

弘业期货股份有限公司

2022 年半年度报告



2022 年 8 月

第一节 重要提示、目录和释义

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

公司负责人周剑秋、主管会计工作负责人周剑秋及会计机构负责人(会计主管人员)陈蓉平声明：保证本半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。

本报告中若有涉及未来的经营计划等前瞻性陈述，不构成公司对投资者的实质承诺，请投资者注意投资风险。

公司在本报告第三节“管理层讨论与分析”之“十、公司面临的风险和应对措施”中详细描述公司经营中可能存在的风险及应对措施，敬请投资者关注相关内容。

公司经本次董事会审议通过的利润分配预案为：以 1,007,777,778 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 0.3 元（含税），送红股 0 股（含税），不以公积金转增股本。

目录

第一节 重要提示、目录和释义.....	2
第二节 公司简介和主要财务指标.....	7
第三节 管理层讨论与分析.....	10
第四节 公司治理.....	26
第五节 环境和社会责任.....	28
第六节 重要事项.....	30
第七节 股份变动及股东情况.....	34
第八节 优先股相关情况.....	37
第九节 债券相关情况.....	38
第十节 财务报告.....	39

备查文件目录

- 1、载有公司法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报表。
- 2、报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。
- 3、载有法定代表人签名的公司 2022 年半年度报告文本原件。
- 4、以上文件均齐备、完整，并备于本公司证券部以供查阅。

释义

释义项	指	释义内容
深交所	指	深圳证券交易所
A 股	指	本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的境内上市普通股已在深交所上市及买卖
A 股发行	指	本公司首次公开发行 100,777,778 股 A 股股份并于 2022 年 8 月 5 日在深交所上市，本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的境内上市普通股已在深交所上市及买卖
内资股	指	本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的已发行普通股，以人民币认购或入账列作缴足，本公司全部 657,300,000 股内资股全部转换为相同数量的 A 股
H 股	指	本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的境外上市外资普通股，该等股份均在香港联交所主板上市
董事会	指	本公司董事会
公司、本公司、弘业期货	指	弘业期货股份有限公司
集团、本集团	指	除非文义另有所指，否则指弘业期货股份有限公司及其子公司
实际控制人	指	除非文义另有所指，否则指江苏省国有资产监督管理委员会
控股股东	指	除非文义另有所指，否则指江苏省苏豪控股集团有限公司
《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》
《公司章程》	指	《弘业期货股份有限公司章程》，公司现行有效的公司章程
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
中期协	指	中国期货业协会
大商所	指	大连商品交易所
郑商所	指	郑州商品交易所
上期所	指	上海期货交易所
中金所	指	中国金融期货交易所
上海能源中心	指	上海国际能源交易中心股份有限公司
中国结算深圳分公司	指	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
报告期、报告期内	指	自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止的期间
报告期末	指	2022 年 6 月 30 日
元、万元、亿元	指	人民币元、万元、亿元
CTA	指	商品交易顾问，可以向他人提供买卖期货、期权合约指导或建议、或以客户名义进行操作的自然人或法人
董事	指	本公司董事
FOF	指	一种专门投资于其他投资基金的基金。并不直接投资股票或债券，其投资范围仅限其他基金，通过持有其他证券投资基金而间接持有股票、债券等证券资产，它是结合基金产品创新和销售渠道创新的基金新品种
汇鸿集团	指	江苏汇鸿国际集团股份有限公司（前称江苏汇鸿股份有限公司），一家于 1992 年 10 月 13 日在中国成立的有限公司，其后于 1994 年改制为股份有限公司
弘业资本	指	弘业资本管理有限公司，一家于 2013 年 6 月 25 日根据中国法律成立的有限公司，为本公司的全资附属公司
弘业资管	指	弘业国际资产管理有限公司，原弘苏资产管理有限公司，一家于 2016 年 7 月 7 日根据香港法例注册成立的有限公司，为本公司的全资附属公司，根据《证券及期货条例》可进行第 4 类（就证券提供意见）及第 9 类（提供资产管理）受规管活动，于 2019 年 12 月更名
弘业股份	指	江苏弘业股份有限公司（前称江苏省工艺品进出口集团股份有限公司），一家于 1994 年 6 月 30 日根据中国法律成立的有限公司，为公司的发起人之一及股

		东
弘业国际金融	指	弘业国际金融控股有限公司，原弘苏期货（香港）有限公司，一家于 2011 年 10 月 20 日根据香港法例注册成立的有限公司，为本公司的全资附属公司，根据《证券及期货条例》可进行第 1 类（证券交易）及第 2 类（期货合约交易）受规管活动，于 2019 年 12 月更名
弘苏实业	指	江苏弘苏实业有限公司，一家于 2011 年 1 月 23 日根据中国法律成立的有限公司，为公司的发起人之一及股东
苏豪控股	指	江苏省苏豪控股集团有限公司（前称江苏省丝绸集团有限公司），一家于 1994 年 4 月 29 日根据中国法律成立的国有独资有限公司，为公司的控股股东及发起人之一
监事	指	本公司监事
对敲	指	交易双方分别扮演卖方和买方角色，各自按照约定的交易种类、价格、数量、向证券或期货经纪商发出交易委托指令并达成交易的行为

第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司简介

股票简称	弘业期货	股票代码	001236 (A股)、03678 (H股)
股票上市证券交易所	深圳证券交易所、香港联合交易所有限公司		
公司的中文名称	弘业期货股份有限公司		
公司的中文简称 (如有)	弘业期货		
公司的外文名称 (如有)	HOLLY FUTURES CO., LTD.		
公司的外文名称缩写 (如有)	HOLLY FUTURES		
公司的法定代表人	周剑秋		

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	黄海清	郑晨
联系地址	南京市秦淮区中华路 50 号弘业大厦	南京市秦淮区中华路 50 号弘业大厦
电话	025-52278884	025-52278884
传真	025-86919358	025-86919358
电子信箱	zqb@ftol.com.cn	zqb@ftol.com.cn

三、其他情况

1、公司联系方式

公司注册地址，公司办公地址及其邮政编码，公司网址、电子信箱在报告期是否变化

适用 不适用

公司注册地址，公司办公地址及其邮政编码，公司网址、电子信箱报告期无变化，具体可参见 2021 年年报。

2、信息披露及备置地点

信息披露及备置地点在报告期是否变化

适用 不适用

公司选定的信息披露报纸的名称	《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》、《上海证券报》
登载半年度报告的网址	http://www.cninfo.com.cn/
公司半年度报告备置地点	江苏省南京市秦淮区中华路 50 号弘业大厦公司证券部
临时公告披露的指定网站查询索引 (如有)	不适用

3、其他有关资料

其他有关资料在报告期是否变更情况

适用 不适用

四、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

是 否

合并

	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
营业总收入（元）	754,744,074.16	777,776,964.49	-2.96%
归属于上市公司股东的净利润（元）	35,254,924.33	45,301,437.69	-22.18%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	34,782,729.88	44,822,791.13	-22.40%
其他综合收益（元）	5,688,022.51	-1,710,504.14	432.53%
经营活动产生的现金流量净额（元）	3,386,828,951.48	288,911,060.33	1,072.27%
基本每股收益（元/股）	0.0389	0.0499	-22.04%
稀释每股收益（元/股）	0.0389	0.0499	-22.04%
加权平均净资产收益率	2.07%	2.73%	-0.66%
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
资产总额（元）	12,366,117,688.25	8,083,101,074.92	52.99%
负债总额（元）	10,643,007,734.73	6,400,934,068.24	66.27%
归属于上市公司股东的净资产（元）	1,723,109,953.52	1,682,167,006.68	2.43%

母公司

	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
营业总收入（元）	156,012,463.06	175,811,469.97	-11.26%
净利润（元）	37,126,093.80	42,528,219.38	-12.70%
其他综合收益（元）	-20.94	-8.76	-139.04%
经营活动产生的现金流量净额（元）	3,362,829,282.16	229,161,094.90	1,367.45%
基本每股收益（元/股）	0.0409	0.0469	-12.79%
稀释每股收益（元/股）	0.0409	0.0469	-12.79%
加权平均净资产收益率	2.17%	2.57%	-0.40%
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
资产总额（元）	12,354,879,058.02	8,225,662,024.97	50.20%
负债总额（元）	10,623,274,289.75	6,531,183,329.56	62.65%
所有者权益总额（元）	1,731,604,768.27	1,694,478,695.41	2.19%

五、境内外会计准则下会计数据差异

1、同时按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用 不适用

公司报告期不存在按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况。

2、同时按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用 不适用

公司报告期不存在按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况。

六、非经常性损益项目及金额

适用 不适用

单位：元

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）	-19,322.87	
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	368,063.89	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	260,997.92	
减：所得税影响额	137,544.49	
合计	472,194.45	

其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况：

适用 不适用

公司不存在其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况。

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明

适用 不适用

公司不存在将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

七、母公司净资产及有关风险控制指标

单位：元

项目	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
净资本	760,060,230.02	708,697,751.82	7.25%
净资产	1,731,604,768.27	1,694,478,695.41	2.19%
净资本/各项风险资本准备之和	167.77%	209.04%	-41.27%
净资本/净资产	43.89%	41.82%	2.07%
净资本/负债	211.39%	201.52%	9.87%
净资产/负债	481.60%	481.84%	-0.24%

第三节 管理层讨论与分析

一、报告期内公司从事的主要业务

经中国证监会及相关监管机构批准，公司从事的主要业务为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售。此外，本公司还从事金融资产投资业务。公司全资子公司弘业资本主要从事大宗商品交易及风险管理业务，全资子公司弘业国际金融主要从事境外证券及期货交易服务。业务内容具体如下：

1、期货经纪业务：公司期货经纪业务包括为期货交易所上市的商品期货以及金融期货提供经纪业务服务，并向客户收取一定比例的手续费。公司是上期所、大商所、郑商所、能源中心的全权会员，以及中金所的全面结算会员，可向客户提供国内 5 家期货交易所全部期货、期权交易品种的代理买卖。同时，公司获得上海证券交易所和深圳证券交易所股票期权交易参与人资格，可向客户提供股票期权经纪服务。

2、资产管理业务：指公司接受单一客户或特定多个客户的书面委托，根据相关规定和合同约定，运用客户委托资产进行投资，并按照合同约定收取费用或者报酬的业务活动。公司作为资产管理人发行资产管理计划，投资范围主要包括期货及其他金融产品等。

3、基金销售业务：弘业期货与各大基金公司合作，签订代销协议成为基金公司的渠道方，依托弘业期货官网、APP 等平台将基金销售给客户。客户认购时只需在弘业期货开立一个统一的账户，即可购买所有弘业期货代销的基金产品。

4、期货投资咨询业务：通过为客户提供风险管理顾问、专项培训、研究分析报告、设计投资方案、期货交易策略等咨询服务，赚取咨询费及相关收入。

5、风险管理业务：公司的风险管理业务主要由子公司弘业资本开展。弘业资本是经中国期货业协会备案设立的风险管理子公司，业务范围主要包括基差贸易、做市业务、场外衍生品业务、合作套保及仓单服务等。

6、境外金融服务业务：公司通过弘业国际金融及其子公司开展境外业务。弘业国际金融于 2012 年 6 月 29 日获发香港证监会核批的第 2 类牌照-期货合约交易。可从事业务范围包括：为客户提供指数或商品期货的买卖及经纪服务；为客户买入/卖出期货合约。现弘业国际金融于 2017 年 1 月 10 日获发香港证监会核批的第 1 类牌照-证券交易。可从事业务范围包括：为客户提供股票及股票期权的买卖及经纪服务；为客户买卖债券；为客户买入/卖出互惠基金及单位信托基金。弘业国际金融子公司弘业国际资管于 2018 年 8 月 28 日获发香港证监会核批的第 4 类牌照-就证券提供意见、第 9 类牌照-提供资产管理。

7、金融资产投资业务：金融资产投资业务为公司使用自有资金投资以获取收益的业务。报告期内，公司使用自有资金从事金融投资，以寻求投资回报，投资标的包括股票、基金、债券、资管计划、信托计划等产品。

（一）报告期内公司所属行业的发展情况、周期性特点

1、报告期内公司所属行业的发展情况

2022 年上半年，在俄乌冲突、新冠疫情以及美联储加息引发全球经济衰退等多重因素的冲击下，期货市场的波动加剧，使得期货行业的业绩有所承压，但市场整体运行相对平稳。今年上半年，按单边计算，全国期货市场累计成交量为 30.46 亿手，累计成交额为 257.48 万亿元，同比分别下降 18.04%和 10.08%。

分交易所来看，其中上海期货交易所 1-6 月累计成交量为 8.19 亿手，累计成交额为 69.63 万亿元，同比分别下降 33.23%和 30.46%，分别占全国市场的 26.88%和 27.04%。上海国际能源交易中心 1-6 月累计成交量为 5,358.95 万手，累计成交额为 20.88 万亿元，同比分别增长 45.28%和 108.25%，分别占全国市场的 1.76%和 8.11%。郑州商品交易所 1-6 月累计成交量为 10.28 亿手，累计成交额为 44.7 万亿元，同比分别下降 20.35%和 12.96%，分别占全国市场的 33.76%和 17.36%。大连商品交易所 1-6 月累计成交量为 10.77 亿手，累计成交额为 62.61 万亿元，同比分别下降 2.22%和 3.52%，分别占全国市场的 35.36%和 24.32%。中国金融期货交易所 1-6 月累计成交量为 6,820.82 万手，累计成交额为 59.67 万亿元，同比分别增长 12.65%和下降 0.46%，分别占全国市场的 2.24%和 23.17%。中国期货市场的活跃度和成交情况有所下滑，导致期货公司的经纪业务有所承压，期货公司业绩下滑。此外，部分期货公司的自营业务、场外业务不及预期，拖累了行业的整体表现。

上半年，全国 150 家期货公司净利润为 58.12 亿元，同比下滑 4.59%；营收 202.03 亿元，同比下滑 9.53%。其中，客户权益较去年同期大幅增长 32.08%，达到 1.37 万亿。上半年期货公司的手续费收入 128.19 亿元，较去年同期下滑 8.83%。此外，资管业务场外业务也不及预期。截至 2022 年 6 月末，共有 129 家期货公司开展资产管理业务，累计收入 5.19 亿元，累计支出 3.86 亿元，行业累计净利润 1.33 亿元。其中，净资产规模 3444.89 亿元，较去年同期增长 28.49%，较去年年底减少 97.76 亿元。

2022 年 4 月份第十三届全国人民代表大会常务委员会第三十四次会议通过《中华人民共和国期货和衍生品法》并于 2022 年 8 月 1 日正式施行，为期货市场以及衍生品市场的健康发展提供了坚实的法制保障。中证 1000 股指期货期权等新品种上市提速，期货市场规模预计将继续保持快速增长。

2、期货行业的基本情况及周期性特点

目前，我国期货市场主要由商品期货和金融期货两大类交易品种构成。其中，商品期货是指标的物为实物商品的期货合约。商品期货历史悠久，是期货市场的最初交易品种，种类丰富多样，发展到目前已经形成了包括农产品期货、金属期货和能源化工期货等在内的众多分类。金融期货是以金融经济指标作为标的物的期货合约，主要包括货币期货、国债期货、股指期货等品类。金融期货在金融市场定价、风险规避等方面有着非常重要的作用，对经济金融体系产生了深远的影响。

经过 30 多年的探索发展，我国期货市场由无序逐渐走向成熟，逐步进入了健康稳定发展、经济功能日益显现的良性轨道。同时，我国期货市场的国际影响力显著增强，逐渐成为全球最大的商品期货交易市场和农产品期货交易市场。我国的大商所、郑商所、上期所和中金所在全球衍生品交易所交易量排名均跻身世界前列，在世界期货市场中占据重要地位。

随着我国资本市场的逐步成熟，金融期货对资本市场的发展发挥着越来越重要的作用。由于金融期货尚处于发展阶段，我国金融期货市场仍需要不断完善，因而我国金融期货交易体量不大，市场仍欠成熟。宏观来看，金融期货在全球迅速普及以及交易量的快速增长，使金融期货在全部期货交易量中的比重迅速提高。金融期货后来居上的主要原因是金融产品相比于有形商品具有更大的市场容量和创新空间。因此，我国的金融期货市场具备巨大的市场需求和无限的潜力。期货市场的最终发展离不开金融期货市场的发展。一方面，从金融投资方面看，随着金融标的增加和期货投资者的涌入，金融期货市场的体量伴随着金融市场整体的蓬勃发展将会有显著的增长。另一方面，在风险控制层面，随着证券市场的发展以及我国金融体系的改革，单一的市场交易模式已经无法满足控制风险的要求，金融期货未来将继续快速发展。

期货公司经营业绩与证券期货市场的行情走势存在相关性，期货行业的营业收入和利润水平受到宏观经济影响具有较强的周期性。期货业务也依赖并受益于我国的经济增长及我国资本市场的发展及表现，受经济环境、监管政策、投资者的风险偏好以及国际市场等多方面因素影响。

(二) 报告期内公司所处的行业地位、业务经营情况及未来发展思路

1、公司所处行业地位

经过多年激烈的市场竞争，公司的综合竞争力不断增强。公司各项监管指标持续符合中国证监会的有关规定，财务指标排名保持稳定。报告期内，公司的成交额市场占有率为 0.64%，成交量市场占有率为 0.7%。

2、业务经营情况

2022 年上半年，国际环境复杂严峻，国内疫情频发散发，不利影响加大，超预期突发因素带来严重冲击，公司各项业务发展均受到前所未有的挑战。面对异常复杂困难局面，在公司董事会的坚强领导下，公司上下坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，围绕“疫情要防住、经济要稳住、发展要安全”三件大事，紧扣“党建强、治理优、经营稳、融合好”的发展主题，坚持稳字当头、稳中求进，强化责任担当、顶住巨大压力、克服重重困难，奋力拼搏、开拓进取。2022 年上半年，公司实现营业收入 7.54 亿元，较上年同期下降 3%；实现归属于上市公司股东的净利润 3,525.49 万元，较上年同期下降 22%。

(1) 期货经纪业务

本公司期货经纪业务包括为中国所有期货交易所上市的商品期货、金融期货及期权提供经纪业务服务，并向客户收取一定比例的手续费。截至 2022 年 6 月 30 日，公司营业网点及分公司共 45 家，主要分布在中国各直辖市、江苏省内和其他经济发达地区。截至 2022 年 6 月 30 日，本公司客户权益为人民币 100.11 亿元，较 2021 年末的人民币 59.31 亿元，增长 69%。公司代理成交额（双边统计，下同）人民币 33,026.63 亿元，较 2021 年同期的人民币 48,568.39 亿元同比下

降 32%。公司代理成交量为 4,292.73 万手，较 2021 年同期的 6,259.34 万手同比下降 31%，成交额市场占有率为 0.64%。公司代理期货经纪业务手续费收入为人民币 1.42 亿元，较 2021 年同期的人民币 1.35 亿元同比增长 5%。

(2) 资产管理业务

截至 2022 年 6 月 30 日，公司资产管理规模人民币 235.06 亿元，较 2021 年年末的资产管理规模人民币 235.93 亿元，减少 0.37%，保持期货行业前三名。资产管理业务实现手续费收入人民币 444 万元，较去年同期下降 29%。公司作为资产管理计划的管理人，成立新产品 6 个，其中集合类产品 2 个，一对一专户产品 4 个，高于行业平均水平。此外，公司作为私募基金产品的投资顾问，成立新产品 1 个。合计在运行资产管理产品 34 个。

公司不断提升资管产品服务变现能力，加大业务创新力度。顺应行业监管趋势，注重发挥合规风控管理效能，积极打造多元化业务体系，着力推动向主动管理业务转型。2022 年上半年公司资管中心发行首期专精特新主题资管产品，量化 CTA 类型产品实际收益再创新高。公司依托近两年稳健的 FOF 产品回报，通过担任投资顾问角色的合作形式，加大与信托公司、私募基金机构等合作机构发行 FOF 类型产品。

(3) 大宗商品交易及风险管理业务

2022 年上半年，弘业资本克服多种困难，进一步夯实队伍。1-6 月实现营业收入人民币 6.06 亿元，实现利润总额人民币 1,036 万元。期现业务团队稳定，风控进一步完善。基差贸易业务方面，稳步推动产研一体化，加大与实体经济合作力度，通过资源共享、优势互补，形成产业合力，实现配套现货贸易额 5.88 亿元。场外期权业务稳定开展，产业客户占比超 50%，新增成交名义本金人民币 61 亿元，同比增长 2 倍，服务中小微企业 22 家，成交规模 30 亿元。做市业务方面，持续优化做市策略和交易系统，获评郑商所优秀期货做市商荣誉。大力研究及宣传推广期权业务，利用交易所「企风计划」政策服务实体经济。

公司注重围绕国家战略，响应中央及行业号召，持续运用“保险+期货”服务乡村振兴，上半年取得了多项进展。

1、获批多个交易所“保险+期货”项目。成功参与三个大商所大豆县域项目，立项三个生猪价格分散试点项目，成功获批上期所云南勐腊县和海南澄迈县两个橡胶项目，其中云南省勐腊县是我司第四年在当地开展，继续巩固脱贫攻坚成果。获批郑商所陕西省黄龙县苹果新型农业主体创新项目和辽宁省花生项目。

2、商业性项目有较大突破，今年在江苏徐州、贵州赫章、新疆、黑龙江四地实施了共计 35 个商业性项目，涉及大豆、玉米、鸡蛋、生猪等品种，承保货值超过人民币 1 亿元。

3、推动江苏省政策性“保险+期货”项目落地。2022 年 6 月 28 日我司与保险公司合作在徐州和淮安落地全省首批财政补贴型生猪“保险+期货”项目，是江苏省首次试水“政府引导、财政补贴、市场运作”原则，推出的财政金融联动服务乡村振兴的创新模式，得到了广泛的宣传和关注。

(4) 境外金融服务业务

2022 年上半年，弘业国际金融期货业务权益同比增长 41.05%，证券业务权益同比增长 339.72%；基金管理规模同比增长 16.86%。公司通过引进优质业务团队，使证券业务在权益、成交量以及手续费收入等指标全面提升。公司将不断深化与现有客户的合作关系，同时通过专注客户需求、提供差异化服务和帮助客户成长展业以进一步扩大业务规模。美股交易功能上线。

(5) 基金销售业务

公司新增代销基金产品 251 只，代销基金产品总数增至 1,783 只，2022 年 1-6 月基金销售规模为人民币 16,600 万元，销售规模同比增长 137%。筛选优质私募基金管理人，进行自有资金投资，在充分评估风险和收益的前提下，挖掘潜在投资机遇，力争公司对外投资收益实现突破。机构客户线上开户和申赎模块正式上线并使用。

(6) 金融资产投资业务

为优化公司资金运作，公司进行了证券、基金、银行委托理财产品、信托及资产管理计划等多渠道的金融资产投资，在控制风险的前提下，有效配置资金，促进主业发展，提高资金盈利水平。

2022 年上半年，本集团金融资产投资业务实现处置与分红收益人民币-1,026 万元，主要是因为 2022 年上半年受金融市场波动的影响，公司投资的部分金融资产出现一定程度亏损。

3、未来发展思路

公司的总体发展战略是：力争建设成为「混合所有制更加完善、体制机制更加灵活、风险管控更加有效、上市平台优势更加突出」的国际型金融上市公司。

在管控好风险的前提下，公司将围绕经纪业务、风险管理、财富管理、资产管理、国际业务五个「中心」，继续拓展线上和线下两个「平台」，充分发挥公司风险管理、资产管理、国际业务等牌照优势，加快创新发展，探索开展期货衍生品投行业务。持续拓展公司「五位一体」服务实体经济模式的广度和深度，充分运用好合作共赢的「赛马」机制，着力构建适应期货期权、场内场外、期货现货、境内境外需求的综合衍生品特色服务体系，推动公司实现从平台服务提供商向综合型专业投行业务提供商的转型。

公司将突出深化改革与转型升级两条主线，以改革释放红利，推动企业健康发展，以转型寻找机遇，促进企业持续发展。以提升核心竞争力为目标，深化改革、转型升级，进一步优化资源配置，调整产业结构，促进和保障公司高质量发展。

本公司将重点做好以下几项工作任务。

（一）全面深化改革，构建高质量发展长效机制

改革是活力之源。坚持把转型升级、提质增效摆在更加突出的位置，依靠改革创新破除发展瓶颈、汇聚发展优势、增强发展动力。

1. 持续深化改革。公司已成功回归 A 股市场，成为行业首家「A+H」上市公司。高质量完成国企改革三年行动。以 A 股上市为契机，充分利用好募集资金，努力提升主营业务质效，提升创新业务贡献度，为做好股价维护夯实基础。加大金融科技的研究和应用，提升客户体验和资产管理水平，向金融科技企业转型。进一步研究用好上市公司平台的路径方法，为强化人才、风险控制、技术、研发等方面提供充足的资本保障。

2. 全面加强干部队伍建设。公司始终坚持「以人为本、人才强企」的发展理念，落实经理层成员任期制、契约化改革工作实施方案，充分激发经理层成员的活力和创造力，提升企业市场化、现代化经营水平。贯彻「能上能下」的用人理念，将内部中层管理岗位竞聘上岗工作常态化，选出政治过硬、业绩突出、品德优异、积极向上的业务骨干走上中层管理岗位，同时将不能适应市场竞争的中层干部分流出去。通过完善双向流动的人力资源通道，形成良好的人才竞争机制和竞争氛围。

（二）对标行业标杆，推动公司主业高质量发展

1. 打造特色化的经纪业务服务。立足「线上和线下」，依靠优质服务增强客户黏性。依托在线平台，实现投顾服务、金融产品的精准推送。依托线下平台，向机构客户、高净值客户开展基于大类资产配置财富管理顾问类服务以及个性化、定制化的综合金融服务。立足「五位一体」，完善多级平台强化业务联动。以「五位一体」发展战略为核心，充分发挥品种事业部的职能作用，实现以品种为核心取代以地域为核心的业务发展模式。以「品种事业部」为抓手，构建完善的贯穿总部、分公司、营业部之间的业务联动机制。通过平台化、体系化建设，优化客户服务体系，为客户提供分层分级服务。改进和完善营业部考核机制，使其业务发展立足财富管理与机构业务双轮驱动模式。在经纪业务的基础上，发展以衍生品为特色的多元化财富管理业务和以风险管理为核心的多元化机构业务。立足市场培育，做好投资者教育，构建产融结合平台。探索建立「专业化、数字化、场景化」的投资者教育平台。创新「在线+线下」联动联通的投教方式，让投教工作直接对接产业客户市场的培育。立足优势品种，重点打造公司投教知名品牌。推进设立省级「投资者教育」基地，择机设立国家级「投资者教育」基地，将投教工作引向更高层次和更深层次。

2. 实现资管业务稳中求质。不断丰富资管产品类型，稳步推出衍生品类和固收+及 FOF 类产品。以低风险、稳收益产品线为契机，拓展与商业银行、证券公司、基金公司、理财子公司等机构的对接。扩大公司集合类产品的销售渠道，提升弘业资管品牌效应。以量化对冲、低风险套利、套保对冲、多策略 FOF 及打新策略为合作切入点，加大与商业银行理财子公司、保险机构及集团内部企业等大型机构的合作，争取获得更多充足稳定的委托资金来源。专注于高评级债券、套利、FOF 及 CTA 等策略的研发，坚持人才培养与引进并举，有力提升公司自主管理能力，培养具有自身特色的资产管理业务团队。

3. 风险管理业务力争有新的突破。大力发展以期货风险管理为主的大宗商品交易商，满足实体经济个性化风险管理的需要，提升公司的定价能力、交易能力，逐步建立起以定价为核心的风险管理架构。期现业务方面：持续深耕产业链，对运行平稳的期现业务品种，加大资金投入力度，通过增加规模提高收入总额。同时，结合产业客户需求提供定制化风险管理服务，通过服务增厚收益。做市业务方面：积极申请有关商品和金融期权的场内做市商资格，提高做市业务利润贡献，让做市业务成为弘业资本利润贡献的「压舱石」。期权业务方面：引入新团队，力争场外期权业务成交名义本金

规模进一步扩大。优化交易策略，提高盈利水平。推进农业保险与信贷、担保、期货、期权等金融工具联动，扩大「保险+期货」范围，探索「订单农业+保险+期货」模式。

4. 财富管理业务抢抓发展新机遇。在优化调整弘业公募基金公司设立方案的基础上，进一步加大与中国证监会的沟通，力争公募基金公司早日获批。不断适应市场发展变化，持续扩大公募基金代销规模，加大基金宣传和培训力度，坚守合规底线，以智能化、专业化的在线线下融合模式推动业务高质量发展，推进私募代销业务，打造多元化金融产品和策略产品体系，健全差异化服务模式，不断增强用户黏性和好感度。搭建优质债券交易业务框架，实现平稳、安全、高效的债券交易运行体系。同时，在防控风险的前提下深入开展投资研发，加大投资力度。

