



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

— 2024 —

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	17
第四节	股份变动及股东情况	20
第五节	董事、监事、高级管理人员及核心员工变动情况	22
第六节	财务会计报告	25
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	2024年1月1日至2024年6月30日
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
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》
《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》
国投证券	指	国投证券股份有限公司

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	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		
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）	国投证券	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	http://www.bhfcc.com		
指定信息披露平台	www.neeq.com.cn		
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实现情况

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、期权经纪业务的主要营销渠道包括网点渠道、IB 业务（介绍经纪商业）、线上渠道等。公司实行总部、分支机构分级管理的经营模式。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、套利等交易方案，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。

报告期内，公司商业模式未发生变化。

二、主要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	1,109,321,655.47	1,498,920,716.90	-25.99%
毛利率%	-0.63%	0.24%	-
归属于挂牌公司股东的净利润	-6,297,868.18	-910,703.66	-591.54%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	-7,561,322.91	-2,972,064.98	-154.41%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	-0.80%	-0.12%	-
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）	-0.96%	-0.38%	-
基本每股收益	-0.01	-0.002	-400%
偿债能力	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	6,956,240,212.16	6,492,145,004.64	7.15%
负债总计	6,155,083,354.66	5,686,616,140.92	8.24%
归属于挂牌公司股东的净资产	787,889,020.58	794,185,952.15	-0.79%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	1.58	1.59	-0.63%
资产负债率%（母公司）	86.38%	86.14%	-
资产负债率%（合并）	88.48%	87.59%	-
流动比率	1.14	1.15	-
利息保障倍数	0.70	1.26	-
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	-175,963,391.22	-83,478,306.39	-110.79%
应收账款周转率	10,841.93	230.35	-
存货周转率	3.40	6.11	-
成长情况	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	7.15%	-0.51%	-
营业收入增长率%	-25.99%	71.95%	-
净利润增长率%	-755.28%	-95.57%	-
行业主要财务指标及监管指标	本期期末	上年期末	增减比例%
净资本	550,276,317.17	604,451,082.91	-8.96%
风险资本准备总额	191,553,967.88	185,382,520.90	3.33%
净资本与风险资本准备总额的比例	287%	326%	-
净资本与净资产的比例	64%	71%	-
扣除客户保证金的流动资产	714,601,810.81	709,892,148.49	0.66%
扣除客户权益的流动负债	74,257,363.51	78,099,832.12	-4.92%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	962%	909%	-
负债与净资产的比例（扣除客户权益）	21%	21%	-
结算准备金额	197,751,443.37	542,948,207.74	-63.58%

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	2,662,947,507.71	38.28%	3,107,425,611.64	47.86%	-14.30%
应收货币保证金	2,689,801,045.56	38.67%	2,546,575,480.10	39.23%	5.62%
应收质押保证金	126,238,404.80	1.81%	108,369,603.20	1.67%	16.49%
存出保证金	346,134,739.07	4.98%	25,375,456.36	0.39%	1,264.05%
交易性金融资产	459,685,561.88	6.61%	327,358,096.80	5.04%	40.42%
衍生金融资产	-	-	2,100.00	0.00%	-100.00%
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收结算担保金	20,800,000.00	0.30%	20,800,000.00	0.32%	0.00%
应收风险损失款	43,991.10	0.00%	438,046.36	0.01%	-89.96%
应收手续费及佣金	337,119.12	0.00%	253,236.07	0.00%	33.12%
结算备付金	816,088.73	0.01%	816,088.73	0.01%	0.00%

应收票据	-	-	-	-	-
应收账款	5,635.40	0.00%	199,000.00	0.00%	-97.17%
预付款项	2,879,203.86	0.04%	5,582,988.05	0.09%	-48.43%
应收利息	50,933.46	0.00%	49,604.49	0.00%	2.68%
应收股利	-	-	-	-	-
其他应收款	44,105,506.69	0.63%	16,009,851.34	0.25%	176.03%
一年内到期的非流动资产	-	-	-	-	-
存货	442,910,156.48	6.37%	212,861,824.70	3.28%	108.07%
其他流动资产	69,448,899.73	1.00%	37,406,948.64	0.58%	85.66%
可供出售金融资产	-	-	-	-	-
持有至到期投资	-	-	-	-	-
长期股权投资	-	-	3,012,777.11	0.05%	-100.00%
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	7,600,333.20	0.11%	7,694,274.36	0.12%	-1.22%
在建工程	-	-	-	-	-
固定资产清理	-	-	-	-	-
待处理固定资产净损失	-	-	-	-	-
无形资产	1,630,515.33	0.02%	1,821,055.07	0.03%	-10.46%
长期待摊费用	814,563.92	0.01%	927,842.35	0.01%	-12.21%
使用权资产	7,036,846.98	0.10%	6,469,760.17	0.10%	8.77%
递延所得税资产	71,604,092.60	1.03%	61,344,963.59	0.94%	16.72%
其他非流动资产	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
应付货币保证金	5,000,138,906.73	71.88%	4,736,448,137.93	72.96%	5.57%
应付质押保证金	126,238,404.80	1.81%	108,369,603.20	1.67%	16.49%
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	56,018,089.74	0.81%	13,361,423.80	0.21%	319.25%
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
期货风险准备金	63,269,768.30	0.91%	62,198,509.12	0.96%	1.72%
应付票据	-	-	-	-	-
应付账款	816,600.41	0.01%	3,522,901.47	0.05%	-76.82%
预收款项	-	-	-	-	-
合同负债	4,362,917.82	0.06%	10,146,933.77	0.16%	-57.00%
应付期货投资者保障基金	259,020.65	0.00%	553,262.46	0.01%	-53.18%
应付手续费及佣金	635,378.01	0.01%	167,256.10	0.00%	279.88%
应付职工薪酬	12,757,345.22	0.18%	18,875,855.72	0.29%	-32.41%
应交税费	6,982,229.30	0.10%	3,540,595.73	0.05%	97.20%
应付利息	-	-	-	-	-
应付股利	-	-	-	-	-
代理买卖证券款	816,088.73	0.01%	816,088.73	0.01%	0.00%

其他应付款	764,280,840.40	10.99%	508,760,746.27	7.84%	50.22%
预提费用	-	-	-	-	-
内部往来应付款	-	-	-	-	-
一年内到期的非流动负债	2,307,106.69	0.03%	108,555,542.97	1.67%	-97.87%
其他流动负债	392,662.60	0.01%	913,224.03	0.01%	-57.00%
长期借款	-	-	-	-	-
应付债券	101,019,178.04	1.45%	100,021,917.78	1.54%	1.00%
租赁负债	4,427,905.69	0.06%	3,493,701.48	0.05%	26.74%
递延所得税负债	10,360,911.53	0.15%	6,870,440.36	0.11%	50.80%
其他非流动负债	-	-	-	-	-
实收资本	500,000,000.00	7.19%	500,000,000.00	7.70%	0.00%
资本公积	13,305,949.69	0.19%	13,305,949.69	0.20%	0.00%
减：库存股	-	-	-	-	-
其他综合收益	-3,675,474.58	-0.05%	-3,676,411.19	-0.06%	-0.03%
专项储备	-	-	-	-	-
盈余公积	34,814,035.87	0.50%	34,814,035.87	0.54%	0.00%
一般风险准备	30,846,337.74	0.44%	30,846,337.74	0.48%	0.00%
未分配利润	212,598,171.86	3.06%	218,896,040.04	3.37%	-2.88%
少数股东权益	13,267,836.92	0.19%	11,342,911.57	0.17%	16.97%
资产总计	6,956,240,212.16	100.00%	6,492,145,004.64	100.00%	7.15%

项目重大变动原因

- 1、存出保证金同比增加1264.05%，主要原因是子公司渤海融盛向其他期货公司缴存的货币保证金增加所致。
- 2、衍生金融负债同比增加319.25%，主要原因是子公司渤海融盛场内期权与场外期权公允价值变动增加所致。
- 3、应付手续费及佣金同比增加279.88%，主要原因是公司期末应付居间佣金增加所致。
- 4、存货同比增加108.07%，主要原因是子公司渤海融盛商品贸易期末存货增加所致。
- 5、长期股权投资同比减少100.00%，主要原因是联营企业上海共赋私募基金管理有限公司注销所致。
- 6、应收账款同比减少97.17%，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。
- 7、应付账款同比减少76.82%，主要原因是子公司渤海融盛期末应付存货采购款减少所致。
- 8、其他应付款同比增加50.22%，主要原因是子公司渤海融盛期货质押保证金增加所致。

(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	1,109,321,655.47	-	1,498,920,716.90	-	-25.99%

