4月22日	2020年 10月23日	其他 (请自行 填写)	一致行 动承诺	同上	正在履行中

承诺事项详细情况：

<p>公司股东、公司及其董事、监事、高级管理人员在公开转让说明书中作出以下承诺：</p> <p>1、关于避免同业竞争的承诺</p> <p>2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券，实际控制人浙江省财政厅控制的省财开、省金控，其他持股5%以上股东及董事、监事、高级管理人员承诺现时及将来均不会以任何方式从事与公司的业务有竞争或可能构成竞争的业务或活动。</p> <p>2、公司股东所持股份的限售安排及股东对所持股份自愿锁定的承诺</p> <p>2015年10月，公司挂牌时的控股股东财通证券承诺：“本公司将严格遵守《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》的规定，不得超出“挂牌公司控股股东及实际控制人在挂牌前直接或间接持有的股票分三批解除转让限制，每批解除转让限制的数量均为其挂牌前所持股票的三分之一，解除转让限制的时间分别为挂牌之日、挂牌期满一年和两年”的规定进行股票交易，也不要求公司回购该部分股份。”</p>

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

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

(五) 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产名称	资产类别	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例%	发生原因
存货	存货	质押	177,648,020.19	0.48%	存货标准仓单用于交易所质押
其他货币资金	其他货币资金	质押	92,975,596.97	0.25%	作为远期结售汇保证金、信用证保证金、保函保证金或借款质押保证金等
总计	-	-	270,623,617.16	0.73%	-

(六) 调查处罚事项

2019年12月，广东证监局因广州分公司“为香港子公司介绍客户且相关员工获取收入情况”向分公司出具《关于对永安期货股份有限公司广州分公司采取责令改正措施的决定》。报告期内，分公司已按相关要求整改完毕。

第六节 股本变动及股东情况

一、普通股股本情况

(一) 普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末	
		数量	比例%		数量	比例%
无限售条件股份	无限售股份总数	1,017,101,450	77.64%	0	1,017,101,450	77.64%
	其中：控股股东、实际控制人					
	董事、监事、高管					
	核心员工					
有限售条件股份	有限售股份总数	292,898,550	22.36%	0	292,898,550	22.36%
	其中：控股股东、实际控制人					
	董事、监事、高管					
	核心员工					
总股本		1,310,000,000.00	-	0	1,310,000,000.00	-
普通股股东人数						260

(二) 普通股股东情况

单位：股

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

	司						
5	浙江省协作大厦有限公司	138,689,727	0	138,689,727	10.59%	0	138,689,727
6	物产中大集团股份有限公司	27,500,000	0	27,500,000	2.10%	0	27,500,000
7	方继方	6,142,000	-300,000	5,842,000	0.45%	0	5,842,000
8	南通金玖惠通三期创业投资基金合伙企业（有限合伙）	4,795,000	0	4,795,000	0.37%	0	4,795,000
9	浙江省经协集团有限公司	4,798,000	-1,065,000	3,733,000	0.29%	0	3,733,000
10	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	0	3,393,000	0.26%	0	3,393,000
	合计	1,279,782,969	-1,365,000	1,278,417,969	97.61%	292,898,550	985,519,419

以上股东间相互关系说明：

1. 省财开持有本公司第一大股东财通证券 3.23% 股权，持有股东协作大厦 100% 股权。
2. 省金控持有本公司第一大股东财通证券 29.03% 股权，同时省金控持有本公司股东浙江产业基金 100% 股权，省金控为省财开的控股子公司。
3. 浙江省交通投资集团有限公司持有本公司第一大股东财通证券 2.03% 股权，同时持有本公司股东经建投 100% 股权。

二、 优先股股本基本情况

适用 不适用

三、 控股股东、实际控制人情况

是否合并披露：

是 否

(一) 控股股东情况

公司无控股股东。

报告期内，公司控股股东未发生变化。

(二) 实际控制人情况

省金控目前持有财通证券 29.03%股权，持有浙江产业基金 100%股权，系财通证券与浙江产业基金的控股股东。省财开持有省金控 100%的股权，持有财通证券 3.23%股权，持有协作大厦 100%股权，省财开是浙江省人民政府批准成立并委托浙江省财政厅领导和管理的政府投资平台公司，因此浙江省财政厅是本公司的实际控制人。浙江省财政厅是机关法人，是浙江省人民政府综合管理国家财政收支、财税政策，实施财政监督，参与国民经济进行宏观调控的职能部门，住所为杭州市环城西路 37 号。

报告期内，公司实际控制人未发生变化。

第七节 融资及利润分配情况

一、普通股股票发行及募集资金适用情况

1. 最近两个会计年度内普通股股票发行情况

适用 不适用

2. 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

二、存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

三、债券融资情况

适用 不适用

四、可转换债券情况

适用 不适用

五、银行及非银行金融机构间接融资发生情况

适用 不适用

六、权益分派情况

(一) 报告期内的利润分配与公积金转增股本情况

适用 不适用

单位：元或股

股利分配日期	每 10 股派现数（含税）	每 10 股送股数	每 10 股转增数
2019 年 12 月 27 日	1.20	0	0
合计	1.20	0	0

报告期内未执行完毕的利润分配与公积金转增股本的情况：

适用 不适用

2019 年第三季度权益分派方案获 2019 年 12 月 27 日召开的股东大会审议通过，本次权益分派权益登记日为 2020 年 2 月 17 日，除权除息日为 2020 年 2 月 18 日。

(二) 权益分派预案

适用 不适用

未提出利润分配预案的说明

适用 不适用

公司在 2019 年三季度已进行了每 10 股分 1.2 元的利润分配，考虑公司发展需要，2019 年度拟不进行利润分配。

第八节 董事、监事、高级管理人员及员工情况

一、 董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	学历	任职起止日期		是否在公司领取薪酬	年度薪酬
					起始日期	终止日期		
方铁道	董事长	男	1980年10月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
葛国栋	董事、党委书记、总经理	男	1972年1月	本科	2019年10月25日	2022年10月24日	是	437万元
申建新	董事	男	1972年1月	EMBA	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
王建	董事	男	1980年12月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
金朝萍	董事	女	1975年7月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
麻亚峻	董事	男	1974年2月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
顾志旭	董事	男	1988年10月	本科	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
李义超	独立董事	男	1963年5月	博士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
黄平	独立董事	男	1969年2月	博士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
冯晓	独立董事	女	1969年11月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	

			月					
黄德春	独立董事	男	1966年2月	博士	2019年11月27日	2022年10月24日	否	
柴会荣	监事会主席	男	1974年8月	本科	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
马笑渊	监事	男	1975年10月	硕士	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
胡慧珺	监事	女	1962年1月	大专	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
钱焕军	监事	男	1969年8月	本科	2019年10月25日	2022年10月24日	否	
吕仙英	职工监事	女	1974年11月	本科	2019年9月24日	2022年10月24日	是	170万元
史品	职工监事	男	1985年8月	硕士	2019年9月24日	2022年10月24日	是	50万元
石春生	副总经理	男	1965年4月	本科	2019年11月27日	2022年11月26日	是	240万元
黄志明	副总经理	男	1976年4月	硕士	2019年11月27日	2022年11月26日	是	74万元
马冬明	副总经理、董事会秘书	男	1970年11月	本科	2019年11月27日	2022年11月26日	是	61万元
金吉来	副总经理	男	1961年10月	本科	2019年11月27日	2022年11月26日	是	61万元
陈敏	首席风险官	女	1976年4月	本科	2019年11月27日	2022年11月26日	是	190万元
黄峥嵘	财务总监	男	1980年10月	本科	2019年11月27日	2022年11月26日	是	4万元

1、上述高级管理人员年度薪酬不含在本年度发放的历年递延部分。

2、独立董事津贴标准为 12 万元/年。

董事会人数:	11
监事会人数:	6
高级管理人员人数:	7

董事、监事、高级管理人员相互间关系及与实际控制人间关系:

董事长方铁道，现任财通证券股份有限公司副总经理、党委委员兼综合办公室主任。

董事申建新，现任财通证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。

董事王建，现任浙江省金融控股有限公司金融管理部副总经理。

董事顾志旭，现任浙江省金融控股有限公司财务主管，浙江省协作大厦有限公司财务部经理。

监事会主席柴会荣，现任浙江省财务开发公司财务内审部经理，浙江省金融控股有限公司财务部总经理。

监事马笑渊，现任财通证券股份有限公司稽核审计部总经理。

公司实际控制人为浙江省财政厅，财通证券股份有限公司、浙江省金融控股有限公司、浙江省协作大厦有限公司、浙江省财务开发公司实际控制人均为浙江省财政厅，董事、监事、高级管理人员之间无其他关联关系。

(二) 持股情况

单位：股

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

(三) 变动情况

信息统计	董事长是否发生变动	√是 □否
	总经理是否发生变动	□是 √否
	首席风险官是否发生变动	□是 √否
	董事会秘书是否发生变动	√是 □否
	财务总监是否发生变动	√是 □否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况:

√适用 □不适用

姓名	期初职务	变动类型（新任、换届、离任）	期末职务	变动原因

方铁道	无	换届	董事长	董事会换届
王建	无	换届	董事	董事会换届
顾志旭	无	换届	董事	董事会换届
冯晓	无	换届	独立董事	董事会换届
黄德春	无	换届	独立董事	董事会换届
柴会荣	无	换届	监事会主席	监事会换届
马笑渊	无	换届	监事	监事会换届
吕仙英	无	换届	职工监事	监事会换届
史品	无	换届	职工监事	监事会换届
黄志明	董事	换届	副总经理	高管换届
马冬明	无	换届	副总经理、董事会 秘书	高管换届
黄峥嵘	无	换届	财务总监	高管换届
阮琪	董事长	换届	无	董事会换届
林瑛	董事	离任	无	工作变动
朱国华	独立董事	换届	无	董事会换届
汪炜	独立董事	换届	无	董事会换届
马成骁	监事会主席	离任	无	工作变动
胡启彪	监事	换届	无	监事会换届
余晓红	职工监事	换届	无	监事会换届
毛贵明	职工监事	换届	无	监事会换届
叶元祖	党委书记、副 总经理、董事 会秘书、财务 总监	换届	无	工作变动

报告期内新任董事、监事、高级管理人员简要职业经历：

√适用 □不适用

方铁道，男，1980年出生，中国国籍，无境外永久居留权，硕士研究生，经济师。曾任职于天和证券经纪有限公司，2006年10月加入财通证券，曾任风险管理部法务主管，合规部总经理助理、法律事务部经理、副总经理，职工董事，并曾在杭州市富阳区（市）挂职任副区（市）长，现任财通证券副总经理、党委委员兼综合办公室主任。兼任永安期货股份有限公司董事长，浙江省浙商资产管理有限公司董事，浙江省金控企业联合会理事。

王建，男，1980年出生，中国国籍，无境外永久居留权，硕士研究生学历，经济师。曾任浙江物产中大元通集团股份有限公司办公室主任，物产中大集团股份有限公司金融产业部副总经理。自2018年1月起，加入浙江省金融控股有限公司，现任浙江省金融控股有限公司金融管理部总经理。兼任永安期货股份有限公司董事，万向信托股份有限公司董事、太平科技保险股份有限公司董事、浙江中国轻纺城集团股份有限公司董事。

顾志旭,男,1988年出生,中国国籍,无境外永久居留权,会计师。曾任天健会计师事务所项目经理、浙江金控投资管理有限公司业务经理。自2016年7月起任浙江省金融控股有限公司财务部业务员、财务主管。现兼任浙江省金海投资有限公司财务部经理助理、浙江金控投资有限公司财务部副经理、浙江省协作大厦有限公司财务部经理、永安期货股份有限公司董事。

冯晓,女,1969年出生,中国国籍,无境外永久居留权,经济学(会计学)硕士,浙江财经大学会计学教授,硕士研究生导师,MBA导师。中国会计学会个人会员,浙江省会计学会理事,浙江省总会计师协会理事,浙江省管理会计专家咨询委员会委员。中国注册会计师(非执业)CICPA,英国皇家注册管理会计师CIMA,美国注册全球管理会计师CGMA。兼任永安期货股份有限公司、银江股份有限公司、北京蓝色光标品牌管理顾问股份有限公司、通策医疗投资股份有限公司、顾家家居股份有限公司独立董事。

黄德春,男,1966年出生,中国国籍,无境外永久居留权,教授,博士生导师。河海大学学术委员会委员,应用经济学、理论经济学学科主任,世界水谷研究院执行院长、海外中心(老挝)主任,产业经济研究所所长。兼任老挝国家工商委投资决策顾问、东亚管理学学会国际联盟(IFEMA)副理事长、管理科学与工程学会理事、江苏区域发展研究会第二届理事会理事、永安期货股份有限公司独立董事。

柴会荣,男,1974年出生,中国国籍,无境外永久居留权,高级会计师。曾任浙江省财务开发公司干部、浙江省科技风险投资公司计划财务部副经理、浙江华财实业发展有限责任公司财务部副经理、经理、浙江省财务开发公司计划财务部副经理。自2009年12月起至今任浙江省财务开发公司财务内审部经理,兼任永安期货股份有限公司监事会主席。

马笑渊,男,1975年出生,中国国籍,无境外永久居留权,工商管理硕士。曾任财政部驻浙江省财政监察专员办事处四处副处长、一处副处长、业务三处副处长(主持工作)、业务三处处长、机关纪委委员。2019年5月加入财通证券股份有限公司,现任财通证券股份有限公司稽核审计部总经理。兼任永安期货股份有限公司监事。

吕仙英,女,1974年出生,中国国籍,无境外永久居留权,本科学历,经济师。曾任信达期货有限公司出纳、结算员、交易员、交易部经理、结算部经理、合规部负责人、总经理助理,广发期货有限公司华东区副总经理、杭州营业部总经理,浙江新世纪期货有限公司首席风险官、副总经理。2019年1月加入永安期货股份有限公司,现任总经理助理、机构管理总部负责人。兼任永安期货股份有限公司职工监事。

史品,男,1985年出生,中国国籍,无境外永久居留权,硕士研究生学历,公司律师。曾任永安

期货股份有限公司法务专员、浙江省浙商资产管理有限公司法务主管。2018年7月起，任永安期货股份有限公司稽核督查总部副经理。兼任永安期货股份有限公司职工监事。

黄志明，男，1976年出生，中国国籍，无境外永久居留权，研究生，高级经济师。曾任浙江省财务开发公司总经办主任、浙江省金融控股有限公司党委委员、职工董事、办公室主任、风险合规部总经理、金融管理部总经理。现任永安期货股份有限公司副总经理。

马冬明，男，1970年出生，中国国籍，无境外永久居留权，本科学历，高级会计师，注册会计师非执业会员。曾任浙江天健会计师事务所注册会计师，杭州家乐福有限公司财务负责人，浙江监管局稽查处副处长、期货处副处长、上市二处副处长、新业务处处长，中国证监会上海专员办调查二处兼会计处处长，并曾在湖州发改委挂职，任发改委主任助理。现任永安期货股份有限公司副总经理、董事会秘书。

黄峥嵘，男，1980年出生，中国国籍，无境外永久居留权，本科学历，注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所，星展银行(中国)上海分行，天健会计师事务所。2014年8月至2019年11月，任财通证券股份有限公司计划财务部副总经理。现任永安期货股份有限公司财务总监。

二、 员工情况

(一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	期末人数
中层以上管理人员	95	93
市场业务人员	396	426
研究人员	73	80
信息技术人员	89	88
财务人员	67	69
合规管理及风控人员	79	84
其他职能人员	242	263
员工总计	1,041	1,103

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	6	4
硕士	256	293
本科	673	698
专科	90	91
专科以下	16	17
员工总计	1,041	1,103

员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：

1. 人员变动

截至报告期末，公司在职工总数 1,103 人，较期初增长 62 人，增长主要体现在市场开发、研究、合规风控及其他职能领域，公司管理及骨干员工队伍稳定，专业能力稳步提升。

2. 人才引进、培训及招聘情况

报告期内，公司根据战略及业务发展需要，拟定年度招聘计划，通过“黄埔联盟”在校大学生实习培育、“新动力”应届大学生招聘、精英专才海内外招聘等方式，推广优秀雇主品牌、拓展招聘渠道，广泛甄优秀人才，为公司战略发展提供人才支撑。

报告期内，公司围绕战略规划及经营目标，建立四级人才培养及学习体系，分层分类组织新员工、产业经理、理财师、国际业务、期权种子、新任干部等人才队伍培训；启动“永动成长”后备干部人才梯队建设项目；组织产业经理、分析师、技术工程、内训师等职业技术等级认证，完善员工职业发展体系，牵引员工不断提高专业能力；上线“永安大讲堂”E-learning 学习平台，提高培训效率、扩大培训覆盖面、沉淀优秀经验及知识。

3. 薪酬政策

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

4. 需公司承担费用的离退休职工人数

无

(二) 核心人员（公司及控股子公司）基本情况

适用 不适用

三、 报告期后更新情况

适用 不适用

第九节 行业信息

是否自愿披露

是 否

第十节 公司治理及内部控制

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

一、 公司治理

(一) 制度与评估

1、 公司治理基本状况

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

2019年度，公司对《风险管理基本制度》《反洗钱和反恐怖融资基本内控制度》《廉洁从业管理办法》《资产管理业务管理办法》等多项基本制度进行了修订，进一步完善了公司内控体系。严格按照证监会要求，对分公司、营业部实行严格的“四统一”管理，制定了分支机构制度汇编，并通过制度指引规范、完善营业部的岗位设置及业务操作规程。为落实看穿式监管要求，完善交易系统建设升级，对17种公司交易终端、390余种外部终端、850余客户的外部接入进行重新审定，优化统一账户入口，完成统一反洗钱系统和人行数据规范平台建设。

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

2、 公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

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

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

3、 公司重大决策是否履行规定程序的评估意见

公司 2019 年度重要的制度修订、对外投资、关联交易、利润分配、人事任免等重大事项，均严格按照相关法律法规、《公司章程》及公司其他相关内控制度的规定履行了相应的决策程序。

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

4、 公司章程的修改情况

(1) 2019 年 2 月 19 日，公司 2019 年第一次临时股东大会审议通过《关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案》，对公司章程中第四条做出修订：公司原注册地址为“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 层、17 层、2702 室。”，变更为“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、2702 室。”。

