



渤海期货

NEEQ : 870662

渤海期货股份有限公司

BOHAI FUTURES CO.,LTD.



半年度报告

— 2023 —

## 重要提示

- 一、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。
- 二、公司负责人濮岩、主管会计工作负责人濮岩及会计机构负责人（会计主管人员）张延鑫保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。
- 三、本半年度报告已经挂牌公司董事会审议通过，不存在未出席审议的董事。
- 四、本半年度报告未经会计师事务所审计。
- 五、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。
- 六、本半年度报告已在“第二节 会计数据和经营情况”之“六、公司面临的重大风险分析”对公司报告期内的重大风险因素进行分析，请投资者注意阅读。
- 七、未按要求披露的事项及原因

无
---

## 目录

第一节	公司概况 .....	5
第二节	会计数据和经营情况 .....	6
第三节	重大事件 .....	19
第四节	股份变动及股东情况 .....	22
第五节	董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况 .....	24
第六节	财务会计报告 .....	26
附件 I	会计信息调整及差异情况 .....	72
附件 II	融资情况 .....	72

备查文件目录	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
	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（如有）
	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	公司综合部办公室

## 释义

释义项目		释义
元、万元	指	人民币元、人民币万元
报告期	指	2023年1月1日至2023年6月30日
公司、股份公司、渤海期货	指	渤海期货股份有限公司
东北证券	指	东北证券股份有限公司
吉林融商	指	吉林省融商投资有限公司
东证融通	指	东证融通投资管理有限公司
东证融达	指	东证融达投资有限公司
东证融汇	指	东证融汇证券资产管理有限公司
东方基金	指	东方基金管理股份有限公司
东证融成	指	东证融成资本管理有限公司
证监会	指	中国证券监督管理委员会
中期协	指	中国期货业协会
渤海融盛	指	渤海融盛资本管理有限公司
渤海融幸	指	渤海融幸（上海）商贸有限公司
融盛商贸	指	渤海融盛商贸（香港）有限公司
上海融渤	指	上海融渤实业有限公司
上海共赋	指	上海共赋私募基金管理有限公司
全国股转系统	指	全国中小企业股份转让系统
全国股转公司	指	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《期货和衍生品法》	指	《中华人民共和国期货和衍生品法》
《管理条例》	指	《期货交易管理条例》
《监督管理办法》	指	《非上市公众公司监督管理办法》
《公司章程》	指	渤海期货股份有限公司现行有效的《章程》
资管业务	指	金融机构资产管理业务
《指导意见》	指	《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》
安信证券	指	安信证券股份有限公司

## 第一节 公司概况

企业情况			
公司中文全称	渤海期货股份有限公司		
英文名称及缩写	BoHai Futures Co., Ltd.		
	-		
法定代表人	濮岩	成立时间	1996年1月12日
控股股东	控股股东为（东北证券股份有限公司）	实际控制人及其一致行动人	无实际控制人
行业（挂牌公司管理型行业分类）	金融业(J)-资本市场服务(J67)-期货市场服务(J672)-其他期货市场服务(J6729)		
主要产品与服务项目	期货经纪，包括商品期货经纪和金融期货经纪		
挂牌情况			
股票交易场所	全国中小企业股份转让系统		
证券简称	渤海期货	证券代码	870662
挂牌时间	2017年1月20日	分层情况	基础层
普通股股票交易方式	集合竞价交易	普通股总股本（股）	500,000,000
主办券商（报告期内）	安信证券	报告期内主办券商是否发生变化	否
主办券商办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦		
联系方式			
董事会秘书姓名	赵利人	联系地址	中国（上海）自由贸易试验区新金桥路28号1201、1202、1203、1205室
电话	021-61257850	电子邮箱	bhqhxinpi@bhfcc.com
传真	021-61257876		
公司办公地址	中国（上海）自由贸易试验区新金桥路28号1201、1202、1203、1205室	邮政编码	201206
公司网址	<a href="http://www.bhfcc.com">http://www.bhfcc.com</a>		
指定信息披露平台	<a href="http://www.neeq.com.cn">www.neeq.com.cn</a>		
注册情况			
统一社会信用代码	91310000MA1FL1T12Q		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区新金桥路28号1201、1202、1203、1205室		
注册资本（元）	500,000,000	注册情况报告期内是否变更	否

## 第二节 会计数据和经营情况

### 一、 业务概要

#### (一) 商业模式与经营计划

报告期内，公司经营范围包括商品期货经纪，金融期货经纪，资产管理，期货投资咨询，并通过全资子公司渤海融盛开展风险管理业务。具体商业模式如下：

##### 1、期货、期权经纪业务

期货、期权经纪业务主要包括代理客户的期货、期权经纪业务和代理客户的结算业务，服务对象是个人客户、机构客户（一般法人客户、特殊法人客户），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括交易手续费、交割手续费和交易所手续费返还或减收。保证金利息收入亦是公司收入的重要来源。公司期货经纪业务的主要营销渠道包括传统网点渠道、IB 业务（介绍经纪商业）。公司实行总部、分支机构分级管理的经营模式。截至报告披露日，公司总部设在上海，在北京、上海、深圳、大连、福州、南京、海口等地设有 13 家分支机构。分支机构是公司的前端营销部门，负责执行公司经营计划、进行市场开发、客户日常沟通服务等工作。公司总部负责制定经营计划，对分支机构工作提供各种支持，公司对分支机构实行统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理及会计核算。公司借助股东东北证券广泛全面的营销网络，与东北证券合作开展的 IB 业务，也是公司开展经纪业务的重要模式。

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，用于开仓前段检查和结算、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东北证券 IB 业务渠道。

##### 2、资产管理业务

资产管理业务是指公司接受客户委托，根据相关规定及合同约定，运用客户资产进行投资，投资收益由客户享有，损失由客户承担。投资范围包括：（一）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括但不限于在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具等；（二）上市公司股票、存托凭证，以及中国证监会认可的其他标准化股权类资产；（三）在证券期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化期货和衍生品类资产；（四）公募基金，以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品；（五）第（一）至（三）项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、期货和衍生品类资产；（六）第（四）项规定以外的其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；（七）中国证监会认可的其他资产。公司作为资产管理人，根据资产管理合同约定的方式、条件、要求及限制，对客户资产进行运作，主要有：为单一客户办理资产管理业务；为特定多个客户办理资产管理业务。公司资产管理业务收入主要来自管理费收入，公司收取的管理费按照合同约定的比例进行收取。

##### 3、期货投资咨询业务

期货投资咨询业务是指公司接受客户委托，向客户提供风险管理顾问、研究分析、交易咨询等服务。公司基于客户委托从事以下营利性活动：（1）协助客户建立风险管理制度、操作流程，提供风险管理咨询、专项培训等风险管理顾问服务；（2）收集整理期货市场信息及各类相关经济信息，研究分析期货市场及相关现货市场的价格及其相关影响因素，制作、提供研究分析报告或者资讯信息的研究分析服务；（3）为客户设计套期保值、套利等投资方案，拟定期货交易策略等交易咨询服务；（4）中国证监会规定的其他活动。通过开展期货投资咨询业务，可满足客户专业化、差异化的服务需求，并为公司提供潜在收入来源、改善公司业务结构。

#### 4、风险管理业务

根据中国期货业协会《期货公司风险管理公司业务试点指引》，公司风险管理子公司渤海融盛在中国期货业协会进行仓单服务、基差贸易、场外衍生品业务、做市业务备案。具体业务商业模式如下：

（一）仓单服务，是指风险管理公司以商品现货仓单串换、仓单质押、约定购回等方式为客户提供服务的业务行为。

（二）基差贸易，是指风险管理公司以确定价格或以点价、均价等方式提供报价并与客户进行现货交易的业务行为。

（三）场外衍生品业务，是指风险管理公司根据与交易对手达成的协议直接进行场外衍生品交易的业务行为。

（四）做市业务，风险管理公司按照交易所相关规则，为特定的期货、期权等衍生品合约提供连续报价或者回应报价等服务。

报告期内，公司主要商业模式未发生变化。

## 二、 会计数据和财务指标

单位：元

盈利能力	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	1,498,920,716.90	871,713,708.47	71.95%
毛利率%	0.24%	1.96%	-
归属于挂牌公司股东的净利润	-910,703.66	15,060,085.76	-106.05%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	-2,972,064.98	6,281,157.64	-147.32%
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）	-0.12%	1.95%	-
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）	-0.38%	0.81%	-
基本每股收益	-0.002	0.03	-106.67%
偿债能力	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	6,979,120,940.64	7,014,727,145.54	-0.51%
负债总计	6,191,101,598.76	6,237,761,317.54	-0.75%
归属于挂牌公司股东的净资产	775,941,300.24	776,965,828.00	-0.13%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	1.55	1.55	0.00%
资产负债率%（母公司）	87.92%	87.43%	-
资产负债率%（合并）	88.71%	88.92%	-
流动比率	1.13	1.13	-
利息保障倍数	1.02	1.67	-
营运情况	本期	上年同期	增减比例%

经营活动产生的现金流量净额	-83,478,306.39	-307,019,325.71	72.81%
应收账款周转率	230.35	246.33	-
存货周转率	6.11	5.71	-
<b>成长情况</b>	<b>本期</b>	<b>上年同期</b>	<b>增减比例%</b>
总资产增长率%	-0.51%	4.49%	-
营业收入增长率%	71.95%	10.86%	-
净利润增长率%	-95.57%	-33.98%	-
<b>行业主要财务指标及监管指标</b>	<b>本期期末</b>	<b>上年期末</b>	<b>增减比例%</b>
净资本	525,382,701.73	632,047,427.44	-16.88%
风险资本准备总额	167,872,515.10	159,290,169.08	5.39%
净资本与风险资本准备总额的比例	313.00%	397.00%	-
净资本与净资产的比例	62.00%	75.00%	-
扣除客户保证金的流动资产	672,711,006.70	745,070,661.01	-9.71%
扣除客户权益的流动负债	71,152,986.20	81,906,898.98	-13.13%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	945.00%	910.00%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	21.00%	22.00%	-
结算准备金额	360,061,656.60	338,800,751.77	6.28%

### 三、 财务状况分析

#### (一) 资产及负债状况分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		变动比例%
	金额	占总资产的比重%	金额	占总资产的比重%	
货币资金	4,023,506,421.29	57.65%	4,085,662,752.39	58.24%	-1.52%
应收货币保证金	2,017,389,572.87	28.91%	1,457,935,978.64	20.78%	38.37%
应收质押保证金	376,128,128.00	5.39%	593,662,960.00	8.46%	-36.64%
存出保证金	1,096,056.31	0.02%	6,769,169.64	0.10%	-83.81%
交易性金融资产	189,343,450.22	2.71%	382,598,241.04	5.45%	-50.51%
衍生金融资产	88,110.00	0.00%	198,220.00	0.00%	-55.55%
买入返售金融资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
应收结算担保金	20,800,000.00	0.30%	20,800,000.00	0.30%	0.00%
应收风险损失款	39,064.86	0.00%	59,726.26	0.00%	-34.59%
应收手续费及佣金	52,114.87	0.00%	0.00	0.00%	100.00%
结算备付金	816,088.73	0.01%	0.00	0.00%	100.00%



应收票据	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
应收账款	3,940,224.39	0.06%	9,074,294.73	0.13%	-56.58%
预付款项	10,302,569.50	0.15%	13,231,125.82	0.19%	-22.13%
应收利息	46,045.05	0.00%	49,607.23	0.00%	-7.18%
应收股利	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
其他应收款	49,334,568.22	0.71%	16,822,626.27	0.24%	193.26%
一年内到期的非流动资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
存货	181,799,707.70	2.60%	307,736,987.47	4.39%	-40.92%
其他流动资产	26,245,803.23	0.38%	43,796,878.49	0.62%	-40.07%
可供出售金融资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
持有至到期投资	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
长期股权投资	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
期货会员资格投资	1,400,000.00	0.02%	1,400,000.00	0.02%	0.00%
固定资产	8,530,587.26	0.12%	8,263,380.01	0.12%	3.23%
在建工程	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
固定资产清理	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
待处理固定资产净损失	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
无形资产	2,130,101.12	0.03%	2,311,580.48	0.03%	-7.85%
长期待摊费用	1,045,350.42	0.01%	1,193,599.04	0.02%	-12.42%
使用权资产	3,902,924.70	0.06%	5,260,501.51	0.07%	-25.81%
递延所得税资产	61,184,051.90	0.88%	57,899,516.52	0.83%	5.67%
其他非流动资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
短期借款	463,389,041.08	6.64%	461,367,808.22	6.58%	0.44%
应付货币保证金	5,080,361,369.10	72.79%	4,915,428,709.48	70.07%	3.36%
应付质押保证金	376,128,128.00	5.39%	593,662,960.00	8.46%	-36.64%
交易性金融负债	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
衍生金融负债	36,413,269.29	0.52%	204,775.00	0.00%	17,682.09%
卖出回购金融资产款	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
期货风险准备金	60,600,916.63	0.87%	59,452,061.55	0.85%	1.93%
应付票据	0.00	0.00%	50,000,000.00	0.71%	-100.00%
应付账款	14,694,930.35	0.21%	1,237,819.16	0.02%	1,087.16%
预收款项	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
合同负债	25,075,559.99	0.36%	4,294,518.17	0.06%	483.90%
应付期货投资者保障基金	244,383.66	0.00%	399,976.23	0.01%	-38.90%
应付手续费及佣金	289,459.09	0.00%	409,567.54	0.01%	-29.33%
应付职工薪酬	12,691,667.68	0.18%	20,333,005.46	0.29%	-37.58%
应交税费	7,335,619.64	0.11%	9,457,737.56	0.13%	-22.44%
应付利息	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
应付股利	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
代理买卖证券款	816,088.73	0.01%	0.00	0.00%	100.00%

其他应付款	3,613,778.98	0.05%	14,274,782.81	0.20%	-74.68%
预提费用	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
内部往来应付款	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
一年内到期的非流动负债	2,754,366.04	0.04%	2,964,399.68	0.04%	-7.09%
其他流动负债	0.00	0.00%	386,506.63	0.01%	-100.00%
长期借款	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
应付债券	103,041,095.87	1.48%	100,065,753.42	1.43%	2.97%
租赁负债	758,152.07	0.01%	1,752,638.11	0.02%	-56.74%
递延所得税负债	2,893,772.56	0.04%	2,068,298.52	0.03%	39.91%
其他非流动负债	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
实收资本	500,000,000.00	7.16%	500,000,000.00	7.13%	0.00%
资本公积	13,305,949.69	0.19%	13,305,949.69	0.19%	0.00%
减：库存股	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
其他综合收益	-3,646,844.87	-0.05%	-3,533,020.77	-0.05%	-3.22%
专项储备	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00%
盈余公积	33,441,405.03	0.48%	33,441,405.03	0.48%	0.00%
一般风险准备	29,473,706.90	0.42%	29,473,706.90	0.42%	0.00%
未分配利润	203,367,083.49	2.91%	204,277,787.15	2.91%	-0.45%
少数股东权益	12,078,041.64	0.17%	0.00	0.00%	100.00%
资产总计	6,979,120,940.64	100.00%	7,014,727,145.54	100.00%	-0.51%