手续费及佣金净收入	21,910,455.66	1.98%	22,723,811.39	1.52%	-3.58%
其中：经纪业务手续费收入	21,404,042.81	1.93%	22,425,971.53	1.50%	-4.56%
资产管理业务收入	506,412.85	0.05%	297,839.86	0.02%	70.03%
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	24,197,100.93	2.18%	1,956,964.06	0.13%	1,136.46%
投资收益	56,372,536.69	5.08%	48,382,244.45	3.23%	16.51%
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	-151,231.72	-0.00%	-	-	-100.00%
公允价值变动收益	-20,445,194.37	-1.84%	-34,237,991.19	-2.28%	40.29%
汇兑收益	-18,788.53	0.00%	-	0.00%	-100.00%
其他业务收入	1,026,292,922.33	92.52%	1,457,377,095.24	97.23%	-29.58%
其中：风险管理业务收入	-	-	-	-	-
其他收益	1,014,740.24	0.09%	2,718,592.95	0.18%	-62.67%
二、营业成本	1,116,319,743.70	100.63%	1,495,347,453.60	99.76%	-25.35%
提取期货风险准备金	1,071,259.18	0.10%	1,148,855.08	0.08%	-6.75%
税金及附加	920,499.03	0.08%	998,595.68	0.07%	-7.82%
业务及管理费	61,081,791.94	5.51%	54,349,620.74	3.63%	12.39%
研发费用	-	-	-	-	-
信用减值损失	137,468.27	0.01%	245,357.61	0.02%	-43.97%
其他资产减值损失	36,892,692.54	3.33%	710,890.32	0.05%	5,089.65%
其他业务成本	1,016,216,032.74	91.61%	1,437,894,134.17	95.93%	-29.33%
三、营业利润	-6,998,088.23	-0.63%	3,573,263.30	0.24%	-295.85%
营业外收入	2,680,612.61	0.24%	32,200.00	0.00%	8,224.88%
营业外支出	1,222,328.22	0.11%	2,624,876.77	0.18%	-53.43%
四、利润总额	-5,539,803.84	-0.50%	980,586.53	0.07%	-664.95%
五、净利润	-4,372,942.83	-	667,337.98	-	-755.28%

项目重大变动原因：

- 1、营业收入同比减少 25.99%，主要原因是子公司渤海融盛现货业务收入减少所致。
- 2、利息净收入同比增加 1136.46%，主要原因是子公司渤海融盛利息支出减少所致。
- 3、其他收益同比减少 62.67%，主要原因是公司政府补助减少所致。
- 4、其他资产减值损失同比增长 5089.65%，主要原因是子公司渤海融盛期末存货跌价损失增加所致。
- 5、营业外收入同比增加 8224.88%，主要原因是子公司渤海融盛收到合同违约金增加所致。
- 6、净利润同比减少 755.28%，主要是公司引进新的业务团队，业务及管理费用增加所致。

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	21,910,455.66	22,723,811.39	-3.58%

利息净收入	24,197,100.93	1,956,964.06	1,136.46%
其他业务收入	1,026,292,922.33	1,457,377,095.24	-29.58%
投资收益	56,372,536.69	48,382,244.45	16.51%
公允价值变动收益	-20,445,194.37	-34,237,991.19	40.29%
其他收益	1,014,740.24	2,718,592.95	-62.67%
汇兑收益	-18,788.53	0.00	-100.00%
资产处置收益	-2,117.48	0.00	-100.00%

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）	-	9,308,293.68	0.84%
上海（不含本部）	1	2,450,519.39	0.22%
北京市	1	509,913.73	0.05%
重庆市	1	746,302.88	0.07%
辽宁省	1	1,754,958.64	0.16%
福建省	2	905,410.40	0.08%
吉林省	1	2,411,412.59	0.22%
浙江省	1	710,090.88	0.06%
河南省	1	766,529.96	0.07%
广东省	1	990,091.55	0.09%
江苏省	1	721,210.43	0.06%
山东省	1	634,398.17	0.06%
海南省	1	1,323.36	0.00%
合计	13	21,910,455.66	1.98%

收入构成变动的原因

本期公司收入结构无重大变动，各项收入变动原因请参见本节“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	-175,963,391.22	-83,478,306.39	-110.79%
投资活动产生的现金流量净额	-173,903,075.90	63,679,332.67	-373.09%
筹资活动产生的现金流量净额	-108,178,679.05	-12,383,756.56	-773.55%

现金流量分析

1、经营活动产生的现金流量净额：本期较上期减少了 110.79%，主要是子公司渤海融盛现货销售规模减少所致。

2、投资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少 373.09%，主要是本期自有资金投资规模增

加所致。

3、筹资活动产生的现金流量净额：本期较上期减少 773.55%，主要是子公司渤海融盛偿还债务所致。

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、仓单服务业务	300,000,000.00	952,123,509.94	200,695,382.31	258,816,060.88	-9,032,882.26
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	221,957,322.37	53,699,759.33	295,072,717.00	-890,100.46
上海融渤实业有限公司	控股子公司	国内贸易	30,000,000.00	733,380,082.62	42,668,601.06	576,247,555.35	9,902,183.53
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	32,483,634.22	32,483,634.22	0.00	-29,922.96

主要参股公司业务分析

适用 不适用

(二) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

五、 企业社会责任

√适用 □不适用

公司积极贯彻中央金融工作会议精神，落实服务实体经济的责任使命。报告期内，公司与广西宾阳县、黑龙江青冈县、湖南辰溪县、新疆石河子市等地建立乡村振兴结对帮扶关系，通过发挥自身在期货及衍生品领域专业优势，在广西、河南、湖北、山东、黑龙江、重庆等地开展“保险+期货”、场外期权和“订单收购+期货”服务，帮助当地农业经营主体稳收增收。公司还在吉林省汪清县、黑龙江省青冈县建立鸡蛋、玉米产业帮扶项目，通过介绍销售渠道、自有资金采购等方式协助甘肃省秦安县、江西省赣州市、重庆市奉节县等地鸡蛋、苹果、脐橙等农产品的销售，以产业振兴助推乡村振兴。

此外，公司还组织开展“3·15打非防非”、“4·15国家安全宣传教育”、“5·15全国投资者保护宣传日”、“金融知识普及月”“《股东来了》知识竞赛”等主题教育系列宣传，持续加强投资者权益保护。

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、市场风险	<p>市场风险是指因市场价格（股票价格、利率、汇率和商品价格）或者其它市场因子的变化而使公司表内、表外业务发生损失的风险。市场风险使得公司可能面临经纪业务手续费持续下降、经纪业务盈利能力下降，客户流失及客户保证金减少、利息收入下滑，管理的资产管理产品收益降低、甚至遭受损失，公司持有的各类资产发生亏损等不利情形，从而影响公司的经营业绩和财务情况。</p> <p>应对措施：</p> <p>经纪业务方面，公司结合国内外市场情况进行分析，依据交易所规则与指导意见，根据公司风险管理制度，通过适当调整公司保证金水平和风控策略，对客户的资金风险与持仓风险进行监控与管理。公司通过压力测试等方式，对市场风险暴露进行动态评估，并及时采取措施控制风险。公司重视对交易者的教育，及时了解交易者动态，主动掌握交易者抵御风险的能力水平，不断提高交易者的风险意识，提升交易者面对市场风险的防范能力。</p> <p>资产管理业务方面，公司不断提升投研水平，有效识别标的风险，实时监控资产管理产品的各项风控指标，控制投资仓位，及时进行风险警示及处理。</p> <p>风险管理业务方面，公司根据实际业务情况制定相应的交易风险指标管理制度，通过设置业务规模限额、损失限额、敞口限额和集中度限额等交易风险指标，对各项指标进行严密监控，积极防范和处置市场风险。</p> <p>自有资金投资方面，公司制定完备的对外投资管理制度，设立科学合理的风险限额指标体系，强化对投资项目的市场风险管控。</p>
2、信用风险	信用风险是指交易对手或债务工具融资人不愿或无力履行合

	<p>同条件而构成违约，致使公司遭受损失的风险。信用风险使得公司可能面临客户保证金透支或穿仓、资管产品投资标的因信用情况恶化导致收益降低、风险管理业务中交易对手发生违约等不利情形，致使公司承担经济损失、甚至引起法律诉讼。</p> <p>应对措施：</p> <p>经纪业务方面，公司严格落实交易者实名制原则、加强交易者适当性管理和有效识别交易者身份，了解交易者信用状况、财务状况及风险承受能力等信息；严格落实交易者保证金管理制度及风险管理制度，确保内控执行有效性；建立风险处置预案，有效应对交易者信用风险。</p> <p>资产管理业务方面，公司在全面研究以及风险评估的基础上进行投资，构建标的池及评价体系，并进行持续的分级、维护与跟踪。</p> <p>风险管理业务方面，公司加强客户管理，建立并不断完善客户准入机制。同时，对客户开展交易者适当性评级、匹配、回访等相关工作，确保履约保证金及时、足额收取，并且制定相应风险控制流程，严格控制信用风险。</p>
3、流动性风险	<p>流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。流动性风险使得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。</p> <p>应对措施：</p> <p>公司持续加强与银行及股东单位沟通合作，并建立了动态的风险监控和资本补足机制，确保各项风险监控指标持续符合标准。根据监管要求，公司严格执行相应的管理制度，同时财务部密切关注动态风险监控指标，实时监控净资本等监管指标，将席位资金变化做到可控，保证各银行客户资金正常流动，避免出现各类流动性风险。</p>
4、合规风险	<p>合规风险是指因公司的经营管理或公司员工的执业行为违反法律、法规或准则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。公司所处的行业受到严格监管，业务经营与开展受到国家法律法规及规范性文件的约束。如果公司因为存在不遵守相关法律法规及监管政策要求导致承担法律风险、被行政处罚或被采取监管措施，这将对公司业务开展及声誉造成损害。</p> <p>应对措施：</p> <p>公司及时根据监管政策及业务需要持续优化内部制度，对于监管部门下发的文件及通知要求深入学习，认真贯彻，配合各项业务监管检查，及时传达监管要求；同时公司还将通过合规稽核部，采用制度建设、宣传培训、配合跟进、稽核检查等方式对经营管理各环节开展事前、事中、事后的内部监督，确保公</p>