(2) 2019 年 12 月 27 日，公司 2019 年第六次临时股东大会审议通过《关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案》。对公司章程中第四条做出修订：公司原注册地址为“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、2702 室”，变更为“浙江省杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 10 层、1102 室、1104 室、16-17 层、2604 室。”。

(二) 三会运作情况

1、 三会召开情况

会议类型	报告期内会议召开的次数	经审议的重大事项（简要描述）
董事会	10	1. 2019 年 1 月 21 日，公司召开第二届董事会第十九次会议，审议通过关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于对新永安国际金融控股有限公司增资的议案、关于修订《永安期货股份有限公司资产管理业务管理办法》的议案、关于召开公司

		<p>2019 年第一次临时股东大会的议案；</p> <p>2. 2019 年 4 月 22 日，公司召开第二届董事会第二十次会议，审议通过 2018 年工作总结和 2019 年工作计划（总经理工作报告）、2018 年董事会工作报告、首席风险官 2018 年度工作报告、2018 年年度报告及摘要、2018 年财务决算报告和 2019 年财务预算报告、2018 年资本性支出预算执行情况报告与 2019 年资本性支出预算计划报告、关于确认公司 2018 年关联交易的议案、关于预计公司 2019 年日常关联交易的议案、2018 年度利润分配方案、2018 年下半年风险监管指标情况报告、2018 年度经营层薪酬考核报告与 2019 年度经营层薪酬考核方案、2018 年扶贫工作情况及 2019 年扶贫工作计划、关于发行次级债的议案、关于同意财通证券股份有限公司担任公司次级债发行的主承销商的议案、关于相关经营管理事项授权的议案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于续聘会计师事务所的议案、关于会计政策变更的议案、关于修订《风险管理基本制度》的议案、关于修订《反洗钱和反恐怖融资基本内控制度》的议案、关于修订《薪酬管理制度》的议案、关于制定《廉洁从业管理办法》的议案、2018 年度廉洁从业管理情况报告、2019 年第一季度报告、关于同意永安国富向部分骨干员工定向增发股份的议案、关于召开公司 2018 年度股东大会的议案；</p> <p>3. 2019 年 8 月 1 日，公司召开第二届董事会第二十一次会议，审议通过关于变更董事会成员的议案、关于召开公司 2019 年第二次临时股东大会的议案；</p> <p>4. 2019 年 8 月 15 日，公司召开第二届董事会第二十二次会议，审议通过 2019 年上半年工作总结及下半年工作计划、2019 年半年度报告、2019 年上半年财务执行情况报告、2019 年上半年风险监管指标情况报告、关于会计政策变更的议案、关于召开公司 2019 年第三次临时股东大会的议案；</p> <p>5. 2019 年 9 月 23 日，公司召开第二届董事会第二十三次会议，审议通过关于确认永安国富资产管理有限公司资产评估结果的议案；</p> <p>6. 2019 年 9 月 24 日，公司召开第二届董事会第二十四次会议，审议通过关于董事会换届选举的议案、关于召开 2019 年第四次临时股东大会的议案；</p> <p>7. 2019 年 10 月 17 日，公司召开第二届董事会第二十五次会议，审议通过 2019 年第三季度报告；</p> <p>8. 2019 年 11 月 6 日，公司召开第三届董事会第一次会议，审议通过关于提名永安期货股份有限公司第三届董事会独立董事候选人的议案、关于召开 2019 年第五次临时股东大会的议案；</p> <p>9. 2019 年 11 月 27 日，公司召开第三届董事会第二次会议，审议通过关于豁免公司第三届董事会第二次会议提前通知义务的议案、关于选举永安期货股份有限公司第三届董事会董事长的议案、关于选举永安期货股份有限公司第三届董事会专业委员会委员的议案、关于聘任永安期货股份有限公司总经理的议案、关于聘任</p>
--	--	--

		<p>永安期货股份有限公司其他高级管理人员的议案、关于公司独立董事津贴的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、2019年前三季度利润分配的议案、关于修订《股票期权经纪业务管理办法》《证券经纪业务管理办法》的议案、关于召开2019年第六次临时股东大会的议案；</p> <p>10. 2019年12月11日，公司召开第三届董事会第三次会议，审议通过关于变更会计师事务所的议案。</p>
监事会	8	<p>1. 2019年4月22日，公司召开第二届监事会第十五次会议，审议通过2018年监事会工作报告、首席风险官2018年度工作报告、2018年年度报告及摘要、2018年财务决算报告和2019年财务预算报告、2018年资本性支出预算执行情况报告与2019年资本性支出预算计划、关于确认公司2018年关联交易的议案、关于预计公司2019年日常关联交易的议案、2018年度利润分配方案、2018年下半年风险监管指标情况报告、2018年度经营层薪酬考核报告与2019年度经营层薪酬考核方案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于修订《风险管理基本制度》的议案、关于修订《反洗钱和反恐怖融资基本内控制度》的议案、关于修订《薪酬管理制度》的议案、关于制定《廉洁从业管理办法》的议案、2018年度廉洁从业管理情况报告、关于会计政策变更的议案、2019年第一季度报告；</p> <p>2. 2019年8月1日，公司召开第二届监事会第十六次会议，审议通过关于变更监事会成员的议案；</p> <p>3. 2019年8月15日，公司召开第二届监事会第十七次会议，审议通过2019年半年度报告、2019年上半年财务执行情况报告、2019年上半年风险监管指标情况报告、关于会计政策变更的议案；</p> <p>4. 2019年8月19日，公司召开第二届监事会第十八次会议，审议通过关于选举监事会主席的议案；</p> <p>5. 2019年9月24日，公司召开第二届监事会第十九次会议，审议通过关于监事会换届选举的议案；</p> <p>6. 2019年10月17日，公司召开二届监事会第二十次会议，审议通过2019年第三季度报告；</p> <p>7. 2019年11月27日，公司召开第三届监事会第一次会议，审议通过关于豁免公司第三届监事会第一次会议提前通知义务的议案、关于选举永安期货股份有限公司第三届监事会主席的议案、2019年前三季度利润分配的议案；</p> <p>8. 2019年12月11日，公司召开第三届监事会第二次会议，审议通过关于变更会计师事务所的议案。</p>
股东大会	7	<p>1. 2019年2月19日，公司召开2019年第一次临时股东大会，审议通过关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案；</p> <p>2. 2019年5月31日，公司召开2018年年度股东大会，审议通过2018年董事会工作报告、2018年监事会工作报告、2018年年度报告及摘要、2018年财务决算报告和2019年财务预算报告、2018年资本性支出预算执行情况报告与2019年资本性支出预算计划、关于确认公司2018年关联交易的议案、关于预计公司2019年度</p>

		<p>日常关联交易的议案、2018年度利润分配方案、2018年下半年风险监管指标情况报告、关于发行次级债的议案、关于同意财通证券股份有限公司担任公司次级债发行的主承销商的议案、关于授权公司管理层合理配置公司资产的议案、关于续聘会计师事务所的议案；</p> <p>3. 2019年8月16日，公司召开2019年第二次临时股东大会，审议通过关于变更董事会成员的议案、关于变更监事会成员的议案；</p> <p>4. 2019年9月4日，公司召开2019年第三次临时股东大会，审议通过2019年上半年风险监管指标情况报告；</p> <p>5. 2019年10月25日，公司召开2019年第四次临时股东大会，审议通过关于董事会换届选举的议案、关于监事会换届选举的议案；</p> <p>6. 2019年11月27日，公司召开2019年第五次临时股东大会，审议通过关于提名永安期货股份有限公司第三届董事会独立董事候选人的议案；</p> <p>7. 2019年12月27日，公司召开2019年第六次临时股东大会，审议通过关于公司独立董事津贴的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、关于变更公司住所并相应修改公司章程的议案、2019年前三季度利润分配的议案、关于变更会计师事务所的议案。</p>
--	--	---

2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见

报告期内公司共召开10次董事会、8次监事会、7次股东大会，“三会”的召集、提案审议、通知时间、召开程序、授权委托、表决和决议等运作程序，符合《公司法》及有关法律法规和《公司章程》的相关规定，公司董事、监事及高级管理人员符合《公司法》等法律法规的任职要求，能够按照《公司章程》、“三会”议事规则等治理制度勤勉、诚信地履行职责和义务。

(三) 公司治理改进情况

公司不断完善公司治理结构，报告期内，对《公司章程》《资产管理业务管理办法》《风险管理基本制度》《反洗钱和反恐怖融资基本内控制度》《薪酬管理制度》《廉洁从业管理办法》《股票期权经纪业务管理办法》《证券经纪业务管理办法》等多项基本制度进行了修订，进一步完善了公司内控体系。严格按照证监会要求，对分公司、营业部实行严格的“四统一”管理，落实看穿式监管要求，完善监控体系建设，完成统一反洗钱系统和人行数据规范平台建设。

报告期内，公司股东大会、董事会、监事会和管理层均严格按照《公司法》、《公司章程》等法律、法规和规范性文件的要求，履行各自的权利和义务。公司重大生产经营决策、投资决策及财务决策均按照《公司章程》及有关内控制度规定的程序和规则进行。截至报告期末，上述机构和人员依法运作，未出现重大违法违规情况。公司将关注期货行业的发展，根据经营发展需要，按照协调运转、有效制

衡的要求，进一步梳理公司决策层、经营层、监督层“各司其职、各负其责、相互制衡、协调发展”的现代公司法人规范治理要求，完善落实公司三会议事规则，加强董事、监事、管理层人员在公司治理方面的能力培训，不断提升公司的治理水平。

报告期内，公司管理层未引入职业经理人。

(四) 投资者关系管理情况

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

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

(五) 董事会下设专门委员会在本年度内履行职责时所提出的重要意见和建议

√适用 □不适用

公司董事会下设4个专门委员会：战略发展委员会、审计委员会、风险控制委员会、提名与薪酬考核委员会。报告期内，公司各委员会各司其职，为公司战略发展规划、经营管理、风险控制、薪酬考核、人才激励等事项提出了建议，为公司治理结构不断完善、长期发展规划和可持续发展起到了积极的作用。

(六) 独立董事履行职责情况

√适用 □不适用

姓名	本年应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数
----	------------	--------	--------	------

李义超	10	10	0	0
黄平	10	10	0	0
冯晓	3	3	0	0
黄德春	2	2	0	0

独立董事的意见:

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

二、 内部控制

(一) 监事会就年度内监督事项的意见

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

(二) 公司保持独立性、自主经营能力的说明

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

1. 业务独立

本公司根据《营业执照》及《经营期货业务许可证》所核定的经营范围独立开展业务。本公司各项业务具有完整的业务流程、独立的经营场所。本公司经营的业务与实际控制人及其控制的其他企业之间不存在实质性同业竞争，未受到本公司股东及其他关联方的干涉、控制，也未因与本公司股东及其他关联方存在关联关系，而使得本公司经营自主权的独立性和完整性受到不良影响。

2. 人员独立

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

在公司任职并领取薪酬，不存在在实际控制人及其控制的其他企业中兼职或领取薪酬的情形。

3. 资产独立

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

4. 机构独立

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

5. 财务独立

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

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

(三) 对重大内部管理制度的评价

公司依据《公司法》《会计法》及《期货交易管理条例》《期货公司监督管理办法》等有关法律法规的规定，按照建立现代企业制度的要求，以全面性、重要性、制衡性和成本效益为原则，制定了本公司内部控制管理制度。

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

事后的决策、执行、监督、反馈等各个环节。

报告期内，公司未发现上述管理制度存在重大缺陷。

(四) 年度报告差错责任追究制度相关情况

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

报告期内，公司未发生重大会计差错更正、重大遗漏信息等情况。

第十一节 财务报告

一、 审计报告

是否审计	是
审计意见	无保留意见
审计报告中的特别段落	<input checked="" type="checkbox"/> 无 <input type="checkbox"/> 强调事项段 <input type="checkbox"/> 其他事项段 <input type="checkbox"/> 持续经营重大不确定性段落 <input type="checkbox"/> 其他信息段落中包含其他信息存在未更正重大错报说明
审计报告编号	中汇会审[2020] 1641 号
审计机构名称	中汇会计师事务所（特殊普通合伙）
审计机构地址	杭州市江干区新业路 8 号华联时代大厦 A 幢 601 室
审计报告日期	2020 年 4 月 20 日
注册会计师姓名	王其超、方立强
会计师事务所是否变更	是
会计师事务所连续服务年限	1
会计师事务所审计报酬	45 万元

审计报告正文：

审 计 报 告

中汇会审[2020] 1641号

永安期货股份有限公司全体股东：

一、 审计意见

我们审计了永安期货股份有限公司(以下简称永安期货公司)财务报表,包括2019年12月31日的合并及母公司资产负债表,2019年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表以及财务报表附注。

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了永安期货公司2019年12月31日的合并及母公司财务状况以及2019年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

二、 形成审计意见的基础

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

适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不对这些事项单独发表意见。我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

(一) 手续费收入的确认

1. 事项描述

永安期货公司的手续费收入主要包括期货经纪业务收入、投资咨询业务收入、基金代销业务收入及资产管理业务收入。如附注三(二十八)所述，期货经纪业务收入在与客户办理买卖期货合约款项清算时确认；投资咨询业务、基金代销业务和资产管理业务收入在业务提供的相关服务已经完成，收到价款或取得收取款项的凭据时确认。

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

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括：

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

(2) 针对处理与手续费收入相关交易的关键信息技术系统，我们利用本所内部信息技术专家的工作，评价和测试该系统关于信息系统应用的关键内部控制的设计和运行有效性。

(3) 对于期货经纪业务收入，将公司记录的交易量与从中国期货业协会网站获取的同期交易数据进行核对，并将财务账面记录的手续费收入与交易运作总部业务系统中记录的数据进行核对。

(4) 对于投资咨询业务和基金代销业务收入，抽取部分业务项目，检查永安期货公司与客户签订的合同，核实相关收入确认与合同条款是否一致，并评价相关收入确认是否符合公司关于收入确认的会计政策。

(5) 对于资产管理业务收入，抽取样本，核对管理费和业绩报酬的费率与合同约定是否一致，并复核管理费和业绩报酬的计算过程。

（二）结构化主体是否纳入合并范围

1. 事项描述

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

由于相关结构化主体是否纳入合并范围可能对财务报表产生重大影响,且涉及重大管理层判断,因此,我们将结构化主体是否纳入合并范围确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们实施的审计程序主要包括:

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

四、其他信息

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

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

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

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

五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

永安期货公司治理层(以下简称治理层)负责监督永安期货公司的财务报告过程。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

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

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

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

中汇会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师：王其超

(项目合伙人)

中国·杭州

中国注册会计师：方立强

报告日期：2020年4月20日

二、 财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2019年12月31日	2019年1月1日
流动资产：			
货币资金	六（一）1	17,277,242,747.04	15,100,136,062.53
其中：期货保证金存款		16,265,578,018.17	13,987,081,754.86
应收货币保证金	六（一）4	11,325,661,929.26	8,634,466,301.81
应收质押保证金	六（一）5	621,717,032.00	453,138,812.00
存出保证金	六（一）6	841,892.55	-
交易性金融资产	六（一）14	4,130,938,590.83	2,889,231,564.30
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		-	-
衍生金融资产			-
应收票据		-	

应收账款	六（一）7	11,013,567.11	651,510.76
应收款项融资	六（一）8	1,793,095.85	
预付款项	六（一）9	302,040,051.78	176,585,144.04
应收结算担保金	六（一）10	34,593,853.25	25,513,880.92
应收风险损失款	六（一）11	17,004.09	62,322.49
应收佣金	六（一）7[注1]	13,861,553.98	2,345,603.23
其他应收款	六（一）12	88,317,675.95	93,487,921.96
其中：应收利息		1,905,396.09	13,877,742.52
应收股利		14,558.23	3,209.07
买入返售金融资产			-
存货	六（一）13	1,531,314,799.31	973,484,388.78
合同资产			
持有待售资产			-
一年内到期的非流动资产			-
其他流动资产	六（一）22[注2]	266,098,144.02	165,645,006.09
流动资产合计		35,605,451,937.02	28,514,748,518.91
非流动资产：			
债权投资			
可供出售金融资产		-	-
其他债权投资			
持有至到期投资		-	
长期应收款			
长期股权投资	六（一）16	486,824,372.27	326,610,079.92
其他权益工具投资	六（一）15	26,845,000.00	27,540,000.00
期货会员资格投资	六（一）17	1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产	六（一）18	10,035,071.69	3,602,959.06
固定资产	六（一）19	232,130,750.50	102,603,824.08
在建工程	六（一）22[注2]	-	87,245,315.29
使用权资产			
无形资产	六（一）20	233,733,432.01	241,219,290.44
开发支出			-
商誉			-
长期待摊费用	六（一）22[注2]	9,454,316.78	14,308,002.80
递延所得税资产	六（一）21	193,591,338.28	147,181,663.99
其他非流动资产			-
非流动资产合计		1,194,014,281.53	951,711,135.58
资产总计		36,799,466,218.55	29,466,459,654.49
流动负债：			-

短期借款	六（一）23	562,544,509.00	428,612,626.00
应付货币保证金	六（一）25	24,535,428,916.12	19,952,524,955.66
应付质押保证金	六（一）26	434,089,168.00	225,137,938.00
交易性金融负债	六（一）27	1,783,215,819.12	1,056,552,059.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		-	-
期货风险准备金	六（一）28	232,191,214.15	213,203,152.39
衍生金融负债			-
应付票据			
应付账款	六（一）29	107,960,512.29	16,818,922.30
预收款项	六（一）30	741,569,234.77	406,991,421.73
合同负债			
卖出回购金融资产款			-
应付期货投资者保障基金	六（一）31	671,681.51	547,449.15
应付手续费及佣金	六（一）34[注3]	840,649.07	1,023,763.63
应付职工薪酬	六（一）32	783,931,911.56	534,545,299.95
应交税费	六（一）33	168,563,751.51	145,792,896.46
其他应付款	六（一）34	453,060,831.14	460,403,915.82
其中：应付利息			-
应付股利		157,200,000.00	157,200,000.00
持有待售负债			-
一年内到期的非流动负债			-
其他流动负债	六（一）24[注4]	43,497,081.98	-
流动负债合计		29,847,565,280.22	23,442,154,400.64
非流动负债：			
长期借款			
应付债券			
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债	六（一）35	445,737.05	435,984.37
递延收益			-
递延所得税负债	六（一）21	87,529,106.96	26,335,907.09
其他非流动负债			-
非流动负债合计		87,974,844.01	26,771,891.46
负债合计		29,935,540,124.23	23,468,926,292.10
所有者权益（或股东权益）：			
股本	六（一）36	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			-