#### 项目重大变动原因：

- 1、应收货币保证金同比增长 38.37%，主要原因是期货公司向期货结算机构划出货币保证金增加所致。
- 2、存出保证金同比减少 83.81%，主要原因是公司本期证券账户存款减少所致。
- 3、应收账款同比减少 56.58%，主要原因是子公司渤海融盛商品贸易期末应收货款减少所致。
- 4、存货同比减少 40.92%，主要原因是子公司渤海融盛商品贸易期末存货减少所致。
- 5、应付账款同比增加 1087.16%，主要原因是子公司渤海融盛商品贸易应付账款增加所致。

## (二) 经营情况分析

### 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	1,498,920,716.90	-	871,713,708.47	-	71.95%
手续费及佣金净收入	22,723,811.39	1.52%	41,653,568.00	4.78%	-45.45%
其中：经纪业务手续费收入	22,425,971.53	1.50%	41,331,630.71	4.74%	-45.74%
资产管理业务收入	297,839.86	0.02%	321,937.29	0.04%	-7.49%
投资咨询业务收入	-	-	-	-	-
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	1,956,964.06	0.13%	13,855,752.83	1.59%	-85.88%
投资收益	48,382,244.45	3.23%	-2,984,875.72	-0.34%	1,720.91%
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	-34,237,991.19	-2.28%	987,695.55	0.11%	-3,566.45%
汇兑收益	-	-	-	-	-
其他业务收入	1,457,377,095.24	97.23%	818,113,246.47	93.85%	78.14%
其中：风险管理业务收入	-	-	-	-	-
其他收益	2,718,592.95	0.18%	88,321.34	0.01%	2,978.07%
二、营业成本	1,495,347,453.60	99.76%	854,645,344.54	98.04%	74.97%
提取期货风险准备金	1,148,855.08	0.08%	2,082,620.56	0.24%	-44.84%
税金及附加	998,595.68	0.07%	940,469.14	0.11%	6.18%
业务及管理费	54,349,620.74	3.63%	46,821,729.57	5.37%	16.08%
研发费用	-	-	-	-	-
信用减值损失	245,357.61	0.02%	23,976.20	0.00%	923.34%
其他资产减值损失	710,890.32	0.05%	994,068.65	0.11%	-28.49%
其他业务成本	1,437,894,134.17	95.93%	803,782,480.42	92.21%	78.89%
三、营业利润	3,573,263.30	0.24%	17,068,363.93	1.96%	-79.06%
营业外收入	32,200.00	0.00%	3,465,033.66	0.40%	-99.07%
营业外支出	2,624,876.77	0.18%	502,826.46	0.06%	422.02%
四、利润总额	980,586.53	0.07%	20,030,571.13	2.30%	-95.10%
五、净利润	667,337.98	-	15,060,085.76	-	-95.57%

#### 项目重大变动原因：

- 1、手续费及佣金净收入同比减少 45.45%，主要原因是期货交易所手续费减收政策调整、客户交易趋于谨慎等原因所致。
- 2、其他业务收入同比增加 78.14%，其他业务成本同增加了 78.89%，主要原因是子公司渤海融盛现货采购规模和销售规模增加所致。

## 2、收入构成

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	22,723,811.39	41,653,568.00	-45.45%
利息净收入	1,956,964.06	13,855,752.83	-85.88%
其他业务收入	1,457,377,095.24	818,113,246.47	78.14%
投资收益	48,382,244.45	-2,984,875.72	1,720.91%
公允价值变动收益	-34,237,991.19	987,695.55	-3,566.45%
其他收益	2,718,592.95	88,321.34	2,978.07%

#### 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%
上海（本部）	-	14,524,860.53	0.97%
上海（不含本部）	1	280,486.94	0.02%
北京市	1	498,612.34	0.03%
重庆市	1	265,627.10	0.02%
辽宁省	1	1,429,844.36	0.10%
福建省	2	1,087,187.28	0.07%
吉林省	1	1,758,749.39	0.12%
浙江省	1	600,245.11	0.04%
河南省	1	510,390.79	0.03%
广东省	1	1,073,604.29	0.07%
江苏省	1	253,564.83	0.02%
山东省	1	440,638.43	0.03%
合计	12	22,723,811.39	1.52%

注：因公司于2023年5月取得海南分公司《营业执照》，2023年7月取得海南分公司《经营证券期货业务许可证》，故上述分支机构总数未将海南分公司纳入统计。

#### 收入构成变动的的原因：

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“三、财务状况分析（二）经营情况分析 1、利润构成”之“项目重大变动原因”。

### （三）现金流量分析

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	-83,478,306.39	-307,019,325.71	72.81%
投资活动产生的现金流量净额	63,679,332.67	-51,777,111.42	222.99%
筹资活动产生的现金流量净额	-12,383,756.56	-1,467,796.88	-743.70%

#### 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 72.81%，主要系母公司渤海期货本期应收货币保证金增加额较去年同期增加额大幅减少以及子公司渤海融盛现货销售规模增加，经营活动现金流入增加所致。
- 2、投资活动产生的现金流量净额：本期较上期增加 222.99%，主要系公司自有资金投资规模减少所致。
- 3、筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期下降 743.70%，主要系子公司渤海融盛偿付借款利息增加所致。

## 四、投资状况分析

### （一）主要控股子公司、参股公司情况

√适用 □不适用

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业收入	净利润
渤海融盛资本管理有限公司	控股子公司	基差贸易、场外衍生品、做市业务、仓单服务业务	300,000,000.00	739,777,860.83	242,607,895.02	344,657,214.44	1,031,720.18
渤海融幸（上海）商贸有限公司	控股子公司	国内贸易、国际贸易	50,000,000.00	576,211,945.21	41,126,910.66	448,663,875.85	-9,439,556.38
上海融渤实业有限公司	控股子公司	国内贸易	30,000,000.00	129,218,093.01	34,508,690.41	660,490,647.70	4,508,690.41
渤海融盛商贸（香港）有限公司	控股子公司	国际贸易	9,959,362.50	35,003,208.08	32,558,499.75	0.00	-87,280.39

### 主要参股公司业务分析

√适用 □不适用

公司名称	与公司从事业务的关联性	持有目的
上海共赋私募基金管理有限公司	无关联	股权投资

注：2022年4月13日，渤海期货股份有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会第三次会议审议通过了《关于申请参股设立私募基金管理公司的议案》。公司与上海共赋同行数字技术合伙企业（有限合伙）共同投资设立上海共赋私募基金管理有限公司（以下简称“上海共赋”），公司出资人民币340万元，持股比例34%。2023年7月28日，上海共赋完成工商登记并取得营业执照。

### (二) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

本公司根据《企业会计准则第33号——合并财务报表》的规定，公司将同时满足以下条件的结构

化主体纳入合并范围：（1）公司对管理或投资的结构化主体拥有实质性权利，该权利不能被无条件罢免；（2）公司通过收取管理费、业绩报酬及直接持有权益享有的可变回报相对于结构化主体预期回报的比重重大（即可变回报占预期综合收益的比率超过 30%）。

截至 2023 年 6 月 30 日，根据上述条件判断，公司做为单一投资者投资的良岳山南凯鑫 1 号私募证券投资基金、盛冠达量化套利 8 号私募证券投资基金、祝融金霖三号私募证券投资基金，幂数富饶套利 3 号私募证券投资基金，明晟东诚友诚 3 号主动式 FOF 私募证券投资基金，岩叶东晟 1 号私募证券投资基金，岩叶东明 2 号私募证券投资基金，古木艳阳 3 号商品期权私募证券投资基金，并对其实施控制，故将其纳入本公司合并财务报表的合并范围。

## 五、 企业社会责任

√适用 □不适用

2023 年上半年，公司持续贯彻落实服务实体经济、服务乡村振兴的职责使命，通过发挥在期货及衍生品方面的专业优势，在实现自身发展的同时积极履行社会责任。一是，与山东省龙口市建立结对帮扶合作关系；二是在甘肃省秦安县、广西省东兰县等地开展苹果、纸浆等“保险+期货”项目；三是，在吉林省汪清县开展调研帮扶活动，详细了解当地发展情况、所需支持，开展“保险+期货”业务培训和产业捐赠；四是，在吉林省梨树县开展“订单收购+期货”服务，解决粮食销售和库存贬值难题；五是，公司党支部开展学雷锋活动，拜访“大连好人”并学习其先进事迹；六是，开展“3.15 消费者权益保护”、“4.15 国家安全”、“5.15 防范非法集资”等主题教育系列宣传，共建行业健康生态。

## 六、 公司面临的重大风险分析

重大风险事项名称	重大风险事项简要描述
1、期货经纪业务盈利能力下降风险	目前我国期货公司的主要收入是经纪业务，经纪业务收入取决于交易规模及佣金费率。交易规模受市场行情波动影响较大，而佣金费率随着市场竞争的加剧，呈现不断下降的趋势，故期货经纪业务面临盈利能力下降的风险。
2、利息收入下滑风险	利息收入是公司营业收入的重要来源之一，包括客户保证金存款和自有资金存款产生的利息。利息收入直接受保证金规模和利率水平的影响，如果利率水平出现大幅下滑，或者客户保证金规模和自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动风险。
3、交易所对期货公司手续费返还的不确定风险	各期货交易所会对期货公司进行不定期手续费返还或减收，但公司每年收到的手续费返还（减收）的金额存在不确定性。交易所未明确规定手续费返还（减收）的标准，若未来交易所降低手续费返还（减收）的金额或取消手续费返还（减收），将对公司的盈利水平产生一定的影响。
4、财务风险	报告期内公司的资产以流动资产为主，负债以流动负债为主，符合期货行业特征。报告期内公司的资产负债率处于合理水平，流动比率和速动比率较高，反映了公司较为稳健的财务状况，资产结构和财务结构较为合理。未来若公司的资产负债率继续升高，流动比率和速动比率降低，将导致公司的资产结构和财务结构趋向不合理，产生财务风险。

5、人才流失及储备不足的风险	期货行业是知识密集型行业，需要大量专业人才。随着我国期货市场的快速发展，创新业务的不断推出，期货人才的竞争愈发激烈。若公司流失核心管理人员及专业人才，可能给公司的业务发展带来不利影响。同时，如果公司在发展创新业务时，人才队伍储备不足，也可能制约公司业务的发展速度，给公司带来不利影响。
6、行业竞争风险	期货行业内业务同质性较高，经纪业务是期货公司收入的主要来源，以低价拉客户的价格战、挖角其他期货公司优秀员工的竞争手段屡见不鲜。因此，职员离职和客户交易成本较高，公司可能面临客户流失风险，从而给公司带来不利影响。
7、经营风险和业务创新风险	公司的决策人员和管理人员在经营管理过程中出现经营决策失误，导致公司盈利水平发生变化，可能给公司带来不利影响。同时，随着期货行业创新业务不断地推出，公司将投入较大精力拓展业务范围、发展创新业务。由于我国的期货创新业务还在发展初期，公司在开展创新业务时面临因业务经验与人才准备不足、产品设计不合理、管理措施不到位、风险管理及内控制度不完善而导致的风险，可能给公司带来风险事件或造成较大损失。
8、投资风险	报告期内，公司运用自有资金投资于证券、基金等金融类资产及中国证监会规定的其他产品，以提高自有资金的管理能力和使用效率。虽然公司对自有资金投资制定了相关的管理制度，但仍面临一定市场风险，存在因自有资金投资收益大幅下降或亏损影响公司盈利状况的可能。
9、信息技术系统风险	信息技术系统是期货公司开展业务的重要载体，其安全性、有效性对公司业务发展至关重要。公司重视信息技术系统的搭建与维护，对信息技术系统的软硬件进行了大量的投入，并制定了相应的管理制度，但因各种原因，信息技术系统仍可能出现如硬件故障、通信线路中断、病毒或黑客攻击等风险事件。如该类风险事件发生，可能给公司带来不利影响。
10、净资本管理及流动性风险	期货行业监管机构对期货公司进行以净资本为核心的风险控制指标管理，对期货公司的资本规模做出了相应要求，建立了以净资本为核心的风险监管体系。如果公司不能满足净资本的监管要求，可能影响公司业务资格的存续及新业务的申请，从而给公司带来不利影响。另外，如果公司客户保证金划转出现问题，或公司自有资金因投资失误不能及时变现，可能使公司的资金周转出现问题，导致公司出现流动性风险。
11、信用风险和员工道德风险	公司可能面临的信用风险包括：（1）客户保证金不足时未能及时追加保证金及自行平仓，可能带来的保证金不足或穿仓风险；（2）客户在期货交易及交割中违约，导致公司须先履约后向客户追偿，可能面临追偿不能的风险；（3）涉及实物交割中的交割库不能履约的风险。该类风险可能给公司带来不利。另外，公司各项业务的有效开展，有赖于员工的诚实、自律，公司面临由于部分员工在追求自身利益最大化时可能做出不利于公司和客户行为的的风险。如个别员工出现玩忽职守、故意隐瞒、挪

	用客户资金、收受贿赂等行为，公司未能及时发现并处理，导致公司利益受到损失，将给公司带来不利影响。
12、股东资格无法获得监管部门批准的风险	根据《期货公司监督管理办法》等相关法规的规定，单个股东或者有关联关系的股东合计持股超过 5%以上，或者控股股东、第一大股东发生变化，应经过中国证监会或其派出机构批准，否则应限期整改，整改前相应股份不得行使表决权。因此，公司存在股东资格无法获得监管部门批准的风险。
13、管理风险和内部控制有效性不足的风险	有效的内部控制是期货公司正常经营的前提和保障。如果缺乏健全的内部控制制度，或者现有的制度未能得到有效贯彻，期货公司将无法实现长期可持续发展。同时，内部控制制度建设是一项复杂的系统工程，既需要营造良好的企业内部控制环境，还需要具备完善的风险评估和管理体系。公司致力于改善和加强风险管理水平，建立了符合监管规定的、较为完善的风险管理和内部控制制度。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、信息难以实时保持准确和完善，管理风险的政策和程序也存在失效或无法预见所有风险的可能；同时，任何内部控制制度均有其固有限制，可能由于各种原因导致风险，例如公司自身经营情况的变化、内部治理结构及外部环境的变化、风险管理当事者对某项事务认识不充分、对现有制度执行不力、内部工作人员或相关第三方舞弊等。如果公司因上述原因造成内部管理和风险防范环节出现问题，可能会遭受经济损失，或者产生法律纠纷和违规风险。公司期货经纪业务的风险管理主要集中在开户阶段和运营阶段两个环节。在开户阶段，公司需要对新客户履行投资者适当性评估、进行投资者教育和风险提示、签署经纪合同并采集影像资料、对新客户进行电话回访确认客户信息资料的准确性；在运营阶段需要实时跟踪客户账户保证金变动的情况，及时提醒客户控制风险追加保证金或者自行减仓，或由公司强制平仓。上述风控措施系由公司相应部门不同业务人员进行操作，不能保证负责相关岗位的员工不会出现操作不当、职务舞弊或违法违规的情形。一旦出现该等情况，则有可能因此给客户的利益带来损害，或者使公司面临监管处罚，导致公司利益和声誉受到损害。同时，随着国内期货市场的发展、创新产品及业务的不断推出以及公司规模的扩大，公司将提供更多产品和服务。由于新业务及现有业务之间的风险性质存在一定差异，公司的风险管理和内部控制制度可能面临更大挑战。如果公司未能及时根据新业务的扩张调整来完善风险管理和内部控制制度及程序，可能给公司带来不利影响。
14、合规风险	合规经营是期货公司经营的重要保障，也是监管部门关注的重点。近年来，我国期货监管机构颁布了多项法律法规、规章和规范性文件，对期货公司的合规运营进行规范，监管呈现趋严趋紧的态势。公司虽然已经建立了完善的合规管理制度和组织体系，并营造了良好的合规文化氛围。但若公司及下属分支机构未能遵守法律、法规及相关监管机构的规定和业务守则，将