	司经营合法合规。
5、操作风险	<p>操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、员工、信息技术系统以及外部事件所造成损失的风险。公司各个业务环节均有可能产生操作风险，使得公司可能面临客户投诉、监管处罚或遭受财产损失。</p> <p>应对措施： 公司持续健全和完善内部管理制度和业务流程，提升系统自动化水平，加强员工岗前操作流程培训，持续提升员工专业能力。公司各部门、分支机构及子公司主动识别存在于内部制度、流程、员工行为、信息技术系统等方面的潜在操作风险，建立相应应急预案、定期监督检查，严格控制操作风险。</p>
6、信息技术风险	<p>信息技术风险是指公司在业务开展过程中，因信息技术系统存在不可抗力及不可预见因素而导致公司和客户发生损失的可能性。信息技术风险的发生可能会对公司业务开展、客户服务、风险管理及公司的声誉和形象带来负面影响，进而对公司经营业绩和财务状况造成不利影响。</p> <p>应对措施： 公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，加强机房、系统建设，为各项业务提供保障与支撑；公司制定了较完备的信息技术相关制度，就信息技术系统可能发生的突发性事件形成应急预案，公司现有中心机房和灾备机房，通讯线路有多线路供应商，以在突发事件发生时互为备份，将风险降到最低。</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 type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
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	

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

(一) 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

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

(二) 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	267,000,000.00	62,322,330.79
出售产品、商品、提供劳务	258,000,000.00	4,487,067.28
委托关联人销售产品、商品	2,000,000.00	0.00
接受关联人委托代为销售其产品、商品		
其他	1,033,000,000.00	1,057,534.23
合计	1,560,000,000.00	67,866,932.30
其他重大关联交易情况	审议金额	交易金额

借入次级债务	100,000,000.00	100,000,000.00
借款	100,000,000.00	100,000,000.00
企业集团财务公司关联交易情况	预计金额	发生金额
存款	-	-
贷款	-	-

重大关联交易的必要性、持续性以及对生产经营的影响

报告期内，公司的关联交易范围基于公司日常经营的正常需求，有利于公司业务的发展，符合公司和全体股东的利益。公司日常性关联交易的价格按照公允原则定价，处于合理状态，符合公开、公平、公正原则，不会对公司财务状况、经营成果产生不利影响，公司的主要业务不会因此而对关联方形成依赖。

(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
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。双方就相互间关联正在履行中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20日	-	挂牌	相关声明及承诺	<p>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、行政法规和部门规章等有关规定，履行忠实、勤勉尽责的义务。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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》。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>	正在履行中
-----	------------	---	----	---------	--	-------

超期未履行完毕的承诺事项详细情况

无

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	-	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	
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
----	-------------	---	-------------	------	---	-------------	------------	---

普通股前十名股东情况说明

适用 不适用

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

二、 董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

单位：股

姓名	职务	性别	出生年月	任职起止日期		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%
				起始日期	终止日期				
濮岩	董事长、总经理	男	1977年11月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
李雪飞	董事	男	1972年3月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
董晨	董事	男	1971年12月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
苏健	董事	男	1976年11月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
丁文勇	董事	男	1957年11月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
薛金艳	监事会主席	女	1976年4月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
刘洋	监事	女	1980年7月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
倪忠	职工监事	男	1968年3月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
赵利人	副总经理	男	1967年9月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
蔡瑞	副总经理	男	1968年2月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
刘卉	副总经理	女	1972年6月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
纪杨	副总经理	男	1982年9月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
高新宇	副总经理	男	1972年4月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
张延鑫	副总经理（拟任）	男	1974年10月	2024年7月5日	2027年7月4日				

	兼财务总监								
任海霞	首席风险官	女	1982年6月	2024年7月5日	2027年7月4日	0	0	0	0%
洪梅	首席风险官(原)	女	1970年11月	2021年7月5日	2024年7月4日	0	0	0	0%

注：

1. 2024年5月9日，李雪飞先生申请辞去董事长职务。经2024年5月15日公司第三届董事会2024年第二次临时会议审议，选举濮岩先生为公司第三届董事会董事长。

2. 公司已于2024年7月5日完成董事、监事、高管的换届选举工作。本次换届涉及的人员变动有：

①换届前张延鑫任公司财务总监，换届后张延鑫任公司副总经理兼财务总监，其中按照监管要求，任职公司副总经理尚需通过《期货公司高管人员专业能力水平评价测试》。

②换届前公司首席风险官由洪梅女士担任，换届后公司首席风险官由任海霞女士担任。

除上述变动外，其余董事、监事、高管连选连任，未发生变动。

董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系

董事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委员、证券事务代表、证券部总经理。

(二) 变动情况

适用 不适用

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
濮岩	董事、总经理	新任	董事长、总经理	因工作安排
李雪飞	董事、董事长	离任	董事	因工作安排

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

(三) 董事、高级管理人员的股权激励情况

适用 不适用

三、 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	13	0	0	13
风险控制	14	0	0	14
高管人员	8	0	0	8
合规审查	7	1	1	7
客户服务	66	10	4	72

客户开发	51	12	3	60
人力资源	4	0	0	4
投资咨询	5	2	2	5
信息技术	17	0	0	17
行政管理	6	2	1	7
研究分析	3	9	5	7
衍生品交易	2	0	0	2
运营管理	7	1	1	7
资产管理	8	5	4	9
员工总计	224	42	21	245

(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	2024年6月30日	2023年12月31日
流动资产：			
货币资金	注释 1	2,662,947,507.71	3,107,425,611.64
其中：期货保证金存款		2,627,440,249.73	3,022,605,100.83
应收货币保证金	注释 2	2,689,801,045.56	2,546,575,480.10
应收质押保证金	注释 3	126,238,404.80	108,369,603.20
存出保证金	注释 4	346,134,739.07	25,375,456.36
交易性金融资产	注释 5	459,685,561.88	327,358,096.80
结算备付金	注释 7	816,088.73	816,088.73
衍生金融资产	注释 8	-	2,100.00
应收票据		-	
应收账款	注释 10	5,635.40	199,000.00
应收款项融资			
预付款项	注释 11	2,879,203.86	5,582,988.05
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		43,991.10	438,046.36
应收佣金	注释 6	337,119.12	253,236.07
其他应收款	注释 12	44,105,506.69	16,009,851.34
其中：应收利息		50,933.46	49,604.49
应收股利			
买入返售金融资产			
存货	注释 13	442,910,156.48	212,861,824.70
其中：数据资源			
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	69,448,899.73	37,406,948.64
流动资产合计		6,866,153,860.13	6,409,474,331.99
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			3,012,777.11

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	7,600,333.20	7,694,274.36
在建工程			
使用权资产	注释 17	7,036,846.98	6,469,760.17
无形资产	注释 18	1,630,515.33	1,821,055.07
其中：数据资源			
开发支出			
其中：数据资源			
商誉			
长期待摊费用	注释 19	814,563.92	927,842.35
递延所得税资产	注释 20	71,604,092.60	61,344,963.59
其他非流动资产			
非流动资产合计		90,086,352.03	82,670,672.65
资产总计		6,956,240,212.16	6,492,145,004.64
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金	注释 21	5,000,138,906.73	4,736,448,137.93
应付质押保证金	注释 22	126,238,404.80	108,369,603.20
交易性金融负债		-	
期货风险准备金	注释 24	63,269,768.30	62,198,509.12
衍生金融负债	注释 23	56,018,089.74	13,361,423.80
应付票据		-	
应付账款	注释 25	816,600.41	3,522,901.47
预收款项		-	
合同负债	注释 26	4,362,917.82	10,146,933.77
卖出回购金融资产款		-	
应付期货投资者保障基金	注释 27	259,020.65	553,262.46
应付手续费及佣金	注释 28	635,378.01	167,256.10
应付职工薪酬	注释 29	12,757,345.22	18,875,855.72
应交税费	注释 30	6,982,229.30	3,540,595.73
代理买卖证券款		816,088.73	816,088.73
其他应付款	注释 31	764,280,840.40	508,760,746.27
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	注释 32	2,307,106.69	108,555,542.97
其他流动负债	注释 33	392,662.60	913,224.03
流动负债合计		6,039,275,359.40	5,576,230,081.30
非流动负债：			
长期借款			

应付债券	注释 34	101,019,178.04	100,021,917.78
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	注释 35	4,427,905.69	3,493,701.48
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	10,360,911.53	6,870,440.36
其他非流动负债			
非流动负债合计		115,807,995.26	110,386,059.62
负债合计		6,155,083,354.66	5,686,616,140.92
所有者权益：			
股本	注释 36	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 37	13,305,949.69	13,305,949.69
减：库存股			
其他综合收益	注释 38	-3,675,474.58	-3,676,411.19
专项储备			
盈余公积	注释 39	34,814,035.87	34,814,035.87
一般风险准备	注释 40	30,846,337.74	30,846,337.74
未分配利润	注释 41	212,598,171.86	218,896,040.04
归属于母公司所有者权益合计		787,889,020.58	794,185,952.15
少数股东权益		13,267,836.92	11,342,911.57
所有者权益合计		801,156,857.50	805,528,863.72
负债和所有者权益合计		6,956,240,212.16	6,492,145,004.64

