

证券代码：834277

证券简称：天风期货

主办券商：光大证券



天 风 期 货

NEEQ:834277

天风期货股份有限公司

半年度报告

2018

公司半年度大事记

2018年4月27日，经2018年第二次临时股东大会审议通过，公司向控股股东天风证券借入1亿元的次级债务用于补充净资本，期限为6年，利率为年化7.5%，按年付息，到期一次性还本。



2018年上半年，公司多次履行企业社会责任，先后于安图县赞助举办健康扶贫义诊捐助活动并与当地政府签订结对帮扶合作备忘录；在汪清县承办“健康扶贫 送药下乡”活动，为当地贫困户送去急需药品；联合吉林省民政厅、省慈善总会及其他社会企业向安图县亮兵镇中心小学无偿捐赠爱心图书；定点帮扶“十三五”贫困村——赣州市南康区隆木乡福田村等。同时，公司已签约参与大连商品交易所“农民收入保障计划”试点，助力乡村振兴战略。

目 录

声明与提示.....	5
第一节 公司概况	6
第二节 会计数据和财务指标摘要	8
第三节 管理层讨论与分析	10
第四节 重要事项	15
第五节 股本变动及股东情况	18
第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工情况	20
第七节 财务报告	24
第八节 财务报表附注	35

释义

释义项目	指	释义
公司、股份公司、天风期货	指	天风期货股份有限公司
天风天成、资产管理子公司	指	深圳天风天成资产管理有限公司
天示公司、风险管理子公司	指	天示(上海)企业管理有限公司
天风证券	指	天风证券股份有限公司
股东大会	指	天风期货股份有限公司股东大会
董事会	指	天风期货股份有限公司董事会
监事会	指	天风期货股份有限公司监事会
三会	指	股东大会、董事会、监事会
三会议事规则	指	《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《监事会议事规则》
管理层	指	对公司决策、经营、管理负有领导职责的人员,包括董事、监事、高级管理人员等
中国证监会、证监会	指	中国证券监督管理委员会
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《公司章程》	指	天风期货股份有限公司章程
高级管理人员	指	公司总经理、副总经理、董事会秘书、财务总监、首席风险官
会计师事务所	指	大信会计师事务所(特殊普通合伙)
报告期	指	2018年1月1日至2018年6月30日
元、万元	指	人民币元、人民币万元
主办券商、光大证券	指	光大证券股份有限公司

声明与提示

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

公司负责人张振、主管会计工作负责人陈佳及会计机构负责人（会计主管人员）王怡保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

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

【备查文件目录】

文件存放地点	天风期货股份有限公司董事会办公室
备查文件	1、载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表。 2、报告期内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

第一节 公司概况

一、 基本信息

公司中文全称	天风期货股份有限公司
英文名称及缩写	-
证券简称	天风期货
证券代码	834277
法定代表人	姚广
办公地址	上海市虹口区黄浦路99号504、06、08室

二、 联系方式

董事会秘书或信息披露负责人	黎澄
是否通过董秘资格考试	是
电话	027-87362579
传真	027-87362577
电子邮箱	licheng@thanf.com
公司网址	http://www.thanf.com
联系地址及邮政编码	湖北省武汉市武昌区中北路86号汉街总部国际E座31楼, 邮编:430071
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司半年度报告备置地	公司董事会秘书办公室

三、 企业信息

股票公开转让场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1996年3月29日
挂牌时间	2015年11月24日
分层情况	基础层
行业（挂牌公司管理型行业分类）	J 金融业-J67 资本市场服务-672 期货市场服务-6729 其他期货市场服务
主要产品与服务项目	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、受托资产管理、风险管理
普通股股票转让方式	集合竞价转让
普通股总股本（股）	314,400,000
优先股总股本（股）	0
做市商数量	0
控股股东	天风证券股份有限公司
实际控制人及其一致行动人	无

四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	91210000100023111F	否
金融许可证机构编码	91210000100023111F	否
注册地址	上海市虹口区黄浦路 99 号 504、06、08 室	否
注册资本（元）	314,400,000	否

