



广州期货

NEEQ : 870367

广州期货股份有限公司

GUANGZHOU FUTURES CO.,LTD.



半年度报告

— 2020 —

公司半年度大事记

助力抗疫脱贫双战双赢，持续推进期货服务实体有序开展

2020年新冠疫情在全球范围传播，全球资本市场陷入震荡，企业面临复工难、复产难等多重挑战。为充分发挥期货市场风险管理职能，履行金融企业责任担当，公司在全面落实防疫任务的同时，为助力企业复工复产，加大了金融扶贫力度。

秉承期货服务“三农”原则，2020年上半年，公司在甘肃天水市及云南西盟佤族自治县分别开展了苹果及橡胶“保险+期货”项目，惠及农户9321户，提供风险保障超2020万元，有效增强了农业企业运用现代金融工具抵抗经营风险的能力。

创新营销模式，积极推广线上服务，多举措提升客户服务质量

公司积极应对疫情影响，充分发挥线上服务功能开展网上营销服务，推出《闻声如面，声入人心》等系列报告会42场，服务客户2.4万余人次，服务模式创新效果显现。

同时，在多个财经直播平台针对农产品、有色金属、能源化工和金融板块举办疫情分析专题线上报告会共11场，总参与人数超过3500人次，及时向客户提示各品种短期风险，帮助投资者理性看待市场。

充分发挥期货风险管理功能，排解疫情期间企业经营风险

2020年2月，期货市场恢复交易后各品种均出现剧烈价格波动，广州期货立足品种产业链，利用期货衍生品工具，借助互联网的线上渠道，为客户提供风险管理服务，帮助其最大程度实现资产保值，化解疫情期间企业经营风险。广州期货通过套期保值帮助化工贸易商成功规避PVC价格的波动风险，实现稳定经营；迅速调整服务方式，为多家玻璃生产商提供远程服务，提出多项有效建议，成功锁定企业采购成本，排解复工生产的后顾之忧。

四川、广东金融高新区、湖北三地分公司开业

2020年1月2日，广州期货股份有限公司四川分公司正式开业。

2020年1月7日，广州期货股份有限公司广东金融高新区分公司正式开业。

2020年1月7日，广州期货股份有限公司湖北分公司正式开业。

分公司是实现在不同重要战略发展区域拓展并深耕业务的关键载体，分公司将进一步丰富服务体系，积极拓展新型业务布局，为广大投资者提供更多、更全面、更广泛、更具价值的期货投资服务。

目 录

第一节	重要提示、目录和释义	1
第二节	公司概况	8
第三节	会计数据和经营情况	10
第四节	重大事件	23
第五节	股份变动和融资	26
第六节	董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况	29
第七节	财务会计报告	34
第八节	备查文件目录	90

第一节 重要提示、目录和释义

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

公司负责人严若中、主管会计工作负责人严若中及会计机构负责人（会计主管人员）吴超雄保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本半年度报告未经会计师事务所审计。

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

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

【重大风险提示表】

重大风险事项名称	重大风险事项简要描述
1.宏观经济变动风险	<p>我国期货公司的收入主要来源于资本市场，期货公司的经营管理和业务发展受到我国资本市场固有风险的影响，例如市场价格波动、整体投资氛围、品种变化、交易量波动、流动资金供应和期货行业信用状况等。此外，期货公司的经营管理和业务发展亦受到宏观经济和社会政治环境的影响，例如货币政策、财政和税收政策、外汇政策和汇率波动、资金成本和利率波动、商业和金融业走势、通货膨胀、资金来源、法律法规和社会政治稳定等因素。上半年受新型冠状病毒疫情在全球蔓延影响，宏观经济陷入低迷。若资本市场持续受疫情及宏观经济影响处于较长时间的景气周期，则会对公司的盈利情况造成不利影响。</p> <p>应对措施：公司密切关注宏观经济指标和趋势、重大经济政策动向、重大市场行动等，加深对内外部经济环境解析，准确研判政策变化，并主动适应经济发展新常态。同时，公司将大力发展创新业务，进一步优化业务结构，保障公司盈利能力。</p>
2.行业竞争风险	<p>目前，我国期货行业格局呈现出具有强大股东背景的券商系大型期货公司与具有区域优势的传统中小型期货公司共存的局面，市场竞争日益激烈。与此同时，商</p>

	<p>业银行及其他非银行金融机构存在向期货公司传统业务领域不断渗透的趋势。随着我国期货市场对外开放的力度不断加大，监管机构对于外资公司进入期货行业的监管政策逐渐放开，外资将不断进入期货市场，使得国内期货公司在人才、产品创新以及大客户资源等方面面临更为激烈的竞争。</p> <p>应对措施：公司不断优化与提升客户服务，通过特色化和差异化的经营模式，持续提升各项业务的服务水平及专业能力，强化公司核心竞争力，为客户提供更优质的产品与服务。</p>
<p>3.期货、期权经纪业务风险</p>	<p>公司的期货、期权经纪业务主要收入来源为手续费收入，其主要影响因素为交易量和手续费率等因素。公司近年来通过积极开拓创新业务，努力拓展收入增长点，但经纪业务收入仍然是公司营业收入的主要构成。传统经纪业务受资本市场走势影响较大，如果受通货膨胀加剧、货币政策紧缩和经济增速放缓等不利因素影响，资本市场将会走低，交易活跃度将降低，交易量亦会萎缩，会影响期货公司经纪业务收入。同时，公司经纪业务面临激烈的行业竞争，经纪业务手续费率持续下滑，使公司期货、期权经纪业务面临着竞争及盈利能力下降的风险。</p> <p>应对措施：公司将加大市场开发及拓展力度，在巩固现有期货、期权经纪业务规模的基础上，通过加大投研与技术投入、提升公司客户服务能力的手段，提升经纪业务规模；通过维护合理的经纪业务手续费率、充分挖掘产业客户以及机构投资者的需求，提供个性化定制服务，持续完善客户机构；此外，公司将着力开拓创新业务，拓展盈利增长点，降低经纪业务风险对公司经营的影响。</p>
<p>4.资产管理业务风险</p>	<p>资产管理业务为近年来期货行业市场创新后的增量业务之一。随着 2018 年 4 月《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》落地，资产管理业务统一监管的基调已经明确。2018 年 10 月《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及配套管理规定实施，期货资产管理业务投资范围进一步受限，投资者准入门槛进一步提高，管理规模将受到影响。</p> <p>应对措施：公司将不断优化期货资产管理业务风险管理工作，持续关注监管动态，严格按照监管要求推动资管业务合规整改工作，及时调整业务及客户结构；加大投研团队的建设力度，确立以自主管理业务为方向，回归期货资产管理业务本源。</p>
<p>5.业务创新风险</p>	<p>2019 年 2 月《期货公司风险管理公司业务试点指引》正式实施，对期货公司设立子公司开展风险管理业务作出进一步规范。公司将大力推进风险管理子公司广期</p>

	<p>资本管理（深圳）有限公司的业务发展，实现业务创新、服务实体经济的重要战略。目前公司风险管理子公司主要开展仓单服务、场外衍生品以及基差贸易业务。公司的各项试点业务开展过程中可能面临如客户的信用风险、质押率不足风险、质押物品质和变现风险、仓储风险等，以及其他不可预料的风险或损失。</p> <p>应对措施：公司将重点加强对创新业务的研究、评估，建立健全各项风险识别、风险控制机制。公司也会借助公司长期在期货市场积累的风险管理经验运用在创新业务上，提高公司在创新产品及业务方面的风险认知及管理能力。</p>
<p>6.盈利模式变动风险</p>	<p>随着国家对期货市场战略定位持续转型，期货公司监督管理体系逐步健全，各期货公司的盈利模式将发生转变。以往依赖经纪业务的传统模式将逐步被打破，期货资产管理业务随着监管力度不断加大，未来发展存在较大不确定性。因此随着公司风险管理子公司等创新业务的进一步发展，公司盈利模式及业务发展重心可能在未来发生变动，以服务实体经济为核心的多元化创新业务将成为公司盈利重点。</p> <p>应对措施：公司将在进一步推动期货、期权经纪业务发展的同时，重点提升风险管理业务的盈利能力，减少对单一业务的依赖，力争将风险管理业务打造成新的利润贡献点，进一步向多元化业务及盈利模式转型。</p>
<p>7.资产结构、财务结构变动风险</p>	<p>公司所处金融业中的期货行业，其日常运转所需的净资本和资金需求较高，如果由于公司资产负债率控制不当或各类资产配置不合理导致资本结构、财务结构不合理，可能对公司的财务风险控制和日常经营产生较大影响。</p> <p>应对措施：公司持续监控各项关键财务及风险指标，合理预测资金需要，提前调配资金，确保净资本等指标符合监管要求。适时通过借入次级债、增资扩股等方式提高公司资本充足率，提高公司资本实力，保证公司资本结构、财务结构合理，高效支持业务稳健发展。</p>
<p>8.风险管理和内部控制有效性不足的风险</p>	<p>公司建立了全面的风险管理制度，明确了董事会、管理层及各个部门、各个岗位的风险管理职责，将风险管理及控制活动覆盖到公司的各个部门、各个层级和经营管理的各个环节。但由于公司业务处于动态发展的环境中，用以识别、监控风险的模型、数据、信息难以确保准确和完整，管理风险的政策和程序也存在失效和无法预见所有风险的可能，且任何内控管理措施都可能因其自身的变化、内部治理结构及外界环境的变化、风险管理资源配置与业务规模不匹配、风险管理当事者对某项事务的认识不够和对现有制度执行不严格、员工行为不当等原因导致风险。如果</p>

	<p>不能有效控制上述风险可能会对公司的业务造成重大不利影响或损失。</p> <p>应对措施：公司将贯彻落实股东全面风险管理要求，明确各风险管理层级的职责，将风险管理及内部控制活动覆盖到公司各经营管理环节，保障风险管理和内部控制体系的有效执行。</p>
<p>9.信用风险</p>	<p>随着公司风险管理子公司业务的不断发展，在仓单服务、基差贸易方面将面临较大的信用风险，主要体现为仓单服务客户未按合同约定交付现货/仓单或未按合同约定期限回购质押现货/仓单，从而造成公司经济损失或变现困难的风险；或是基差交易业务现货供应商未按约定交付现货造成经济损失的风险。若因经济环境持续下行，市场流动性短缺，信用风险发生的可能性将进一步加大。</p> <p>应对措施：公司已根据各项业务的实际情况建立管理制度，明确各项业务的决策、执行、监督等方面的职责权限，将权利与责任落实到各责任部门。对风险管理子公司业务，公司建立了完善的客户、仓储及现货供应商资信调查制度，对客户、供应商的信用状况进行评定，选择资信情况较高的客户及供应商开展业务。</p>
<p>10.信息技术治理风险</p>	<p>公司信息技术系统的稳定有效运行受到电信运营商、交易所、托管银行和其他金融机构的信息技术系统运行情况的影响。公司期货交易、客户服务、风险管理、办公系统、财务监控、总部与分支机构之间的通信等环节的正常运转均依靠信息技术系统作为支撑。目前公司使用的信息技术产品和服务来自多家第三方开发商、承包商和供应商，如果公司未能对其实施有效管理，将可能导致信息技术系统故障或者缺陷，软件或技术平台不兼容，系统与平台的同步、数据传输和管理等产生问题。</p> <p>应对措施：公司将持续加大对信息技术治理的投入，加强机房、系统建设，为各项业务提供保障与支撑。公司已建立完整的信息技术管理及风险防控制度，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。</p>
<p>11.人才流失的风险</p>	<p>期货行业的竞争关键在于人才的竞争，期货公司业务的顺利开展需要大量高素质专业人才。公司在发展和壮大过程中培养了众多优秀专业人才，为公司发展做出了巨大的贡献。随着我国期货行业的快速发展，各类市场主体对优秀人才的需求不断增加，优秀专业人才已成为稀缺资源，公司面临着来自证券、基金、银行、信托、保险等行业机构对优秀专业人才的竞争。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不利影响。</p> <p>应对措施：公司坚持以自主培养与市场化引进相结合的人才管理机制，通过制</p>

定实施可持续发展的人力资源政策、考核与激励体系，保持公司优秀管理人员和专业人才的规模，以满足公司发展需求。

12.监管政策及合规风险

国家关于期货行业的相关法律、法规和监管政策逐步规范，并随着期货市场的发展而不断调整、完善。法律、法规、规章和其他规范性文件的变化可能会影响期货业的经营模式和竞争方式，使得公司各项业务发展存在一定的不确定性。

应对措施：公司密切关注行业监管政策变化，及时落实各项监管政策要求，定期开展公司内部稽核及合规检查，积极配合监管检查。同时有效履行定期及临时报告义务，根据市场环境持续优化各项内部控制制度，保证公司合法合规经营。

公司、子公司、分支机构的经营场所均系租赁使用，若发生租赁合同到期无法续租或其他原因导致经营场所变更情形的，会对公司日常经营产生一定影响。

应对措施：公司每年会对所有经营场所的租赁合同进行盘点，如存在当年度到期的情形，会安排相关部门提前做好续签或迁址的准备工作；公司、子公司及分支机构变更经营场所时，会及时按照法律法规要求向相关监管部门报告，做好信息公示及报备工作，切实避免对公司日常经营产生影响。

13.经营场所变更产生的风险

名称	租赁到期日
总部	2021年12月31日
广期资本	2021年2月3日
成都营业部	2023年3月12日
佛山南海营业部	2024年10月7日
清远营业部	2021年9月28日
上海陆家嘴营业部	2021年6月14日
北京分公司	2020年12月31日
深圳营业部	2023年1月11日
武汉营业部	2022年8月7日
长沙营业部	2021年6月30日
杭州营业部	2020年11月30日
东莞营业部	2021年8月31日
广州体育中心营业部	2021年9月18日
杭州城星路营业部	2020年10月9日
天津营业部	2022年10月31日
郑州营业部	2022年12月24日
厦门营业部	2023年5月31日
苏州营业部	2020年9月30日

		山东分公司	2022年11月30日
		肇庆营业部	2022年12月31日
		重庆营业部	2021年9月5日
		青岛分公司	2023年11月5日
		四川分公司	2022年10月31日
		广东金融高新区分公司	2024年10月7日
		湖北分公司	2024年10月9日
本期重大风险是否发生重大变化:	否		

是否存在被调出创新层的风险

是 否 不适用

释义

释义项目		释义
公司、本公司、广州期货	指	广州期货股份有限公司
越秀金控	指	广州越秀金融控股集团股份有限公司
广州越秀金控	指	广州越秀金融控股集团有限公司
广州证券	指	广州证券股份有限公司（已更名为中信证券华南股份有限公司）
广期资本、子公司、风险管理子公司	指	广期资本管理（深圳）有限公司
公司实际控制人、广州市国资委	指	广州市人民政府国有资产监督管理委员会
越秀集团	指	广州越秀集团股份有限公司
中信证券	指	中信证券股份有限公司
主办券商、申万宏源	指	申万宏源证券有限公司
全国股份转让系统	指	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
《公司章程》、《章程》	指	《广州期货股份有限公司章程》
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
报告期、本期	指	2020年1月1日至2020年6月30日
报告日	指	2020年8月25日
元、万元、亿元	指	人民币元、万元、亿元

第二节 公司概况

一、 基本信息

公司中文全称	广州期货股份有限公司
英文名称及缩写	GUANGZHOU FUTURES CO.,LTD.
证券简称	广州期货
证券代码	870367
法定代表人	严若中

二、 联系方式

董事会秘书	孙颖
是否具备全国股转系统董事会秘书 任职资格	是
联系地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼10楼
电话	020-22139815
传真	020-22139811
电子邮箱	gzqh2014@gzf2010.com.cn
公司网址	www.gzf2010.com.cn
办公地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼10楼
邮政编码	510623
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司半年度报告备置地	董事会办公室

三、 企业信息

股票交易场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	2003年8月22日
挂牌时间	2017年1月4日
分层情况	基础层
行业（挂牌公司管理型行业 分类）	金融业(J-资本市场服务(67)-资本市场服务(672)-期货市场服务(6729)
主要业务	期货、期权经纪业务,资产管理业务,风险管理业务,期货投资咨询业务
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
普通股股票交易方式	集合竞价交易
普通股总股本（股）	550,000,000
优先股总股本（股）	-
做市商数量	
控股股东	广州越秀金融控股集团股份有限公司
实际控制人及其一致行动人	实际控制人为（广州市人民政府国有资产监督管理委员会）

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	9144010171093174XF	否
注册地址	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼第1007房、1008房、1009房、1010房、1011房、1012房	否
注册资本（元）	550,000,000 元	否

五、 中介机构

主办券商（报告期内）	申万宏源
主办券商办公地址	上海市常熟路239号
报告期内主办券商是否发生变化	否
主办券商（报告披露日）	申万宏源

六、 自愿披露

适用 不适用

七、 报告期后更新情况

适用 不适用

第三节 会计数据和经营情况

一、主要会计数据和财务指标

(一) 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	1,149,944,069.56	1,525,051,938.67	-24.60%
利润总额	3,960,560.96	11,341,176.74	-65.08%
归属于挂牌公司股东的净利润	2,375,592.95	9,991,435.47	-76.22%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	1,379,631.72	9,567,989.74	-85.58%
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）	0.33%	1.43%	-
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	0.19%	1.37%	-
基本每股收益	0.004	0.018	-77.78%