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	2024年6月30日	2023年12月31日
流动资产：			
货币资金		2,655,567,119.17	3,034,997,351.41
其中：期货保证金存款		2,627,440,249.73	3,022,605,100.83
应收货币保证金		2,689,801,045.56	2,546,575,480.10
应收质押保证金		126,238,404.80	108,369,603.20
存出保证金		9,911,938.46	25,435.49
交易性金融资产		425,062,975.45	100,999,694.63
结算备付金		816,088.73	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		43,991.10	438,046.36
应收佣金		337,119.12	253,236.07
其他应收款	十、注释 1	32,028,630.39	31,683,647.97
其中：应收利息		50,933.46	49,604.49
应收股利		30,000,000.00	30,000,000.00
买入返售金融资产			
存货			
其中：数据资源			
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		6,569,511.07	11,560,239.37
流动资产合计		5,967,176,823.85	5,856,518,823.33
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	十、注释 2	300,000,000.00	303,012,777.11
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		7,357,921.62	7,369,622.23
在建工程			
使用权资产		3,572,145.09	2,474,922.28
无形资产		786,925.76	898,110.28
其中：数据资源			
开发支出			
其中：数据资源			
商誉			
长期待摊费用		760,698.98	861,853.21
递延所得税资产		2,192,815.94	1,548,570.60
其他非流动资产			
非流动资产合计		316,070,507.39	317,565,855.71
资产总计		6,283,247,331.24	6,174,084,679.04
流动负债：			
短期借款			

应付货币保证金		5,118,951,008.44	5,025,880,743.54
应付质押保证金		126,238,404.80	108,369,603.20
交易性金融负债			
期货风险准备金		63,269,768.30	62,198,509.12
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		259,020.65	553,262.46
应付手续费及佣金		632,426.69	148,794.73
应付职工薪酬		7,075,078.73	11,590,825.24
应交税费		2,838,756.18	1,917,246.33
代理买卖证券款		816,088.73	816,088.73
其他应付款		182,312.96	1,691,194.24
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		1,258,524.77	1,613,588.26
其他流动负债			
流动负债合计		5,321,521,390.25	5,214,779,855.85
非流动负债：			
长期借款			
应付债券		101,019,178.04	100,021,917.78
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		1,965,973.57	497,702.76
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		2,911,425.98	3,036,040.13
其他非流动负债			
非流动负债合计		105,896,577.59	103,555,660.67
负债合计		5,427,417,967.84	5,318,335,516.52
所有者权益：			
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		34,814,035.87	34,814,035.87
一般风险准备		30,846,337.74	30,846,337.74
未分配利润		276,863,040.10	276,782,839.22
所有者权益合计		855,829,363.40	855,749,162.52
负债和所有者权益合计		6,283,247,331.24	6,174,084,679.04

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	2024年1-6月	2023年1-6月
一、营业收入		1,109,321,655.47	1,498,920,716.90
手续费及佣金净收入	注释 42	21,910,455.66	22,723,811.39
其中：经纪业务手续费收入		21,404,042.81	22,425,971.53
资产管理业务收入		506,412.85	297,839.86
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 44	24,197,100.93	1,956,964.06
其中：利息收入		42,464,746.13	56,044,548.51
利息支出		18,267,645.20	54,087,584.45
投资收益（损失以“-”号填列）	注释 43	56,372,536.69	48,382,244.45
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		-151,231.72	
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）		-212,086.94	373,972.60
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	注释 47	1,014,740.24	2,718,592.95
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	注释 45	-20,445,194.37	-34,237,991.19
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-18,788.53	
其他业务收入	注释 46	1,026,292,922.33	1,457,377,095.24
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）	注释 48	-2,117.48	
二、营业支出		1,116,319,743.70	1,495,347,453.60
提取期货风险准备金	注释 49	1,071,259.18	1,148,855.08
税金及附加	注释 50	920,499.03	998,595.68
业务及管理费	注释 51	61,081,791.94	54,349,620.74
研发费用		-	
信用减值损失	注释 53	137,468.27	245,357.61

其他资产减值损失	注释 54	36,892,692.54	710,890.32
其他业务成本	注释 52	1,016,216,032.74	1,437,894,134.17
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		-6,998,088.23	3,573,263.30
加：营业外收入	注释 55	2,680,612.61	32,200.00
减：营业外支出	注释 56	1,222,328.22	2,624,876.77
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,539,803.84	980,586.53
减：所得税费用	注释 57	-1,166,861.01	313,248.55
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,372,942.83	667,337.98
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）		-4,372,942.83	667,337.98
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）		1,924,925.35	1,578,041.64
2. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”填列）		-6,297,868.18	-910,703.66
六、其他综合收益的税后净额		936.61	-113,824.10
（一）归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		936.61	-113,824.10
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		936.61	-113,824.10
（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		936.61	-113,824.10
（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		-4,372,006.22	553,513.88
（一）归属于母公司所有者的综合收益总额		-6,296,931.57	-1,024,527.76
（二）归属于少数股东的综合收益总额		1,924,925.35	1,578,041.64
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		-0.01	-0.002
（二）稀释每股收益		-0.01	-0.002

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	2024年1-6月	2023年1-6月
一、营业收入		49,723,086.43	45,944,875.07
手续费及佣金净收入	十、注释 3	21,931,596.44	22,822,676.93
其中：经纪业务手续费收入		21,425,183.59	22,524,837.07
资产管理业务收入		506,412.85	297,839.86
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	23,529,775.49	14,222,491.83
其中：利息收入		41,737,146.72	54,921,035.20
利息支出		18,207,371.23	40,698,543.37
投资收益（损失以“-”号填列）	十、注释 5	-500,179.14	1,457,944.23
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		-151,231.72	
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		219,532.56	2,706,473.50
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,201,411.18	1,176,324.06
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入		3,340,949.90	3,558,964.52
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		48,960,338.35	39,419,017.03
提取期货风险准备金		1,071,259.18	1,148,855.08
税金及附加		54,881.54	98,359.03
业务及管理费		47,239,066.18	37,798,002.00
研发费用			
信用减值损失		-1,010.67	18,697.74
其他资产减值损失			
其他业务成本		596,142.12	355,103.18
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		762,748.08	6,525,858.04
加：营业外收入		0.94	
减：营业外支出		386,956.15	321,061.77
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		375,792.87	6,204,796.27

减：所得税费用		295,591.99	1,551,199.07
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		80,200.88	4,653,597.20
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		80,200.88	4,653,597.20
（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		80,200.88	4,653,597.20
八、每股收益：			
（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	2024年1-6月	2023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		1,074,659,780.83	1,192,571,696.66
收取利息、手续费及佣金的现金		54,758,319.51	35,970,304.84
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 58	311,126,804.09	343,631,866.12
经营活动现金流入小计		1,440,544,904.43	1,572,173,867.61
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		1,372,950,388.78	1,192,880,367.11
支付利息、手续费及佣金的现金		19,904,033.40	40,698,543.37
以现金支付的业务及管理费		23,994,423.43	18,839,081.38
支付给职工以及为职工支付的现金		37,136,325.47	29,897,550.33
支付的各项税费		8,036,397.10	13,779,249.34

支付其他与经营活动有关的现金	注释 59	154,486,727.47	359,557,382.47
经营活动现金流出小计		1,616,508,295.65	1,655,652,174.00
经营活动产生的现金流量净额		-175,963,391.22	-83,478,306.39
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		735,290,494.71	2,463,127,583.10
取得投资收益收到的现金		222,507,312.14	1,458,508.30
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		972.00	
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		77,000,000.00	
投资活动现金流入小计		1,034,798,778.85	2,464,586,091.40
投资支付的现金		1,206,847,515.58	2,399,331,793.04
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,854,339.17	1,574,965.69
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		1,208,701,854.75	2,400,906,758.73
投资活动产生的现金流量净额		-173,903,075.90	63,679,332.67
三、筹资活动产生的现金流量：			
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			
筹资活动现金流入小计		-	10,500,000.00
偿还债务支付的现金		100,000,000.00	
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		5,980,821.91	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		2,197,857.14	1,652,934.64
筹资活动现金流出小计		108,178,679.05	22,883,756.56
筹资活动产生的现金流量净额		-108,178,679.05	-12,383,756.56
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-17,854.08	9,660.28
五、现金及现金等价物净增加额		-458,063,000.25	-32,173,070.00
加：期初现金及现金等价物余额		3,100,546,519.44	4,003,550,109.57
六、期末现金及现金等价物余额		2,642,483,519.19	3,971,377,039.57

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	2024年1-6月	2023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			24,192,037.55
收取利息、手续费及佣金的现金		54,764,715.45	29,014,110.46
回购业务资金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金		96,999,228.61	327,448,445.07
经营活动现金流入小计		151,763,944.06	380,654,593.08
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		19,904,033.40	40,698,543.37
以现金支付的业务及管理费		16,102,075.55	17,895,894.44
支付给职工以及为职工支付的现金		29,762,681.39	25,590,908.41
支付的各项税费		1,566,330.24	9,041,856.61
支付其他与经营活动有关的现金		153,653,900.54	343,019,362.35
经营活动现金流出小计		220,989,021.12	436,246,565.18
经营活动产生的现金流量净额		-69,225,077.06	-55,591,972.10
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		658,126,225.49	1,044,919,917.49
取得投资收益收到的现金		6,020,315.32	1,457,944.23
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		664,146,540.81	1,046,377,861.72
投资支付的现金		984,510,091.37	1,001,964,927.90
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,854,339.17	1,553,439.15
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		986,364,430.54	1,003,518,367.05
投资活动产生的现金流量净额		-322,217,889.73	42,859,494.67
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			
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		1,575,676.05	1,275,798.64
筹资活动现金流出小计		1,575,676.05	1,275,798.64
筹资活动产生的现金流量净额		-1,575,676.05	-1,275,798.64
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		-393,018,642.84	-14,008,276.07
加：期初现金及现金等价物余额		3,028,121,773.49	3,967,553,308.18
六、期末现金及现金等价物余额		2,635,103,130.65	3,953,545,032.11