五、 中介机构

主办券商	光大证券
主办券商办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号
报告期内主办券商是否发生变化	否
会计师事务所	-
签字注册会计师姓名	-
会计师事务所办公地址	-

六、 自愿披露

适用 不适用

七、 报告期后更新情况

适用 不适用

第二节 会计数据和财务指标摘要

一、 基本财务指标

单位：元

	本期/本期期末	上年同期/本期期初	增减比例
营业收入	216,701,433.99	59,333,691.25	265.22%
归属于挂牌公司股东的净利润	2,205,745.39	2,141,338.91	3.01%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	4,555,809.26	333,187.51	1,267.34%
加权平均净资产收益率（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	0.41%	0.52%	-
加权平均净资产收益率（依据归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	0.85%	0.08%	-
基本每股收益（元/股）	0.01	0.01	0.00%
经营活动产生的现金流量净额	178,708,702.56	-222,516,371.44	180.31%
资产总计	2,317,797,614.29	1,679,584,125.26	38.00%
负债总计	1,778,533,767.97	1,144,018,135.47	55.46%
归属于挂牌公司股东的净资产	539,263,846.32	535,565,989.79	0.69%
归属于挂牌公司股东的每股净资产（元/股）	1.72	1.70	1.18%
总资产增长率	38.00%	-20.80%	-
营业收入增长率	265.22%	-21.79%	-
净利润增长率%	3.01%	-90.17%	-
扣除客户权益的资产负债率%（母公司）	21.01%	35.93%	-
扣除客户权益的资产负债率%（合并）	24.23%	33.66%	-

二、 行业主要财务及监管指标

单位：股

	本期期末	本期期初	增减比例
净资本	308,437,668.44	265,556,180.54	16.15%
风险资本准备总额	79,385,676.37	90,956,019.73	-12.72%
净资本与风险资本准备总额的比例	388.53%	291.96%	-
净资本与净资产的比例	65.86%	55.06%	-
扣除客户保证金的流动资产	300,235,687.14	511,193,148.74	-41.27%
扣除客户权益的流动负债	122,480,981.12	270,431,286.06	-54.71%
流动资产与流动负债的比例（扣除客户权益）	245.13%	189.03%	-

负债与净资产的比例（扣除客户权益）	26.15%	56.08%	-
结算准备金额	232,111,638.17	90,880,381.11	155.40%

三、 补充财务指标

适用 不适用

四、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

适用 不适用

第三节 管理层讨论与分析

一、 商业模式

本公司是处于金融业-资本市场服务的期货公司，公司主营业务为商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询业务，并通过全资子公司深圳天风天成资产管理有限公司开展受托资产管理业务，通过全资子公司天示（上海）企业管理有限公司开展风险管理业务。

1、期货、期权经纪业务商业模式：

公司按照客户要求代理客户进行期货交易，妥善经营经纪业务。作为交易者与期货交易所之间的桥梁，公司根据客户指令代理买卖期货合约、办理结算和交割手续；对客户账户进行管理，控制客户交易风险；为客户提供期货市场信息，进行期货交易咨询，充当客户的交易顾问。

期货经纪业务收入主要包括交易手续费、交割手续费、交易所手续费返还或减收和保证金利息收入。期货经纪业务的主要营销渠道包括传统网点渠道、券商 IB 业务渠道和居间人。

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

2、投资咨询业务商业模式：

公司基于客户委托，从事风险管理顾问、期货研究分析、期货交易咨询等营利性业务。其中包括：协助客户建立风险管理制度、操作流程，提供风险管理咨询、专项培训，研究分析期货市场及相关现货市场的价格及其相关影响因素，制作、提供研究分析报告或者资讯信息，为客户设计套期保值、套利等投资方案，拟定期货交易策略等。投资咨询服务收入为其主要收入来源，投资咨询对象包括普通投资者、产业客户和机构投资者。