(二) 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	4,008,516,450.87	3,174,083,193.87	26.29%
负债总计	3,292,642,121.65	2,460,584,457.60	33.82%
归属于挂牌公司股东的净资产	715,874,329.22	713,498,736.27	0.33%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	1.30	1.30	0.00%
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	6.14%	6.83%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	57.32%	43.34%	-
流动比率	169.06%	224.96%	-
利息保障倍数	134.15%	514.68%	-

(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	-427,282,572.11	16,436,807.60	-
应收账款周转率			-
存货周转率	12.07	29.76	-

(四) 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	26.29%	-0.04%	-
营业收入增长率%	-24.60%	603.54%	-
净利润增长率%	-76.22%	-54.07%	-

(五) 行业主要财务及监管指标

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
净资本	573,047,843.23	556,942,520.99	2.89%
风险资本准备总额	88,386,954.67	84,191,341.45	4.98%
净资本与风险资本准备总额的比例	648.34%	661.52%	-
净资本与净资产的比例	80.16%	78.95%	-
扣除客户保证金的流动资产	648,244,410.40	646,568,811.84	0.26%
扣除客户权益的流动负债	46,742,938.74	51,732,649.34	-9.65%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	1,386.83%	1,249.83%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	6.54%	7.33%	-
结算准备金额	26,982,047.26	53,046,708.91	-49.14%

注：上述数据均为按母公司口径计算。

(六) 补充财务指标

适用 不适用

二、 非经常性损益项目及金额

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益	-6,660.43
计入当期损益的政府补助	557,473.25
其他符合非经常性损益定义的损益项目	777,135.49
非经常性损益合计	1,327,948.31
所得税影响数	331,987.08
少数股东权益影响额（税后）	
非经常性损益净额	995,961.23

三、 会计政策变更、会计估计变更或重大差错更正等情况

(一) 会计数据追溯调整或重述情况

会计政策变更 会计差错更正 其他原因 不适用

(二) 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因及影响

适用 不适用

1. 会计政策变更概述

2017年7月5日，财政部修订并发布了《企业会计准则第14号—收入》（以下简称“新收入准则”），并要求在境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报表的企业，自2018年1月1日起施行；其他境内上市企业，自2020年1月1日起施行；执行企业会计准则的非上市企业，自2021年1月1日起施行。

本次会计政策变更是因按照国家财政部发布的相关企业会计准则而进行的变更，不会对公司损益、总资产、净资产产生重大影响，不涉及以前年度追溯调整。

2. 会计政策变更的具体情况对公司的影响

新收入准则将现行收入和建造合同两项准则纳入统一的收入确认模型；以控制权转移替代风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准；对于包含多重交易安排的合同的会计处理提供更明确的指引；对于某些特定交易(或事项)的收入确认和计量给出了明确规定。

根据新收入准则的新旧准则衔接规定，公司自2020年1月1日起执行新准则，根据首次执行新收入准则的累积影响数，调整当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整。执行新收入准则预计不会对公司经营成果产生重大影响，亦不会导致本公司收入确认方式发生重大变化，不会对财务报表产生重大影响。

四、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

五、 主要经营情况回顾

(一) 经营计划

适用 不适用

(二) 行业情况

适用 不适用

(三) 商业模式

公司目前主营业务包括期货经纪业务、资产管理业务、风险管理业务和期货投资咨询业务，其中，风险管理业务通过公司全资子公司——广期资本管理（深圳）有限公司开展。截至2020年6月底，公司已设立了23家分支机构，业务覆盖全国主要中心城市，可为投资者提供一站式的金融服务。

公司各项主营业务的具体商业运作模式如下：

1.期货、期权经纪业务

期货经纪业务主要是为个人、企业及专业投资机构等客户提供的代理期货交易与结算的中间业务，公司接受客户委托并按照客户指令进行期货交易并收取手续费，是期货公司一项基础性业务。目前，公司期货经纪业务的营销渠道包括网点渠道及居间人，业务收入主要包含交易手续费、交割手续费、交易所手续费减收以及客户的保证金利息收入。

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，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缴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，客户以资金的形式向期货公司缴纳保证金的情况居多。

2.资产管理业务

资产管理业务是指接受单一客户或者特定多个客户的书面委托并提供资产投资与管理的服务，根据相关规定及合同的约定，运用客户委托资产进行投资，并按照合同约定收取费用或者报酬的业务活动。投资范围包括：银行存款、同业存单标准化债权资产、债券、中央银行票据、资产支持证券、金融企业债务融资工具、上市公司股票、存托凭证、标准化股权类资产、期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产以及公开募集证券投资基金等标准化资产。目前，公司主要是通过自有营业网点以及银行、基金、券商、私募、第三方理财等合作性营销通道开展资产管理业务。公司资产管理业务的收入主要来自于管理费收入以及管理人业绩报酬收入。其中，管理费率按照合同约定比例为准；管理人业绩报酬收入是公司管理的受托资产盈利水平挂钩的利润分成，产品到期时公司按照约定的比例收取管理人业绩报酬。

3.风险管理业务

公司全资子公司广期资本管理（深圳）有限公司于2016年12月9日通过中国期货业协会设立备案，2017年1月17日顺利通过试点业务备案，通过备案的试点业务包括：仓单服务、合作套保、基差贸易、场外衍生品业务。公司主要通过风险管理子公司开展期货风险管理业务，以切实服务客户为宗旨，深植于品种基本面研究，依靠期货、现货渠道资源，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，为产业客户提供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一站式风险管理服务，致力于打造一流的风险管理服务平台以及成为业内领先的专业衍生品服务商。

风险管理业务作为公司有效衔接期、现货市场的重要纽带，是公司营业收入的主要贡献者，未来将有望成为公司重要的利润增长点，收入来源主要由场外衍生品交易收入、大宗商品贸易收入、融资服务利息收入等构成。

4.期货投资咨询业务

期货投资咨询业务是基于客户委托，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，期货投资咨询服务对象涵盖普通投资者、产业客户以及机构投资者等各类客户。期货投资咨询业务作为公司开展差异化服务的业务模式，在利用期货工具的基础上，通过专业化的金融衍生品及策略研究，为客户量身定制风险管理和投资管理的个性化服务，帮助客户实现资产保值增值，满足客户资产优化配置的多样化需求，是公司构建差异化核心竞争力的重要服务内容。目前，期货投资咨询业务收入主要来自于客户购买投资咨询服务所支付的投资咨询费。

(四) 经营情况回顾

2020年上半年，新冠疫情突如其来，全球经济陷入停滞，同时伴随着原油价格负值、非洲蝗灾等黑天鹅事件，期货市场极端行情频发，市场投机度也随之加大，企业经营的风险管理需求大幅提升，叠加在延续2019年期货市场新品种集中上市及国际化进程持续加快的市场红利影响下，上半年期货市场交投活跃度较为乐观。

面对全球经济持续下行及新冠疫情袭击的“双重挑战”，公司坚持以新时代中国特色社会主义思想 and 党的十九大精神为引领，努力开创公司事业发展新局面。上半年，在面临新冠疫情大考之际，公司上下坚定信心，同舟共济，积极响应广州市重大突发公共卫生事件一级响应的工作要求，全力以赴落实疫情防控措施，有序复产复工。

报告期内，公司各项经营工作有序推进，各业务条线工作稳步开展。

2020年1-6月，公司实现营业收入11.50亿元，同比下降24.60%；公司利润总额396.06万元，同比减少65.08%；净利润237.56万元，同比下降76.22%；主要是因新冠疫情等黑天鹅事件影响，市场行情波动剧烈，风险管理子公司业务受创。

受疫情影响线下业务开展受阻，公司积极应对，不断创新服务模式，客户开发与客户服务效果较好。截至2020年6月底，公司日均客户权益为21.02亿元，同比增长7.74%，且1-6月累计新开户数和法人户数均实现增长。

公司各项风险监管指标持续符合监管部门的要求。截止本期末，公司净资本与风险资本准备总额的比例为648.34%，高于120%的预警标准及100%的监管标准；净资本与净资产的比例为80.16%，高于24%的预警标准和20%的监管标准；流动资产与流动负债的比例为1386.83%，高于120%的预警标准和100%的监管标准；负债与净资产的比例为6.54%，低于120%的预警标准和150%的监管标准。

报告期内主要工作：

1. 攻克“疫情”展业困难，经纪业务积极创新，规模持续稳步增长

公司紧紧围绕经纪业务“增量提质”的关键目标，多措并举积极应对疫情的挑战与困难，2020年上半年，公司经纪业务工作稳步向前。客户开发与服务方面，公司充分发挥线上服务功能，适时推出“闻声如面，声入人心”系列线上报告会，服务客户2.4万余人次，为经纪业务注入新的发展活力。作为期货日报、证券时报主办的“第十四届全国期货（期权）实盘交易大赛”指定交易商，公司积极宣传推广，为客户权益增长开拓新渠道，截至6月底实盘大赛带来新增权益4,804.44万元。

截至 2020 年 6 月末，公司期末客户权益突破 23 亿元，同比增长 17.60%。但因市场手续费费率竞争白热化加剧，1-6 月公司经纪业务手续费收入 2,556.24 万元，同比下降 3.62%。

为积极应对疫情，平稳推进全面复工，公司领导班子成员下沉一线，走访分支机构，慰问值守员工，开展疫情防控措施和复工复产督导工作，并针对性地开展了全面业务风险点排查及营业部质量提升计划之系列调研走访等工作，进一步巩固经纪业务发展基础。面对行业日益严峻的同质化竞争趋势，经纪业务亟待加快创新转型，基于股东背景和自身基础积极打造专业化、差异化的业务竞争优势。

2.资管业务持续探索转型之道，基本完成 FOF 体系的搭建

为充分发挥衍生品、风险管理领域上的业务特色和专业优势，聚焦主动管理转型，实现期货财富管理职能，公司依托研究所与资产管理部共同构建的“投研一体化”体系，着力培养有实力、能实战的投研团队，专注研发并设计具备市场竞争力的策略及产品。上半年，资产管理业务以“探出路”为核心理念加快转型节奏，持续推动自主转型，并试水“FOF”业务，现已基本完成 FOF 投资管理体系的搭建。但因自主交易能力尚未形成竞争优势，业务受资管新规政策影响较大，致使业务暂未有规模性突破。截止 2020 年 6 月，资管业务收入 246.50 万元，同比增长 712.65%，主要是上年 12 月末新发行资管计划，资管管理费收入有了较大幅度增长。报告期内，资管产品规模（含存续）21,935.08 万元。

3.子公司业务受黑天鹅事件影响较大，基础建设工作持续优化

报告期内，子公司广期资本立足品种产业链，通过期货与现货结合、传统业务与创新业务结合、场内与场外结合等多种展业方式，辅以内控管理及业务管理体制机制建设的持续完善，聚焦优势品种，充分发挥期现平台优势，持续为客户提供优质的风险管理服务，助力在疫情期间企业经营风险的管理。受疫情及黑天鹅事件影响，期市行情波动较大，国内夜盘暂停，已开展项目的风险管理应急处理手段受限，且与实体企业开展的期现交易业务也受到较大影响。截止 2020 年 6 月底，子公司营业收入 11.06 亿元，同比下降 24.52%。在持续推进业务开展的同时，上半年子公司以“促发展”为核心理念，积极拓宽融资渠道、试点探索非标业务，并通过人才引进、内部优化等方式进一步巩固、夯实业务发展的基础。

4.抗疫扶贫工作两手抓，持续推进期货服务实体经济工作有序开展

面对打赢抗疫复工和脱贫攻坚的“双战”，为充分发挥期货市场风险管理职能，履行金融企业责任担当，报告期内，公司在全面落实防疫任务的同时，为助力企业复工复产，加大了金融扶贫力度。秉承期货服务“三农”原则，继 2019 年公司分别在内蒙古、甘肃、四川、天津等地区开展了 5 个“保险+期货”项目，2020 年上半年，公司在甘肃天水市及云南西盟佤族自治县分别开展了关于苹果及橡胶的“保险+期货”项目，惠及农户 9321 户，提供提供风险保障超 2020 万元，有效增强了农业企业运用现代金融工具抵抗经营风险的能力。

在金融供给侧改革以及金融监管一体化发展的大背景下，期货行业将延续“严监管”与“大开放”管理基调，加强行业政策监管力度，加速期货市场对外开放步伐。面对复杂严峻的内外部环境变化，公司将保持发展定力，继续聚焦主业，为客户提供多样化、专业化、个性化的金融风险管理服务。

(五) 财务分析

1. 资产负债结构分析

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期期末		上年期末		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	1,565,844,252.11	39.06%	1,755,612,758.89	55.31%	-10.81%
应收票据					
应收账款					
应收货币保证金	1,531,081,269.07	38.20%	703,003,945.99	22.15%	117.79%
应收质押保证金	107,915,496.00	2.69%	33,037,880.00	1.04%	226.64%
存出保证金	2,470,101.47	0.06%	2,374,372.62	0.07%	4.03%
应收结算担保金	10,000,000.00	0.25%	10,000,000.00	0.32%	0.00%
交易性金融资产	606,214,954.71	15.12%	574,240,807.28	18.09%	5.57%
其他应收款	3,078,828.81	0.08%	13,085,299.69	0.41%	-76.47%
存货	130,028,438.04	3.24%	51,096,913.93	1.61%	154.47%
固定资产	4,082,430.72	0.10%	2,020,379.71	0.06%	102.06%
无形资产	1,331,561.47	0.03%	1,468,668.61	0.05%	-9.34%
递延所得税资产	961,039.00	0.02%	961,039.00	0.03%	0.00%
其他资产	44,108,079.47	1.10%	25,781,128.15	0.81%	71.09%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.03%	1,400,000.00	0.04%	0.00%
应付期货投资者保障 基金	48,255.89	0.0012%	129,262.62	0.0041%	-62.67%
期货风险准备金	28,568,868.18	0.71%	27,290,748.90	0.86%	4.68%
应付货币保证金	2,223,265,679.24	55.46%	1,881,824,909.40	59.29%	18.14%
应付质押保证金	107,915,496.00	2.69%	33,037,880.00	1.04%	226.64%
应付职工薪酬	10,522,874.08	0.26%	16,267,869.50	0.51%	-35.31%
应交税费	951,520.08	0.02%	1,709,645.42	0.05%	-44.34%
其他应付款	28,058,178.18	0.70%	24,152,623.27	0.76%	16.17%
其他流动负债	893,290,000.00	22.28%	476,150,268.49	15.00%	87.61%
递延所得税负债	21,250.00	0.0005%	21,250.00	0.0007%	0.00%

资产负债项目重大变动原因：

1.应收货币保证金比上年末增长 117.79%，主要是本期期货市场交投较活跃，为满足客户交易需求，存入各交易所的资金规模增加。

2.应收质押保证金比上年末增长 226.64%，主要是本期客户加大了对交易所仓单质押的规模。

3.其它应收款比上年末减少 76.47%，主要是风险管理子公司本期的银行承兑汇票保证金减少。

4.存货比上年末增长 154.47%，主要是风险管理子公司本期加大了仓单服务及基差贸易的业务规模，期末持有的库存商品增加。

5.固定资产比上年末增长 102.06%，主要是本期公司加大信息技术投入，升级主交易系统，相应的硬件投入大幅增加。

6.其它资产比上年末增长 71.09%，主要是风险管理子公司支付的银行承兑汇票贴现利息列入待摊费用，在票据有效期内平均摊销，其次是风险管理子公司期末持有存货，相对应的待抵扣进项税同比增加。

7.应付期货投资者保障基金比上年末减少 62.67%，主要是本年初支付了应付上年的期货投资者保障基金。

8.应付质押保证金比上年末增长 226.64%，主要是客户加大了对交易所仓单质押的规模。

9.应付职工薪酬比上年末减少 35.31%，主要是本期支付上年的年度奖金，应付职工薪酬减少。

10.应交税费比上年末减少 44.34%，主要是本期支付上年末计提的税金及附加税以及所得税，同时本期利润受新冠疫情及黑天鹅事件影响同比下跌较大，相应的所得税大幅减少。

11.其它流动负债比上年末增长 87.61%，主要是风险管理子公司本期加大基差贸易业务规模，通过银行承兑汇票融资购买库存商品的规模大幅增加。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
一、营业收入	1,149,944,069.56	-	1,525,051,938.67	-	-24.60%
手续费及佣金净收入	28,363,741.02	2.47%	28,450,077.21	1.87%	-0.30%
其中：经纪业务手续费收入	25,562,385.77	2.22%	26,521,934.58	1.74%	-3.62%
资产管理业务收入	2,465,034.49	0.21%	303,331.32	0.02%	712.65%
投资咨询业务收入	336,320.76	0.03%	1,624,811.31	0.11%	-79.30%
代理销售金融产品收入	-	-	-	-	-
其他手续费及佣金收入	-	-	-	-	-
利息净收入	18,881,680.67	1.64%	18,085,735.89	1.19%	4.40%
投资收益	-8,788,163.97	-0.76%	14,227,803.88	0.93%	-161.77%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	-	-	-	-	-
公允价值变动收益	4,975,402.09	0.43%	-1,597,547.69	-0.10%	411.44%
汇兑收益	-	-	-	-	-
其他业务收入	1,106,511,409.75	96.22%	1,465,885,869.38	96.12%	-24.52%
其中：风险管理业务收入	1,106,511,409.75	96.22%	1,465,885,869.38	96.12%	-24.52%