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 2024 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	14,227,180.73	77,125,329.88
其他货币资金		
期货保证金存款	2,627,440,249.73	3,022,605,100.83
未到期应收利息	21,280,077.25	7,695,180.93
合计	2,662,947,507.71	3,107,425,611.64

其中期货保证金存款:

项目	期末余额	期初余额
交通银行	31,504,291.04	1,337,076.00
建设银行	1,233,862.86	1,061,144.58
工商银行	582,211.78	800,479.37
农业银行	1,169,700,006.96	1,649,844,136.27
中国银行	15,126,561.41	929,517.69
兴业银行	10,691,735.01	11,054,421.85
光大银行	6,641,143.22	680,348.11
民生银行	608,825,937.85	600,680,620.46
中信银行	209,425,364.27	200,804,834.28
招商银行	669,732.56	1,080,785.36
浦发银行	515,644,676.63	501,780,494.74
平安银行	55,667,422.61	50,707,286.08
广发银行	1,717,255.31	1,816,110.48
邮储银行	10,037.65	10,027.45
农发银行	10.57	17,818.11
合计	2,627,440,249.73	3,022,605,100.83

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		
合计		

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	469,886,841.97	278,133,451.77
郑州商品交易所	540,521,580.06	478,971,319.00
大连商品交易所	429,351,801.27	557,593,144.46
中国金融期货交易所	849,311,977.71	858,851,868.65
上海国际能源交易中心	169,407,128.79	88,552,940.78
中国证券登记结算有限责任公司	99,183,461.36	145,307,568.11
广州期货交易所	131,750,443.33	138,865,426.06
应收利息	387,811.07	299,761.27
合计	2,689,801,045.56	2,546,575,480.10

应收货币保证金期末余额比期初余额增加 5.62%，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	46,599,280.00	87,128,640.00

项目	期末余额	期初余额
大连商品交易所	5,094,400.00	312,800.00
郑州商品交易所	130,800.00	
中国金融期货交易所	9,668,524.80	9,770,083.20
广州期货交易所	64,745,400.00	11,158,080.00
合计	126,238,404.80	108,369,603.20

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	9,911,827.11	25,325.26
广发证券股份有限公司上海天山路证券营业		521.01
无锡市不锈钢电子交易中心有限公司	528.86	428.36
广西糖网食糖批发市场有限责任公司	7,077.86	7,077.86
山东招金集团有限公司	10,001.00	10,001.00
东兴期货有限责任公司	11,507.59	11,421.54
中国工商银行股份有限公司上海市浦东开发	2,988.00	8,787.16
国泰君安期货有限公司	304,743,818.94	2,711.71
东北证券股份有限公司上海普陀区武宁路证	13,719.18	13,705.24
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	110.35	110.23
银河期货有限公司	31,433,153.74	25,295,361.55
中信建投证券营口路营业部	1.00	
合计	346,134,739.07	25,375,456.36

存出保证金期末余额比期初余额增加了 12.64 倍，主要原因是间接控股子公司向期货公司缴存的货币保证金增加所致。

注释5. 交易性金融资产

项目	2024年6月30日	2023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	459,685,561.88	327,358,096.80
债务工具投资		
权益工具投资	14,640.00	14,400.00
衍生金融资产		
其他	459,670,921.88	327,343,696.80
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		
混合工具		
其他		
合计	459,685,561.88	327,358,096.80

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	337,119.12	253,236.07
合计	337,119.12	253,236.07

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	816,088.73
合计	816,088.73	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		2,100.00
场外期权		
合计		2,100.00

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	5,663.72	
3-12 月		200,000.00
1—2 年		
2—3 年		
3 年以上		
小计	5,663.72	200,000.00
减：坏账准备	28.32	1,000.00
合计	5,635.40	199,000.00

2. 按坏账准备计提方法分类披露

类别	期末余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提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	5,663.72	100	28.32	0.5	5,635.40
其中：账龄组合	5,663.72	100	28.32	0.5	5,635.40
合计	5,663.72	100	28.32	0.5	5,635.40

续：

类别	期初余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提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	200,000.00	100	1,000.00	0.5	199,000.00
其中：账龄组合	200,000.00	100	1,000.00	0.5	199,000.00
合计	200,000.00	100	1,000.00	0.5	199,000.00

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	5,663.72	28.32	0.5
3-12 月			
1—2 年			
2—3 年			
3 年以上			
合计	5,663.72	28.32	0.5

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	5,663.72	100	28.32

应收账款期末余额比期初余额减少 97.17%，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	1,241,245.13	43.11	3,950,138.92	70.76
1至2年	1,521,540.58	52.85	1,607,502.22	28.79
2至3年	91,071.24	3.16	6,171.57	0.11
3年以上	25,346.91	0.88	19,175.34	0.34
合计	2,879,203.86	100.00	5,582,988.05	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	2,765,895.64	96.06

预付款项期末余额比期初余额减少 48.43%，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	50,933.46	49,604.49
应收股利		
其他应收款	44,054,573.23	15,960,246.85
合计	44,105,506.69	16,009,851.34

(一) 应收利息

1. 应收利息分类

项目	期末余额	期初余额
其他	50,933.46	49,604.49
合计	50,933.46	49,604.49

(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	41,913,720.68	13,678,550.11
1—2年	242,424.37	238,462.26
2—3年	2,117,952.23	2,121,050.39
3年以上	427,921.98	429,209.99
小计	44,702,019.26	16,467,272.75
减：坏账准备	647,446.03	507,025.90
合计	44,054,573.23	15,960,246.85

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	1,299,289.19	1,082,477.79

款项性质	期末余额	期初余额
场外期权结算款	40,097,791.49	8,761,010.69
仓储、物流押金	1,000.00	5,701.40
往来及其他	3,303,938.58	6,618,082.87
合计	44,702,019.26	16,467,272.75

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	44,702,019.26	100.00	647,446.03	1.45	44,054,573.23
其中：账龄组合	44,702,019.26	100.00	647,446.03	1.45	44,054,573.23
合计	44,702,019.26	100.00	647,446.03	1.45	44,054,573.23

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	16,467,272.75	100.00	507,025.90	3.08	15,960,246.85
其中：账龄组合	16,467,272.75	100.00	507,025.90	3.08	15,960,246.85
合计	16,467,272.75	100.00	507,025.90	3.08	15,960,246.85

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	41,913,720.68	209,568.60	0.50
1—2年	242,424.37	12,121.22	5.00
2—3年	2,117,952.23	211,795.22	10.00
3年以上	427,921.98	213,960.99	50.00
合计	44,702,019.26	647,446.03	1.45

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	507,025.90			507,025.90
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	140,420.13			140,420.13
本期转回				
本期转销				
本期核销				
其他变动				
期末余额	647,446.03			647,446.03

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郑州市分公司	场外期权结算款	11,514,763.86	1年以内	25.76	57,573.82
中国人民财产保险股份有限公司信阳市分公司	场外期权结算款	9,999,954.30	1年以内	22.37	49,999.77
中国太平洋财产保险股份有限公司	场外期权结算款	7,781,540.88	1年以内	17.41	38,907.70
阳光财产保险股份有限公司新疆维吾尔自治区分公司	场外期权结算款	2,694,602.67	1年以内	6.03	13,473.01
中国人民财产保险股份有限公司重庆市长寿支公司	场外期权结算款	2,402,119.00	1年以内	5.37	12,010.60
合计		34,392,980.71		76.94	171,964.90

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	478,886,586.02	35,976,429.54	442,910,156.48	217,786,897.10	4,925,072.40	212,861,824.70
合计	478,886,586.02	35,976,429.54	442,910,156.48	217,786,897.10	4,925,072.40	212,861,824.70

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	转回或转销	其他	
库存商品	4,925,072.40	37,023,967.77		5,972,610.63		35,976,429.54
合计	4,925,072.40	37,023,967.77		5,972,610.63		35,976,429.54

3. 其他说明：

期末存货账面余额中 263,083,712.00 元的库存商品用于质押。

存货期末余额比期初余额增加 1.08 倍，主要原因是子公司和孙公司商品交易产生的期末存货增加所致。

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	2,945,259.79	5,636,977.59
应交税费借方余额	7,136,108.54	7,183,091.84
暂估进项税	59,367,531.40	24,586,879.21
合计	69,448,899.73	37,406,948.64

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	48,762.83	276,029.35	282,275.68		42,516.50
宽带费	53,698.19	60,418.91	42,332.60		71,784.50
信息费	5,534,516.57	3,229,114.02	5,932,671.80		2,830,958.79
合计	5,636,977.59	3,565,562.28	6,257,280.08		2,945,259.79

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	7,600,333.20	7,694,274.36
固定资产清理		
合计	7,600,333.20	7,694,274.36

(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
一. 账面原值				
1. 期初余额	1,725,600.00	22,108,769.54	1,301,188.93	25,135,558.47