3、资产管理业务商业模式：

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

4、风险管理业务商业模式：

公司风险管理业务主要通过设立的风险管理子公司开展包括仓单服务、合作套保、基差交易、定价服务等与风险管理服务相关的试点业务，涵盖期货上市品种及其产业链相关品种的现货贸易、远期交易和期货交割等。公司风险管理业务以服务实体产业客户为宗旨，致力于为客户提供一流的期现结合与风险管理产品与服务，形成稳定、可持续的盈利模式和交易体系，发展成为业内领先的商品、金融市场风险管理服务商。

报告期内，公司的商业模式未发生实质性变化。

报告期后至报告披露日，公司的商业模式较报告期末未发生变化。

商业模式变化情况：

适用 不适用

二、 经营情况回顾

报告期内，公司共实现营业收入 21,670.14 万元，较去年同期增加 265.22%，其中资产管理子公司营业收入 1,041.90 万元，风险管理子公司营业收入 18,429.79 万元；公司营业支出 20,301.82 万元，较去年同期增长 283.76%，其中资产管理子公司营业支出 1,714.54 万元，风险管理子公司营业支出 14,906.57 万元；公司共实现净利润 220.57 万元，较去年同期增长 3.01%。

2018 年上半年手续费及佣金净收入为 1,806.68 万元，同比下降 55.34%，占营业收入比重为 8.34%。2018 年上半年公司分别实现期货经纪业务手续费收入 844.69 万元，同比下降 24.01%；投资咨询业务收入 64.53 万元，同比下降 94.06%；资产管理业务收入 897.47 万元，同比下降 51.44%。

经营活动产生的现金流量净额为 17,870.87 万元，同比增长 180.31%；投资活动产生的现金流量净额为 35,611.95 万元，同比增长 4528.63%；筹资活动产生的现金流量净额为 10,000.00 万元，同比下降 28.32%。

截止 2018 年 6 月 30 日，公司总股本为 31,440.00 万股，公司总资产为 231,779.76 万元，净资产为 53,926.38 万元。

三、 风险与价值

（一）传统经纪业务手续费收入下降的风险

目前公司期货经纪业务收入主要来源于手续费收入。期货经纪业务手续费收入变动主要取决于交易的活跃度和手续费率两个方面。交易的活跃度主要受资本市场走势影响较大，近年来随着期货市场竞争日益加剧，期货市场经纪业务手续费率持续下降，导致传统经纪业务手续费收入盈利能力较差，公司期货经纪业务面临着竞争风险以及盈利能力下降的风险。如果公司不能持续发展创新业务以减少传统经纪业务手续费收入占比较高的风险，将对公司的盈利情况带来不利影响。

应对措施：公司通过提高客户服务能力，完善客户结构，积极开拓创新业务，拓展收入增长点，降低经纪业务风险。

（二）交易所手续费返还（减收）不确定的风险

由于各交易所未明确规定手续费的返还、减收的政策及标准，造成现行有效的优惠政策具有不确定性，存在着降低手续费返还（减收）的金额或被取消的风险。如果未来交易所降低手续费返还（减收）的金额或取消手续费返还（减收）的优惠政策，将对公司的利润造成一定影响。

应对措施：公司通过积极开拓创新业务，大力开发机构客户，完善客户结构，拓宽业务收入增长点，减少对手续费返还的依赖，降低手续费返还不确定的风险。

（三）前五大客户变动较大的风险

公司前五大客户存在变动较大的风险，主要系我国期货公司所提供的经纪业务服务同质性比较高，而客户更换期货公司进行交易的成本也不高，同时加上期货公司之间互相抢夺拉拢竞争对手客户的现象时有发生，因此导致期货公司客户流动性较高。此外，有时期货公司的经纪人员跳槽也可能会带走其所服务过的部分客户。公司存在前五大客户变动较大的风险，客户的流失将对公司的收入和盈利造成不利影响。

应对措施：公司通过加强企业文化建设，提高员工专业水平、服务能力和服务质量；另一方面，针对不同类型客户提供有差异的个性化服务，努力为客户提供满意的服务，与客户建立长期、稳定、互信和互利的合作关系。