其他收益	-	-	-	-	-
二、营业成本	1,147,311,456.91	99.77%	1,514,275,356.24	99.29%	-24.23%
提取期货风险准备金	1,278,119.28	0.11%	1,348,043.70	0.09%	-5.19%
税金及附加	520,534.24	0.05%	272,337.12	0.02%	91.14%
业务及管理费	52,146,390.96	4.53%	44,326,799.37	2.91%	17.64%
研发费用	-	-	-	-	-
信用减值损失	-	-	-	-	-
其他资产减值损失	-	-	3,746,261.42	0.25%	-100.00%
其他业务成本	1,093,366,412.43	95.08%	1,464,581,914.63	96.03%	-25.35%
三、营业利润	2,632,612.65	0.23%	10,776,582.43	0.71%	-75.57%
营业外收入	1,334,608.74	0.12%	566,168.14	0.04%	135.73%
营业外支出	6,660.43	0.0006%	1,573.83	0.0001%	323.20%
四、利润总额	3,960,560.96	0.34%	11,341,176.74	0.74%	-65.08%
五、净利润	2,375,592.95	-	9,991,435.47	-	-76.22%

项目重大变动原因：

1.资产管理业务收入同比增长 712.65%，主要是上年 12 月末新增资产管理计划，相应的管理费收入增加。

2.投资咨询业务收入同比减少 79.30%，主要是本期受新冠疫情影响，与公募基金等机构合作减少。

3.投资收益同比减少 161.77%，主要是风险管理子公司衍生品业务受新冠疫情等黑天鹅事件影响出现较大亏损，投资收益减少。

4.公允价值变动损益同比增长 411.44%，主要是风险管理子公司大力发展基差贸易业务，其对应的期货端衍生工具期末公允价值增加。

5.税金及附加同比增长 91.14%，主要是风险管理子公司印花税同比大幅增加。

6.营业外收入同比增长 135.73%，主要是本期收到政府补助增加。

7.营业外支出同比增长 323.20%，主要是本期报废的固定资产增加。

(2) 收入构成

√适用 □不适用

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
手续费及佣金净收入	28,363,741.02	28,450,077.21	-0.30%
利息净收入	18,881,680.67	18,085,735.89	4.40%
其他业务收入	1,106,511,409.75	1,465,885,869.38	-24.52%
投资收益	-8,788,163.97	14,227,803.88	-161.77%
公允价值变动收益	4,975,402.09	-1,597,547.69	-411.44%

分行政区域营业部及手续费收入情况

√适用 □不适用

单位：元

省级行政区域名称	营业部家数	手续费收入金额	占营业收入比例%
北京市	1	680,576.86	0.06%
上海市	1	218,532.13	0.02%
天津市	1	357,771.30	0.03%
重庆市	1	92,969.87	0.01%
广东省	8	22,106,580.38	1.92%
江苏省	1	471,420.81	0.04%
山东省	2	855,528.66	0.07%
浙江省	2	1,106,462.11	0.10%
四川省	2	969,759.01	0.09%
湖北省	2	810,173.60	0.07%
湖南省	1	118,452.42	0.01%
福建省	1	162,608.51	0.01%
河南省	1	412,905.36	0.04%
合计	24	28,363,741.02	2.47%

注：广州期货股份有限公司总部开展业务，因此作为广东省内的 1 家营业部计算，公司截止 2020 年 6 月 30 日共有 3 家分公司，分公司亦作为营业部纳入统计。

收入构成变动的的原因：

1.手续费净收入占比由上年的 1.87%上升至 2.47%，主要是本期受疫情影响，尤其是本年第一季度，风险管理子公司业务难以开展，其销售收入同比减少 24.52%，同时其衍生品业务受新冠疫情等黑天鹅事件影响出现较大亏损，使得公司总体营业收入同比减少 24.60%，而手续费净收入基本与上年持平，最终使得手续费收入在营业收入中的占比有所上升。

2.投资收益占比由上年的 0.93%下降至-0.76%，主要是本期投资收益同比上年大幅减少，风险管理子公司衍生品业务受新冠疫情等黑天鹅事件影响出现较大亏损。

3.其它业务收入主要是风险管理子公司的仓单服务及基差贸易的销售收入，占比由上年的 96.12%上升至 96.22%，虽然本期其它业务收入同比上年同期减少 24.52%，但由于总营业收入同比上年减少 24.60%，其减幅大于其他业务收入的减幅，从而使得其它业务收入的占比上升。

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	-427,282,572.11	16,436,807.60	-
投资活动产生的现金流量净额	-5,806,577.99	112,066,815.68	-
筹资活动产生的现金流量净额	-82,529,356.68	-137,611,593.52	-

现金流量分析:

1.经营活动产生的现金流量净额同比上年减少 44,371.94 万元,主要是本期期货市场交投较活跃,为满足客户交易需求,将大部分的客户保证金存入各交易所席位。

2.投资活动产生的现金流量净额同比上年减少 11,787.34 万元,主要是上年将原投资的券商理财产品赎回,产生较大的现金流入,而本期主要是直接续做。

3.筹资活动产生的现金流量净额同比上年少减少 5,508.22 万元,主要是上期偿还次级债 13,000.00 万元,而本期无此支出。

六、 主要控股参股公司分析

(一) 要控股子公司、参股公司经营情况

适用 不适用

单位:元

公司名称	公司类型	主要业务	与公司从事业务的关联性	持有目的	注册资本	总资产	净资产	营业收入	净利润
广期资本管理(深圳)有限公司	子公司	仓单服务、合作套保、基差交易、定价服务、做市业务、第三方风险管理服务	广期资本主要开展风险管理公司试点业务	开展期货风险管理业务,适应期货服务实体经济发展的需要	100,000,000	1,121,506,844.63	101,000,322.96	1,094,097,376.64	-7,009,583.49

(二) 报告期内取得和处置子公司的情况

适用 不适用

合并财务报表的合并范围是否发生变化

是 否

本期公司新设 3 家分支机构纳入合并范围内,分别为四川分公司、广东金融高新区分公司、湖北分公司。

(三) 合并报表范围内是否包含私募基金管理人:

是 否

七、 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

八、 对非标准审计意见及关键审计事项的说明

(一) 非标准审计意见说明

适用 不适用

(二) 关键审计事项说明:

适用 不适用

九、 企业社会责任

(一) 精准扶贫工作情况

适用 不适用

2020年也是我国全面建成小康社会目标的实现之年，是全面打赢脱贫攻坚战的收官之年，面对打赢抗疫复工和脱贫攻坚的“双战”，对于如何充分发挥期货市场风险管理的功能，持续探索期货服务“三农”的创新模式，广州期货积极作为勇于担当，运用先进的金融管理工具为农民创收保驾护航。报告期内，公司开展两项“保险+期货”项目，持续践行期货市场服务“三农”社会责任。

2020年5月，公司参与的天水市麦积区苹果“保险+期货”第二期顺利落地。天水市麦积区是国家扶贫开发工作重点县，属于六盘山集中连片特困地区，2019年11月刚刚进行脱贫公示，扶贫任务依然艰巨。该项目由甘肃省农业农村厅和甘肃省财政厅政策支持，保费由中央财政和省市县级财政提供资金支持，农户自行承担25%。中国人民财产保险股份有限公司郑州市公司、太平洋财产保险股份有限公司、中国平安保险三家保险公司共同承保，由广州期货、浙商期货、瑞达期货、大地期货、五矿经易期货共5家期货公司风险管理子公司共同负责场外期权风险对冲。项目惠及当地8800余户苹果种植户，第二期中公司承保量对应提供的风险保障超1100万元。

2020年6月，在上海期货交易所支持下，公司在云南西盟佤族自治县的天然橡胶“保险+期货”第一期项目顺利开展。处在西南边陲中缅边境的西盟佤族自治县是国家级重点贫困县，橡胶种植业作为西盟县农赖以生存的支柱产业，受新冠疫情影响，胶价出现剧烈波动，为响应国务院、证监会关于期货市场服务“三农”及“精准扶贫”的号召，发挥金融机构的专业优势，缓解橡胶价格剧烈波动给胶农带来的不利影响，在上海期货交易所及西盟佤族自治县人民政府的支持和指导下，广州期货联合子公司，携手云南天然橡胶产业集团西盟有限公司、中国人民财产保险股份有限公司上海市分公司及云南西盟支公司在云南省普洱市西盟县天然橡胶价格指数“保险+期货”精准扶贫项目展开试点，为当地胶农收入保驾护航。本次项目涉及橡胶现货量750吨，种植面积约2.57万亩，为当地521户种植户（含32户建档立卡贫困户）提供风险保障约920万元。基于当前橡胶价格低位震荡的复杂行情，广期资本衍生品团队特别设计了触碰式锁定结构，以求达到更好的保障效果。

在新冠病毒全球肆虐的特殊时期，广州期货将立足期货公司自身的专业优势和服务实体经济的使命切实将精准扶贫工作落到实处，用实际行动为打赢“双战”获得全面胜利持续输送正能量。

(二) 其他社会责任履行情况

适用 不适用

报告期内，公司创新投资者教育模式，有序开展线上市场投教活动。2020年上半年，广州期货已开展线上报告会共71场，品种涉及有色金属、鸡蛋、油脂油料、股指期货及期权、尿素、甲醇、棉花等，内容涵盖投资策略分享、企业风险管理规避、品种供需情况分析、市场影响评估等。累计服务人次2.4万余人。

十、 公司面临的风险和应对措施

适用 不适用

第四节 重大事件

一、 重大事件索引

事项	是或否	索引
是否存在诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	四. 二. (一)
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<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	四. 二. (二)
是否存在其他重大关联交易事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资、企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股份回购事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四. 二. (三)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在被调查处罚的事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	四. 二. (四)
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在破产重整事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在应当披露的其他重要事项	<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、 重大事件详情

(一) 诉讼、仲裁事项

本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项。

(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		
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	38,500,000.00	2,392,002.60
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	700,000,000.00	-
4. 利息收支	6,000,000.00	151.80
5. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型		
6. 担保（挂牌公司接受的）	500,000,000.00	125,650,000.00
合计	1,244,500,000.00	128,042,154.40

(三) 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
董监高	2017/1/4	-	挂牌	同业竞争承诺	详见承诺事项详情	正在履行中
董监高	2017/1/4	-	挂牌	关联交易	详见承诺事项详情	正在履行中

承诺事项详细情况：

1.避免同业竞争承诺事项

为避免出现同业竞争情形，公司股东、董事、监事、高级管理人员向公司出具了《避免同业竞争的承诺函》，其中股东具体承诺如下：

“本单位不在中国境内外直接或间接从事或参与从事任何在商业上对广州期货股份有限公司构成竞争的业务及活动，或拥有与广州期货股份有限公司存在竞争关系的任何经济实体、机构、经济组织的权益，或以其他任何形式取得该经济实体、机构、经济组织的控制权，或在该经济实体、机构、经济组织中担任高级管理人员或核心技术人员。本单位在作为公司股东期间，本承诺持续有效。本单位愿意承担因违反上述承诺而给公司造成的全部经济损失。”

董事、监事、高级管理人员关于避免同业竞争的承诺如下：

(1) 本人将不在中国境内外直接或间接从事或参与任何在商业上对广州期货股份有限公司构成竞争的业务及活动，或拥有与公司存在竞争关系的任何经济实体、机构、经济组织的权益，或以其他任何形式取得该经济实体、机构、经济组织的控制权，或在该经济实体、机构、经济组织中担任高级管理人员或核心技术人员。

(2) 本人在作为公司董、监、高或核心技术人员期间及辞去上述职务六个月内，本承诺持续有效。

(3) 本人愿意承担因违反上述承诺而给公司造成的全部经济损失。

报告期内，公司控股股东、实际控制人与公司不存在同业竞争，且公司的股东、董事、监事、高级管理人员已作出有效承诺以避免同业竞争的可能。

2.规范关联交易承诺

为进一步规范关联交易，公司股东、董事、监事、高级管理人员向公司出具了《规范关联交易承诺函》，其中股东具体承诺如下：

本公司将尽可能减少与公司之间的关联交易。对于确实无法避免的关联交易，将依法签订协议，并按照《公司法》、《公司章程》、《关联交易管理办法》及其他相关法律法规的规定，履行相应的决策程序。

董事、监事、高级管理人员关于规范关联交易的承诺如下：

- (1) 本人及与本人关系密切的家庭成员；
- (2) 本人直接或间接控制的其他企业；
- (3) 本人担任董事、监事、高级管理人员的其他企业；
- (4) 与本人关系密切的家庭成员直接或间接控制的，或担任董事、高级管理人员的其他企业；

上述各方将尽可能减少与公司之间的关联交易。对于确实无法避免的关联交易，将依法签订协议，并按照《公司法》、《公司章程》、《关联交易管理办法》及其他相关法律法规的规定，履行相应的决策程序。

报告期内，公司董事、监事、高级管理人员与公司未有发生关联交易，公司控股股东与公司发生的部分关联交易为公司纯受益行为，公司无需向关联方支付对价，属于关联方对公司发展的支持行为，其他关联交易公司根据市场同类价格的标准确定具体交易定价。交易行为遵循市场公允原则，不会影响公司经营成果的真实性，亦未出现损害公司及中小股东利益的情形。

(四) 调查处罚事项

2020年4月23日，中国证监会广东监管局对公司下发了《关于对广州期货股份有限公司采取责令改正措施的决定》的行政监管措施决定书，经查，公司天津营业部原负责人庞晓军、天津营业部员工闫文亮、黄斐斐在公司天津营业部工作期间，为期货配资活动提供便利，反映公司存在对分支机构管控不到位的问题，违反了《期货公司监督管理办法》（证监会令第155号）第五十六条的规定。

公司高度重视上述问题，严格按照中国证监会要求将进行深度自查自纠，全面落实整改，强化内部控制，并于收到决定书后30日内将整改报告、内部问责情况等材料报送至广东证监局。截止目前，上述事件未对公司经营及财务方面产生不利影响。

详见公司于2020年4月23日披露的《关于公司收到中国证监会广东证监局<关于对广州期货股份有限公司采取责令改正措施的决定>的公告》（2020-015）。

第五节 股份变动和融资

一、普通股股本情况

(一) 报告期期末普通股股本结构

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	550,000,000	100%	0	550,000,000	100%
	其中：控股股东、实际控制人	550,000,000	100%	0	550,000,000	100%
	董事、监事、高管	-	-	-	-	-
	核心员工	-	-	-	-	-
有限售条件股份	有限售股份总数	0	0%	0	0	0%
	其中：控股股东、实际控制人	0	0%	0	0	0%
	董事、监事、高管	-	-	-	-	-
	核心员工	-	-	-	-	-
总股本		550,000,000	-	0	550,000,000	-
普通股股东人数		2				

股本结构变动情况：

√适用 □不适用

广州证券股份有限公司（现已更名为中信证券华南股份有限公司）将其持有的公司 99.03% 股份转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司已于 2020 年 1 月 8 日在中国证券登记结算有限责任公司北京分公司完成过户登记手续办理，公司控股股东变更为“广州越秀金融控股集团股份有限公司”。本次股权变更完成后，公司股东 2 名，分别为广州越秀金融控股集团股份有限公司（持股 99.03%），广州越秀金融控股集团有限公司（持股 0.97%）。

(二) 报告期期末普通股前十名股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有限售股份数量	期末持有无限售股份数量	期末持有的质押或司法冻结股份数量
1	广州越秀金融控股集团股份有限公司	0	544,665,000	544,665,000	99.03%	0	544,665,000	0

2	广州越秀金融控股集团有限公司	5,335,000	0	5,335,000	0.97%	0	5,335,000	0
合计		5,335,000	-	550,000,000	100%	0	550,000,000	0

普通股前十名股东间相互关系说明：

截至 2020 年 6 月 30 日，公司股东 2 名，分别为广州越秀金融控股集团股份有限公司以及广州越秀金融控股集团有限公司，其中广州越秀金融控股集团有限公司为广州越秀金融控股集团股份有限公司之全资子公司。

二、 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

公司控股股东为广州越秀金控集团股份有限公司。

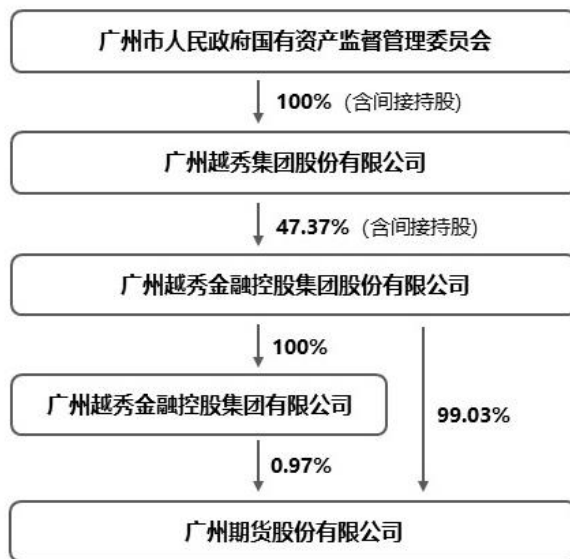
名称	广州越秀金融控股集团股份有限公司
单位负责人/法定代表人	王恕慧
成立日期	1992 年 12 月 24 日
社会信用代码	914401011904817725
注册资本	2,752,884,754.00 元