项目	运输工具	电子设备	其他	合计
2. 本期增加金额		1,432,464.66	17,225.18	1,449,689.84
购置		1,432,464.66	17,225.18	1,449,689.84
其他增加				
3. 本期减少金额		1,827,707.84	28,366.00	1,856,073.84
处置或报废		1,827,707.84	28,366.00	1,856,073.84
4. 期末余额	1,725,600.00	21,713,526.36	1,290,048.11	24,729,174.47
二. 累计折旧				
1. 期初余额	1,673,832.00	14,540,708.40	1,226,743.71	17,441,284.11
2. 本期增加金额		1,467,219.48	19,967.92	1,487,187.40
本期计提		1,467,219.48	19,967.92	1,487,187.40
其他增加				
3. 本期减少金额		1,771,264.24	28,366.00	1,799,630.24
处置或报废		1,771,264.24	28,366.00	1,799,630.24
4. 期末余额	1,673,832.00	14,236,663.64	1,218,345.63	17,128,841.27
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	7,476,862.72	71,702.48	7,600,333.20
2. 期初账面价值	51,768.00	7,568,061.14	74,445.22	7,694,274.36

(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	10,973,620.23				10,973,620.23
2. 本期增加金额	2,674,827.92				2,674,827.92
租赁	2,674,827.92				2,674,827.92
3. 本期减少金额	992,850.64				992,850.64
租赁到期	992,850.64				992,850.64
其他减少					
4. 期末余额	12,655,597.51				12,655,597.51

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	电子设备	合计
二. 累计折旧					
1. 期初余额	4,503,860.06				4,503,860.06
2. 本期增加金额	2,107,741.11				2,107,741.11
本期计提	2,107,741.11				2,107,741.11
3. 本期减少金额	992,850.64				992,850.64
租赁到期	992,850.64				992,850.64
4. 期末余额	5,618,750.53				5,618,750.53
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	7,036,846.98				7,036,846.98
2. 期初账面价值	6,469,760.17				6,469,760.17

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	4,131,794.04	4,131,794.04
2. 本期增加金额		
购置		
3. 本期减少金额		
处置		
其他原因减少		
4. 期末余额	4,131,794.04	4,131,794.04
二. 累计摊销		
1. 期初余额	2,310,738.97	2,310,738.97
2. 本期增加金额	190,539.74	190,539.74
本期计提	190,539.74	190,539.74
3. 本期减少金额		
处置		
其他原因减少		

项目	软件	合计
4. 期末余额	2,501,278.71	2,501,278.71
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	1,630,515.33	1,630,515.33
2. 期初账面价值	1,821,055.07	1,821,055.07

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	927,842.35	198,339.13	311,617.56		814,563.92
合计	927,842.35	198,339.13	311,617.56	0.00	814,563.92

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	2024年6月30日		2023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	35,976,429.54	8,994,107.39	4,925,072.40	1,231,268.09
信用减值准备	669,188.05	167,297.02	514,474.83	128,618.72
应付职工薪酬	3,814,721.78	953,680.46	5,248,770.75	1,312,192.69
可抵扣亏损	175,503,262.29	43,875,815.58	203,987,345.90	50,996,836.48
公允价值变动	63,766,509.76	15,941,627.44	24,575,493.90	6,143,873.47
承租人租赁使用权资产与 负债	6,686,258.87	1,671,564.71	6,128,696.52	1,532,174.14
合计	286,416,370.29	71,604,092.60	245,379,854.30	61,344,963.59

2. 已确认的递延所得税负债

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	36,051,508.50	9,012,877.12	19,726,992.58	4,931,748.14

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
使用权资产	3,464,701.89	866,175.47	5,969,390.75	1,492,347.70
内部交易未实现利润	1,927,435.74	481,858.94	1,785,378.09	446,344.52
合计	41,443,646.13	10,360,911.53	27,481,761.42	6,870,440.36

3. 未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异明细

项目	2024年6月30日	2023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	29,922.96	42,977.85
合计	29,922.96	42,977.85

注释21. 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	57,447.00	1,923,465,265.85	56,245.00	1,788,728,127.75
法人	1,115	3,076,673,640.88	1,035.00	2,947,720,010.18
合计	58,562.00	5,000,138,906.73	57,280.00	4,736,448,137.93

应付货币保证金期末余额比期初余额增加 5.57%，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22. 应付质押保证金

项目	期末余额	期初余额
上海期货交易所	46,599,280.00	87,128,640.00
大连商品交易所	5,094,400.00	312,800.00
广州期货交易所	64,745,400.00	11,158,080.00
中国金融期货交易所	9,668,524.80	9,770,083.20
郑州商品交易所	130,800.00	
合计	126,238,404.80	108,369,603.20

注释23. 衍生金融负债

项目	期末余额	期初余额
场内期权	511,195.00	
场外期权	55,506,894.74	13,361,423.80
合计	56,018,089.74	13,361,423.80

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24. 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	62,198,509.12	1,071,259.18		63,269,768.30
合计	62,198,509.12	1,071,259.18		63,269,768.30

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25. 应付账款

项目	期末余额	期初余额
应付货款	816,600.41	3,522,901.47
合计	816,600.41	3,522,901.47

账龄超过一年的重要应付账款

无。

注释26. 合同负债

合同负债情况

项目	期末余额	期初余额
预收货款	4,362,917.82	10,146,933.77
合计	4,362,917.82	10,146,933.77

合同负债期末余额比期初余额减少57%，主要原因系上年末现货交易预收货款较多所致。

注释27. 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	553,262.46	258,937.34	553,179.15	259,020.65

2. 计提方法和比例说明

2024年1-6月投资者保障基金计提比例为成交额的亿分之6.50。

注释28. 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	635,378.01	167,256.10
合计	635,378.01	167,256.10

注释29. 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
短期薪酬	18,875,855.72	27,769,098.94	33,887,609.44	12,757,345.22
离职后福利-设定提存计划		3,359,201.08	3,359,201.08	
辞退福利		10,448.61	10,448.61	
一年内到期的其他福利				
合计	18,875,855.72	31,138,748.63	37,257,259.13	12,757,345.22

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	13,001,258.57	22,857,675.09	29,317,873.54	6,541,060.12
职工福利费		200,334.18	200,334.18	
社会保险费		1,936,938.32	1,936,938.32	
其中：基本医疗保险费		1,744,070.19	1,744,070.19	

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
工伤保险费		35,259.44	35,259.44	
生育保险费		157,608.69	157,608.69	
住房公积金		2,412,993.26	2,412,993.26	
工会经费和职工教育经费	5,874,597.15	356,505.54	14,817.59	6,216,285.10
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		4,652.55	4,652.55	
合计	18,875,855.72	27,769,098.94	33,887,609.44	12,757,345.22

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		3,252,873.56	3,252,873.56	
失业保险费		106,327.52	106,327.52	
企业年金缴费				
合计		3,359,201.08	3,359,201.08	

注释30. 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	5,208,363.05	1,043,589.35
个人所得税	165,675.32	164,115.08
城市维护建设税	61,727.49	99,936.42
教育费附加	31,459.84	53,846.15
地方教育费	3,697.73	18,621.92
增值税	230,226.06	924,963.00
其他	549,777.53	504,221.53
合计	6,982,229.30	3,540,595.73

应交税费期末余额比期初余额增加 97.2%，主要原因是应交企业所得税增加所致。

注释31. 其他应付款

项目	期末余额	期初余额
应付利息		
应付股利		
其他应付款	764,280,840.40	508,760,746.27
合计	764,280,840.40	508,760,746.27

(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		
合计		

(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	43,089.19	43,170.11
撤户余额	87,364.03	87,364.03
场外期权结算款	6,555,124.27	225,340.86
往来款	719,590.91	2,228,391.27
期货质押保证金	182,871,032.00	9,171,840.00
场外期权保证金	574,000,000.00	497,000,000.00
其他	4,640.00	4,640.00
合计	764,280,840.40	508,760,746.27

2. 账龄超过一年的重要其他应付款

无。

注释32. 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	2,307,106.69	2,634,995.03
一年内到期的长期借款		105,920,547.94
合计	2,307,106.69	108,555,542.97

注释33. 其他流动负债

项目	期末余额	期初余额
待转销项税	392,662.60	913,224.03
合计	392,662.60	913,224.03

注释34. 应付债券

1. 应付债券类别

项目	期末余额	期初余额
其他应付债券	101,019,178.04	100,021,917.78
减：一年内到期的应付债券		
合计	101,019,178.04	100,021,917.78

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	100,021,917.78
合计	100,000,000.00			100,000,000.00	100,021,917.78

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	997,260.26			101,019,178.04

注释35. 租赁负债

项目	期末余额	期初余额
租金	6,735,012.38	6,128,696.51
小 计	6,735,012.38	6,128,696.51
减：一年内到期的租赁负债	2,307,106.69	2,634,995.03
合计	4,427,905.69	3,493,701.48

其他说明：

本期确认租赁负债利息费用 160,194.60 元。

注释36. 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37. 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38. 其他综合收益

项目	2024年1月1日	本期发生额								2024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	-3,676,411.19	936.61					936.61				-3,675,474.58
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	-3,676,411.19	936.61					936.61				-3,675,474.58

注释39. 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	34,814,035.87			34,814,035.87
合计	34,814,035.87			34,814,035.87

注释40. 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	30,846,337.74			30,846,337.74
合计	30,846,337.74			30,846,337.74

注释41. 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	218,896,040.04	—
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	218,896,040.04	—
加: 本期归属于母公司所有者的净利润	-6,297,868.18	—
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		
对其他的其他分配		
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	212,598,171.86	