5. 稳步提升跨境服务综合能力。充分发挥弘业国际金融境外证券、期货、资产管理等牌照优势，做实做响弘业国际金融品牌。一是不断充实境外团队力量。引入带头人和市场经验丰富的管理团队，重点加强香港本地期货、证券、资产管理业务团队建设，大力培养具有自身特色的精英营销团队。二是多种业务齐抓共进。以建立粤港澳大湾区团队作为突破口，做大做强主营业务。进一步提高服务大客户的能力，向中国证监会申请试点互换业务。寻找优质基金合作伙伴，大力配置和营销基金产品，与国内资管业务形成联动。与其他香港金融机构合作，开展 IPO 及债券承销业务。

（三）坚持科技创新，夯实稳致远发展根基

1. 聚焦「科技赋能」，构建数字化平台。公司致力于金融科技的研发和投入，以云计算为基础，以智能化为目标，进行项目开发、系统优化、云平台建设、系统运维等工作。主动迎接数字化浪潮带来的机遇和挑战，运用互联网思维、利用金融科技不断探索优化和调整业务场景，建立大数据平台。金融科技部着力打造新媒体矩阵，创新服务「零距离」，其中，官微受众规模扩大，视频号持续发布高质量视频，新增「弘业先锋」微信服务号、「弘业期货投教基地」微信公众号。推行「科技弘业」战略，开发弘业期货小程序，为客户提供 7*24 小时信息信息，快速实现基本业务办理。坚持用信息化助推企业转型，将信息化运用于公司经营的各个方面。提升客户服务的质效、合规风控的预警能力以及企业信息化流转的便捷性。为更好服务客户，上线移动 CRM—弘业知客。信息技术部围绕数据中心优化、核心系统升级、系统安全维护等方面，持续加强金融科技实力，提升客户体验。

2. 聚合「投研能力」，以研究创造价值。坚持以市场为导向，以客户为中心，加强事业部建设，加大金融研究院对客户开发和服务的支持力度。加强应用型研究，将研究成果进一步向客户服务、产品服务转化，提升公司研发的「变现力」。强化公司在优势产业的研究能力，充分挖掘和满足实体产业需求。注重提升研发实力，开展「碳达峰、碳中和」、电力期货的前瞻性研究，为新品种客户开发奠定基础。立足交易所「企风计划」「走进企业、服务实体」等项目，构建市场培育和 innovation 业务推广促进平台。

3. 推动「风险控制」再上新台阶。通过制度完善、宣讲培训、实时监控、合规审查等方式，对公司经营管理各环节开展从事前到事后的内部监督。坚持底线思维，从制度和技术上不断强化风险防控能力建设。加强对重点领域、重点环节管理制度的分析梳理，识别各业务流程和岗位职责中的合规风险点，查漏补缺，完善相关管理措施。特别是面对当前复杂严峻的市场形势，把潜在风险考虑得更全面，把应对措施谋划得更有效，把风险控制在合理范围内。同时，深入推进法治企业建设，促进子公司风险管理体系与业务经营管理进一步契合。注重加强企业文化和法制宣传教育，让「合法合规、诚实自律」的经营理念深入人心。

4. 推动「安全生产」再上新台阶。深入贯彻习近平总书记关于疫情防控的重要指示要求，坚决落实控股集团各项防控要求，进一步增强风险意识，坚持科学防控，从严从紧落实各项防控措施。认真履行安全生产主体责任，做到安全投入到位、安全培训到位、基础管理到位、应急救援到位，确保安全生产。从安全监管最薄弱的环节着手，查漏洞、补短板，不断推进安全生产创新发展。

二、核心竞争力分析

1、优越的地理区位

公司的总部位于江苏省省会南京市，在江苏拥有稳固地位。截至 2022 年 6 月 30 日，公司 45 家分支机构（包括 39 家营业部和 6 家分公司）中，20 家位于江苏省。

江苏省位于我国东部沿海地区，经济发达。江苏省 2021 年 GDP 达到 11.64 万亿元，同比增长 8.6%；2021 年江苏省居民人均可支配收入 47,498 元，同比增长 9.5%。近年来，江苏省政府不断出台新政策刺激全省经济发展，尤其是金融

服务行业的发展。江苏省政府曾发布《关于加快推进金融改革创新的意见》，促进江苏省金融控股平台的发展及创新、增强期货公司、银行、证券公司、保险公司及信托公司的全面投资能力、进一步提高江苏省的证券化率。凭借有利的政策条件，本公司将获得更多市场机会。

2、广泛分布的分支机构网络

截至 2022 年 6 月 30 日，公司拥有分支机构共计 45 家（包括 39 家营业部和 6 家分公司），其中 20 家位于江苏省，其余主要位于北京、上海和深圳等经济发达、金融业繁荣地区，实现了对全国金融业发达地区和其他主要地区的覆盖。此外，公司的子公司弘业国际金融可以为客户在香港联交所、香港期货交易所及全球其他主要期货交易所提供证券期货相关服务。

公司期货营业部分布较广，区位优势明显，使得公司能够在接触发达地区的优质客户方面更为便利，并受惠于东部沿海地区和中西部地区的城市化及经济发展成果。公司的营业部分布和区位覆盖能够为本公司客户提供便利的金融服务，进一步提升本公司的品牌知名度和客户忠诚度。

3、强大的创新能力保障本公司把握中国期货行业改革带来的机遇

2012 年 7 月，中国证监会发布《期货公司资产管理业务试点办法》，并向期货公司开放资产管理业务资格。2012 年 11 月 15 日，中国证监会核准本公司的资产管理业务资格。

2012 年 12 月，中国证监会发布《期货公司设立子公司开展以风险管理服务为主的业务试点工作指引》，期货公司可以通过设立风险管理子公司开展以风险管理服务为主的业务。2013 年 4 月 25 日，中期协对本公司风险管理服务子公司弘业资本试点仓单服务业务和合作套保及基差交易业务予以备案。

随着我国期货行业的竞争日益激烈，公司积极把握我国期货行业改革带来的新机会，拓宽公司的期货业务、收益渠道及客户基础。基于公司的创新意识和创新能力，公司积极响应监管政策改革，开拓新的业务条线。

4、高效、综合及稳定的网上交易平台

作为网上期货交易服务供应商，公司为客户提供高效及稳定的交易平台以进行实时交易。通过公司网上交易平台，客户可在市场开放时实时进行期货交易，并查阅其账户详细数据及记录、图表系统、新闻提要、过往市场数据，并可使用其他服务。客户可通过免费个人计算机软件交易程序、智能手机应用程序，快速执行交易。

公司维持稳定交易平台的能力是建立及维持客户忠诚度和吸引新客户的关键因素。为确保客户的交易活动顺利进行，公司建立了 3 个独立的数据中心，其中 1 个位于南京，2 个位于上海，公司的数据中心均可每日备份网上交易平台的交易记录。公司的 3 个独立数据中心任何 1 个出现故障，不会导致公司中断提供服务。同时，公司还建立了上期所、中金所、郑商所及大商所数据中心，满足极速及量化交易客户的需求。公司网上交易平台运营以来，未发生严重影响客户交易活动的事件。

5、强大的客户服务能力

公司的销售团队稳定，客户经理与客户联系紧密。依托公司的客户服务体系，销售团队能够在国内拓展业务，可以为客户提供全方位服务支持。

公司通过 400 热线电话、微信公众号以及手机应用程序“弘运通”为客户提供信息资讯、行情交易、在线开户等全方位的服务。

公司为客户提供使用网上交易平台的指导。在交易过程中，公司会就客户遇到的有关交易系统或客户的账户状况的技术问题或疑问提供相应服务。公司拥有一支研究团队，并且在行业内率先建立了国家级博士后工作站，可以为客户提供增值信息服务。

6、经验丰富而稳定的高级管理团队

本公司拥有一支稳定而经验丰富的高级管理团队，在期货行业拥有多年的工作经验，并被授予江苏省国有企业创建“四好”领导班子先进集体称号，带领弘业期货获得“全国文明单位”称号。经验丰富的高级管理团队是本公司能实现未来长期增长的关键因素。

7、全面的业务资质

公司及子公司在境内外拥有全面的业务资质，实现了从期货到现货、从场内到场外、从国内到国际、从线上到线下的全面业务覆盖。

公司拥有商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售以及股票期权交易参与人等中国证监会或行业监管机构颁发的业务资格。

公司子公司弘业国际金融在香港拥有证券和期货牌照，可交易或通过代理交易全球主流的境外证券期货产品，覆盖包括香港联交所、芝加哥期货交易所、伦敦金属交易所、香港期货交易所、欧洲期货交易所、新加坡商品期货交易所、东京商品交易所以及美国洲际交易所等全球大型证券期货交易所。弘业国际金融的子公司弘业国际资管拥有香港资产管理与证券投资咨询相关业务牌照。

公司子公司弘业资本主要从事大宗商品交易及风险管理业务，包括基差贸易、做市业务、场外衍生品业务、合作套保及仓单服务等。目前，弘业资本是大商所、郑商所、上期所和能源中心多个期货品种的做市商。

8、良好的市场声誉

公司凭借多年的业务发展和市场积累，在期货行业中树立了良好的市场形象，形成了稳定的客户群体，品牌价值不断提升。

三、主营业务分析

概述

参见“一、报告期内公司从事的主要业务”相关内容。

主要财务数据同比变动情况

单位：元

	本报告期	上年同期	同比增减	变动原因
营业总收入	754,744,074.16	777,776,964.49	-2.96%	
营业总支出	709,013,880.94	715,590,657.22	-0.92%	
所得税费用	10,780,055.16	15,124,459.03	-28.72%	
经营活动产生的现金流量净额	3,386,828,951.48	288,911,060.33	1,072.27%	客户保证金存款的大幅增加
投资活动产生的现金流量净额	-43,479,968.40	-288,680,900.56	84.94%	上年同期支付用于购买南京河西紫金金融中心办公用房款项
筹资活动产生的现金流量净额	39,940,478.73	130,945,574.64	-69.50%	上年同期获得用于购买南京河西紫金金融中心办公用房的银行贷款
现金及现金等价物净增加额	3,392,998,609.66	128,666,865.60	2,537.04%	客户保证金存款的大幅增加

公司报告期利润构成或利润来源发生重大变动

适用 不适用

公司报告期利润构成或利润来源没有发生重大变动。

营业总收入构成

单位：元

项目	本报告期		上年同期		同比增减
	金额	占营业总收入比重	金额	占营业总收入比重	
手续费及佣金净收入	145,949,979.25	19.34%	141,345,295.32	18.17%	3.26%
利息净收入	49,213,667.55	6.52%	38,426,229.11	4.94%	28.07%
投资收益	-25,663,806.86	-3.40%	323,058.74	0.04%	-8,044.01%
其他收益	324,275.54	0.04%	3,178,866.31	0.41%	-89.80%

公允价值变动收益	-5,624,500.99	-0.75%	7,428,358.37	0.96%	-175.72%
汇兑收益	2,639,036.48	0.35%	-979,760.16	-0.13%	369.36%
其他业务收入	587,924,746.06	77.90%	588,187,600.92	75.62%	-0.04%
资产处置收益	-19,322.87	0.00%	-132,684.12	-0.02%	85.44%
营业总收入合计	754,744,074.16	100.00%	777,776,964.49	100.00%	-2.96%

相关数据同比发生变动 30% 以上的原因说明

适用 不适用

(1) 投资收益和公允价值变动损益：今年上半年金融市场出现较大波动，本公司投资的部分金融资产出现一定程度的亏损。

(2) 其他收益：上年同期子公司弘业资本收到一次性企业所得税税收返还 262.24 万元。

(3) 汇兑收益：受汇率波动影响，本公司持有的港币产生汇兑收益。

(4) 资产处置收益：本期处置固定资产产生的损失较上年同期减少。

主营业务分业务情况

单位：元

业务类别	营业总收入	营业总支出	营业利润率	营业总收入比上年同期增减	营业支出比上年同期增减	营业利润率比上年同期增减
期货经纪及资产管理业务	152,878,479.95	113,794,123.96	25.57%	-13.67%	-8.15%	-4.47%
大宗商品交易及风险管理业务	605,575,563.94	595,219,756.98	1.71%	1.15%	0.60%	0.54%

变动原因

本公司主营业务的营业总收入、营业总支出未发生重大变化。

公司主营业务数据统计口径在报告期发生调整的情况下，公司最近 1 期按报告期末口径调整后的主营业务数据

适用 不适用

主营业务分地区情况

(1) 营业总收入地区分部情况

单位：元

地区	本报告期		上年同期		营业总收入比上年同期增减
	营业部数量	营业总收入	营业部数量	营业总收入	
中国大陆	47	759,344,225.40	47	776,492,783.64	-2.21%
中国香港	1	-4,600,151.24	1	1,284,180.85	-458.22%
合计	48	754,744,074.16	48	777,776,964.49	-2.96%

(2) 营业利润地区分部情况

单位：元

地区	本报告期		上年同期		营业利润比上年同期增减
	营业部数量	营业利润	营业部数量	营业利润	
中国大陆	47	56,421,280.64	47	66,674,379.67	-15.38%
中国香港	1	-10,691,087.42	1	-4,488,072.40	-138.21%
合计	48	45,730,193.22	48	62,186,307.27	-26.46%

四、非主营业务分析

适用 不适用

五、资产及负债状况分析

1、资产构成重大变动情况

单位：元

	本报告期末		上年末		比重 增减	重大变动说明
	金额	占总资产 比例	金额	占总资产 比例		
货币资金	7,536,812,255.03	60.95%	4,143,641,973.33	51.26%	9.69%	客户保证金存款的大幅增加
交易性金融资产	846,829,186.47	6.85%	840,419,634.46	10.40%	-3.55%	无重大变动
存货	48,686,145.22	0.39%	9,531.74	0.00%	0.39%	无重大变动
长期股权投资	8,203,412.73	0.07%	7,036,127.76	0.09%	-0.02%	无重大变动
固定资产	12,980,627.29	0.10%	14,899,414.00	0.18%	-0.08%	无重大变动
在建工程	274,716,656.66	2.22%	0.00	0.00%	2.22%	公司购置的南京河西紫金金融中心办公用房本期开始进入装修阶段，尚未达到预定可使用状态
使用权资产	32,900,612.87	0.27%	24,655,989.58	0.31%	-0.04%	无重大变动
卖出回购金融资产款	48,051,155.15	0.39%	32,625,838.11	0.40%	-0.01%	无重大变动
合同负债	716,855.00	0.01%	1,000,000.00	0.01%	0.00%	无重大变动
长期借款	103,175,661.98	0.83%	117,197,967.93	1.45%	-0.62%	无重大变动
租赁负债	33,245,922.67	0.27%	24,831,103.80	0.31%	-0.04%	无重大变动
应收货币保证金	2,504,259,046.74	20.25%	2,025,860,140.16	25.06%	-4.81%	应付客户保证金的大幅增加导致该项目占总资产比例有所下降
应收质押保证金	991,770,498.40	8.02%	668,817,393.60	8.27%	-0.25%	无重大变动
应收结算担保金	20,000,000.00	0.16%	20,000,000.00	0.25%	-0.09%	无重大变动
衍生金融资产	9,871,158.50	0.08%	465,835.77	0.01%	0.07%	无重大变动
其他应收款	44,345,072.41	0.36%	24,951,725.11	0.31%	0.05%	无重大变动
买入返售金融资产	0.00	0.00%	6,719,000.00	0.08%	-0.08%	无重大变动
期货会员资格投资	1,827,595.00	0.01%	1,808,800.00	0.02%	-0.01%	无重大变动
无形资产	752,789.54	0.01%	1,025,204.63	0.01%	0.00%	无重大变动
递延所得税资产	7,547,290.85	0.06%	7,394,041.07	0.09%	-0.03%	无重大变动
其他资产	24,615,340.54	0.20%	295,396,263.71	3.65%	-3.45%	公司购置的南京河西

						紫金金融中心办公用房本期开始进入装修阶段，尚未达到预定可使用状态，预付购房款转入在建工程
应付货币保证金	9,036,416,322.74	73.07%	5,261,811,881.42	65.10%	7.97%	应付客户保证金的大幅增加
应付质押保证金	974,938,338.40	7.88%	668,817,393.60	8.27%	-0.39%	无重大变动
交易性金融负债	114,652,344.11	0.93%	86,471,254.16	1.07%	-0.14%	无重大变动
衍生金融负债	15,899,936.78	0.13%	1,514,054.34	0.02%	0.11%	无重大变动
期货风险准备金	157,119,049.72	1.27%	151,215,411.17	1.87%	-0.60%	无重大变动
应付期货投资者保障基金	198,232.66	0.00%	522,926.88	0.01%	-0.01%	无重大变动
应付职工薪酬	577,259.68	0.00%	20,659,015.94	0.26%	-0.26%	无重大变动
应交税费	8,498,830.47	0.07%	6,015,879.24	0.07%	0.00%	无重大变动
预计负债	0.00	0.00%	1,969,920.97	0.02%	-0.02%	无重大变动
其他应付款	149,517,825.37	1.21%	26,281,420.68	0.33%	0.88%	无重大变动

2、主要境外资产情况

适用 不适用

3、以公允价值计量的资产和负债

适用 不适用

单位：元

项目	期初数	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	本期购买金额	本期出售金额	其他变动	期末数
金融资产								
1. 交易性金融资产（不含衍生金融资产）	840,419,634.46	-19,833,457.38			400,758,978.64	374,515,969.25		846,829,186.47
2. 衍生金融资产	465,835.77	103,484,487.48				94,079,164.75		9,871,158.50
金融资产小计	840,885,470.23	83,651,030.10			400,758,978.64	468,595,134.00		856,700,344.97
上述合计	840,885,470.23	83,651,030.10			400,758,978.64	468,595,134.00		856,700,344.97
金融负债	87,985,308.50	-89,275,531.09			32,814,588.20	79,523,146.90		130,552,280.89

其他变动的内容

无

报告期内公司主要资产计量属性是否发生重大变化

是 否**4、截至报告期末的资产权利受限情况**

项目	2022年6月30日账面价值（元）	受限原因
货币资金	210,212.54	产品募集资金账户
货币资金	1,446,863.88	场外期权保证金
交易性金融资产	71,119,031.72	卖出回购交易质押
存货	6,271,559.62	交易所质押借款（红枣）
存货	39,713,467.20	交易所质押借款（棉花）

六、投资状况分析**1、总体情况**适用 不适用**2、报告期内获取的重大的股权投资情况**适用 不适用**3、报告期内正在进行的重大的非股权投资情况**适用 不适用**4、金融资产投资****(1) 证券投资情况**适用 不适用

单位：元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
信托产品	现金添利1号	江苏信托现金添利1号	25,000,000.00	公允价值计量	0.00	16,961.93		25,000,000.00	0.00	16,961.93	25,016,961.93	交易性金融资产	自有资金
信托产品	熙元臻享	华能信托	20,000,000.00	公允价值	20,115,068.00	495,890.41		0.00	0.00	495,890.41	20,610,958.00	交易性金	自有资金

	3号-第四期-A1	熙元臻享3号-第四期-A1	.00	计量	.49						.90	融资产	
基金	中港策略基金(港元)	匯添中港策略基金(港元)	9,771,581.97	公允价值计量	20,076,741.16	245,640.93		0.00	0.00	245,640.93	20,322,382.09	交易性金融资产	自有资金
基金	SES697	涌泽4号私募证券投资基金	15,000,000.00	公允价值计量	15,703,143.60	685,726.80		0.00	0.00	685,726.80	16,388,870.40	交易性金融资产	自有资金
信托产品	圆融1号	中融融圆融1号集合信托	15,000,000.00	公允价值计量	0.00	268,520.55		15,000,000.00	0.00	268,520.55	15,268,520.55	交易性金融资产	自有资金
基金	006228	中欧医疗创新股票A	14,999,000.00	公允价值计量	14,458,531.08	-921,304.27		1,998,002.00	3,957,965.43	-1,845,391.43	11,577,263.38	交易性金融资产	自有资金
信托产品	永宁10号	西部信托永宁10号	10,000,000.00	公允价值计量	10,098,383.56	312,410.96		0.00	0.00	312,410.96	10,410,794.52	交易性金融资产	自有资金
基金	004702	南方金融主题灵活配置混合A	9,985,044.87	公允价值计量	0.00	395,653.37		9,985,044.87	0.00	395,653.37	10,380,698.24	交易性金融资产	自有资金
基金	SCP572	中量投CTA一号私募基金	10,000,000.00	公允价值计量	9,950,830.18	290,743.25		0.00	0.00	290,743.25	10,241,573.43	交易性金融资产	自有资金
信托产品	汇远1号	陆家嘴信托汇远1号	10,000,000.00	公允价值计量	20,042,191.78	153,424.66		0.00	10,000,000.00	0.00	10,195,616.44	交易性金融资产	自有资金
信托产品	甄选1号	国民信托甄选1号信托计划	10,000,000.00	公允价值计量	10,531,232.88	-412,328.77		0.00	0.00	345,206.18	10,118,904.11	交易性金融资产	自有资金
期末持有的其他证券投资			642,332,93	--	719,443,51	-21,36		1,541,202,	1,552,984,	-31,30	686,296,64	--	--

	5.60		1.73	4,797		000.5	072.5	0,620	2.48		
				.21		1	5	.63			
合计	792,088,562.44	---	840,419,634.46	-19,833,457.39	0.00	1,593,185,047.38	1,566,942,037.98	-30,089,257.68	846,829,186.47	---	---

(2) 衍生品投资情况

适用 不适用

公司报告期不存在衍生品投资。

5、募集资金使用情况

适用 不适用

(1) 募集资金总体使用情况

适用 不适用

单位：万元

募集年份	募集方式	募集资金总额	本期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	报告期内变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额比例	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金用途及去向	闲置两年以上募集资金金额
2022年	A股首发上市	16,135.44	0	0	0	0	0.00%	16,135.44	补充资本金	0
合计	---	16,135.44	0	0	0	0	0.00%	16,135.44	---	0

募集资金总体使用情况说明

公司报告期无 A 股募集资金使用情况。公司于 2022 年 8 月 5 日在深交所主板挂牌上市，上表数据为公司于 2022 年 8 月 5 日至本公告披露日之间的 A 股募集资金使用情况。

公司 H 股募集资金使用情况如下：

经中国证监会证监许可[2015]1963 号文核准，公司于 2015 年 12 月 30 日于香港联交所主板上市，共向全球发行 2.497 亿股港股（包括由本公司发售的 227,000,000 股 H 股及由售股股东发售的 22,700,000 股 H 股），发行价格为港币 2.43 元/股，募集资金总计约港币 6.07 亿元。根据招股说明书中对全球发售资金的使用用途说明，公司募集资金计划用于以下用途：发展公司的香港及全球期货业务、发展资产管理业务、发展大宗商品交易及风险管理业务、发展及加强现有期货经纪业务、购买信息技术设备及软件及补充本集团一般运营资金。

公司于 2019 年 6 月 6 日召开 2018 年度股东周年大会，将原本拟用于“发展及加强现有期货经纪业务”的剩余资金港币 5,000 万元变更为用于“发展香港及全球期货业务”，并获得通过。此次变更需经国家外汇管理局、国家发展和改革委员会等相关部门核准后方可实施。截至 2022 年 6 月 30 日，公司尚未获得相关监管部门对上述改变募集资金使用用途申请的批准。

截至 2022 年 6 月 30 日，募集资金已按照招股说明书所列的用途，作如下使用：1、“发展香港及全球期货业务”可用金额港币 17,157 万元，累计已使用金额港币 16,500 万元，结余港币 657 万元；2、“发展资产管理业务”可用金额港币 13,404 万元，累计已使用金额港币 13,404 万元，结余港币 0 万元；3、“发展大宗商品交易及风险管理业务”可用金额港币 10,723 万元，累计已使用金额港币 9,784 万元，结余港币 939 万元；4、“发展及加强现有期货经纪业务”可用金额港币 5,361 万元，累计已使用金额港币 52 万元，结余港币 5,309 万元（获得监管部门批准后，将转为“发展香港及全球期货业务”）；5、“购买信息技术设备及软件”可用金额港币 2,681 万元，累计已使用金额港币 2,681 万元，结余港币 0 万元；6、“本集团一般运营资金”可用金额港币 4,289 万元，累计已使用金额港币 4,289 万元，结余港币 0 万元。

出于提高资金运用效率的考虑，截至 2022 年 6 月 30 日，公司将剩余募集资金以银行存款的方式存放于大型商业银行，本公司计划 2022 年下半年选择适当时机，按照招股说明书约定及本公司 2018 年股东周年大会所修订的募集资金净额及用途，予以使用（须经监管部门批准）。

(2) 募集资金承诺项目情况□适用 不适用**(3) 募集资金变更项目情况**□适用 不适用

公司报告期不存在募集资金变更项目情况。

七、重大资产和股权出售**1、出售重大资产情况**□适用 不适用

公司报告期末未出售重大资产。

2、出售重大股权情况□适用 不适用**八、主要控股参股公司分析**适用 不适用

主要子公司及对公司净利润影响达 10%以上的参股公司情况

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	营业总收入	营业利润	净利润
弘业资本管理有限公司	子公司	大宗商品交易及风险管理	390,000,000 元	559,859,874.89	419,568,320.32	605,575,563.94	10,355,806.96	7,763,893.77
弘业国际金融控股有限公司	子公司	证券、期货经纪	港币 190,000,000 元	273,746,216.74	126,810,825.50	- 4,600,151.24	- 10,691,087.42	- 8,780,560.57

报告期内取得和处置子公司的情况

□适用 不适用

主要控股参股公司情况说明

弘业国际金融控股有限公司因受香港金融市场波动等因素的影响，部分金融资产投资出现亏损。导致其营业收入、营业利润、净利润同比下降幅度较大。

九、公司控制的结构化主体情况适用 不适用

按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》的规定，本集团将管理人为本集团或者本集团作为主要责任人、且本集团以自有资金参与、并满足新修订准则规定“控制”定义的结构化主体纳入合并报表范围。

截止 2022 年 6 月 30 日，本集团合并资产管理计划及基金的净资产规模为人民币 194,863,734.36 元，同时，本集团在合并资产管理计划及基金中所持有权益的账面价值为人民币 80,211,390.25 元，该权益在财务报告中计入交易性金融资产、货币资金、其他应收款以及其他应付款。

十、公司面临的风险和应对措施

公司经营活动面临的风险主要包括风险管理和内部控制风险、道德风险、市场风险、信用风险、信息技术风险等。2022 年上半年公司采取有效措施，积极主动应对风险，保障了经营活动的安全高效。

1、风险管理和内部控制风险

公司依赖风险管理及内部控制制度以及相关人员对于相关制度的严格执行来管理风险。公司制定的风险管理及内部控制制度用于识别、监控及控制各种风险，包括市场风险、操作风险、信贷风险及合规风险等。但部分风险管理方法是基于内部建立的控制制度、对于过往市场行为的观察和总结以及标准行业惯例等，在公司业务创新和多元化发展的过程中，可能无法预测未来的风险敞口或者识别意料之外和不可预见的风险。部分风险管理方法依赖于对市场情况及经营状况相关数据的评估与分析，但对于相关数据的评估和分析可能不准确。此外，随着市场情况以及监管政策的变化，如果公司不能及时依据未来期货市场发展及业务扩充而调整完善风险管理及内部控制政策及程序，公司的业务、财务状况及经营业绩可能会受到重大不利影响。

公司的风险管理方法也依赖于执行人员的控制和监督，实际操作中可能会出现错误和失误。尽管公司能够识别潜在风险，但公司对有关风险的评估及就处理风险采取的相应措施可能并不一定充分有效。由于公司的营业网点分部广泛，公司无法保证所有员工将全面遵守公司的风险管理及内部控制政策。公司的风险管理及内部控制政策并不一定能保障公司规避全部风险，在此情况下，可能会对公司的业务、财务状况及经营业绩造成重大不利影响。

2、道德风险

道德风险指因未遵守相关法律法规、监督部门或机构的规定、自律行为准则或任何与本公司的期货经纪业务有关的指引而遭受法律制裁、起诉、诉讼索赔、罚款、财产损失以及使名誉受损。道德风险主要与公司的雇员相关。