(二) 实际控制人情况

公司股东的实际控制人均为广州市人民政府国有资产监督管理委员会，因此，广州市人民政府国有资产监督管理委员会为公司实际控制人。

报告期内，公司实际控制人未发生变更，公司主要经营管理团队、主营业务均未发生重大变化。公司与实际控制人之间的产权和控制关系：

广州期货股份有限公司股权架构图



三、 报告期内的普通股股票发行及募集资金使用情况

(一) 股票发行情况

适用 不适用

(二) 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

四、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

五、 存续至本期的债券融资情况

适用 不适用

六、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用

七、 特别表决权安排情况

适用 不适用

第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况

一、董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	任职起止日期	
				起始日期	终止日期
凌富华	董事长	男	1968年3月	2020年6月29日	2023年4月19日
严若中	董事、总经理	男	1959年12月	2020年4月20日	2023年4月19日
周建余	董事	男	1981年3月	2020年4月20日	2023年4月19日
肖成	独立董事	男	1956年5月	2020年4月20日	2023年4月19日
颜康富	董事	男	1974年1月	2020年4月20日	2023年4月19日
李松民	监事会主席	男	1974年11月	2020年4月29日	2023年4月19日
黄峥	监事	男	1979年5月	2020年4月20日	2023年4月19日
叶菲	职工代表监事	女	1982年9月	2018年12月18日	2021年12月17日
胡红霞	副总经理	女	1969年2月	2015年10月9日	2018年10月8日
罗强	副总经理	男	1982年9月	2015年10月9日	2018年10月8日
孙文慧	首席风险官	女	1977年6月	2015年10月9日	2018年10月8日
吴超雄	财务负责人	男	1979年1月	2015年10月9日	2018年10月8日
孙颖	董事会秘书	女	1972年7月	2015年10月9日	2018年10月8日
董事会人数:					5
监事会人数:					3
高级管理人员人数:					6

1.公司董事会于2020年3月25日收到董事长詹松茂先生递交的辞职报告,自2020年3月25日起辞职生效。在董事会选举产生新任董事长之前,由公司董事、总经理严若中先生代为履行董事长职责。公司积极推进董事会换届及董事长选举工作,中期协于6月24日公告期货公司高管人员任职资质测试结果,公司于6月29日召开第二届董事会第三次会议,选举凌富华先生为公司第二届董事会董事长。

2.公司第一届董事会、监事会、高级管理人员的任期于2018年10月8日届满。公司已于2018年9月28日在全国中小企业股份转让系统指定信息披露平台(www.neeq.com.cn)上披露了《关于董事会、监事会、高级管理人员延迟换届的公告》(2018-027)。目前,公司已完成董事会、监事会换届工作,高管换届工作正在程序中。新一届高管聘任工作完成前,公司全体高管人员依照法律法规和《公司章程》等规定,继续履行义务及职责。报告期内未出现不能履职等情形。

董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系:

- 1.公司董事、监事、高级管理人员之间不存在亲属或关联关系。
- 2.公司董事、监事及高级管理人员均未在实际控制人广州市国资委任职。
- 3.截至报告期末,公司董事周建余先生、董事颜康富先生、监事李松民先生在公司控股股东越秀

金控任职：周建余先生任广州越秀金融控股集团股份有限公司战略管理部总经理；颜康富先生任广州越秀金融控股集团股份有限公司风险管理与法务合规部总经理；李松民先生任广州越秀金融控股集团股份有限公司职工监事。

4.截至报告期末，公司董事周建余先生、颜康富先生、监事李松民先生、黄峥先生在广州市国资委下属企业任职：周建余先生任上海越秀融资租赁有限公司董事，广州越秀融资担保有限公司董事，金鹰基金管理有限公司董事；颜康富先生任金鹰基金管理有限公司董事、广州资产管理有限公司董事、广州越秀融资租赁有限公司董事；李松民先生任广州越秀融资担保有限公司董事长、总经理，广州越秀小额贷款有限公司董事长；黄峥先生任广州越秀小额贷款有限公司监事。

(二) 持股情况

单位：股

姓名	职务	期初持普通股股数	数量变动	期末持普通股股数	期末普通股持股比例%	期末持有股票期权数量	期末被授予的限制性股票数量
凌富华	董事长	0	0	0	0%	0	0
严若中	董事、总经理	0	0	0	0%	0	0
周建余	董事	0	0	0	0%	0	0
肖成	独立董事	0	0	0	0%	0	0
颜康富	董事	0	0	0	0%	0	0
李松民	监事会主席	0	0	0	0%	0	0
黄峥	监事	0	0	0	0%	0	0
叶菲	职工代表监事	0	0	0	0%	0	0
胡红霞	副总经理	0	0	0	0%	0	0
罗强	副总经理	0	0	0	0%	0	0
孙文慧	首席风险官	0	0	0	0%	0	0
吴超雄	财务负责人	0	0	0	0%	0	0
孙颖	董事会秘书	0	0	0	0%	0	0
合计	-	0	-	0	0%	0	0

(三) 变动情况

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

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：

√适用 □不适用

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
詹松茂	董事长	离任	无	个人原因离职
凌富华	无	新任	董事长	选举产生
罗剑	董事	离任	无	个人原因离职
颜康富	无	新任	董事	选举产生

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

√适用 □不适用

1.广州期货董事会董事长凌富华先生

凌富华先生，1968年3月出生，湖南娄底人。大学本科学历，经济学学士学位，中级会计师。

1991年7月至1993年2月，于苏州航空工业部长风机械总厂任财务处会计；

1993年3月至1995年2月，于广州大同精密机械有限公司任会计部经理；

1995年3月至1996年9月，于广西北海国际信托投资公司历任城市信用社、营业部、信贷部经理助理；

1996年10月至1999年4月，于香港大同机械企业有限公司任会计部驻国内企业会计主任；

1999年5月至2000年8月，于广东联谊信诚贸易有限公司任财务部经理；

2000年9月至2006年3月，于长城证券有限责任公司历任广州营业部财务经理、财务中心综合部经理、拟任营业部总经理；

2006年4月至2012年12月，于广州恒运企业集团股份有限公司历任财务部副经理，财务部经理，财务负责人，财务总监兼财务部经理及财务负责人；

2013年1月至2014年9月，于广州证券有限责任公司历任拟任副总裁，董事总经理，财务总监，财务负责人；

2014年9月至2020年1月，于广州证券股份有限公司任副总裁兼财务总监及财务负责人；

2018年6月至2020年1月，于广州证券股份有限公司兼任投资银行事业部总经理；

2020年1月至2020年4月，于中信证券华南股份有限公司任副总裁兼财务总监及财务负责人、兼任投资银行事业部总经理；

2020年5月至6月，于中信证券华南股份有限公司，进行离任审计；

2020年4月至今，于广州期货股份有限公司任董事；

2020年6月至今，于广州期货股份有限公司任董事长。

2.广州期货董事会董事颜康富先生

颜康富先生，1974年1月出生，广东茂名人。大学本科学历，经济学学士学位，中级经济师。

1997年6月至2011年7月，于深圳发展银行股份有限公司，历任罗湖支行信贷员，罗湖支行彩田支行副行长，长城支行任副行长级，风险管理部室副经理级，信贷审批中心室副经理级，信贷审批部高级信贷审批岗；

2011年8月至2015年5月，于广东南粤银行股份有限公司，历任总行授信审批部副总经理，广州分行副行长，惠州分行副行长；

2015年5月至2019年12月，于广州越秀融资租赁有限公司，任首席风险官；

2019年12月至今，于广州越秀金融控股集团有限公司，任风险管理部（2020年4月更名为风险管理与法务合规部）总经理；

2019年12月至今，于广州越秀金融控股集团股份有限公司，任风险管理部（2020年4月更名为风险管理与法务合规部）总经理；

2020年3月至今，于金鹰基金管理有限公司，任董事；

2020年4月至今，于广州资产管理有限公司，任董事；

2020年4月至今，于广州期货股份有限公司任董事。

(四) 董事、监事、高级管理人员股权激励情况

适用 不适用

二、 员工情况

(一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
研究人员	22	1	2	21
市场业务人员	122	17	25	114
财务人员	9	1	0	10
行政管理人员	30	4	3	31
信息技术人员	35	5	7	33
合规及风控人员	33	5	3	35
其他人员	21	2	0	23
员工总计	272	35	40	267

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	0	0
硕士	56	52
本科	175	179

专科	38	34
专科以下	3	2
员工总计	272	267

(二) 核心员工（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

第七节 财务会计报告

一、 审计报告

是否审计	否
------	---

二、 财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
流动资产：			
货币资金	六、1.(1)	1,565,844,252.11	1,755,612,758.89
其中：期货保证金存款	六、1.(1)	776,693,129.44	1,303,720,129.82
应收货币保证金	六、2.(1)	1,531,081,269.07	703,003,945.99
应收质押保证金	六、2.(1)	107,915,496.00	33,037,880.00
存出保证金	六、3	2,470,101.47	2,374,372.62
交易性金融资产	六、4	606,214,954.71	574,240,807.28
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	六、5	10,000,000.00	10,000,000.00
应收风险损失款			
应收佣金			
其他应收款	六、6.(1)	3,078,828.81	13,085,299.69
其中：应收利息			
应收股利			
买入返售金融资产			
存货	六、7	130,028,438.04	51,096,913.93
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			
流动资产合计		3,956,633,340.21	3,142,451,978.40
非流动资产：			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资			
其他权益工具投资			
期货会员资格投资	六、8.(1)	1,400,000.00	1,400,000.00

其他非流动金融资产			
投资性房地产			
固定资产	六、9.(1)	4,082,430.72	2,020,379.71
在建工程			
使用权资产			
无形资产	六、10.(1)	1,331,561.47	1,468,668.61
开发支出			
商誉			
长期待摊费用			
递延所得税资产	六、11.(1)	961,039.00	961,039.00
其他非流动资产	六、12.(1)	44,108,079.47	25,781,128.15
非流动资产合计		51,883,110.66	31,631,215.47
资产总计		4,008,516,450.87	3,174,083,193.87
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金	六、13	2,223,265,679.24	1,881,824,909.40
应付质押保证金	六、14	107,915,496.00	33,037,880.00
交易性金融负债			
期货风险准备金	六、15	28,568,868.18	27,290,748.90
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款			
预收款项			
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、17.(1)	48,255.89	129,262.62
应付手续费及佣金			
应付职工薪酬	六、18.(1)	10,522,874.08	16,267,869.50
应交税费	六、19	951,520.08	1,709,645.42
其他应付款	六、20.(1)	28,058,178.18	24,152,623.27
其中：应付利息			
应付股利			
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债	六、21	893,290,000.00	476,150,268.49
流动负债合计		3,292,620,871.65	2,460,563,207.60
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	六、11.(1)	21,250.00	21,250.00
其他非流动负债			
非流动负债合计		21,250.00	21,250.00
负债合计		3,292,642,121.65	2,460,584,457.60
所有者权益（或股东权益）：			
股本	六、22	550,000,000.00	550,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	六、23	22,875,662.30	22,875,662.30
减：库存股			
其他综合收益			
专项储备			
盈余公积	六、24	12,949,705.48	12,949,705.48
一般风险准备	六、25	16,520,971.41	16,520,971.41
未分配利润	六、26.(1)	113,527,990.03	111,152,397.08
归属于母公司所有者权益合计		715,874,329.22	713,498,736.27
少数股东权益			
股东权益合计		715,874,329.22	713,498,736.27
负债和股东权益总计		4,008,516,450.87	3,174,083,193.87

法定代表人：严若中

主管会计工作负责人：严若中

会计机构负责人：吴超雄

（二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
流动资产：			
货币资金	六、1.(1)	781,281,221.32	1,313,763,372.86
其中：期货保证金存款	六、1.(1)	776,693,129.44	1,303,720,129.82
应收货币保证金	六、2.(1)	1,531,081,269.07	703,003,945.99
应收质押保证金	六、2.(1)	107,915,496.00	33,037,880.00
存出保证金			
交易性金融资产		596,205,264.71	570,396,558.17
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	六、5	10,000,000.00	10,000,000.00

应收风险损失款		93,095.00	5,839.47
应收佣金			
其他应收款		2,690,702.41	2,374,236.08
其中：应收利息			
应收股利			
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			
流动资产合计		3,029,267,048.51	2,632,581,832.57
非流动资产：			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资		100,000,000.00	100,000,000.00
其他权益工具投资			
期货会员资格投资	六、8.(1)	1,400,000.00	1,400,000.00
其他非流动金融资产			
投资性房地产			
固定资产		4,025,530.15	1,971,686.05
在建工程			
使用权资产			
无形资产		1,331,561.47	1,468,668.61
开发支出			
商誉			
长期待摊费用			
递延所得税资产		605,776.59	605,776.59
其他非流动资产		6,009,656.39	5,256,469.58
非流动资产合计		113,372,524.60	110,702,600.83
资产总计		3,142,639,573.11	2,743,284,433.40
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		2,273,107,142.11	1,953,032,691.10
应付质押保证金		107,915,496.00	33,037,880.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		28,568,868.18	27,290,748.90
衍生金融负债			
应付票据			
应付账款			
预收款项			
卖出回购金融资产款			

应付期货投资者保障基金		48,255.89	129,262.62
应付手续费及佣金			
应付职工薪酬		10,067,885.57	15,262,232.63
应交税费		949,020.96	681,813.05
其他应付款		7,087,658.14	8,347,342.14
其中：应付利息			
应付股利			
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		2,427,744,326.85	2,037,781,970.44
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	六、11.(1)	21,250.00	21,250.00
其他非流动负债			
非流动负债合计		21,250.00	21,250.00
负债合计		2,427,765,576.85	2,037,803,220.44
所有者权益（或股东权益）：			
股本	六、22	550,000,000.00	550,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	六、23	22,875,662.30	22,875,662.30
减：库存股			
其他综合收益			
专项储备			
盈余公积		12,949,705.48	12,949,705.48
一般风险准备		16,058,201.28	16,058,201.28
未分配利润		112,990,427.20	103,597,643.90
股东权益合计		714,873,996.26	705,481,212.96
负债和股东权益总计		3,142,639,573.11	2,743,284,433.40

法定代表人：严若中

主管会计工作负责人：严若中

会计机构负责人：吴超雄

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
一、营业收入		1,149,944,069.56	1,525,051,938.67
手续费及佣金净收入	六、27	28,363,741.02	28,450,077.21
其中：经纪业务手续费收入		25,562,385.77	26,521,934.58
资产管理业务收入		2,465,034.49	303,331.32
投资咨询业务收入		336,320.76	1,624,811.31
代理销售金融产品收入			
其他代理业务收入			
利息净收入	六、28	18,881,680.67	18,085,735.89
其中：利息收入	六、28	30,477,924.76	20,820,677.30
利息支出	六、28	11,596,244.09	2,734,941.41
投资收益（损失以“-”号填列）	六、29	-8,788,163.97	14,227,803.88
其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
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			
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六、30	4,975,402.09	-1,597,547.69
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入	六、31	1,106,511,409.75	1,465,885,869.38
其中：风险管理业务收入	六、31	1,106,511,409.75	1,465,885,869.38
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
二、营业支出		1,147,311,456.91	1,514,275,356.24
提取期货风险准备金	六、32	1,278,119.28	1,348,043.70
税金及附加	六、33	520,534.24	272,337.12
业务及管理费	六、34	52,146,390.96	44,326,799.37
研发费用			
信用减值损失			
其他资产减值损失	六、35		3,746,261.42
其他业务成本	六、36	1,093,366,412.43	1,464,581,914.63
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		2,632,612.65	10,776,582.43
加：营业外收入	六、37	1,334,608.74	566,168.14
减：营业外支出	六、38	6,660.43	1,573.83
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,960,560.96	11,341,176.74
减：所得税费用	六、39	1,584,968.01	1,349,741.27
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,375,592.95	9,991,435.47
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）		2,375,592.95	9,991,435.47
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)		2,375,592.95	9,991,435.47
六、其他综合收益的税后净额			
(一) 归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额			
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			
(1) 权益法下可转损益的其他综合收益			
(2) 其他债权投资公允价值变动			
(3) 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
(4) 其他债权投资信用损失准备			
(5) 现金流量套期储备			
(6) 外币财务报表折算差额			
(7) 其他			
(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		2,375,592.95	9,991,435.47
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		2,375,592.95	9,991,435.47
(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		0.004	0.018
(二) 稀释每股收益			

法定代表人: 严若中

主管会计工作负责人: 严若中

会计机构负责人: 吴超雄

(四) 母公司利润表

单位: 元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
一、营业收入		55,854,299.78	53,293,012.17
手续费及佣金净收入	六、27	28,363,741.02	28,186,982.46
其中: 经纪业务手续费收入		25,562,385.77	26,258,839.83
资产管理业务收入		2,465,034.49	303,331.32
投资咨询业务收入		336,320.76	1,624,811.31
代理销售金融产品收入			

其他代理业务收入			
利息净收入		18,331,854.35	18,337,915.72
其中：利息收入		19,571,057.25	20,196,537.36
利息支出		1,239,202.90	1,858,621.64
投资收益（损失以“-”号填列）		8,709,532.36	7,292,256.68
其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
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			
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		449,172.05	-524,142.69
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入			
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
二、营业支出		46,235,633.04	43,828,455.61
提取期货风险准备金	六、32	1,278,119.28	1,348,043.70
税金及附加		104,256.56	137,546.27
业务及管理费		44,853,257.20	42,342,865.64
研发费用			
信用减值损失			
其他资产减值损失			
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		9,618,666.74	9,464,556.56
加：营业外收入		1,325,756.57	566,168.14
减：营业外支出	六、38	6,660.43	1,573.83
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,937,762.88	10,029,150.87
减：所得税费用		1,544,979.58	1,076,581.19
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,392,783.30	8,952,569.68
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		9,392,783.30	8,952,569.68
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额			
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动			
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益			
1. 权益法下可转损益的其他综合收益			
2. 其他债权投资公允价值变动			
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备			