注释42. 手续费及佣金净收入

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
交易手续费净收入	12,129,011.26	10,740,230.95
交易所手续费返还	9,169,283.68	11,564,614.36
交割手续费净收入	105,747.85	121,126.22
资管业务收入	506,412.85	297,839.86

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
合计	21,910,455.65	22,723,811.39

注释43. 投资收益
投资收益明细情况

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
权益法核算的长期股权投资收益	-158,429.25	
成本法核算的长期股权投资收益	7,197.53	
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	-42,220.11	-3,856.54
处置交易性金融资产取得的投资收益	-14,850.40	2,747,616.09
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	-212,086.94	373,972.60
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	56,792,925.86	45,264,512.30
合计	56,372,536.69	48,382,244.45

注释44. 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	42,464,746.13	54,921,035.20
减：利息支出	18,267,645.20	40,698,543.37
合计	24,197,100.93	14,222,491.83

注释45. 公允价值变动收益

产生公允价值变动收益的来源	2024年1-6月	2023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	1,053,481.57	-125,050.51
衍生金融资产	-513,295.00	-201,263.50
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	-42,145,470.94	-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	2024年1-6月	2023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	21,160,090.00	1,227,865.17
合计	-20,445,194.37	-34,237,991.19

注释46. 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	1,022,951,972.43	1,453,811,737.99
资金占用费		
交易所培训费及交易所系统保障费等	43,396.23	222,264.16
保险加期货项目收入	3,297,553.67	3,336,700.36
其他		6,392.73
合计	1,026,292,922.33	1,457,377,095.24

注释47. 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	958,043.70	2,629,605.85
个税手续费返还	56,696.54	88,987.10
合计	1,014,740.24	2,718,592.95

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
安商育商补贴	791,800.00		与收益相关
稳岗补贴	10,679.00	5,000.00	与收益相关
金融业发展扶持基金	135,700.00		与收益相关
招聘残疾人超比例奖励	19,864.70	16,205.85	与收益相关
以工代训补贴		2,000.00	与收益相关
经济贡献奖		2,606,400.00	与收益相关
合计	958,043.70	2,629,605.85	

其他收益本期发生额较上期减少了 63.57%，主要原因是政府补助减少所致。

注释48. 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	-2,117.48	0.00
合计	-2,117.48	0.00

注释49. 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	1,071,259.18	1,148,855.08
合计	1,071,259.18	1,148,855.08

注释50. 税金及附加

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	49,615.02	72,600.71
教育费附加	22,175.45	37,029.81
地方教育附加	14,783.62	24,515.17
印花税及其他	833,924.94	864,449.99
合计	920,499.03	998,595.68

注释51. 业务管理费用

项目	本期发生额	上期发生额
工资	22,717,163.21	15,837,640.57
咨询费		28,773.57
信息费	7,580,315.71	6,776,965.57
房租	2,962,756.36	2,456,350.06
邮电费	1,813,923.08	1,421,732.41
劳动保险费	5,300,791.95	3,607,608.28
办公费	437,640.79	502,199.25
机动车辆运营费	589,512.49	580,624.90
折旧	1,487,187.41	1,357,169.87
差旅费	587,643.98	624,893.65
居间人费用	1,077,717.59	664,961.17
仓储物流费	6,276,649.72	10,801,736.54
保险加期货项目保费支出		500,000.00
其他	10,250,489.65	9,188,964.90
合计	61,081,791.94	54,349,620.74

注释52. 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	26,735.65	355,103.18
现货买卖	1,015,619,890.62	1,437,539,030.99
保险加期货项目支出	569,406.47	
合计	1,016,216,032.74	1,437,894,134.17

注释53. 信用减值损失

项目	本期发生额	上期发生额
坏账损失	137,468.27	245,357.61
合计	137,468.27	245,357.61

注释54. 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	36,892,692.54	710,890.32
合计	36,892,692.54	710,890.32

注释55. 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	2,680,611.18	32,200.00	2,680,611.18
其他	1.43		1.43
合计	2,680,612.61	32,200.00	2,680,612.61

营业外收入本期发生额较上期增加 8224.88%，主要原因是子公司收到合同违约金收入增加所致。

注释56. 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	1,168,860.00	300,000.00	1,168,860.00
违约和赔偿损失	114.10	2,304,434.07	114.10
非流动资产毁损报废损失	53,354.12	20,442.66	53,354.12
其他		0.04	
合计	1,222,328.22	2,624,876.77	1,222,328.22

营业外支出本期发生额较上期减少 53.43%，主要原因是子公司现货业务违约赔偿支出减少所致。

注释57. 所得税费用

1. 所得税费用表

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
当期所得税费用	5,601,796.83	2,772,309.89
递延所得税费用	-6,768,657.84	-2,459,061.34
合计	-1,166,861.01	313,248.55

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	-5,539,803.84
按法定/适用税率计算的所得税费用	-1,384,950.96
子公司适用不同税率的影响	5,018.28
调整以前期间所得税的影响	
非应税收入的影响	
不可抵扣的成本、费用和损失影响	141,921.78
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	68,681.25
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	2,468.64
所得税费用	-1,166,861.01

注释58. 现金流量表附注

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
场外期权权利金		16,474,993.65
其他业务收入		3,922,771.35
存出保证金减少		2,968,954.82
应付货币保证金增加	299,967,168.80	316,195,129.21
政府补助收入	958,043.70	2,629,605.85
个税手续费返还	58,506.53	88,987.10
其他应收款减少		480,810.93
其他	6,525,638.90	857,766.59

合计	307,509,357.93	343,619,019.50
----	----------------	----------------

2. 支付其他与经营活动有关的现金

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
场外期权权益		16,469,724.12
捐赠支出	1,168,860.00	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	143,137,515.66	341,918,762.23
其他业务支出		55,103.18
存出保证金增加	9,885,995.90	
其他	294,355.91	68,296.00
合计	154,486,727.47	359,557,382.47

注释59. 现金流量表补充资料

1. 现金流量表补充资料

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	-4,372,942.83	667,337.98
加：期货风险准备金	1,071,259.18	1,148,855.08
信用减值准备	137,468.27	245,357.61
资产减值准备	36,892,692.54	710,890.32
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	1,487,187.40	1,357,169.87
使用权资产折旧	2,107,741.11	1,685,058.60
无形资产摊销	190,539.74	241,656.35
长期待摊费用摊销	311,617.56	171,593.62
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)	2117.48	0.00
固定资产报废损失(收益以“—”号填列)	53,354.12	20,442.66
公允价值变动损失(收益以“—”号填列)	20,445,194.37	34,237,991.19
财务费用(收益以“—”号填列)	1,041,891.95	12,369,590.07
投资损失(收益以“—”号填列)	-56,372,536.69	-48,283,378.91
递延所得税资产减少(增加以“—”号填列)	-10,259,129.01	-3,284,535.38
递延所得税负债增加(减少以“—”号填列)	3,490,471.17	825,474.04
存货的减少(增加以“—”号填列)	-266,941,024.32	125,937,279.77
经营性应收项目的减少(增加以“—”号填列)	650,471,078.70	-209,969,646.09
经营性应付项目的增加(减少以“—”号填列)	-555,720,371.96	-1,559,443.16
其他	0.00	0.00
经营活动产生的现金流量净额	-175,963,391.22	-83,478,306.38
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	0.00
一年内到期的可转换公司债券	0.00	0.00
融资租入固定资产	0.00	0.00

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
3. 现金及现金等价物净变动情况	0.00	0.00
现金的期末余额	2,642,483,519.19	3,971,377,039.57
减：现金的期初余额	3,100,546,519.44	4,003,550,109.57
加：现金等价物的期末余额	0.00	0.00
减：现金等价物的期初余额	0.00	0.00
现金及现金等价物净增加额	-458,063,000.25	-32,173,070.00

2. 现金和现金等价物的构成

项目	2024年6月30日	2023年6月30日
一、现金	2,642,483,519.19	3,971,377,039.57
其中：库存现金		
可随时用于支付的银行存款	14,227,180.73	24,389,892.73
可随时用于支付的期货保证金	2,628,256,338.46	3,946,987,146.84
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	2,642,483,519.19	3,971,377,039.57
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60. 所有权或使用权受到限制的资产

项目	余额	受限原因
存货	263,083,712.00	仓单质押
合计	263,083,712.00	

注释61. 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			263,038.55
其中：美元	14,748.40	7.1268	105,108.89
港币	173,039.47	0.91268	157,929.66

注释62. 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	958,043.70	958,043.70	详见附注注释 47
合计	958,043.70	958,043.70	

二、合并范围的变更

无。

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2024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%(2023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76.85%(2023年：75.18%)

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2024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	合同现金流量按合同剩余期限列示如下：				
	即时偿还	1年以内	1-2年	2-3年	3年以上
应付货币保证金	5,000,138,906.73	5,000,138,906.73			
应付质押保证金	126,238,404.80	126,238,404.80			
衍生金融负债	56,018,089.74	56,018,089.74			
应付账款	816,600.41	816,600.41			
应付手续费及佣金	635,378.01	635,378.01			

项目	期限				
	即时偿还	1年以内	1-2年	2-3年	3年以上
代理买卖证券款	816,088.73	816,088.73			
其他应付款	764,280,840.40	764,280,840.40			
应付债券	108,166,666.67	2,000,000.00	2,000,000.00	2,000,000.00	102,166,666.67
租赁负债（含重分类至“一年内到期的非流动负债”部分）	7,265,886.33	2,560,107.68	2,127,809.49	1,316,973.34	1,260,995.82