雇员引发的道德风险包括在未经客户同意及授权的情况下管理客户资产、开设账户并代表客户进行交易。其主要指个别员工道德水平不高，不能抵御充满诱惑的市场，较容易出现员工违规代客理财、自行开户交易等行为。目前公司已就工作人员的计算机交易端口透过技术手段予以屏蔽，防范员工在营业场所接受客户委托代客理财、私自开户交易。针对员工道德风险，公司从强化内控制度出发，建立了责任追究机制。通过相关部门联合排查，从源头杜绝员工开户交易风险，同时通过加强对员工培训教育工作，强化合规意识以避免员工此类风险发生。

3、市场风险

市场风险指由于宏观经济形势的变化，如由于股价、利率、汇率、商品等风险因子波动导致公司收入减少或资产损失的风险。

报告期内，国际环境更趋复杂严峻，国内疫情多发散发，不利影响明显加大，经济发展极不寻常，超预期突发因素带来严重冲击，公司主营业务和金融资产投资业务均受到较大挑战。权益类证券投资方面，公司持续推进去方向化投资的转型，同时根据市场变化灵活调整对冲头寸，控制投资组合下行风险的前提下，积极发掘交易机会。公司坚持对冲控制风险的理念，积极控制风险敞口，通过各项风险管控措施管理持仓资产的市场风险。

传统经纪业务方面，由于期货公司数量多、手续费价格战逐年愈演愈烈，发展局面并不乐观。投资者进入期货市场，没有足够的期货投资的经验与技巧，没有良好的风险控制能力，仅注重投机交易而忽略风险控制，或者由于自身因素受到经济环境影响导致被迫终止交易等因素，各种因素的综合作用使客户穿仓成为期货公司面临重要风险。

针对此类风险，公司风控部门通过密切跟踪市场走势，监控市场波动，合理调整投资者保证金标准，加强对持仓变化和保证金水平等风险指标的监控，通过适时提高保证金、采取强行平仓等风控措施，依据有关法规规范投资者的交易行为；加大了日常交易中的监控力度，特别是针对冷门品种和合约的异常交易行为监控，对于交易中的对敲行为做到及时发现、及时报告和及时处理；加强对客户的风险教育工作，提醒投资者做好风险管理，防止投资者因对相关规则的不了解及风险防范意识不强而带来的风险隐患。

4、信用风险

信用风险是指由于产品或债券发行人违约、交易对手违约导致公司资产受损失的风险。

当期货经纪公司接受客户委托，按照客户交易指令为其进行期货交易时，若客户无法或拒绝履行其合约责任，则期货公司会遭受损失。来自客户的信用风险分为两种，第一种为企业客户因法人代表更换、所有权变更、业务业绩欠

佳以及发生其他不可抗力事件而无法履行其合约责任；第二种信用风险来自期货市场的动荡，导致价格大幅波动，亦使某些客户无法履行其合约责任。

为控制信用风险，公司严格控制开户流程。公司制定了严格的投资者适当性管理制度，认真履行投资者适当性，充分评估每位新客户的身分、信用度以及其用于期货交易的资金的充足度。公司亦做好投资者教育与培训工作，以确保持客户充分了解期货交易相关风险，不断提高客户抵御风险的能力。

5、信息技术风险

信息技术风险主要是指各种内、外部原因造成公司信息系统运行异常或者数据毁损、泄露，导致系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面不能持续保障交易与业务管理稳定、高效、安全地进行，从而造成损失的风险。

公司各项业务以及中后台管理均高度依赖于信息技术系统，信息系统已成为支撑公司业务运转的关键保障。报告期内，公司持续加大信息技术投入，不断完善信息技术风险管理制度与流程，不断加强信息技术质量控制，加强信息技术风险排查与治理，完善监控体系，风险管理成效进一步提升。公司不断完善信息技术风险应急预案，定期进行应急演练。报告期内，公司信息系统安全平稳运行，未发生重大信息技术风险事件。

第四节 公司治理

一、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

1、本报告期股东大会情况

会议届次	会议类型	投资者参与比例	召开日期	披露日期	会议决议
2021 年度股东周年大会、2022 年第一次 H 股类别股东大会、2022 年第一次内资股类别股东大会	年度股东大会	72.40%	2022 年 05 月 11 日	2022 年 05 月 11 日	审议通过了《关于延长公司首次公开发行 A 股股票并上市股东大会决议有效期的议案》等

2、表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

公司董事、监事和高级管理人员在报告期没有发生变动，具体可参见 2021 年年报。

三、本报告期利润分配及资本公积金转增股本情况

适用 不适用

每 10 股送红股数（股）	0
每 10 股派息数（元）（含税）	0.3
分配预案的股本基数（股）	1,007,777,778
现金分红金额（元）（含税）	30,233,333.34
以其他方式（如回购股份）现金分红金额（元）	0.00
现金分红总额（含其他方式）（元）	30,233,333.34
可分配利润（元）	134,088,372.88
现金分红总额（含其他方式）占利润分配总额的比例	100%
本次现金分红情况	
其他	
利润分配或资本公积金转增预案的详细情况说明	
<p>综合考虑公司长远发展和投资者利益，根据《公司法》、《上市公司监管指引第 3 号——上市公司现金分红》等法律法规、规范性文件以及《公司章程》的相关规定，公司 2022 年度中期利润分配预案为：以实施权益分派股权登记日登记的总股本为基数，向全体股东实施每 10 股派发现金红利 0.30 元（含税），按公司截至 2022 年 8 月 29 日的总股本 1,007,777,778 股为基数测算，预计派发现金红利 30,233,333.34 元（含税），剩余未分配利润结转至以后期间/年度分配。本次利润分配不送红股，不以资本公积金转增股本。</p>	

四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

适用 不适用

公司报告期无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

第五节 环境和社会责任

一、重大环保问题情况

上市公司及其子公司是否属于环境保护部门公布的重点排污单位

是 否

报告期内因环境问题受到行政处罚的情况

无

参照重点排污单位披露的其他环境信息

无

在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

未披露其他环境信息的原因

公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。公司及子公司在日常经营过程中严格遵守国家及地方有关环境保护方面的法律、法规及规范性文件的规定，依法履行各项环保义务，未发生环境污染事故，报告期内不存在因违反相关环保规定而受到处罚的情形。

二、社会责任情况

公司扎实履行企业社会责任。发挥期货市场功能，有效衔接乡村振兴，签订结对帮扶协议 7 份；购买乡村振兴产品作为职工福利，并协助建立销售平台，助力产品销售。组织数十名员工参与无偿献血。发出倡议书，组织多批次志愿者支援核酸检测。在“学习强国”平台刊登 7 篇报道，在省级及以上主流媒体平台刊登 108 篇报道，其中 62 篇宣传公司在疫情防控、服务实体、乡村振兴及履行社会责任方面的做法。公司始终坚持企业与社会共同发展的理念，通过巩固扶贫成果、组织公益活动、参与慈善捐款等，积极服务社会、反馈社会。

（一）助力乡村振兴

乡村兴则国家兴。实施乡村振兴这一重大战略，是以习近平总书记为核心的党中央从党和国家事业全局出发，着眼于实现“两个一百年”奋斗目标、实现中华民族伟大复兴的中国梦，顺应亿万农民对美好生活的向往，作出的重大决策，在我国“三农”发展进程中具有划时代的里程碑意义。

1、获批多个交易所“保险+期货”项目。成功参与三个大商所大豆县域项目，立项三个生猪价格分散试点项目，成功获批上期所云南勐腊县和海南澄迈县两个橡胶项目，其中云南省勐腊县是我司第四年在当地开展，继续巩固脱贫攻坚成果。获批郑商所陕西省黄龙县苹果新型农业主体创新项目和辽宁省花生项目。

2、商业性项目有较大突破，今年在江苏徐州、贵州赫章、新疆、黑龙江四地实施了共计 35 个商业性项目，涉及大豆、玉米、鸡蛋、生猪等品种，承保货值超 1 亿元。

3、推动江苏省政策性“保险+期货”项目落地。2022 年 6 月 28 日我司与保险公司合作在徐州和淮安落地全省首批财政补贴型生猪“保险+期货”，是江苏省首次试水“政府引导、财政补贴、市场运作”原则，推出的财政金融联动服务乡村振兴的创新模式，得到了广泛的宣传和关注。

4、利用自有资金 31.7 万元购买陕西青海、江苏宿迁等地的乡村振兴产品。

5、为更好地开展党建活动，充分发挥主观能动性，弘业期货第三党支部与中共民强村第二党支部签订共建对接协议书并开展多次共建活动。6 月初，弘业期货领导带队拜访民强村党支部，参观民强村党支部的文化建设展示墙，并与民强村党支部领导展开深入交流，了解了民强村的产业情况、村民的居住情况、乡村发展中遇到的困难、日常的党建活动情况等，公司强调：“在共建对接中，要相互启发、开拓思路，更好地了解乡村党组织所想所需，实现互帮互助。”6 月中旬，为提倡尊老爱老精神，引导员工用实际行动奉献社会，传播爱心，弘扬中华民族传统美德。在弘

业期货工会和第三党支部的支持下，淮安营业部联系结对共建党支部——中共民强村第二党支部委员会，并前往当地看望孤寡老党员。

6、公司年轻干部于 2021 年 10 月起在江苏省宿迁市泗阳县王集镇魏圩村担任基层领导，为巩固当地脱贫攻坚成果作出贡献。

（二）投身公益慈善

报告期内，为建设和谐社会尽一份心力，促进社会的公平和进步。面对新冠疫情反覆，公司积极响应社区号召，迅速组织公司志愿者支援核酸检测，组织热血青年参与献血，为疫情防控工作贡献力量，切实履行国有企业责任和使命。

1、弘业期货组织总部 30 余名员工参加无偿献血。2022 年 3 月 10 日，弘业期货干部职工严格遵守防疫要求，有序进行信息登记、血型测定、血液初筛。符合献血条件的干部职工参与了无偿献血活动，彰显了公司勇于承担社会责任的良好形象。

2、2022 年 4 月 5 日，弘业期货党员、进步青年积极报名参加核酸检测工作，在现场维持秩序、检查健康码、安排人员高效有序地参加检测。为老年人、学生、弱势群体指导绿色通道路径、查找健康码、调取核酸码，弘扬勇于担当的抗疫精神。

第六节 重要事项

一、公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内履行完毕及截至报告期末超期未履行完毕的承诺事项

适用 不适用

公司报告期不存在公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内履行完毕及截至报告期末超期未履行完毕的承诺事项。

二、控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

适用 不适用

公司报告期不存在控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金。

三、违规对外担保情况

适用 不适用

公司报告期无违规对外担保情况。

四、聘任、解聘会计师事务所情况

半年度财务报告是否已经审计

是 否

公司半年度报告未经审计。

五、董事会、监事会对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

适用 不适用

六、董事会对上年度“非标准审计报告”相关情况的说明

适用 不适用

七、破产重整相关事项

适用 不适用

公司报告期未发生破产重整相关事项。

八、诉讼事项

重大诉讼仲裁事项

适用 不适用

本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项。

其他诉讼事项

适用 不适用

诉讼(仲裁)基本情况	涉案金额(万元)	是否形成预计负债	诉讼(仲裁)进展	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况	披露日期	披露索引
<p>2017年11月3日,本公司北京营业部收到北京市东城区人民法院寄送的客户L、客户M起诉本公司北京营业部委托理财合同纠纷两案传票及有关材料。两客户分别于2005年10月、2007年4月在本公司开立期货账户。两诉状指称本公司一名前雇员向其推销理财产品,北京营业部未经客户授权擅自开展期货交易,以及将客户账户的委托理财资金转移至北京营业部账户进行违规交易,导致客户资金全部亏损。请求法院:判令本公司北京营业部返还原告理财存款分别为人民币150万元、人民币835.2495万元及利息,承担诉讼费。经初步核实,本公司及北京营业部从未与两客户签署过委托理财合同,且本公司严格遵守期货行业相关监管规定,无论是本公司还是分支机构从未开设过期货账户。</p> <p>两案分别于2017年11月21日、12月14日进行了管辖权异议谈话。2018年1月15日,本公司北京营业部收到管辖权异议的民事裁定书,两案移送至北京市第二中级人民法院(「北京二中院」)管辖。2018年11月6日,本公司北京营业部收到北京二中院的一审判决,判决驳回两客户的全部诉讼请求,案件受理费(已缴纳)、鉴定费由两原告负担。2019年12月26日,本公司北京营业部收到北京市高级人民法院的二审民事裁定书,裁定撤销一审判决,两案发回北京二中院重审。2021年4月14日,本公司北京营业部收到一审民事判决书:本公司北京营业部于本判决生效之日起十日内赔偿两原告合计人民币196.992万元,鉴定费35200元由两原告负担。2021年4月28日,本公司北京营业部向法院寄送两案上诉状,两原告也在上诉期内向法院提交了上诉状。2021年10月11日,北京市高级人民法院已对两案开庭审理,2022年4月19日,本公司北京营业部收到北京市高级人民法院作出的两案二审民事判决,判决驳回上诉,维持原判。</p> <p>2022年5月9日,本公司已依判决,在扣除案件鉴定费后,向两原告支付赔偿款193.470万元。已履行完两案生效判决确定的给付义务。</p>	196.99	否	已判决	无影响	已履行给付义务	2022年05月09日	

九、处罚及整改情况

适用 不适用

十、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

适用 不适用

十一、重大关联交易

1、与日常经营相关的关联交易

适用 不适用

公司报告期未发生与日常经营相关的关联交易。

2、资产或股权收购、出售发生的关联交易

适用 不适用

公司报告期未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

3、共同对外投资的关联交易

适用 不适用

公司报告期未发生共同对外投资的关联交易。

4、关联债权债务往来

适用 不适用

是否存在非经营性关联债权债务往来

是 否

公司报告期不存在非经营性关联债权债务往来。

5、与存在关联关系的财务公司的往来情况

适用 不适用

公司与存在关联关系的财务公司、公司控股的财务公司与关联方之间不存在存款、贷款、授信或其他金融业务。

6、公司控股的财务公司与关联方的往来情况

适用 不适用

公司控股的财务公司与关联方之间不存在存款、贷款、授信或其他金融业务。

7、其他重大关联交易

适用 不适用

公司报告期无其他重大关联交易。

十二、重大合同及其履行情况

1、托管、承包、租赁事项情况

(1) 托管情况

适用 不适用

公司报告期不存在托管情况。

(2) 承包情况

适用 不适用

公司报告期不存在承包情况。

(3) 租赁情况

适用 不适用

租赁情况说明

截至 2022 年 6 月 30 日，本公司作为承租人向关联方弘业股份租赁其拥有的南京市秦淮区弘业大厦 3-10 楼，租赁面积 10,084.99 平方米，房屋月租金为人民币 55.37 万元，2022 年上半年合计租金为人民币 332.22 万元，房屋用途为总部及办公场所。

为公司带来的损益达到公司报告期利润总额 10%以上的项目

适用 不适用

公司报告期不存在为公司带来的损益达到公司报告期利润总额 10%以上的租赁项目。

2、重大担保

适用 不适用

公司报告期不存在重大担保情况。

3、委托理财

适用 不适用

公司报告期不存在委托理财。

4、其他重大合同

适用 不适用

公司报告期不存在其他重大合同。

十三、各单项业务资格的变化情况

无

十四、其他重大事项的说明

适用 不适用

公司报告期不存在需要说明的其他重大事项。

十五、公司子公司重大事项

适用 不适用

第七节 股份变动及股东情况

一、股份变动情况

1、股份变动情况

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例
一、有限售条件股份	657,300,000	72.47%						657,300,000	72.47%
1、国家持股									
2、国有法人持股	504,475,369	55.62%						504,475,369	55.62%
3、其他内资持股	152,824,631	16.85%						152,824,631	16.85%
其中：境内法人持股	152,824,631	16.85%						152,824,631	16.85%
境内自然人持股									
4、外资持股									
其中：境外法人持股									
境外自然人持股									
二、无限售条件股份	249,700,000	27.53%						249,700,000	27.53%
1、人民币普通股									
2、境内上市的外资股									
3、境外上市的外资股	249,700,000	27.53%						249,700,000	27.53%
4、其他									
三、股份总数	907,000,000	100.00%						907,000,000	100.00%

股份变动的原因

适用 不适用

股份变动的批准情况

适用 不适用

股份变动的过户情况

适用 不适用

股份回购的实施进展情况

适用 不适用

采用集中竞价方式减持回购股份的实施进展情况

适用 不适用

股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

适用 不适用

公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

经中国证监会《关于核准弘业期货股份有限公司首次公开发行股票批复》（证监许可〔2022〕1135号）和深圳证券交易所《关于弘业期货股份有限公司人民币普通股股票上市的通知》（深证上〔2022〕756号）同意，公司首次公开发行的人民币普通股股票于2022年8月5日在深圳证券交易所主板上市，证券简称：“弘业期货”，证券代码：“001236”，本次公开发行境内上市人民币普通股100,777,778股，上市后公司总股本为1,007,777,778股。

2、限售股份变动情况

适用 不适用

二、证券发行与上市情况

适用 不适用

三、公司股东数量及持股情况

单位：股

报告期末普通股股东总数	8	报告期末表决权恢复的优先股股东总数（如有）（参见注8）	0					
持股5%以上的普通股股东或前10名普通股股东持股情况								
股东名称	股东性质	持股比例	报告期末持有的普通股数量	报告期内增减变动情况	持有有限售条件的普通股数量	持有无限售条件的普通股数量	质押、标记或冻结情况	
							股份状态	数量
苏豪控股	国有法人	30.37%	275,456,777	0	275,456,777	0		
弘业股份	国有法人	16.31%	147,900,000	0	147,900,000	0		
弘苏实业	境内非国有法人	15.83%	143,548,000	0	143,548,000	0	冻结	143,548,000
汇鸿集团	国有法人	7.05%	63,930,134	0	63,930,134	0		
上海铭大	境内非国有法人	1.02%	9,276,631	0	9,276,631	0		
弘瑞科创	国有法人	0.98%	8,903,113	0	8,903,113	0		
弘业物流	国有法人	0.91%	8,285,345	0	8,285,345	0		
香港中央结算（代理人）有限公司	境外法人	27.53%	249,700,000	0	0	249,700,000		
战略投资者或一般法人因配售新股成为前10名普通股股东的情况（如有）（参见注3）	不适用							
上述股东关联关系或一致行动的说明	内资股股东中，苏豪控股为本公司的控股股东，直接持有公司内资股275,456,777股，占公司总股本的30.37%。苏豪控股的实际控制人为江苏省国资委。除苏豪控股直接持有的股份外，苏豪控股通过其控制的弘业股份及弘业物流分别持有公司内资股147,900,000股和8,285,345股，分别占公司总股本的16.31%和0.91%。苏豪控股通							

	过弘业股份持有弘瑞科创的参股权。 汇鸿集团持有本公司内资股 63,930,134 股，占公司总股本的 7.05%。弘瑞科创持有本公司内资股 8,903,113 股，占公司总股本的 0.98%。汇鸿集团和弘瑞科创的实际控制人均为江苏省国资委。 弘苏实业和上海铭大之间以及与其他五位内资股股东之间不存在关联关系。		
上述股东涉及委托/受托表决权、放弃表决权情况的说明	不适用		
前 10 名股东中存在回购专户的特别说明（参见注 11）	不适用		
前 10 名无限售条件普通股股东持股情况			
股东名称	报告期末持有无限售条件普通股股份数量（不适用）	股份种类	
		股份种类	数量
前 10 名无限售条件普通股股东之间，以及前 10 名无限售条件普通股股东和前 10 名普通股股东之间关联关系或一致行动的说明	无		

注：弘苏实业冻结的股权已在报告期后全部解冻。

公司前 10 名普通股股东、前 10 名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

是 否

公司前 10 名普通股股东、前 10 名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

四、董事、监事和高级管理人员持股变动

适用 不适用

公司董事、监事和高级管理人员在报告期持股情况没有发生变动，具体可参见 2021 年年报。

五、控股股东或实际控制人变更情况

控股股东报告期内变更

适用 不适用

公司报告期控股股东未发生变更。

实际控制人报告期内变更

适用 不适用

公司报告期实际控制人未发生变更。

第八节 优先股相关情况

适用 不适用

报告期公司不存在优先股。

第九节 债券相关情况

适用 不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

半年度报告是否经过审计

是 否

公司半年度财务报告未经审计。

二、财务报表

财务附注中报表的单位为：元

1、合并资产负债表

编制单位：弘业期货股份有限公司

2022 年 06 月 30 日

单位：元

项目	2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日
资产：		
货币资金	7,536,812,255.03	4,143,641,973.33
其中：客户资金存款		
期货保证金存款	7,244,452,355.04	3,959,706,206.55
结算备付金		
其中：客户备付金		
贵金属		
拆出资金		
融出资金		
应收货币保证金	2,504,259,046.74	2,025,860,140.16
应收质押保证金	991,770,498.40	668,817,393.60
应收结算担保金	20,000,000.00	20,000,000.00
衍生金融资产	9,871,158.50	465,835.77
存出保证金		
应收款项		
应收款项融资		
合同资产		
其他应收款	44,345,072.41	24,951,725.11
存货	48,686,145.22	9,531.74
买入返售金融资产	0.00	6,719,000.00
持有待售资产		
金融投资：	846,829,186.47	840,419,634.46
交易性金融资产	846,829,186.47	840,419,634.46
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资	8,203,412.73	7,036,127.76
期货会员资格投资	1,827,595.00	1,808,800.00
投资性房地产		
固定资产	12,980,627.29	14,899,414.00
在建工程	274,716,656.66	0.00
使用权资产	32,900,612.87	24,655,989.58
无形资产	752,789.54	1,025,204.63
商誉		
递延所得税资产	7,547,290.85	7,394,041.07
其他资产	24,615,340.54	295,396,263.71
资产总计	12,366,117,688.25	8,083,101,074.92
负债：		
短期借款		
应付货币保证金	9,036,416,322.74	5,261,811,881.42
应付质押保证金	974,938,338.40	668,817,393.60
应付短期融资款		
拆入资金		
交易性金融负债	114,652,344.11	86,471,254.16
衍生金融负债	15,899,936.78	1,514,054.34

卖出回购金融资产款	48,051,155.15	32,625,838.11
代理买卖证券款		
代理承销证券款		
期货风险准备金	157,119,049.72	151,215,411.17
应付期货投资者保障基金	198,232.66	522,926.88
应付职工薪酬	577,259.68	20,659,015.94
应交税费	8,498,830.47	6,015,879.24
应付款项		
合同负债	716,855.00	1,000,000.00
其他应付款	149,517,825.37	26,281,420.68
持有待售负债		
预计负债		1,969,920.97
长期借款	103,175,661.98	117,197,967.93
应付债券		
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	33,245,922.67	24,831,103.80
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计	10,643,007,734.73	6,400,934,068.24
所有者权益：		
股本	907,000,000.00	907,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积	537,826,419.52	537,826,419.52
减：库存股		
其他综合收益	-1,697,145.94	-7,385,168.45
盈余公积	66,606,194.62	66,606,194.62
一般风险准备	92,485,771.99	92,485,771.99
未分配利润	120,888,713.33	85,633,789.00
归属于母公司所有者权益合计	1,723,109,953.52	1,682,167,006.68
少数股东权益		
所有者权益合计	1,723,109,953.52	1,682,167,006.68
负债和所有者权益总计	12,366,117,688.25	8,083,101,074.92

法定代表人：周剑秋

主管会计工作负责人：周剑秋

会计机构负责人：陈蓉平

2、母公司资产负债表

单位：元

项目	2022年6月30日	2022年1月1日
资产：		
货币资金	7,402,710,712.48	4,038,043,781.83
其中：客户资金存款		
期货保证金存款	7,175,010,387.08	3,933,237,738.95
结算备付金		
其中：客户备付金		
贵金属		
拆出资金		
融出资金		
应收货币保证金	2,429,978,032.42	1,963,110,837.41
应收质押保证金	991,770,498.40	668,817,393.60
应收结算担保金	20,000,000.00	20,000,000.00
衍生金融资产		

存出保证金		
应收款项		
应收款项融资		
合同资产		
其他应收款	29,993,981.69	12,925,889.39
买入返售金融资产	0.00	6,719,000.00
持有待售资产		
金融投资：	631,557,699.90	672,947,193.56
交易性金融资产	631,557,699.90	672,947,193.56
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资	554,445,492.54	553,278,207.57
投资性房地产		
期货会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00
固定资产	12,747,329.98	14,621,800.48
在建工程	231,343,101.49	
使用权资产	32,138,068.48	23,052,131.01
无形资产	239,675.54	534,644.63
商誉		
递延所得税资产	2,039,760.12	4,412,785.28
其他资产	14,514,704.98	245,798,360.21
资产总计	12,354,879,058.02	8,225,662,024.97
负债：		
短期借款		
应付货币保证金	9,271,950,434.45	5,510,697,950.46
应付质押保证金	991,770,498.40	668,817,393.60
应付短期融资款		
拆入资金		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款	33,703,953.43	32,625,838.11
期货风险准备金	157,119,049.72	151,215,411.17
应付期货投资者保障基金	198,232.66	522,926.88
代理买卖证券款		
代理承销证券款		
应付职工薪酬	542,208.00	20,160,381.89
应交税费	8,394,845.54	4,763,065.21
应付款项		
合同负债		
其他应付款	41,083,539.63	19,411,278.81
持有待售负债		
预计负债		1,969,920.97
长期借款	86,039,261.78	97,775,228.50
应付债券		
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	32,472,266.14	23,223,933.96
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计	10,623,274,289.75	6,531,183,329.56
所有者权益：		
股本	907,000,000.00	907,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		

永续债		
资本公积	531,424,379.33	531,424,379.33
减：库存股		
其他综合收益	49.45	70.39
盈余公积	66,606,194.62	66,606,194.62
一般风险准备	92,485,771.99	92,485,771.99
未分配利润	134,088,372.88	96,962,279.08
所有者权益合计	1,731,604,768.27	1,694,478,695.41
负债和所有者权益总计	12,354,879,058.02	8,225,662,024.97

3、合并利润表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入	754,744,074.16	777,776,964.49
利息净收入	49,213,667.55	38,426,229.11
利息收入	49,581,948.23	38,874,154.41
利息支出	368,280.68	447,925.30
手续费及佣金净收入	145,949,979.25	141,345,295.32
其中：经纪业务手续费净收入	141,509,969.37	135,117,839.40
投资银行业务手续费净收入		
资产管理业务手续费净收入	4,440,009.88	6,227,455.92
投资收益（损失以“-”列示）	-25,663,806.86	323,058.74
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	1,167,305.91	13,221.42
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	324,275.54	3,178,866.31
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	-5,624,500.99	7,428,358.37
汇兑收益（损失以“-”列示）	2,639,036.48	-979,760.16
其他业务收入	587,924,746.06	588,187,600.92
资产处置收益（损失以“-”号填列）	-19,322.87	-132,684.12
二、营业总支出	709,013,880.94	715,590,657.22
税金及附加	1,042,700.01	1,188,411.77
提取期货风险准备金	5,903,638.55	5,421,203.27
业务及管理费	113,862,622.92	128,550,214.97
资产减值损失		
信用减值损失	373,276.78	-681,117.57
其他资产减值损失		
其他业务成本	587,831,642.68	581,111,944.78
三、营业利润（亏损以“-”列示）	45,730,193.22	62,186,307.27
加：营业外收入	337,404.53	538,581.07
减：营业外支出	32,618.26	2,298,991.62
四、利润总额（亏损总额以“-”列示）	46,034,979.49	60,425,896.72
减：所得税费用	10,780,055.16	15,124,459.03
五、净利润（净亏损以“-”列示）	35,254,924.33	45,301,437.69
（一）按经营持续性分类		
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	35,254,924.33	45,301,437.69
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		

“—”号填列)		
(二) 按所有权归属分类		
1. 归属于母公司所有者的净利润	35,254,924.33	45,301,437.69
2. 少数股东损益		
六、其他综合收益的税后净额	5,688,022.51	-1,710,504.14
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	5,688,022.51	-1,710,504.14
(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	5,688,022.51	-1,710,504.14
1. 权益法下可转损益的其他综合收益	-20.94	-8.76
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	5,688,043.45	-1,710,495.38
7. 其他		
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		
七、综合收益总额	40,942,946.84	43,590,933.55
其中：归属于母公司所有者（或股东）的综合收益总额	40,942,946.84	43,590,933.55
归属于少数股东的综合收益总额		
八、每股收益		
(一) 基本每股收益	0.0389	0.0499
(二) 稀释每股收益	0.0389	0.0499