其中：优先股			-
永续债			
资本公积	六（一）37	1,501,682,614.86	1,500,868,930.15
减：库存股			-
其他综合收益	六（一）38	39,928,823.91	17,870,359.84
专项储备			-
盈余公积	六（一）39	398,170,713.39	296,991,371.55
一般风险准备	六（一）40	458,061,727.32	356,882,385.48
未分配利润	六（一）41	3,156,082,214.84	2,514,920,315.37
归属于母公司所有者权益合计		6,863,926,094.32	5,997,533,362.39
少数股东权益		-	-
股东权益合计		6,863,926,094.32	5,997,533,362.39
负债和股东权益总计		36,799,466,218.55	29,466,459,654.49

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

注 1：财务报表附注与上表列示项目略有不同，下同。财务报表附注六（一）“应收账款”包含上表所列的“应收账款”和“应收佣金”；

注 2：财务报表附注六（一）“结算备付金”、“融出资金”、“其他资产-待抵扣增值税”、“其他资产-待摊费用”列示在上表“其他流动资产”项目中；财务报表附注六（一）“其他资产-长期待摊费用”单列在上表“长期待摊费用”中；

注 3：财务报表附注六（一）“其他应付款”包含上表所列的“应付手续费及佣金”和“其他应付款”；

注 4：财务报表附注六（一）“代理买卖证券款”与“其他流动负债”列示在上表“其他流动负债”中。

（二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2019 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日
流动资产：			
货币资金		15,488,253,132.19	13,620,901,224.29
其中：期货保证金存款		15,308,127,388.12	13,235,117,657.99
应收货币保证金		10,815,398,355.32	8,092,469,298.99
应收质押保证金		621,717,032.00	453,138,812.00
存出保证金			
交易性金融资产		2,688,152,511.34	2,009,616,327.28
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		-	
衍生金融资产			
应收票据			
应收账款			
应收款项融资			
预付款项			
应收结算担保金		31,112,096.04	25,513,880.92
应收风险损失款		17,004.09	62,322.49

应收佣金		16,120,242.25	3,795,329.73
其他应收款		101,019,294.42	34,319,795.71
其中：应收利息			10,761,780.82
应收股利		80,000,000.00	
买入返售金融资产			
存货			
合同资产			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		18,677,298.98	18,281,976.97
流动资产合计		29,780,466,966.63	24,258,098,968.38
非流动资产：			
债权投资			
可供出售金融资产		-	
其他债权投资			
持有至到期投资		-	
长期应收款			
长期股权投资	十（一）1	2,176,245,132.90	1,716,924,160.41
其他权益工具投资		18,922,500.00	19,270,000.00
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产		10,035,071.69	3,602,959.06
固定资产		228,380,541.36	98,694,779.81
在建工程		-	87,245,315.29
使用权资产			
无形资产		232,219,958.38	240,288,925.60
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		8,483,879.16	13,286,857.71
递延所得税资产		132,961,247.51	100,425,131.09
其他非流动资产			
非流动资产合计		2,808,648,331.00	2,281,138,128.97
资产总计		32,589,115,297.63	26,539,237,097.35
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		24,449,581,016.08	19,770,604,020.00
应付质押保证金		621,717,032.00	453,138,812.00
交易性金融负债			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		-	
期货风险准备金		232,191,214.15	213,203,152.39
衍生金融负债			
应付票据			

应付账款			
预收款项		373,054.92	1,004,166.79
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金		671,681.51	547,449.15
应付手续费及佣金		840,649.07	1,023,763.63
应付职工薪酬	=	668,066,501.12	458,848,934.22
应交税费		119,142,637.79	87,595,497.77
其他应付款		198,461,735.03	175,804,808.96
其中：应付利息			
应付股利		157,200,000.00	157,200,000.00
合同负债			
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
流动负债合计		26,291,045,521.67	21,161,770,604.91
非流动负债：			
长期借款			
应付债券			
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债		65,806,417.33	
其他非流动负债			
非流动负债合计		65,806,417.33	
负债合计		26,356,851,939.00	21,161,770,604.91
所有者权益（或股东权益）：			
股本		1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		1,502,904,302.10	1,502,700,854.26
减：库存股			
其他综合收益		-1,220,053.50	-1,220,053.50
专项储备			
盈余公积		398,170,713.39	296,991,371.55
一般风险准备		458,061,727.32	356,882,385.48
未分配利润		2,564,346,669.32	1,912,111,934.65
股东权益合计		6,232,263,358.63	5,377,466,492.44
负债和股东权益总计		32,589,115,297.63	26,539,237,097.35

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	2019年	2018年
一、营业收入		22,757,609,299.75	15,763,889,406.71
手续费及佣金净收入	六（二） 1	516,308,160.73	534,254,965.29
其中：经纪业务手续费收入		427,857,510.01	473,267,701.94
资产管理业务收入		35,929,709.16	10,572,215.13
投资咨询业务收入		2,912,778.01	6,291,242.47
代理销售金融产品收入		49,608,163.55	44,123,805.75
其他代理业务收入			-
利息净收入	六（二） 2	552,305,587.41	569,688,435.51
其中：利息收入		618,496,985.72	639,545,275.16
利息支出		66,191,398.31	69,856,839.65
投资收益（损失以“-”号填列）	六（二） 3	712,152,946.29	921,167,244.16
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		212,858,720.40	153,509,885.56
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	六（二） 4	7,922,956.41	4,980,332.24
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六（二） 5	438,751,993.31	46,332,896.52
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-3,233,184.93	2,953,804.50
其他业务收入	六（二） 6	20,533,367,550.92	13,684,164,075.39
其中：风险管理业务收入		20,512,110,273.07	13,671,612,382.29
资产处置收益（损失以“-”号填列）	六（二） 7	33,289.61	347,653.10
二、营业支出		21,577,925,727.76	14,652,062,489.53
提取期货风险准备金		19,051,965.16	21,395,264.59
税金及附加	六（二） 8	8,564,808.13	5,566,520.89
业务及管理费	六（二） 9	1,095,510,076.60	875,955,401.11
研发费用		-	-

资产减值损失	六（二） 12	-	270,021,886.07
信用减值损失	六（二） 10	3,243,087.24	
其他资产减值损失	六（二） 11	354,745,444.10	
其他业务成本	六（二） 13	20,096,810,346.53	13,479,123,416.87
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,179,683,571.99	1,111,826,917.18
加：营业外收入	六（二） 14	77,097,898.60	24,367,583.02
减：营业外支出	六（二） 15	5,732,298.77	23,161,114.44
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,251,049,171.82	1,113,033,385.76
减：所得税费用	六（二） 16	250,328,588.67	240,836,048.61
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,000,720,583.15	872,197,337.15
其中：被合并方在合并前实现的净利润			-
（一）按经营持续性分类：	-	-	-
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,000,720,583.15	872,197,337.15
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			-
（二）按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益（净亏损以“-”填列）			-
2. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”填列）		1,000,720,583.15	872,197,337.15
六、其他综合收益的税后净额	六（二） 17	22,058,464.07	-304,249,659.66
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		22,058,464.07	- 304,249,659.66
1. 不能重分类进损益的其他综合收益			-
（1）重新计量设定受益计划变动额			-
（2）权益法下不能转损益的其他综合收益			
（3）其他权益工具投资公允价值变动			
（4）企业自身信用风险公允价值变动			
（5）其他			
2. 将重分类进损益的其他综合收益		22,058,464.07	-304,249,659.66
（1）权益法下可转损益的其他综合收益			-11,304,846.92
（2）其他债权投资公允价值变动			
（3）可供出售金融资产公允价值变动损益		-	-312,345,644.00
（4）金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
（5）持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益		-	

(6) 其他债权投资信用损失准备			
(7) 现金流量套期储备			
(8) 外币财务报表折算差额		22,058,464.07	19,400,831.26
(9) 其他			
(二) 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		1,022,779,047.22	567,947,677.49
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		1,022,779,047.22	567,947,677.49
(二) 归属于少数股东的综合收益总额			-
八、每股收益：			-
(一) 基本每股收益		0.76	0.67
(二) 稀释每股收益		0.76	0.67

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	2019年	2018年
一、营业收入		2,054,174,936.99	1,556,512,450.10
手续费及佣金净收入	十（二） 1	561,351,813.74	494,167,462.36
其中：经纪业务手续费收入		381,039,303.21	427,905,291.72
资产管理业务收入		127,949,913.22	16,327,297.53
投资咨询业务收入		2,754,433.76	5,811,067.36
代理销售金融产品收入		49,608,163.55	44,123,805.75
其他代理业务收入			
利息净收入		551,384,976.52	572,173,937.31
其中：利息收入		584,478,191.12	608,722,851.22
利息支出		33,093,214.60	36,548,913.91
投资收益（损失以“-”号填列）	十（二） 2	561,009,804.43	477,735,138.53
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		211,509,024.65	150,359,762.64
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		3,762,620.52	1,296,956.41
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		355,853,987.57	-
汇兑收益（损失以“-”号填列）		744.32	3,476.49
其他业务收入		20,777,700.28	10,916,362.22
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）		33,289.61	219,116.78

二、营业支出		822,544,973.73	693,165,037.68
提取期货风险准备金		19,051,965.16	21,395,264.59
税金及附加		5,804,812.93	3,551,711.41
业务及管理费		795,657,577.63	667,570,320.11
研发费用		-	
资产减值损失		-	513,436.25
信用减值损失		1,566,207.43	
其他资产减值损失		-	
其他业务成本		464,410.58	134,305.32
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,231,629,963.26	863,347,412.42
加：营业外收入		12,650.76	137,610.42
减：营业外支出		5,657,122.94	6,434,081.04
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,225,985,491.08	857,050,941.80
减：所得税费用		214,192,072.73	178,462,384.96
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,011,793,418.35	678,588,556.84
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,011,793,418.35	678,588,556.84
（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		-	-309,765,345.12
（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		-	-309,765,345.12
1. 权益法下可转损益的其他综合收益			-11,304,846.92
2. 其他债权投资公允价值变动			
3. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-	-298,460,498.20
4. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
5. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益		-	
6. 其他债权投资信用损失准备			
7. 现金流量套期储备			
8. 外币财务报表折算差额			
9. 其他			
七、综合收益总额		1,011,793,418.35	368,823,211.72
八、每股收益：			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(五) 合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2019年	2018年
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金		23,449,379,329.47	15,944,895,336.09
处置交易目的而持有的金融资产净增加额		-	-
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额		-	-
收取利息、手续费及佣金的现金		1,167,841,289.21	1,203,895,742.24
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	六（三） 1	2,645,947,318.56	2,947,015,361.53
经营活动现金流入小计		27,263,167,937.24	20,095,806,439.86
为交易目的而持有的金融资产净增加额		30,705,567.95	236,383,772.03
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		23,712,835,444.60	15,849,941,368.16
支付利息、手续费及佣金的现金		36,761,634.11	23,514,541.95
以现金支付的业务及管理费		285,528,206.00	240,220,719.05
支付给职工以及为职工支付的现金		533,905,882.85	483,490,779.16
支付的各项税费		240,993,520.37	315,478,743.44
支付其他与经营活动有关的现金	六（三） 2	783,721,722.73	4,038,118,909.76
经营活动现金流出小计		25,624,451,978.61	21,187,148,833.55
经营活动产生的现金流量净额		1,638,715,958.63	-1,091,342,393.69
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		695,000.00	500,000.00
取得投资收益收到的现金		52,800,000.00	132,126,250.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		201,491.53	441,646.11
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金	六（三） 3	50,445,501.69	6,907,526.53
投资活动现金流入小计		104,141,993.22	139,975,422.64
投资支付的现金		-	24,500,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		50,614,383.60	63,238,843.45
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金	六（三） 4	45,000,000.00	-
投资活动现金流出小计		95,614,383.60	87,738,843.45
投资活动产生的现金流量净额		8,527,609.62	52,236,579.19
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			

其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		982,485,874.00	782,900,518.26
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金	六（三） 5	454,512,772.00	774,247,408.30
筹资活动现金流入小计		1,436,998,646.00	1,557,147,926.56
偿还债务支付的现金		853,000,000.00	1,344,900,518.26
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		182,183,755.20	251,682,924.76
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	六（三） 6	22,000,000.00	-
筹资活动现金流出小计		1,057,183,755.20	1,596,583,443.02
筹资活动产生的现金流量净额		379,814,890.80	-39,435,516.46
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		23,142,419.79	20,880,666.94
五、现金及现金等价物净增加额		2,050,200,878.84	-1,057,660,664.02
加：期初现金及现金等价物余额		13,919,415,645.30	14,977,076,309.32
六、期末现金及现金等价物余额		15,969,616,524.14	13,919,415,645.30

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2019年	2018年
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额		-	
收取利息、手续费及佣金的现金		1,178,913,890.98	1,133,897,111.38
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		2,838,816,507.53	3,977,222,567.91
经营活动现金流入小计		4,017,730,398.51	5,111,119,679.29
为交易目的而持有的金融资产净增加额		143,837,536.02	205,321,658.42
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金			
支付利息、手续费及佣金的现金		33,093,214.60	22,044,365.97
以现金支付的业务及管理费		145,861,112.67	124,375,087.12
支付给职工以及为职工支付的现金		417,895,682.59	378,455,299.07
支付的各项税费		182,146,211.63	241,700,988.98
支付其他与经营活动有关的现金		517,235,038.47	3,957,364,021.30
经营活动现金流出小计		1,440,068,795.98	4,929,261,420.86
经营活动产生的现金流量净额		2,577,661,602.53	181,858,258.43
二、投资活动产生的现金流量：			

收回投资收到的现金		347,500.00	250,000.00
取得投资收益收到的现金		145,800,000.00	294,899,128.69
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		201,491.53	324,220.98
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		146,348,991.53	295,473,349.67
投资支付的现金		300,408,500.00	500,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		49,050,186.16	58,911,059.27
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		349,458,686.16	558,911,059.27
投资活动产生的现金流量净额		-203,109,694.63	-263,437,709.60
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金			
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计			
偿还债务支付的现金		-	430,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		157,200,000.00	219,720,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计		157,200,000.00	649,720,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		-157,200,000.00	-649,720,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
五、现金及现金等价物净增加额		2,217,351,907.90	-731,299,451.17
加：期初现金及现金等价物余额		13,270,901,224.29	14,002,200,675.46
六、期末现金及现金等价物余额		15,488,253,132.19	13,270,901,224.29

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

(七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	2019年												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者 权益	
	股本	其他权益工具			资本 公积	减：库 存股	其他综 合收益	专项 储备	盈余 公积	一般风 险准备			未分配 利润
	优先股	永续债	其他										
一、上年期末余额	1,310,000.00				1,500,868,930.15		-59,662,853.60		296,991,371.55	356,882,385.48	2,567,087,497.43		5,972,167,331.01
加：会计政策变更							77,533,213.44				-52,167,182.06		25,366,031.38
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年期初余额	1,310,000.00				1,500,868,930.15		17,870,359.84		296,991,371.55	356,882,385.48	2,514,920,315.37		5,997,533,362.39
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）					813,684.71		22,058,464.07		101,179,341.84	101,179,341.84	641,161,899.47		866,392,731.93
（一）综合收益总额							22,058,464.07				1,000,720,583.15		1,022,779,047.22

(二) 所有者投入和减少资本													
1. 股东投入的普通股													
2. 其他权益工具持有者投入资本													
3. 股份支付计入所有者权益的金额													
4. 其他													
(三) 利润分配								101,179,341.84	101,179,341.84	-359,558,683.68			-157,200,000.00
1. 提取盈余公积								101,179,341.84		-101,179,341.84			
2. 提取一般风险准备									101,179,341.84	-101,179,341.84			
3. 对所有者(或股东)的分配										-157,200,000.00			-157,200,000.00
4. 其他													
(四) 所有者权益内部结转													
1. 资本公积转增资本(或股本)													
2. 盈余公积转增资本(或股本)													
3. 盈余公积弥补亏损													
4. 设定受益计划变动额结转留存收益													

5. 其他综合收益结转留存收益													
6. 其他													
（五）专项储备													
1. 本期提取													
2. 本期使用													
（六）其他					813,684. 71								813,684. 71
四、本期末余额	1,310,00 0,000.00				1,501,68 2,614.86		39,928,8 23.91		398,170 ,713.39	458,061 ,727.32	3,156,0 82,214. 84		6,863,92 6,094.32

项目	2018 年												
	归属于母公司所有者权益										少数股 东权益	所有者 权益	
	股本	其他权益工具			资本 公积	减：库 存股	其他综 合收益	专项 储备	盈余 公积	一般风 险准备			未分配 利润
优先股		永续债	其他										
一、上年期末余额	1,310,00 0,000.00				1,500,86 8,930.15		244,586, 806.06		229,132 ,515.87	289,023 ,529.80	1,987,8 07,871. 64		5,561,41 9,653.52
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	1,310,00 0,000.00				1,500,86 8,930.15		244,586, 806.06		229,132 ,515.87	289,023 ,529.80	1,987,8 07,871. 64		5,561,41 9,653.52

三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）								- 304,249, 659.66	67,858, 855.68	67,858, 855.68	579,279 ,625.79	410,747, 677.49
（一）综合收益总额								- 304,249, 659.66			872,197 ,337.15	567,947, 677.49
（二）所有者投入和减少资本												
1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
（三）利润分配									67,858, 855.68	67,858, 855.68	- 292,917 ,711.36	- 157,200, 000.00
1. 提取盈余公积									67,858, 855.68		- 67,858, 855.68	
2. 提取一般风险准备										67,858, 855.68	- 67,858, 855.68	
3. 对所有者（或股东）的分配											- 157,200 ,000.00	- 157,200, 000.00
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												