	<p>会承受法律风险或者行政处罚，包括但不限于：责令整改、警告、罚款、没收违法所得、责令停业整顿、吊销业务许可证等。公司还可能因违反法律法规及监管部门规定而被采取监管措施，包括但不限于：限制或者暂停部门业务，停止批准新增业务或者分支机构；限制分配红利；限制向董事、监事、高级管理人员支付报酬和提供福利；限制转让财产或者在财产上设定其他权利；责令更换董事、监事、高级管理人员或者有关业务部门、分支机构的负责人员，或者限制其权利；限制自有资金或者风险准备金的调拨和使用；责令控股股东转让股权或者限制有关股东行使股东权利；撤销部分或者全部期货业务许可，关闭分支机构，责令停业整顿，指定其他机构托管或接管等。</p>
15、重大诉讼、仲裁风险	<p>截至 2023 年 6 月 30 日，公司无重大诉讼和仲裁事项，但受市场变动、业务经营及其他因素影响，公司未来可能会出现重大诉讼或仲裁事项，将可能给公司经营带来不利影响。</p>
16、监管政策风险	<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行政管制的逐渐放松，相关期货法律法规的建设也处于完善阶段，部分限制性的规定正逐步取消，关于新业务及新产品的规定可能逐步出台。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。如果公司未能完全适应相关法律、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>
17、理财产品违约风险	<p>报告期内，为了提高资金使用效率，公司购买了系列理财产品。虽然公司购买的理财产品主要为资产管理计划、基金产品、债券产品的低风险、高流动性的产品，且报告期内也未发生理财产品本金或者收益无法兑付的情形，但是在极端情况下，公司仍存在损失收益甚至本金的违约风险。</p>
18、公司挂牌后股权变更、融资、董监高变动等事项需要履行的审批不能通过的风险	<p>公司挂牌后，发生控股股东、第一大股东变更，单个股东的持股比例或者有关联关系的股东合计持股比例增加到 5%以上且涉及境外股东的，应当经中国证监会批准；除前款规定情形外，期货公司单个股东的持股比例或者有关联关系的股东合计持股比例增加到 5%以上，应当经期货公司住所地中国证监会派出机构批准。除前述情形以外的股权变更，应当自完成工商变更登记手续之日起 5 个工作日内向公司住所地中国证监会派出机构报备书面材料。公司挂牌后，董监高变动，应当自作出决定之日起 5 个工作日内，向中国证监会相关派出机构报告。公司变更注册资本且调整股权结构的，应经中国证监会批准；发行次</p>

	<p>级债券，公司应当在次级债借入或发行完成后 5 个工作日内向住所地中国证监会派出机构报告，并由承销机构在每次发行完成后 5 个工作日内向中国证券业协会备案。如公司在股权变更、融资、董监高变动等事项上需要履行的审批未能获得批准通过，则可能影响公司业务进一步开展及公司有效平稳运营。</p>
19、居间人管理风险	<p>居间人，也称为中介人，是指受期货公司委托，为期货公司提供订立期货经纪合同的中介服务，独立承担基于中介服务所产生的民事责任，期货公司按照约定向其支付报酬的机构及自然人。居间人变动引发的客户流失，将对公司盈利情况产生不利影响。另外居间人素质参差不齐，其违规展业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>
20、资产管理业务风险	<p>公司的资产管理业务面临监管政策调整以及证券公司、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等多种影响，加之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，导致无法达到预期收益，从而导致客户遭受损失以及公司资产管理规模和收入的下降。</p>
21、子公司业务风险	<p>公司全资子公司渤海融盛设立于 2015 年 7 月，并经中期协备案通过四项试点业务：仓单服务、基差贸易、场外衍生品业务、做市业务。报告期内子公司业务有序开展，未出现风险情况。但在业务开展过程中仍面临着对手方信用风险、价格波动导致市场风险、员工操作导致亏损的操作风险、无法正常交割的风险以及仓储风险等，这些风险点不仅制约着子公司的发展，也可能给公司带来较大的损失。</p>
本期重大风险是否发生重大变化：	本期重大风险未发生重大变化

### 第三节 重大事件

#### 一、 重大事件索引

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	三. 二. (一)
是否存在提供担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	三. 二. (二)
是否存在关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	三. 二. (三)
是否存在经股东大会审议通过的收购、出售资产、对外投资事项以及报告期内发生的企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股份回购事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	三. 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 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	三. 二. (五)
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在应当披露的其他重大事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

#### 二、 重大事件详情

##### (一) 重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项。

##### (二) 股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况

本报告期公司无股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况。

##### (三) 报告期内公司发生的关联交易情况

单位：元

日常性关联交易情况	预计金额	发生金额
购买原材料、燃料和动力、接受劳务	32,000,000.00	1,226,742.77
出售产品、商品、提供劳务	24,000,000.00	139,939.17
委托关联人销售产品、商品	10,000,000.00	
接受关联人委托代为销售其产品、商品		
其他	3,081,000,000.00	16,430,136.95
合计	3,147,000,000.00	17,796,818.89
其他重大关联交易情况	审议金额	交易金额
收购、出售资产或股权	0	0

与关联方共同对外投资	0	0
提供财务资助	0	0
提供担保	0	0
委托理财	0	0
<b>企业集团财务公司关联交易情况</b>	<b>预计金额</b>	<b>发生金额</b>
存款	0	0
贷款	0	0

**重大关联交易的必要性、持续性以及对公司生产经营的影响：**

公司与上述关联交易范围基于公司日常经营的正常需要，有利于公司业务的发展。

**(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
实际控制人或控股股东	2016年6月5日	-	挂牌	同业竞争承诺	1、股东单位实际控制渤海期货期间，不经营与渤海期货及其控股子公司相同的业务，亦不直接或间接控制与渤海期货及其控股子公司业务有竞争或可能有竞争的企业；保证不利用控股股东地位损害渤海期货及其他股东的正当权益。2、股东单位及其控制的其他公司不开展与渤海期货牌照（“商品期货经纪”、“金融期货经纪”、“期货投资咨询”）相同的业务。	正在履行中
实际控制人或控股股东	2017年1月20日	-	挂牌	关联交易	1、股东单位将尽力减少与渤海期货之间的关联交易。对于无法避免的任何业务往来或交易均应严格遵守有关法律、法规以及公司章程、关联交易决策制度等规定，按照公平、公允和等价有偿的原则进行，交易价格严格按市场公认的合理价格确定，并按规定履行信息披露义务。双方就相互间关联事务及交易事务所做出的任何约定及安排，均不妨碍对方为其自身利益、在市场同等竞争条件下与任何第三方进行业务往来或交易。2、股东单位保证严格遵守相关法律法规及《公司章程》、《关联交易管理制度》等公司管理制度的规定，与其他股东一样平等地行使股东权利、履行股东义务，不利用控股股东或实际控制人的地位谋取不当的利益，不损害公司及其他股东的合法权益。	正在履行中
董监高	2017年1月	-	挂牌	相关承诺及声明	1、本人在履行董监高职责时，将遵守并促使本公司和本人的授权人遵守国家法律、行政	正在履行中

20 日				<p>法规和部门规章等有关规定，履行忠实、勤勉尽责的义务。2、本人在履行董监高职责时，将遵守并促使本公司和本人的授权人遵守中国证监会发布的部门规章、规范性文件的有关规定。3、本人在履行董监高职责时，将遵守并促使本公司和本人的授权人遵守《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》和全国股转公司发布的其他业务规则、细则、指引和通知等。4、本人在履行董监高职责时，将遵守并促使本公司和本人的授权人遵守公司《章程》。5、同意接受中国证监会和全国股转公司的监管，包括及时、如实地答复中国证监会和全国股转公司向本人提出的任何问题，及时提供《证券法》、《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）》等法律、行政法规、部门规章、业务规则规定应当报送的资料及要求提供的其他文件的正本或副本，并出席本人被要求出席的会议。6、本人授权全国股转公司可将本人提供的承诺与声明的资料向中国证监会报告。7、本人将按要求参加中国证监会和全国股转公司组织的专业培训。8、本人如违反上述承诺，愿意承担由此引起的一切法律责任和接受中国证监会任何行政处罚与全国股转公司的违规处分。9、本人因履行职责或者本承诺而与全国股转公司发生争议提起诉讼时，由全国股转公司住所地法院管辖。</p>	
------	--	--	--	---	--

**超期未履行完毕的承诺事项详细情况：**

无

**(五) 调查处罚事项**

公司控股股东东北证券于 2023 年 2 月 6 日收到中国证监会《立案告知书》（证监立案字 0392023014 号）。因东北证券在执行豫金刚石 2016 年非公开发行股票项目中，涉嫌保荐、持续督导等业务未勤勉尽责，所出具的文件存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对东北证券立案。

针对上述立案事项，东北证券已于 2023 年 5 月 12 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2023]23 号），于 2023 年 6 月 20 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（行政处罚[2023]45 号）。

公司控股股东的上述行政处罚事项未对公司生产经营产生不利影响。

## 第四节 股份变动及股东情况

### 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	500,000,000	100%	0	500,000,000	100%
	其中：控股股东、实际控制人	480,000,000	96%	0	480,000,000	96%
	董事、监事、高管	0	0%	0	0	0%
	核心员工	0	0%	0	0	0%
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	0	0%	0	0	0%
	核心员工	0	0%	0	0	0%
总股本		500,000,000	-	0	500,000,000	-
普通股股东人数		2				

#### 股本结构变动情况：

适用 不适用

#### (二) 普通股前十名股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有有限售股份数量	期末持有无限售股份数量	期末持有的质押股份数量	期末持有的司法冻结股份数量
1	东北证券股份有限公司	480,000,000	0	480,000,000	96%	0	480,000,000	0	0
2	吉林省融商投资有限公司	20,000,000	0	20,000,000	4%	0	20,000,000	20,000,000	0
合计		500,000,000	-	500,000,000	100%	0	500,000,000	20,000,000	0

普通股前十名股东间相互关系说明：普通股前十名股东间相互关系说明：经核查，公司股东之间不存在关联关系。

## 二、 控股股东、实际控制人变化情况

报告期内控股股东、实际控制人未发生变化

## 三、 特别表决权安排情况

适用 不适用

## 第五节 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
李雪飞	董事长	男	1972年3月	2021年7月5日	2024年7月4日
董晨	董事	男	1971年12月	2021年7月5日	2024年7月4日
苏健	董事	男	1976年11月	2021年7月5日	2024年7月4日
丁文勇	董事	男	1957年11月	2021年7月5日	2024年7月4日
濮岩	董事、总经理	男	1977年11月	2021年7月5日	2024年7月4日
薛金艳	监事会主席	女	1976年4月	2021年7月5日	2024年7月4日
刘洋	监事	女	1980年7月	2021年7月5日	2024年7月4日
倪忠	职工监事	男	1968年3月	2021年7月5日	2024年7月4日
赵利人	副总经理	男	1967年9月	2021年7月5日	2024年7月4日
蔡瑞	副总经理	男	1968年2月	2021年7月5日	2024年7月4日
刘卉	副总经理	女	1972年6月	2021年7月5日	2024年7月4日
纪杨	副总经理	男	1982年9月	2023年7月7日	2024年7月4日
洪梅	首席风险官	女	1970年11月	2021年7月5日	2024年7月4日
张延鑫	财务总监	男	1974年10月	2021年7月5日	2024年7月4日

注：2023年7月7日，公司第三届董事会2023年第一次临时会议审议通过《关于聘任纪杨先生为公司副总经理的议案》，聘任纪杨先生为公司副总经理，任期自本次董事会审议通过之日起至本届董事会任期届满。

#### 董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系：

董事、监事、高级管理人员相互之间无关联方关系。

董事长李雪飞兼任东北证券党委委员、副总裁、财富资管业务委员会主任、机构业务部总经理；董事董晨兼任东北证券党委委员、副总裁、战略规划部总经理；董事苏健兼任东北证券运营管理部总经理、职工监事；董事丁文勇兼任吉林融商执行董事、总经理；监事、监事会主席薛金艳兼任东北证券首席风险官、风险管理总部总经理；监事刘洋兼任东北证券纪委书记、证券部总经理、证券事务代表。

#### (二) 持股情况

适用 不适用

#### (三) 变动情况

适用 不适用

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

适用 不适用

#### (四) 董事、高级管理人员的股权激励情况

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
财务	13	0	0	13
分支机构负责人	12	1	0	13
风险控制	12	2	0	14
高管人员	6	0	0	6
合规审查	8	1	0	9
客户服务	52	11	2	61
客户开发	44	10	13	41
人力资源	3	0	0	3
投资咨询	5	0	0	5
信息技术	14	2	0	16
行政管理	8	0	2	6
研究分析	3	0	1	2
衍生品交易	7	2	7	2
运营管理	7	2	1	8
资产管理	9	2	1	10
<b>员工总计</b>	<b>203</b>	<b>33</b>	<b>27</b>	<b>209</b>