本期发生同一控制下企业合并的，被合并方在合并前实现的净利润为：0.00 元，上期被合并方实现的净利润为：0.00 元。

法定代表人：周剑秋

主管会计工作负责人：周剑秋

会计机构负责人：陈蓉平

4、母公司利润表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入	156,012,463.06	175,811,469.97
利息净收入	49,714,441.42	37,993,960.96
利息收入	50,082,722.10	38,441,886.26
利息支出	368,280.68	447,925.30
手续费及佣金净收入	123,374,767.45	115,015,811.60
其中：经纪业务手续费净收入	118,091,219.18	108,465,997.42
投资银行业务手续费净收入		
资产管理业务手续费净收入	5,283,548.27	6,549,814.18
投资收益（损失以“—”列示）	-7,690,891.63	15,614,594.83
其中：对联营企业和合营企业的	1,167,305.91	13,221.42

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	316,317.33	555,461.35
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	-12,425,534.61	7,027,445.75
汇兑收益（损失以“-”列示）	2,544,107.90	-806,764.23
其他业务收入	198,578.07	543,643.83
资产处置收益（损失以“-”号填列）	-19,322.87	-132,684.12
二、营业总支出	106,237,019.65	118,132,582.35
税金及附加	824,792.72	743,169.53
提取期货风险准备金	5,903,638.55	5,421,203.27
业务及管理费	99,645,495.02	111,910,297.75
资产减值损失		
信用减值损失	-136,906.64	57,911.80
其他资产减值损失		
其他业务成本		
三、营业利润（损失以“-”列示）	49,775,443.41	57,678,887.62
加：营业外收入	161,791.34	458,603.74
减：营业外支出	32,618.26	2,248,991.62
四、利润总额（损失以“-”列示）	49,904,616.49	55,888,499.74
减：所得税费用	12,778,522.69	13,360,280.36
五、净利润（损失以“-”列示）	37,126,093.80	42,528,219.38
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	37,126,093.80	42,528,219.38
（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	-20.94	-8.76
（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	-20.94	-8.76
1. 权益法下可转损益的其他综合收益	-20.94	-8.76
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	37,126,072.86	42,528,210.62
八、每股收益		
（一）基本每股收益	0.0409	0.0469

(二) 稀释每股收益	0.0409	0.0469
------------	--------	--------

5、合并现金流量表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、经营活动产生的现金流量：		
销售商品、提供劳务收到的现金	662,135,937.32	665,802,761.18
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	199,102,862.70	174,878,552.48
应收货币保证金及应收质押保证金净减少额		
应付货币保证金及应付质押保证金净增加额	4,080,725,386.12	799,044,697.25
使用受限制的货币资金净减少额	3,415,408.35	
原始到期日三个月以上的定期存款净减少额		
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		
代理买卖证券收到的现金净额		
收到其他与经营活动有关的现金	130,629,936.66	93,209,010.57
经营活动现金流入小计	5,076,009,531.15	1,732,935,021.48
为交易目的而持有的金融资产净增加额		
拆出资金净增加额		
返售业务资金净增加额		
购买商品、接受劳务支付的现金	716,776,316.16	657,523,377.30
支付利息、手续费及佣金的现金	66,382.48	253,767.14
应收货币保证金及应收质押保证金净增加额	801,958,943.57	550,357,012.52
应付货币保证金及应付质押保证金净减少额		
处置风险管理业务相关金融资产净减少额	2,019,294.62	12,580,011.74
使用受限制的货币资金净增加额		13,547,483.10
支付给职工及为职工支付的现金	96,506,477.77	92,120,423.38
以现金支付的业务及管理费	21,183,992.34	15,082,227.04
支付的各项税费	13,747,236.01	35,993,271.36
支付其他与经营活动有关的现金	36,921,936.72	66,566,387.57
经营活动现金流出小计	1,689,180,579.67	1,444,023,961.15
经营活动产生的现金流量净额	3,386,828,951.48	288,911,060.33
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资所收到的现金	2,976,374,132.75	1,503,951,603.66
取得投资收益收到的现金	209,980.32	151,070.08
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	442.48	8,970.15
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	2,976,584,555.55	1,504,111,643.89
投资支付的现金	3,006,193,978.64	1,554,147,676.20
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	13,870,545.31	238,644,868.25
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	3,020,064,523.95	1,792,792,544.45
投资活动产生的现金流量净额	-43,479,968.40	-288,680,900.56
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金		
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		
取得借款收到的现金		149,497,972.00
卖出回购业务收到的现金净额	15,070,989.79	
发行债券收到的现金		
收到其他与筹资活动有关的现金	50,000,000.00	50,000,000.00
筹资活动现金流入小计	65,070,989.79	199,497,972.00
偿还债务支付的现金	13,335,484.00	10,995,430.00
偿还租赁负债本金和利息支付的现金	8,304,740.22	7,412,749.91
卖出回购业务支付的现金净额		2,327,824.39
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	3,149,720.80	47,061,676.08
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	340,566.04	754,716.98
筹资活动现金流出小计	25,130,511.06	68,552,397.36
筹资活动产生的现金流量净额	39,940,478.73	130,945,574.64
四、汇率变动对现金的影响	9,709,147.85	-2,508,868.81
五、现金及现金等价物净增加额	3,392,998,609.66	128,666,865.60
加：期初现金及现金等价物余额	4,106,185,249.67	2,854,855,864.32
六、期末现金及现金等价物余额	7,499,183,859.33	2,983,522,729.92

6、母公司现金流量表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、经营活动产生的现金流量：		
销售商品、提供劳务收到的现金		
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	191,887,026.29	148,116,800.61
应收货币保证金及应收质押保证金净减少额		
应付货币保证金及应付质押保证金净增加额	4,084,205,588.79	810,909,252.76
使用受限制的货币资金净减少额	576,828.77	
原始到期日三个月以上的定期存款净减少额		
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		
代理买卖证券收到的现金净额		
收到其他与经营活动有关的现金	46,254,489.61	2,859,682.25
经营活动现金流入小计	4,322,923,933.46	961,885,735.62
为交易目的而持有的金融资产净增加额		
拆出资金净增加额		
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	66,382.48	253,767.14
应收货币保证金及应收质押保证金净增加额	789,820,299.81	555,117,053.99
应付货币保证金及应付质押保证金净减少额		

处置风险管理业务相关金融资产净减少额		
使用受限制的货币资金净增加额		8,915,463.59
支付给职工及为职工支付的现金	88,157,520.17	80,553,248.87
以现金支付的业务及管理费	17,329,920.68	11,740,769.38
支付的各项税费	30,407,631.25	34,833,720.79
支付其他与经营活动有关的现金	34,312,896.91	41,310,616.96
经营活动现金流出小计	960,094,651.30	732,724,640.72
经营活动产生的现金流量净额	3,362,829,282.16	229,161,094.90
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资所收到的现金	2,964,817,252.30	1,477,734,658.10
取得投资收益收到的现金	209,980.32	6,744,955.77
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	442.48	8,970.15
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	2,965,027,675.10	1,484,488,584.02
投资支付的现金	2,937,992,490.79	1,487,009,361.30
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	11,521,926.49	192,990,062.09
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	2,949,514,417.28	1,679,999,423.39
投资活动产生的现金流量净额	15,513,257.82	-195,510,839.37
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		117,037,680.00
卖出回购业务收到的现金净额	723,788.07	
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	723,788.07	117,037,680.00
偿还债务支付的现金	11,703,768.00	7,802,512.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,084,733.69	47,061,676.08
偿还租赁负债本金和利息支付的现金	6,075,632.59	6,554,785.78
卖出回购业务支付的现金净额		705,620.11
支付其他与筹资活动有关的现金	89,622.64	754,716.98
筹资活动现金流出小计	19,953,756.92	62,879,310.95
筹资活动产生的现金流量净额	-19,229,968.85	54,158,369.05
四、汇率变动对现金的影响	2,544,107.90	-626,278.96
五、现金及现金等价物净增加额	3,361,656,679.03	87,182,345.62
加：期初现金及现金等价物余额	4,004,872,501.63	2,794,025,651.56
六、期末现金及现金等价物余额	7,366,529,180.66	2,881,207,997.18

7、合并所有者权益变动表

本期金额

单位：元

项目	2022 年半年度											
	归属于母公司所有者权益										少数 股东 权益	所有 者权 益合 计
	股本	其他权益工具			资本 公积	减： 库存 股	其他 综合 收益	盈余 公积	一般 风险 准备	未分 配利 润		
	优先 股	永续 债	其他									
一、上年期末	907,0				537,8		-	66,60	92,48	85,63		1,682

末余额	00,00 0.00				26,41 9.52		7,385 ,168. 45	6,194 .62	5,771 .99	3,789 .00		,167, 006.6 8
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	907,0 00,00 0.00				537,8 26,41 9.52		- 7,385 ,168. 45	66,60 6,194 .62	92,48 5,771 .99	85,63 3,789 .00		1,682 ,167, 006.6 8
三、本期增减变动金额 (减少以 “-”号填 列)							5,688 ,022. 51			35,25 4,924 .33		40,94 2,946 .84
(一) 综合 收益总额							5,688 ,022. 51			35,25 4,924 .33		40,94 2,946 .84
(二) 所有者投入和减少资本												
1. 所有者投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
(三) 利润分配												
1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准备												
3. 对所有者(或股东)的分配												
4. 其他												
(四) 所有者权益内部												

结转												
1. 资本公积转增资本(或股本)												
2. 盈余公积转增资本(或股本)												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
四、本期末余额	907,000,000.00				537,826,419.52		-1,697,145.94	66,606,194.62	92,485,771.99	120,888,713.33		1,723,109,953.52

上年金额

单位：元

项目	2021 年半年度											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	907,000,000.00				533,124,529.52		-3,692,964.07	58,426,314.46	84,305,891.83	67,503,955.76		1,646,667,727.50
加：会计政策变更							371,877.91			-371,877.91		
前期差错更正												
其他												
二、本年初余额	907,000,000.00				533,124,529.52		-3,321,086.16	58,426,314.46	84,305,891.83	67,132,077.85		1,646,667,727.50
三、本期增减变动金额(减少以“—”号填列)							-1,710,504.14			-48,562.31		-1,759,066.45

(一) 综合收益总额							- 1,710, 504. 14			45,30 1,437 .69		43,59 0,933 .55
(二) 所有者投入和减少资本												
1. 所有者投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
(三) 利润分配										- 45,35 0,000 .00		- 45,35 0,000 .00
1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准备												
3. 对所有者(或股东)的分配										- 45,35 0,000 .00		- 45,35 0,000 .00
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本(或股本)												
2. 盈余公积转增资本(或股本)												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												

5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
四、本期期末余额	907,000,000.00				533,124,529.52		-5,031,590.30	58,426,314.46	84,305,891.83	67,083,515.54		1,644,908,661.05

8、母公司所有者权益变动表

本期金额

单位：元

项目	2022 年半年度										
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	907,000,000.00				531,424,379.33		70.39	66,606,194.62	92,485,771.99	96,962,279.08	1,694,478,695.41
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	907,000,000.00				531,424,379.33		70.39	66,606,194.62	92,485,771.99	96,962,279.08	1,694,478,695.41
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）							-20.94			37,126,093.80	37,126,072.86
（一）综合收益总额							-20.94			37,126,093.80	37,126,072.86
（二）所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											

4. 其他											
(三) 利润分配											
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											
3. 对所有者(或股东)的分配											
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本(或股本)											
2. 盈余公积转增资本(或股本)											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
四、本期期末余额	907,000,000.00				531,424,379.33	49.45	66,606,194.62	92,485,771.99	134,088,372.88	1,731,604,768.27	

上年金额

单位：元

项目	2021 年半年度										
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	907,000,000.00				526,722,489.33		-371,801.28	58,426,314.46	84,305,891.83	77,245,115.75	1,653,328,010.09
加：会							371,87			-	

计政策变更						7.91			371,877.91	
前期差错更正										
其他										
二、本年期初余额	907,000,000.00				526,722,489.33	76.63	58,426,314.46	84,305,891.83	76,873,237.84	1,653,328,010.09
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）						-8.76			-2,821,780.62	-2,821,789.38
（一）综合收益总额						-8.76			42,528,219.38	42,528,210.62
（二）所有者投入和减少资本										
1. 所有者投入的普通股										
2. 其他权益工具持有者投入资本										
3. 股份支付计入所有者权益的金额										
4. 其他										
（三）利润分配									-45,350,000.00	-45,350,000.00
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备										
3. 对所有者（或股东）的分配									-45,350,000.00	-45,350,000.00
4. 其他										
（四）所有者权益内部结转										
1. 资本公积转增										

资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
四、本期期末余额	907,000,000.00				526,722,489.33	67.87	58,426,314.46	84,305,891.83	74,051,457.22	1,650,506,220.71	

三、公司基本情况

弘业期货股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”，在包含子公司时统称“本集团”）是一家注册于南京市中华路 50 号的股份有限公司，注册资本人民币 9.07 亿元，法定代表人：周剑秋。公司统一社会信用代码为 91320000100022362N，经营期货业务许可证号为 30870000。本公司前身为成立于 1995 年 7 月的“江苏金陵期货经纪有限公司”。

1999 年 12 月，本公司名称变更为“江苏弘业期货经纪有限公司”（以下简称“有限公司”）由原江苏金陵期货有限公司于 1999 年 12 月 14 日更名而来，原注册资本人民币 3,000 万元，其中江苏弘业股份有限公司（原江苏省工艺品进出口集团股份有限公司）出资人民币 2,820 万元，占注册资本的 94%；江苏弘业国际物流有限公司（原江苏鹏程国际储运有限公司）出资人民币 180 万元，占注册资本的 6%。

2001 年根据有限公司股东会决议及有关股权转让协议，江苏弘业股份有限公司将其持有有限公司 48% 的股权转让给江苏弘业国际集团投资管理有限公司。股权转让后，江苏弘业国际集团投资管理有限公司出资人民币 1,440 万元，占注册资本的 48%；江苏弘业股份有限公司出资人民币 1,380 万元，占注册资本的 46%；江苏弘业国际物流有限公司出资人民币 180 万元，占注册资本的 6%。

2006 年，经有限公司股东会决议同意，以未分配利润转增实收资本人民币 800 万元，注册资本变更为人民币 3,800 万元，其中，江苏弘业国际集团投资管理有限公司出资人民币 1,824 万元，占注册资本的 48%；江苏弘业股份有限公司出资人民币 1,748 万元，占注册资本的 46%；江苏弘业国际物流有限公司出资人民币 228 万元，占注册资本的 6%。

2007 年，经本公司股东会决议同意，增加注册资本人民币 1,200 万元，注册资本变更为人民币 5,000 万元，其中，江苏弘业国际集团投资管理有限公司出资人民币 2,143.50 万元，占注册资本的 42.87%；江苏弘业股份有限公司出资人民币 2,143.50 万元，占注册资本的 42.87%；江苏弘业国际物流有限公司出资人民币 228 万元，占注册资本的 4.56%；江苏弘瑞科技创业投资有限公司出资人民币 245 万元，占注册资本的 4.90%；上海铭大实业（集团）有限公司出资人民币 240 万元，占注册资本的 4.80%。

2008 年，经有限公司股东会决议同意，增加注册资本人民币 5,800 万元，注册资本变更为人民币 10,800 万元，各股东投资比例不变。

2009 年，经有限公司股东会决议同意，增加注册资本人民币 3,000 万元，注册资本变更为人民币 13,800 万元，其中，江苏弘业国际集团投资管理有限公司出资人民币 6,129.96 万元，占注册资本的 44.42%；江苏弘业股份有限公司出

资人民币 6,129.96 万元，占注册资本的 44.42%；江苏弘业国际物流有限公司出资人民币 492.48 万元，占注册资本的 3.57%；江苏弘瑞科技创业投资有限公司出资人民币 529.20 万元，占注册资本的 3.83%；上海铭大实业（集团）有限公司出资人民币 518.40 万元，占注册资本的 3.76%。

2011 年 4 月 25 日，经有限公司股东会决议同意，增加注册资本人民币 24,200 万元，注册资本变更为人民币 38,000 万元。其中，江苏弘业国际集团投资管理有限公司出资人民币 8,265.00 万元，占注册资本的 21.75%；江苏弘业股份有限公司出资人民币 8,265.00 万元，占注册资本的 21.75%；江苏弘业国际物流有限公司出资人民币 492.48 万元，占注册资本的 1.30%；江苏弘瑞科技创业投资有限公司出资人民币 529.20 万元，占注册资本的 1.39%；上海铭大实业（集团）有限公司出资人民币 518.40 万元，占注册资本的 1.36%；江苏省苏豪控股集团有限公司（以下简称“苏豪控股”）（原江苏省丝绸集团有限公司）出资人民币 8,108.12 万元，占注册资本的 21.34%；江苏弘苏实业有限公司出资人民币 8,021.80 万元，占注册资本的 21.11%；江苏汇鸿国际集团有限公司出资人民币 3,800.00 万元，占注册资本的 10.00%。

2012 年 8 月 20 日，经江苏省人民政府国有资产监督管理委员会苏国资复[2012]78 号《关于同意变更江苏弘业期货有限公司部分国有股权持有人的批复》同意，将江苏弘业国际集团投资管理有限公司持有有限公司 21.75% 的股权变更为由苏豪控股持有，有限公司于 2012 年 11 月 21 日办理了工商变更登记手续，变更后苏豪控股持有有限公司 43.09% 股份。

2012 年 11 月，有限公司股东共同签署《关于整体变更设立弘业期货股份有限公司的发起人协议》，将有限公司整体变更为弘业期货股份有限公司。根据发起人协议的约定，有限公司股东以经审计的净资产并经相应调整后折合股本人民币 680,000,000.00 元，股份总额为 680,000,000 股，每股面值为人民币 1 元，均为普通股，剩余净资产值超过股本总额的部分人民币 350,124,231.10 元计入公司的“资本公积—股本溢价”。

整体变更后公司股本为 680,000,000 股，其中：苏豪控股持有 292,992,674 股，占总股本的 43.09%；江苏弘业股份有限公司持有 147,900,000 股，占总股本的 21.75%；江苏弘苏实业有限公司持有 143,548,000 股，占总股本的 21.11%；江苏汇鸿国际集团有限公司持有 68,000,000 股，占总股本的 10.00%；江苏弘瑞科技创业投资有限公司持有 9,469,895 股，占总股本的 1.39%；上海铭大实业（集团）有限公司持有 9,276,631 股，占总股本的 1.36%；江苏弘业国际物流有限公司持有 8,812,800 股，占总股本的 1.30%。

2015 年 8 月 18 日，经中国证监会《关于核准弘业期货股份有限公司发行境外上市外资股的批复》（证监许可[2015]1963 号）核准，公司发行不超过 26,105 万股境外上市外资股，每股面值人民币 1 元，全部为普通股。2015 年 12 月 31 日，公司境外发行股份在香港联交所主板上市，股票简称：弘业期货，股票代码：03678，根据国务院国有资产监督管理委员会《关于弘业期货股份有限公司国有股转持有关问题的批复》（国资产权[2015]411 号），在本公司完成该次发行后，国有股东苏豪控股、江苏汇鸿国际集团股份有限公司、江苏弘瑞科技创业投资有限公司和江苏弘业国际物流有限公司将其持有的部分股份划转给全国社会保障基金理事会持有，合计 22,700,000 股。本公司全球公开发售 H 股股份（其中包括国有股减持部分）249,700,000 股，股票面值为人民币 1 元，发行价格为每股港币 2.43 元，共募集资金港币 6.07 亿元。上市后公司总股本为 907,000,000 股，其中：H 股股东合计持有 249,700,000 股，占总股本的 27.53%。

本公司的总部设于南京，截至 2022 年 6 月 30 日止，本公司在全国共设有 6 家分公司和 39 家营业部。本公司的经营范围：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

公司合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。

详见本节“八、合并范围的变更”及“九、在其他主体中的权益”相关内容。

四、财务报表的编制基础

1、编制基础

本集团财务报表以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则》及相关规定，并基于本节“五、重要会计政策及会计估计”所述会计政策和会计估计编制。

2、持续经营

本集团自本报告期末至少 12 个月内具备持续经营能力，无影响持续经营能力的重大事项。

五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

本公司根据企业会计准则和公司实际生产经营特点，针对固定资产折旧、无形资产摊销、收入确认和资产减值等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

1、遵循企业会计准则的声明

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

2、会计期间

本集团的会计期间为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

3、营业周期

本集团以 12 个月为营业周期，营业周期起止日为 1 月 1 日至 12 月 31 日。

4、记账本位币

本公司的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及本集团子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本集团的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币，在编制本财务报表时，这些子公司的外币财务报表按照本节“五、9、外币业务和外币报表折算”进行了折算。

5、同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

（1）同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制，且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。

公司在同一控制下的企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额计量，取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

公司为同一控制下的企业合并发生的审计评估费、法律咨询费等各项直接相关费用，于发生时计入当期损益。为企业合并发行的债券或承担其他债务支付的手续费、佣金等，计入所发行债券及其他债务的初始计量金额。企业合并中发行权益性证券发生的手续费、佣金等费用，抵减权益性证券溢价收入，溢价收入不足冲减的，冲减留存收益。

同一控制下的企业合并形成母子公司关系的，公司编制合并日的合并资产负债表、合并利润表和合并现金流量表。因被合并方采用的会计政策与公司不一致的，在合并日按照公司会计政策对被合并方的财务报表相关项目进行调整，以调整后的账面价值计量。合并利润表包括参与合并各方自合并当期期初至合并日所发生的收入、费用和利润。被合并方在合并前实现的净利润，在合并利润表中单列项目反映。合并现金流量表包括参与合并各方自合并当期期初至合并日的现金流量。

（2）非同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制，为非同一控制下的企业合并。

非同一控制下的企业合并下，公司在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量，公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。

公司为非同一控制下的企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

非同一控制下的企业合并形成母子公司关系的，公司设置备查簿，记录企业合并中取得的子公司各项可辨认资产、负债及或有负债等在购买日的公允价值。编制合并财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整。

6、合并财务报表的编制方法

(1) 合并范围的确定原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。

(2) 合并财务报表所采用的会计方法

本集团合并财务报表按照《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》及相关规定的要求编制，合并时合并范围内的所有重大内部交易和往来业务已抵销。子公司的股东权益中不属于母公司所拥有的部分作为“少数股东权益”在合并财务报表中股东权益项下单独列示。子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股东损益”项目列示。少数股东分担的子公司的亏损超过了少数股东在该子公司期初股东权益中所享有的份额，其余额仍冲减少数股东权益。

子公司与本公司采用的会计政策不一致的，在编制合并财务报表时，按照本公司的会计政策对子公司财务报表进行必要的调整。

对于非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其个别财务报表进行调整；对于同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，视同合并后形成的报告主体自最终控制方开始实施控制时一直是一体化存续下来的，对合并资产负债表的期初数进行调整，同时对比较报表的相关项目进行调整。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为权益性交易核算，调整归属于母公司股东权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允价值之间的差额调整资本公积，资本公积不足冲减的，调整留存收益。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，剩余股权按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原子公司自购买日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益，在丧失控制权时转为当期投资收益。

7、合营安排分类及共同经营会计处理方法

不适用

8、现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9、外币业务和外币报表折算

公司对外币业务采用分账制进行核算。外币业务发生时，分别不同的币种按照原币记账。资产负债表日，分别外币货币性项目和外币非货币性项目进行处理：外币货币性项目按资产负债表日即期汇率（中国人民银行公布的人民币汇率中间价）折算，外币非货币性项目按交易日即期汇率折算，产生的汇兑差额计入当期损益。

对于境外经营，本集团在编制财务报表时将其记账本位币折算为人民币，折算方法为：资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算。产生的差额作为未实现汇兑损益确认为其他综合收益并在合并报表所有者权益项目下单独列示。

10、营业部的资金管理、交易清算原则

本公司的营业部资金由总部统一调拨，营业部客户的交易由总部统一结算，营业部按规定做好交易定单、结算单的客户确认工作。

11、客户期货保证金

（1）客户期货保证金的分类

本公司的客户期货保证金包括货币保证金和质押保证金。货币保证金系本公司代理客户交易收到货币形式的期货保证金，质押保证金系本公司代理客户交易收到的有价证券，该有价证券用于冲抵期货保证金。

（2）客户期货保证金的管理

本公司客户期货保证金采取专户存放、定向划转、封闭运行的管理办法，与自有资金严格分离。

本公司对客户期货保证金实行独立建档，每日无负债结算。根据逐日盯市制度对客户期货交易盈亏进行结算；根据与客户约定的手续费标准及客户当日成交量（或成交额）计算交易手续费。

（3）客户期货保证金的核算

1) 客户货币保证金

本公司接受客户委托收到货币保证金并存入指定银行账户时，本公司确认为货币资金及应付货币保证金。当本公司接受客户委托代理进行期货交易时，本公司确认期货交易所核定的应收货币保证金，并相应减少货币资金。本公司代理与客户进行清算时，如客户当日的期货合约实现盈利，按期货结算机构结算单据列明的盈利金额扣减应向客户收取的佣金后，增加应收货币保证金及应付货币保证金；如客户当日的期货合约发生亏损，按期货结算机构结算单据列明的亏损金额加应向客户收取的佣金后减少应收货币保证金及应付货币保证金。

2) 客户质押保证金

本公司接受客户委托向期货交易所提交有价证券办理充抵保证金业务时，按期货交易所核定的充抵保证金金额确认应收质押保证金及应付质押保证金。本公司接受客户委托通过期货交易所代理交易时，其会计处理与客户货币保证金相同。有价证券价值发生增减变化时，期货交易所相应调整核定的充抵保证金金额，本公司按调整增减数相应增减应收质押保证金及应付质押保证金。当期货交易所将有价证券退还给客户时，本公司按期货交易所核定的充抵保证金金额，相应减少应收质押保证金及应付质押保证金。

12、质押品的管理

本公司接受的质押品为交易所注册的标准仓单。本公司对客户交存的质押品按照期货交易所的规定及时办理质押手续。在客户发生损失而客户不能及时追加保证金时，本公司按协议规定强制平仓，并依法处置质押品，其处置质押品所得收入，用以弥补损失后，多余部分归还客户。

13、实物交割的核算方法

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

14、存货

存货包括大宗商品现货，按成本进行初始计量。存货成本包括采购成本和使存货达到目前场所和状态所发生的其他支出。发出存货的实际成本采用先进先出法计量。

资产负债表日，存货按照成本与可变现净值孰低计量。可变现净值，是指在日常活动中，存货的估计售价减去估计的销售费用以及相关税费后的金额。为执行销售合同或者劳务合同而持有的存货，其可变现净值以合同价格为基础计算。当持有存货的数量多于相关合同订购数量的，超出部分的存货的可变现净值以一般销售价格为基础计算。按单个存货项目计算的成本高于其可变现净值的差额，计提存货跌价准备，计入当期损益。

本集团存货盘存制度为永续盘存制。

15、金融工具

本集团的金融工具包括货币资金、应收货币保证金、交易性金融资产、衍生金融资产、买入返售金融资产、应收款项、其他应收款、应付货币保证金、应付期货投资者保障基金、交易性金融负债、衍生金融负债、应付职工薪酬、其他应付款及股本等。

(1) 金融资产及金融负债的确认和初始计量

金融资产和金融负债在本集团成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

除不具有重大融资成分的应收账款外，在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于不具有重大融资成分的应收账款，本集团根据本节“五、45、收入”的会计政策确定的交易价格进行初始计量。

(2) 金融资产的分类和后续计量

1) 本集团金融资产的分类

本集团通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除非本集团改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本集团将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- ①本集团管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本集团将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：

- ①本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本集团可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本集团将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本集团

可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本集团如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集团所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集团以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本集团对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本集团对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

2) 本集团金融资产的后续计量

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

②以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

③以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

④以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。股利收入计入损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(3) 金融负债的分类和后续计量

本集团将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

②以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对其他金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(4) 抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- ①本集团具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- ②本集团计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(5) 金融资产和金融负债的终止确认

满足下列条件之一时，本集团终止确认该金融资产：

- ①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- ②该金融资产已转移，且本集团将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- ③该金融资产已转移，虽然本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制。

金融资产转移整体满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

①被转移金融资产在终止确认日的账面价值；

②因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资）之和。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本集团终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（6）减值

本集团以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

①以摊余成本计量的金融资产；

②以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资。

本集团持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型，包括以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资或权益工具投资，指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资，以及衍生金融资产。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集团按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

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

对于应收账款，本集团始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。本集团基于历史信用损失经验、使用准备矩阵计算上述金融资产的预期信用损失，相关历史经验根据资产负债表日借款人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