1. 资本公积转增资本（或股本）													
2. 盈余公积转增资本（或股本）													
3. 盈余公积弥补亏损													
4. 设定受益计划变动额结转留存收益													
5. 其他综合收益结转留存收益													
6. 其他													
（五）专项储备													
1. 本期提取													
2. 本期使用													
（六）其他													
四、本年期末余额	1,310,000,000.00				1,500,868,930.15		-59,662,853.60	296,991,371.55	356,882,385.48	2,567,087,497.43		5,972,167,331.01	

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

（八）母公司股东权益变动表

单位：元

项目	2019年											
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,502,700,854.26		-75,562,719.52	296,991,371.55	356,882,385.48	1,986,454,600.67	5,377,466,492.44	

加：会计政策变更							74,342,666.02					-	0
前期差错更正												74,342,666.02	
其他													
二、本年期初余额	1,310,000,000.00				1,502,700,854.26		-	296,991,371.55	356,882,385.48	1,912,111,934.65		5,377,466,492.44	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）					203,447.84			101,179,341.84	101,179,341.84	652,234,734.67		854,796,866.19	
（一）综合收益总额										1,011,793,418.35		1,011,793,418.35	
（二）所有者投入和减少资本													
1. 股东投入的普通股													
2. 其他权益工具持有者投入资本													
3. 股份支付计入所有者权益的金额													
4. 其他													
（三）利润分配								101,179,341.84	101,179,341.84	-	359,558,683.68	-	157,200,000.00
1. 提取盈余公积								101,179,341.84		-	101,179,341.84		
2. 提取一般风险准备									101,179,341.84	-			

										1.84	101,179,341.84	
3. 对所有者（或股东）的分配											-	-
											157,200,000.00	157,200,000.00
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
（五）专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
（六）其他					203,447.84							203,447.84
四、本年年末余额	1,310,000,000.00				1,502,904,302.10		-	398,170,713.39	458,061,727.32	2,564,346,669.32	6,232,263,358.63	

项目	2018年											
----	-------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,310,000,000.00				1,502,700,854.26		234,202,625.60		229,132,515.87	289,023,529.80	1,600,783,755.19	5,165,843,280.72
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				1,502,700,854.26		234,202,625.60		229,132,515.87	289,023,529.80	1,600,783,755.19	5,165,843,280.72
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）							-309,765,345.12		67,858,855.68	67,858,855.68	385,670,845.48	211,623,211.72
（一）综合收益总额							-309,765,345.12				678,588,556.84	368,823,211.72
（二）所有者投入和减少资本												
1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
（三）利润分配									67,858,855.68	67,858,855.68	-292,917,711.36	-157,200,000.00
1. 提取盈余公积									67,858,855.68		-	

									55.68		67,858,85	
											5.68	
2. 提取一般风险准备										67,858,85	-	
										5.68	67,858,85	
											5.68	
3. 对所有者（或股东）的分配											-	-
											157,200,0	157,200,000
											00.00	.00
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
（五）专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
（六）其他												
四、本年期末余额	1,310,00				1,502,700		-		296,991,	356,882,3	1,986,454,	5,377,466,4
	0,000.00				,854.26		75,562,7		371.55	85.48	600.67	92.44
							19.52					

法定代表人：葛国栋

主管会计工作负责人：黄峥嵘

会计机构负责人：黄峥嵘

永安期货股份有限公司

财务报表附注

2019 年度

一、公司基本情况

(一) 公司概况

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

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

本公司下设 28 家营业部及 15 家分公司,分别位于北京、天津、上海、重庆、浙江、山东、辽宁等地。本公司拥有控股子公司 13 家,分别为浙江永安资本管理有限公司(以下简称永安资本公司)、浙江中邦实业发展有限公司(以下简称中邦实业公司)、上海瑞萌商贸有限公司(以下简称上海瑞萌公司)、香港永安商贸有限公司(以下简称永安商贸公司)、永安(新加坡)国际贸易有限公司(以下简称永安新加坡公司)、浙江国油能源有限公司(以下简称国油能源公司)、新永安国际金融控股有限公司(以下简称新永安控股公司)、中国新永安期货有限公司(以下简称新永安期货公司)、中国新永安实业有限公司(以下简称新永安实业公司)、新永安国际证券有限公司(以下简称新永安证券公司)、新永安国际资产管理有限公司(以下简称新永安资管公司)、永安国际金融(新加坡)有限公司(以下简称永安国际金融公司)和永安全球基金独立投资组合公司(以下简称永安全球基金公司)。

更正前的财务报告经公司 2020 年 4 月 20 日第三届董事会第五次会议批准对外报出。公司经过自查,针对发现的会计差错,出具了《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》,并据此重新编制了财务报告。更正后的财务报告经公司 2020 年 12 月 9 日第三届十次董事会批准对外报出。中汇会计师事务所(特殊普通合伙)对公司更正前的财务报告出具了文号为中汇会审(2020)1641 号的标准无保留意见审计报告。天健会计师事务所(特殊普通合伙)对《永安期货股份有限公司关于前期会计差错更正的专项说明》进行了专项审核,出具了《永安期货股份有限公司前期会计差错更正专项说明的审核报告》。经其审核,天健会计师事务所(特殊普通合伙)认为公司对相关会计差错更正的会计处理符合《企业会计准则第 28 号——会计政策、会计估计变更和差错更正》和全国中小企业股份转让系统有限责任公司《挂牌公司信息披露及会计业务问答(三)》的规定。

二、财务报表的编制基础

（一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

（二）持续经营能力评价

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

三、重要会计政策和会计估计

（一）遵循企业会计准则的声明

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

（二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

（三）记账本位币

公司采用人民币为记账本位币。

（四）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

1. 同一控制下企业合并的会计处理方法

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

2. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

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

（五）合并财务报表的编制方法

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

（六）现金及现金等价物的确定标准

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

（七）外币业务和外币报表折算

1. 外币业务折算

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

2. 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率的近似汇率折算。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。

(八) 金融工具

1. 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：(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，按照交易价格进行初始计量。

(2) 金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

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

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损

益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

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

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

(3) 金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

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

按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

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

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

4) 以摊余成本计量的金融负债

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

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

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

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

该部分金融负债)。

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

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

4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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

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

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

5. 金融工具减值

(1) 金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资、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。

对于不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款，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。

公司判断金融工具是否已违约，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。如果金融工具逾期超过730天，则公司将其界定为违约。

公司判断金融工具已发生信用减值的依据，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- 1) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 2) 债务人发生重大财务困难；
- 3) 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 4) 债务人很可能破产或存在其他财务重组等事项；
- 5) 以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实；
- 6) 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 7) 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别。

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

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
结算备付金——应收交易所和商业银行组合	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组合	款项性质	
应收货币保证金——应收交易所和商业银行组合	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，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——应收交易所组合款	款项性质	应收结算担保金存放于中国金融期货交易所、中国证券登记结算有限公司和Asia Pacific Exchange等，纳入应收交易所和商业银行等组合，参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失
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

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

(3) 按组合计量预期信用损失的应收款项和合同资产

1) 具体组合及计量预期信用损失的方法

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

(4) 对于单项风险特征明显的应收款项，根据应收款项类似信用风险特征(债务人根据合同条款偿还欠款的能力)，按历史款项损失情况及债务人经济状况预计可能存在的损失情况，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。

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。

(九) 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

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

3. 存货可变现净值的确定依据及存货跌价准备的计提方法

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

4. 存货的盘存制度为永续盘存制。

(十) 营业部的资金管理、交易清算原则

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

(十一) 客户保证金的管理与核算方法

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

(十二) 质押品的管理与核算方法

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

(十三) 实物交割的管理与核算方法

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

(十四) 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。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

(十五) 长期股权投资

1. 共同控制、重要影响的判断

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

2. 投资成本的确定

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

(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。

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

3. 后续计量及损益确认方法

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

4. 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

(1) 个别财务报表

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

(2) 合并财务报表

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

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

丧失对原子公司控制权时，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子

公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益等，应当在丧失控制权时转为当期投资收益。

2) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“一揽子交易”的

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

(十六) 投资性房地产

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

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

(十七) 固定资产

1. 固定资产的确认条件

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

2. 各类固定资产的折旧方法

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

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

(十八) 在建工程

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

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

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

(十九) 无形资产

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

项 目	摊销年限(年)
软 件	3
土地使用权	40

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

(二十) 长期待摊费用

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

(二十一) 职工薪酬

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

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

3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

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

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

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

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

3) 期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不

允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

4. 辞退福利的会计处理方法

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

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

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

(二十二) 期货风险准备金提取和使用的会计处理方法

1. 期货风险准备金按代理手续费净收入的 5% 计提，计入当期损益。

2. 风险损失的确认标准为：

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

3. 风险准备金不足以弥补的损失计入当期损益。

(二十三) 预计负债

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

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

(二十四) 期货投资者保障基金确认和计量

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

(二十五) 收入

收入是指企业在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加的、与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入只有在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时才能予以确认。符合收入定义和收入确认条件的项目，应当列入利润表。

1. 提供劳务

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

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

2. 让渡资产使用权

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

3. 销售商品

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

(二十六) 政府补助

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

2. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

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

3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

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

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

(二十七) 递延所得税资产、递延所得税负债

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

2. 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

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

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

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

(二十八) 一般风险准备的提取和使用核算方法

1. 一般风险准备按照当期实现净利润的 10% 提取。

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

(二十九) 重要会计政策变更说明

1. 本公司自 2019 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下简称新金融工具准则)。根据相关新旧准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新准则与原准则的差异追溯调整本报告期初留存收益或其他综合收益。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。公司考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。权益类投资需按公允价值计量且其变动计入当期损益，但在初始确认时可选择按公允价值计量且其变动计入其他综合收益(处置时的利得或损失不能回转到损益，但股利收入计入当期损益)，且该选择不可撤销。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于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金融资产、合同资产、租赁应收款等。

(1) 执行新金融工具准则对公司 2019 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2018 年 12 月 31 日	新金融工具 准则调整影响	2019 年 1 月 1 日
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	251,501,334.99	-251,501,334.99	
交易性金融资产		2,889,231,564.30	2,889,231,564.30
可供出售金融资产	2,631,966,620.73	-2,631,966,620.73	

其他权益工具投资		27,540,000.00	27,540,000.00
其他应付款	462,040,305.45	-612,626.00	461,427,679.45
短期借款	428,000,000.00	612,626.00	428,612,626.00
交易性金融负债		1,056,552,059.55	1,056,552,059.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	988,122,622.02	-988,122,622.02	
预计负债	68,865,421.90	-68,429,437.53	435,984.37
递延所得税负债	18,398,329.89	7,937,577.20	26,335,907.09
其他综合收益	-59,662,853.60	77,533,213.44	17,870,359.84
未分配利润	2,567,087,497.43	-52,167,182.06	2,514,920,315.37

(2) 2019年1月1日,公司金融资产和金融负债按照新金融工具准则和按原金融工具准则的规定进行分类和计量结果对比如下表:

项 目	原金融工具准则		新金融工具准则	
	计量类别	账面价值	计量类别	账面价值
货币资金	摊余成本(贷款和应收款项)	15,100,136,062.53	摊余成本	15,100,136,062.53
应收货币保证金	摊余成本(贷款和应收款项)	8,634,466,301.81	摊余成本	8,634,466,301.81
应收质押保证金	摊余成本(贷款和应收款项)	453,138,812.00	摊余成本	453,138,812.00
应收账款	摊余成本(贷款和应收款项)	2,997,113.99	摊余成本	2,997,113.99
应收结算担保金	摊余成本(贷款和应收款项)	25,513,880.92	摊余成本	25,513,880.92
应收风险损失款	摊余成本(贷款和应收款项)	62,322.49	摊余成本	62,322.49
其他应收款	摊余成本(贷款和应收款项)	93,487,921.96	摊余成本	93,487,921.96
金融工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益(交易性)	251,501,334.99	以公允价值计量且其变动计入当期损益(准则要求)	2,889,231,564.30
	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益(可供出售)	2,604,426,620.73		

	类资产)			
	以成本计量 (可供出售类 资产)	27,540,000.00	以公允价值计 量且其变动计 入其他综合收 益(指定)	27,540,000.00
短期借款	摊余成本	428,000,000.00	摊余成本	428,612,626.00
应付货币保证 金	摊余成本	19,952,524,955.66	摊余成本	19,952,524,955.66
应付质押保证 金	摊余成本	225,137,938.00	摊余成本	225,137,938.00
以公允价值计 量且其变动计 入当期损益的 金融负债	以公允价值计 量且其变动计 入当期损益	988,122,622.02	以公允价值计 量且其变动计 入当期损益	1,056,552,059.55
应付账款	摊余成本	16,818,922.30	摊余成本	16,818,922.30
其他应付款	摊余成本	462,040,305.45	摊余成本	461,427,679.45

(3) 2019年1月1日,公司原金融资产和金融负债账面价值调整为按照新金融工具准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节表如下:

项目	按原金融工具准则 列示的账面价值 (2018年12月31 日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则 列示的账面价值 (2019年1月1 日)
(1) 金融资产				
1) 摊余成本				
货币资金				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	15,100,136,062.53			15,100,136,062.53
应收货币保证金				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	8,634,466,301.81			8,634,466,301.81
应收质押保证金				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	453,138,812.00			453,138,812.00
应收账款				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	2,997,113.99			2,997,113.99
应收结算担保金				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	25,513,880.92			25,513,880.92
应收风险损失款				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	62,322.49			62,322.49
其他应收款				
按原CAS22列示的余额和按 新CAS22列示的余额	93,487,921.96			93,487,921.96
以摊余成本计量的总金融资	24,309,802,415.70			24,309,802,415.70

项目	按原金融工具准则 列示的账面价值 (2018年12月31 日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则 列示的账面价值 (2019年1月1 日)
产				
2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益				
交易性金融资产				
按原 CAS22 列示的余额	251,501,334.99			
加：自可供出售类（原 CAS22）转入		2,604,426,620.73		
重新计量：公允价值变动			33,303,608.58	
按新 CAS22 列示的余额				2,889,231,564.30
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的总金融资产	251,501,334.99	2,604,426,620.73	33,303,608.58	2,889,231,564.30
3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益				
可供出售金融资产				
按原 CAS22 列示的余额	2,631,966,620.73			
减：转出至以公允价值计量 且其变动计入当期损益的金 融资产		-2,604,426,620.73		
减：转出至以公允价值计量 且其变动计入其他综合收益 的金融资产		-27,540,000.00		
按新 CAS22 列示的余额				
其他权益工具投资				
按原 CAS22 列示的余额				
加：自可供出售类（原 CAS22）转入		27,540,000.00		
按新 CAS22 列示的余额				27,540,000.00
以公允价值计量且其变动计 入其他综合收益的总金融资 产	2,631,966,620.73	-2,604,426,620.73		27,540,000.00
(2) 金融负债				
1) 摊余成本				
短期借款				
按原 CAS22 列示的余额	428,000,000.00			
加：自应付利息转入		612,626.00		
按新 CAS22 列示的余额				428,612,626.00
应付货币保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	19,952,524,955.66			19,952,524,955.66
应付质押保证金				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	225,137,938.00			225,137,938.00
应付款项				
按原 CAS22 列示的余额和按 新 CAS22 列示的余额	16,818,922.30			16,818,922.30

项目	按原金融工具准则列示的账面价值 (2018年12月31日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则列示的账面价值 (2019年1月1日)
其他应付款				
按原CAS22列示的余额	462,040,305.45			
减: 转出至短期借款		-612,626.00		
按新CAS22列示的余额				461,427,679.45
以摊余成本计量的总金融负债	21,084,522,121.41			21,084,522,121.41

2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益

交易性金融负债				
按原CAS22列示的余额				
加: 自以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债转入		988,122,622.02		
加: 自预计负债转入		68,429,437.53		
按新CAS22列示的余额				1,056,552,059.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债				
按原CAS22列示的余额	988,122,622.02			
减: 转出至交易性金融负债		-988,122,622.02		
按新CAS22列示的余额				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的总金融负债	988,122,622.02	68,429,437.53		1,056,552,059.55

(4) 2019年1月1日, 公司原金融资产减值准备期末金额调整为按照新金融工具准则的规定进行分类和计量的新损失准备的调节表如下:

项目	按原金融工具准则计提损失准备/按或有事项准则确认的预计负债 (2018年12月31日)	重分类	重新计量	按新金融工具准则计提损失准备 (2019年1月1日)
应收货币保证金	17,033,680.29			17,033,680.29
应收账款	570,083.27			570,083.27
其他应收款	12,229,844.15			12,229,844.15

2. 根据财政部《关于修订印发2018年度金融企业财务报表格式的通知》(财会〔2018〕36号), 本公司对部分资产负债表和利润表的列报项目进行了修订, 新增了“交易性金融资产”、“其他权益工具投资”、“信用减值损失”、“其他资产减值损失”等科目, 删除了“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”、“可供出售金融资产”、“持有至到期投资”、“应收利息”、“应付利息”等科目, “利息净收入”包含分类为以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产按照实际利率法计算的利息收入。对于上述列报项目的变更, 公司采用未来适用法进行会计处理, 未对上年比较数据

进行重新列报。

3. 本公司自 2019 年 6 月 10 日起执行经修订的《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》，自 2019 年 6 月 17 日起执行经修订的《企业会计准则第 12 号——债务重组》。该项会计政策变更采用未来适用法处理。

四、税（费）项

（一）主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	16%、13%、10%、9%、6%、3% [注 1]
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
商品及服务税	实际缴纳的流转税税额	7%、0%[注 2]
企业所得税	应纳税所得额	16.5%、17%、25%

不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率
永安新加坡公司	17%
永安国际金融公司	17%
永安商贸公司	16.5%
新永安控股公司	16.5%
新永安期货公司	16.5%
新永安实业公司	16.5%
新永安证券公司	16.5%
新永安资管公司	16.5%
永安全球基金公司	[注 3]
除上述以外的其他纳税主体	25%

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

根据财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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。

[注 2] 永安国际金融公司在新加坡销售商品及提供服务的商品及服务税税率为 7%，永安新加坡公司经营的出口货物和服务的商品及服务税税率为零

[注 3]永安全球基金公司注册地在开曼群岛，免交企业所得税

(二) 税收优惠

1. 据财政部、国家税务总局《财政部 国家税务总局关于原油和铁矿石期货保税交割业务增值税政策的通知》(财税〔2015〕35号)，自2015年4月1日起，通过上海国际能源交易中心股份有限公司交易的原油和通过大连商品交易所交易的铁矿石期货保税交割业务，暂免征收增值税。2017年至2020年度，子公司永安资本和永安国油经向主管税务机关办理免税备案后，开展的原油期货保税交割业务开具增值税普通发票，免缴增值税。