### (二) 核心员工（公司及控股子公司）基本情况及变动情况

适用 不适用

## 第六节 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	2023年6月30日	2022年12月31日
<b>流动资产：</b>			
货币资金	注释 1	4,023,506,421.29	4,085,662,752.39
其中：期货保证金存款		3,946,987,146.84	3,958,723,111.28
应收货币保证金	注释 2	2,017,389,572.87	1,457,935,978.64
应收质押保证金	注释 3	376,128,128.00	593,662,960.00
存出保证金	注释 4	1,096,056.31	6,769,169.64
交易性金融资产	注释 5	189,343,450.22	382,598,241.04
结算备付金	注释 7	<b>816,088.73</b>	
衍生金融资产	注释 8	88,110.00	198,220.00
应收票据			
应收账款	注释 10	3,940,224.39	9,074,294.73
应收款项融资			
预付款项	注释 11	10,302,569.50	13,231,125.82
应收结算担保金	注释 9	20,800,000.00	20,800,000.00
应收风险损失款		39,064.86	59,726.26
应收佣金	注释 6	52,114.87	
其他应收款	注释 12	49,380,613.27	16,872,233.50
其中：应收利息		226,612.10	49,607.23
应收股利			
买入返售金融资产			
存货	注释 13	181,799,707.70	307,736,987.47
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	注释 14	26,245,803.23	43,796,878.49
<b>流动资产合计</b>		<b>6,900,927,925.24</b>	<b>6,938,398,567.98</b>
<b>非流动资产：</b>			
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	注释 15	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	注释 16	8,530,587.26	8,263,380.01
在建工程			
使用权资产	注释 17	3,902,924.70	5,260,501.51
无形资产	注释 18	2,130,101.12	2,311,580.48
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	注释 19	1,045,350.42	1,193,599.04
递延所得税资产	注释 20	61,184,051.90	57,899,516.52
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		<b>78,193,015.40</b>	<b>76,328,577.56</b>
<b>资产总计</b>		<b>6,979,120,940.64</b>	<b>7,014,727,145.54</b>
<b>流动负债：</b>			
短期借款	注释 21	463,389,041.08	461,367,808.22
应付货币保证金	注释 22	5,080,361,369.10	4,915,428,709.48
应付质押保证金	注释 23	376,128,128.00	593,662,960.00
交易性金融负债			
期货风险准备金	注释 25	60,600,916.63	59,452,061.55
衍生金融负债	注释 24	36,413,269.29	204,775.00
应付票据	注释 26		50,000,000.00
应付账款	注释 27	14,694,930.35	1,237,819.16
预收款项			
合同负债	注释 28	25,075,559.99	4,294,518.17
卖出回购金融资产款			
应付期货投资者保障基金	注释 29	244,383.66	399,976.23
应付手续费及佣金	注释 30	289,459.09	409,567.54
应付职工薪酬	注释 31	12,691,667.68	20,333,005.46
应交税费	注释 32	7,335,619.64	9,457,737.56
代理买卖证券款		<b>816,088.73</b>	
其他应付款	注释 33	3,613,778.98	14,274,782.81
其中：应付利息			9,863,013.70
应付股利			
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债	注释 34	2,754,366.04	2,964,399.68
其他流动负债	注释 35		386,506.63
<b>流动负债合计</b>		<b>6,084,408,578.26</b>	<b>6,133,874,627.49</b>
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券	注释 36	103,041,095.87	100,065,753.42
其中：优先股			
永续债			

租赁负债	注释 37	758,152.07	1,752,638.11
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	注释 20	2,893,772.56	2,068,298.52
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		106,693,020.50	103,886,690.05
<b>负债合计</b>		6,191,101,598.76	6,237,761,317.54
<b>所有者权益：</b>			
股本	注释 38	500,000,000.00	500,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	注释 39	13,305,949.69	13,305,949.69
减：库存股			
其他综合收益	注释 40	-3,646,844.87	-3,533,020.77
专项储备			
盈余公积	注释 41	33,441,405.03	33,441,405.03
一般风险准备	注释 42	29,473,706.90	29,473,706.90
未分配利润	注释 43	203,367,083.49	204,277,787.15
归属于母公司所有者权益合计		775,941,300.24	776,965,828.00
少数股东权益		12,078,041.64	
<b>所有者权益合计</b>		788,019,341.88	776,965,828.00
<b>负债和所有者权益合计</b>		6,979,120,940.64	7,014,727,145.54

法定代表人：濮岩

主管会计工作负责人：濮岩

会计机构负责人：张延鑫

## （二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2023年6月30日	2022年12月31日
流动资产：			
货币资金		4,005,674,413.83	3,994,188,645.39
其中：期货保证金存款		3,946,987,146.84	3,958,723,111.28
应收货币保证金		2,017,389,572.87	1,457,935,978.64
应收质押保证金		376,128,128.00	593,662,960.00
存出保证金		986,277.26	3,955,232.08
交易性金融资产		200,389,255.53	312,167,921.06
结算备付金		816,088.73	
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		20,800,000.00	20,800,000.00
应收风险损失款		39,064.86	59,726.26
应收佣金		52,114.87	
其他应收款	十、注释 1	31,289,753.51	31,774,126.62
其中：应收利息		46,045.05	49,607.23
应收股利		30,000,000.00	30,000,000.00
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		6,899,493.04	7,314,386.57
<b>流动资产合计</b>		<b>6,660,464,162.50</b>	<b>6,421,858,976.62</b>
<b>非流动资产：</b>			
债权投资			
其他债权投资			
长期应收款			
长期股权投资	十、注释 2	330,000,000.00	260,000,000.00
其他权益工具投资			
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			
固定资产		8,179,232.26	7,837,261.47
在建工程			
使用权资产		3,673,485.61	4,686,903.92
无形资产		1,127,801.11	1,229,925.25
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		1,022,861.29	1,164,278.49
递延所得税资产		680,608.83	625,625.82
其他非流动资产			
<b>非流动资产合计</b>		<b>346,083,989.10</b>	<b>276,943,994.95</b>
<b>资产总计</b>		<b>7,006,548,151.60</b>	<b>6,698,802,971.58</b>
<b>流动负债：</b>			
短期借款			
应付货币保证金		5,603,909,446.03	5,075,810,969.04
应付质押保证金		376,128,128.00	593,662,960.00
交易性金融负债			
期货风险准备金		60,600,916.63	59,452,061.55
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		244,383.66	399,976.23
应付手续费及佣金		112,795.38	279,696.69
应付职工薪酬		6,997,181.79	13,998,254.12
应交税费		2,435,804.59	6,897,492.17
代理买卖证券款		<b>816,088.73</b>	
其他应付款		761,904.15	879,418.22
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		2,576,116.75	2,435,600.86
其他流动负债			
<b>流动负债合计</b>		<b>6,054,582,765.71</b>	<b>5,753,816,428.88</b>
<b>非流动负债：</b>			
长期借款			
应付债券		103,041,095.87	100,065,753.42
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		758,152.07	1,752,638.11
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		1,489,686.61	1,145,297.02
其他非流动负债			
<b>非流动负债合计</b>		<b>105,288,934.55</b>	<b>102,963,688.55</b>
<b>负债合计</b>		<b>6,159,871,700.26</b>	<b>5,856,780,117.43</b>
<b>所有者权益：</b>			
股本		500,000,000.00	500,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		13,305,949.69	13,305,949.69
减：库存股			
其他综合收益			
专项储备			
盈余公积		33,441,405.03	33,441,405.03
一般风险准备		29,473,706.90	29,473,706.90
未分配利润		270,455,389.72	265,801,792.53
<b>所有者权益合计</b>		<b>846,676,451.34</b>	<b>842,022,854.15</b>

负债和所有者权益合计		7,006,548,151.60	6,698,802,971.58
------------	--	------------------	------------------

### (三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、营业收入</b>		1,498,920,716.90	871,713,708.47
手续费及佣金净收入	注释 44	22,723,811.39	41,653,568.00
其中：经纪业务手续费收入		22,425,971.53	41,331,630.71
资产管理业务收入		297,839.86	321,937.29
投资咨询业务收入			
代理销售金融产品收入			
其他代理业务收入			
利息净收入	注释 46	1,956,964.06	13,855,752.83
其中：利息收入		56,044,548.51	43,647,520.90
利息支出		54,087,584.45	29,791,768.07
投资收益（损失以“-”号填列）	注释 45	48,382,244.45	-2,984,875.72
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）		373,972.60	421,113.82
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	注释 49	2,718,592.95	88,321.34
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	注释 47	-34,237,991.19	987,695.55
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入	注释 48	1,457,377,095.24	818,113,246.47
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）	注释 50		
<b>二、营业支出</b>		1,495,347,453.60	854,645,344.54
提取期货风险准备金	注释 51	1,148,855.08	2,082,620.56
税金及附加	注释 52	998,595.68	940,469.14
业务及管理费	注释 53	54,349,620.74	46,821,729.57
研发费用			
信用减值损失	注释 55	245,357.61	23,976.20
其他资产减值损失	注释 56	710,890.32	994,068.65
其他业务成本	注释 54	1,437,894,134.17	803,782,480.42
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		3,573,263.30	17,068,363.93
加：营业外收入	注释 57	32,200.00	3,465,033.66
减：营业外支出	注释 58	2,624,876.77	502,826.46
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		980,586.53	20,030,571.13
减：所得税费用	注释 59	313,248.55	4,970,485.37
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		667,337.98	15,060,085.76
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）		667,337.98	15,060,085.76
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）		1,578,041.64	
2. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”填列）		-910,703.66	15,060,085.76
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-113,824.10	-3,912,243.93
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-113,824.10	-3,912,243.93
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		-113,824.10	-3,912,243.93
（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		-113,824.10	-3,912,243.93
（7）其他			
（二）归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
<b>七、综合收益总额</b>		553,513.88	11,147,841.83
（一）归属于母公司所有者的综合收益总额		-1,024,527.76	11,147,841.83
（二）归属于少数股东的综合收益总额		1,578,041.64	
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益		-0.002	0.03
（二）稀释每股收益		-0.002	0.03

法定代表人：濮岩

主管会计工作负责人：濮岩

会计机构负责人：张延鑫

#### （四） 母公司利润表

单位：元

项目	附注	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、营业收入</b>		45,944,875.07	81,573,618.67
手续费及佣金净收入	十、注释3	22,822,676.93	41,974,348.20
其中：经纪业务手续费收入		22,524,837.07	41,652,410.91
资产管理业务收入		297,839.86	321,937.29



投资咨询业务收入			
代理销售金融产品收入			
其他代理业务收入			
利息净收入	十、注释 4	14,222,491.83	29,531,188.88
其中：利息收入		54,921,035.20	43,533,426.52
利息支出		40,698,543.37	14,002,237.64
投资收益（损失以“-”号填列）	十、注释 5	1,457,944.23	11,948,692.38
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		2,706,473.50	76,795.80
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,176,324.06	-2,299,349.22
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入		3,558,964.52	341,942.63
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
<b>二、营业支出</b>		39,419,017.03	40,004,784.84
提取期货风险准备金		1,148,855.08	2,082,620.56
税金及附加		98,359.03	481,333.71
业务及管理费		37,798,002.00	36,975,095.28
研发费用			
信用减值损失		18,697.74	7,720.44
其他资产减值损失			
其他业务成本		355,103.18	458,014.85
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		6,525,858.04	41,568,833.83
加：营业外收入			0.04
减：营业外支出		321,061.77	26,826.46
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,204,796.27	41,542,007.41
减：所得税费用		1,551,199.07	10,385,501.85
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,653,597.20	31,156,505.56
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		4,653,597.20	31,156,505.56
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>			
（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			
<b>七、综合收益总额</b>		4,653,597.20	31,156,505.56
<b>八、每股收益：</b>			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

### （五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
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		1,192,571,696.66	855,942,878.47
收取利息、手续费及佣金的现金		35,970,304.84	32,555,455.25
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	注释 60	343,631,866.12	174,947,523.06
<b>经营活动现金流入小计</b>		1,572,173,867.61	1,063,445,856.78
为交易目的而持有的金融资产净增加额			
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金		1,192,880,367.11	823,748,255.50
支付利息、手续费及佣金的现金		40,698,543.37	16,083,245.96
以现金支付的业务及管理费		18,839,081.38	14,930,081.75
支付给职工以及为职工支付的现金		29,897,550.33	36,668,194.55
支付的各项税费		13,779,249.34	21,177,301.90
支付其他与经营活动有关的现金	注释 60	359,557,382.47	457,858,102.83
<b>经营活动现金流出小计</b>		1,655,652,174.00	1,370,465,182.49
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		-83,478,306.39	-307,019,325.71
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		2,463,127,583.10	1,565,722,988.09
取得投资收益收到的现金		1,458,508.30	19,022,421.25
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			
<b>投资活动现金流入小计</b>		2,464,586,091.40	1,584,745,409.34
投资支付的现金		2,399,331,793.04	1,605,854,081.46
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的		1,574,965.69	668,439.30

现金			
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			30,000,000.00
<b>投资活动现金流出小计</b>		2,400,906,758.73	1,636,522,520.76
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		63,679,332.67	-51,777,111.42
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		10,500,000.00	
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		10,500,000.00	
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			
<b>筹资活动现金流入小计</b>		10,500,000.00	0.00
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		21,230,821.92	
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		1,652,934.64	1,467,796.88
<b>筹资活动现金流出小计</b>		22,883,756.56	1,467,796.88
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-12,383,756.56	-1,467,796.88
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		9,660.28	-23,210.16
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-32,173,070.00	-360,287,444.17
加：期初现金及现金等价物余额		4,003,550,109.57	2,456,111,800.03
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		3,971,377,039.57	2,095,824,355.86

法定代表人：濮岩

主管会计工作负责人：濮岩

会计机构负责人：张延鑫

#### （六） 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
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		24,192,037.55	44,492,809.09
收取利息、手续费及佣金的现金		29,014,110.46	32,441,482.08
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		327,448,445.07	252,489,458.50
<b>经营活动现金流入小计</b>		380,654,593.08	329,423,749.67
为交易目的而持有的金融资产净增加额			
返售业务资金净增加额			
购买商品、接受劳务支付的现金			
支付利息、手续费及佣金的现金		40,698,543.37	16,083,245.96
以现金支付的业务及管理费		17,895,894.44	13,289,563.10
支付给职工以及为职工支付的现金		25,590,908.41	29,763,138.78

支付的各项税费		9,041,856.61	20,455,192.96
支付其他与经营活动有关的现金		343,019,362.35	443,942,474.74
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>436,246,565.18</b>	<b>523,533,615.54</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>-55,591,972.10</b>	<b>-194,109,865.87</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		1,044,919,917.49	529,997,596.05
取得投资收益收到的现金		1,457,944.23	18,702,332.40
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			
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>1,046,377,861.72</b>	<b>548,699,928.45</b>
投资支付的现金		1,001,964,927.90	717,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,553,439.15	668,439.30
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			
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>1,003,518,367.05</b>	<b>717,668,439.30</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>42,859,494.67</b>	<b>-168,968,510.85</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
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			
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金			
支付其他与筹资活动有关的现金		1,275,798.64	1,090,660.88
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>1,275,798.64</b>	<b>1,090,660.88</b>
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-1,275,798.64</b>	<b>-1,090,660.88</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		<b>-14,008,276.07</b>	<b>-364,169,037.60</b>
加：期初现金及现金等价物余额		3,967,553,308.18	2,453,298,256.21
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		<b>3,953,545,032.11</b>	<b>2,089,129,218.61</b>