除应收账款，本集团对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

①该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

②该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，并且即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

本集团通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本集团考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本集团考虑的信息包括：

①债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；

②已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级（如有）的严重恶化；

③已发生的或预期的债务人经营成果的严重恶化；

④现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本集团的还款能力产生重大不利影响。

根据金融工具的性质，本集团以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本集团可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。

本集团认为金融资产在下列情况发生违约：

①交易对手方不大可能全额支付其对本集团的欠款，该评估不考虑本集团采取例如变现抵押品（如果持有）等追索行动；或

②金融资产逾期超过 90 天。

本集团在资产负债表日评估以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资是否已发生信用减值。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- ①发行方或债务人发生重大财务困难；
- ②债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- ③本集团出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- ④债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- ⑤发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本集团在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，本集团在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

如果本集团不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本集团确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本集团催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

16、除存货及金融资产外的其他资产减值

本集团在资产负债表日根据内部及外部信息以确定下列资产是否存在减值的迹象，包括：

- ①固定资产
- ②使用权资产
- ③无形资产
- ④商誉
- ⑤长期股权投资等

本集团对存在减值迹象的资产进行减值测试，估计资产的可收回金额。此外，无论是否存在减值迹象，本集团于每年年度终了对商誉估计其可收回金额。本集团依据相关资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中的受益情况分摊商誉账面价值，并在此基础上进行商誉减值测试。

可收回金额是指资产（或资产组、资产组组合，下同）的公允价值（参见本节“五、17、公允价值计量”）减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者。

资产组由创造现金流入相关的资产组成，是可以认定的最小资产组合，其产生的现金流入基本上独立于其他资产或者资产组。

资产预计未来现金流量的现值，按照资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量，选择恰当的税前折现率对其进行折现后的金额加以确定。

可收回金额的估计结果表明，资产的可收回金额低于其账面价值的，资产的账面价值会减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。与资产组或者资产组组合相关的减值损失，先抵减分摊至该资产组或者资产组组合中商誉的账面价值，再根据资产组或者资产组组合中除商誉之外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值，但抵减后的各资产的账面价值不得低于该资产的公允价值减去处置费用后的净额（如可确定的）、该资产预计未来现金流量的现值（如可确定的）和零三者之中最高者。

资产减值损失一经确认，在以后会计期间不会转回。

17、公允价值计量

除特别声明外，本集团按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本集团估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

18、贵金属

不适用

19、应收款项

不适用

20、应收款项融资

不适用

21、合同资产

不适用

22、合同成本

不适用

23、持有待售资产

不适用

24、债权投资

不适用

25、其他债权投资

不适用

26、长期股权投资

(1) 长期股权投资成本确定

1) 通过企业合并形成的长期股权投资

对于同一控制下的企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照合并日取得的被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付对价账面价值之间的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。

2) 其他方式取得的长期股权投资

对于通过企业合并以外的其他方式取得的长期股权投资，在初始确认时，对于以支付现金取得的长期股权投资，本集团按照实际支付的购买价款作为初始投资成本；对于发行权益性证券取得的长期股权投资，本集团按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

(2) 长期股权投资后续计量及损益确认方法

1) 对子公司的投资

在本公司个别财务报表中，本公司采用成本法对子公司的长期股权投资进行后续计量，对被投资单位宣告分派的现金股利或利润由本公司享有的部分确认为当期投资收益，但取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润除外。

对子公司的投资按照成本减去减值准备后在资产负债表内列示。

对子公司投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见本节“五、16、除存货及金融资产外的其他资产减值”。

在本集团合并财务报表中，对子公司的长期股权投资按本节“五、6、合并财务报表的编制方法”进行处理。

2) 对联营企业的投资

联营企业指本集团能够对其施加重大影响（参见本节“九、3、在合营安排或联营企业中的权益”）的企业。

后续计量时，对联营企业的长期股权投资采用权益法核算，除非投资符合持有待售的条件。

本集团在采用权益法核算时的具体会计处理包括：

①对于长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以前者作为长期股权投资的成本；对于长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以后者作为长期股权投资的成本，长期股权投资的成本与初始投资成本的差额计入当期损益。

②取得对联营企业投资后，本集团按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。对联营企业除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动（以下简称“其他所有者权益变动”），本集团按照应享有或应分担的份额计入股东权益，并同时调整长期股权投资的账面价值。

③在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益、其他综合收益及其他所有者权益变动的份额时，本集团以取得投资时被投资单位可辨认净资产公允价值为基础，按照本集团的会计政策或会计期间进行必要调整后确认投资收益和其他综合收益等。本集团与联营企业之间内部交易产生的未实现损益按照应享有的比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵销。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

④本集团对联营企业发生的净亏损，除本集团负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对联营企业净投资的长期权益减记至零为限。联营企业以后实现净利润的，本集团在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

本集团对联营企业投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见本节“五、16、除存货及金融资产外的其他资产减值”。

(3) 确定对被投资单位具有重大影响的判断标准

重大影响指本集团对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。

27、投资性房地产

不适用

28、固定资产

(1) 确认条件

固定资产指本集团为提供劳务或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

外购固定资产的初始成本包括购买价款、相关税费以及使该资产达到预定可使用状态前所发生的可归属于该项资产的支出。

对于构成固定资产的各组成部分，如果各自具有不同使用寿命或者以不同方式为本集团提供经济利益，适用不同折旧率或折旧方法的，本集团分别将各组成部分确认为单项固定资产。

对于固定资产的后续支出，包括与更换固定资产某组成部分相关的支出，在与支出相关的经济利益很可能流入本集团时资本化计入固定资产成本，同时将被替换部分的账面价值扣除；与固定资产日常维护相关的支出在发生时计入当期损益。

固定资产以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。

(2) 折旧方法

类别	折旧方法	折旧年限	残值率	年折旧率
运输工具	年限平均法	10 年	5%	9.5%
办公设备	年限平均法	4-5 年	0%-5%	19%-25%
电子设备	年限平均法	3-5 年	0%-5%	19%-33%

本集团将固定资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在其使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非固定资产符合持有待售的条件。

本集团至少在每年年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核。

(3) 减值测试方法及减值准备计提方法

固定资产减值测试方法及减值准备计提方法参见本节“五、16、除存货及金融资产外的其他资产减值”。

(4) 固定资产处置

固定资产满足下述条件之一时，本集团会予以终止确认。

- ① 固定资产处于处置状态；
- ② 该固定资产预期通过使用或处置不能产生经济利益。

报废或处置固定资产项目所产生的损益为处置所得款项净额与项目账面金额之间的差额，并于报废或处置日在损益中确认。

(5) 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

不适用

29、在建工程

在建工程在达到预定可使用状态时转入固定资产。

30、借款费用

不适用

31、使用权资产

使用权资产的确定方法及会计处理方法参见本节“五、50、租赁”。

32、无形资产

(1) 计价方法、使用寿命、减值测试

无形资产以成本减累计摊销（仅限于使用寿命有限的无形资产）及减值准备（参见本节“五、16、除存货及金融资产外的其他资产减值”）在资产负债表内列示。对于使用寿命有限的无形资产，本集团将无形资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后按直线法在预计使用寿命期内摊销，除非该无形资产符合持有待售的条件。

各项无形资产的摊销年限分别为：

无形资产	摊销年限
软件	2 - 4 年
客户关系	3.5 年

(2) 内部研究开发支出会计政策

不适用

33、长期资产减值

不适用

34、长期待摊费用

不适用

35、商誉

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额。

本集团对商誉不摊销，以成本减累计减值准备（参见本节“五、16、除存货及金融资产外的其他资产减值”）在资产负债表内列示。商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。

36、附回购条件的资产转让

不适用

37、合同负债

合同负债的确定方法参见本节“五、45、收入”。

38、职工薪酬

(1) 短期薪酬的会计处理方法

本集团在职工提供服务的会计期间，将实际发生或按规定的基准和比例计提的职工工资、奖金、医疗保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费和住房公积金，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 离职后福利的会计处理方法

本集团所参与的设定提存计划包括：

①本集团所参与的设定提存计划是按照中国有关法规要求，本集团职工参加的由政府机构设立管理的社会保障体系中的基本养老保险。基本养老保险的缴费金额按国家规定的基准和比例计算。

②根据《企业年金试行办法》的有关规定，本集团职工参加的经职工代表大会讨论通过并报送劳动保障行政部门的企业年金计划。企业年金的缴费金额按年金计划方案计算。

本集团在职工提供服务的会计期间，将应缴存的金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(3) 辞退福利的会计处理方法

本集团在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，在下列两者孰早日，确认辞退福利产生的负债，同时计入当期损益：

①本集团不能单方面撤回解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；

②本集团有详细、正式的涉及支付辞退福利的重组计划；并且，该重组计划已开始实施，或已向受其影响的各方通告了该计划的主要内容，从而使各方形成了对本集团将实施重组的合理预期时。

(4) 其他长期职工福利的会计处理方法

不适用

39、期货风险准备金

(1) 计提方法和用途

根据财商字 [1997] 44 号《关于〈商品期货交易财务管理暂行规定〉的通知》的规定，风险准备金按代理手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5% 提取。期货风险准备金专门用于抵补本公司错单交易等的损失，当其余额达到本公司注册资本的 10 倍时，不再提取。

当发生以下情况时确认风险损失，冲减期货风险准备金：①错单合约平仓产生亏损；②因本公司自身原因造成的无法追究责任的风险损失；③无法收回的垫付因客户责任造成的风险损失。

(2) 核算方法

本公司按上述规定以代理手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5% 提取期货风险准备金，计提额计入当期损益，并同时计入“期货风险准备金”项目。当符合使用用途而动用期货风险准备金时，期货风险准备金余额以减计至零为限，超出部分计入当期损益。

40、租赁负债

租赁负债的确定方法及会计处理方法参见本节“五、50、租赁”。

41、所得税

除因企业合并和直接计入股东权益（包括其他综合收益）的交易或者事项产生的所得税外，本集团将当期所得税和递延所得税计入当期损益。

当期所得税是按本年度应税所得额，根据税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上以往年度应付所得税的调整。

资产负债表日，如果本集团拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行时，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

42、预计负债

如果与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且该义务的履行很可能会导致经济利益流出本集团，以及有关金额能够可靠地计量，则本集团会确认预计负债。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。对于货币时间价值影响重大的，预计负债以预计未来现金流量折现后的金额确定。在确定最佳估计数时，本集团综合考虑了与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- ①或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定；
- ②或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

本集团在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，并按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

43、股份支付

不适用

44、优先股、永续债等其他金融工具

不适用

45、收入

收入确认和计量所采用的会计政策

收入是本集团在日常活动中形成的、会导致股东权益增加且与股东投入资本无关的经济利益的总流入。

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本集团在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。

交易价格是本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项。本集团确认的交易价格不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。预期将退还给客户的款项作为退货负债，不计入交易价格。合同中存在重大融资成分的，本集团按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，本集团预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

满足下列条件之一时，本集团属于在某一段时间内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：

- ①客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- ②客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- ③本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本集团在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，本集团已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。

对于在某一时点履行的履约义务，本集团在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品或服务控制权时，本集团会考虑下列迹象：

- ①本集团就该商品或服务享有现时收款权利；
- ②本集团已将该商品的实物转移给客户；
- ③本集团已将该商品的法定所有权或所有权上的主要风险和报酬转移给客户；
- ④客户已接受该商品或服务。

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

与本集团取得收入的主要活动相关的具体会计政策描述如下：

（1）手续费收入

期货及期权经纪手续费收入于代理交易发生日予以确认。根据期货及期权代理合同，本集团按向客户收取的手续费，扣减代收的支付给交易所的手续费部分之后的净额确认手续费收入。

交易所手续费返还减收在本集团收到交易所的返还减收时确认。

资产管理业务手续费在本集团有权根据资产管理协议取得收入时确认。

风险管理业务收入本集团按风险管理业务合同的约定确认收入。

（2）利息收入

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

（3）投资收益

处置金融工具产生的损益及获得股利分红于交易日确认投资收益。

（4）公允价值变动损益

金融工具公允价值变动产生的损益于资产负债表日按公允价值与账面价值之间的差额确认。

（5）其他业务收入

其他业务收入主要系销售商品收入及咨询服务收入。对于销售商品，本集团按照合同收取货款后，将现货货权转移给客户，客户取得商品的控制权，本集团确认收入。对于咨询服务收入，本集团根据提供咨询服务的履约进度确认收入。同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

无

46、政府补助

政府补助是本集团从政府无偿取得的货币性资产或非货币性资产，但不包括政府以投资者身份向本集团投入的资本。政府拨入的投资补助等专项拨款中，国家相关文件规定作为资本公积处理的，也属于资本性投入的性质，不属于政府补助。

政府补助在能够满足政府补助所附条件，并能够收到时，予以确认。

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量。

本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助作为与资产相关的政府补助。本集团取得的与资产相关之外的其他政府补助作为与收益相关的政府补助。与资产相关的政府补助，本集团将其确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入其他收益或营业外收入。与收益相关的政府补助，如果用于补偿本集团以后期间的相关成本费用或损失的，本集团将其确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入其他收益或营业外收入；否则直接计入其他收益或营业外收入。

47、佣金费用

本集团与居间人签订居间协议，支付给居间人的佣金列支于业务及管理费用。

48、一般风险准备金

本公司根据《金融企业财务规则》及《金融企业财务规则—实施指南》规定，按照当期净利润的 10%提取一般风险准备。

49、递延所得税资产/递延所得税负债

递延所得税资产与递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

如果不属于企业合并交易且交易发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损），则该项交易中产生的暂时性差异不会产生递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生相关的递延所得税。

资产负债表日，本集团根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

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

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

- ① 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；
- ② 并且递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债。

50、租赁

（1）经营租赁的会计处理方法

租赁，是指在一定期间内，出租人将资产的使用权让与承租人以获取对价的合同。

在合同开始日，本集团评估合同是否为租赁或者包含租赁。如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。

为确定合同是否让渡了在一定期间内控制已识别资产使用的权利，本集团进行如下评估：

① 合同是否涉及已识别资产的使用。已识别资产可能由合同明确指定或在资产可供客户使用时隐性指定，并且该资产在物理上可区分，或者如果资产的某部分产能或其他部分在物理上不可区分但实质上代表了该资产的全部产能，从而使客户获得因使用该资产所产生的几乎全部经济利益。如果资产的供应方在整个使用期间拥有对该资产的实质性替换权，则该资产不属于已识别资产；

② 承租人是否有权获得在使用期间内因使用已识别资产所产生的几乎全部经济利益；

③ 承租人是否有权在该使用期间主导已识别资产的使用。

合同中同时包含多项单独租赁的，承租人和出租人将合同予以分拆，并分别各项单独租赁进行会计处理。合同中同时包含租赁和非租赁部分的，承租人和出租人将租赁和非租赁部分进行分拆。在分拆合同包含的租赁和非租赁部分时，承租人按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。

1) 本集团作为承租人

在租赁期开始日，本集团对租赁确认使用权资产和租赁负债。使用权资产按照成本进行初始计量，包括租赁负债的初始计量金额、在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额（扣除已享受的租赁激励相关金额），发生的初始直接费用以及为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

本集团使用直线法对使用权资产计提折旧。对能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，本集团在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。否则，租赁资产在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。使用权资产按附注四、19 所述的会计政策计提减值准备。

租赁负债按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量，折现率为租赁内含利率。无法确定租赁内含利率的，采用本集团增量借款利率作为折现率。

本集团按照固定的周期性利率计算租赁负债在租赁期内各期间的利息费用，并计入当期损益或相关资产成本。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益或相关资产成本。

租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团按照变动后租赁付款额的现值重新计量租赁负债：

①根据担保余值预计的应付金额发生变动；

②用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动；

③本集团对购买选择权、续租选择权或终止租赁选择权的评估结果发生变化，或续租选择权或终止租赁选择权的实际行使情况与原评估结果不一致。

在对租赁负债进行重新计量时，本集团相应调整使用权资产的账面价值。使用权资产的账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将剩余金额计入当期损益。

本集团已选择对短期租赁（租赁期不超过 12 个月的租赁）和低价值资产租赁不确认使用权资产和租赁负债，并将相关的租赁付款额在租赁期内各个期间按照直线法计入当期损益或相关资产成本。

（2）融资租赁的会计处理方法

不适用

51、利润分配

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

52、融资融券业务

不适用

53、关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成关联方。

此外，本集团同时根据证监会颁布的《上市公司信息披露管理办法》确定本集团或本公司的关联方。

54、分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部。如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时在各单项产品或劳务的性质、生产过程的性质、产品或劳务的客户类型、销售产品或提供劳务的方式、生产产品及提供劳务受法律及行政法规的影响等方面具有相同或相似性的，可以合并为一个经营分部。本集团以经营分部为基础考虑重要性原则后确定报告分部。

本集团在编制分部报告时，分部间交易收入按实际交易价格为基础计量。编制分部报告所采用的会计政策与编制本集团财务报表所采用的会计政策一致。

55、其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本集团管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本公司管理层对估计涉及的关键假设和不确定性因素的判断进行持续评估。会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

下列会计估计及关键假设存在导致未来期间的资产及负债账面价值发生重大调整的重要风险。

（1）金融资产减值准备

本集团以预期信用损失为基础，对债权投资、其他债权投资、开展融资类业务（含融资融券、约定购回、股票质押回购等）形成的资产，以及货币市场拆出（借出）资金或证券、应收款项和应收融资租赁款等进行减值处理并确认损失准备。

本集团基于上述金融资产的分类与性质，结合自身风险管理实践及减值指引的相关要求，以概率加权平均为基础，综合考虑货币时间价值和在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息，建立预期信用损失模型计量上述金融工具的减值损失。预期信用损失模型的相关假设、参数、数据来源和计量程序均需本公司作出专业的判断，这些相关因素假设的变化会对金融工具的预期信用损失计算结果产生影响。

本集团采用预期信用损失模型对金融资产的减值进行评估，应用预期信用损失模型需要做出重大判断和估计如违约概率、违约损失率及信用风险是否显著增加，需考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。在做出该等判断和估计时，本公司根据历史还款数据结合经济政策、宏观经济指标、行业风险等因素推断债务人信用风险的预期变动。

（2）除金融资产之外的非流动资产减值

本集团于资产负债表日对除金融资产之外的非流动资产判断是否存在可能发生减值的迹象。在进行减值测试时，当资产或资产组的账面价值高于可收回金额，表明发生了减值。预计未来现金流量现值时，管理层必须估计该项资产或资产组的预计未来现金流量，并选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

（3）金融工具的公允价值

对于缺乏活跃市场的金融工具，本集团运用估值方法确定其公允价值。估值方法包括参照在市场中具有完全信息且有买卖意愿的经济主体之间进行公平交易时确定的交易价格，参考市场上另一类似金融工具的公允价值，或运用现金流量折现分析及期权定价模型进行估算。估值方法在最大程度上利用可观察市场信息，然而，当可观察市场信息无法获得时，管理层将对估值方法中包括的重大不可观察信息作出估计。

（4）所得税及递延所得税

本集团需要对某些交易未来的税务处理作出判断以确认所得税。本集团根据有关税收法规，谨慎判断交易对应的所得税影响并相应地计提所得税。递延所得税资产只会在有可能有未来应纳税利润并可用作抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重大判断，并需要就是否有足够的未来应纳税利润以抵销递延所得税资产的可能性作出重大的估计。

（5）合并范围的确定

评估本集团是否作为投资者控制被投资企业时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：1）拥有对被投资者的权力；2）通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；3）有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则本集团需要重新评估其是否对被投资企业构成控制。

对于本集团管理并投资的结构化主体，本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

56、重要会计政策和会计估计变更

（1）重要会计政策变更

适用 不适用

（2）重要会计估计变更

适用 不适用

57、其他

无

六、税项

1、主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	按税法规定的应税服务收入及销售货物收入为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分应交增值税	6%、9%、13%
城市维护建设税	按实际缴纳的增值税计征	7%
教育费附加	按实际缴纳的增值税计征	3%
地方教育费附加	按实际缴纳的增值税计征	2%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

纳税主体名称	所得税税率
弘业期货股份有限公司	25%
弘业资本管理有限公司	25%
弘业国际金融控股有限公司	16.5%
弘业国际资产管理有限公司	16.5%

2、税收优惠

无

3、其他

无

七、合并财务报表项目注释

1、货币资金

单位：元

项目	期末账面价值			期初账面价值		
	原币金额	折算率	折人民币金额	原币金额	折算率	折人民币金额
银行存款	---	---	7,395,503.05 1.99	---	---	4,105,756.94 2.18
其中：自有资金	---	---	115,079,377. 67	---	---	113,666,496. 74
其中：人民币	33,227,706.2 2	100.00%	33,227,706.2 2	43,152,930.3 7	100.00%	43,152,930.3 7
港元	89,210,879.5 7	85.52%	76,292,252.1 0	82,765,118.7 0	81.76%	67,668,761.0 5
美元	828,354.64	671.14%	5,559,419.30	446,194.97	637.57%	2,844,805.27

日元	1.00	4.91%	0.05	1.00	5.54%	0.06
其中：期货保证金存款			7,244,452,35 5.04			3,959,706,20 6.55
其中：人民币	7,175,629,87 6.25	100.00%	7,175,629,87 6.25	3,933,887,25 1.17	100.00%	3,933,887,25 1.17
港元	56,865,338.3 9	85.52%	48,630,668.7 4	4,388,895.22	81.76%	3,588,360.73
美元	3,007,209.98	671.14%	20,182,589.0 4	3,485,138.15	637.57%	22,220,195.3 0
日元	187,663.00	4.91%	9,221.01	187,663.00	5.54%	10,399.35
其中：应计利息			35,971,319.2 8			32,384,238.8 9
其他货币资金	---	---	141,309,203. 04	---	---	37,885,031.1 5
其中：人民币	141,151,999. 13	100.00%	141,151,999. 13	37,885,031.1 5	100.00%	37,885,031.1 5
港元	18,174.48	85.52%	15,542.63			
美元	21,107.56	671.14%	141,661.28			
合计	---	---	7,536,812,25 5.03	---	---	4,143,641,97 3.33

其他说明

(1) 期货保证金存款明细

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
中信银行	1,647,336,006.96	1,054,078,895.82
民生银行	832,017,761.99	883,884,376.49
兴业银行	759,927,851.33	1,157,480,298.10
浦发银行	47,131,149.79	115,589,915.20
交通银行	690,345,606.52	678,396,184.79
广发银行	258,420.79	185,620.99
中国银行	77,734,304.60	32,236,681.18
中国农业银行	17,082,373.38	8,220,606.60
中国建设银行	11,505,599.12	8,958,007.41
招商银行	11,512,367.79	5,155,922.79
中国工商银行	3,035,184,679.46	10,389,858.47
平安银行	108,081,175.94	1,572,620.46
中国光大银行	6,334,310.39	3,557,218.25
汇丰银行	746.98	
合计	7,244,452,355.04	3,959,706,206.55

(2) 期末使用受限资金情况

详见本节“七、88、所有权或使用权受到限制的资产”。

2、应收货币保证金

(1) 按交易所/清算商分类情况

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
上海期货交易所	582,353,672.28	186,376,259.43
大连商品交易所	780,600,965.15	654,164,795.52
郑州商品交易所	529,237,738.58	498,143,426.63
中国金融期货交易所	334,354,922.36	399,286,033.93
中国证券登记结算有限责任公司	105,632,741.36	103,385,291.13
上海国际能源交易中心	97,797,992.69	121,755,030.77
R. J. O' Brien&AssociatesLLC	673,813.68	640,197.99
PHILLIPFUTURESPTELTD	22,032,759.28	27,200,217.85
PhillipCommodities(HK)Limited	11,009,592.66	8,854,413.76
MarexFinancial	14,072,190.67	11,734,143.13
G. H. Financials(HongKong)Limited	30,186,927.82	17,614,078.04
PHILLIPSECURITIESPTELTD	25,946.09	8,846.86
HongKongExchangesandClearingLimited	189,311.19	
小计	2,508,168,573.81	2,029,162,735.04
减：减值准备	3,909,527.07	3,302,594.88
合计	2,504,259,046.74	2,025,860,140.16

(2) 按类别分类情况

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
结算准备金	396,756,484.14	343,966,861.36
交易保证金	2,033,221,548.28	1,619,143,976.05
境外期货经纪公司	78,190,541.39	66,051,897.63
小计	2,508,168,573.81	2,029,162,735.04
减：减值准备	3,909,527.07	3,302,594.88
合计	2,504,259,046.74	2,025,860,140.16

3、应收质押保证金

(1) 交易所明细

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
上海期货交易所	687,288,900.00	428,672,112.00
郑州商品交易所	96,103,598.40	79,350,321.60
大连商品交易所	161,089,200.00	160,794,960.00
上海国际能源交易中心	47,288,800.00	
合计	991,770,498.40	668,817,393.60

(2) 质押品明细

质押品种类	2022 年 6 月 30 日市值	折扣率	2022 年 6 月 30 日金额
上海期货交易所			
其中：2020 年记账式付息（八期）国债	433,741,000.00	80%	346,992,800.00
2021 年记账式付息（十一期）国债	100,270,000.00	80%	80,216,000.00
2021 年记账式付息（二期）国债	91,530,000.00	80%	73,224,000.00
2020 年记账式付息（五期）国债	49,370,000.00	80%	39,496,000.00
2020 年记账式付息（十四期）国债	50,480,000.00	80%	40,384,000.00
2020 年记账式付息（十三期）国债	40,640,000.00	80%	32,512,000.00
2021 年记账式付息（十五期）国债	50,260,000.00	80%	40,208,000.00
标准仓单铝	42,820,125.00	80%	34,256,100.00
郑州商品交易所			
其中：2020 年记账式付息（十一期）国债	99,089,298.00	80%	79,271,438.40
标准仓单棉花	15,545,200.00	80%	12,436,160.00
标准仓单红枣	5,495,000.00	80%	4,396,000.00
大连商品交易所			
其中：2016 年记账式付息（十期）国债	101,167,300.00	80%	80,933,840.00
2020 年记账式付息（三期）国债	100,194,200.00	80%	80,155,360.00
上海国际能源交易中心			
其中：2021 年记账式付息（十一期）国债	50,135,000.00	80%	40,108,000.00
标准仓单 20 号胶	8,976,000.00	80%	7,180,800.00
合计	1,239,713,123.00		991,770,498.40

(续)

质押品种类	2021 年 12 月 31 日市值	折扣率	2021 年 12 月 31 日金额
上海期货交易所			
其中：2021 年记账式付息（八期）国债	100,280,000.00	80%	80,224,000.00
2020 年记账式付息（八期）国债	433,741,000.00	80%	346,992,800.00
标准仓单锡	1,819,140.00	80%	1,455,312.00
郑州商品交易所			
其中：2020 年记账式付息（十一期）国债	99,187,902.00	80%	79,350,321.60
大连商品交易所			
其中：2016 年记账式付息（十期）国债	101,169,800.00	80%	80,935,840.00
2020 年记账式付息（三期）国债	99,823,900.00	80%	79,859,120.00
合计	836,021,742.00		668,817,393.60

4、应收结算担保金

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日

中国金融期货交易所	20,000,000.00	20,000,000.00
合计	20,000,000.00	20,000,000.00

5、结算备付金

无

6、贵金属

无

7、拆出资金

无

8、融出资金

无

9、衍生金融工具

单位：元

类别	期末金额						期初金额					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义 金额	公允价值		名义 金额	公允价值		名义 金额	公允价值		名义 金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
利率 衍生 工具												
货币 衍生 工具												
权益 衍生 工具												
信用 衍生 工具												
其他 衍生 工具												
商品 衍生 金融 工具												
期货 合约				2,196,832,070.77	132,843,591.67	120,498,360.00				1,155,503,009.85	38,764,426.92	40,975,213.10

期权 合约				1,455,802,359.19	9,871,158.50	15,899,936.78				1,188,697,480.04	465,835.77	1,514,054.34
减： 结算 金额					-132,843,591.67	-120,498,360.00					-38,764,426.92	-40,975,213.10
合计				3,652,634,429.96	9,871,158.50	15,899,936.78				2,344,200,489.89	465,835.77	1,514,054.34

已抵销的衍生金融工具

适用 不适用

10、存出保证金

无

11、应收款项

无

12、应收款项融资

无

13、合同资产

无

14、其他应收款

(1) 明细情况

类别	2022年6月30日				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
按单项计提坏账准备的其他应收款	10,713,048.00	19.60	9,106,090.80	85.00	1,606,957.20
按组合计提坏账准备的其他应收款	43,941,042.12	80.40	1,202,926.91	2.74	42,738,115.21
组合：无风险组合	25,778,218.99	47.17	-		25,778,218.99
保证金及押金	12,690,849.42	23.22	634,542.47	5.00	12,056,306.95
其他组合	5,471,973.71	10.01	568,384.44	10.39	4,903,589.27
合计	54,654,090.12	100.00	10,309,017.71	-	44,345,072.41