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

五、企业合并、合并财务报表范围及在其他主体中的权益

(一) 合并范围增加

1. 报告期新纳入合并财务报表范围的子公司

因直接设立方式而增加子公司的情况说明

公司名称	股权取得方式	股权取得时点	实际出资额	出资比例
国油能源公司	设立	2019年2月	1亿人民币	100.00%
永安全球基金公司	设立	2019年6月 [注]		

[注]永安全球基金公司于2018年成立，本公司于2019年出资并取得股权

2. 本期新纳入合并范围的结构化主体

本期无新纳入合并范围的结构化主体。

(二) 合并范围减少

1. 本期无合并财务报表范围的子公司减少。

2. 本期不再纳入合并财务报表范围的结构化主体

本公司管理的七禾言起2号资产管理计划(以下简称七禾言起2号)因本期全额赎回，故自赎回日起不再纳入合并范围；本公司管理的永进1号资产管理计划(以下简称永进1号)因已清算，故自清算日起不再纳入合并范围。

(三) 在子公司中的权益

1. 子公司的构成

基本情况

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
永安资本公司	杭州	杭州	商业	100.00		设立
中邦实业公司	杭州	杭州	商业	100.00		非同一控制下企业合并
上海瑞萌公司	上海	上海	商业		100.00	设立
永安商贸公司	香港	香港	商业		100.00	设立
永安新加坡公司	新加坡	新加坡	商业		100.00	设立
国油能源公司	舟山	舟山	商业		100.00	设立
新永安控股公司	香港	香港	金融业	100.00		设立
新永安期货公司	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安实业公司	香港	香港	商业		100.00	设立
新永安资管公司	香港	香港	金融业		100.00	设立
新永安证券公司	香港	香港	金融业		100.00	设立
永安国际金融公司	新加坡	新加坡	金融业		100.00	设立
永安全球基金公司	开曼	香港	金融业		100.00	设立

2. 对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据

对于公司管理并投资的结构化主体，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。

(四) 在联营企业中的权益

1. 重要的联营企业

(1) 基本情况

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
永安国富资产管理有限公司(以下简称永安国富公司)	杭州	杭州	金融业	31.3539		权益法核算
浙江玉皇山南投资管理有限公司(以下简称玉皇山南公司)	杭州	杭州	金融业		19.00	权益法核算
鞍钢永安商品贸易有限公司(以下简称鞍钢商贸公司)	杭州	杭州	商业		49.00	权益法核算

(2) 持有 20%以下表决权但具有重大影响

永安资本公司因向玉皇山南公司派遣董事，故能够对其生产经营产生重大影响。

2. 重要联营企业的主要财务信息

项 目	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	永安国富公司	玉皇山南公司	鞍钢商贸公司	永安国富公司	玉皇山南公司	鞍钢商贸公司
流动资产	1,940,825,259.42	236,807,821.96	64,233,688.92	870,041,901.02	92,502,938.30	111,255,106.09
非流动资产	75,236,491.93	23,979,630.09	18,180.28	458,445,989.52	25,489,416.85	26,096.34
资产合计	2,016,061,751.35	260,787,452.05	64,251,869.20	1,328,487,890.54	117,992,355.15	111,281,202.43
流动负债	553,808,109.94	137,975,671.50	17,301,924.90	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71
非流动负债	42,108,914.68		30,692.50			
负债合计	595,917,024.62	137,975,671.50	17,332,617.40	460,734,683.81	27,657,653.94	60,155,807.71
少数股东权益		39,231,816.52			16,468,750.59	
归属于母公司所有者权益	1,420,144,726.73	83,579,964.03	46,919,251.80	867,753,206.73	73,865,950.62	51,125,394.72
按持股比例计算的净资产份额	445,271,030.71	15,880,193.16	22,990,433.38	286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41
对联营企业权益投资的账面价值	445,271,030.71	15,880,193.16		286,358,558.22	14,034,530.61	25,051,443.41
营业收入	1,041,569,096.79	13,444,921.76	781,610,040.90	1,281,525,686.40	2,046,677.87	486,385,002.58
净利润	648,887,520.00	19,014,987.25	-4,206,142.92	455,635,644.35	-7,131,923.03	1,125,394.72
其他综合收益				-34,257,111.87		
综合收益总额	648,887,520.00	19,014,987.25	-4,206,142.92	421,378,532.48	-7,131,923.03	1,125,394.72
本期收到的来自联营企业的股利				132,000,000.00		

(五) 本期纳入合并范围的结构化主体的财务数据

名 称	期末净资产	本期净利润
永利 1 号资产管理计划 (以下简称永利 1 号)	1,197,178,231.45	159,203,251.26
永屹一号资产管理计划 (以下简称永屹一号)	5,046,708.44	-70,329.69
永利 2 号资产管理计划 (以下简称永利 2 号)	705,217,771.47	189,934,010.96
七禾言起 2 号		-209,224.39
永进 1 号		1,476,867.62
小 计	1,907,442,711.36	350,334,575.76

六、合并财务报表项目注释

(一) 合并资产负债表项目注释

1. 货币资金

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
库存现金	8,315.11	20,185.76
银行存款	897,611,616.61	1,037,089,547.63
期货保证金存款	16,209,864,177.87	13,987,081,754.86
证券经纪业务保证金	55,713,840.30	
其他货币资金	114,044,797.15	75,944,574.28
合 计	17,277,242,747.04	15,100,136,062.53

期末，其他货币资金中有 92,975,596.97 元借款保证金、信用证保证金和保函保证金使用受限。

(2) 货币资金——期货保证金存款

银 行 名 称	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
工商银行	EUR			EUR 4,008,799.07	7.8473	31,458,248.94
工商银行	HKD 1,476,204.99	0.8958	1,322,384.43	HKD 487,635.68	0.8762	427,266.38
工商银行	JPY 25,391,446.00	0.0641	1,627,591.69	JPY 39,583,026.00	0.0619	2,450,189.31
工商银行	USD 2,403,860.43	6.9762	16,769,811.13	USD 1,426,346.38	6.8632	9,789,300.48
工商银行	RMB 321,026,270.14	1.0000	321,026,270.14	RMB 440,911,883.25	1.0000	440,911,883.25
光大银行	RMB 5,477,465.74	1.0000	5,477,465.74	RMB 5,138,586.20	1.0000	5,138,586.20
建设银行	RMB 36,054,317.41	1.0000	36,054,317.41	RMB 29,727,493.00	1.0000	29,727,493.00
交通银行	EUR 264,912.20	7.8155	2,070,421.30	EUR 399,639.57	7.8473	3,136,091.60
交通银行	HKD 23,357,345.26	0.8958	20,923,509.88	HKD 624,184.06	0.8762	546,910.07
交通银行	JPY 10,092,241.00	0.0641	646,912.65	JPY 41,607,594.00	0.0619	2,575,510.07
交通银行	RMB 8,934,218,786.33	1.0000	8,934,218,786.33	RMB 11,154,153,310.35	1.0000	11,154,153,310.35
交通银行	USD 4,494,324.53	6.9762	31,353,306.79	USD 9,273,580.72	6.8632	63,646,439.19
交通银行	GBP 153,857.41	9.1501	1,407,810.69	GBP 162,519.00	8.6762	1,410,047.35
民生银行	RMB 2,637,399,231.25	1.0000	2,637,399,231.25	RMB 510,884,818.36	1.0000	510,884,818.36
民生银行	HKD 6.80	0.8958	6.09	HKD 42,888,636.55	0.8762	37,579,023.35
民生银行	USD 25,079,606.91	6.9762	174,960,353.73	USD 57,291,230.88	6.8632	393,201,175.78
农业银行	RMB 35,249,488.19	1.0000	35,249,488.19	RMB 29,186,899.99	1.0000	29,186,899.99
浦发银行	RMB 5,561,946.47	1.0000	5,561,946.47	RMB 310,186,592.53	1.0000	310,186,592.53
兴业银行	RMB 2,759,135,469.13	1.0000	2,759,135,469.13	RMB 5,622,157.17	1.0000	5,622,157.17

银行名称	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
兴业银行	HKD 20,000,000.00	0.8958	17,916,000.00	HKD		
兴业银行	USD 57,048,154.78	6.9762	397,979,337.38	USD		
渣打银行	HKD 1,883,248.11	0.8958	1,687,013.66	HKD 1,042,315.45	0.8762	913,276.80
渣打银行	USD 179,236.38	6.9762	1,250,388.83	USD 1,506,688.88	6.8632	10,340,707.12
招商银行	RMB 5,936,956.61	1.0000	5,936,956.61	RMB 5,929,762.60	1.0000	5,929,762.60
招商银行	HKD 11,341,185.99	0.8958	10,159,434.41	HKD 773,286.51	0.8762	677,553.64
招商银行	USD 1,027,322.26	6.9762	7,166,805.55	USD 719,719.06	6.8632	4,939,575.85
中国银行	EUR 55,580.90	7.8155	434,392.52	EUR		
中国银行	HKD 72,751,236.74	0.8958	65,170,557.87	HKD 18,905,340.25	0.8762	16,564,859.13
中国银行	USD 15,191,157.51	6.9762	105,976,553.02	USD 17,935,747.31	6.8632	123,096,620.94
中国银行	JPY 41,284,112.00	0.0641	2,646,311.58	JPY 350,985,017.00	0.0619	21,725,972.55
中国银行	RMB 82,253,432.44	1.0000	82,253,432.44	RMB 103,937,030.28	1.0000	103,937,030.28
中信银行	RMB 12,974,167.78	1.0000	12,974,167.78	RMB 612,955,553.13	1.0000	612,955,553.13
平安银行	RMB 1,998,471.61	1.0000	1,998,471.61	RMB 2,683,017.54	1.0000	2,683,017.54
星展银行	RMB 506,225,490.67	1.0000	506,225,490.67	RMB 51,285,881.91	1.0000	51,285,881.91
星展银行	USD 700,063.20	6.9762	4,883,780.90	USD		
小计			16,209,864,177.87			13,987,081,754.86

(3) 货币资金——证券经纪业务保证金

银行名称	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
中国银行	HKD 45,400,249.67	0.8958	40,669,543.65			
中国银行	RMB 1,639,929.06	1.0000	1,639,929.06			
中国银行	USD 1,921,442.56	6.9762	13,404,367.59			
小计			55,713,840.30			

(4) 货币资金——外币货币资金

项目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
美元	134,864,791.14	6.9762	940,843,755.95
港币	493,019,003.96	0.8958	441,646,423.75
新加坡元	1,061,947.76	5.1739	5,494,411.52

欧元	357,396.69	7.8155	2,793,233.83
日元	81,968,703.00	0.0641	5,254,193.86
英镑	155,746.80	9.1501	1,425,098.79
小 计			1,397,457,117.70

2. 结算备付金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67
合 计	739,169.66	100.00	6,992.99	0.95	732,176.67

2) 采用组合计提坏账准备的结算备付金

项 目	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收交易所和商业银行组合	599,309.79		
其他组合	139,859.87	6,992.99	5.00
小 计	739,169.66	6,992.99	0.95

按组合计提坏账的确认标准及说明：以款项性质区分结算备付金组合。

(2) 明细情况——按类别

项 目	期末数		
	账面余额	坏账准备	账面价值
公司自有备付金	739,169.66	6,992.99	732,176.67
小 计	739,169.66	6,992.99	732,176.67

(3) 坏账准备变动情况

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

(4) 结算备付金-外币结算备付金

项 目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
港币	6,644,523.61	0.9134	6,069,107.87
小 计			6,069,107.87

3. 融出资金

(1) 明细情况——按类别

项 目	期末数
孖展融资	42,305,165.46
减：减值准备	2,115,258.27
合 计	40,189,907.19

(2) 明细情况——按客户

项 目	期末数
个人	32,004,680.10
机构	10,300,485.36
减：减值准备	2,115,258.27
合 计	40,189,907.19

(3) 融出资金-外币融出资金

项 目	外币余额	折算汇率	折算成人民币余额
美元	235,072.19	7.0795	1,664,193.57
港币	217,235,205.73	0.9134	198,422,636.91
小 计			200,086,830.48

4. 应收货币保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	11,342,645,743.82	100.00	16,983,814.56	0.15	11,325,661,929.26
合 计	11,342,645,743.82	100.00	16,983,814.56	0.15	11,325,661,929.26

种 类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	8,651,499,982.10	100.00	17,033,680.29	0.20	8,634,466,301.81
合 计	8,651,499,982.10	100.00	17,033,680.29	0.20	8,634,466,301.81

2) 采用组合计提坏账准备的应收货币保证金

项 目	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收交易所和商业银行组合	11,002,969,452.69		
其他组合	339,676,291.13	16,983,814.56	5.00
小 计	11,342,645,743.82	16,983,814.56	0.15

(2) 明细情况——按交易所/清算商

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	3,597,636,324.04	2,528,008,697.31
大连商品交易所	2,851,763,069.36	2,675,622,555.31
郑州商品交易所	1,194,736,420.73	1,047,969,608.94
中国金融期货交易所	2,548,869,476.49	1,491,710,748.42
上海国际能源交易中心	278,249,745.06	119,861,077.47
中国证券登记结算有限责任公司	344,143,319.64	229,296,611.54
香港期货交易所	180,607,087.44	194,148,336.83
G. H. FINANCIALS (HONG KONG) LIMITED	120,611,578.84	117,993,058.82
MAREX FINANCIAL Ltd	71,599,398.20	124,041,106.97
Philip Futures Pte Ltd	100,755,176.17	54,319,346.17
R. J. O' Brien & Associates	35,675,599.28	37,434,080.54
Nissan Securities Co., Ltd	2,701,090.81	2,505,054.99
Hyundai Futures Corporaiong	166,090.73	168,094.90
KGI ONG CAPITAL PTE. Ltd	16,889.91	16,618.80
Asia Pacific Exchange	304,399.43	
ADMIS SINGAPORE PTE LTD BANKING INSTRUCTION	8,150,467.19	4,196,244.76
DBS Bank Ltd	6,148,091.64	3,451,249.07
其他	511,518.86	20,757,491.26
减：坏账准备	16,983,814.56	17,033,680.29
合 计	11,325,661,929.26	8,634,466,301.81

5. 应收质押保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	621,717,032.00	100.00			621,717,032.00
合 计	621,717,032.00	100.00			621,717,032.00

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 (%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	453,138,812.00	100.00			453,138,812.00
合 计	453,138,812.00	100.00			453,138,812.00

2) 采用组合计提坏账准备的应收质押保证金

项 目	期末数		
	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	621,717,032.00		
小 计	621,717,032.00		

(2) 明细情况——分交易所

交易所名称	期末数	期初数
上海期货交易所	184,389,160.00	188,878,648.00
大连商品交易所		11,770,000.00
郑州商品交易所	129,312,000.00	93,760,404.00
上海国际能源交易中心		158,729,760.00
中国金融期货交易所	308,015,872.00	
合 计	621,717,032.00	453,138,812.00

(3) 质押物明细情况

质押物类别	折扣率	期末市值
白银	80.00%	78,570,000.00
镍	80.00%	21,365,760.00
漂针浆	80.00%	87,544,440.00
铜	80.00%	43,006,250.00

棉花一号	80.00%	161,640,000.00
国债10年期	80.00%	283,043,340.00
国债2年期	80.00%	101,976,500.00
合计		777,146,290.00

6. 存出保证金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	876,773.21	100.00	34,880.66	3.98	841,892.55
合计	876,773.21	100.00	34,880.66	3.98	841,892.55

2) 采用组合计提坏账准备的存出保证金

项目	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
应收交易所和商业银行组合	179,160.00		
其他组合	697,613.21	34,880.66	5.00
小计	876,773.21	34,880.66	3.98

按组合计提坏账的确认标准及说明：以款项性质区分存出保证金组合。

用于确定本期坏账准备计提金额以及评估信用风险自初始确认后是否已显著增加等事项的所采用的输入值、假设等信息说明：本公司存出保证金不存在重大融资成分，均按照未来12个月的预期信用损失计量损失准备。

7. 应收账款

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按组合计提坏账准备	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09
其中：应收佣金	15,614,020.73	57.39	1,752,466.75	11.22	13,861,553.98

应收货款	11,593,228.54	42.61	579,661.43	5.00	11,013,567.11
合 计	27,207,249.27	100.00	2,332,128.18	8.57	24,875,121.09

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(%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	3,567,197.26	100.00	570,083.27	15.98	2,997,113.99
其中：应收佣金	2,881,396.46	80.77	535,793.23	18.59	2,345,603.23
应收货款	685,800.80	19.23	34,290.04	5.00	651,510.76
合 计	3,567,197.26	100.00	570,083.27	15.98	2,997,113.99

2) 采用组合计提坏账准备的应收账款

账 龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1 年以内	25,961,665.93	1,298,083.30	5.00
1-2 年			
2-3 年	107,692.28	32,307.68	30.00
3-4 年	226,923.10	90,769.24	40.00
4 年以上	910,967.96	910,967.96	100.00
小 计	27,207,249.27	2,332,128.18	8.57

(续上表)

账 龄	期初数		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
1 年以内	2,321,613.92	116,080.70	5.00
1-2 年	107,692.28	21,538.46	20.00
2-3 年	226,923.10	68,076.93	30.00
3-4 年	910,967.96	364,387.18	40.00
4 年以上			
小 计	3,567,197.26	570,083.27	15.98

(2) 坏账准备变动情况

1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加			本期减少			期末数
		计提	收回	其他	转回	核销	其他	
按组合计提坏账准	570,083.27	1,762,044.91						2,332,128.18

备								
小 计	570,083.27	1,762,044.91						2,332,128.18

(3) 应收账款金额前 5 名情况

单位名称	账面余额	占应收账款余额的比例 (%)	坏账准备
客户 a	5,688,702.27	20.91	284,435.11
客户 b	3,963,041.92	14.57	198,152.10
客户 c	3,436,446.02	12.63	171,822.30
客户 d	2,149,870.47	7.90	107,493.52
客户 e	1,987,269.98	7.30	99,363.50
小 计	17,225,330.66	63.31	861,266.53