（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 2024 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 1 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 2 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	322,859,807.53	136,825,754.35		459,685,561.88
债务工具投资				
权益工具投资	14,640.00			14,640.00
衍生金融资产				
其他	322,845,167.53	136,825,754.35		459,670,921.88
衍生金融资产	0.00			0.00
资产合计	322,859,807.53	136,825,754.35		459,685,561.88
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债小计				
发行的交易性债券				
衍生金融负债				
其他				
衍生金融负债			56,018,089.74	56,018,089.74
负债合计			56,018,089.74	56,018,089.74

（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

(五) 相关资产或负债的不可观察的输入值。

(六) 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
东方汇智资产管理有限公司	同一控制人
东证融汇证券资产管理有限公司	同一控制人
上海孚稻实业有限公司	子公司股东

(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	2024年1-6月	2023年1-6月
东北证券股份有限公司	手续费支出	2,157.17	5,761.64
东北证券股份有限公司	佣金支出	1,503,694.68	1,220,981.13
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	17,779.86	
东方基金管理股份有限公司	手续费支出		
上海孚稻实业有限公司	商品采购	60,798,699.08	
合计		62,322,330.79	1,226,742.77

3. 销售商品、提供劳务的关联交易

关联方	关联交易内容	2024年1-6月	2023年1-6月
东北证券股份有限公司	手续费收入	212,020.03	139,785.93
东方基金管理股份有限公司	手续费收入	17.82	0
东证融汇证券资产管理有限公司	手续费收入	489.94	153.24
东方汇智资产管理有限公司	手续费收入	303.72	
上海孚稻实业有限公司	商品销售	4,274,235.77	
合计		4,487,067.28	139,939.17

4. 其他关联交易

无。

5. 关联方资金拆借

公司孙公司渤海融率在 2022 年 5 月 1 日-2024 年 4 月 30 日向股东东北证券股份有限公司拆入资金 100,000,000.00 元，2024 年 1 月 1 日-2024 年 1 月 11 日计提利息 60,273.97 元。2024 年 1 月 12 日已将该笔拆入资金的本金及利息全部还清。

2022 年 12 月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，2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日计提应付次级债务利息 997,260.26 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	2024 年 6 月 30 日		2023 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	9,925,656.64		39,140.73	

(2) 本公司应付关联方款项

项目名称	关联方	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
应付货币保证金			
	东北证券股份有限公司	278,399,435.43	176,902,795.17
	东证融汇证券资产管理有限公司	38,711,136.21	41,355,640.09
	东证融达投资有限公司		10.94
	东方基金管理股份有限公司	2,145,102.79	514,855.93
	东方汇智资产管理有限公司	17,593,978.94	10,219,735.96
其他应付款			
	东北证券股份有限公司	263,550.34	307,429.62
一年内到期非流动负债			
	东北证券股份有限公司		105,920,547.94
应付债券			
	东北证券股份有限公司	101,019,178.04	100,021,917.78

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	2024 年期末余额/本期发生额						合计
	华北区	东北区	华南区	华中区	西南区	华东区	
一.营业收入	83.4	486.02	126.09	92.42	99.13	110,045.11	110,932.17
其中：手续费收入	50.99	416.64	99.14	76.65	74.63	1,472.99	2,191.05
利息收入	32.4	68.39	26.73	15.65	24.47	2,252.08	2,419.71
二.营业成本费用	105.4	334.98	190.67	110.92	127.45	110,762.57	111,631.97
其中：业务管理费	102.62	312.41	185.01	106.64	123.31	5,278.19	6,108.18
风险基金	2.55	20.83	4.96	3.83	3.73	71.22	107.13
税金及附加	0.22	1.73	0.66	0.44	0.47	88.52	92.05
三.利润总额	-22	151.05	-64.59	-18.5	-28.33	-571.62	-553.98
四.所得税费用	0	0	0.01	0	0.02	-116.71	-116.69
五.净利润	-22	151.05	-64.6	-18.5	-28.34	-454.9	-437.29
六.资产总额	19.71	15.09	23.05	47.07	5.92	695,513.17	695,624.02
七.负债总额	228.28	-4,130.12	-89.36	294.86	-53.66	619,258.34	615,508.34

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	50,933.46	49,604.49
应收股利	30,000,000.00	30,000,000.00
其他应收款	1,977,696.93	1,634,043.48
合计	32,028,630.39	31,683,647.97

(一) 应收利息

1. 应收利息分类

项目	期末余额	期初余额
其他	50,933.46	49,604.49
合计	50,933.46	49,604.49

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	1,464,468.31	7,322.34	0.50
1—2年	242,424.37	12,121.22	5.00
2—3年	85,318.69	8,531.87	10.00
3年以上	426,921.98	213,460.99	50.00
小计	2,219,133.35	241,436.42	10.88
减：坏账准备	241,436.42		
合计	1,977,696.93		

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	985,497.24	765,685.84
其他	1,233,636.11	1,108,824.55
合计	2,219,133.35	1,874,510.39

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	2,219,133.35	100	241,436.42	10.88	1,977,696.93

类别	期末余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
其中：账龄分析组合	2,219,133.35	100	241,436.42	10.88	1,977,696.93
合计	2,219,133.35	100	241,436.42	10.88	1,977,696.93

续：

类别	期初余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提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	1,874,510.39	100	240,466.91	12.83	1,634,043.48
其中：账龄分析组合	1,874,510.39	100	240,466.91	12.83	1,634,043.48
合计	1,874,510.39	100	240,466.91	12.83	1,634,043.48

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	1,464,468.31	7,322.34	0.50
1—2年	242,424.37	12,121.22	5.00
2—3年	85,318.69	8,531.87	10.00
3年以上	426,921.98	213,460.99	50.00
合计	2,219,133.35	241,436.42	

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	240,466.91			240,466.91
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	969.51			969.51

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)	
本期转回				
本期转销				
本期核销				
其他变动				
期末余额	241,436.42			241,436.42

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	300,000,000.00		300,000,000.00	300,000,000.00		300,000,000.00
对联营、合营企业投资				3,012,777.11		3,012,777.11
合计	300,000,000.00		300,000,000.00	303,012,777.11		303,012,777.11

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	300,000,000.00	300,000,000.00	0.00	0.00	300,000,000.00		
合计	300,000,000.00	300,000,000.00	0.00	0.00	300,000,000.00		

对联营企业投资

被投资单位	期初余额	本期增减变动			
		追加投资	减少投资	权益法确认的投资损益	其他综合收益调整
上海共赋私募基金管理有限公司	3,012,777.11		2,854,347.86	-158,429.25	
合计	3,012,777.11		2,854,347.86	-158,429.25	

续:

被投资单位	其他权益变动	本期增减变动			期末余额	减值准备期末余额
		宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
上海共赋私募基金管理有限公司						
合计						

其他说明:

2024年1月31日，渤海期货股份有限公司的参股公司上海共赋私募基金管理有限公司（以下简称“上海共赋”）召开2024年第一次临时股东会，会议审议通过了《关于上海共赋私募基金管理有限公司解散的议案》。2024年2月29日，上海共赋收到上海市市场监督管理局核发的《登记通知书》，准予上海共赋注销登记，上海共赋的注销登记办理完成。

注释3. 手续费及佣金净收入

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
交易手续费净收入	12,140,222.81	10,839,096.49
交易所手续费返还	9,169,283.68	11,564,614.36
交割手续费净收入	115,677.10	121,126.22
资管业务收入	506,412.85	297,839.86
合计	21,931,596.44	22,822,676.93

注释4. 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	41,737,146.72	54,921,035.20
减：利息支出	18,207,371.23	40,698,543.37
合计	23,529,775.49	14,222,491.83

注释5. 投资收益

项目	2024年1-6月	2023年1-6月
权益法核算的长期股权投资收益	-158,429.25	
成本法核算的长期股权投资收益	7,197.53	
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	-42,220.11	-3,856.54
处置交易性金融资产取得的投资收益	-306,727.31	1,461,800.77
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	-500,179.14	1,457,944.23

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，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-2,117.48	
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关、符合国家政策规定、按照确定的标准享有、对公司损益产生持续影响的政府补助除外）	958,043.7	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，非金融企业持有金融资产和金融负债产生的公允价值变动损益以及处置金融资产和金融负债产生的损益	137,896.19	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
委托他人投资或管理资产的损益		
对外委托贷款取得的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而产生的各项财产损失		
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
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		
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		
非货币性资产交换损益		
债务重组损益		
企业因相关经营活动不再持续而发生的一次性费用，如安置职工的支出等		
因税收、会计等法律、法规的调整对当期损益产生的一次性影响		
因取消、修改股权激励计划一次性确认的股份支付费用		
对于现金结算的股份支付，在可行权日之后，应付职工薪酬的公允价值变动产生的损益		
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		
交易价格显失公允的交易产生的收益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
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	1,458,284.39	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小计	2,552,106.80	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	638,026.70	
少数股东权益影响额（税后）	650,625.37	
归属于母公司所有者权益的非经常性损益净额	1,263,454.73	

(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	-0.80	-0.01	-0.01
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	-0.96	-0.02	-0.02

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	-2,117.48
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）	958,043.70
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，非金融企业持有金融资产和金融负债产生的公允价值变动损益以及处置金融资产和金融负债产生的损益	137,896.19
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	1,458,284.39
非经常性损益合计	2,552,106.80
减：所得税影响数	638,026.70
少数股东权益影响额（税后）	650,625.37
非经常性损益净额	1,263,454.73

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

四、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用