(续)

类别	2021年12月31日			
----	-------------	--	--	--

	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
按单项计提坏账准备的其他应收款	10,713,048.00	30.33	9,106,090.80	85.00	1,606,957.20
按组合计提坏账准备的其他应收款	24,613,016.83	69.67	1,268,248.92	5.15	23,344,767.91
组合：无风险组合	4,880,716.81	13.82	-		4,880,716.81
保证金及押金	11,273,842.21	31.91	563,692.10	5.00	10,710,150.11
其他组合	8,458,457.81	23.94	704,556.82	8.33	7,753,900.99
合计	35,326,064.83	100.00	10,374,339.72	—	24,951,725.11

(2) 采用单项计提坏账准备的应收账款

单位名称	2022年6月30日			
	其他应收款	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
汉邦(江阴)石化有限公司	10,713,048.00	9,106,090.80	85.00	经营不善, 预计无法全额收回
合计	10,713,048.00	9,106,090.80	—	—

(续)

单位名称	2022年6月30日			
	其他应收款	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
汉邦(江阴)石化有限公司	10,713,048.00	9,106,090.80	85.00	经营不善, 预计无法全额收回
合计	10,713,048.00	9,106,090.80	—	—

注：详见本节“十六、2、或有事项”。

(3) 减值准备变动情况

项目	2022年1-6月			
	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	
年初余额	1,268,248.92		9,106,090.80	10,374,339.72
本年计提	-65,322.01			-65,322.01
年末余额	1,202,926.91		9,106,090.80	10,309,017.71

(4) 按类别分析

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
PTA 现货交易应退货款	10,713,048.00	10,713,048.00
应收基金及资管计划分红及赎回款	21,831,906.42	1,471,741.45
应收证券清算款	3,946,312.57	3,408,975.36
应收场外期权保证金	8,216,552.81	6,849,475.86
押金	4,474,296.61	4,424,366.35
其他	5,471,973.71	8,458,457.81
小计	54,654,090.12	35,326,064.83
减：减值准备	10,309,017.71	10,374,339.72
合计	44,345,072.41	24,951,725.11

15、买入返售金融资产

(1) 按业务类别

单位：元

项目	期末余额	期初余额	备注
债券质押式回购	0.00	6,719,000.00	国债逆回购
合计	0.00	6,719,000.00	---

(2) 按金融资产类别

单位：元

标的物类别	期末余额	期初余额
债券	0.00	6,719,000.00
合计	0.00	6,719,000.00

16、持有待售资产

无

17、交易性金融资产

单位：元

类别	期末余额						期初余额					
	公允价值			初始成本			公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
债券	170,590,921.26		170,590,921.26	168,416,711.56		168,416,711.56	97,121,997.66		97,121,997.66	97,507,884.13		97,507,884.13
股票	66,598,117.84		66,598,117.84	71,079,700.31		71,079,700.31	90,534,211.97		90,534,211.97	85,098,650.02		85,098,650.02
信托计划	131,888,708.50		131,888,708.50	130,000,000.00		130,000,000.00	126,522,054.80		126,522,054.80	125,000,000.00		125,000,000.00
基金	456,382,129.51		456,382,129.51	457,463,732.48		457,463,732.48	486,081,988.72		486,081,988.72	475,380,302.79		475,380,302.79
资产	21,36		21,36	20,66		20,66	40,15		40,15	38,39		38,39

管理计划	9,309.36		9,309.36	3,820.03		3,820.03	9,381.31		9,381.31	4,118.05		4,118.05
合计	846,829,186.47		846,829,186.47	847,623,964.38		847,623,964.38	840,419,634.46		840,419,634.46	821,380,954.99		821,380,954.99

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的描述性说明

适用 不适用

其他说明

有承诺条件或存在限制的交易性金融资产情况见本节“七、88、所有权或使用权受到限制的资产”。

18、债权投资

无

19、其他债权投资

无

20、其他权益工具投资

无

21、存货

(1) 存货分类

项目	2022年6月30日		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	48,686,145.22		48,686,145.22
合计	48,686,145.22		48,686,145.22

(续)

项目	2021年12月31日		
	账面余额	跌价准备	账面价值
库存商品	9,531.74		9,531.74
合计	9,531.74		9,531.74

(2) 报告各期末存货未发现减值迹象，未计提存货减值准备。

(3) 期末受限存货情况，详见本节“七、88、所有权或使用权受到限制的资产”。

22、长期股权投资

单位：元

被投资单位	期初余额（账	本期增减变动							期末余额（账	减值准备期末
		追加	减少	权益	其他	其他	宣告	计提		

	面价值)	投资	投资	法下确认的投资损益	综合收益调整	权益变动	发放现金股利或利润	减值准备		面价值)	余额
一、合营企业											
二、联营企业											
江苏弘瑞新时代创业投资有限公司	4,787,111.14			1,262,024.03						6,049,135.17	
江苏弘瑞成长创业投资有限公司	2,249,016.62			-94,718.12	-20.94					2,154,277.56	
小计	7,036,127.76			1,167,305.91	-20.94					8,203,412.73	
合计	7,036,127.76			1,167,305.91	-20.94					8,203,412.73	

其他说明

无

23、期货会员资格投资

(1) 明细情况

项目	2022年6月30日		
	账面余额	减值准备	账面价值
期货会员资格投资	1,827,595.00		1,827,595.00
合计	1,827,595.00		1,827,595.00

(续)

项目	2021年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值
期货会员资格投资	1,808,800.00		1,808,800.00
合计	1,808,800.00		1,808,800.00

(2) 按交易所分类

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
上海期货交易所	500,000.00	500,000.00
大连商品交易所	500,000.00	500,000.00
郑州商品交易所	400,000.00	400,000.00
香港期货交易所	427,595.00	408,800.00
合计	1,827,595.00	1,808,800.00

(3) 报告各期末期货会员资格投资未发现减值迹象，未计提减值准备，报告各期末香港期货交易所期货会员资格变动原因主要系汇率变动。

24、投资性房地产

(1) 采用成本计量模式的投资性房地产

适用 不适用

(2) 采用公允价值计量模式的投资性房地产

适用 不适用

(3) 未办妥产权证书的投资性房地产情况

无

其他说明

无

25、固定资产

(1) 固定资产情况

单位：元

项目	运输工具	办公设备	电子设备	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	4,530,441.60	647,047.14	50,321,958.08	55,499,446.82
2. 本期增加金额		908,495.57	206,846.47	1,115,342.04
(1) 购置		908,495.57	206,846.47	1,115,342.04
(2) 在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额		129,916.85	268,800.00	398,716.85
(1) 处置或报废		129,916.85	268,800.00	398,716.85
外币报表折算差异		3,904.76	70,598.27	74,503.03
4. 期末余额	4,530,441.60	1,429,530.62	50,330,602.82	56,290,575.04
二、累计折旧				
1. 期初余额	3,819,348.80	231,810.63	36,548,873.39	40,600,032.82
2. 本期增加金额	41,465.11	47,616.18	2,936,527.87	3,025,609.16
(1) 计提	41,465.11	47,616.18	2,936,527.87	3,025,609.16
3. 本期减少金额		123,591.50	255,360.00	378,951.50
(1) 处置或报废		123,591.50	255,360.00	378,951.50
外币报表折算差异		3,847.41	59,409.86	63,257.27
4. 期末余额	3,860,813.91	159,682.72	39,289,451.12	43,309,947.75
三、减值准备				

1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置或报废				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	669,627.69	1,269,847.90	11,041,151.70	12,980,627.29
2. 期初账面价值	711,092.80	415,236.51	13,773,084.69	14,899,414.00

(2) 暂时闲置的固定资产情况

无

(3) 通过经营租赁租出的固定资产

无

(4) 未办妥产权证书的固定资产情况

无

其他说明

报告期各期末无未办妥产权证书的固定资产。

报告期各期末固定资产未发现减值迹象，未计提固定资产减值准备。

26、在建工程

(1) 在建工程情况

单位：元

项目	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
南京河西紫金金融中心办公用房	274,716,656.66	0.00	274,716,656.66	0.00	0.00	0.00
合计	274,716,656.66	0.00	274,716,656.66	0.00	0.00	0.00

(2) 重要在建工程项目本期变动情况

单位：元

项目名称	预算数	期初余额	本期增加金额	本期转入固定资产金额	本期其他减少金额	期末余额	工程累计投入占预算比例	工程进度	利息资本化累计金额	其中：本期利息资本化金额	本期利息资本化率	资金来源
南京河西		0.00	274,7	0.00		274,7						金融

紫金金融 中心办公 用房			16,65 6.66			16,65 6.66						机构 贷款
合计		0.00	274,7 16,65 6.66	0.00		274,7 16,65 6.66	--	--				--

(3) 本期计提在建工程减值准备情况

无

其他说明

无

27、使用权资产

单位：元

项目	房屋租赁	合计
一、账面原值：		
1. 期初余额	74,881,707.35	74,881,707.35
2. 本期增加金额	14,757,082.89	14,757,082.89
租入增加	14,757,082.89	14,757,082.89
3. 本期减少金额		
外币报表折算差异	227,677.93	227,677.93
4. 期末余额	89,866,468.17	89,866,468.17
二、累计折旧		
1. 期初余额	50,225,717.77	50,225,717.77
2. 本期增加金额	6,586,198.67	6,586,198.67
(1) 计提	6,586,198.67	6,586,198.67
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
外币报表折算差异	153,938.86	153,938.86
4. 期末余额	56,965,855.30	56,965,855.30
三、减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
(1) 计提		
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
4. 期末余额		
四、账面价值		
1. 期末账面价值	32,900,612.87	32,900,612.87
2. 期初账面价值	24,655,989.58	24,655,989.58

其他说明

报告各期末使用权资产未发现减值迹象，未计提使用权资产减值准备。

28、无形资产

(1) 无形资产情况

单位：元

项目	软件	客户关系	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	7,726,476.75	6,100,000.00	13,826,476.75
2. 本期增加金额			
(1) 购置			
(2) 内部研发			
(3) 企业合并增加			
3. 本期减少金额			
(1) 处置			
外币报表折算差异	27,253.08		27,253.08
4. 期末余额	7,753,729.83	6,100,000.00	13,853,729.83
二、累计摊销			
1. 期初余额	6,701,272.12	6,100,000.00	12,801,272.12
2. 本期增加金额	294,969.09		294,969.09
(1) 计提	294,969.09		294,969.09
3. 本期减少金额			
(1) 处置			
外币报表折算差异	4,699.08		4,699.08
4. 期末余额	7,000,940.29	6,100,000.00	13,100,940.29
三、减值准备			
1. 期初余额			
2. 本期增加金额			
(1) 计提			
3. 本期减少金额			
(1) 处置			
4. 期末余额			
四、账面价值			
1. 期末账面价值	752,789.54		752,789.54
2. 期初账面价值	1,025,204.63		1,025,204.63

本期末通过公司内部研发形成的无形资产占无形资产余额的比例 0.00%

(2) 未办妥产权证书的土地使用权情况

无

其他说明

报告各期末无形资产未发现减值迹象，未计提无形资产减值准备。

29、商誉

(1) 商誉账面原值

单位：元

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
		企业合并形成的	处置	
华证期货有限公司期货经纪业务及其相关的资产和负债	53,167,251.21			53,167,251.21
合计	53,167,251.21			53,167,251.21

(2) 商誉减值准备

单位：元

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
		计提	处置	
华证期货有限公司期货经纪业务及其相关的资产和负债	53,167,251.21			53,167,251.21
合计	53,167,251.21			53,167,251.21

商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

本集团于 2013 年支付人民币 60,000,000.00 元收购了华证期货有限公司期货经纪业务及其相关的资产和负债。合并成本超过该资产组可辨认资产、负债公允价值的差额人民币 53,167,251.21 元，确认为商誉。

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

于 2019 年 12 月 31 日，本集团根据管理层批准的资产组最近未来 5 年财务预算和 16.7% 税前折现率预计该资产组的未来现金流量现值。超过 5 年财务预算之后年份的现金流量均保持稳定。经减值测试后，若资产组的可收回金额估计结果低于其账面价值，本集团先抵减资产组中的商誉账面价值。2019 年，资产组业务下降较为明显，当年实现的收入和利润规模较预算金额差距较大，管理层根据资产组未来 5 年盈利预测判断资产组盈利能力较弱，经营现金流持续下滑，不足以支撑商誉，故遵循谨慎性原则全额计提商誉减值准备。

商誉减值测试的影响

无

其他说明

无

30、递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

单位：元

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
内部交易未实现利润	11,421,868.24	2,855,467.06		
可抵扣亏损	10,855,195.14	1,791,107.20		
应付职工薪酬	542,208.00	135,552.00	19,655,122.19	4,913,780.55

信用减值损失	10,258,613.55	2,564,653.39	10,326,151.10	2,581,537.78
预提费用	2,373,062.18	593,265.55	3,300,766.11	825,191.53
预计负债			1,969,920.97	492,480.24
衍生金融工具公允价值变动			3,305,416.91	826,354.23
交易性金融资产/负债公允价值变动	3,911,051.63	977,762.91		
租赁	334,197.66	83,549.42	171,802.95	42,950.74
合计	39,696,196.40	9,001,357.53	38,729,180.23	9,682,295.07

(2) 未经抵销的递延所得税负债

单位：元

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
衍生金融工具公允价值变动	5,816,266.71	1,454,066.68		
交易性金融资产/负债公允价值变动			9,153,015.98	2,288,254.00
合计	5,816,266.71	1,454,066.68	9,153,015.98	2,288,254.00

(3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

单位：元

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	-1,454,066.68	7,547,290.85	-2,288,254.00	7,394,041.07
递延所得税负债	-1,454,066.68		-2,288,254.00	

(4) 未确认递延所得税资产明细

单位：元

项目	期末余额	期初余额
可抵扣亏损	60,241,310.17	58,466,875.71
商誉减值准备	53,167,251.21	53,167,251.21
合计	113,408,561.38	111,634,126.92

(5) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

单位：元

年份	期末金额	期初金额	备注
无限期	60,241,310.17	58,466,875.71	根据现行税法，弘业国际金控可抵扣亏损自发生年度起可无限期结转以扣减税款。
合计	60,241,310.17	58,466,875.71	--

其他说明

无

31、其他资产

(1) 按类别列示

单位：元

项目	期末余额	期初余额
预付款项	7,215,533.10	281,485,696.70
待退、待抵扣及待结算税金	7,706,028.69	1,960,559.20
海外期货交易所押金	1,431,957.99	1,369,016.07
待摊费用	4,586,349.06	6,995,142.68
其他	3,675,471.70	3,585,849.06
合计	24,615,340.54	295,396,263.71

(2) 其他应收款

本公司其他应收款单独列示，具体内容详见本节“七、14、其他应收款”。

(3) 应收利息

无

(4) 长期待摊费用

无

(5) 其他

无

32、融券业务

无

33、资产减值准备

无

34、金融工具及其他项目预期信用损失准备

无

35、短期借款

无

36、应付货币保证金

(1) 按客户类别列示

客户类别	2022年6月30日		2021年12月31日	
	户数	金额	户数	金额
自然人	92,174	3,541,117,501.46	85,991	3,244,516,564.70
法人	3,457	5,495,298,821.28	3,070	2,017,295,316.72
合计	95,631	9,036,416,322.74	89,061	5,261,811,881.42

(2) 按交易所列示

交易所	2022年6月30日		2021年12月31日	
	户数	金额	户数	金额
境内期货交易所				
其中：上海期货交易所	2,411	1,057,402,153.00	2,062	520,554,746.95
大连商品交易所	2,679	597,069,931.70	2,590	507,598,638.10
中国金融期货交易所	349	312,709,433.50	330	362,963,783.28
郑州商品交易所	2,891	359,245,737.90	2,819	419,692,429.65
上海国际能源交易中心	14	11,101,312.20	106	35,442,258.80
中国证券登记结算有限责任公司	123	41,629,153.00	16	7,519,835.67
小计	8,467	2,379,157,721.30	7,923	1,853,771,692.45
境外期货经纪公司	2,107	144,479,660.21	2,095	89,679,035.34
合计	10,574	2,523,637,381.51	10,018	1,943,450,727.79

注：按交易所列示的客户保证金不包括存入银行应付客户保证金及存放交易所的结算准备金。

37、应付质押保证金

(1) 按客户类别列示

客户类别	2022年6月30日		2021年12月31日	
	户数	金额	户数	金额
法人	9	974,938,338.40	5	668,817,393.60
合计	9	974,938,338.40	5	668,817,393.60

(2) 按交易所列示

交易所	2022年6月30日	2021年12月31日
上海期货交易所	687,288,900.00	428,672,112.00
大连商品交易所	161,089,200.00	160,794,960.00
郑州商品交易所	79,271,438.40	79,350,321.60
上海国际能源交易中心	47,288,800.00	
合计	974,938,338.40	668,817,393.60

38、应付短期融资款

无

39、拆入资金

无

40、交易性金融负债

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

适用 不适用

单位：元

类别	期末账面余额			期初账面余额		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
应付款项		114,652,344.11	114,652,344.11		86,471,254.16	86,471,254.16
合计		114,652,344.11	114,652,344.11		86,471,254.16	86,471,254.16

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的描述性说明

适用 不适用

对于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，公允价值的变动情况如下表所示：

项目	2022年6月30日公允价值变动额	因自身信用风险变动引起的公允价值累计变动额
应付款项	-408,959.19	

截止 2022 年 6 月 30 日，指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的账面价值与按合同约定到期应支付债权人金额之间无差额。

(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益

适用 不适用

(3) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益

适用 不适用

41、卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别

单位：元

项目	期末账面余额	期初账面余额
质押式卖出回购	48,051,155.15	32,625,838.11
合计	48,051,155.15	32,625,838.11

(2) 按金融资产种类

单位：元

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	48,051,155.15	32,625,838.11
合计	48,051,155.15	32,625,838.11

(3) 担保物金额

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	71,119,031.72	54,775,333.50
合计	71,119,031.72	54,775,333.50

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

单位：元

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	48,051,155.15	2.515%-2.520%	32,625,838.11	2.847%-3.905%
合计	48,051,155.15	--	32,625,838.11	--

42、代理买卖证券款

无

43、代理承销证券款

无

44、期货风险准备金

(1) 明细情况

项目	2021年12月31日 余额	本期增加	本期减少	2022年6月30日 余额
期货风险准备金	151,215,411.17	5,903,638.55		157,119,049.72
合计	151,215,411.17	5,903,638.55		157,119,049.72

45、应付期货投资者保障基金

(1) 明细情况

项目	2021 年 12 月 31 日 余额	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日 余额
应付期货投资者保障基金	522,926.88	198,161.07	522,855.29	198,232.66
合计	522,926.88	198,161.07	522,855.29	198,232.66

注：根据 2016 年 11 月 8 日证监会颁布的证监会令第 129 号《关于修改〈期货投资者保障基金管理暂行办法〉的决定》，自 2016 年 12 月 8 日起，本公司缴纳比率为代理交易额的亿分之六。

46、应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	20,659,015.94	65,938,862.98	86,021,474.43	576,404.49
二、离职后福利-设定提存计划		10,488,784.53	10,487,929.34	855.19
合计	20,659,015.94	76,427,647.51	96,509,403.77	577,259.68

(2) 短期薪酬列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、工资、奖金、津贴和补贴	20,121,777.68	53,074,192.02	73,195,969.70	
2、职工福利费		775,005.99	775,005.99	
3、社会保险费		6,211,958.72	6,211,958.72	
其中：医疗保险费		5,794,692.87	5,794,692.87	
工伤保险费		97,926.50	97,926.50	
生育保险费		319,339.35	319,339.35	
4、住房公积金		4,424,814.72	4,424,814.72	
5、工会经费和职工教育经费	537,238.26	1,452,891.53	1,413,725.30	576,404.49
合计	20,659,015.94	65,938,862.98	86,021,474.43	576,404.49

(3) 设定提存计划列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险		7,550,845.18	7,549,989.99	855.19
2、失业保险费		232,550.30	232,550.30	
3、企业年金缴费		2,705,389.05	2,705,389.05	
合计		10,488,784.53	10,487,929.34	855.19

其他说明

无

47、应交税费

单位：元

项目	期末余额	期初余额
增值税	1,833,313.18	1,771,663.92
企业所得税	6,010,786.20	4,087,590.83
个人所得税	10,960.85	8,034.85
税金及附加	643,770.24	148,589.64
合计	8,498,830.47	6,015,879.24

其他说明

无

48、应付款项

无

49、合同负债

单位：元

项目	期末余额	期初余额
预收货款	716,855.00	1,000,000.00
合计	716,855.00	1,000,000.00

报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

无

50、其他应付款

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
待结算资产管理计划款项	1,153,766.01	1,085,141.20
应付标准仓单质押款	31,158,271.23	
应付保证金	24,275,053.80	2,034,551.68
应付佣金	1,408,135.79	1,452,492.29
应付审计费	964,612.35	1,641,219.20
应付风险抵押款	3,933,281.99	4,247,710.09
应付银期夜盘客户权益	21,621,022.86	
关联方借款	50,650,000.00	
其他	14,353,681.34	15,820,306.22
合计	149,517,825.37	26,281,420.68

51、持有待售负债

无

52、预计负债

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因及经济利益流出不确定性的说明
未决诉讼	1,969,920.97		1,969,920.97	0.00	
合计	1,969,920.97				

其他说明，包括重要预计负债的相关重要假设、估计说明：

无

53、长期借款

(1) 长期借款分类

单位：元

项目	期末余额	期初余额
抵押借款	102,940,502.00	116,925,986.00
未到期的应计利息	235,159.98	271,981.93
合计	103,175,661.98	117,197,967.93

长期借款分类的说明：

长期借款用于向南京金融城建设发展股份有限公司支付购房款以购买南京河西紫金金融中心房产并进行登记，长期借款的抵押物为登记的房产。

其他说明，包括利率区间：

利率区间具体内容详见本节“十一、1、市场风险管理”。

54、应付债券

无

55、租赁负债

单位：元

项目	期末余额	期初余额
1 年内	11,879,033.69	11,051,398.16
1 - 2 年	9,972,596.50	7,408,033.43
2 - 5 年	11,394,292.48	6,371,672.21
合计	33,245,922.67	24,831,103.80

其他说明：

无

56、递延收益

无

57、其他负债

(1) 按类别列示

无

(2) 其他应付款

本公司其他应付款单独列示，具体内容详见本节“七、50、其他应付款”。

(3) 应付股利

无

58、股本

单位：元

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	907,000,000.00						907,000,000.00

其他说明：

股东名称	2021年12月31日 余额	本期变动增减(+、-)					2022年6月30日 余额
		发行 新股	送股	公积金 转股	其他	小计	
江苏省苏豪控股集团有限公司	275,456,777.00						275,456,777.00
江苏弘业股份有限公司	147,900,000.00						147,900,000.00
江苏弘苏实业有限公司	143,548,000.00						143,548,000.00
江苏汇鸿国际集团股份有限公司	63,930,134.00						63,930,134.00
上海铭大实业(集团)有限公司	9,276,631.00						9,276,631.00
江苏弘瑞科技创业投资有限公司	8,903,113.00						8,903,113.00
江苏弘业国际物流有限公司	8,285,345.00						8,285,345.00
港股流通股	249,700,000.00						249,700,000.00
合计	907,000,000.00						907,000,000.00

59、其他权益工具

无

60、库存股

无

61、其他综合收益

单位：元

项目	期初余额	本期发生额	期末余额
----	------	-------	------

		本期所得 税前发生 额	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 损益	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 留存收益	减：所得 税费用	税后归属 于母公司	税后归属 于少数股 东	
二、将重 分类进损 益的其他 综合收益	- 7,385,168 .45	5,688,022 .51				5,688,022 .51		- 1,697,145 .94
其中：权 益法下可 转损益的 其他综合 收益	70.39	-20.94				-20.94		49.45
外币 财务报表 折算差额	- 7,385,238 .84	5,688,043 .45				5,688,043 .45		- 1,697,195 .39
其他综合 收益合计	- 7,385,168 .45	5,688,022 .51				5,688,022 .51		- 1,697,145 .94

单位：元

项目	期初余额	上期发生额					期末余额	
		本期所得 税前发生 额	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 损益	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 留存收益	减：所得 税费用	税后归属 于母公司		税后归属 于少数股 东
二、将重 分类进损 益的其他 综合收益	- 3,321,086 .16	- 1,710,504 .14				- 1,710,504 .14		- 5,031,590 .30
其中：权 益法下可 转损益的 其他综合 收益	76.63	-8.76				-8.76		67.87
外币 财务报表 折算差额	- 3,321,162 .79	- 1,710,495 .38				- 1,710,495 .38		- 5,031,658 .71
其他综合 收益合计	- 3,321,086 .16	- 1,710,504 .14				- 1,710,504 .14		- 5,031,590 .30

其他说明，包括对现金流量套期损益的有效部分转为被套期项目初始确认金额调整：

无

62、资本公积

单位：元

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）	533,124,529.52			533,124,529.52
其他资本公积	4,701,890.00			4,701,890.00

合计	537,826,419.52			537,826,419.52
----	----------------	--	--	----------------

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

63、盈余公积

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	66,606,194.62			66,606,194.62
合计	66,606,194.62			66,606,194.62

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

64、一般风险准备

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备	92,485,771.99			92,485,771.99
合计	92,485,771.99			92,485,771.99

65、未分配利润

单位：元

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	85,633,789.00	67,503,955.76
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		-371,877.91
调整后期初未分配利润	85,633,789.00	67,132,077.85
加：本期归属于母公司所有者的净利润	35,254,924.33	45,301,437.69
应付普通股股利		45,350,000.00
期末未分配利润	120,888,713.33	67,083,515.54

调整期初未分配利润明细：

- 1)、由于《企业会计准则》及其相关新规定进行追溯调整，影响期初未分配利润 0.00 元。
- 2)、由于会计政策变更，影响期初未分配利润 0.00 元。
- 3)、由于重大会计差错更正，影响期初未分配利润 0.00 元。
- 4)、由于同一控制导致的合并范围变更，影响期初未分配利润 0.00 元。
- 5)、其他调整合计影响期初未分配利润 0.00 元。

66、利息净收入

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	49,581,948.23	38,874,154.41
其中：货币资金及结算备付金利息收入	49,383,853.55	38,791,736.40

买入返售金融资产利息收入	198,094.68	82,418.01
利息支出	368,280.68	447,925.30
卖出回购金融资产款利息支出	368,280.68	447,925.30
利息净收入	49,213,667.55	38,426,229.11

67、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入情况

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
期货经纪业务净收入	141,509,969.37	135,117,839.40
资产管理业务净收入	4,440,009.88	6,227,455.92
合计	145,949,979.25	141,345,295.32

(2) 分行政区域营业部及手续费及佣金净收入情况

行政区域名称	2022年1-6月		2021年1-6月	
	营业部家数	手续费及佣金净收入	营业部家数	手续费及佣金净收入
江苏省	22	122,000,822.08	22	113,109,091.06
福建省	2	4,937,678.37	2	3,353,665.76
上海市	2	2,087,054.34	2	4,805,347.49
浙江省	2	2,999,283.74	2	3,215,489.48
河南省	1	897,125.68	1	2,275,334.06
广东省	3	1,299,169.25	3	1,659,045.39
北京市	2	756,024.39	2	1,179,402.59
中国香港	1	1,734,035.01	1	795,612.62
山东省	2	2,942,653.84	2	1,985,290.59
陕西省	1	773,118.10	1	1,779,901.00
安徽省	2	854,060.04	2	1,495,721.93
辽宁省	2	960,425.52	2	1,454,050.77
广西省	1	754,762.47	1	978,175.83
湖南省	1	633,624.20	1	1,252,965.13
重庆市	1	1,583,238.49	1	556,359.05
四川省	1	206,331.88	1	320,398.62
山西省	1	378,371.30	1	718,058.76
海南省	1	152,200.55	1	411,385.19
合计	48	145,949,979.25	48	141,345,295.32

(3) 财务顾问业务净收入

无

(4) 代理销售金融产品业务收入情况

无

(5) 资产管理业务开展及收入情况

单位：元

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	10	18	
期末客户数量	252	18	
其中：个人客户	83		
机构客户	169	18	
年初受托资金	11,997,108,290.62	9,226,352,422.95	
期末受托资金	16,544,209,596.13	5,198,256,859.53	
当期资产管理业务净收入	2,067,511.74	2,372,498.14	