5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		9,392,783.30	8,952,569.68
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		0.02	0.02
（二）稀释每股收益			

法定代表人：严若中

主管会计工作负责人：严若中

会计机构负责人：吴超雄

（五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			6,973,759.14
销售商品、提供劳务收到的现金		783,987,242.43	414,432,177.46
收取利息、手续费及佣金的现金		49,235,648.01	74,707,534.85
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、40	15,859,035.91	12,051,535.26
经营活动现金流入小计		849,081,926.35	508,165,006.71
为交易目的而持有的金融资产净增加额		23,051,962.23	
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		658,570,601.87	359,477,728.42
支付利息、手续费及佣金的现金			
以现金支付的业务及管理费		27,187,944.69	20,476,811.74
支付给职工以及为职工支付的现金		39,065,032.26	30,416,636.80
支付的各项税费		3,335,626.43	3,585,100.97
支付其他与经营活动有关的现金	六、40	525,153,330.98	77,771,921.18
经营活动现金流出小计		1,276,364,498.46	491,728,199.11
经营活动产生的现金流量净额		-427,282,572.11	16,436,807.60
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,914,655.22	163,710,958.90
取得投资收益收到的现金			3,470,036.65
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
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		1,914,655.22	167,180,995.55
投资支付的现金		2,132,956.00	53,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		5,588,277.21	2,114,179.87
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		7,721,233.21	55,114,179.87
投资活动产生的现金流量净额		-5,806,577.99	112,066,815.68
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			
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		70,000,000.00	130,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		12,529,356.68	7,611,593.52
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			
筹资活动现金流出小计		82,529,356.68	137,611,593.52
筹资活动产生的现金流量净额		-82,529,356.68	-137,611,593.52
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		-515,618,506.78	-9,107,970.24
加：期初现金及现金等价物余额		1,315,612,758.89	1,317,506,367.70
六、期末现金及现金等价物余额		799,994,252.11	1,308,398,397.46

法定代表人：严若中
雄

主管会计工作负责人：严若中

会计机构负责人：吴超

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年1-6月	2019年1-6月
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			
销售商品、提供劳务收到的现金			
收取利息、手续费及佣金的现金		48,069,920.90	74,323,454.63
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		2,302,045.19	949,842.16
经营活动现金流入小计		50,371,966.09	75,273,296.79
为交易目的而持有的金融资产净增加额		16,650,002.13	16,162,185.12
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			
以现金支付的业务及管理费		21,879,281.78	20,190,288.86
支付给职工以及为职工支付的现金		36,541,590.13	28,624,981.19
支付的各项税费		1,856,219.35	3,197,292.90
支付其他与经营活动有关的现金		500,494,892.02	56,609,672.11
经营活动现金流出小计		577,421,985.41	124,784,420.18

经营活动产生的现金流量净额		-527,050,019.32	-49,511,123.39
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金			146,710,958.90
取得投资收益收到的现金			2,931,763.16
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
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			149,642,722.06
投资支付的现金			36,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		5,432,132.22	2,096,514.87
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		5,432,132.22	38,096,514.87
投资活动产生的现金流量净额		-5,432,132.22	111,546,207.19
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			130,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金			5,270,520.55
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计			135,270,520.55
筹资活动产生的现金流量净额			-135,270,520.55
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		-532,482,151.54	-73,235,436.75
加：期初现金及现金等价物余额		1,313,763,372.86	1,316,612,542.36
六、期末现金及现金等价物余额		781,281,221.32	1,243,377,105.61

法定代表人：严若中

主管会计工作负责人：严若中

会计机构负责人：吴超雄

财务报表附注

● 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	√是 □否	四、27
2. 半年度报告所采用的会计估计与上年度财务报表是否变化	□是 √否	
3. 是否存在前期差错更正	□是 √否	
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	□是 √否	
5. 存在控制关系的关联方是否发生变化	√是 □否	七
6. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	√是 □否	八
7. 是否存在证券发行、回购和偿还情况	□是 √否	
8. 是否存在向所有者分配利润的情况	□是 √否	
9. 是否根据会计准则的相关规定披露分部报告	√是 □否	九
10. 是否存在半年度资产负债表日至半年度财务报告批准报出日之间的非调整事项	□是 √否	
11. 是否存在上年度资产负债表日以后所发生的或有负债和或有资产变化情况	□是 √否	
12. 是否存在企业结构变化情况	□是 √否	
13. 重大的长期资产是否转让或者出售	□是 √否	
14. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	□是 √否	
15. 是否存在重大的研究和开发支出	□是 √否	
16. 是否存在重大的资产减值损失	□是 √否	
17. 是否存在预计负债	□是 √否	

● 报表项目注释

一、 公司的基本情况

广州期货股份有限公司(以下简称公司)前身为冠华期货经纪有限公司,成立于2003年8月,成立时注册资本30,000,000.00元,2009年12月11日中国证券监督管理委员会以证监许可【2009】1348号文批准原股东将公司100%的股权转让给广州证券有限责任公司。2010年2月4日,公司完成股东变更的工商登记。2010年7月5日中国证监会广东监管局以广东证监许可【2010】127号文批准公司将住所地由成都迁往广州。

2010年7月23日中国证券监督管理委员会以证监许可【2010】979号文批准公司增资至127,920,000.00元。2010年8月16日经广州市工商行政管理局核准,公司名称变更为广州期货有限公司。2010年9月6日,公司完成增资、更名、迁址的工商登记,取得由广州市工商行政管理局核发的440101000126377号营业执照。2012年11月15日经中国证券监督管理委员会批准取得了期货投资咨询业务资格,2015年1月22日经中国期货业协会备案登记,取得了期货公司资产管理业务资格。2015年7月29日,广州证券股份有限公司和广州越秀金融控股集团有限公司分别以货币资金197,479,200.00元、3,500,000.00元对广州期货有限公司增资,其中列入注册资本的款项分别为159,257,419.35元、2,822,580.65元,列入资本公积的款项分别为38,221,780.65元、

677,419.35元。本次增资后,公司注册资本增至人民币290,000,000.00元,广州证券股份有限公司和广州越秀金融控股集团有限公司持股比例变更为99.03%和0.97%,公司类型由有限责任公司(法人独资)变更为其他有限责任公司。

2015年8月11日经公司2015年第1次临时股东会议决议,将广州期货有限公司整体变更为股份有限公司,2015年9月16日,公司股东会决议以2015年7月31日为基准日,经审计的广州期货有限公司账面净资产359,984,158.10元折合为广州期货股份有限公司实收股本350,000,000.00股,折余部分扣除一般风险准备3,108,495.80元后,余额6,875,662.30元作为股本溢价计入股份公司的资本公积,各股东的股权比例保持不变。2015年9月23日,信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)出具XYZH/2015GZA10098号《验资报告》。2015年10月15日,公司取得了广州市工商行政管理局核发的统一社会信用代码为9144010171093174XF的《营业执照》。

2016年9月13日经公司第三次临时股东大会决议和修改后的章程规定,公司申请增加注册资本人民币200,000,000.00元,广州证券股份有限公司缴纳新增出资额人民币213,904,800.00元,其中增加注册资本198,060,000.00元,增加资本公积15,844,800.00元;广州越秀金融控股集团有限公司缴纳新增出资额人民币2,095,200.00元,其中增加注册资本1,940,000元,增加资本公积155,200.00元。本次增资后,公司注册资本增至人民币550,000,000.00元,广州证券股份有限公司和广州越秀金融控股集团有限公司持股仍为99.03%和0.97%。

2016年12月19日,广州期货收到全国中小股份转让系统有限责任公司出具的《关于同意广州期货股份有限公司股票在全国中小企业股份转让系统挂牌的函》,同意广州期货股票在全国中小企业股份转让系统(即“新三板”)挂牌,转让方式为协议转让。2017年1月4日,广州期货正式挂牌新三板,股票代码为870367。

2020年1月8日,广州证券股份有限公司(现已更名为中信证券华南股份有限公司)将其持有的公司99.03%股份转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司,并在中国证券登记结算有限责任公司北京分公司完成过户登记手续办理,公司控股股东变更为“广州越秀金融控股集团股份有限公司”。本次股权变更完成后,公司股东2名,分别为广州越秀金融控股集团股份有限公司(持股99.03%),广州越秀金融控股集团有限公司(持股0.97%)。

公司住所:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼第1007房、1008房、1009房、1010房、1011房、1012房。

公司总部地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼第1007房、1008房、1009房、1010房、1011房、1012房。

法定代表人:严若中。

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。

二、合并财务报表范围

报告期内,公司除广州期货总部外,共设有23家分支机构:成都营业部、佛山南海

营业部、清远营业部、上海陆家嘴营业部、北京分公司、深圳营业部、武汉营业部、长沙营业部、杭州营业部、东莞营业部、天津营业部、广州体育中心营业部、杭州城星路营业部、郑州营业部、厦门营业部、苏州营业部、肇庆营业部、山东分公司、重庆营业部、青岛分公司、四川分公司、广东金融高新区分公司、湖北分公司；一家全资子公司：广期资本管理（深圳）有限公司。

详见本附注“七、合并范围的变化”相关内容。

三、 财务报表的编制基础

1. 编制基础

公司财务报表以持续经营为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部颁布的《企业会计准则》及相关规定,并基于本附注“四、重要会计政策及会计估计”所述会计政策和会计估计编制。

2. 持续经营

公司自本报告期末至少12个月内具备持续经营能力,无影响持续经营能力的重大事项。因此,公司财务报表以持续经营为基础编制。

四、 重要会计政策及会计估计

1. 遵循企业会计准则的声明

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

2. 会计年度

公司会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

3. 营业周期

本公司以12个月为营业周期,营业周期起止日为1月1日至12月31日。

4. 记账本位币

公司以人民币为记账本位币。

5. 记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础进行会计确认、计量和报告。在将符合确认条件的会计要素(即:资产、负债、所有者权益、收入、费用和利润)登记入账并列报于财务报表时,按照企业会计准则规定的计量属性进行计量。主要会计计量属性包括历史成本、重置成本、可变现净值、现值和公允价值。在对会计要素进行计量时,一般采用历史成本,当能够保证取得并可靠计量会计要素的金额时,采用公允价值、重置成本、可变现净值或现值。

6. 现金流量表之现金及现金等价物的确定标准

现金,是指企业库存现金以及可以随时用于支付的存款。不能随时用于支付的存款不

属于现金。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。

7. 营业部的资金管理、交易清算原则

公司对营业部实行统一结算、统一风险控制、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算。

营业部的交易清算由总部统一进行。

8. 外币业务折算

对于发生的外币经济业务,初始确认采用交易发生日的即期汇率将外币金额折算为记帐本位币金额。

在资产负债表日,外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率计算,由此产生的汇兑差额,除了按照企业会计准则的规定,与购建或生产符合资本化条件的资产相关的外币借款产生的汇兑差额予以资本化外,均计入当期损益。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,不改变其记帐本位币金额;以公允价值计量的非货币性项目,如果期末的公允价值以外币反映,将该外币按照公允价值确定当日的即期汇率折算,折算后的记帐本位币金额与原记帐本位币金额的差额,作为公允价值变动损益,计入当期损益或资本公积。

9. 金融资产和金融负债

本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。

(1) 金融资产

1) 金融资产分类、确认和计量

金融资产在初始确认计量时,根据企业管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,将金融资产分为以下三类: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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以常规方式买卖金融资产,按交易日会计进行确认和终止确认。

本公司管理金融资产的业务模式,是指公司如何管理其金融资产以产生现金流量。业务模式决定公司所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。

金融资产的合同现金流量特征,是指金融工具合同约定的,反映相关金融资产经济特征的现金流量属性。以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致。

2) 以摊余成本计量的金融资产

金融资产同时满足以下条件的,分类为以摊余成本计量的金融资产:①本公司管理金

融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;②该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和未偿付本金金额为基础的利息的支付。

以摊余成本计量的金融资产以取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额,采用实际利率法按摊余成本进行后续计量,所产生的利得或损失,在终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时,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金融资产

①以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产(债务工具)

金融资产同时满足以下条件的,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(债务工具): a. 本公司管理金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标; b. 该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产(债务工具)按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额,并按公允价值进行后续计量,产生的所有利得或损失,除减值损失或利得和汇兑损益计入当期损益外,均计入其他综合收益,直至该金融资产终止确认或被重分类。

采用实际利率法计算的该金融资产的利息计入当期损益,该金融资产计入各期损益的金额与视同其一直按摊余成本计量而计入各期损益的金额相等,该金融资产终止确认时,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。

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(权益工具)

在初始确认时,本公司可以将非交易性权益工具投资指定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(权益工具)。该指定一经做出,不得撤销。该金融资产的股利收入,计入当期损益,当该金融资产终止确认时,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

分类为以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产之外的金融资产,本公司将其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。

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初始确认及后续计量,相关交易费用直接计入当期损益,公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

(2) 金融资产转移的确认和计量

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止。

2) 该金融资产已转移,且本公司将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

3) 该金融资产已转移,虽然本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,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产转移满足上述(2)、(3)点的,除应当终止确认该金融资产外,还应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。

若本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,且未放弃对该金融资产的控制的,则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。继续涉入所转移金融资产的程度,是指该金融资产价值变动使企业面临的风险水平。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,将所转移金融资产的账面价值,与因转移而收到的对价及原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额计入当期损益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的,将所转移金融资产整体的账面价值,在终止确认部分和未终止确认部分之间,按照转移日各自的相对公允价值进行分摊,并将因转移而收到的对价及应分摊至终止确认部分的原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和,与分摊的前述账面金额的差额计入当期损益。

(3) 金融资产减值

本公司以预期信用损失为基础,对除了以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,进行减值会计处理并确认减值准备。

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,是指本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。

在计量预期信用损失时,本公司需考虑的最长期间为企业面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

对于金融资产发生信用减值的过程分为三个阶段:

第一阶段:在资产负债表日信用风险较低的金融工具,或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具,本公司按照相当于该金融工具未来12个月内(若预期存续期少于12个月,则为预期存续期内)预期信用损失的金额计量其损失准备;

第二阶段:自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具,但未发生信用减值,即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据,按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备;

第三阶段:初始确认后已发生信用减值的金融工具,按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

未来12个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

本公司在进行相关评估时,应当考虑所有合理且有依据的信息,包括前瞻性信息。为确认金融工具自初始确认后信用风险显著增加即确认整个存续期预期信用损失,本公司在一些情况下应当以组合为基础考虑评估信用风险是否显著增加。整个存续期预期信用损失,是指金融工具整个预期存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产,本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。在每个资产负债表日,本公司将整个存续期内预期信用损失的变动金额作为减值损失或利得计入当期损益。

(4) 金融负债

1) 金融负债分类、确认和计量

除下列各项外,本公司将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债:

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,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;

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不属于以上①和②的财务担保合同,以及不属于①低于市价市场利率贷款的贷款承诺。

本公司初始确认金融负债,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负债,相关交易费用应当直接计入当期损益;对于其他类别的金融负债,相关交易费用应当直接计入初始确认金额。

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进行后续计量,除由本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计入其他综合收益外,其他公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利和利息支出计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法,按摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益。

2) 金融负债终止确认条件

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。本公司与债权人之间签订协议,以承担新金融负债方式替换现存金融负债,且新金

融负债与现存金融负债的合同条款实质上不同的,终止确认现存金融负债,并同时确认新金融负债。本公司对现存金融负债全部或部分的合同条款作出实质性修改的,终止确认现存金融负债或其一部分,同时将修改条款后的金融负债确认为一项新金融负债。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

3) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

本公司以主要市场的价格计量金融资产和金融负债的公允价值,不存在主要市场的,以最有利市场的价格计量金融资产和金融负债的公允价值,并且采用当时适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。公允价值计量所使用的输入值分为三个层次,即第一层次输入值是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;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;第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本公司优先使用第一层次输入值,最后再使用第三层次输入值。公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重大意义的输入值所属的最低层次决定。

10. 存货

(1) 存货的分类及计价方法

本公司持有的存货主要为与交易所交易品种相关的库存商品。存货的计价根据批次认定,采用个别认定法,如果无法进行批次认定的,则采用先进先出法计价。

(2) 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。

(3) 存货的盘存制度为永续盘存制。

11. 应收款项坏账准备的确认标准、核算方法

应收款项分为含重大融资成分的应收款项和不含重大融资成分的应收款项,含重大融资成分的应收款项按照金融资产减值的测试方法计提减值准备,不含重大融资成分的应收款项按照简化模型考虑信用损失,遵循单项和组合法计提的方式。

12. 受托理财业务的确认和计量

公司的受托理财业务,包括集合资产管理业务、定向资产管理业务和专项资产管理业务。公司受托经营集合资产管理业务、定向资产管理业务和专项资产管理业务,以托管客户或集合计划为主体,独立建账,独立核算,不在本公司财务报表内列示。

13. 客户保证金的管理与核算方法

公司财务部门设置应付货币保证金科目进行明细核算,结算部为每一个客户单独开立专门帐户、设置交易编码,按单个客户进行明细核算。

14. 质押品的管理和核算

公司办理质押品登记业务的部门设置质押品登记簿,按单个客户逐笔登记发生的质押业务。

公司财务部门设置应收质押保证金科目,核算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;设置应付质押保证金科目按客户核算客户质押有价证券时交易所核定的充抵保证金金额。