### 三、 财务报表附注

#### (一) 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
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	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
3. 是否存在前期差错更正	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
5. 存在控制关系的关联方是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
6. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
7. 是否存在证券发行、回购和偿还情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
8. 是否存在向所有者分配利润的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
9. 是否根据会计准则的相关规定披露分部报告	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
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	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 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	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
12. 是否存在企业结构变化情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
13. 重大的长期资产是否转让或者出售	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
14. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
15. 是否存在重大的研究和开发支出	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
16. 是否存在重大的资产减值损失	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
17. 是否存在预计负债	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

#### 附注事项索引说明:

不适用

#### (二) 财务报表项目附注

##### 一、 合并财务报表主要项目注释

(以下金额单位若未特别注明者均为人民币元, 期初余额均为 2023 年 1 月 1 日)

##### 注释1. 货币资金

项目	期末余额	期初余额
库存现金		
自有银行存款	24,389,892.73	44,826,998.29
其他货币资金		50,000,000.00
期货保证金存款	3,946,987,146.84	3,958,723,111.28
未到期应收利息	52,129,381.72	32,112,642.82
合计	4,023,506,421.29	4,085,662,752.39

其中期货保证金存款:

项目	期末余额	期初余额
交通银行	2,933,258.56	315,231,998.36
建设银行	1,032,066.11	11,582,133.09
工商银行	200,862,195.99	1,695,054.49
农业银行	793,865,329.86	1,217,039.08
中国银行	1,078,366.60	17,772,385.06
兴业银行	1,477,913.48	12,964,207.05
光大银行	13,300,722.07	5,699,939.14
民生银行	14,304,180.66	286,773,584.40
中信银行	102,187,563.69	482,983,707.81
招商银行	1,275,417.43	1,308,795.64
浦发银行	2,802,788,990.75	2,814,543,948.88
平安银行	10,157,639.58	5,856,320.33
广发银行	1,695,826.07	1,083,993.16
邮储银行	10,017.26	10,004.79
农发银行	17,658.73	
合计	3,946,987,146.84	3,958,723,111.28

其中受限制的货币资金明细如下：

项目	期末余额	期初余额
定期存款质押		55,476,027.40
合计		55,476,027.40

### 注释2. 应收货币保证金

交易所名称	期末余额	期初余额
上海期货交易所	104,853,491.60	134,016,536.14
郑州商品交易所	657,357,670.94	364,779,772.47
大连商品交易所	575,417,025.21	289,554,262.39
中国金融期货交易所	474,445,623.62	471,980,737.22
上海国际能源交易中心	34,453,740.08	31,977,217.70
中国证券登记结算有限责任公司	135,115,557.12	138,332,471.73
广州期货交易所	35,519,852.20	27,294,980.99
应收利息	226,612.10	
合计	2,017,389,572.87	1,457,935,978.64

应收货币保证金期末余额比期初余额增加 38.37%，主要原因是期货公司向期货结算机构划出的货币保证金增加所致。

### 注释3. 应收质押保证金

项目	期末余额	期初余额
上海期货交易所	309,080,208.00	406,434,208.00

项目	期末余额	期初余额
大连商品交易所	18,407,360.00	147,202,080.00
郑州商品交易所	8,332,800.00	
中国金融期货交易所	16,111,104.00	16,120,272.00
上海国际能源交易中心	24,196,656.00	23,906,400.00
合计	376,128,128.00	593,662,960.00

#### 注释4. 存出保证金

存放机构	期末余额	期初余额
东北证券股份有限公司大连分公司	986,167.15	3,955,036.98
广发证券股份有限公司上海天山路证券营业	520.48	519.83
无锡市不锈钢电子交易中心有限公司	727.65	726.74
广西糖网食糖批发市场有限责任公司	7,076.86	1,556,739.02
山东招金集团有限公司	10,001.00	10,000.00
东兴期货有限责任公司	11,336.13	11,251.81
中国工商银行股份有限公司上海市浦东开发	61,974.57	61,171.00
国泰君安期货有限公司	2,711.71	2,711.71
东北证券股份有限公司上海普陀区武宁路证	11,180.97	2,236.07
横华国际证券有限公司	5.44	5.44
东北证券股份有限公司重庆沙南街营业部	110.11	195.1
吉林玉米中心批发市场		1,165,776.00
国信证券股份有限公司	10.07	10.05
华鑫证券有限责任公司		2,789.89
物产中大期货有限公司	2,700.88	
安粮期货股份有限公司	1,533.29	
合计	1,096,056.31	6,769,169.64

存出保证金期末余额比期初余额减少 83.81%，主要原因是公司本期减少证券账户存款所致。

#### 注释5. 交易性金融资产

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
分类为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产小计	189,343,450.22	382,598,241.04
债务工具投资		
权益工具投资	14,400.00	12,960.00
衍生金融资产		
其他	189,343,450.22	382,585,281.04
指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产小计		
债务工具投资		

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
混合工具		
其他		
合计	189,343,450.22	382,598,241.04

交易性金融资产的说明：

本公司分类为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产中其他为基金和资产管理计划投资。

**注释6. 应收手续费及佣金**

项目	期末余额	期初余额
应收手续费及佣金	52,114.87	
合计	52,114.87	

**注释7. 结算备付金**

项目	期末余额	期初余额
中国证券登记结算有限责任公司	816,088.73	
合计	816,088.73	

**注释8. 衍生金融资产**

项目	期末余额	期初余额
场内期权	88,110.00	
场外期权		198,220.00
合计	88,110.00	198,220.00

衍生金融资产说明：

衍生金融资产形成原因为期权公允价值变动形成的。

**注释9. 应收结算担保金**

交易所名称	期末余额	期初余额
中国金融期货交易所	10,000,000.00	10,000,000.00
中国证券登记结算有限责任公司	10,800,000.00	10,800,000.00
合计	20,800,000.00	20,800,000.00

注：应收结算担保金为支付给中国金融期货交易所的交易结算会员基础结算担保金和支付给中国证券登记结算有限责任公司的结算担保金账户结算担保金。

**注释10. 应收账款**

**1. 按账龄披露应收账款**

账龄	期末余额	期初余额
0-3月	3,960,024.51	9,119,894.21
3-12月		
1-2年		
2-3年		
3年以上		
小计	3,960,024.51	9,119,894.21
减：坏账准备	19,800.12	45,599.48



账龄	期末余额	期初余额
合计	3,940,224.39	9,074,294.73

## 2. 按坏账准备计提方法分类披露

类别	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的应收账款					
按组合计提预期信用损失的应收账款	3,960,024.51	100.00	19,800.12	0.50	3,940,224.39
其中：账龄组合	3,960,024.51	100.00	19,800.12	0.50	3,940,224.39
合计	3,960,024.51	100.00	19,800.12	0.50	3,940,224.39

续：

类别	期初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的应收账款					
按组合计提预期信用损失的应收账款	9,119,894.21	100.00	45,599.48	0.50	9,074,294.73
其中：账龄组合	9,119,894.21	100.00	45,599.48	0.50	9,074,294.73
合计	9,119,894.21	100.00	45,599.48	0.50	9,074,294.73

## 3. 按组合计提预期信用损失的应收账款账龄分析组合

账龄	期末余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
0-3 月	3,960,024.51	19,800.12	0.50
3-12 月			
1—2 年			
2—3 年			
3 年以上			
合计	3,960,024.51	19,800.12	0.50

## 4. 按欠款方归集的期末余额前五名应收账款

单位名称	期末余额	占应收账款期末余额的比例 (%)	已计提坏账准备
期末余额前五名应收账款汇总	3,960,024.51	100.00	19,800.12

应收账款期末余额比期初余额减少 56.58%，主要原因是子公司和孙公司商品交易产生的期末应收货款减少所致。

### 注释11. 预付款项

#### 1. 预付款项按账龄列示

账龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	10,145,825.45	98.48	13,180,571.54	99.62
1至2年	92,334.66	0.90	29,378.94	0.22
2至3年	26,175.34	0.25	21,175.34	0.16
3年以上	38,234.05	0.37		
合计	10,302,569.50	100.00	13,231,125.82	100.00

**2. 账龄超过一年且金额重要的预付款项未及时结算原因的说明**

无

**3. 按预付对象归集的期末余额前五名的预付款情况**

单位名称	期末金额	占预付款项总额的比例(%)
期末余额前五名预付款项汇总	10,137,478.09	98.40

预付款项期末余额比期初余额减少 22.13%，主要原因是子公司和孙公司商品交易产生的期末预付货款减少所致。

**注释12. 其他应收款**

项目	期末余额	期初余额
应收利息	46,045.05	49,607.23
应收股利		
其他应收款	49,334,568.22	16,822,626.27
合计	49,380,613.27	16,872,233.50

**(一) 应收利息**

**1. 应收利息分类**

项目	期末余额	期初余额
其他	46,045.05	49,607.23
合计	46,045.05	49,607.23

**(二) 应收股利**

无

**(三) 其他应收款**

**1. 按账龄披露**

账龄	期末余额	期初余额
1年以内	46,751,603.88	14,604,673.13
1—2年	2,644,133.81	2,121,242.17
2—3年	43,329.45	86,601.34
3年以上	531,597.51	395,710.49
小计	49,970,664.65	17,208,227.13
减：坏账准备	636,096.43	385,600.86
合计	49,334,568.22	16,822,626.27

**2. 按款项性质分类情况**

款项性质	期末余额	期初余额
------	------	------

款项性质	期末余额	期初余额
房租及物业押金	901,330.84	920,254.79
场外期权结算款	41,285,117.29	6,880,864.91
仓储、物流押金	1,000.00	6,133,034.40
往来及其他	7,783,216.52	3,274,073.03
合计	49,970,664.65	17,208,227.13

### 3. 按坏账准备计提方法分类披露

类别	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的其他应收款					
按组合计提预期信用损失的其他应收款	49,970,664.65	100	636,096.43	1.27	49,334,568.22
其中：账龄组合	49,970,664.65	100	636,096.43	1.27	49,334,568.22
合计	49,970,664.65	100	636,096.43	1.27	49,334,568.22

续：

### 4. 按组合计提预期信用损失的其他应收款

类别	期初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的其他应收款					
按组合计提预期信用损失的其他应收款	17,208,227.13	100.00	385,600.86	2.24	16,822,626.27
其中：账龄组合	17,208,227.13	100.00	385,600.86	2.24	16,822,626.27
合计	17,208,227.13	100.00	385,600.86	2.24	16,822,626.27

账龄组合

### 5. 其他应收款坏账准备计提情况

账龄	期末余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
1年以内	46,751,603.88	233,758.02	0.5
1—2年	2,644,133.81	132,206.70	5
2—3年	43,329.45	4,332.95	10
3年以上	531,597.51	265,798.76	50
合计	49,970,664.65	636,096.43	1.27

  

坏账准备	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)	
期初余额	385,600.86			385,600.86
期初余额在本期				
— 转入第二阶段				
— 转入第三阶段				
— 转回第二阶段				
— 转回第一阶段				
本期计提	261,308.99			261,308.99
本期转回	10,813.42			10,813.42
本期转销				
本期核销				
其他变动				
期末余额	636,096.43			636,096.43

#### 6. 按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款

单位名称	款项性质	期末余额	账龄	占其他应收款期末余额的比例(%)	坏账准备期末余额
中国人民财产保险股份有限公司开封市分公司	场外期权结算款	26,694,870.77	1 年以内	53.42	133,474.35
中国人民财产保险股份有限公司天水市分公司	场外期权结算款	7,623,184.20	1 年以内	15.26	38,115.92
贵阳国家粮食交易中心	保证金	4,920,000.00	1 年以内	9.85	24,600.00
中国平安财产保险股份有限公司吉林分公司	场外期权结算款	4,000,001.75	1 年以内	8	20,000.01
天水勤丰果业有限责任公司	违约合同应收款项	1,995,180.00	1—2 年	3.99	99,759.00
合计		45,233,236.72		90.52	315,949.28

#### 注释13. 存货

##### 1. 存货分类

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	跌价准备	账面价值	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	182,510,598.02	710,890.32	181,799,707.70	307,899,186.19	162,198.72	307,736,987.47

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	跌价准备	账面价值	账面余额	跌价准备	账面价值
合计	182,510,598.02	710,890.32	181,799,707.70	307,899,186.19	162,198.72	307,736,987.47

## 2. 存货跌价准备

项目	期初余额	本期增加金额		本期减少金额			期末余额
		计提	其他	转回	转销	其他	
库存商品	162,198.72	710,890.32			162,198.72		710,890.32
合计	162,198.72	710,890.32			162,198.72		710,890.32

## 3. 其他说明:

期末存货账面余额中 42,439,069.16 元的库存商品用于质押。

存货期末余额比期初余额减少 40.92%，主要原因是子公司和孙公司商品交易产生的期末存货减少所致。

### 注释14. 其他流动资产

#### 其他流动资产分项列示

项目	期末余额	期初余额
待摊费用	5,136,543.37	6,620,392.07
应交税费借方余额	21,109,259.86	32,177,856.34
买入返售金融资产		4,998,630.08
合计	26,245,803.23	43,796,878.49

#### 待摊费用明细情况

项目	期初余额	本期增加额	本期摊销额	其他减少额	期末余额
房租	137,351.69	184,567.94	244,018.48		77,901.15
宽带费	8,414.24	168,319.17	78,777.27		97,956.14
信息费	6,474,626.14	4,344,240.20	5,858,180.26		4,960,686.08
合计	6,620,392.07	4,697,127.31	6,180,976.01		5,136,543.37

### 注释15. 期货会员资格投资

交易所名称	期末余额	期初余额
大连商品交易所会员资格投资	500,000.00	500,000.00
郑州商品交易所会员资格投资	400,000.00	400,000.00
上海期货交易所会员资格投资	500,000.00	500,000.00
合计	1,400,000.00	1,400,000.00

### 注释16. 固定资产

项目	期末余额	期初余额
固定资产	8,530,587.26	8,263,380.01
固定资产清理		
合计	8,530,587.26	8,263,380.01

#### (一) 固定资产

##### 固定资产情况

项目	运输工具	电子设备	其他	合计
----	------	------	----	----

项目	运输工具	电子设备	其他	合计
一. 账面原值				
1. 期初余额	1,725,600.00	21,987,241.57	1,283,805.57	24,996,647.14
2. 本期增加金额		1,629,492.49	15,327.31	1,644,819.80
购置		1,629,492.49	15,327.31	1,644,819.80
其他增加				
3. 本期减少金额		669,996.71	21,968.91	691,965.62
处置或报废		669,996.71	21,968.91	691,965.62
4. 期末余额	1,725,600.00	22,946,737.35	1,277,163.97	25,949,501.32
二. 累计折旧				
1. 期初余额	1,673,832.00	13,834,005.39	1,225,429.74	16,733,267.13
2. 本期增加金额		1,339,775.30	17,394.58	1,357,169.88
本期计提		1,339,775.30	17,394.58	1,357,169.88
其他增加				
3. 本期减少金额		649,554.04	21,968.91	671,522.95
处置或报废		649,554.04	21,968.91	671,522.95
4. 期末余额	1,673,832.00	14,524,226.65	1,220,855.41	17,418,914.06
三. 减值准备				
1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
本期计提				
其他增加				
3. 本期减少金额				
处置或报废				
其他减少				
4. 期末余额				
四. 账面价值				
1. 期末账面价值	51,768.00	8,422,510.70	56,308.56	8,530,587.26
2. 期初账面价值	51,768.00	8,153,236.18	58,375.83	8,263,380.01