68、投资收益

(1) 投资收益情况

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	1,167,305.91	13,221.42
金融工具投资收益	-26,831,112.77	309,837.32
其中：持有期间取得的收益	5,743,442.82	14,031,202.07
其中：交易性金融工具	5,743,442.82	14,031,202.07
处置金融工具取得的收益	-32,574,555.59	-13,721,364.75
其中：交易性金融工具	-15,999,243.12	6,900,405.46
衍生金融工具	-16,575,312.47	-20,621,770.21
合计	-25,663,806.86	323,058.74

(2) 交易性金融工具投资收益明细表

单位：元

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	5,743,442.82	14,031,202.07
	处置取得收益	-32,574,555.59	-13,721,364.75

其他说明：

对联营企业的投资收益

项目	2022年1-6月	2021年1-6月

项目	2022 年 1-6 月	2021 年 1-6 月
江苏弘瑞新时代创业投资有限公司	1,262,024.03	7,279.26
江苏弘瑞成长创业投资有限公司	-94,718.12	5,942.16
合计	1,167,305.91	13,221.42

本公司不存在投资收益汇回的重大限制。

69、净敞口套期收益

无

70、其他收益

单位：元

产生其他收益的来源	本期发生额	上期发生额
政府补助	192,451.57	3,121,819.70
个税返还	131,823.97	57,046.61

71、公允价值变动收益

单位：元

产生公允价值变动收益的来源	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-19,833,457.38	15,182,686.76
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-19,833,457.38	15,182,686.76
交易性金融负债	4,633,498.25	-5,508,804.69
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	4,633,498.25	-5,508,804.69
衍生金融工具	9,575,458.14	-2,245,523.70
合计	-5,624,500.99	7,428,358.37

其他说明：

无

72、其他业务收入

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
现货销售收入	587,924,746.06	587,643,957.09
咨询费收入及其他		543,643.83
合计	587,924,746.06	588,187,600.92

73、资产处置收益

单位：元

资产处置收益的来源	本期发生额	上期发生额
-----------	-------	-------

固定资产	-19,322.87	-132,684.12
------	------------	-------------

74、税金及附加

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	194,001.14	535,312.59
教育费附加	82,721.67	229,206.36
房产税	555,353.44	
地方教育费附加	55,147.81	152,804.32
其他	155,475.95	271,088.50
合计	1,042,700.01	1,188,411.77

其他说明：

无

75、提取期货风险准备金

项目	2022年1-6月	2021年1-6月
提取期货风险准备金	5,903,638.55	5,421,203.27
合计	5,903,638.55	5,421,203.27

76、业务及管理费

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	76,427,647.51	85,869,667.72
租赁费	4,692,994.20	5,023,249.60
折旧费	9,611,807.83	10,220,031.91
无形资产摊销	294,969.09	374,721.34
投资者保护基金	186,944.39	274,895.85
办公费	13,545,177.79	16,387,303.50
中介及咨询服务费	1,041,737.13	1,656,447.62
维护费	1,233,848.57	1,566,096.26
财务费用	3,968,924.89	4,064,851.18
其他	2,858,571.52	3,112,949.99
合计	113,862,622.92	128,550,214.97

77、资产减值损失

无

78、信用减值损失

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
应收货币保证金减值损失	440,814.33	-208,064.64
应收账款坏账损失	0.00	-352,431.97
其他应收款坏账损失	-67,537.55	-120,620.96
合计	373,276.78	-681,117.57

其他说明：

无

79、其他资产减值损失

无

80、其他业务成本

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
现货销售成本	587,831,642.68	581,111,944.78
合计	587,831,642.68	581,111,944.78

81、营业外收入

单位：元

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
政府补助	175,612.32	8,338.30	175,612.32
交易所赞助	55,852.36	402,607.09	55,852.36
其他	105,939.85	127,635.68	105,939.85
合计	337,404.53	538,581.07	337,404.53

计入当期损益的政府补助：

单位：元

补助项目	发放主体	发放原因	性质类型	补贴是否 影响当年 盈亏	是否特殊 补贴	本期发生 金额	上期发生 金额	与资产相 关/与收益 相关
香港特别行政区政府防疫抗疫基金补助	香港特别行政区政府	补助		否	是	175,612.32	0.00	与收益相关
保就业计划资助	香港特别行政区政府	补助		否	是	0.00	8,338.30	与收益相关

其他说明：

无

82、营业外支出

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
捐赠和赞助支出		50,000.00	
预计负债		1,969,920.97	
诉讼赔偿款		234,314.11	
其他	32,618.26	44,756.54	32,618.26
合计	32,618.26	2,298,991.62	32,618.26

其他说明：

无

83、所得税费用

(1) 所得税费用表

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	10,877,112.25	11,233,970.50
递延所得税费用	-97,057.09	3,890,488.53
合计	10,780,055.16	15,124,459.03

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

单位：元

项目	本期发生额
利润总额	46,034,979.49
按法定/适用税率计算的所得税费用	11,508,744.87
子公司适用不同税率的影响	893,815.39
非应税收入的影响	-520,237.37
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	825,706.89
内部交易未实现损益的影响	-1,927,974.63
所得税费用	10,780,055.16

其他说明：

无

84、其他综合收益

详见附注“七、61、其他综合收益”

85、现金流量表项目

(1) 收到的其他与经营活动有关的现金

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
收到证券清算款或赎回款		8,549,773.75

待结算资产管理计划款项	40,277,998.84	
收到标准仓单质押款	31,158,271.23	
收到的保证金及佣金	20,829,068.67	
收到结构化主体其他持有人资金	32,814,588.20	80,267,966.75
营业外收入及其他收益	661,680.07	3,717,447.38
其他	4,888,329.65	673,822.69
合计	130,629,936.66	93,209,010.57

收到的其他与经营活动有关的现金说明：

无

(2) 支付的其他与经营活动有关的现金

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
支付待结算款项	20,291,540.16	19,559,021.08
支付标准仓单质押款		13,447,865.33
支付的保证金及佣金		15,279,919.69
支付证券清算款或赎回款	537,337.21	
预付账款		8,646,905.78
支付的诉讼赔偿款	1,969,920.97	4,467,575.89
其他	14,123,138.38	5,165,099.80
合计	36,921,936.72	66,566,387.57

支付的其他与经营活动有关的现金说明：

无

(3) 收到的其他与投资活动有关的现金

无

(4) 支付的其他与投资活动有关的现金

无

(5) 收到的其他与筹资活动有关的现金

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
关联方借款	50,000,000.00	50,000,000.00
合计	50,000,000.00	50,000,000.00

收到的其他与筹资活动有关的现金说明：

无

(6) 支付的其他与筹资活动有关的现金

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
融资相关费用	340,566.04	754,716.98
合计	340,566.04	754,716.98

支付的其他与筹资活动有关的现金说明：

无

86、现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

单位：元

项目	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	35,254,924.33	45,301,437.69
加：资产减值损失		
固定资产折旧	3,025,609.16	3,440,856.12
使用权资产折旧	6,586,198.67	6,779,175.79
无形资产摊销	294,969.09	374,721.34
长期待摊费用摊销		
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）	19,322.87	132,684.12
固定资产报废损失（收益以“－”号填列）		
公允价值变动损失（收益以“－”号填列）	15,199,959.13	-9,673,882.07
利息支出	3,712,400.98	3,321,267.75
汇兑损失（收益以“－”号填列）	-2,639,036.48	979,760.16
投资损失（收益以“－”号填列）	9,088,494.39	-14,108,130.48
递延所得税资产减少（增加以“－”号填列）	-153,249.78	3,890,488.53
递延所得税负债增加（减少以“－”号填列）		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 等的减少（减少以“－”号填列）		
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-825,074,994.50	-564,572,013.35
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	4,183,769,704.84	804,792,102.98
其他	-42,255,351.22	8,252,591.75
经营活动产生的现金流量净额	3,386,828,951.48	288,911,060.33
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	7,499,183,859.33	2,983,522,729.92
减：现金的年初余额	4,106,185,249.67	2,854,855,864.32

加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加额	3,392,998,609.66	128,666,865.60

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

无

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

无

(4) 现金和现金等价物的构成

单位：元

项目	期末余额	期初余额
一、现金	7,499,183,859.33	4,106,185,249.67
可随时用于支付的银行存款	7,357,874,656.29	4,068,300,218.52
可随时用于支付的其他货币资金	141,309,203.04	37,885,031.15
三、期末现金及现金等价物余额	7,499,183,859.33	4,106,185,249.67

其他说明：

使用受到限制的现金及现金等价物具体内容详见本节“七、88、所有权或使用权受到限制的资产”。

87、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

无

88、所有权或使用权受到限制的资产

单位：元

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	1,657,076.42	产品募集资金账户和场外期权保证金
存货	45,985,026.82	交易所质押借款（红枣和棉花）
交易性金融资产	71,119,031.72	卖出回购交易质押
合计	118,761,134.96	

其他说明：

无

89、外币货币性项目**(1) 外币货币性项目**

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
----	--------	------	-----------

货币资金			
其中：美元	3,856,672.17	6.7114	25,883,669.62
欧元			
港币	146,094,392.44	0.8552	124,938,463.47
日元	187,664.00	0.0491	9,221.06
应收货币保证金	86,859,077.31	0.8552	74,281,014.32
其中：美元			
港币	86,859,077.31	0.8552	74,281,014.32

其他说明：

无

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

适用 不适用

单位名称	主要经营地	记账本位币	记账本位币选择依据
弘业国际金融控股有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币

90、套期

无

91、政府补助

(1) 政府补助基本情况

单位：元

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
稳岗补贴	192,451.57	其他收益	192,451.57
香港特别行政区政府防疫抗疫基金补助	175,612.32	营业外收入	175,612.32

(2) 政府补助退回情况

适用 不适用

其他说明：

2022 年 1-6 月政府补助明细

补助项目	金额	与资产相关 / 收益相关	下文机关	批准文件
稳岗补贴	9,218.37	与收益相关	安徽省人力资源和社会保障厅 安徽省财政厅国家税务总局 安徽省税务局	《关于落实援企稳岗有关政策的通知》
稳岗补贴	1,754.60	与收益相关	成都市人力资源和社会保障局 成都市财政局国家税务总局 成都市税务局	《关于落实相关惠企政策助企发展的通知》

稳岗补贴	8,945.28	与收益相关	福州市人力资源和社会保障局 福州市财政局国家税务总局 福州市税务局	《福建省人力资源和社会保障厅福建省财政厅国家税务总局福建省税务局关于做好失业保险稳岗位提技能防失业工作的通知》
稳岗补贴	11,789.22	与收益相关	广东省人力资源和社会保障厅 广东省财政厅国家税务总局 广东省税务局	《广东省人力资源和社会保障厅广东省财政厅国家税务总局广东省税务局关于做好失业保险稳岗位提技能防失业工作的通知》
稳岗补贴	5,464.58	与收益相关	广西壮族自治区人力资源和社会保障厅 广西壮族自治区财政厅国家税务总局 广西壮族自治区税务局	《广西壮族自治区人力资源和社会保障厅广西壮族自治区财政厅国家税务总局广西壮族自治区税务局关于做好失业保险稳岗位提技能防失业工作的通知》
稳岗补贴	86,572.00	与收益相关	江苏省人民政府	《省政府印发关于进一步帮助市场主体纾困解难着力稳定经济增长若干政策措施的通知》
稳岗补贴	14,364.00	与收益相关	辽宁省人力资源和社会保障厅 辽宁省财政厅国家税务总局 辽宁省税务局	《关于进一步做好助企纾困和民生保障有关工作的通知》
稳岗补贴	18,101.93	与收益相关	人力资源社会保障部财政部 国家税务总局	《人力资源社会保障部财政部国家税务总局关于做好失业保险稳岗位提技能防失业工作的通知》
稳岗补贴	4,872.96	与收益相关	陕西省人民政府办公厅	《陕西省人民政府办公厅关于印发进一步加大对中小企业纾困帮扶力度若干措施的通知》
稳岗补贴	1,226.28	与收益相关	深圳市人民政府	《深圳市人民政府关于印发应对新冠肺炎疫情进一步帮助市场主体纾困解难若干措施的通知》
稳岗补贴	19,026.00	与收益相关	苏州市人民政府	《苏州市人民政府印发关于进一步帮助市场主体纾困解难着力稳定经济增长若干政策措施的通知》
稳岗补贴	11,116.35	与收益相关	浙江省人力资源和社会保障厅 浙江省财政厅国家税务总局 浙江省税务局	《浙江省人力资源和社会保障厅浙江省财政厅国家税务总局浙江省税务局关于做好失业保险稳岗位提技能防失业工作的通知》
香港特别行政区政府防疫抗疫基金补助	175,612.32	与收益相关	香港特别行政区政府	香港特别行政区政府防疫抗疫基金

92、金融工具项目计量基础

(1) 金融资产计量基础分类表

单位：元

期末账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	7,536,812,255.03					

应收货币保证金	2,504,259,046.74					
交易性金融资产				846,829,186.47		
应收质押保证金	991,770,498.40					
衍生金融资产				9,871,158.50		
其他应收款	44,345,072.41					
合计	11,077,186,872.58			856,700,344.97		
期初账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	4,143,641,973.33					
应收货币保证金	2,025,860,140.16					
交易性金融资产				840,419,634.46		
应收质押保证金	668,817,393.60					
衍生金融资产				465,835.77		
买入返售金融资产	6,719,000.00					
其他应收款	24,951,725.11					
合计	6,869,990,232.20			840,885,470.23		

(2) 金融负债计量基础分类表

单位：元

期末账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
应付货币保证金	9,036,416,322.74			
应付质押保证金	974,938,338.40			
应付期货投资者保障基金	198,232.66			
卖出回购金融资产款	48,051,155.15			
交易性金融负债		114,652,344.11		
衍生金融负债		15,899,936.78		
应付职工薪酬	577,259.68			
其他应付款	149,517,825.37			
租赁负债	33,245,922.67			
长期借款	103,175,661.98			
合计	10,346,120,718.65	130,552,280.89		

期初账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
应付货币保证金	5,261,811,881.42			
应付质押保证金	668,817,393.60			
应付期货投资者保障基金	522,926.88			
卖出回购金融资产款	32,625,838.11			
交易性金融负债		86,471,254.16		
衍生金融负债		1,514,054.34		
应付职工薪酬	20,659,015.94			
其他应付款	26,281,420.68			
租赁负债	24,831,103.80			
长期借款	117,197,967.93			
合计	6,152,747,548.36	87,985,308.50		

93、其他

无

八、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

(1) 本期发生的非同一控制下企业合并

本集团 2022 年 1-6 月无通过非同一控制下企业合并取得的子公司。

(2) 合并成本及商誉

无

(3) 被购买方于购买日可辨认资产、负债

无

(4) 购买日之前持有的股权按照公允价值重新计量产生的利得或损失

是否存在通过多次交易分步实现企业合并并且在报告期内取得控制权的交易

是 否

(5) 购买日或合并当期期末无法合理确定合并对价或被购买方可辨认资产、负债公允价值的相关说明

无

(6) 其他说明

无

2、同一控制下企业合并

(1) 本期发生的同一控制下企业合并

本集团 2022 年 1-6 月无通过同一控制下企业合并取得的子公司。

(2) 合并成本

无

(3) 合并日被合并方资产、负债的账面价值

无

3、反向购买

交易基本信息、交易构成反向购买的依据、上市公司保留的资产、负债是否构成业务及其依据、合并成本的确定、按照权益性交易处理时调整权益的金额及其计算：

无

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

是 否

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

是 否

5、其他原因的合并范围变动

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

1、新设子公司

2022 年 1-6 月无新设子公司且纳入合并范围的主体。

2、注销或其他方式减少子公司

2022 年 1-6 月无注销或其他方式减少子公司。

3、结构化主体

2022 年 1-6 月本集团新纳入合并范围的结构化主体共 1 个，为“弘业博孚利 FOF2 号集合资产管理计划”，合并该结构化主体对本集团 2022 年 1-6 月的财务状况、经营成果和现金流量影响并不重大。

6、其他

无

九、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

(1) 企业集团的构成

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	
弘业资本管理有限公司	南京	深圳	大宗商品交易及风险管理	100.00%		设立
弘业国际金融控股有限公司	香港	香港	期货经纪	100.00%		同一控制下企业合并
弘业国际资产管理有限公司	香港	香港	资产管理		100.00%	设立
弘业国际基金系列 SPC	香港	开曼	基金投资		100.00%	设立
弘业国际固定收益基金	香港	开曼	基金投资		100.00%	设立

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：无

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

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》的规定，本集团将管理人为本集团或者本集团作为主要责任人、且本集团以自有资金参与、并满足新修订准则规定“控制”定义的结构化主体纳入合并报表范围。

截止 2022 年 6 月 30 日，本集团合并资产管理计划及基金的净资产规模为 194,863,734.36 人民币元，同时，本集团在合并资产管理计划及基金中所持有权益的账面价值为 80,211,390.25 人民币元，该权益在财务报告中计入交易性金融资产、货币资金、其他应收款以及其他应付款。

结构化主体名称	类型	本集团期末实际出资额
弘业科创量化优选 1 号资产管理计划	资产管理计划	人民币 509.83 万元
弘业瑞鑫 1 号集合资产管理计划	资产管理计划	人民币 500.00 万元
弘业价值成长 CTA1 号集合资产管理计划	资产管理计划	人民币 150.00 万元
弘业景信一期 FOF 集合资产管理计划	资产管理计划	人民币 200.00 万元
弘业博孚利 FOF2 号集合资产管理计划	资产管理计划	人民币 600.00 万元
弘业稳健成长 CTA2 集合资管计划	资产管理计划	人民币 500.00 万元
弘业固定收益基金	基金	美元 3,560,695.53 元
弘业广业基金 SP	基金	美元 3,128,802.70 元
弘业国际环球机遇基金 SP	基金	美元 2,547,179.40 元

确定公司是代理人还是委托人的依据：无

其他说明：

无

(2) 重要的非全资子公司

本集团不存在重要的非全资子公司。

(3) 重要非全资子公司的主要财务信息

无

(4) 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制

无

(5) 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持

本集团不存在向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持。

其他说明：

无

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易**(1) 在子公司所有者权益份额发生变化的情况说明**

本集团不存在在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的情况。

(2) 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响

无

其他说明

无

3、在合营安排或联营企业中的权益**(1) 重要的合营企业或联营企业**

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
江苏弘瑞新时代创业投资有限公司	江苏	江苏	风险投资等	22.00%		权益法
江苏弘瑞成长创业投资有限公司	江苏	江苏	风险投资等	9.90%		权益法

在合营企业或联营企业的持股比例不同于表决权比例的说明：无

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

本集团及本公司在报告期持有江苏弘瑞成长创业投资有限公司（以下简称“弘瑞成长”）9.901%的股权。依据弘瑞成长的公司章程，本集团及本公司指派一名董事会成员。本集团及本公司通过参加对被投资公司的生产经营决策，对其产生重大影响。因此，弘瑞成长作为联营企业计入本集团及本公司的财务报表。

(2) 重要合营企业的主要财务信息

无

(3) 重要联营企业的主要财务信息

单位：元

	期末余额/本期发生额		期初余额/上期发生额	
	弘瑞新时代	弘瑞成长		
流动资产	24,924,382.14	434,796.03	17,802,195.29	485,712.72
非流动资产	2,571,686.79	22,001,028.00	3,972,811.66	22,917,595.05
资产合计	27,496,068.93	22,435,824.03	21,775,006.95	23,403,307.77
流动负债		677,476.00	15,410.85	688,025.68
非流动负债		166.47		236.97
负债合计		677,642.47	15,410.85	688,262.65
少数股东权益				
归属于母公司股东权益				
按持股比例计算的净资产份额	6,049,135.17	2,154,277.56	4,787,111.14	2,249,016.62
调整事项				
--商誉				
--内部交易未实现利润				
--其他				
对联营企业权益投资的账面价值	6,049,135.17	2,154,277.56	4,787,111.14	2,249,016.62
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值				
营业总收入				
净利润	5,736,472.86	-956,652.06	33,087.54	60,015.73
终止经营的净利润				
其他综合收益	0.00	-210.94	0.00	-88.49
综合收益总额	5,736,472.86	-956,863.56	33,087.54	59,927.24
本年度收到的来自联营企业的股利	0.00	0.00	0.00	0.00

其他说明

无

(4) 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

无

(5) 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明

合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力未受到限制。

(6) 合营企业或联营企业发生的超额亏损

本集团不存在合营企业或联营企业发生的超额亏损。

(7) 与合营企业投资相关的未确认承诺

本集团无与合营企业投资相关的未确认承诺。

(8) 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

本集团无与合营企业或联营企业投资相关的或有负债。

4、重要的共同经营

无

5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

截止 2022 年 6 月 30 日，本集团发起设立但未纳入合并财务报表范围的结构化主体的净资产规模为人民币 23,364,326,618.49 元。

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益。本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中的权益在本集团合并资产负债表中的相关资产负债项目及其账面价值 / 最大损失敞口列示如下：

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
	交易性金融资产	交易性金融资产
基金	456,382,129.51	486,081,988.72
信托计划	131,888,708.50	126,522,054.80
资产管理计划	10,931,683.56	20,966,041.70
合计	599,202,521.57	633,570,085.22

报告期各期末，本集团因投资上述基金、信托计划、资产管理计划以及理财产品而可能遭受损失的最大风险敞口为其在报告日的公允价值。

6、其他

无

十、与金融工具相关的风险

与金融工具相关的风险参见本节“十一、风险管理”。

十一、风险管理

本集团从事风险管理的目标是在风险和收益之间取得适当的平衡，力求降低金融风险对本集团财务业绩的不利影响。基于该风险管理目标，本集团已制定风险管理政策以辨别和分析本集团所面临的风险，设定适当的风险可接受水平并设

计相应的内部控制程序，以监控本集团的风险水平。本集团会定期审阅这些风险管理政策及有关内部控制系统，以适应市场情况或本集团经营活动的改变。

1、市场风险管理

1、汇率风险

由于本集团主要业务集中在中国大陆且以人民币结算，因此除由于发行股票所形成的港币银行存款外，本集团无重大汇率风险。汇率风险主要是由港元和美元引起的。由于大多由发行股票而取得的货币资金已在报告期内转换为人民币，且目前涉及美元业务较少，因此汇率风险较低。

(1) 出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。外币报表折算差额未包括在内。本集团于期末各外币资产负债项目汇率风险敞口如下：

项目	2022年6月30日		2021年12月31日	
	外币余额	折算人民币余额	外币余额	折算人民币余额
货币资金				
港币	67,680,816.34	57,879,957.33	67,679,206.96	55,334,519.61
美元	46,974.92	315,267.48	44,625.80	284,520.73

(2) 本集团适用的人民币对外币的汇率分析

项目	平均汇率		报告日中间汇率	
	2022年1-6月	2021年1-6月	2022年6月30日	2021年12月31日
港币	0.82836	0.83383	0.85519	0.8176
美元	6.4809	6.4698	6.7114	6.3757

(3) 敏感性分析

假定除汇率以外的其他风险变量不变，于年末人民币对港币及美元的汇率变动使人民币升值10%将导致本集团股东权益和净利润的减少情况如下。此影响按资产负债表日即期汇率折算为人民币列示。

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
净利润及股东权益		
港币项目	-4,340,996.80	-4,150,088.97
美元项目	-23,645.06	-21,339.05

在假定其他变量保持不变的前提下，人民币对港币、美元的汇率变动使人民币贬值10%将导致本集团股东权益和净利润的变化和上表列示的金额相同但方向相反。

上表显示了于报告期末港币、美元兑换成人民币时，汇率变化对本集团的净利润及股东权益的即时影响。

上述敏感性分析是假设资产负债表日汇率发生变动，以变动后的汇率对资产负债表日本集团或本公司持有的、面临汇率风险的金融工具进行重新计量得出的。上述分析不包括外币报表折算差异。之前期间的分析基于同样的假设和方法。

2、利率风险

固定利率和浮动利率的带息金融工具分别使本集团面临公允价值利率风险及现金流量利率风险。本集团根据市场环境来决定固定利率与浮动利率工具的比例并通过定期审阅与监察维持适当的固定和浮动利率工具组合。本集团并未以衍生金融工具对冲利率风险。

(1) 本集团于年末持有的计息金融工具

项目	2022年6月30日		2021年12月31日	
	实际利率	金额	实际利率	金额
固定利率金融工具				

金融资产				
货币资金				
其中：期货保证金	2.30%-3.00%	3,890,000,000.00	2.45%-3.40%	3,665,000,000.00
自有资金				
应收货币保证金及应收质押保 证金	1.66%-1.85%	712,336,078.77	1.66%-1.85%	514,930,761.04
买入返售金融资产			3.157%-3.517%	6,719,000.00
交易性金融资产				
其中：交易性债券	1.00%-7.50%	170,590,921.26	1.00%-7.50%	97,121,997.66
信托计划	4.20%-8.10%	131,888,708.50	4.20%-8.10%	126,522,054.80
金融负债				
短期借款				
卖出回购金融资产款	2.515%-2.520%	48,037,201.72	2.847%-3.905%	32,601,000.00
长期借款	4.50%	102,940,502.00	4.50%	116,925,986.00
净额		4,753,838,004.81		4,254,047,827.50
浮动利率金融工具				
金融资产				
货币资金				
其中：期货保证金	0.001%-2.40%	3,354,452,355.04	0.001%-2.25%	294,706,206.55
自有资金	0.001%-1.95%	115,079,377.67	0.001%-1.95%	113,666,496.74
其他货币资金	0.35%	141,309,203.04	0.35%	37,885,031.15
净额		3,610,840,935.75		446,257,734.44

(2) 敏感性分析

固定利率金融工具的公允价值敏感性分析

截至 2022 年 6 月 30 日，在其他变量不变的情况下，假定利率上升 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润减少人民币 1,839,266.98 元；假定利率下降 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润增加人民币 1,897,448.29 元。

截至 2021 年 6 月 30 日，在其他变量不变的情况下，假定利率上升 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润减少人民币 1,702,811.21 元；假定利率下降 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润增加人民币 1,759,978.21 元。

浮动利率金融工具的现金流敏感性分析

截至 2022 年 6 月 30 日，在其他变量不变的情况下，假定利率上升 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润增加人民币 27,184,959.16 元；假定利率下降 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润下降人民币 25,108,713.43 元。

截至 2021 年 6 月 30 日，在其他变量不变的情况下，假定利率上升 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润增加人民币 2,485,079.54 元；假定利率下降 100 个基点将会导致本集团股东权益和净利润下降人民币 1,152,642.68 元。

对于资产负债表日持有的、使本集团面临现金流量利率风险的浮动利率非衍生工具，上述敏感性分析中的净利润及股东权益的影响是上述利率变动对按半年度估算的利息费用或收入的影响。

3、其他价格风险

其他价格风险是指本集团所持权益类金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集团主要投资于证券交易所上市的股票、基金等，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

敏感性分析

下列分析用于显示在所有其他参数保持不变的情况下，股票价格和商品价格上下波动 10%对本集团净利润和权益的影响。

项目	净利润	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
股票价格的变化		
上升 10%	4,994,858.84	6,790,065.90
下降 10%	-4,994,858.84	-6,790,065.90
商品价格的变化		
上升 10%	27,597,497.59	3,945,856.95
下降 10%	-27,597,497.59	-3,945,856.95

(续)

项目	股东权益	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
股票价格的变化		
上升 10%	4,994,858.84	6,790,065.90
下降 10%	-4,994,858.84	-6,790,065.90
商品价格的变化		
上升 10%	27,597,497.59	3,945,856.95
下降 10%	-27,597,497.59	-3,945,856.95

敏感性分析表明，假定股市指数和大宗商品期货市场在相关期间结束时出现变化且已用于重新测量本集团所持有的上述金融工具（可导致本集团在相关期间结束时出现股票和大宗商品价格风险），则可能出现本集团净利润和股东权益的暂时变化。同时，假定本集团的股权投资和对冲投资之公允价值将依据相关股市指数和大宗商品期货价格之间历史相关性而变化，所有其他参数保持不变。

2、信用风险管理

信用风险，是指金融工具的一方不能履行义务，造成另一方发生财务损失的风险。本集团的信用风险主要来自货币资金、应收货币保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、衍生金融资产、其他应收款和其他资产等。管理层会持续监控这些信用风险的敞口。