（四）利息收入大幅下滑的风险

利息收入是我国期货公司营业收入的重要来源之一，包括客户保证金和自有资金存款产生的利息。近年来公司的客户保证金和自有资金规模逐年上升，利息收入逐年增长，对营业收入贡献占比逐年增大，利率水平的变化也将影响公司的营业收入和净利润水平。如果利率水平出现大幅下滑，或者客户保证金和自有资金规模大幅下滑，可能导致公司出现业绩波动的风险。

另外，随着市场竞争加剧、客户保证金规模持续上升，市场关注度提高，如果未来行业政策发生变化，或者期货公司需要向客户支付利息，公司的利息收入可能存在大幅下滑风险，公司利息收入水平将受到较大影响。

应对措施：公司通过灵活运用自有资金，使用金融工具提高自有资金的收益水平，应对利息收入大幅下滑的风险。

（五）信息技术系统风险

信息技术系统是期货公司开展各项业务的重要载体，信息系统的安全性、有效性及合理性对业务发展至关重要，公司各项业务均依赖于信息技术系统的支持。公司重视信息技术系统的搭建和完善，持续加大对软硬件的投入，并制定了完整的信息技术相关制度，确保信息技术系统稳定运行。然而由于各种原因，信息技术系统仍可能出现硬件故障、软件崩溃、通信线路中断、遭受病毒、黑客攻击等情况。公司向客户提供的交易系统主要来源于与外部公司合作，自主研发能力相对不足。如果公司遭受上述突发性事件，或信息技术系统未能及时、有效地改进或升级而发生故障，可能对公司的声誉、竞争力和经营业绩造成不利影响。

此外，随着业务量的不断扩大，创新业务的不断推出，公司信息技术系统的处理能力和功能模块需要不断升级和扩展，以适应业务发展需要。若信息技术不能得到相应提升，公司的内部管理能力、客户服务水平、风险管理及内部控制能力将可能因此受到不利影响。

应对措施：公司通过不断构建与完善信息技术核心系统，提高信息技术系统的稳定性和有效运行；结合业务特征梳理各业务环节的信息技术风险，形成有效识别、监测、防范、应对突发事件的机制。

（六）风险管理和内部控制不够充分和有效的风险

公司对风险管理和内部控制的制度和政策随时提出补充及改进，以符合政策监管要求、加强公司的风险管理和改善公司的内部控制体系。但是公司无法保证该系统能够防范、识别和管理所有风险。并且制度的全面完善需要实践的过程，以全面评估其充分性和有效性；员工对新政策和制度的要求也无法保证及时准确地理解和遵循，员工自身执业操守不严格，也都会为公司带来业务风险甚至监管风险。

2018年5月23日，公司因“部分资产管理计划存在未经资产管理系统风控功能审核直接委托交易后，将交易结果补录到资产管理系统的情况，风险管理和内部控制等存在较大缺陷”的问题，被中国期货业协会给予“公开谴责”的纪律惩戒。

应对措施：公司与监管机构和行业协会紧密沟通，关注政策走向，及时改进风险管理和内部控制体系，加强其充分性和有效性；同时加强员工培训和执业操守教育及监管，增强员工对政策的理解、把握和自律，有效执行政策法规和内控制度，降低相关风险。

（七）股东资格无法获得监管部门批准的风险：

依照《期货公司监督管理办法》等有关法律法规的规定，单个股东或有关联关系的股东合计持股比例超过5%以上，或者控股股东、第一大股东发生变化，应当经中国证监会或其派出机构批准，否则应限期改正；未改正前，相应股份不得行使表决权。因此，公司存在股东资格无法获得监管机构批准的风险。