(二) 固定资产清理

无

注释17. 使用权资产

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	电子设备	合计
一. 账面原值					
1. 期初余额	7,714,120.69				7,714,120.69
2. 本期增加金额	363,018.89				363,018.89
租赁	363,018.89				363,018.89
3. 本期减少金额					

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	电子设备	合计
租赁到期					
其他减少					
4. 期末余额	8,077,139.58				8,077,139.58
二. 累计折旧					
1. 期初余额	2,453,619.18				2,453,619.18
2. 本期增加金额	1,720,595.70				1,720,595.70
本期计提	1,720,595.70				1,720,595.70
3. 本期减少金额					
租赁到期					
4. 期末余额	4,174,214.88				4,174,214.88
三. 减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加金额					
本期计提					
3. 本期减少金额					
租赁到期					
4. 期末余额					
四. 账面价值					
1. 期末账面价值	3,902,924.70				3,902,924.70
2. 期初账面价值	5,260,501.51				5,260,501.51

**注释18. 无形资产**  
**无形资产情况**

项目	软件	合计
一. 账面原值		
1. 期初余额	6,195,796.30	6,195,796.30
2. 本期增加金额	60,176.99	60,176.99
购置	60,176.99	60,176.99
3. 本期减少金额		
处置		
其他原因减少		
4. 期末余额	6,255,973.29	6,255,973.29
二. 累计摊销		
1. 期初余额	3,884,215.82	3,884,215.82
2. 本期增加金额	241,656.35	241,656.35

项目	软件	合计
本期计提	241,656.35	241,656.35
3. 本期减少金额		
处置		
其他原因减少		
4. 期末余额	4,125,872.17	4,125,872.17
三. 减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
本期计提		
其他原因增加		
3. 本期减少金额		
处置子公司		
其他转出		
4. 期末余额		
四. 账面价值		
1. 期末账面价值	2,130,101.12	2,130,101.12
2. 期初账面价值	2,311,580.48	2,311,580.48

#### 注释19. 长期待摊费用

项目	期初余额	本期增加额	本期摊销额	其他减少额	期末余额
租入房屋装修费	1,193,599.04	23,345.00	171,593.62		1,045,350.42
合计	1,193,599.04	23,345.00	171,593.62		1,045,350.42

#### 注释20. 递延所得税资产和递延所得税负债

##### 1. 已确认的递延所得税资产

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	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
资产减值准备	710,890.32	177,722.58	162,198.72	40,549.68
信用减值准备	696,171.48	174,042.87	431,200.34	107,800.09
应付职工薪酬	5,239,797.48	1,309,949.37	5,831,576.13	1,457,894.03
可抵扣亏损	196,222,266.04	49,055,566.51	218,690,707.33	54,672,676.83
公允价值变动	41,802,940.12	10,450,735.03	6,392,236.88	1,598,059.22
承租人租赁使用权资产与负债	64,142.16	16,035.54	90,146.70	22,536.67
合计	244,736,207.60	61,184,051.90	231,598,066.10	57,899,516.52

##### 2. 已确认的的递延所得税负债

项目	期末余额	期初余额
----	------	------



	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
公允价值变动	11,575,090.24	2,893,772.56	8,273,194.09	2,068,298.52
合计	11,575,090.24	2,893,772.56	8,273,194.09	2,068,298.52

### 3. 未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异明细

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
与子公司会计期间不同产生可抵扣暂时性差异		18,161,308.56
合计		18,161,308.56

## 注释21. 短期借款

### 1. 短期借款分类

项目	期末余额	期初余额
信用借款	450,000,000.00	450,000,000.00
未到期借款利息	13,389,041.08	11,367,808.22
合计	463,389,041.08	461,367,808.22

### 2. 短期借款说明

期末余额为股东东北证券股份有限公司提供的借款，公司于2022年5月1日取得450,000,000.00元，年利率为6.00%，到期日2024年4月30日。

### 注释22. 应付货币保证金

项目	期末余额		期初余额	
	户数	账面余额	户数	账面余额
自然人	53,302.00	1,749,944,080.21	50,133.00	1,578,709,794.62
法人	939.00	3,330,417,288.89	872.00	3,336,718,914.86
合计	54,241.00	5,080,361,369.10	51,005.00	4,915,428,709.48

应付货币保证金期末余额比期初余额增加3.36%，主要原因是期货公司客户量增加，收到客户的货币保证金增加所致。

### 注释23. 应付质押保证金

项目	期末余额	期初余额
上海期货交易所	309,080,208.00	406,434,208.00
大连商品交易所	18,407,360.00	147,202,080.00
郑州商品交易所	8,332,800.00	
中国金融期货交易所	16,111,104.00	16,120,272.00
上海国际能源交易中心	24,196,656.00	23,906,400.00
合计	376,128,128.00	593,662,960.00

### 注释24. 衍生金融负债

项目	期末余额	期初余额
场内期权	685,852.50	204,775.00
场外期权	35,727,416.79	
合计	36,413,269.29	204,775.00

衍生金融负债说明：  
衍生金融负债形成原因为期权公允价值变动形成的。

**注释25. 期货风险准备金**

**1. 明细情况**

项目	期初余额	本期计提	本期动用	期末余额
期货风险准备金	59,452,061.55	1,148,855.08		60,600,916.63
合计	59,452,061.55	1,148,855.08		60,600,916.63

**2. 风险准备金计提方法和比例说明**

公司按手续费净收入的 5%计提风险准备金。

**注释26. 应付票据**

种类	期末余额	期初余额
银行承兑汇票		50,000,000.00
商业承兑汇票		
合计		50,000,000.00

**注释27. 应付账款**

项目	期末余额	期初余额
应付货款	14,694,930.35	1,237,819.16
合计	14,694,930.35	1,237,819.16

**账龄超过一年的重要应付账款**

无

**注释28. 合同负债**

**合同负债情况**

项目	期末余额	期初余额
预收货款	25,075,559.99	4,294,518.17
合计	25,075,559.99	4,294,518.17

合同负债期末余额比期初余额增加 483.90%，主要原因是子公司与孙公司预收货款较上期增加所致。

**注释29. 应付期货投资者保障基金**

**1. 明细情况**

项目	期初余额	本期计提	本期缴纳	期末余额
期货投资者保障基金	399,976.23	244,371.04	399,963.61	244,383.66

**2. 计提方法和比例说明**

2023年 1-6 月投资者保障基金计提比例为成交额的亿分之 6.00。

**注释30. 应付手续费及佣金**

项目	期末余额	期初余额
应付手续费及佣金	289,459.09	409,567.54
合计	289,459.09	409,567.54

**注释31. 应付职工薪酬**

**1. 应付职工薪酬列示**

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
----	------	------	------	------

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期薪酬	20,333,005.46	19,950,197.88	27,591,535.66	12,691,667.68
离职后福利-设定提存计划		2,265,335.48	2,265,335.48	
辞退福利		77,295.00	77,295.00	
一年内到期的其他福利				
合计	20,333,005.46	22,292,828.36	29,934,166.14	12,691,667.68

## 2. 短期薪酬列示

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
工资、奖金、津贴和补贴	15,009,056.46	16,379,505.09	24,220,328.16	7,168,233.39
职工福利费		368,352.70	368,352.70	
社会保险费	48,486.80	1,336,187.48	1,384,674.28	
其中：基本医疗保险费	43,722.60	1,242,758.52	1,286,481.12	
工伤保险费		24,910.19	24,910.19	
生育保险费	4,764.20	68,518.77	73,282.97	
住房公积金		1,594,130.68	1,594,130.68	
工会经费和职工教育经费	5,275,462.20	265,936.61	17,964.52	5,523,434.29
短期累积带薪缺勤				
短期利润（奖金）分享计划				
以现金结算的股份支付				
其他短期薪酬		6,085.32	6,085.32	
合计	20,333,005.46	19,950,197.88	27,591,535.66	12,691,667.68

## 3. 设定提存计划列示

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
基本养老保险		2,194,051.70	2,194,051.70	
失业保险费		71,283.78	71,283.78	
企业年金缴费				
合计		2,265,335.48	2,265,335.48	

## 注释32. 应交税费

税费项目	期末余额	期初余额
营业税	731,302.28	731,302.28
企业所得税	4,421,108.97	8,122,197.54
个人所得税	118,290.51	179,307.06
城市维护建设税	60,791.36	65,355.71
教育费附加	26,840.69	29,512.62
地方教育费	7,462.48	2,261.73

税费项目	期末余额	期初余额
增值税	1,416,827.08	2,831.13
其他	552,996.27	324,969.49
合计	7,335,619.64	9,457,737.56

应交税费期末余额比期初余额减少 22.44%，主要原因是应交企业所得税减少所致。

**注释33. 其他应付款**

项目	期末余额	期初余额
应付利息		9,863,013.70
应付股利		
其他应付款	3,613,778.98	4,411,769.11
合计	3,613,778.98	14,274,782.81

**(一) 应付利息**

项目	期末余额	期初余额
非银机构借款应付利息		9,863,013.70
合计		9,863,013.70

**(二) 应付股利**

无

**(三) 其他应付款**

**1. 按款项性质列示的其他应付款**

款项性质	期末余额	期初余额
代扣保险公积金	50,606.26	59,063.19
撤户余额	87,364.03	87,364.03
场外期权结算款	2,076,384.04	1,578,236.72
往来款	1,399,424.65	2,685,876.15
其他		1,229.02
合计	3,613,778.98	4,411,769.11

**2. 账龄超过一年的重要其他应付款**

无

**注释34. 一年内到期的非流动负债**

项目	期末余额	期初余额
一年内到期的租赁负债	2,754,366.04	2,964,399.68
合计	2,754,366.04	2,964,399.68

**注释35. 其他流动负债**

项目	期末余额	期初余额
待转销项税		386,506.63
合计		386,506.63

**注释36. 应付债券**

**1. 应付债券类别**

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

项目	期末余额	期初余额
其他应付债券	103,041,095.87	100,065,753.42
减：一年内到期的应付债券		
合计	103,041,095.87	100,065,753.42

**2. 应付债券的增减变动(不包括划分为金融负债的优先股、永续债等其他金融工具)**

债券名称	面值	发行日期	债券期限	发行金额	期初余额
次级债	100,000,000.00	2022年12月28日	2028年1月27日	100,000,000.00	100,065,753.42
合计	100,000,000.00			100,000,000.00	100,065,753.42

续：

债券名称	本期发行	按面值计提利息	溢折价摊销	本期偿还	期末余额
次级债	0	3,041,095.87			103,041,095.87
合计	0	2,945,342.45			103,041,095.87

**注释37. 租赁负债**

项目	期末余额	期初余额
租赁付款额	3,645,397.61	4,935,630.99
减：未确认融资费用	132,879.50	218,593.20
租赁付款额现值小计	3,512,518.11	4,717,037.79
减：一年内到期的租赁负债	2,754,366.04	2,964,399.68
合计	758,152.07	1,752,638.11

**注释38. 实收资本（或股本）**

股东名称	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
东北证券股份有限公司	480,000,000.00			480,000,000.00
吉林省融商投资有限公司	20,000,000.00			20,000,000.00
合计	500,000,000.00			500,000,000.00

**注释39. 资本公积**

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	13,305,949.69			13,305,949.69
合计	13,305,949.69			13,305,949.69

**注释40. 其他综合收益**

项目	2023年1月1日	本期发生额									2023年6月30日
		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	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	减：套期储备转入相关资产或负债	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	减：结转重新计量设定受益计划变动额	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	
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											
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. 可供出售金融资产公允价值变动损益		—									
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益		—									
4. 其他债权投资公允价值变动											
5. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额											
6. 其他债权投资信用减值准备											
7. 现金流量套期储备											
8. 外币报表折算差额	-3,533,020.77	-113,824.10									-3,646,844.87
9. 一揽子处置子公司在丧失控制权之前产生的处置收益											
10. 其他资产转换为公允价值模式计量的投资性房地产											
其他综合收益合计	-3,533,020.77	-113,824.10									-3,646,844.87

**注释41. 盈余公积**

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	33,441,405.03			33,441,405.03
合计	33,441,405.03			33,441,405.03

**注释42. 一般风险准备金****1. 明细情况**

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备金	29,473,706.90			29,473,706.90
合计	29,473,706.90			29,473,706.90

**注释43. 未分配利润**

项目	金额	提取或分配比例(%)
调整前上期末未分配利润	204,277,787.15	—
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		—
调整后期初未分配利润	204,277,787.15	—
加：本期归属于母公司所有者的净利润	-910,703.66	—
减：提取法定盈余公积		10.00
提取任意盈余公积		
提取储备基金		
提取企业发展基金		
利润归还投资		
提取职工奖福基金		
提取一般风险准备		10.00
应付普通股股利		
转为股本的普通股股利		
优先股股利		
对其他股东的分配		
利润归还投资		
其他利润分配		
加：盈余公积弥补亏损		
设定受益计划变动额结转留存收益		
其他综合收益结转留存收益		
所有者权益其他内部结转		
期末未分配利润	203,367,083.49	

**注释44. 手续费及佣金净收入**

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
交易手续费净收入	10,740,230.95	13,568,069.95
交易所手续费返还	11,564,614.36	27,736,896.83
交割手续费净收入	121,126.22	26,663.93
资管业务收入	297,839.86	321,937.29

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
合计	22,723,811.39	41,653,568.00

**注释45. 投资收益**  
**投资收益明细情况**

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
权益法核算的长期股权投资收益		
成本法核算的长期股权投资收益		
处置长期股权投资产生的投资收益		
交易性金融资产持有期间的投资收益	-3,856.54	1,239,842.10
处置交易性金融资产取得的投资收益	2,747,616.09	10,728,746.76
债权投资持有期间的投资收益		
处置债权投资取得的投资收益		
其他债权投资持有期间的投资收益		
处置其他债权投资取得的投资收益		
其他权益工具投资持有期间的股利收入		
本期终止确认的其他权益工具股利收入		
以摊余成本计量的金融资产终止确认收益	373,972.60	421,113.82
取得控制权时股权按公允价值重新计量产生的利得		
丧失控制权后剩余股权按公允价值重新计量产生的利得		
现金流量套期的无效部分的已实现收益（损失）		
期货、期权交易取得的投资收益	45,264,512.30	-15,374,578.40
合计	48,382,244.45	-2,984,875.72

**注释46. 利息净收入**

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	56,044,548.51	43,647,520.90
减：利息支出	54,087,584.45	29,791,768.07
合计	1,956,964.06	13,855,752.83