8. 应收款项融资

(1) 明细情况

项 目	期末数					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	减值准备
应收票据	1,793,095.85				1,793,095.85	
合 计	1,793,095.85				1,793,095.85	

(2) 公司已背书或贴现且在资产负债表日尚未到期的应收票据情况

项 目	期末终止确认金额
银行承兑汇票	43,622,024.38
小 计	43,622,024.38

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

9. 预付款项

(1) 账龄分析

1) 明细情况

账 龄	期末数				期初数			
	账面余额	比例 (%)	减值准备	账面价值	账面余额	比例 (%)	减值准备	账面价值
1 年以 内	298,483,701.06	98.82		298,483,701.06	176,567,742.44	99.99		176,567,742.44

1-2 年	3,546,949.12	1.17		3,546,949.12	17,401.60	0.01		17,401.60
2-3 年	9,401.60	0.01		9,401.60				
合 计	302,040,051.78	100.00		302,040,051.78	176,585,144.04	100.00		176,585,144.04

(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 (%)
中国诚通国际贸易有限公司	15,704,705.86	5.20
上海建发物资有限公司	15,128,113.79	5.01
浙江特产石化有限公司	13,308,377.21	4.41
金光食品(宁波)有限公司	12,008,000.00	3.98
山东鲁泰化学有限公司	10,161,759.32	3.36
小 计	66,310,956.18	21.96

(3) 期末应收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
鞍钢永安商品贸易有限公司	1,440,757.90		1 年以内	货款
小 计	1,440,757.90			

10. 应收结算担保金

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按组合计提坏账准备	34,593,853.25	100.00			34,593,853.25
合 计	34,593,853.25	100.00			34,593,853.25

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 (%)	
按信用风险特征组合计提坏账准备	25,513,880.92	100.00			25,513,880.92
合 计	25,513,880.92	100.00			25,513,880.92

2) 采用组合计提坏账准备的应收结算担保金

① 2019 年 12 月 31 日

项 目	期末数		
	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	34,593,853.25		
小 计	34,593,853.25		

② 2018年12月31日

组合中，采用其他方法计提坏账准备的应收结算担保金

项 目	期初数		
	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	25,513,880.92		
小 计	25,513,880.92		

(2) 明细情况——分客商

交易所名称	期末数	期初数
中国金融期货交易所	20,312,096.04	20,113,880.92
中国证券登记结算有限责任公司	10,800,000.00	5,400,000.00
Asia Pacific Exchange	3,481,757.21	
合 计	34,593,853.25	25,513,880.92

11. 应收风险损失款

(1) 账龄分析

账 龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内				
1-2年				
2-3年	17,004.09	100.00		17,004.09
合 计	17,004.09	100.00		17,004.09

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内				
1-2年	17,004.09	27.28		17,004.09
2-3年	45,318.40	72.72		45,318.40
合 计	62,322.49	100.00		62,322.49

(2) 应收风险损失款金额前5名情况

单位名称	期末数

客户 f	9,240.28
客户 g	6,848.75
客户 h	915.06
小 计	17,004.09

12. 其他应收款

(1) 明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	50,153,408.74	49.95	3,229,194.47	6.44	46,924,214.27
其中：其他应收款	50,153,408.74	49.95	3,229,194.47	6.44	46,924,214.27
按组合计提坏账准备	50,263,403.59	50.05	8,869,941.91	17.65	41,393,461.68
其中：应收利息	1,905,396.09	1.90			1,905,396.09
应收股利	14,558.23	0.01			14,558.23
其他应收款	48,343,449.27	48.14	8,869,941.91	18.35	39,473,507.36
合 计	100,416,812.33	100.00	12,099,136.38	12.05	88,317,675.95

种 类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
应收利息	13,877,742.52	13.13			13,877,742.52
应收股利	3,209.07				3,209.07
其他应收款	91,836,814.52	86.87	12,229,844.15	13.32	79,606,970.37
单项金额重大并单项 计提坏账准备	33,508,301.60	31.70	686,415.08	2.05	32,821,886.52
按信用风险特征组合 计提坏账准备	45,223,920.41	42.78	9,020,380.78	19.95	36,203,539.63
单项金额不重大但单 项计提坏账准备	13,104,592.51	12.39	2,523,048.29	19.25	10,581,544.22
合 计	105,717,766.11	100.00	12,229,844.15	11.57	93,487,921.96

2) 单项计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由

其他应收款				
客户 i	13,952,264.16	697,613.21	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
七禾言起 1 号资产管理计划	12,772,869.90			理财产品清算款
客户 j	10,631,625.29	531,581.26	5.00	该客户以在本公司享有的权益为担保
境外证券业务清算及认购款	5,489,773.29			证券业务清算款
千象全景 19 号私募证券投资基金	5,306,876.10			理财产品清算款
文胜	2,000,000.00	2,000,000.00	100.00	预计无法收回
小 计	50,153,408.74	3,229,194.47	6.44	

3) 采用组合计提坏账准备的其他应收款

账 龄	期末数		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
应收利息组合	1,905,396.09		
应收股利组合	14,558.23		
其他应收款账龄组合	48,343,449.27	8,869,941.91	18.35
其中：1 年以内	31,416,553.63	1,570,592.73	5.00
1-2 年	2,790,795.28	558,159.07	20.00
2-3 年	1,810,696.07	543,208.83	30.00
3-4 年	10,212,371.69	4,084,948.68	40.00
4 年以上	2,113,032.60	2,113,032.60	100.00
小 计	50,263,403.59	8,869,941.91	17.65

(2) 账龄情况

项 目	期末数账面余额
1 年以内	56,906,027.24
1-2 年	13,422,420.57
2-3 年	15,762,960.23
3-4 年	10,212,371.69
4 年以上	4,113,032.60
小 计	100,416,812.33

(3) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合 计

	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失(未发 生信用减值)	整个存续期预 期信用损失(已 发生信用减值)	
期初数	2,452,198.22	677,142.09	9,100,503.84	12,229,844.15
期初数在本期				
--转入第二阶段	-139,539.77	139,539.77		
--转入第三阶段		-362,139.21	362,139.21	
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提	455,634.20	103,541.15	-721,452.94	-162,277.59
本期收回				
本期转回				
本期核销				
其他变动	31,494.55	75.27		31,569.82
期末数	2,799,787.20	558,159.07	8,741,190.11	12,099,136.38

(4) 其他应收款款项性质分类情况

款项性质	期末数	期初数
应收利息	1,905,396.09	13,877,742.52
应收股利	14,558.23	3,209.07
押金保证金	10,219,875.86	13,511,298.49
对外拆出款	35,551,987.03	41,489,315.34
理财产品认购、清算及分红款	18,079,746.00	20,423,626.69
境外证券业务清算及认购款	5,489,773.29	
场外业务应收款	24,636,602.08	11,675,974.19
其他	4,518,873.75	4,736,599.81
合计	100,416,812.33	105,717,766.11

(5) 应收股利明细情况

项目	期末数	期初数
其他零星股利	14,558.23	3,209.07
合计	14,558.23	3,209.07

(6) 其他应收款金额前 5 名情况

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余 额的比例(%)	坏账准备
------	------	------	----	--------------------	------

客户 i	对外拆出款	13,952,264.16	2-3 年	14.17	697,613.21
七禾言起 1 号资产管理计划	理财产品认购、清算及分红款	12,772,869.90	1 年以内	12.97	
OSTC Yongan Trading Co., Limited	对外拆借款	916,916.08	1 年以内	11.14	3,887,950.13
		891,841.38	1-2 年		
		9,159,340.12	3-4 年		
客户 j	对外拆借款	10,631,625.29	1-2 年	10.79	531,581.26
深圳市前海锐斯得金融投资有限公司	场外业务应收款	7,427,251.76	1 年以内	7.54	371,362.59
小 计		55,752,108.69		56.61	5,488,507.19

(7) 期末应收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
OSTC Yongan Trading Co., Limited	10,968,097.58	15,240,802.69	1-4 年	往来款及利息
小 计	10,968,097.58	15,240,802.69		

13. 存货

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	1,309,871,578.16	16,128,741.30	1,293,742,836.86
发出商品	246,943,848.05	15,341,261.60	231,602,586.45
在途物资	5,969,376.00		5,969,376.00
合 计	1,562,784,802.21	31,470,002.90	1,531,314,799.31

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	909,810,220.54	63,933,936.79	845,876,283.75
发出商品	127,622,692.26	14,587.23	127,608,105.03
在途物资			
合 计	1,037,432,912.80	63,948,524.02	973,484,388.78

(2) 期末存货账面余额中 179,520,522.30 元用于质押。

(3) 存货跌价准备

项目	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	转回或转销	其他	
存货	63,948,524.02	375,919,317.19		408,397,838.31		31,470,002.90
小计	63,948,524.02	375,919,317.19		408,397,838.31		31,470,002.90

14. 交易性金融资产

(1) 明细情况

项目	期末数	期初数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	4,130,938,590.83	2,889,231,564.30
其中：债务工具投资	20,301,792.54	
权益工具投资	4,025,967,544.94	2,844,843,700.76
衍生金融资产	84,669,253.35	44,387,863.54
合计	4,130,938,590.83	2,889,231,564.30

(2) 其他说明

在当日无负债结算制度下，本公司的期货合约每日结算，其产生的持仓损益金额已在本公司应收货币保证金以及利润表中体现，而并未反映在上述衍生金融工具科目中。期末，截至本期末，本公司持有的期货合约浮盈为 42,163,112.40 元，浮亏为 11,445,003.06 元。期初，本公司持有的期货合约的浮盈为 100,189,730.16 元，浮亏为 3,449,611.19 元。

15. 其他权益工具投资

项目	期末数			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	26,845,000.00	26,845,000.00		预计不会在可预见的将来出售，属于非交易性权益工具投资
合计	26,845,000.00	26,845,000.00		

(续上表)

项目	期初数			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股权投资	27,540,000.00	27,540,000.00		预计不会在可预见的将来出售，属于非交易性权益工具投资
合计	27,540,000.00	27,540,000.00		

16. 长期股权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	486,824,372.27		486,824,372.27
合 计	486,824,372.27		486,824,372.27

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	326,610,079.92		326,610,079.92
合 计	326,610,079.92		326,610,079.92

(2) 对联营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整
玉皇山南公司	14,034,530.61			1,235,425.68	
永安国富公司	286,358,558.22			211,509,024.65	
OSTC Yongan Trading Co., Limited	1,165,547.68			2,175,280.10	-658,112.76
鞍钢商贸公司	25,051,443.41			-2,061,010.03	
合 计	326,610,079.92			212,858,720.40	-658,112.76

(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		
玉皇山南公司	610,236.87				15,880,193.16	
永安国富公司	203,447.84	52,800,000.00			445,271,030.71	
OSTC Yongan Trading Co., Limited					2,682,715.02	
鞍钢商贸公司					22,990,433.38	
合 计	813,684.71	52,800,000.00			486,824,372.27	

17. 期货会员资格投资

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
期货会员资格投资	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00
合 计	1,400,000.00		1,400,000.00	1,400,000.00		1,400,000.00

18. 投资性房地产

(1) 明细情况

账面原值

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	4,153,902.54	7,541,560.00		11,695,462.54
小计	4,153,902.54	7,541,560.00		11,695,462.54

累计折旧和累计摊销

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
房屋及建筑物	550,943.48	1,109,447.37		1,660,390.85
小计	550,943.48	1,109,447.37		1,660,390.85

账面价值

项目	期初数	期末数
房屋及建筑物	3,602,959.06	10,035,071.69
合计	3,602,959.06	10,035,071.69

(2) 期末无投资性房地产用于担保。

(3) 期末，未办妥产权证书的投资性房地产的情况说明如下：

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
福州中盛大厦7层701室	9,509,271.36	尚未办妥房产证及土地使用权证
沈阳财富中心23-5(部分)、23-6(部分)	525,800.33	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
小计	10,035,071.69	

19. 固定资产

(1) 明细情况

项目	房屋及建筑物	电子设备及其他	运输工具	合计
账面原值				
期初数	109,235,718.66	73,919,955.26	18,246,635.70	201,402,309.62
本期增加金额	144,034,554.39	4,874,658.31		148,909,212.70
购置	8,560,240.60	4,874,658.31		13,434,898.91
在建工程转入	135,474,313.79			135,474,313.79
本期减少金额	7,541,560.00	1,999,057.41	1,240,676.00	10,781,293.41
处置或报废		1,999,057.41	1,240,676.00	3,239,733.41
转入投资性房地产	7,541,560.00			7,541,560.00
外币报表折算差额		152,266.58	18,986.27	171,252.85
期末数	245,728,713.05	76,947,822.74	17,024,945.97	339,701,481.76

累计折旧				
期初数	31,070,786.06	53,925,218.76	13,802,480.72	98,798,485.54
本期增加金额	3,229,903.34	7,890,183.21	1,290,868.27	12,410,954.82
计提	3,229,903.34	7,890,183.21	1,290,868.27	12,410,954.82
本期减少金额	731,298.28	1,921,490.40	1,091,831.48	3,744,620.16
处置或报废		1,921,490.40	1,091,831.48	3,013,321.88
转入投资性房地 产	731,298.28			731,298.28
外币报表折算差额		92,264.69	13,646.37	105,911.06
期末数	33,569,391.12	59,986,176.26	14,015,163.88	107,570,731.26
账面价值				
期末账面价值	212,159,321.93	16,961,646.48	3,009,782.09	232,130,750.50
期初账面价值	78,164,932.60	19,994,736.50	4,444,154.98	102,603,824.08

(2) 未办妥产权证书的固定资产的情况

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
浙江协作大厦 6-8 楼	875,293.88	尚未办妥房产证及土地使用权证
福州中盛大厦 7 层 702 室	7,565,808.32	尚未办妥房产证及土地使用权证
郑州绿地中心 1 号楼 4205	8,491,056.73	尚未办妥房产证及土地使用权证
长春伟峰彩宇新城 2204、2205 号房屋	7,455,572.96	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
沈阳财富中心 B 座 23-1 至 23-7 号房	7,464,162.04	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
潍坊金融服务区 2 号楼 2701 至 2703、2705 至 2708 号房	3,225,119.39	已办妥房产证但未办妥土地使用权证
杭州财通双冠大厦	135,474,313.79	已办妥土地使用权证但未办妥房产证
小 计	170,551,327.11	

(3) 期末无固定资产用于担保。

20. 无形资产

(1) 明细情况

项 目	土地使用权	软件	合 计
账面原值			
期初数	261,915,921.72	40,364,517.14	302,280,438.86
本期增加金额		6,256,892.98	6,256,892.98
购置		6,256,892.98	6,256,892.98
本期减少金额		677,094.01	677,094.01

处置		677,094.01	677,094.01
外币报表折算差额		35,280.00	35,280.00
期末数	261,915,921.72	45,979,596.11	307,895,517.83
累计摊销			
期初数	30,363,236.88	30,697,911.54	61,061,148.42
本期增加金额	6,547,898.04	7,194,853.37	13,742,751.41
计提	6,547,898.04	7,194,853.37	13,742,751.41
本期减少金额		677,094.01	677,094.01
处置		677,094.01	677,094.01
外币报表折算差额		35,280.00	35,280.00
期末数	36,911,134.92	37,250,950.90	74,162,085.82
账面价值			
期末账面价值	225,004,786.80	8,728,645.21	233,733,432.01
期初账面价值	231,552,684.84	9,666,605.60	241,219,290.44

(2) 期末无无形资产用于担保。

21. 递延所得税资产、递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

项 目	期末数		期初数	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
尚未支付的职工薪酬	584,716,222.37	146,179,055.59	337,748,786.22	84,437,196.56
可供出售金融资产公允价值变动			100,333,370.93	25,083,342.73
存货跌价准备	31,470,002.90	7,867,500.72	63,012,538.92	15,753,134.73
预计负债			67,541,932.24	16,885,483.07
坏账准备	10,344,228.32	2,481,575.55	7,769,978.56	1,830,806.93
期货风险准备金	7,525,024.55	1,881,256.14	7,588,927.95	1,897,231.99
公允价值变动浮亏	140,487,141.56	35,023,534.83	4,661,410.45	1,165,352.61
应付期货投资者保障基金	633,661.80	158,415.45	516,461.46	129,115.37
合 计	775,176,281.50	193,591,338.28	589,173,406.73	147,181,663.99

(2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
公允价值变动浮盈	350,116,427.78	87,529,106.96	113,126,771.45	26,335,907.09
合 计	350,116,427.78	87,529,106.96	113,126,771.45	26,335,907.09

(3) 未确认递延所得税资产明细

项 目	期末数	期初数
可抵扣暂时性差异	11,857,903.77	10,183,210.80
可抵扣亏损	39,669,257.56	40,739,247.50
小 计	51,527,161.33	50,922,458.30

22. 其他资产

项 目	期末数	期初数
待抵扣增值税	159,917,978.67	105,461,604.70
在建工程[注]		87,245,315.29
长期待摊费用	9,454,316.78	14,308,002.80
待摊费用	19,951,814.80	19,646,119.30
买入返售金融资产	44,800,508.00	29,455,327.96
预缴所得税		10,704,697.50
其他	505,758.69	377,256.63
合 计	234,630,376.94	267,198,324.18

[注]2013年度，本公司与双冠控股集团有限公司、财通证券股份有限公司（以下简称财通证券公司）合作购买杭州翠苑单元 B1/B2-10-2 地块用于联建办公楼，三方出资比例分别为 30%、35%和 35%。本期该办公楼已完工转入固定资产

23. 短期借款

项 目	期末数	期初数
保证借款本金	557,485,874.00	428,000,000.00
保证借款应付利息	5,058,635.00	612,626.00
合 计	562,544,509.00	428,612,626.00

24. 代理买卖证券款

项 目	期末数
经纪业务	
其中：个人	32,759,036.99
机构	10,738,044.99
小 计	43,497,081.98
合 计	43,497,081.98

25. 应付货币保证金

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	109,870	7,961,489,413.71	101,399	6,617,150,433.04
法人	6,395	16,415,028,263.07	5,637	13,238,243,382.27
非结算客户	3	158,911,239.34	3	97,131,140.35
合 计	116,268	24,535,428,916.12	107,039	19,952,524,955.66