应对措施：公司严格做好股东资格前端合规审查工作，保证股东资格及相关报批程序符合监管规定。

（八）资产管理业务风险

受国内外金融市场、资产管理行业激烈的竞争环境以及监管机构对期货公司、私募基金监管政策的多重影响，公司和子公司虽有完善的内部控制及风险管理制度，子公司的资产管理业务仍将面临因监管政策变化、管理费降低、投资决策失败、合规经营失误以及专业人才缺失等较大的风险，可能导致公司资产管理规模下滑、经营收入、利润下降、公司声誉遭受一定影响等情况，极端情况下母公司有可能承担责任。

应对措施：公司将继续规范内部治理，不断优化子公司组织结构，进一步明确公司内部风险管理机构设置及权限，优化公司运营流程及风险管理体系，密切跟踪子公司资产管理业务开展情况，加强对资产管理业务的风险管控，确保资产管理业务风险可测、可控、可承受；持续引进、储备高素质专业人才，不断提升资产管理业务风险管理能力，促进资产管理业务持续发展、合规展业。

（九）行业竞争风险

国内期货行业近年来发展迅速，但仍处于经营分散、业务相对单一的状态，行业格局呈现出具有强大股东背景的券商系大型期货公司与具有区域优势的传统中小型期货公司共存的局面，行业面临激烈竞争。同时，商业银行及其他非银行金融机构存在向期货公司传统业务领域不断渗透的趋势，也与期货公司形成了潜在的竞争，使公司面临更大的竞争压力。此外，随着监管机构对于外资公司进入期货行业的监管政策逐渐放开，外资将不断进入期货市场，使得国内期货公司在人才、产品创新以及大客户资源等方面面临更为激烈的竞争。

应对措施：公司将通过不断完善业务模式，持续提升各项业务的服务内涵，深化客户服务工作，为客户提供优质的产品与服务。

（十）监管政策风险

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

应对措施：公司加强与监管机构和行业协会紧密沟通，密切关注政策变化，改进风险管理和内部控制体系，加强其充分性和有效性。

（十一）金融产品创新风险

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

应对措施：公司将加强对创新业务的制度建设和风险评估工作，结合监管要求，加大内部稽核，确保创新业务可持续发展。

（十二）经营风险

公司虽建立了较为完善的法人治理结构，重要的人事变动、对外投资、融资、关联交易事项均按照《公司章程》以及相关内部控制制度的规定程序规范进行。但如果公司的决策人员和管理人员在公司经营管理中出现失误，仍可能导致公司盈利水平下降的风险。

应对措施：公司将不断完善风险控制体系，加强经营风险管理，在重大经营决策上严格按照公司章程及内部控制制度的规定程序操作，并做好风险评估和风险应对措施。

（十三）财务风险

为了加强对期货公司的监督管理，监管机构对期货公司采取以净资本为核心的风险监管指标管理。公司的业务规模、业务资格存续和新业务申请均与净资本监管指标动态挂钩。若公司不满足净资本监管要求，将对公司各项业务发展造成不利影响。

若公司的客户保证金划转迟滞，或自有资金投资不当，导致公司的资金周转出现问题，可能使公司面临流动性风险。

应对措施：公司制定了明晰完备的财务管理制度、风险监管指标管理制度和自有资金管理制度，并严格按照监管要求和公司制度规定进行财务管理和风险管控。

四、 企业社会责任

公司坚定不移贯彻落实新时代中国特色社会主义思想 and 党的十九大精神，紧密围绕“坚决打赢脱贫攻坚战”以及“资本市场服务实体经济”两大主题，开展精准扶贫与“期货+保险”工作。

2018年上半年，公司多次履行企业社会责任，先后于吉林省安图县赞助举办健康扶贫义诊捐助活动并与当地政府签订结对帮扶合作备忘录；在汪清县承办“健康扶贫 送药下乡”活动，为当地贫困户送去急需药品；联合吉林省民政厅、省慈善总会及其他社会企业共同组织“书送希望”爱心书屋捐赠活动，向安图县亮兵镇中心小学无偿捐赠爱心图书；定点帮扶“十三五”贫困村——赣州市南康区隆木乡福田村等。同时，公司已签约参与大连商品交易所“农民收入保障计划”试点，将陆续在河北省广宗县、安平县开展“期货+保险”工作，为当地农民提供风险管理服务，助力乡村振兴战略。