**注释47. 公允价值变动收益**

产生公允价值变动收益的来源	2023年1-6月	2022年1-6月
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融资产	-125,050.51	-2,074,037.81
衍生金融资产	-201,263.50	872,526.17
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
交易性金融负债		
衍生金融负债	-35,139,542.35	
按公允价值计量的投资性房地产		
按公允价值计量的生物资产		
按公允价值计量的贵金属		



产生公允价值变动收益的来源	2023年1-6月	2022年1-6月
现金流量套期的无效部分的未实现收益净额		
商品期货交易	1,227,865.17	2,189,207.19
合计	-34,237,991.19	987,695.55

公允价值变动收益本期发生额较上期减少 3,566.45%，主要原因是受商品期货行情影响所致。

**注释48. 其他业务收入**

项目	本期发生额	上期发生额
中间业务介绍收入		
现货买卖	1,453,811,737.99	817,771,303.84
资金占用费		
交易所培训费及交易所系统保障费等	222,264.16	262,264.15
保险加期货项目收入	3,336,700.36	
其他	6,392.73	79,678.48
合计	1,457,377,095.24	818,113,246.47

**注释49. 其他收益**

**1. 其他收益明细情况**

产生其他收益的来源	本期发生额	上期发生额
政府补助	2,629,605.85	60,663.98
个税手续费返还	88,987.10	27,657.36
合计	2,718,592.95	88,321.34

**2. 计入其他收益的政府补助**

项目	本期发生额	上期发生额	与资产相关/ 与收益相关
开发扶持资金			与收益相关
稳岗补贴	5,000.00	32,614.55	与收益相关
金融业发展扶持基金			与收益相关
招聘残疾人超比例奖励	16,205.85	20,502.26	与收益相关
以工代训补贴	2,000.00	7,547.17	与收益相关
社会保险补贴			与收益相关
经济贡献奖	2,606,400.00		与收益相关
合计	2,629,605.85	60,663.98	

其他收益本期发生额较上期增加了 2,978.07%，主要原因是政府补助增加所致。

**注释50. 资产处置收益**

项目	本期发生额	上期发生额
固定资产处置利得或损失	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**注释51. 提取期货风险准备金**

项目	本期发生额	上期发生额
期货风险准备金	1,148,855.08	2,082,620.56
合计	1,148,855.08	2,082,620.56

**注释52. 税金及附加**

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	72,600.71	280,966.02
教育费附加	37,029.81	118,037.09
地方教育附加	24,515.17	78,691.40
印花税及其他	864,449.99	462,774.63
合计	998,595.68	940,469.14

**注释53. 业务管理费用**

项目	本期发生额	上期发生额
工资	15,837,640.57	17,635,071.98
咨询费	28,773.57	55,708.88
信息费	6,776,965.57	5,717,862.55
房租	2,456,350.06	2,454,034.12
邮电费	1,421,732.41	700,445.96
劳动保险费	3,607,608.28	4,884,015.95
办公费	502,199.25	238,092.88
机动车辆运营费	580,624.90	897,666.13
折旧	1,357,169.87	976,390.18
差旅费	624,893.65	314,380.55
佣金支出	664,961.17	2,081,008.32
仓储物流费	10,801,736.54	2,770,779.99
保险加期货项目保费支出	500,000.00	
其他	9,188,964.90	8,096,272.08
合计	54,349,620.74	46,821,729.57

**注释54. 其他业务成本**

项目	本期发生额	上期发生额
交易所办会成本	355,103.18	458,014.85
现货买卖	1,437,539,030.99	803,324,465.57
合计	1,437,894,134.17	803,782,480.42

**注释55. 信用减值损失**

项目	本期发生额	上期发生额
坏账损失	245,357.61	23,976.20
合计	245,357.61	23,976.20

**注释56. 其他资产减值损失**

项目	本期发生额	上期发生额
存货跌价损失及合同履约成本减值损失	710,890.32	994,068.65
合计	710,890.32	994,068.65

**注释57. 营业外收入**

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额

收到合同违约金	32,200.00	3,465,032.00
其他		1.66
合计	32,200.00	3,465,033.66

营业外收入本期发生额较上期减少 99.07%，主要原因是子公司现货业务违约赔偿收入减少所致。

**注释58. 营业外支出**

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
对外捐赠	300,000.00		300,000.00
违约和赔偿损失	2,304,434.07	476,000.00	2,304,434.07
非流动资产毁损报废损失	20,442.66	26,812.31	20,442.66
其他	0.04	14.15	0.04
合计	2,624,876.77	502,826.46	2,624,876.77

营业外支出本期发生额较上期增加 422.02%，主要原因是子公司现货业务违约赔偿支出增加所致。

**注释59. 所得税费用**

**1. 所得税费用表**

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
当期所得税费用	2,772,309.89	10,579,395.23
递延所得税费用	-2,459,061.34	-5,608,909.86
合计	313,248.55	4,970,485.37

**2. 会计利润与所得税费用调整过程**

项目	本期发生额
利润总额	980,586.53
按法定/适用税率计算的所得税费用	245,146.63
子公司适用不同税率的影响	67,281.64
调整以前期间所得税的影响	-41.74
非应税收入的影响	
不可抵扣的成本、费用和损失影响	862.02
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	
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	
所得税费用	313,248.55

**注释60. 现金流量表附注**

**1. 收到其他与经营活动有关的现金**

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
场外期权权利金	16,474,993.65	6,653,120.24
其他业务收入	3,922,771.35	1,788,495.81
存出保证金减少	2,968,954.82	50,948,493.07
应付货币保证金增加	316,195,129.21	101,913,115.66
政府补助收入	2,629,605.85	76,795.80
个税手续费返还	88,987.10	
其他应付款增加		45,501.84
其他应收款减少	480,810.93	

其他流动资产减少		2,839,234.71
其他	857,766.59	10,562,799.09
合计	343,619,019.50	174,827,556.22

## 2. 支付其他与经营活动有关的现金

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
场外期权权益	16,469,724.12	12,442,912.46
捐赠支出	300,000.00	
其他其他流动资产增加	745,496.94	
应收货币保证金增加	341,918,762.23	439,431,878.79
其他业务支出	55,103.18	458,014.85
其他应收款增加		4,052,581.10
其他	68,296.00	1,472,715.63
合计	359,557,382.47	457,858,102.83

### 注释61. 现金流量表补充资料

#### 1. 现金流量表补充资料

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	667,337.98	15,060,085.77
加：期货风险准备金	1,148,855.08	2,082,620.56
信用减值准备	245,357.61	23,976.20
资产减值准备	710,890.32	994,068.65
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	1,357,169.87	976,390.18
使用权资产折旧	1,685,058.60	1,482,525.06
无形资产摊销	241,656.35	232,706.02
长期待摊费用摊销	171,593.62	273,576.96
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)	0.00	0
固定资产报废损失(收益以“—”号填列)	20,442.66	26,812.31
公允价值变动损失(收益以“—”号填列)	34,237,991.19	-987,695.55
财务费用(收益以“—”号填列)	12,369,590.07	15,698,646.22
投资损失(收益以“—”号填列)	-48,283,378.91	3,305,655.92
递延所得税资产减少(增加以“—”号填列)	-3,284,535.38	-5,663,226.55
递延所得税负债增加(减少以“—”号填列)	825,474.04	-1,072,861.56
存货的减少(增加以“—”号填列)	125,937,279.77	-102,680,222.67
经营性应收项目的减少(增加以“—”号填列)	-209,969,646.09	-428,943,134.02
经营性应付项目的增加(减少以“—”号填列)	-1,559,443.16	192,455,983.73
其他	0.00	0
经营活动产生的现金流量净额	-83,478,306.38	-307,019,325.71
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动	0.00	0.00
债务转为资本	0.00	0

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
一年内到期的可转换公司债券	0.00	0
融资租入固定资产	0.00	0
3. 现金及现金等价物净变动情况	0.00	0
现金的期末余额	3,971,377,039.57	2,095,824,355.86
减：现金的期初余额	4,003,550,109.57	2,456,111,800.03
加：现金等价物的期末余额	0.00	0
减：现金等价物的期初余额	0.00	0
现金及现金等价物净增加额	-32,173,070.00	-360,287,444.17

## 2. 现金和现金等价物的构成

项目	2023年6月30日	2022年6月30日
一、现金	3,971,377,039.57	2,095,824,355.86
其中：库存现金		0.00
可随时用于支付的银行存款	24,389,892.73	8,788,509.67
可随时用于支付的期货保证金	3,946,987,146.84	2,087,035,846.19
二、现金等价物		0.00
其中：三个月内到期的债券投资		0.00
三、期末现金及现金等价物余额	3,971,377,039.57	2,095,824,355.86
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金及现金等价物		

## 注释62. 所有权或使用权受到限制的资产

项目	余额	受限原因
存货	42,439,069.16	期货交易保证金
合计	42,439,069.16	

## 注释63. 外币货币性项目

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			304,166.80
其中：美元	14,796.45	7.2258	106,916.19
港币	213,942.40	0.92198	197,250.61

## 注释64. 政府补助

### 政府补助基本情况

政府补助种类	本期发生额	计入当期损益的金额	备注
计入其他收益的政府补助	2,629,605.85	2,629,605.85	详见附注五注释 49
合计	2,629,605.85	2,629,605.85	

## 二、合并范围的变更

### 其他原因的合并范围变动

2023年1月13日本公司投资设立上海融渤实业有限公司,持股比例65.00%,注册资本为3,000.00万元人民币。

本期末,本公司做为单一投资者投资的良岳山南凯鑫1号私募证券投资基金、盛冠达量化套利8号私募证券投资基金、祝融金霖三号私募证券投资基金,幂数富饶套利3号私募证券投资基金,明晟东诚友诚3号主动式FOF私募证券投资基金,岩叶东晟1号私募证券投资基金,岩叶东明2号私募证

券投资基金，古木艳阳3号商品期权私募证券投资基金，并对其实施控制，故将其纳入本公司合并财务报表的合并范围。

### 三、 在其他主体中的权益

#### 在子公司中的权益

##### 企业集团的构成

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	
渤海融盛资本管理有限公司	上海	上海	资本投资服务	100.00		设立
渤海融幸(上海)商贸有限公司	上海	上海	其他批发业		100.00	设立
渤海融盛商贸(香港)有限公司	香港	香港	其他批发业		100.00	设立
上海融渤实业有限公司	上海	上海	批发业		65.00	设立

其他说明：2022年4月，经公司股东会批准，公司向渤海融盛资本管理有限公司增加注册资本20,000.00万元，渤海融盛资本管理有限公司注册资本由15,000.00万元，增至35,000.00万元。截至2022年12月31日公司已认缴新增注册资本11,000.00万元。2023年4月减资5000万元，注册资本由35000万元减至30000万元

2023年1月13日，经中国（上海）自由贸易试验区临港新片区行政审批局审批，渤海融盛投资设立上海融渤实业有限公司，持股比例65.00%，注册资本为3,000.00万元人民币。

#### 四、 与金融工具相关的风险披露

本公司的经营活动会面临各种金融风险：信用风险、流动风险和市场风险。本公司整体的风险管理计划针对金融市场的不可预见性，力求减少对本公司财务业绩的潜在不利影响。

##### (一) 信用风险

本公司的信用风险主要来自货币资金、应收货币保证金、应收质押保证金、应收结算担保金、存出保证金、应收票据、应收账款、其他应收款、在交易性金融资产中列报的集合资产管理计划等。管理层已制定适当的信用政策，并且不断监察这些信用风险的敞口。

本公司持有的货币资金、应收货币保证金、应收质押保证金、应收结算担保金、存出保证金、集合资产管理计划，主要存放于商业银行、期货交易所、证券公司等金融机构，管理层认为这些金融机构具备较高信誉和资产状况，存在较低的信用风险。本公司采取限额政策以规避对任何金融机构的信用风险。

对于应收账款、其他应收款，本公司设定相关政策以控制信用风险敞口。本公司基于对客户的财务状况、信用记录及其它因素诸如目前市场状况等评估客户的信用资质。本公司会定期对客户信用记录进行监控，以确保本公司的整体信用风险在可控的范围内。

截止2023年6月30日，本公司的前五大客户的应收账款占本公司应收账款总额100.00%(2022年：100.00%)；本公司的前五大客户的其他应收款占本公司其他应收款项总额94.06%(2022年：78.56%)

本公司所承受的最大信用风险敞口为资产负债表中每项金融资产的账面金额。本公司没有提供任何其他可能令本公司承受信用风险的担保。

##### (二) 流动性风险

流动性风险是指本公司无法及时获得充足资金，满足业务发展需要或偿付到期债务以及其他支付义务的风险。

本公司财务部门持续监控公司短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备；同时持续监控是否符合借款协议的规定，从主要金融机构获得提供足够备用资金的承诺，以满足短期和长期的资金需求。

截止2023年6月30日，本公司金融负债以未折现的合同现金流量按合同剩余期限列示如下：

项目	期末余额					
	账面净值	账面原值	1年以内	1-2年	2-3年	3年以上
短期借款	463,389,041.08	463,389,041.08	463,389,041.0			

项目	期末余额					
	账面净值	账面原值	1年以内	1-2年	2-3年	3年以上
			8			
应付货币保证金	5,080,361,369.10	5,080,361,369.10	5,080,361,369.10			
应付质押保证金	376,128,128.00	376,128,128.00	376,128,128.00			
衍生金融负债	36,413,269.29	36,413,269.29	36,413,269.29			
期货风险准备金	60,600,916.63	60,600,916.63	60,600,916.63			
应付票据						
应付账款	14,694,930.35	14,694,930.35	14,694,930.35			
应付职工薪酬	12,691,667.68	12,691,667.68	12,691,667.68			
应交税金	7,335,619.64	7,335,619.64	7,335,619.64			
应付投资者保障基金	244,383.66	244,383.66	244,383.66			
应付手续费及佣金	289,459.09	289,459.09	289,459.09			
其他应付款	3,613,778.98	3,613,778.98	3,613,778.98			
应付债券	103,041,095.87	103,041,095.87				103,041,095.87
小计	6,158,803,659.37	6,158,803,659.37	6,055,762,563.50			103,041,095.87

### (三) 市场风险

目前行业低手续费的竞争日趋激烈，互联网金融的兴起更是将期货行业零手续费竞争公开化。公司手续费标准也会面临降低的风险，但公司管理层为了避免手续费收入下降而导致的盈利下降的风险，采取了提供增值服务，优化客户结构等措施规避该风险。

### 五、 公允价值

#### (一) 以公允价值计量的金融工具

本公司按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融资产工具于2023年6月30日的账面价值。公允价值整体归类于三个层次时，依据的是公允价值计量时使用的各重要输入值所属三个层次中的最低层次。三个层次的定义如下：

第1层次：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；

第2层次：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；

第二层次输入值包括：1) 活跃市场中类似资产或负债的报价；2) 非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；3) 除报价以外的其他可观察输入值，包括在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线、隐含波动率和信用利差等；4) 市场验证的输入值等。