本集团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（包括衍生金融工具）的账面金额。

本集团除现金以外的货币资金主要存放于信用良好的金融机构，因此管理层认为货币资金及相应产生的利息不存在重大的信用风险。

对于存放于境内交易所等金融机构的应收货币保证金，本集团认为这些金融机构具有较高信誉和资产状况，存在较低的信用风险。

对于存放于境外期货交易经纪商的应收货币保证金，本集团于报告期末以谨慎原则参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计提损失准备。

对于应收账款和其他应收款，本集团定期对采用信用方式交易的客户进行评估。根据评估结果，本集团选择与经认可的且信用良好的客户进行交易，并对应收账款和其他应收款的余额进行监控。对于应收账款和其他应收款，本集团于报告期末以谨慎原则参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来 12 个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失及计提减值准备。对于已发生信用减值的应收款项，本集团会采取书面催款或法律仲裁等方式积极催款，在考虑可收回金额后以整个存续期内预期信用损失的金额计提损失准备。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集团无对外担保，因此，在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本集团资产负债表日最大信用风险敞口为本集团金融资产的账面金额减去相应的减值准备。本集团最大信用风险敞口列示如下：

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
货币资金	7,536,812,255.03	4,143,641,973.33
应收货币保证金	2,504,259,046.74	2,025,860,140.16
交易性金融资产	846,829,186.47	840,419,634.46
应收质押保证金	991,770,498.40	668,817,393.60
衍生金融资产	9,871,158.50	465,835.77
买入返售金融资产		6,719,000.00
应收款项	44,345,072.41	24,951,725.11
最大风险敞口合计	11,933,887,217.55	7,710,875,702.43

3、流动性风险管理

流动性风险，是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本公司及各子公司负责自身的现金管理工作，包括现金盈余的短期投资和筹措贷款以应付预计现金需求（如果借款额超过某些预设授权上限，便需获得本公司董事会的批准）。本集团的政策是定期监察其流动资金需求，确保其维持充裕的现金储备，以满足短期和长期流动资金需求。

本集团于资产负债表日的金融负债按未折现的合同现金流量（包括按合同利率（如果是浮动利率则按年末的现行利率）计算的利息）的剩余合约期限，以及被要求支付的最早日期如下：

1、2022 年 6 月 30 日

项目	即期	1 年内	1 年至 5 年以内	合计	资产负债表 账面价值
应付货币保证金	9,036,416,322.74			9,036,416,322.74	9,036,416,322.74
应付质押保证金	974,938,338.40			974,938,338.40	974,938,338.40
应付期货投资者保障基金		198,232.66		198,232.66	198,232.66
卖出回购金融资产款		48,051,155.15		48,051,155.15	48,051,155.15
交易性金融负债		114,652,344.11		114,652,344.11	114,652,344.11
衍生金融负债		15,899,936.78		15,899,936.78	15,899,936.78
应付职工薪酬		577,259.68		577,259.68	577,259.68
其他应付款		149,517,825.37		149,517,825.37	149,517,825.37
租赁负债		15,041,460.53	22,740,146.31	37,781,606.84	33,245,922.67
长期借款		32,198,126.41	79,460,067.08	111,658,193.49	103,175,661.98
合计	10,011,354,661.14	376,136,340.69	102,200,213.39	10,489,691,215.22	10,476,672,999.54

2、2021 年 12 月 31 日

项目	即期	1 年内	1 年至 5 年以内	合计	资产负债表 账面价值
应付货币保证金	5,261,811,881.42			5,261,811,881.42	5,261,811,881.42
应付质押保证金	668,817,393.60			668,817,393.60	668,817,393.60

应付期货投资者保障基金		522,926.88		522,926.88	522,926.88
卖出回购金融资产款		32,625,838.11		32,625,838.11	32,625,838.11
交易性金融负债		86,471,254.16		86,471,254.16	86,471,254.16
衍生金融负债		1,514,054.34		1,514,054.34	1,514,054.34
应付职工薪酬		20,659,015.94		20,659,015.94	20,659,015.94
其他应付款		26,281,420.68		26,281,420.68	26,281,420.68
租赁负债		11,974,787.90	14,433,350.15	26,408,138.05	24,831,103.80
长期借款		32,859,584.76	95,283,813.50	128,143,398.26	117,197,967.93
合计	5,930,629,275.02	212,908,882.77	109,717,163.65	6,253,255,321.44	6,240,732,856.86

4、操作风险

操作风险是指由于公司内部流程设置不合理，员工操作失误或未严格执行流程、信息技术系统问题以及外部事件等导致公司损失的风险。针对操作风险，集团建立合规、适用、清晰的日常运作制度体系，制定严格的业务流程和权限划分，完善业务制度，重要岗位采用双人复核，减少人为疏忽的概率，并建立健全绩效考核机制。同时通过建立应急预案、开展系统测试，加强应急备份通道建设等方式，避免交易、风控系统差错导致的风险。加强内部培训，持续提升员工专业能力，减少产品设计等方面定价错误的概率和可能性。

十二、金融资产及负债的公允价值管理

无

十三、公允价值的披露

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

单位：元

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
一、持续的公允价值计量	--	--	--	--
1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	475,098,220.09	229,404,632.10	142,326,334.28	846,829,186.47
（1）债务工具投资	145,282,541.26	25,308,380.00	131,888,708.50	302,479,629.76
（2）权益工具投资	329,815,678.83	204,096,252.10	10,437,625.78	544,349,556.71
（3）衍生金融资产	456,440.00		9,414,718.50	9,871,158.50
持续以公允价值计量的资产总额	475,554,660.09	229,404,632.10	151,741,052.78	856,700,344.97
1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	387,200.00		15,512,736.78	15,899,936.78
衍生金融负债	387,200.00		15,512,736.78	15,899,936.78

2. 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			114,652,344.11	114,652,344.11
其中：交易性金融负债			114,652,344.11	114,652,344.11
持续以公允价值计量的负债总额	387,200.00		130,165,080.89	130,552,280.89
二、非持续的公允价值计量	--	--	--	--

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

在活跃市场交易的金融工具的公允价值通过其在活跃市场的报价进行确定。活跃市场报价是指容易获取的、及时的交易所、券商、经纪人、行业协会、定价机构及监管机构等的报价，并且此类报价能够代表实际发生的公平市场交易的价格。

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

未在活跃市场交易的金融工具的公允价值通过使用价值评估方法进行确定。此类价值评估方法采用可行且不依赖实体特定估计的数据，在最大程度上使用可观测市场数据。如果金融工具的公允价值所需所有重要参数均可观测，则该金融工具包含在第二层级范围内。如果一个或多个重要参数未基于可观测市场数据，则该金融工具应包含在第三层级范围内。

报告期末，本集团金融工具的价值评估方法如下所述：

对于上市股票而言，公允价值基于报告期结束日股票买卖差价的收盘价确定。如果在报告期结束日无市场报价且在最近交易日之后经济环境出现重大变化，则采用价值评估方法确定公允价值。

对于交易所上市的投资基金，公允价值依据报告期结束日或最近交易日的买卖差价的收盘价确定。对于未上市开放式基金，公允价值通过基于报告期结束日的净资产价值报价确定。

对于通过场外交易市场交易的期货，公允价值通过使用基于具有类似特性的可观测大宗商品期货市场的价值评估方法确定。

对于公开市场的债券投资，公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价，相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

对于不存在公开市场的资产管理计划，公允价值通过基于报告期结束日的净资产价值报价确定。

在报告期间，本集团上述持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

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

对于第三层次金融工具，本集团通过现金流折现模型及其他类似评估方法确定其价值。是否分类为第三层次评估方法一般基于非可观测市场数据对整个公允价值计量的重要性。下表显示了第三层次主要金融工具的相关价值评估方法和参数：

金融工具	价值评估方法	重大不可观测参数	不可见参数与公允价值的关系
资产管理计划、信托计划、理财产品及资产支持证券	现金流折现模型	风险调整折现率	风险调整折现率越高，公允价值越低
场外期权	彭博社 OVML 功能，布莱克斯科尔 PDE、克拉克尼尔森有限差分法求解偏微分方程	隐含波动率	隐含波动率越高，公允价值越高
交易性金融负债 其中：指定以公允价值计量的	底层金融工具估值与合约分配法	合约分配率	合约分配率越高，公允价值越高(收益时)/越

应付款项						低(亏损时)
------	--	--	--	--	--	--------

报告期末，上述持续第三层次公允价值计量的资产和负债的公允价值的估值技术并未发生变更。

持续的第三层次公允价值计量的资产和负债的年初余额与年末余额之间的调节信息如下：

项目	2022年1月1日	本年利得或损失总额计入损益	购买	结算与出售	2022年6月30日	对于期末持有的资产和承担的负债，计入损益的当期未实现利得或损失
金融资产						
交易性金融资产						
其中：债务工具投资	126,522,054.80	4,036,417.34	55,000,000.00	53,669,763.64	131,888,708.50	1,888,708.50
权益工具投资	19,166,174.36	-88,248.33	5,000,000.00	13,640,300.25	10,437,625.78	372,087.77
衍生金融资产	431,533.27	8,983,185.23			9,414,718.50	9,414,718.50
金融资产小计	146,119,762.43	12,931,354.24	60,000,000.00	67,310,063.89	151,741,052.78	11,675,514.77
金融负债						
交易性金融负债						
其中：指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	86,471,254.16	-4,633,498.25	32,814,588.20		114,652,344.11	-408,959.19
衍生金融负债	1,171,915.17	14,340,821.61			15,512,736.78	15,512,736.78
金融负债小计	87,643,169.33	9,707,323.36	32,814,588.20		130,165,080.89	15,103,777.59
净额	58,476,593.10	3,224,030.88	27,185,411.80	67,310,063.89	21,575,971.89	-3,428,262.83

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

无

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

无

7、本期内发生的估值技术变更及变更原因

无

8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

本集团或本公司不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：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、买入返售金融资产、其他应收款、应付货币保证金、应付质押保证金、应付期货投资者保障基金、应付账款、应付职工薪酬和其他应付款等。报告期末，以上金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

9、其他

无

十四、关联方及关联交易

1、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	母公司对本企业的持股比例	母公司对本企业的表决权比例
江苏省苏豪控股集团有限公司	江苏省	金融、实业投资，授权范围内国有资产的经营、管理；国际贸易；房屋租赁；茧丝绸、纺织服装的生产、研发和销售	2,000,000,000.00	30.37%	30.37%

本企业的母公司情况的说明

无

本企业最终控制方是江苏省人民政府。

其他说明：无

2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注“九、1、在子公司中的权益”。

3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注“九、3、在合营安排或联营企业中的权益”。

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

无

其他说明

无

4、其他关联方情况

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
江苏省苏豪控股集团有限公司	本集团及本公司股东
江苏弘业股份有限公司	本集团及本公司股东
弘业资本管理有限公司	本公司全资子公司
弘业国际金融控股有限公司	本公司全资子公司
江苏汇鸿国际集团中鼎控股股份有限公司	本集团及本公司股东控股子公司
江苏弘瑞成长创业投资有限公司	本集团及本公司联营企业
江苏苏豪投资集团有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏苏豪国际集团股份有限公司	受同一最终控股公司控制

江苏苏豪尚品有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏苏豪轻纺有限公司	受同一最终控股公司控制
爱涛文化集团有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏爱涛文化产业有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏金融控股有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏弘业环保科技产业有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏省化肥工业有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏苏豪资产运营集团有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏苏豪传媒有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏苏豪健康产业有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏康泓汽车服务有限公司	受同一最终控股公司控制
海安市苏豪制丝有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏弘业国际技术工程有限公司	受同一最终控股公司控制
江苏弘业永昌（香港）有限公司	受同一最终控股公司控制
爱涛文化（英国）中心有限公司	受同一最终控股公司控制
爱涛文化贸易（荷兰）有限公司	受同一最终控股公司控制
储某某	关键管理人员关系密切的家庭成员

其他说明

无

5、关联交易情况

（1）购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

单位：元

关联方	关联交易内容	本期发生额	获批的交易额度	是否超过交易额度	上期发生额
江苏弘业股份有限公司	服务费				23,815.63
江苏爱涛文化产业有限公司	装修及采购费				2,657.00
江苏苏豪健康产业有限公司	采购款	8,035.40			
江苏弘业环保科技产业有限公司	采购款	1,159.29			132.74
江苏弘业国际技术工程有限公司	宣传费	27,982.30			
江苏金融控股有限公司	劳务费	111,828.60			293,508.16

出售商品/提供劳务情况表

单位：元

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
储某某	手续费收入		2,192.06
江苏苏豪投资集团有限公司	资管业务收入	3,102.23	
爱涛文化集团有限公司	资管业务收入	26,552.85	
江苏弘业股份有限公司	资管业务收入	26,552.85	
江苏省化肥工业有限公司	手续费收入	820.75	174.06
江苏弘业永昌（香港）有限公司	手续费收入	122,934.61	

爱涛文化（英国）中心有限公司	手续费收入	24,346.91	
爱涛文化贸易（荷兰）有限公司	手续费收入	3,936.91	

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明

无

（2）关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

无

（3）关联租赁情况

本公司作为出租方：

无

本公司作为承租方：

单位：元

出租方名称	租赁资产种类	简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用（如适用）		未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额（如适用）		支付的租金		承担的租赁负债利息支出		增加的使用权资产	
		本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
江苏弘业股份有限公司	房屋租赁	3,163,805.42	3,162,813.86								

关联租赁情况说明

无

（4）关联担保情况

本公司作为担保方

无

本公司作为被担保方

无

关联担保情况说明

无

（5）关联方资金拆借

单位：元

关联方	拆借金额	起始日	到期日	说明
拆入				
江苏省苏豪控股集团有限公司	50,000,000.00	2022年04月13日	2022年09月16日	2022年本公司第四届董事会第五次会议，审议通过了《关于弘业资本管理有限公司申请向江苏省苏豪控

				股集团有限公司借款的议案》，同意借款 5000 万元资金，借款利率 6%，借款期限五个月。借款期限为 4 月 13 号至 9 月 16 日。
拆出				
无				

(6) 关联方资产转让、债务重组情况

无

(7) 关键管理人员报酬

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员薪酬	1,626,631.59	3,244,878.72

(8) 其他关联交易

关联方	科目	关联交易内容	2022 年 1-6 月	2021 年 1-6 月
江苏弘业股份有限公司	不适用	净投资/处置资管计划	-10,210,099.26	
江苏爱涛文化产业有限公司	不适用	净投资/处置资管计划	-10,210,198.52	
江苏苏豪资产运营集团有限公司	不适用	净投资/处置资管计划		-10,000,000.00
江苏苏豪投资集团有限公司	不适用	净投资/处置资管计划	20,000,000.00	
江苏弘业永昌（香港）有限公司	不适用	净投资/处置资管计划	30,201,312.79	

6、关联方应收应付款项

(1) 应收项目

无

(2) 应付项目

单位：元

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
应付货币保证金	江苏苏豪国际集团股份有限公司	1,001.00	1,001.00
应付货币保证金	江苏汇鸿国际集团中鼎控股股份有限公司	1,001.00	1,001.00
应付货币保证金	江苏省化肥工业有限公司	2,925,943.16	2,843,893.50
应付货币保证金	爱涛文化集团有限公司	1,500.00	1,500.00

7、关联方承诺

无

8、其他

无

十五、股份支付**1、股份支付总体情况**适用 不适用**2、以权益结算的股份支付情况**适用 不适用**3、以现金结算的股份支付情况**适用 不适用**4、股份支付的修改、终止情况**

无

5、其他

无

十六、承诺及或有事项**1、重要承诺事项**

资产负债表日存在的重要承诺

已签订的尚未履行或尚未完全履行的对外投资合同

资本承担	2022年6月30日	2021年12月31日
已签订但未执行合同	42,000,000.00	42,000,000.00
已授权但未签订合同	78,000,000.00	78,000,000.00
合计	120,000,000.00	120,000,000.00

2、或有事项**(1) 资产负债表日存在的重要或有事项**

重要的未决诉讼或仲裁

2020 年 12 月，弘业资本上海分公司向南京市秦淮区人民法院提起诉讼（本案已根据江苏省高级人民法院于 2020 年 8 月 31 日向全省范围内各地中级人民法院发出的通知移送至江阴市人民法院管辖），诉讼请求为：要求汉邦（江阴）石化有限公司（下称汉邦石化）偿还 10,713,048.00 元及利息并承担案件受理费、保全费等全部诉讼费。江阴市人民法院于 2021 年 7 月 2 日作出判决，判决弘业资本上海分公司享有 10,713,048.00 元及利息。江阴市人民法院于 2021 年 2 月 3 日做出（2021）苏 0281 破 8 号《决定书》，汉邦石化目前处于破产重整阶段，并由江苏谋盛律师事务所担任管理人。弘业资本已提交债权申报文件。2021 年 7 月 14 日，汉邦石化管理人对弘业资本上海分公司债权的复审意见为本金 10,713,048 元及利息 48,590.28 元，合计债权金额 10,761,638.28 元。2022 年 1 月 28 日汉邦石化管理人组织召开汉邦石化债权人会议，债权人对汉邦石化《重整计划草案》进行审议并表决。1 月 29 日江阴市人民法院裁定：批准汉邦公司重整计划，终止汉邦公司重整程序。2 月 28 日，弘业资本上海分公司向汉邦石化管理人完成提交对债权清偿方案的选择涉及的相关材料。

本公司基于相关事实情况和谨慎性原则，在财务报表中就该案单项计提坏账准备 9,106,090.80 元。

除上文所述事项外，截止 2022 年 6 月 30 日，本集团未涉及预期会对财务状况及经营业绩造成重大不利影响的任何重大法律、仲裁或行政诉讼事件。

（2）公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明

公司不存在需要披露的重要或有事项。

3、其他

截至 2022 年 6 月 30 日，本集团无需要披露的其他或有事项。

十七、资产负债表日后事项

1、重要的非调整事项

单位：元

项目	内容	对财务状况和经营成果的影响数	无法估计影响数的原因
股票和债券的发行	根据中国证券监督管理委员会《关于核准弘业期货股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可（2022）1135 号），公司获准向社会公开发售人民币普通股股票（“A”股）100,777,778 股，每股面值人民币 1 元。公司于 2022 年 8 月 2 日收到发行所募集资金净额人民币 161,354,358.20 元，其中增加股本为人民币 100,777,778.00 元，增加资本公积为人民币 60,576,580.20 元。变更后的注册资本及股本为人民币 1,007,777,778.00 元。	161,354,358.20	

2、利润分配情况

单位：元

拟分配的利润或股利	30,233,333.34
利润分配方案	根据 2022 年 8 月 29 日公司第四届董事会第七次会议决议，上述利润分配预案尚待公司股东大会审议通过。

3、销售退回

无

4、其他资产负债表日后事项说明

除上述事项，截止报告出具日，本公司无重大资产负债表日后事项。

十八、其他重要事项

1、前期会计差错更正

(1) 追溯重述法

无

(2) 未来适用法

无

2、债务重组

无

3、资产置换

(1) 非货币性资产交换

无

(2) 其他资产置换

无

4、年金计划

无

5、终止经营

无

其他说明

无

6、分部信息

(1) 报告分部的确定依据与会计政策

本集团拥有期货经纪及资产管理业务部和大宗商品交易及风险管理业务部共 2 个报告分部。每个报告分部为单独的业务分部，提供不同的产品和劳务，由于每个分部需要不同的技术及市场策略而需要进行单独的管理。

期货经纪及资产管理业务部代表客户参与大宗商品期货与金融期货的交易，同时，其参与基于资产规模与客户需求的资产管理产品与服务的开发与销售。此外，资产管理计划、银行理财产品、上市与非上市证券、信托计划、基金、衍生金融工具的投资活动也由本分部执行。

大宗商品交易及风险管理业务部参与提供大宗商品购买和转售、期货套利、期现基差贸易和套期保值服务。

分部经营成果是指各个分部产生的收入（包括对外交易收入及分部间的交易收入），扣除各个分部发生的费用、归属于各分部的资产发生的折旧和摊销及减值损失、直接归属于某一分部的银行存款及银行借款所产生的利息净支出后的净额。分部之间收入的转移定价按照与其他对外交易相似的条款计算。本集团并没有将营业外收支及所得税费用分配给各分部。

（2）报告分部的财务信息

单位：元

项目	期货经纪及资产管理业务	大宗商品交易及风险管理业务	分部间抵销	合计
对外营业收入	176,587,166.17	578,156,907.99		754,744,074.16
分部间营业收入	-23,708,686.22	27,418,655.95	-3,709,969.73	
营业支出	-113,794,123.96	-595,219,756.98		-709,013,880.94
营业外收支	304,785.40	0.87		304,786.27
利润总额	39,389,141.39	10,355,807.83	-3,709,969.73	46,034,979.49
所得税费用	-5,332,674.04	-2,591,914.06	-2,855,467.06	-10,780,055.16
净利润	34,056,467.35	7,763,893.77	-6,565,436.79	35,254,924.33
资产总额	12,212,192,270.95	559,859,874.89	-405,934,457.59	12,366,117,688.25
负债总额	10,900,084,236.57	140,291,554.57	-397,368,056.41	10,643,007,734.73
其他重要项目：				
其中：利息净收入	48,555,675.16	657,992.39		49,213,667.55
折旧和摊销	9,895,122.47	11,654.45		9,906,776.92
除长期股权投资外非流动资产增加额	1,073,000.44	42,341.60		1,115,342.04

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

无

（4）其他说明

本集团按不同地区列示的有关取得的对外交易收入信息如下。对外交易收入是按接受服务或购买产品的客户的地进行划分。

项目	对外交易收入总额	
	2022年1-6月	2021年1-6月
中国大陆	759,344,225.40	776,492,783.64
中国香港	-4,600,151.24	1,284,180.85
合计	754,744,074.16	777,776,964.49

7、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

无

8、其他

无

十九、母公司财务报表主要项目注释

1、长期股权投资

单位：元

项目	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	546,242,079.81		546,242,079.81	546,242,079.81		546,242,079.81
对联营、合营企业投资	8,203,412.73		8,203,412.73	7,036,127.76		7,036,127.76
合计	554,445,492.54		554,445,492.54	553,278,207.57		553,278,207.57

(1) 对子公司投资

单位：元

被投资单位	期初余额（账面价值）	本期增减变动				期末余额（账面价值）	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	计提减值准备	其他		
弘业资本管理有限公司	390,000,000.00					390,000,000.00	
弘业国际金融控股有限公司	156,242,079.81					156,242,079.81	
合计	546,242,079.81					546,242,079.81	

(2) 对联营、合营企业投资

单位：元

投资单位	期初余额（账面价值）	本期增减变动								期末余额（账面价值）	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
一、合营企业											
二、联营企业											
江苏弘瑞新时代创业投资有限公司	4,787,111.14			1,262,024.03						6,049,135.17	
江苏弘瑞成长	2,249,016.62			-94,718	-20.94					2,154,277.56	

创业投资有限公司				.12							
小计	7,036,127.76			1,167,305.91	-20.94					8,203,412.73	
合计	7,036,127.76			1,167,305.91	-20.94					8,203,412.73	

(3) 其他说明

2、应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	20,160,381.89	58,865,109.79	78,483,283.68	542,208.00
二、离职后福利-设定提存计划		9,677,162.49	9,677,162.49	
合计	20,160,381.89	68,542,272.28	88,160,446.17	542,208.00

(2) 短期薪酬列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、工资、奖金、津贴和补贴	19,655,122.19	47,024,295.72	66,679,417.91	
2、职工福利费		488,422.00	488,422.00	
3、社会保险费		5,816,628.29	5,816,628.29	
其中：医疗保险费		5,439,296.40	5,439,296.40	
工伤保险费		86,369.59	86,369.59	
生育保险费		290,962.30	290,962.30	
4、住房公积金		4,161,214.64	4,161,214.64	
5、工会经费和职工教育经费	505,259.70	1,374,549.14	1,337,600.84	542,208.00
合计	20,160,381.89	58,865,109.79	78,483,283.68	542,208.00

(3) 设定提存计划列示

单位：元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险		6,926,255.22	6,926,255.22	
2、失业保险费		219,771.97	219,771.97	
3、企业年金缴费		2,531,135.30	2,531,135.30	
合计		9,677,162.49	9,677,162.49	

其他说明：

无

3、利息净收入

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	50,082,722.10	38,441,886.26
其中：货币资金及结算备付金利息收入	49,884,627.42	38,359,468.25
买入返售金融资产利息收入	198,094.68	82,418.01
利息支出	368,280.68	447,925.30
卖出回购金融资产款利息支出	368,280.68	447,925.30
利息净收入	49,714,441.42	37,993,960.96

4、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入情况

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
期货经纪业务净收入	118,091,219.18	108,465,997.42
资产管理业务净收入	5,283,548.27	6,549,814.18
合计	123,374,767.45	115,015,811.60

(2) 财务顾问业务净收入

无

(3) 代理销售金融产品业务收入情况

无

(4) 资产管理业务开展及收入情况

单位：元

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	16	18	
期末客户数量	272	18	
其中：个人客户	100		
机构客户	172	18	
年初受托资金	12,084,503,890.70	9,226,352,422.95	
期末受托资金	16,630,593,908.26	5,198,256,859.53	
当期资产管理业务净收入	2,911,050.13	2,372,498.14	

5、投资收益

(1) 投资收益情况

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	1,167,305.91	13,221.42
金融工具投资收益	-8,858,197.54	15,601,373.41
其中：持有期间取得的收益	7,481,382.11	8,943,780.73
其中：交易性金融工具	7,481,382.11	8,943,780.73
处置金融工具取得的收益	-16,339,579.65	6,657,592.68
其中：交易性金融工具	-16,339,579.65	6,657,592.68
合计	-7,690,891.63	15,614,594.83

(2) 交易性金融工具投资收益明细表

单位：元

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	7,481,382.11	8,943,780.73
	处置取得收益	-16,339,579.65	6,657,592.68

其他说明

无

6、公允价值变动收益

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-12,425,534.61	7,027,445.75
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-12,425,534.61	7,027,445.75
合计	-12,425,534.61	7,027,445.75

其他说明

无

7、业务及管理费

单位：元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	68,542,272.28	74,875,511.77
租赁费	4,664,125.85	4,907,437.58
折旧费	8,598,851.01	9,292,893.16
无形资产摊销	294,969.09	374,721.34
投资者保护基金		274,895.85
办公费	11,453,736.36	14,405,613.09

中介及咨询服务费	848,947.86	1,381,542.01
维护费	1,126,662.10	1,472,210.34
其他	4,115,930.47	4,925,472.61
合计	99,645,495.02	111,910,297.75

8、现金流量表补充资料

单位：元

项目	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	37,126,093.80	42,528,219.38
加：资产减值损失	-136,906.64	57,911.80
固定资产折旧	2,927,705.59	3,328,505.71
使用权资产折旧	5,671,145.42	5,964,387.45
无形资产摊销	294,969.09	347,939.38
长期待摊费用摊销		
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）	19,322.87	132,684.12
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）		
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	12,425,534.61	-7,027,445.75
利息支出	2,619,416.85	2,331,838.86
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-2,544,107.90	806,764.23
投资损失（收益以“-”号填列）	7,690,891.63	-15,614,594.83
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	2,373,025.16	4,001,040.80
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少（减少以“-”号填列）		
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-804,015,887.43	-581,507,919.23
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,092,330,093.63	768,029,997.50
其他	6,047,985.48	5,781,765.48
经营活动产生的现金流量净额	3,362,829,282.16	229,161,094.90
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	7,366,529,180.66	2,881,207,997.18
减：现金的年初余额	4,004,872,501.63	2,794,025,651.56
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加额	3,361,656,679.03	87,182,345.62

9、其他

无

二十、补充资料

1、当期非经常性损益明细表

适用 不适用

单位：元

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-19,322.87	
计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外）	368,063.89	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	260,997.92	
减：所得税影响额	137,544.49	
合计	472,194.45	--

其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况：

适用 不适用

公司不存在其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况。

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明

适用 不适用

2、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（元/股）	稀释每股收益（元/股）
归属于公司普通股股东的净利润	2.07%	0.0389	0.0389
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	2.04%	0.0383	0.0383

3、境内外会计准则下会计数据差异

(1) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用 不适用

(2) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用 不适用

(3) 境内外会计准则下会计数据差异原因说明，对已经境外审计机构审计的数据进行差异调节的，应注明该境外机构的名称

不适用

4、其他

无



(本页无正文，为弘业期货股份有限公司 2022 年半年度报告的签署页)



A handwritten signature in black ink, appearing to be "周利平", written over a horizontal line.

法定代表人

A red curved stamp or mark on the right side of the page, containing the characters "弘业" (Hongye) written vertically.