15. 实物交割的核算方法

代理买方客户进行实物交割的,依据交易所交割单据,按实际划转支付的交割货款(含增值税额,下同),借记应付货币保证金科目,贷记应收货币保证金科目。

代理卖方客户进行实物交割的,依据交易所交割单据,按实际划转收到的交割货款,借记应收货币保证金科目,贷记应付货币保证金科目。

16. 固定资产

固定资产是指公司为提供劳务、出租或经营管理而持有的、使用年限超过一年的有形资产。

固定资产包括房屋及建筑物、电子设备、运输设备和其他,按其取得时的成本作为入账的价值,其中,外购的固定资产成本包括买价和进口关税等相关税费,以及为使固定资产达到预定可使用状态前所发生的可直接归属于该资产的其他支出;自行建造固定资产的成本,由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成;投资者投入的固定资产,按投资合同或协议约定的价值作为入账价值,但合同或协议约定价值不公允的按公允价值入账;融资租赁租入的固定资产,按租赁开始日租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值两者中较低者作为入账价值。

与固定资产有关的后续支出,包括修理支出、更新改造支出等,符合固定资产确认条件的,计入固定资产成本,对于被替换的部分,终止确认其账面价值;不符合固定资产确认条件的,于发生时计入当期损益。

除已提足折旧仍继续使用的固定资产和单独计价入账的土地外,公司对所有固定资产计提折旧。计提折旧时采用平均年限法,并根据用途分别计入相关资产的成本或当期费用。

公司固定资产的分类折旧年限、预计净残值率、折旧率如下:

类别	折旧年限(年)	预计残值率(%)	年折旧率(%)
电子设备	5	3	19.4
运输设备	5	3	19.4
其他设备	5	3	19.4

公司于每年年度终了,对固定资产的预计使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核,如发生改变,则作为会计估计变更处理。

当固定资产被处置、或者预期通过使用或处置不能产生经济利益时,终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的金额计入当期损益。

17. 长期待摊费用

公司长期待摊费用是指已经支出,但应由当期及以后各期承担的摊销期限在1年以上(不含1年)的各项费用,该等费用在受益期内平均摊销。如果长期待摊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。

18. 职工薪酬

本公司职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期福利。

短期薪酬主要包括职工工资、奖金、津贴和补贴、职工福利费、医疗保险费、生育保险费、工伤保险费、住房公积金、工会经费和职工教育经费、非货币性福利、短期利润分享计划及其他短期薪酬,在职工提供服务的会计期间,将实际发生的短期薪酬确认为负债,并按照受益对象计入当期损益或相关资产成本。

离职后福利主要包括基本养老保险费、失业保险等,按照公司承担的风险和义务,分类为设定提存计划。对于设定提存计划在根据在资产负债表日为换取职工在会计期间提供的服务而向单独主体缴存的提存金确认为负债,并按照受益对象计入当期损益或相关资产成本。

公司按规定参加由政府机构设立的职工社会保障体系,包括基本养老保险、医疗保险、住房公积金及其他社会保障制度,相应的支出于发生时计入相关资产成本或当期损益。

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系,或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议的,在下列两者孰早日确认因解除与职工的劳动关系给予补偿而产生的职工薪酬负债,并计入当期损益:(1)企业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)企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。内部退养福利是对未达到国家规定退休年龄,经本公司管理层批准,向自愿退出工作岗位休养的员工支付的各项福利费用。本公司自员工内部退养安排开始之日起至国家正式退休年龄止,向接受内部退养安排的境内机构员工支付内部退养福利。

对内部退养福利,本公司比照辞退福利进行会计处理,在符合确认条件时,将自职工停止提供服务日至正常退休日期间拟支付的内部退养福利,确认为负债,计入当期损益。

19. 预计负债

当与对外担保、未决诉讼或仲裁等或有事项相关的业务同时符合以下条件时,公司将其确认为负债:该义务是本公司承担的现时义务;该义务的履行很可能导致经济利益流出企业;该义务的金额能够可靠地计量。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量,并综合考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。货币时间价值影响重大的,通过对相关未来现金流出进行折现后确定最佳估计数。每个资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核,如有改变则对账面价值进行调整以反映当前最佳估计数。

20. 风险准备金核算方法

按期货经纪业务向客户收取的手续费减去付期货交易所手续费后的净手续费收入的5%提取风险准备金。错单合约平仓产生的盈亏、因公司自身原因造成的风险损失、因客户责任造成的风险损失难以收回予以核销部分,按成交结算单列明金额,并说明原因,经领导签字后在本科目核算。风险准备金不足弥补的损失计入当期损益。

21. 收入确认原则

(1) 期货经纪业务手续费净收入

以向客户收取的手续费减去付期货交易所手续费后的净手续费计算手续费净收入,结算部门执行当日无负债结算制度,每天交易结束后根据客户成交纪录从客户资金中收取手续费。

(2) 资产管理业务收入

资产管理业务管理费收入于与委托人结算时,按合同规定的比例计算应由公司享有的管理费收益,在业务提供的相关服务已经完成时确认为当期收益,业绩报酬收入在符合合同约定的业绩报酬计提条件时,在委托资产运作终止日或资产管理合同约定的时点予以提取并确认收入。

(3) 利息净收入

在相关的收入金额能够可靠计量,相关的经济利益能够收到时,按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

(4) 其他收入

其他业务收入主要是指除以上主营业务活动以外的其他业务活动而实现的收入,主要包括风险管理子公司仓单服务、基差贸易类的销售收入,其收入确认原则为:

当在与客户之间的合同同时满足下列条件时,公司应当在客户取得相关商品控制权时确认收入:

- 1) 合同各方已批准该合同并承诺将履行各自义务;
- 2) 该合同明确了合同各方与所转让商品或提供劳务(以下简称“转让商品”)相关的权利和义务;
- 3) 该合同有明确的与所转让商品相关的支付条款;
- 4) 该合同具有商业实质,即履行该合同将改变企业未来现金流量的风险、时间分布

或金额;

5) 公司因向客户转让商品而有权取得的对价很可能收回。

在合同开始日即满足前款条件的合同,公司在后续期间无需对其进行重新评估,除非有迹象表明相关事实和情况发生重大变化。对于不符合上述条件的合同,公司只有在不再负有向客户转让商品的剩余义务,且已向客户收取的对价无需退回时,才能将已收取的对价确认为收入;否则,应当将已收取的对价作为负债进行会计处理。

22. 政府补助

政府补助在公司能够满足其所附的条件以及能够收到时予以确认。政府补助为货币性资产的,按照实际收到的金额计量,对于按照固定的定额标准拨付的补助,按照应收的金额计量;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(1元)计量。

与资产相关的政府补助确认为递延收益,并在相关资产使用寿命内平均分配计入当期损益。与收益相关的政府补助,用于补偿以后期间的相关费用或损失的,确认为递延收益,并在确认相关费用的期间计入当期损益;用于补偿已发生的相关费用或损失的,直接计入当期损益。

23. 递延所得税资产和递延所得税负债

递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与其账面价值的差额(暂时性差异)计算确认。对于按照税法规定能够于以后年度抵减应纳税所得额的可抵扣亏损和税款抵减,视同暂时性差异确认相应的递延所得税资产。于资产负债表日,递延所得税资产和递延所得税负债,按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。

公司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,确认由可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产。对已确认的递延所得税资产,当预计到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时,应当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,减记的金额予以转回。

24. 所得税的会计核算

所得税的会计核算采用资产负债表债务法。所得税费用包括当期所得税和递延所得税。除将与直接计入股东权益的交易和事项相关的当期所得税和递延所得税计入股东权益,以及企业合并产生的递延所得税调整商誉的账面价值外,其余的当期所得税和递延所得税费用或收益计入当期损益。

当期所得税是指企业按照税务规定计算确定的针对当期发生的交易和事项,应交纳给税务部门的金额,即应交所得税;递延所得税是指按照资产负债表债务法应予确认的递延所得税资产和递延所得税负债在期末应有的金额相对于原已确认金额之间的差额。

25. 一般风险准备提取和使用核算方法

按净利润的10%提取风险准备金,用于风险的补偿。风险准备金不得用于分红、转增资本。

26. 分部信息

公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部。经营分部,是指公司内同时满足下列条件的组成部分:该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;公司能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

分部间转移价格参照市场价格确定,共同费用除无法合理分配的部分外按照收入比例在不同的分部之间分配。

27. 重要会计政策会计估计变更

(1) 重要会计政策变更

本公司自2020年1月1日起执行财政部于2017年修订的企业会计准则第14号—收入》(以下简称“新收入准则”),新收入准则将现行收入和建造合同两项准则纳入统一的收入确认模型;以控制权转移替代风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准;对于包含多重交易安排的合同的会计处理提供更明确的指引;对于某些特定交易(或事项)的收入确认和计量给出了明确规定。

根据新收入准则的新旧准则衔接规定,公司自2020年1月1日起执行新收入准则,根据首次执行新收入准则的累积影响数,调整当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额,对可比期间信息不予调整。执行新收入准则预计不会对公司经营成果产生重大影响,亦不会导致本公司收入确认方式发生重大变化,不会对财务报表产生重大影响。

本次会计政策变更是因按照国家财政部发布的相关企业会计准则而进行的变更,不会对公司损益、总资产、净资产产生重大影响,不涉及以前的年度追溯调整。

(2) 重要会计估计变更

无。

五、 税项

1、主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	手续费收入、服务费收入、咨询费收入等	6%、10%、16%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育费附加	应缴流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%

根据《中华人民共和国企业所得税法》及国税发[2012]57号《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理暂行办法》的规定,公司执行“统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库”的企业所得税征收管理办法。

根据财税(2018)32号《关于调整增值税税率的通知》,自2018年5月1日起,纳税人发生增值税应税销售行为或者进口货物,原适用17%和11%税率的,税率分别调整为16%、10%。公司自2018年5月1日起根据各业务范围分别适用新税率。

2、税收优惠及批文

(1) 根据国家税务总局公告2012年第15号《关于企业所得税应纳税所得额若干税务处理问题的公告》,从事代理服务、主营业务收入为手续费、佣金的企业(如证券、期货、保险代理等企业),其为取得该类收入而实际发生的营业成本(包括手续费及佣金支出),准予在企业所得税前据实扣除。

(2) 根据财税[2017]23号《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》,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,准予在企业所得税税前扣除。自2016年1月1日起至2020年12月31日止执行。

(3) 根据财税[2017]23号《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》,期货公司依据《期货投资者保障基金管理办法》(证监会令第38号、第129号)和《关于明确期货投资者保障基金缴纳比例有关事项的规定》(证监会财政部公告〔2016〕26号)的有关规定,从其收取的交易手续费中按照代理交易额的亿分之五至亿分之十的比例(2016年12月8日前按千万分之五至千万分之十的比例)缴纳的期货投资者保障基金,在基金总额达到有关规定的额度内,准予在企业所得税税前扣除。自2016年1月1日起至2020年12月31日止执行。

六、 合并会计报表主要项目注释

下列所披露的财务报表数据,除特别注明之外,“期初”系指2020年1月1日,“期末”系指2020年06月30日,“本期”系指2020年1月1日至06月30日,“上期”系指2019年1月1日至06月30日,除另有注明外,货币单位为人民币元。

1. 货币资金

(1) 明细项目

项目	期末金额		
	原币	折算汇率	折合人民币
库存现金	16,290.26	1	16,290.26
其中:人民币	16,290.26	1	16,290.26
银行存款	1,527,277,961.85	1	1,527,277,961.85
客户存款	776,693,129.44	1	776,693,129.44
其中:人民币	776,693,129.44		776,693,129.44
自有存款	750,584,832.41	1	750,584,832.41
其中:人民币	750,584,832.41		750,584,832.41
其他货币资金	38,550,000.00	1	38,550,000.00
合计	1,565,844,252.11	1	1,565,844,252.11

(续)

项目	期初金额		
	原币	折算汇率	折合人民币
库存现金	17,491.85	1.00	17,491.85
其中:人民币	17,491.85	1.00	17,491.85
银行存款	1,755,595,267.04	1.00	1,755,595,267.04
客户存款	1,303,720,129.82	1.00	1,303,720,129.82
其中:人民币	1,303,720,129.82	1.00	1,303,720,129.82
自有存款	451,875,137.22	1.00	451,875,137.22
其中:人民币	451,875,137.22	1.00	451,875,137.22
合计	1,755,612,758.89	1.00	1,755,612,758.89

(2) 期货保证金存款明细

银行名称	期末金额		期初金额	
	币种	本位币	币种	本位币
光大银行广州分行	RMB	15,706,726.49	RMB	12,718,133.28
交通银行广州五羊支行	RMB	89,161,340.24	RMB	75,203,609.19

银行名称	期末金额		期初金额	
	币种	本位币	币种	本位币
交通银行郑州期货大厦支行	RMB	31,550,623.64	RMB	79,227,026.15
浦发银行大连期货大厦支行	RMB	1,145,684.48	RMB	1,080,662.10
浦发银行广州中大支行	RMB	11,298,569.03	RMB	11,677,508.65
浦发银行上海期交所支行	RMB	1,136,966.97	RMB	151,829,572.10
浦发银行郑州期货大厦支行	RMB	1,353,209.17	RMB	11,825,113.52
兴业银行广州分行	RMB	14,500,583.15	RMB	42,842,237.45
兴业银行郑州金水东路支行	RMB	30,926,233.00	RMB	121,659,460.92
中国工商银行大连商品交易所支行	RMB	737,453.85	RMB	40,039,003.82
中国工商银行广州南方支行	RMB	22,672,733.80	RMB	22,566,629.02
中国工商银行上海期货大厦支行	RMB	101,148.13	RMB	101,915.31
中国工商银行郑州未来支行	RMB	92,697.10	RMB	92,177.40
中国建设银行大连商品交易所支行	RMB	587,336.81	RMB	95,212.92
中国建设银行广州珠江新城支行	RMB	9,097,322.05	RMB	21,407,654.18
中国建设银行上海期货支行	RMB	80,801.90	RMB	80,934.06
中国建设银行郑州期货城支行	RMB	281,711.40	RMB	279,228.82
中国民生银行大连商品交易所支行	RMB	240,704,708.81	RMB	363,898,700.09
中国民生银行广州分行	RMB	75,565,838.08	RMB	63,532,229.01
中国民生银行上海期交所支行	RMB	164,305,478.84	RMB	234,320,227.12
中国农业银行广州天河东路支行	RMB	19,189,843.32	RMB	13,146,622.69
中国农业银行上海期货大厦支行	RMB	30,478.24	RMB	30,558.62
中国农业银行郑州未来支行	RMB	100,268.00	RMB	-
中国银行广州明月支行	RMB	29,057,857.00	RMB	17,828,862.69
中国银行上海市期货大厦支行	RMB	1,227,480.07	RMB	1,024,024.03
中国银行郑州商品交易所支行	RMB	1,063,495.47	RMB	1,053,684.97
中国招商银行广州体育东路支行	RMB	15,016,540.40	RMB	16,159,141.71
合计		776,693,129.44		1,303,720,129.82

(3) 自有存款截至期末金额, 子公司广期资本将 72,730.00 万元质押给银行开具银行承兑汇票, 除此之外的银行存款不存在抵押、冻结、封存、存放境外等或有潜在回收风险的款项。

(4) 其他货币资金为子公司广期资本开具银行承兑汇票存入银行的保证金。

2. 应收货币保证金

(1) 明细情况

交易所	期末金额		期初金额	
	应收货币保证金	应收质押保证金	应收货币保证金	应收质押保证金
上海期货交易所	446,845,367.72	27,961,536.00	253,610,571.67	10,192,760.00
大连商品交易所	393,379,608.56		178,888,504.69	
郑州商品交易所	238,818,217.38	30,934,080.00	96,040,213.84	22,845,120.00
中国金融期货交易所	332,678,840.93		149,136,506.84	
上海国际能源交易中心	119,359,234.48	49,019,880.00	25,328,148.95	
合计	1,531,081,269.07	107,915,496.00	703,003,945.99	33,037,880.00

3. 存出保证金

项目	期末金额	期初金额
券商三方存管保证金	-	6,000.00
交易保证金	51.89	1,322.86
衍生品保证金	2,470,049.58	2,367,049.76
合计	2,470,101.47	2,374,372.62

4. 交易性金融资产

项目	期末金额		期初金额	
	公允价值	初始成本	公允价值	初始成本
基金	554,543,475.31	554,538,482.52	541,257,488.27	540,229,957.57
其他	51,671,479.40	50,184,829.44	32,983,319.01	35,079,293.72
合计	606,214,954.71	604,723,311.96	574,240,807.28	575,309,251.29

注:截至期末金额中的基金主要为公司持有的货币基金,其分红方式为红利再投资。

5. 应收结算担保金

项目	期末金额	期初金额
中国金融期货交易所	10,000,000.00	10,000,000.00
合计	10,000,000.00	10,000,000.00

6. 其他应收款

(1) 其他应收款分类

类别	期末金额				期初金额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收账款								
按组合计提坏账准备的其他应收款								
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收账款	3,078,828.81	100.00			13,085,299.69	100.00		
合计	3,078,828.81	100.00			13,085,299.69	100.00		

(2) 截至期末,其他应收款余额较大单位情况

单位名称	金额	账龄	占其他应收款总额的比例(%)	款项性质
广州越秀城建国际金融中心有限公司	708,626.10	1-2年	23.02%	押金
广州越秀城建仲量联行物业服务服务有限公司	321,576.00	1-2年	10.44%	押金
苏州工业园区金鸡湖城市发展有限公司	111,292.50	2-3年	3.61%	押金
上海中国煤炭大厦有限责任公司	110,807.79	1-2年	3.60%	押金
新华地产开发公司	100,000.00	1-2年	3.25%	押金
合计	1,352,302.39		43.92%	