第3层次：是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### (二) 期末公允价值计量

##### 持续的公允价值计量

项目	期末公允价值			
	第1层次	第2层次	第3层次	合计
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产小计	96,952,719.41	92,390,730.81		189,343,450.22
债务工具投资				
权益工具投资	14,400.00			14,400.00
衍生金融资产				
其他	96,938,319.41	92,390,730.81		189,329,050.22
衍生金融资产	85,410.00		2,700.00	88,110.00

项目	期末公允价值			
	第1层次	第2层次	第3层次	合计
<b>资产合计</b>	<b>97,038,129.41</b>	<b>92,390,730.81</b>	<b>2,700.00</b>	<b>189,431,560.22</b>
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债小计	685,852.50		35,727,416.79	36,413,269.29
发行的交易性债券				
衍生金融负债				
其他				
衍生金融负债	685,852.50		35,727,416.79	36,413,269.29
<b>负债合计</b>	<b>685,852.50</b>		<b>35,727,416.79</b>	<b>36,413,269.29</b>

**(三) 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**

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

**(四) 持续和非持续第二层次公允价值计量的项目，采用估值技术和重要参数的定性及定量信息**

项目	期末公允价值	估值技术	重要参数	
			定性信息	定量信息
集合计划、私募基金及其他	92,390,730.81	对相关资产公开报价计算		相关资产收盘价
合计	92,390,730.81			

**(五) 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况**

本公司不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：应收货币保证金、存出保证金、应付货币保证金、期货风险准备金和其他应付款等。上述不以公允价值计量的金融资产和负债的账面价值与公允价值相差很小。

**六、 关联方及关联交易**

**(一) 本企业的母公司情况**

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本(万元)	对本公司的持股比例(%)	对本公司的表决权比例(%)
东北证券股份有限公司	吉林省长春市	证券及与证券相关的业务	234,045.29	96.00	96.00

**(二) 本公司的子公司情况详见附注七在子公司中的权益**

**(三) 其他关联方情况**

其他关联方名称	其他关联方与本公司的关系
吉林省融商投资有限公司	股东
东证融达投资有限公司	同一控制人
东方基金管理股份有限公司	同一控制人
东证融汇证券资产管理有限公司	同一控制人

**(四) 关联方交易**

1. 存在控制关系且已纳入本公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

**2. 购买商品、接受劳务的关联交易**

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
东北证券股份有限公司	手续费支出	5,761.64	12,768.12



东北证券股份有限公司	佣金支出	1,220,981.13	1,813,508.90
东北证券股份有限公司	信息费		
东北证券股份有限公司	水电费		11,418.83
东方基金管理股份有限公司	手续费支出		
合计		1,226,742.77	1,837,695.85

### 3. 销售商品、提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
东北证券股份有限公司	手续费收入	139,785.93	149,645.06
东北证券股份有限公司	手续费收入		79,678.48
东方基金管理股份有限公司	手续费收入	0	47.17
东证融汇证券资产管理有限公司	手续费收入	153.24	73.63
合计		139,939.17	229,444.34

### 4. 关联租赁情况

本公司作为承租方

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上期确认的租赁费
东北证券股份有限公司	房屋建筑物		87,199.98
合计			87,199.98

### 5. 关联方资金拆借

公司本期向股东东北证券股份有限公司拆入资金 450,000,000.00 元，同时截至 2023 年 6 月 30 日应付拆借资金利息 13,389,041.08 元。

2022 年 12 月 13 日，股东会审议通过《关于借入次级债务暨关联交易的议案》，公司向控股股东东北证券股份有限公司借入次级债务。借入规模为人民币 1 亿元、期限为 5 年 1 个月，同时截至 2023 年 6 月 30 日应付次级债务利息 3,041,095.87 元。

### 6. 关联方应收应付款项

(1) 本公司应收关联方款项

项目名称	关联方	2023年6月30日		2022年12月31日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
存出保证金					
	东北证券股份有限公司	997,458.23		3,957,468.15	

(2) 本公司应付关联方款项

项目名称	关联方	2023年6月30日	2022年12月31日
短期借款			
	东北证券股份有限公司	463,389,041.08	461,367,808.22
应付利息			
	东北证券股份有限公司		9,863,013.70
应付货币保证金			
	东北证券股份有限公司	172,152,727.40	294,901,234.79
	东证融汇证券资产管理有限公司	36,009,246.53	9,213,369.12

项目名称	关联方	2023年6月30日	2022年12月31日
	东证融达投资有限公司	10.94	10.94
	东方基金管理股份有限公司	517,952.64	515,302.41
其他应付款			
	东北证券股份有限公司	243,656.70	266,391.61
应付债券			
	东北证券股份有限公司	103,041,095.87	100,065,753.42

2018年8月21日公司作为资产管理人发起设立了“渤海期货-国融1号集合资产管理计划”，该计划为混合类一对多开放式资产管理计划。截至2023年6月30日，公司共收取管理费收入188,621.92元，业绩报酬0.00元。

## 七、 承诺及或有事项

### (一) 重要承诺事项

本公司不存在需要披露的重要承诺事项。

### (二) 资产负债表日存在的重要或有事项

本公司不存在需要披露的重要或有事项。

## 八、 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日止，本公司不存在需要披露重大资产负债表日后事项。

## 九、 其他重要事项说明

### 分部信息

#### 1. 报告分部的确定依据与会计政策

本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。本公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够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。

本公司以经营分部为基础确定报告分部，满足下列条件之一的经营分部确定为报告分部：

- (1) 该经营分部的分部收入占所有分部收入合计的10%或者以上；
- (2) 该分部的分部利润（亏损）的绝对额，占所有盈利分部利润合计额或者所有亏损分部亏损合计额的绝对额两者中较大者的10%或者以上。

按上述会计政策确定的报告分部的经营分部的对外交易收入合计额占总收入的比重未达到75%时，增加报告分部的数量，按下述规定将其他未作为报告分部的经营分部纳入报告分部的范围，直到该比重达到75%：

- (1) 将管理层认为披露该经营分部信息对会计信息使用者有用的经营分部确定为报告分部；
- (2) 将该经营分部与一个或一个以上的具有相似经济特征、满足经营分部合并条件的其他经营分部合并，作为一个报告分部。

分部间转移价格参照市场价格确定，与各分部共同使用的资产、相关的费用按照收入比例在不同的分部之间分配。

#### 2. 本公司确定报告分部考虑的因素、报告分部的产品和劳务的类型

本公司的报告分部都是位于不同地域的业务单元。由于不同地域的公司其所处的市场环境不同、公司需要制定不同的市场战略，因此本公司按地理区域分别独立管理各个报告分部的经营活动，分别评价其经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。

本公司有6个报告分部：东北区、华北区、西南区、华东区、华中区、华南区。

#### 3. 报告分部的财务信息

金额单位：万元

项目	2022年期末余额/本期发生额						
	东北区	华北区	西南区	华东区	华中区	华南区	合计
一.营业收入	369.49	64.04	40.58	149,213.06	67.03	137.87	149,892.07

项目	2022 年期末余额/本期发生额						
	东北区	华北区	西南区	华东区	华中区	华南区	合计
其中：手续费收入	318.86	49.86	26.56	1,718.70	51.04	107.36	2,272.38
利息收入	50.51	14.16	14.00	70.82	15.88	30.33	195.70
二.营业成本费用	336.19	122.71	94.32	148,705.14	121.25	155.14	149,534.75
其中：业务管理费	318.98	120.56	92.91	4,635.02	118.44	149.05	5,434.96
风险基金	15.94	2.49	1.33	87.21	2.55	5.37	114.89
税金及附加	1.26	0.20	0.08	97.37	0.25	0.70	99.86
三.利润总额	33.20	-58.67	-53.74	248.82	-54.22	-17.33	98.06
四.所得税费用	3.69	0.87	0.48	24.51	0.74	1.03	31.32
五.净利润	29.50	-59.54	-54.22	224.30	-54.95	-18.36	66.73
六.资产总额	17.46	42.20	16.43	697,773.44	52.50	10.06	697,912.09
七.负债总额	-3,799.46	177.34	-131.67	622,893.76	235.90	-265.71	619,110.16

## 十、 母公司财务报表主要项目注释

### 注释1. 其他应收款

项目	期末余额	期初余额
应收利息	46,045.05	49,607.23
应收股利	30,000,000.00	30,000,000.00
其他应收款	1,243,708.46	1,724,519.39
合计	31,289,753.51	31,774,126.62

#### (一) 应收利息

##### 1. 应收利息分类

项目	期末余额	期初余额
其他	46,045.05	49,607.23
合计	46,045.05	49,607.23

#### 应收利息的说明

其他为应收结算担保金账户利息。

#### (二) 应收股利

##### 1. 应收股利

被投资单位	期末余额	期初余额
渤海融盛资本管理有限公司	30,000,000.00	30,000,000.00
合计	30,000,000.00	30,000,000.00

##### 2. 重要的账龄超过 1 年的应收股利

被投资单位	期末余额	账龄	未收回的原因	是否发生减值及其原因
渤海融盛资本管理有限公司	30,000,000.00	5 年以上	利于子公司资金周转	否
合计	30,000,000.00			

#### (三) 其他应收款

##### 1. 按账龄披露其他应收款

账龄	期末余额
----	------

	其他应收款	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	923,719.73	4,618.60	0.5
1—2 年	95,439.77	4,771.99	5
2—3 年	34,996.45	3,499.65	10
3 年以上	404,885.51	202,442.76	50
小计	1,459,041.46	215,333.00	14.76
减：坏账准备	215,333.00		
合计	1,243,708.46		

## 2. 按款项性质分类情况

款项性质	期末余额	期初余额
房租及物业押金	765,685.84	794,542.79
其他	693,355.62	1,147,273.26
合计	1,459,041.46	1,941,816.05

## 3. 按坏账准备计提方法分类披露

类别	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的其他应收款					
按组合计提预期信用损失的其他应收款	1,459,041.46	100	215,333.00	14.76	1,243,708.46
其中：账龄分析组合	1,459,041.46	100	215,333.00	14.76	1,243,708.46
合计	1,459,041.46	100	215,333.00	14.76	1,243,708.46

续：

类别	期初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的其他应收款					
按组合计提预期信用损失的其他应收款	1,941,816.05	100.00	217,296.66	11.19	1,724,519.39
其中：账龄分析组合	1,941,816.05	100.00	217,296.66	11.19	1,724,519.39
合计	1,941,816.05	100.00	217,296.66	11.19	1,724,519.39

## 4. 按组合计提预期信用损失的其他应收款

### (1) 账龄组合

账龄	期末余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	923,719.73	4,618.60	0.50
1—2 年	95,439.77	4,771.99	5.00
2—3 年	34,996.45	3,499.65	10.00

账龄	期末余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
3年以上	404,885.51	202,442.76	50.00
合计	1,459,041.46	215,333.00	

#### 5. 其他应收款坏账准备计提情况

坏账准备	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)	
期初余额	217,296.66			217,296.66
期初余额在本期				
—转入第二阶段				
—转入第三阶段				
—转回第二阶段				
—转回第一阶段				
本期计提	8,849.76			8,849.76
本期转回	10,813.42			10,813.42
本期转销				
本期核销				
其他变动				
期末余额	215,333.00			215,333.00

#### 注释2. 长期股权投资

款项性质	期末余额			期初余额		
	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	330,000,000.00		330,000,000.00	260,000,000.00		260,000,000.00
合计	330,000,000.00		330,000,000.00	260,000,000.00		260,000,000.00

#### 对子公司投资

被投资单位	初始投资成本	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备期末余额
渤海融盛资本管理有限公司	260,000.00	260,000.00	90,000,000.00	20,000,000.00	330,000.00		
合计	260,000.00	260,000.00	90,000,000.00	20,000,000.00	330,000.00		

#### 注释3. 手续费及佣金净收入

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
交易手续费净收入	10,839,096.49	13,888,850.15

项 目	2023 年 1-6 月	2022 年 1-6 月
交易所手续费返还	11,564,614.36	27,736,896.83
交割手续费净收入	121,126.22	26,663.93
资管业务收入	297,839.86	321,937.29
合计	22,822,676.93	41,974,348.20

#### 注释4. 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	54,921,035.20	43,533,426.52
减：利息支出	40,698,543.37	14,002,237.64
合计	14,222,491.83	29,531,188.88

#### 注释5. 投资收益

项目	2023 年 1-6 月	2022 年 1-6 月
权益法核算的长期股权投资收益		
成本法核算的长期股权投资收益		
处置长期股权投资产生的投资收益		
交易性金融资产持有期间的投资收益	-3,856.54	1,239,842.10
处置交易性金融资产取得的投资收益	1,461,800.77	10,708,850.28
债权投资持有期间的投资收益		
处置债权投资取得的投资收益		
其他债权投资持有期间的投资收益		
处置其他债权投资取得的投资收益		
其他权益工具投资持有期间的股利收入		
本期终止确认的其他权益工具股利收入		
以摊余成本计量的金融资产终止确认收益		
取得控制权时股权按公允价值重新计量产生的利得		
丧失控制权后剩余股权按公允价值重新计量产生的利得		
现金流量套期的无效部分的已实现收益（损失）		
合计	1,457,944.23	11,948,692.38

### 十一、 补充资料

#### （一） 当期非经常性损益明细表

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-20,442.66	
越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	2,718,592.95	
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		

项目	金额	说明
益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债、债权投资和其他债权投资取得的投资收益	2,622,565.58	
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		
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	-2,572,234.11	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
减: 所得税影响额	687,120.44	
少数股东权益影响额(税后)		
合计	2,061,361.32	

**(二) 净资产收益率及每股收益**

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	-0.12	-0.002	-0.002
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	-0.38	-0.006	-0.006

## 附件 I 会计信息调整及差异情况

### 一、 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

### 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	-20,442.66
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	2,718,592.95
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、债权投资和其他债权投资取得的投资收益	2,622,565.58
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-2,572,234.11
<b>非经常性损益合计</b>	<b>2,748,481.76</b>
减：所得税影响数	687,120.44
少数股东权益影响额（税后）	0.00
<b>非经常性损益净额</b>	<b>2,061,361.32</b>

### 三、 境内外会计准则下会计数据差异

适用  不适用

## 附件 II 融资情况

### 一、 报告期内的普通股股票发行及募集资金使用情况

#### (一) 报告期内的股票发行情况

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

### 二、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用  不适用

### 三、 存续至本期的债券融资情况

适用  不适用

单位：元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续期间		是否违约
					起始日期	终止日期	
	渤海期	次级债务	100,000,000.00	6%	2022年12	2028年1	否



	货-次级 债务				月 28 日	月 27 日	
合计	-	-	100,000,000.00	-	-	-	-

**债券违约情况:**

适用 不适用

**募集资金用途变更情况**

适用 不适用

**四、 存续至本期的可转换债券情况**

适用 不适用