26. 应付质押保证金

(1) 明细情况——按客户类别

项 目	期末数		期初数	
	户数	账面余额	户数	账面余额
法人	11	434,089,168.00	10	225,137,938.00
合 计	11	434,089,168.00	10	225,137,938.00

(2) 明细情况——按交易所

交易所名称	期末数
上海期货交易所	78,658,896.00
郑州商品交易所	47,414,400.00
中国金融期货交易所	308,015,872.00
合 计	434,089,168.00

27. 交易性金融负债

项 目	期末数	期初数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	135,074,240.55	73,103,195.98
其中：衍生金融工具	135,074,240.55	73,103,195.98
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	1,648,141,578.57	983,448,863.57
其中：结构化主体其他投资者享有的权益	1,648,141,578.57	983,448,863.57
合 计	1,783,215,819.12	1,056,552,059.55

28. 期货风险准备金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
风险准备金	213,203,152.39	19,051,965.16	63,903.40	232,191,214.15

合 计	213,203,152.39	19,051,965.16	63,903.40	232,191,214.15
-----	----------------	---------------	-----------	----------------

(2) 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) 动用风险准备金的说明

本期动用期货风险准备金系用于弥补错单造成的客户损失。

29. 应付账款

项 目	期末数	期初数
货款	107,960,512.29	16,818,922.30
合 计	107,960,512.29	16,818,922.30

30. 预收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
预收货款	741,196,179.85	405,987,254.94
投资咨询费	373,054.92	1,004,166.79
合 计	741,569,234.77	406,991,421.73

(2) 预收关联方款项

关联方名称	期末数	期初数	款项性质
鞍钢商贸公司	7,518,337.58		预收货款
合 计	7,518,337.58		

31. 应付期货投资者保障基金

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期上缴	期末数
应付期货投资者保障基金	547,449.15	671,591.24	547,358.88	671,681.51
合 计	547,449.15	671,591.24	547,358.88	671,681.51

(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。

32. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	512,738,258.3 1	729,076,421.2 3	483,357,886.1 9	758,456,793.3 5
离职后福利—设定提存计划	21,807,041.64	54,333,381.47	50,665,304.90	25,475,118.21
辞退福利		180,000.00	180,000.00	
合 计	534,545,299.9 5	783,589,802.7 0	534,203,191.0 9	783,931,911.5 6

(2) 短期薪酬明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	488,425,020.8 6	644,884,540.7 7	402,985,374.4 1	730,324,187.2 2
职工福利费		14,925,377.40	14,925,377.40	
社会保险费	13,748,192.80	36,186,266.72	33,880,396.99	16,054,062.53
其中：医疗保险费	439,581.88	14,623,548.13	14,574,251.31	488,878.70
补充医疗保 险	13,250,000.00	19,161,018.00	16,911,018.00	15,500,000.00
工伤保险费	8,372.99	319,694.78	318,755.79	9,311.98
生育保险费	50,237.93	1,482,682.55	1,477,048.63	55,871.85
其 他		599,323.26	599,323.26	
住房公积金	681,482.00	23,019,682.25	22,968,742.25	732,422.00
工会经费和职工教育经 费	9,883,562.65	10,060,554.09	8,597,995.14	11,346,121.60
小 计	512,738,258.3 1	729,076,421.2 3	483,357,886.1 9	758,456,793.3 5

(3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	586,109.17	23,028,558.97	22,962,829.87	651,838.27
失业保险费	20,932.47	804,510.10	802,162.63	23,279.94
补充养老保险	21,200,000.00	30,500,312.40	26,900,312.40	24,800,000.00
小 计	21,807,041.64	54,333,381.47	50,665,304.90	25,475,118.21

33. 应交税费

项 目	期末数	期初数
-----	-----	-----

企业所得税	153,907,328.46	143,190,506.98
增值税	6,966,778.76	2,911.34
代扣代缴个人所得税	3,393,100.22	2,214,977.60
城市维护建设税	507,207.13	63,801.83
教育费附加	217,374.48	27,343.64
地方教育附加	144,916.30	18,121.08
印花税	214,884.03	219,813.20
代扣代缴税金	970,821.66	55,420.79
房产税	2,073,212.15	
土地使用税	28,540.00	
其他	139,588.32	
合 计	168,563,751.51	145,792,896.46

34. 其他应付款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付股利	157,200,000.00	157,200,000.00
其他应付款	296,701,480.21	304,227,679.45
合 计	453,901,480.21	461,427,679.45

(2) 应付股利

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

(3) 其他应付款

1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应付佣金	840,649.07	1,023,763.63
经营层风险金	10,544,154.91	8,415,804.41
交易所质押款	187,627,864.00	228,000,874.00
场外业务应付款	60,942,876.58	40,112,756.79
业务保证金		10,000,000.00
暂估工程款	24,446,598.04	
其 他	12,299,337.61	16,674,480.62

合 计	296,701,480.21	304,227,679.45
-----	----------------	----------------

2) 应付关联方款项

单位名称	期末数	期初数	账龄	款项性质
财通证券股份有限公司	624,564.08	768,009.80	1年以内	IB业务费
小 计	624,564.08	768,009.80		

3) 其他应付款金额前5名情况

单位名称	期末数	款项性质
上海期货交易所质押款	105,730,264.00	交易所质押款
郑州商品交易所质押款	81,897,600.00	交易所质押款
杭州财通双冠大厦建设项目部	24,446,598.04	暂估工程款
中信证券股份有限公司	16,420,000.00	场外业务应付款
上海芮广国际贸易有限公司	4,369,480.00	场外业务应付款
小 计	232,863,942.04	

4) 其他应付款——外币其他应付款

币种	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额
HKD	1,301,376.48	0.8958	1,165,773.05	2,932,861.51	0.8762	2,569,773.26
USD	103,778.15	6.9762	723,977.15	10,023.00	6.8632	68,789.85
SGD	41,860.02	5.1739	216,579.54	11,836.44	5.0062	59,255.59
小计			2,106,329.74			2,697,818.70

35. 预计负债

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
未决诉讼	445,737.05	435,984.37
合 计	445,737.05	435,984.37

(2) 其他说明

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

并就此事于 2017 年度计提了预计负债折合人民币 417,623.47 元，各期末余额的变化系外币报表折算。

36. 股本

(1) 明细情况

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

(2) 期末股东所持股份的质押或冻结情况

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

(3) 持股 10%（含 10%）以上的法人股东情况

股东单位名称	法定代表人	经营范围	行业类别	注册资本
财通证券公司	陆建强	发行主要从事证券经纪业务、投资银行业务、资产管理业务、证券自营业务、证券信用业务以及研究业务。	券商信托	35.89 亿元
产业基金公司	章启诚	实业投资，投资管理。	金融业	200 亿元
浙江东方金融控股集团股份有限公司	金朝萍	资产管理；实业投资、私募股权投资及投资管理；企业管理咨询；进出口贸易。	其他金融业	15.91 亿元
浙江省经济建设投资有限公司	麻亚峻	经济建设项目的投资、开发、经营，房地产的投资；金属材料，化工原料及产品（不含危险品），建筑材料，纺织原料，橡胶及制品，木材，胶合板，造纸原料，矿产品，机电设备的销售。	租赁和商务服务业	4.20 亿元
协作大厦公司	林瑛	实业投资，物业管理，自有房屋租赁，金属材料、木材、建筑材料、化工原料及产品（不含化学危险品和易制毒品）、橡胶材料及制品、纺织品及原料、五金交电、汽车配件、饲料、农副产品（不含食品）的销售。	房地产业	1.5 亿元

37. 资本公积

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	1,489,444,325.01			1,489,444,325.01
其他资本公积	11,424,605.14	813,684.71		12,238,289.85
合 计	1,500,868,930.15	813,684.71		1,501,682,614.86

(2) 本期变动情况

本期资本公积变动系公司对联营企业永安国富公司、玉皇山南公司除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他权益变动按持股比例计算应享有的份额 203,447.84

元、610,236.87元，计入其他资本公积。

38. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额	
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益
将重分类进损益的其他综合收益	17,870,359.84	22,058,464.07	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-1,220,053.50		
外币财务报表折算差额	19,090,413.34	22,058,464.07	
其他综合收益合计	17,870,359.84	22,058,464.07	

(续上表)

项 目	本期发生额			期末数
	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
将重分类进损益的其他综合收益		22,058,464.07		39,928,823.91
其中：权益法下可转损益的其他综合收益				-1,220,053.50
外币财务报表折算差额		22,058,464.07		41,148,877.41
其他综合收益合计		22,058,464.07		39,928,823.91

39. 盈余公积

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	296,991,371.55	101,179,341.84		398,170,713.39
合 计	296,991,371.55	101,179,341.84		398,170,713.39

(2) 盈余公积本期增减原因及依据说明

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

40. 一般风险准备

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期动用	期末数
一般风险准备	356,882,385.48	101,179,341.84		458,061,727.32
合 计	356,882,385.48	101,179,341.84		458,061,727.32

(2) 本期计提方法和比例说明

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

41. 未分配利润

(1) 明细情况

项 目	金 额	提取或分配比例
调整前上期末未分配利润	2,567,087,497.43	
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）	-52,167,182.06	
调整后期初未分配利润	2,514,920,315.37	
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,000,720,583.15	
减：提取法定盈余公积	101,179,341.84	母公司净利润的10%
提取一般风险准备	101,179,341.84	母公司净利润的10%
应付普通股股利	157,200,000.00	
期末未分配利润	3,156,082,214.84	

(2) 调整期初未分配利润明细

由于会计政策变更，影响期初未分配利润-52,167,182.06元。

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况—按服务类

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费净收入	139,313,381.01	166,793,726.93
交易所减收手续费收入	288,544,129.00	306,862,795.76
资产管理业务收入	35,929,709.16	10,183,394.38
投资咨询业务收入	2,912,778.01	6,291,242.47
基金销售业务收入	49,608,163.55	44,123,805.75
合 计	516,308,160.73	534,254,965.29

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

行政区域名称	本期数		上年同期数	
	营业部家数	手续费净收入金额	营业部家数	手续费净收入金额
杭州本部		414,657,754.85		408,597,416.54
香港特别行政区[注]		29,602,641.60		36,630,566.76
浙江省(不含杭州本部)	14	29,615,193.90	14	34,433,471.13
辽宁省	3	5,634,252.25	3	7,751,869.55

行政区域名称	本期数		上年同期数	
	营业部家数	手续费净收入金额	营业部家数	手续费净收入金额
山东省	7	6,266,056.95	7	6,752,045.11
北京市	1	2,640,590.21	1	6,157,751.60
广东省	2	4,100,024.44	2	5,497,894.73
上海市	1	4,610,797.07	1	5,270,181.37
福建省	2	2,080,165.93	2	3,273,304.53
河南省	1	1,969,212.09	1	2,659,104.89
江苏省	2	1,674,477.50	2	2,634,251.40
吉林省	1	2,763,956.17	1	2,630,775.63
天津市	1	1,856,158.61	1	2,340,012.16
重庆市	1	1,377,309.95	1	2,256,891.27
河北省	2	1,958,012.51	2	1,979,034.02
湖北省	1	1,270,965.82	1	1,757,746.53
四川省	1	1,658,874.84	1	1,450,867.18
湖南省	1	1,666,923.12	1	1,226,805.22
江西省	1	802,271.97	1	954,975.67
陕西省	1	102,520.95		
合计	43	516,308,160.73	42	534,254,965.29

[注]香港特别行政区营业部系指公司子公司新永安期货。

(3) 公司前5名客户的期货经纪手续费收入情况

客户名称	期货经纪手续费收入	占全部期货经纪手续费收入的比例(%)
客户1	3,959,209.16	2.84
客户2	2,470,091.10	1.77
客户3	1,733,496.84	1.24
客户4	1,630,312.29	1.17
客户5	1,505,799.28	1.08
合计	11,298,908.67	8.10

2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	618,496,985.72	639,545,275.16
其中：境内保证金利息收入	579,363,001.64	585,437,094.25
境外利息收入	30,901,144.79	27,248,295.02
境内其他利息收入	8,232,839.29	26,859,885.89
利息支出	66,191,398.31	69,856,839.65
利息净收入	552,305,587.41	569,688,435.51

3. 投资收益

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	212,858,720.40	153,509,885.56
金融工具持有期间的投资收益	150,205,699.14	---
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	150,205,699.14	---
处置金融工具取得的投资收益	559,268,469.75	---
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	559,268,469.75	---
持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益		8,306,722.37
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益	---	500,535,941.85
可供出售金融资产在持有期间的投资收益	---	348,394,784.51
处置可供出售金融资产取得的投资收益	---	-1,982,055.73
减：结构化主体其他投资者享有的收益	210,179,943.00	87,598,034.40
合 计	712,152,946.29	921,167,244.16

4. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数
与收益相关的政府补助[注]	7,725,687.60	3,824,232.17
代扣个人所得税手续费返还	197,268.81	1,156,100.07
合 计	7,922,956.41	4,980,332.24

[注]计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注六(四)1之说明

5. 公允价值变动收益

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产(以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)	508,615,042.62	48,364,618.50
其中:衍生金融工具产生的公允价值变动收益	-17,577,089.84	66,722,132.49
交易性金融负债(以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债)	-69,863,049.31	-2,031,721.98
其中:衍生金融工具产生的公允价值变动收益	-69,863,049.31	-2,031,721.98
合 计	438,751,993.31	46,332,896.52

(2) 其他说明

衍生工具之公允价值变动收益系持有的期货合约、期权以及远期待执行合同等的浮动盈亏。

6. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
销售货物收入	20,512,110,273.07	13,671,612,382.29
租赁收入	302,433.99	228,963.13
交易所课题费、活动费等收入	19,579,535.77	10,246,613.78
其 他	1,375,308.09	2,076,116.19
合 计	20,533,367,550.92	13,684,164,075.39

7. 资产处置收益

项 目	本期数	上年同期数
固定资产处置收益	33,289.61	347,653.10
合 计	33,289.61	347,653.10

8. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	1,908,370.02	1,439,339.91
教育费附加	817,872.77	616,740.15

地方教育附加	544,724.84	410,283.43
印花税	2,279,344.70	2,002,087.90
房产税	2,935,733.54	998,434.50
其他	78,762.26	99,635.00
合计	8,564,808.13	5,566,520.89

9. 业务及管理费

项目	本期数	上年同期数
职工薪酬	783,589,802.70	604,715,819.64
仓储费	56,174,612.22	40,148,976.46
租赁费	38,036,891.31	38,107,219.20
“保险+期货”业务费用	12,520,115.26	40,672,901.86
运输费	20,818,734.13	13,583,288.77
折旧费	12,410,954.82	13,823,115.39
通讯费	12,603,283.02	10,691,283.90
无形资产摊销	13,742,751.41	15,644,318.99
数据业务费	9,713,467.14	8,395,594.91
业务招待费	12,311,090.01	10,487,912.40
信息咨询费	9,753,732.17	5,535,933.68
差旅费	15,365,688.28	13,810,502.86
广告宣传费	10,081,041.34	7,518,318.88
其他	88,387,912.79	52,820,214.17
小计	1,095,510,076.60	875,955,401.11

10. 信用减值损失

项目	本期数
融出资金减值准备损失	2,115,258.27
坏账损失	1,242,551.28
存出保证金减值损失	34,880.66
结算备付金减值损失	6,992.99
应收货币保证金减值损失	-156,595.96
合计	3,243,087.24

11. 其他资产减值损失

项 目	本期数
存货跌价损失	354,745,444.10
合 计	354,745,444.10

12. 资产减值损失

项 目	上年同期数
坏账损失	122,063.31
存货跌价损失	268,204,748.78
应收货币保证金减值损失	1,695,073.98
合 计	270,021,886.07

13. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
销售货物成本	20,096,345,935.95	13,478,989,111.55
租赁成本	464,410.58	134,305.32
合 计	20,096,810,346.53	13,479,123,416.87

14. 营业外收入

项 目	本期数	上年同期数
合同违约及赔付收入	77,085,584.87	4,125,105.75
存货毁损违约金收入		20,104,866.85
非流动资产毁损报废利得	2,040.59	
其他	10,273.14	137,610.42
合 计	77,097,898.60	24,367,583.02

15. 营业外支出

项 目	本期数	上年同期数
非流动资产毁损报废损失	60,487.23	80,711.38
待执行亏损合同		16,399,892.24
残疾人就业保障基金	1,449,007.05	1,378,932.10
地方水利建设基金	5,063.84	6,215.35
捐赠支出	4,067,516.25	4,140,700.00

罚款及滞纳金	67,724.39	986,267.86
其他	82,500.01	168,395.51
合计	5,732,298.77	23,161,114.44

16. 所得税费用

(1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	235,540,731.75	283,507,427.90
递延所得税费用	14,787,856.92	-42,671,379.29
合计	250,328,588.67	240,836,048.61

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

项目	本期数	上年同期数
利润总额	1,251,049,171.82	1,113,033,385.76
按母公司适用税率计算的所得税费用	312,762,292.95	278,258,346.44
子公司适用不同税率的影响	-21,843,053.34	-3,514,590.80
调整以前期间所得税的影响	995,199.97	2,902,621.03
非应税收入的影响	-46,192,071.43	-44,367,778.77
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	3,414,120.74	1,263,392.24
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-729,945.28	-564,688.99
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	1,922,045.06	6,858,747.46
所得税费用	250,328,588.67	240,836,048.61

17. 其他综合收益的税后净额

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

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项目	本期数	上年同期数
交易所保证金净额		2,902,161,949.10
客户保证金净额	2,496,075,591.90	

违约金及保险赔付收入	77,085,484.87	24,229,972.60
其他现金流入	29,289,159.81	20,623,439.83
代理买卖证券收到的现金	43,497,081.98	
合 计	2,645,947,318.56	2,947,015,361.53

2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
交易所保证金净额	604,317,393.16	
客户保证金净额		3,884,879,842.47
保证金及定期存款增加	104,905,805.67	18,630,999.49
融出资金	42,305,165.46	
往来款净额	13,931,671.17	129,457,789.94
应收结算担保金和结算备付金增加	9,819,141.99	
其他现金流出	8,442,545.28	5,150,277.86
合 计	783,721,722.73	4,038,118,909.76

3. 收到其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
对外拆借款收回	50,445,501.69	6,907,526.53
合 计	50,445,501.69	6,907,526.53

4. 支付其他与投资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
对外拆出款支出	45,000,000.00	
合 计	45,000,000.00	