(3) 截至期末,公司无其他应收持公司5%(含5%)以上股份的股东单位的款项。

7. 存货

项目	期末金额	期初金额
库存商品账面余额	130,028,438.04	51,096,913.93
减: 存货跌价准备	-	-
合计	130,028,438.04	51,096,913.93

注: 期末库存商品全部为子公司广期资本管理(深圳)有限公司所持有, 其中有132,235,630.00元(含增值税)质押给上海期货交易所, 按80%充抵期货保证金105,788,504.00元。

8. 期货会员资格投资

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
上海期货交易所	500,000.00	-	-	500,000.00
大连商品交易所	500,000.00	-	-	500,000.00
郑州商品交易所	400,000.00	-	-	400,000.00
合计	1,400,000.00	-	-	1,400,000.00

9. 固定资产及累计折旧

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
一、账面原值合计:	9,001,478.50	2,511,879.48	227,907.00	11,285,450.98
其中: 电子设备	8,064,440.27	2,501,019.31	227,907.00	10,337,552.58
办公设备	243,561.23	10,860.17	-	254,421.40
运输工具	693,477.00	-	-	693,477.00
二、累计折旧合计:	6,981,098.79	443,168.04	221,246.57	7,203,020.26
其中: 电子设备	6,155,045.25	424,415.60	220,972.79	6,358,488.06
办公设备	153,380.85	18,752.44	273.78	171,859.51
运输工具	672,672.69	-	-	672,672.69
三、固定资产账面净值合计	2,020,379.71	-	-	4,082,430.72
其中: 电子设备	1,909,395.02	-	-	3,979,064.52
办公设备	90,180.38	-	-	82,561.89
运输工具	20,804.31	-	-	20,804.31
四、减值准备合计				
其中: 电子设备				
办公设备				
运输工具				
五、固定资产账面价值计	2,020,379.71	-	-	4,082,430.72
其中: 电子设备	1,909,395.02	-	-	3,979,064.52
办公设备	90,180.38	-	-	82,561.89
运输工具	20,804.31	-	-	20,804.31

注: 本期计提的固定资产折旧 443,168.04 元均已计入业务及管理费。

(2) 截至期末, 公司固定资产无用于抵押、担保、被封存等情形。

(3) 截至期末,未发现上述固定资产存在减值迹象,未计提固定资产减值准备。

10. 无形资产

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
一、原价合计	5,346,342.67	217,457.08		5,563,799.75
其中: 软件	5,346,342.67	217,457.08		5,563,799.75
二、累计摊销合计	3,877,674.06	354,564.22		4,232,238.28
其中: 软件	3,877,674.06	354,564.22		4,232,238.28
三、无形资产减值准备合计	-	-	-	-
其中: 软件				
四、账面价值合计	1,468,668.61			1,331,561.47
其中: 软件	1,468,668.61			1,331,561.47

注: (1) 本期增加的无形资产摊销中 354,564.22 元均计入业务及管理费。

(2) 截至期末,未发现无形资产存在减值迹象,未计提减值准备。

11. 递延所得税资产与递延所得税负债

(1) 递延所得税资产和递延所得税负债不以抵销后的净额列示

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
递延所得税资产				
存货跌价准备	-	-		
递延工资	2,423,106.36	605,776.59	2,423,106.36	605,776.59
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动	1,421,049.64	355,262.41	1,421,049.64	355,262.41
合计	3,844,156.00	961,039.00	3,844,156.00	961,039.00

(续)

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
递延所得税负债				
可供出售金融资产公允价值变动	-	-	-	-

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动	85,000.00	21,250.00	85,000.00	21,250.00
合计	85,000.00	21,250.00	85,000.00	21,250.00

12. 其他资产

(1) 明细情况

项目	期末金额	期初金额
待摊费用	12,330,051.97	9,860,107.83
长期待摊费用	1,301,089.28	1,214,844.81
预付款项	5,392,052.37	3,584,124.12
待抵扣进项税额	10,837,961.20	6,507,398.93
待返回税金		47,037.76
应收利息	14,246,924.65	4,567,614.70
合计	44,108,079.47	25,781,128.15

(2) 待摊费用

项目	期初金额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	期末金额	其他减少原因
系统租赁及维护费	1,139,387.88	2,444,970.85	1,824,374.39	-	1,759,984.34	-
票据贴现利息	8,690,978.54	11,550,645.57	9,773,326.40	-	10,468,297.71	-
信息系统服务	29,741.41	122,123.90	50,095.39	-	101,769.92	-
合计	9,860,107.83	14,117,740.32	11,647,796.18	-	12,330,051.97	-

(3) 长期待摊费用明细情况

项目	期初金额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	期末金额	其他减少原因
办公室装修	1,214,844.81	532,609.49	446,365.02	-	1,301,089.28	-
合计	1,214,844.81	532,609.49	446,365.02	-	1,301,089.28	-

(4) 预付款项

1) 账龄分析

项目	期末金额		期初金额	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	5,392,052.37	100	3,477,286.51	97.02
1-2年	-	-	106,837.61	2.98
2-3年	-	-	-	-
3-4年	-	-	-	-
5年以上	-	-	-	-
合计	5,392,052.37	100	3,584,124.12	100.00

2) 截至期末, 预付账款中余额较大单位明细如下:

单位名称	金额	账龄	占预付账款总额的比例 (%)	款项性质
深圳市建侨建工集团有限公司	584,403.67	1年以内	10.84	总部装修工程款
恒生电子股份有限公司	1,221,238.99	1年以内	22.65	预付软件服务费
福建顶点软件股份有限公司	119,469.03	1年以内	2.22	预付软件服务费
“保险+期货”项目代垫款	1,556,038.09	1年以内	28.86	代垫款
合计	3,481,149.78		64.56	

13. 应付货币保证金

项目	期末金额		期初金额	
	户数	金额	户数	金额
应付货币保证金	27,177.00	2,223,265,679.24	26,236.00	1,881,824,909.40
其中: 自然人	26,466.00	1,335,852,543.78	25,571.00	1,201,985,349.92
法人	711.00	887,413,135.46	665.00	679,839,559.48
合计	27,177.00	2,223,265,679.24	26,236.00	1,881,824,909.40

14. 应付质押保证金

项目	期末金额		期初金额	
	户数	金额	户数	金额
自然人	-	-	-	-
法人	3.00	107,915,496.00	6.00	33,037,880.00
合计	3.00	107,915,496.00	6.00	33,037,880.00

15. 期货风险准备金

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期计提	本期动用	期末金额
期货风险准备金	27,290,748.90	1,278,119.28	-	28,568,868.18
合计	27,290,748.90	1,278,119.28	-	28,568,868.18

注: 公司按照经纪业务手续费收入的5%计提期货风险准备金。

16. 预收账款

项目	期末金额	期初金额
商品销售款	-	-
合计	-	-

17. 应付期货投资者保障基金

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期计提	本期缴纳	期末金额
期货投资者保障基金	129,262.62	47,643.45	128,650.18	48,255.89
合计	129,262.62	47,643.45	128,650.18	48,255.89

18. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
一、短期薪酬	16,267,869.50	22,973,351.36	28,718,346.78	10,522,874.08
二、离职后福利-设定提存计划	-	329,211.31	329,211.31	-
合计	16,267,869.50	23,302,562.67	29,047,558.09	10,522,874.08

(2) 短期薪酬

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
工资、奖金、津贴和补贴	15,613,423.50	20,253,224.31	26,003,474.40	9,863,173.41
职工福利费	-	414,517.00	414,517.00	-
社会保险费	-	613,404.78	613,404.78	-
其中: 医疗保险费	-	506,946.10	506,946.10	-
工伤保险费	-	3,291.97	3,291.97	-
生育保险费	-	85,349.49	85,349.49	-
重大疾病保险	-	17,817.22	17,817.22	-
住房公积金	-	1,325,080.60	1,325,080.60	-
工会经费和职工教育经费	654,446.00	367,124.67	361,870.00	659,700.67

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
合计	16,267,869.50	22,973,351.36	28,718,346.78	10,522,874.08

(3) 设定提存计划

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
基本养老保险	-	320,585.94	320,585.94	-
失业保险费	-	8,625.37	8,625.37	-
合计	-	329,211.31	329,211.31	-

(4) 应付职工薪酬期末余额主要为公司已计提尚未发放的年终奖金、职工工资。

19. 应交税费

项目	期末金额	期初金额
增值税	-312,251.94	38,279.56
城建税	8,010.10	7,610.39
教育费附加	4,791.58	4,595.55
个人所得税	72,710.95	123,157.82
企业所得税	1,143,262.24	1,502,028.39
河道管理费	46.89	35.24
代扣代缴税费	34,950.26	33,938.47
合计	951,520.08	1,709,645.42

20. 其他应付款

(1) 明细情况

款项性质	期末金额	期初金额
押金、保证金	20,790,618.30	5,106,458.97
单位往来	-	10,857,137.86
服务费	1,618,022.26	1,346,110.42
资产管理费	1,788,750.00	4,250,000.00
未付合同款及其他	3,860,787.62	2,592,916.02
合计	28,058,178.18	24,152,623.27
其中: 1年以上	75,904.32	185,818.63

注: (1) 押金、保证金其中期货代采购保证金 19,122,853.47 元。

(2) 截止期末,无其他应付持本公司 5% (含 5%) 以上股份的股东单位的款项。

21. 其他负债

项目	年末金额	年初金额
第三方在结构化主体中享有的权益	-	1,010,268.49
应付票据-银行承兑汇票	893,290,000.00	475,140,000.00
合计	893,290,000.00	476,150,268.49

22. 实收资本

投资者名称	期初金额		本期增加	本期减少	期末金额	
	投资金额	所占比例(%)			投资金额	所占比例(%)
广州越秀金融控股集团股份 有限公司	-	-	544,665,000.00	-	550,000,000.00	99.03
广州证券股份 有限公司	544,665,000.00	99.03	-	544,665,000.00	-	-
广州越秀金融 控股集团有限 公司	5,335,000.00	0.97	-	-	5,335,000.00	0.97
合计	550,000,000.00	100.00	544,665,000.00	544,665,000.00	550,000,000.00	100.00

注:广州证券股份有限公司将其持有的公司99.03%股份转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司已于2020年1月8日在中国证券登记结算有限责任公司北京分公司完成过户登记手续办理,公司控股股东变更为“广州越秀金融控股集团股份有限公司”。

23. 资本公积

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
股本溢价	22,875,662.30	-	-	22,875,662.30
合计	22,875,662.30	-	-	22,875,662.30

24. 盈余公积

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
法定盈余公积	12,949,705.48	-	-	12,949,705.48
合计	12,949,705.48	-	-	12,949,705.48

25. 一般风险准备

项目	期初金额	本期增加	本期减少	期末金额
一般风险准备	16,520,971.41	-	-	16,520,971.41
合计	16,520,971.41	-	-	16,520,971.41

26. 未分配利润

(1) 利润分配比例

项目	分配基础	本期计提比例	上期计提比例
提取法定盈余公积金	公司净利润	-	-
提取一般风险准备	公司净利润	-	-

(2) 利润分配表

项目	本期金额	上期金额
期初未分配利润	111,152,397.08	92,714,434.22
加:本期归属于母公司股东的净利润	2,375,592.95	9,991,435.47
减:提取法定盈余公积	-	-
提取一般风险准备金	-	-
转增资本	-	-
对股东分配股利	-	-
期末未分配利润	113,527,990.03	102,705,869.69

27. 手续费净收入

(1) 明细情况

项目	本期金额	上期金额
期货经纪业务净收入	25,562,385.77	26,521,934.58
投资咨询业务净收入	336,320.76	1,624,811.31
资产管理业务净收入	2,465,034.49	303,331.32
合计	28,363,741.02	28,450,077.21

(2) 分地区手续费净收入

地区	数量	手续费收入	
		本期金额	上期金额
广东省	8	22,106,580.38	20,423,274.21
四川省	2	969,759.01	2,016,932.69
上海市	1	218,532.13	146,982.11
北京市	1	680,576.86	569,237.12
湖北省	2	810,173.60	1,164,485.06
湖南省	1	118,452.42	540,585.30
浙江省	2	1,106,462.11	1,983,377.86
天津市	1	357,771.30	647,624.31

地区	数量	手续费收入	
		本期金额	上期金额
河南省	1	412,905.36	72,066.01
福建省	1	162,608.51	47,214.38
江苏省	1	471,420.81	210,950.71
山东省	2	855,528.66	624,383.07
重庆市	1	92,969.87	2,964.38
合计	24	28,363,741.02	28,450,077.21

28. 利息净收入

项目	本期金额	上期金额
利息收入	30,477,924.76	20,820,677.30
利息支出	11,596,244.09	2,734,941.41
合计	18,881,680.67	18,085,735.89

29. 投资收益

项目	本期金额	上期金额
交易性金融资产在持有期间的投资收益	4,180,600.48	10,884,590.22
处置交易性金融资产取得的投资收益	4,647,461.89	1,073,552.10
处置衍生金融工具期间取得的投资收益	-17,616,226.34	2,269,661.56
合计	-8,788,163.97	14,227,803.88

30. 公允价值变动损益

项目	本期金额	上期金额
衍生金融工具	4,526,230.04	-1,073,405.00
基金	-1,022,537.91	-524,142.69
其他	1,471,709.96	
合计	4,975,402.09	-1,597,547.69

31. 其他业务收入

项目	本期金额	上期金额
服务费收入	1,291,221.14	1,952,510.96
商品销售收入	1,105,220,188.61	1,463,933,358.42
合计	1,106,511,409.75	1,465,885,869.38

32. 提取期货风险准备金

项目	本期金额	上期金额
提取期货风险准备金	1,278,119.28	1,348,043.70
合计	1,278,119.28	1,348,043.70

33. 税金及附加

项目	本期金额	上期金额
城建税	62,664.58	77,652.92
教育费附加	38,665.47	51,872.15
印花税	411,317.28	117,071.30
堤围防护费	148.31	383.74
其他	7,738.60	25,357.01
合计	520,534.24	272,337.12

34. 业务及管理费

(1) 明细情况

项目	本期金额	上期金额
业务及管理费	52,146,390.96	44,326,799.37
合计	52,146,390.96	44,326,799.37

(2) 主要费用项目明细如下

项目	本期金额	上期金额
职工薪酬	23,308,928.36	23,205,586.12
劳务费及服务费	9,475,441.54	8,401,168.79
租赁及物业费	5,810,580.51	5,347,203.94
邮电通讯费	927,565.44	881,210.64
投资者教育费	260,031.75	486,530.78
长期待摊费用摊销	446,365.02	760,933.30
业务招待费	240,934.01	395,959.42
无形资产摊销	354,564.22	355,945.75
营销费用	268,046.37	324,846.90
固定资产折旧	443,168.04	372,066.45
合计	41,535,625.26	40,531,452.09

35. 资产减值损失

项目	本期金额	上期金额
存货跌价准备	-	3,746,261.42
合计	-	3,746,261.42

36. 其他业务成本

项目	本期金额	上期金额
商品销售成本	1,093,366,412.43	1,464,581,914.63
合计	1,093,366,412.43	1,464,581,914.63

37. 营业外收入

(1) 营业外收入明细

项目	本期金额	上期金额
政府补助	557,473.25	80,000.00
其他	777,135.49	486,168.14
合计	1,334,608.74	566,168.14

(2) 政府补助明细

项目	本期金额	上期金额	与资产相关/收益相关
济南市促进金融业积聚发展补助	500,000.00	-	与收益相关
社保局稳定岗位补贴	6,627.13	-	与收益相关
其他	50,846.12	80,000.00	与收益相关
合计	557,473.25	80,000.00	-

38. 营业外支出

项目	本期金额	上期金额
逾期固定资产报废损失	6,660.43	1,573.83
合计	6,660.43	1,573.83

39. 所得税费用

(1) 所得税费用

项目	本期金额	上期金额
当期所得税费用	1,584,968.01	1,349,741.27
递延所得税费用	-	-
合计	1,584,968.01	1,349,741.27

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

项目	金额
利润总额	3,960,560.96
按母公司适用税率计算的所得税费用	990,140.24
其他地区采用不同税率的影响	
无须纳税收入的影响	-1,147,571.00
当期不可抵扣支出的影响	-
调整以前期间所得税的影响	
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	1,742,398.77
按实际税率计算的所得税	1,584,968.01

40. 现金流量表相关事项说明

(1) 收到的其他与经营活动有关的现金

项目	本期金额	上期金额
当期收到的政府补助	57,473.25	80,000.00
收到的履约保证金	15,530,437.74	10,421,693.10
收到其他经营活动现金	271,124.92	1,549,842.16
合计	15,859,035.91	12,051,535.26

(2) 支付的其他与经营活动有关的现金

项目	本期金额	上期金额
货币保证金净支出额	493,308,198.95	56,469,039.51
银行承兑汇票保证金	28,350,000.00	8,572,000.00
客户合作套保资金出金	-	10,140,817.18
其他	3,495,132.03	2,590,064.49
合计	525,153,330.98	77,771,921.18

(3) 现金流量表补充资料

项目	本期金额	上期金额
净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	2,375,592.95	9,991,435.47
加: 资产减值准备	-	3,746,261.42
固定资产折旧	443,168.04	372,066.45
无形资产摊销	354,564.22	355,945.75
长期待摊费用摊销	446,365.02	760,933.30

项目	本期金额	上期金额
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”号填列)	6,660.43	1,573.83
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	-	-
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-4,975,402.09	1,597,547.69
财务费用(收益以“-”号填列)		
投资损失(收益以“-”号填列)	8,788,163.97	-14,227,803.88
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)		-495,743.11
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)		-
存货的减少(增加以“-”号填列)	-78,931,524.11	541,195.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少		25,479,164.99
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-925,018,344.48	-130,443,682.18
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	569,228,183.94	118,757,912.87
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-427,282,572.11	16,436,807.60
涉及现金收支的投资和筹资活动		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
现金及现金等价物净增加情况		
现金的期末余额	799,994,252.11	1,308,398,397.46
减:现金的年初余额	1,315,612,758.89	1,317,506,367.70
加:现金等价物的年末余额		
减:现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加额	-515,618,506.78	-9,107,970.24

(4) 现金及现金等价物单位: 人民币元

项目	本期金额	上期金额
现金	799,994,252.11	1,308,398,397.46
其中: 库存现金	16,290.26	6,136.16
可随时用于支付的银行存款	799,977,961.85	1,308,392,261.30
可随时用于支付的其他货币资金		
现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		
期末现金及现金等价物余额	799,994,252.11	1,308,398,397.46

七、 合并范围的变化

(一) 报告期内合并范围内子公司基本情况

子公司名称	主要经营地	注册地	营业执照	成立时间	注册资本	法人代表	纳入合并范围时间	经营范围
广期资本管理(深圳)有限公司	深圳	深圳	91440300MA5D9MJC6L	2016年3月30日	10,000万元	周小涛	2016年3月	见注释

注释: 广期资本管理(深圳)有限公司的经营范围为: 投资顾问(不含限制项目); 资产管理(不含限制项目); 经济信息咨询、商务信息咨询(不含限制项目); 从事担保业务(不含融资性担保业务); 保付代理(非银行融资类); 股权投资; 投资兴办实业(具体项目另行申报); 国内贸易(不含专营、专控); 经营进出口业务(法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外, 限制的项目须取得许可后方可经营); 贸易经纪与贸易代理; 在网上从事商贸活动(不含限制项目); 国内货运代理; 供应链管理及相关业务; 自有设备租赁(不配备操作人员的机械设备租赁, 不包括金融租赁活动); 会议策划、展览展示策划; 信用风险管理平台的技术开发; 代理报关业务; 仓储服务(不含危险品); 企业信用征集与评定; 金银制品、铂金制品、钻石及制品的销售, 纪念币(章)、珠宝玉器、贵金属及合金制品的销售, 谷物、豆类、棉类、其他农产品等(油脂作物、糖类作物、经济作物)、油脂油料的销售、化工产品(不含危险化学品)的销售。(以上各项涉及法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外, 限制的项目须取得许可后方可经营)。

(二) 报告期内合并范围的变化

本期公司新设三家分支机构纳入合并范围内: 四川分公司、广东金融高新区分公司、湖北分公司。公司原纳入合并范围的由公司资管部发行的资管产品-红棉套利1号, 本期已清盘, 不再纳入合并范围。

八、 分部报告

公司的报告分部按照业务类型的不同, 主要划分为: 商品期货经纪业务分部以及金融期货经纪业务分部、资产管理业务分部及风险管理业务。

(一) 本期金额分部报告:

项目	商品期货经纪业务	金融期货经纪业务	资产管理业务	风险管理业务(子公司)	期货投资咨询业务	合计
一、营业收入	50,228,820.83	2,816,516.84	2,465,034.49	1,094,097,376.64	336,320.76	1,149,944,069.56
手续费净收入	24,170,547.23	1,391,838.54	2,465,034.49		336,320.76	28,363,741.02
其中: 分部间手续费收入						0.00
对外交易手续费收入	24,170,547.23	1,391,838.54	2,465,034.49		336,320.76	28,363,741.02
二、营业费用	41,079,193.31	2,349,226.39	2,807,213.34	1,101,075,823.87		1,147,311,456.91
三、营业利润(亏损)	9,149,627.52	467,290.45	-342,178.85	-6,978,447.23	336,320.76	2,632,612.65
四、资产总额(包含客户权益)	2,832,601,747.17	154,212,621.85	195,237.22	1,021,506,844.63		4,008,516,450.87
五、负债总额(包含客户权益)	2,153,002,605.34	119,133,004.64		1,020,506,511.67		3,292,642,121.65
六、补充信息						0
1、折旧和摊销费用	1,165,559.82	62,459.94	7,772.87	8,304.65	-	1,244,097.28
2、资本性支出	5,142,932.83	289,199.39	-	156,144.99	-	5,588,277.21
3、折旧和摊销以外的非现金费用						

(二) 上期金额分部报告:

项目	商品期货经纪业务	金融期货经纪业务	资产管理业务	风险管理业务	期货投资咨询业务	合计
一、营业收入	48,745,644.20	2,454,668.77	303,331.32	1,471,923,483.07	1,624,811.31	1,525,051,938.67
手续费净收入	25,266,377.77	1,255,556.81	303,331.32	-	1,624,811.31	28,450,077.21
其中: 分部间手续费收入	-	-	-	-	-	-
对外交易手续费收入	25,266,377.77	1,255,556.81	303,331.32	-	1,624,811.31	28,450,077.21
二、营业费用	40,405,694.35	1,931,491.37	1,324,457.93	1,470,613,712.59		1,514,275,356.24
三、营业利润(亏损)	8,339,949.85	523,177.40	-1,021,126.61	1,309,770.48	1,624,811.31	10,776,582.43
四、资产总额(包含客户权益)	2,491,165,765.20	91,246,437.11	211,418.33	234,946,376.69	-	2,817,569,997.33
五、负债总额(包含客户权益)	1,918,744,933.63	68,252,261.28	-	129,282,064.92	-	2,116,279,259.83
六、补充信息						
1、折旧和摊销费用	1,340,406.22	68,806.78	72,728.49	7,004.01		1,488,945.50
2、资本性支出	1,975,560.98	120,953.89	-	17,665.00	-	2,114,179.87
3、折旧和摊销以外的非现金费用	-	-	-	-	-	-

九、 关联方关系及其交易

(一) 关联方关系

1. 控股股东及实际控制人

(1) 本公司的控股股东

项目	持股比例(%)	表决权比例(%)	注册地	业务性质	注册资本(万元)
广州越秀金融控股集团股份有限公司	99.03	99.03	广东省天河区珠江江西路5号	商务服务业	275,288.4754

(2) 实际控制人

项目	与本公司关系
广州市人民政府国有资产监督管理委员会	实际控制人

2. 子公司

本公司的子公司情况详见附注七(一)

3. 其他关联方

序号	企业名称	与本公司的关系
1	创兴银行有限公司	控股股东的其他关联关系方
2	广州越秀城建国际金融中心有限公司	控股股东的其他关联关系方
3	广州越秀城建仲量联行物业服务有限公司	控股股东的其他关联关系方
4	广州越秀鲲鹏私募证券投资基金管理有限公司	控股股东的子公司
5	广州证券股份有限公司(现中信华南股份有限公司)	过去十二个月内曾是公司控股股东

(二) 关联交易及关联往来

1. 关联交易定价政策: 参照市场同类交易价格执行。

(1) 关联方在本公司开设账户, 从事期货交易的情况如下:

1) 期末权益

客户名称	期末金额		期初金额	
	金额	占期末权益比(%)	金额	占期初权益比(%)
广州越秀鲲鹏私募证券投资基金管理有限公司	3,345,019.37	0.14%	15,000,000.82	0.76%
合计	3,345,019.37	0.14%	15,000,000.82	0.76%

2) 手续费收入

客户名称	本期金额		上期金额	
	金额	占手续费收入比(%)	金额	占手续费收入比(%)
广州证券股份有限公司	-	-	124.45	0.00
广州越秀鲲鹏私募证券投资基金管理有限公司	11,173.95	0.04%	823.93	0.00
合计	11,173.95	0.04%	948.38	0.00

注: 手续费收入为扣除代期货交易所收取的部分。

(2) 证券佣金手续费

①公司及下属子公司在广州证券股份有限公司开设股票账户,本期无手续费支出发生。

②公司的资产管理计划在广州证券股份有限公司开设股票账户进行有价证券投资,相应产生的手续费情况如下:

公司名称	证券权益值		手续费支出	
	期末金额	年初金额	本期金额	上年同期金额
广州证券股份有限公司	-	-	-	9,534.35
合计	-	-	-	9,534.35

(3) 本公司管理的资管产品由广州证券提供销售及业务联动的开户奖励,支付的服务费情况如下:

项目	本期金额	上期金额
广州证券股份有限公司	-	15,193.92
合计	-	15,193.92

(4) 其他关联交易

1) 其他关联方利息收入

关联方	本期金额		上期金额	
	金额	占当期利息收入比(%)	金额	占当期利息收入比(%)
创兴银行有限公司	151.80	0.00	199.11	0.00

2. 与关联方往来款项

(1) 关联方往来

项目名称	关联方名称	期末金额	期初金额
货币资金	创兴银行有限公司	35,526.99	29,575.19
其他应收款	广州越秀城建国际金融中心有限公司	708,626.10	708,626.10
其他应收款	广州越秀城建仲量联行物业服务有限公司	321,576.00	249,735.00
应付货币保证金	广州越秀鲲鹏私募证券投资基金管理有限公司	3,345,019.37	15,000,000.82

3. 关联方出租情况

(1) 承租情况

出租方名称	承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上期确认的租赁费
广州越秀城建国际金融中心有限公司	广州期货股份有限公司	房屋租赁	2,024,606.00	1,687,205.00
广州越秀城建仲量联行物业服务有限公司	广州期货股份有限公司	物业管理及代收水电	321,153.61	297,481.14
合计			2,345,759.61	1,984,686.14

4. 关联担保情况

担保方名称	被担保方名称	担保金额	起始日	到期日	担保是否已经履行完毕
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	700.00万元	2019/12/19	2020/12/18	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	1,680.00万元	2019/12/23	2020/12/23	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	1,190.00万元	2020/1/6	2021/1/6	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	1,400.00万元	2020/1/9	2021/1/8	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	1,050.00万元	2020/3/16	2021/3/16	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	2,975.00万元	2020/4/23	2021/4/16	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	1,400.00万元	2020/4/23	2021/4/23	否
广州越秀金融控股集团有限公司	广期资本管理(深圳)有限公司	2,170.00万元	2020/4/24	2021/4/24	否

注:因上述担保事项,子公司广期资本本期需支付广州越秀金融控股集团有限公司担保费 35,069.04 元。

十、或有事项

截至 2020 年 06 月 30 日,本公司无重大或有事项。

十一、承诺事项

截至 2020 年 06 月 30 日,本公司无重大承诺事项。

十二、资产负债表日后事项

根据 2020 年 7 月 3 日公司第二届董事会第四次会议决议,公司以现金人民币 1 亿元整对子公司广期资本进行增资。2020 年 7 月 6 日,公司与子公司广期资本签订了增资协议,并于同日向广期资本支付增资款 1 亿元整。2020 年 7 月 16 日广期资本完成了增资的工商变更登记。

十三、其他重要事项

截至 2020 年 06 月 30 日,本公司无其他重要事项。

十四、公允价值披露管理

(一)期末以公允价值计量的资产和负债的金额和公允价值计量层次

项目	期末金额公允价值			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
一、持续的公允价值计量				
(一) 交易性金融资产	606,054,644.71			606,054,644.71
1 债务工具投资				
2 权益工具投资				
3 衍生金融资产	-160,310.00			-160,310.00
4 其他	606,214,954.71			606,214,954.71
(二) 投资性房地产				
(三) 生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	606,214,954.71			606,214,954.71
(一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债				
持续以公允价值计量的负债总额				
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				

项目	期末金额公允价值			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

(续)

项目	期初金额公允价值			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
一、持续的公允价值计量				
(一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产				
1. 交易性金融资产	574,240,807.28			574,240,807.28
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(3) 衍生金融资产	2,000,265.00			2,000,265.00
(4) 其他	572,240,542.28			572,240,542.28
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(二) 可供出售金融资产		-		-
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(3) 其他		-		-
(三) 投资性房地产				
(四) 生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	574,240,807.28			574,240,807.28
(一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债				
持续以公允价值计量的负债总额				
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

本期和上期本公司按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转

移。

(二)持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在交易所等活跃市场年末时点的收盘价。

(三)持续和非持续第二层次公允价值计量项目,采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

输入值为相关资产或负债的债券收益率的现金流量法计算。

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

输入值为相关资产或负债的不可观察输入值为缺乏流通性的折扣率采用的市价折扣法计算。

(五)持续的第三层次公允价值计量项目,年初与年末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

无。

(六)持续的公允价值计量项目,本期内发生各层级之间的转换

无。

十五、母公司财务报表主要项目注释

1. 货币资金

项目	期末金额		
	原币	折算汇率	折合人民币
库存现金	16,290.26	1	16,290.26
其中:人民币	16,290.26		16,290.26
银行存款	781,264,931.06	1	781,264,931.06
客户存款	776,693,129.44	1	776,693,129.44
其中:人民币	776,693,129.44		776,693,129.44
自有存款	4,571,801.62	1	4,571,801.62
其中:人民币	4,571,801.62		4,571,801.62
合计	781,281,221.32	1	781,281,221.32

(续)

项目	期初金额		
	原币	折算汇率	折合人民币
库存现金	6,940.26	1.00	6,940.26
其中:人民币	6,940.26		6,940.26
银行存款	1,313,756,432.60	1.00	1,313,756,432.60
客户存款	1,303,720,129.82	1.00	1,303,720,129.82
其中:人民币	1,303,720,129.82		1,303,720,129.82
自有存款	10,036,302.78	1.00	10,036,302.78
其中:人民币	10,036,302.78		10,036,302.78
合计	1,313,763,372.86	1.00	1,313,763,372.86

2. 交易性金融资产

项目	期末金额		期初金额	
	公允价值	初始成本	公允价值	初始成本
基金	554,543,475.31	554,538,482.52	537,708,808.17	536,681,277.47
其他	41,661,789.40	40,000,000.00	32,687,750.00	32,512,500.00
合计	596,205,264.71	594,538,482.52	570,396,558.17	569,193,777.47

3. 其他应收款

(1) 其他应收款分类

类别	期末金额				期初金额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收账款								
按组合计提坏账准备的其他应收账款								
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收账款	2,690,702.41	100.00			2,374,236.08	100.00		
合计	2,690,702.41	100.00			2,374,236.08	100.00		

(2) 截至期末金额,其他应收款余额较大单位情况

单位名称	金额	账龄	占其他应收款总额的比例(%)	款项性质
广州越秀城建国际金融中心有限公司	708,626.10	1-2年	26.34	押金

单位名称	金额	账龄	占其他应收款总额的比例(%)	款项性质
广州越秀城建仲量联行物业服务有限公司	321,576.00	1-2年	11.95	押金
苏州工业园区金鸡湖城市发展有限公司	111,292.50	2-3年	4.14	押金
上海中国煤炭大厦有限责任公司	110,807.79	1-2年	4.12	押金
新华地产开发公司	100,000.00	1-2年	3.72	押金
合计	1,280,461.39		47.59	

(3) 截至年末,公司无应收持公司5%(含5%)以上股份的股东单位的款项。

4. 长期股权投资

项目	期末金额			期初金额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	100,000,000.00	-	100,000,000.00	100,000,000.00	-	100,000,000.00
合计	100,000,000.00	-	100,000,000.00	100,000,000.00	-	100,000,000.00

(1) 对子公司投资

被投资单位	年初金额	本期增加	本期减少	年末金额	本期计提减值准备	减值准备年末余额
广期资本管理(深圳)有限公司	100,000,000.00			100,000,000.00		
合计	100,000,000.00			100,000,000.00		

5. 营业收入

项目	本期金额	上期金额
手续费收入	28,363,741.02	28,186,982.46
利息净收入	18,331,854.35	18,337,915.72
投资收益	8,709,532.36	7,292,256.68
公允价值变动收益	449,172.05	-524,142.69
合计	55,854,299.78	53,293,012.17

6. 投资收益

项目	本期金额	上期金额
交易性金融资产在持有期间的投资收益	4,062,070.47	6,248,705.36

项目	本期金额	上期金额
处置交易性金融资产的投资收益	4,647,461.89	1,043,551.32
合计	8,709,532.36	7,292,256.68

十六、财务报表批准

本财务报表于2020年8月21日由本公司董事会批准报出。

财务报表补充资料

1. 非经常性损益表

按照中国证券监督管理委员会《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号—非经常性损益（2008）》的规定，本公司非经常性损益如下：

项目	本期金额	上期金额
非流动资产处置损益	-6,660.43	-1,573.83
越权审批或无正式批准文件或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助	557,473.25	80,000.00
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司年初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		

项目	本期金额	上期金额
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	777,135.49	486,168.14
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小计	1,327,948.31	564,594.31
所得税影响额	331,987.08	141,148.58
少数股东权益影响额(税后)		
合计	995,961.23	423,445.73

2. 净资产收益率及每股收益

按照中国证监会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第九号—净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010修订)的要求,本公司净资产收益率及每股收益如下:

报告期利润	报告期	加权平均 净资产收益率	每股收益	
			基本每股收益	稀释每股收益
归属于母公司股东的 净利润	本期金额	0.33%	0.004	0.004
	上期金额	1.43%	0.018	0.018
扣除非经常性损益后 归属于母公司股东的 净利润	本期金额	0.19%	0.003	0.017
	上期金额	1.37%	0.018	0.018

第八节 备查文件目录

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

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

文件备置地址：

公司董事会办公室

广州期货股份有限公司

2020年8月25日