5. 收到其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
合并结构化主体收到的现金	454,512,772.00	767,247,408.30
借款保证金的减少		7,000,000.00
合计	454,512,772.00	774,247,408.30

6. 支付其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
借款保证金的增加	22,000,000.00	
合 计	22,000,000.00	

(四)政府补助

1. 与收益相关,且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项 目	金额	列报项目	说明
2018 年度企业扶持资金	3,600,000.00	其他收益	杭州市西湖区人民政府翠苑街道办事处街道税收补助款
政府考评奖励	3,319,700.00	其他收益	绍兴、台州、大连、辽宁等营业部政府考评奖
财政扶持资金	532,000.00	其他收益	上海自贸试验区保税区财政扶持资金
稳岗补贴	167,987.60	其他收益	对稳定就业企业给予失业保险金返还
房租装修补贴	80,000.00	其他收益	长沙市政府购房及房屋装修补贴款
企业扶持资金	26,000.00	其他收益	杭州市拱墅区人民政府米市巷街道办事处企业扶持资金
小 计	7,725,687.60		

2. 本期计入当期损益的政府补助金额合计为 7,725,687.60 元。

七、关联方关系及其交易

(一) 关联方认定标准说明

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

(二) 关联方关系

关联方名称	与本公司的关系
财通证券公司	第一大股东
永安国富公司	联营企业
浙江永安国富实业有限公司（以下简称国富实业公司）	永安国富公司之子公司
永富物产有限公司（以下简称永富物产公司）	永安国富公司之子公司
浙江省协作大厦有限公司（以下简称协作大厦公司）	股东
财通证券资产管理有限公司（以下简称财通资管公司）	财通证券公司之子公司

财通基金管理有限公司（以下简称财通基金公司）	财通证券公司之联营企业
OSTC Yongan Trading Co., Limited	永安商贸公司之联营企业
浙江永安投资咨询有限公司（以下简称永安咨询公司）	OSTC Yongan Trading Co., Limited 之子公司
玉皇山南公司	永安资本公司之联营企业
鞍钢商贸公司	永安资本公司之联营企业

(三) 关联交易情况

1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

(1) 明细情况

1) 采购商品和接受劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鞍钢商贸公司	货物	45,021,731.55	6,244,473.27
国富实业公司	货物	8,939,180.93	16,621,904.13
财通证券公司	IB 业务佣金	7,405,007.94	8,149,469.29
财通证券公司		78,113.21	

2) 出售商品和提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鞍钢商贸公司	货物	63,033,204.83	32,881,922.14
国富实业公司	货物	3,712,499.24	5,229,154.49
财通基金公司	投资咨询服务		45,789.14
永安国富公司	代销基金产品服务	15,179,831.86	13,105,724.70
玉皇山南公司	代销基金产品服务		16,337.96
财通基金公司	代销基金产品服务		38,781.17
敦和资管公司	代销基金产品服务		24,942.34

2. 关联方在本公司开设期货账户，从事期货交易，关联交易明细如下：

客户名称	期末数权益	本期手续费净收入
财通证券公司	91,353,316.99	19,353.03
国富实业公司	22,299,971.98	36,765.18
永富物产公司	4,808,589.45	178.35
协作大厦公司	20.82	
永安咨询公司	1,011.00	
鞍钢商贸公司	7,497,820.32	936.09

财通基金	2,011.00	
财通资管	15,533,269.92	3,739.11
永安国富	1,784,593,159.72	1,733,496.84
玉皇山南		9,354.01
小计	1,926,089,171.20	1,803,822.61

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计划、基金，明细情况如下：

证券名称	管理人	期末数 账面价值
永安国富-永富1号资产管理计划	永安国富公司	6,577,546.80
永安国富-永富3号私募基金	永安国富公司	938,401,261.96
永安国富-永富10号私募证券投资基金	永安国富公司	232,103,801.01
永安国富-FOF1号私募投资基金	永安国富公司	92,400,000.00
永安国富-稳健5号私募投资基金	永安国富公司	52,433,396.55
永安国富-稳健6号私募基金	永安国富公司	437,810,180.00
永安国富-永富12号私募基金	永安国富公司	6,039,100.00
永安国富-永富15号私募基金	永安国富公司	5,888,000.00
财通资管鑫管家货币B	财通资管公司	256,861,736.52
财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金A	财通资管公司	12,247,105.89
山南敦和私募资产配置基金	玉皇山南公司	10,020,000.00
小计		2,050,782,128.73

4. 关联方持有本公司作为管理人募集设立的资产管理计划，明细情况如下：

证券名称	持有人	期末数 持有份额
永利1号资产管理计划	财通证券公司	100,000,000.00
永利2号资产管理计划	财通证券公司	100,000,000.00
永利3号资产管理计划	财通证券公司	140,000,000.00
CTA联盟3号FOF集合资产管理计划	财通证券公司	15,000,787.50
永安期货工银量化恒盛精选A类25期	永安国富公司	18,797,443.76
永利1号资产管理计划		41,498,889.24

永利 2 号资产管理计划	本公司董监高及其关系密切的家庭成员、直接或间接控制本公司的法人的董监高	4,700,000.00
永利 3 号集合资产管理计划		17,100,000.00
永利 4 号集合资产管理计划		35,602,289.00
永安财富 CTA 联盟 2 号资产管理计划		5,500,000.00
行远集合资产管理计划		7,001,837.50

5. 在财通证券公司开户从事股票交易

(1) 本公司及子公司在财通证券公司开户从事股票交易，关联交易明细情况如下：

公司	期末数资金余额	本期证券交易费
本公司	688.27	
合计	688.27	

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

关联方	本期数	上年同期数
财通证券公司	1,375,948.27	724,107.28

6. 关联方资金拆借

(1) 拆出资金-OSTC Yongan Trading Co., Limited

永安商贸公司向 OSTC Yongan Trading Co., Limited 拆出资金 2,117,647.00 英镑，该公司已累计偿还 1,611,952.14 美元，剩余未偿还本金折合人民币为 9,159,340.12 元。永安商贸公司本期计提利息折合人民币为 916,916.08 元。

(2) 拆出资金-鞍钢商贸公司

本期，永安资本公司向鞍钢商贸公司拆出资金 45,000,000.00 元，并于当年全部收回，永安资本公司计提并收到利息 255,880.50 元。

7. 关键管理人员报酬

项 目	本期数
关键管理人员报酬	3,179.62 万元

8. 永安资本公司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
财通证券公司		-2,713,680.00
鞍钢商贸公司	1,020,257.00	2,246,883.70

9. 共同投资

(1) 2017 年，永安资本同浙江财通资本投资有限公司、宁波财通涌创投资管理有限公司共同投资了杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业(有限合伙)。其中永安资本投资 300 万

元，系有限合伙人；浙江财通资本投资有限公司投资 1,990 万元，系有限合伙人；宁波财通涌创投资管理有限公司投资 10 万元，系普通合伙人。截止 2020 年 6 月 30 日，永安资本持有 3%的合伙份额，浙江财通资本投资有限公司持有 30%的合伙份额，浙江绍兴源和投资管理有限公司持有 1%的合伙份额，虞兔良等 12 人持有 66%的合伙份额。

(2) 本公司与双冠控股集团有限公司、财通证券合作购买杭州翠苑单元 B1/B2-10-2 地块用于联建办公楼，三方出资比例分别为 30%、35%和 35%。2019 年该办公楼已完工转入固定资产。

10. 其他关联交易

2019 年度，财通证券代公司结算相关费用分别为 36,341.84 元。

八、与金融工具相关的风险

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

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

(一) 信用风险

公司期货业务可能存在的信用风险主要包括：

1. 客户在保证金不足时未及时追加保证金或者自行平仓而导致的保证金透支或穿仓的风险；

2. 客户在期货交易或交割中违约，导致公司须先行履约再向客户追偿，可能发生追偿不成的风险；

3. 存放在期货交易所的结算担保金由于其他结算会员无法履约而被承担连带结算担保责任的风险；

4. 存放在期货交易所的客户保证金或结算准备金不能提取的风险；

5. 存放在银行的客户保证金不能提取的风险；

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

7. 涉及实物交割的指定交割仓库不能履约的风险；

8. 基差业务中，交易对手不按合同约定履行其业务的风险；

9. 非标仓单不能够按照仓单所示内容提取货物的风险。

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

为控制该项风险，公司将制度建设视为内控机制的根基，已建立了各项治理制度、交易、

开户、结算及风控、财务、信息技术、金融期货业务、IB 业务、信息披露、合规(含反洗钱)等 7 大系列制度,以及营业部管理制度,明确决策、执行、监督等方面的职责权限,形成科学有效的职责分工制衡机制,结合业务特点和内部控制要求设置内部机构,明确职责权限,将权利与责任落实到各责任部门,同时确保了稽核督查总部机构设置、人员配备和工作的独立性。各业务部门、各分支机构在公司相应职能部门的指导下,严格按照内部控制要求执行,主动做好本部门、分支机构的风险管理工作,防范各类潜在风险。在基差贸易业务和场外衍生品业务中,建立完善的客户、仓储企业资信调查制度,对客户信用进行评定,有限选择信用等级较高的客户,避免选择信用等价较低的客户。(二) 流动风险

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

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

金融负债按剩余到期日分类

项 目	期末数				
	账面价值	未折现合同金额	1 年以内	1-3 年	3 年以上
银行借款	562,544,509.00	567,491,202.19	567,491,202.19		
代理买卖证券款	43,497,081.98	43,497,081.98	43,497,081.98		
应付货币保证金	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12	24,535,428,916.12		
应付质押保证金	434,089,168.00	434,089,168.00	434,089,168.00		
交易性金融负债	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12	1,783,215,819.12		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债					
应付账款	107,960,512.29	107,960,512.29	107,960,512.29		
其他应付款	453,901,480.21	453,901,480.21	453,901,480.21		
小 计	27,920,637,486.72	27,925,584,179.91	27,925,584,179.91		

(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	428,000,000.00	436,769,026.04	436,769,026.04		
代理买卖证券款					
应付货币保证金	19,952,524,955.66	19,952,524,955.66	19,952,524,955.66		
应付质押保证金	225,137,938.00	225,137,938.00	225,137,938.00		
交易性金融负债					
以公允价值计量且其变动计入当期损	988,122,622.02	988,122,622.02	988,122,622.02		

益的金融负债					
应付账款	16,818,922.30	16,818,922.30	16,818,922.30		
其他应付款	462,040,305.45	462,040,305.45	462,040,305.45		
小 计	22,072,644,743.43	22,081,413,769.47	22,081,413,769.47		

(三) 市场风险

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

1. 利率风险

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

截至 2020 年 6 月 30 日，本公司以浮动利率计息的银行借款人民币为 0 元(2019 年 12 月 31 日：人民币 0 元)，在其他变量不变的假设下，假定利率变动 50 个基准点，不会对本公司的利润总额和股东权益产生重大的影响。

2. 外汇风险

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

3. 价格风险

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

九、其他重要事项

(一) 承诺及或有事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的承诺及或有事项。

(二) 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，公司不存在需要披露的资产负债表日后事项。

(三) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

项 目	公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合 计
持续的公允价值计量				
1. 交易性金融资产和其他非流动金融资产	1, 214, 084, 682. 22	2, 959, 017, 021. 01		4, 173, 101, 703. 23
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1, 214, 084, 682. 22	2, 959, 017, 021. 01		4, 173, 101, 703. 23
债务工具投资	20, 301, 792. 54			20, 301, 792. 54
权益工具投资	1, 151, 619, 777. 28	2, 874, 347, 767. 66		4, 025, 967, 544. 94
衍生金融资产 [注]	42, 163, 112. 40	84, 669, 253. 35		126, 832, 365. 75
2. 其他权益工具投资			26, 845, 000. 00	26, 845, 000. 00
持续以公允价值计量的资产总额	1, 214, 084, 682. 22	2, 959, 017, 021. 01	26, 845, 000. 00	4, 199, 946, 703. 23
5. 交易性金融负债	13, 981, 178. 17	1, 780, 679, 644. 01		1, 794, 660, 822. 18
(1) 交易性金融负债	13, 981, 178. 17	132, 538, 065. 44		146, 519, 243. 61
衍生金融负债 [注]	13, 981, 178. 17	132, 538, 065. 44		146, 519, 243. 61
(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		1, 648, 141, 578. 57		1, 648, 141, 578. 57
结构化主体其他投资者享有的权益		1, 648, 141, 578. 57		1, 648, 141, 578. 57
持续以公允价值计量的负债总额	13, 981, 178. 17	1, 780, 679, 644. 01		1, 794, 660, 822. 18

[注] 衍生金融资产、衍生金融负债中含期货合约交易形成的浮盈或浮亏，相关说明见本财务报表附注六(一)14 交易性金融资产、15 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产之说明

说明：

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

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

3. 持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息：采用特定估值技术确定公允价值，采用的重要参数包括不能直接观察或无法由可观

察市场数据验证的股票波动率、使用自身数据作出的财务预测等。

(四) 2019 年期末, 公司股东浙江省经济建设投资有限公司将其持有公司的 2,654 万股股份出质。

十、母公司财务报表主要项目注释

(一) 母公司资产负债表项目注释

1. 长期股权投资

(1) 明细情况

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

(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	1,430,565,602.19		1,430,565,602.19
对联营、合营企业投资	286,358,558.22		286,358,558.22
合 计	1,716,924,160.41		1,716,924,160.41

(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
中邦实业公司	251,984,002.19			251,984,002.19		
永安资本公司	1,000,000,000.00			1,000,000,000.00		
新永安控股公司	178,581,600.00	300,408,500.00		478,990,100.00		
小 计	1,430,565,602.19	300,408,500.00		1,730,974,102.19		

(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
永安国富公司	286,358,558.22			211,509,024.65	
合 计	286,358,558.22			211,509,024.65	

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备期末余额
	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		

永安国富公 司	203,447.84	52,800,000.00			445,271,030.71	
合 计	203,447.84	52,800,000.00			445,271,030.71	

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费净收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
期货经纪手续费净收入	109,958,962.11	130,655,630.97
交易所减收手续费收入	271,080,341.10	297,249,660.75
期货投资咨询收入	2,754,433.76	5,811,067.36
资产管理业务收入	127,949,913.22	16,327,297.53
代销基金业务收入	49,608,163.55	44,123,805.75
合 计	561,351,813.74	494,167,462.36

(2) 分行政区域营业部及手续费收入情况

行政区域名称	本期数		上年同期数	
	营业部 家数	手续费收入净金 额	营业部 家数	手续费收入净金 额
杭州本部		489,304,049.46		405,140,480.37
浙江省(不含杭州本部)	14	29,615,193.90	14	34,433,471.13
辽宁省	3	5,634,252.25	3	7,751,869.55
山东省	7	6,266,056.95	7	6,752,045.11
北京市	1	2,640,590.21	1	6,157,751.60
广东省	2	4,100,024.44	2	5,497,894.73
上海市	1	4,610,797.07	1	5,270,181.37
福建省	2	2,080,165.93	2	3,273,304.53
河南省	1	1,969,212.09	1	2,659,104.89
江苏省	2	1,674,477.50	2	2,634,251.40
吉林省	1	2,763,956.17	1	2,630,775.63
天津市	1	1,856,158.61	1	2,340,012.16
重庆市	1	1,377,309.95	1	2,256,891.27
河北省	2	1,958,012.51	2	1,979,034.02

湖北省	1	1,270,965.82	1	1,757,746.53
四川省	1	1,658,874.84	1	1,450,867.18
湖南省	1	1,666,923.12	1	1,226,805.22
江西省	1	802,271.97	1	954,975.67
陕西省	1	102,520.95		
合计	43	561,351,813.74	42	494,167,462.36

2. 投资收益

项目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	211,509,024.65	150,359,762.64
成本法核算的长期股权投资收益	173,000,000.00	
金融工具持有期间的投资收益	159,896,764.37	
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	159,896,764.37	
处置金融工具取得的投资收益	16,604,015.41	
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	16,604,015.41	
可供出售金融资产在持有期间的投资收益		330,413,352.62
处置可供出售金融资产取得的投资收益		-3,037,976.73
合计	561,009,804.43	477,735,138.53

十一、其他补充资料

(一) 非经常性损益

项目	金额	说明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-25,157.03	
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	7,725,687.60	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	1,172,796.58	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-4,010,098.70	

小 计	4,863,228.45	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“－”表示）	1,154,800.34	
少数股东权益影响额（税后）		
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	3,708,428.11	

（二）净资产收益率及每股收益

1. 明细情况

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益(元/股)	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	15.37	0.76	0.76
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	15.32	0.76	0.76

2. 加权平均净资产收益率的计算过程

项 目	序号	本期数	
归属于公司普通股股东的净利润	A	1,000,720,583.15	
非经常性损益	B	3,708,428.11	
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	997,012,155.04	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	5,997,450,150.39	
发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	E		
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	F		
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	G	157,200,000.00	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	H		
其他	权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	I1	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	
	可供出售金融资产公允价值变动	I2	
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J2	
	外币报表折算差额变动	I3	22,141,676.07
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J3	6
	其他	I4	813,684.71
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J4	6
报告期月份数	K	12	

加权平均净资产	$L = \frac{D+A}{2} + \frac{E \times F}{K} - \frac{G \times H}{K} \pm \frac{I}{K} \times \frac{J}{K}$	6,509,288,122.36
加权平均净资产收益率	$M=A/L$	15.37%
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	$N=C/L$	15.32%

3. 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

(1) 基本每股收益的计算过程

项 目	序号	本期数	上年同期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	1,000,720,583.15	872,197,337.15
非经常性损益	B	3,708,428.11	682,991.07
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	997,012,155.04	871,514,346.08
期初股份总数	D	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E		
发行新股或债转股等增加股份数	F		
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G		
因回购等减少股份数	H		
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I		
报告期缩股数	J		
报告期月份数	K	12	12
发行在外的普通股加权平均数	$L = \frac{D+E+F \times G}{K} - \frac{H \times I}{K} - J$	1,310,000,000.00	1,310,000,000.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.76	0.67
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.76	0.67

(2) 稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

永安期货股份有限公司

2020年12月9日

附：

备查文件目录

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

（二）载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。

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

文件备置地址：

杭州市新业路 200 号华峰国际商务大厦 22 楼