五、 对非标准审计意见审计报告的说明

适用 不适用

第四节 重要事项

一、重要事项索引

事项	是或否	索引
是否存在重大诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	二（一）
是否存在偶发性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	二（二）
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资、企业合并事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股权激励事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	二（三）
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在被调查处罚的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在利润分配或公积金转增股本的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在普通股股票发行事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在存续至本期的债券融资事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	二（四）
是否存在存续至本期的可转换债券相关情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在自愿披露的其他重要事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

二、重要事项详情（如事项存在选择以下表格填列）

（一）报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
1. 向关联方收取期货交易手续费和投资咨询服务费	30,000,000.00	78,227.44
2. 购买关联方发行的理财产品	300,000,000.00	41,566,447.81
3. 购买关联方发行的理财产品的投资收益	50,000,000.00	327,358.47
4. 关联方在公司开立期货账户进行期货交易所缴纳的保证金	2,000,000,000.00	291,125,685.34
5. 向关联方发行定向资产管理计划	600,000,000.00	227,270,984.67
6. 向关联方发行定向资产管理计划收取的管理费	15,000,000.00	458,007.22
7. 租赁关联方的房屋和转租办公场所给关联方	3,000,000.00	0.00
8. 向关联方支付佣金	15,000,000.00	0.00

（二）报告期内公司发生的偶发性关联交易情况

单位：元

关联方	交易内容	交易金额	是否履行必要决策程序	临时公告披露时间	临时公告编号
天风证券股份有限公司	次级债务	100,000,000.00	是	2018年4月11日	2018-019
天风证券股份有限公司	次级债务利息	1,335,616.75	是	2018年4月11日	2018-019

偶发性关联交易的必要性、持续性以及对公司生产经营的影响：

上述关联交易是公司开展业务的正常所需，是合理的、必要的。本次关联交易不存在损害公司及其他非关联方股东利益的情况，有利于公司的财务状况和经营成果。

(三) 承诺事项的履行情况

1、2015年8月，天风期货控股股东天风证券就天风期货历史沿革中涉及的集体所有制企业和国有企业对外投资和股权转让及天风期货的资本充实性等有关事项，作出如下保证、承诺与声明：

“一、关于天风期货历史沿革中涉及的集体所有制企业和国有企业对外投资

天风期货历史沿革中存在涉及集体所有制企业（大连亚晨集团公司）和国有企业（大连理工高新技术有限公司、北京华实兴业公司）对外投资和股权转让的情形。由于该情形发生时间较远，现无法核查到该情形所涉及的集体所有制企业就对外投资和股权转让作出的内部决策文件、国有企业就对外投资作出的内部决策文件及与国有资产转让相关的资产评估及国有资产管理部门的批准文件。

有鉴于此，本公司现承诺：本公司保证不因天风期货历史沿革中涉及的集体所有制企业就对外投资和股权转让有关内部决策程序、国有企业就对外投资作出的内部决策程序及与国有资产转让相关的资产评估及国有资产管理部门的批准程序的缺失（若有），而影响本公司所持有的天风期货股份的合法性。若因本公司前项保证不实，并导致将来受让本公司所持天风期货全部或部分股份的受让方遭受损失，本公司将向股份受让方补偿其所遭受的全部损失。本公司将在股份受让方的损失经法院生效裁判或仲裁裁决确认后支付全部补偿款。

本项承诺自天风期货股票在全国中小企业股份转让系统挂牌之日起生效。

二、关于天风期货的资本充实性

本公司保证，截止天风期货改制设立为股份有限公司之日（2015年5月28日）前，天风期货的注册资本已由股东全部足额缴纳。若前项保证不实，本公司将向天风期货补足未足额缴纳部分及其利息（按同期银行贷款基准利率，自应缴纳之日起计至实际付清之日）。本公司承诺在未足额缴纳事项经公司登记机关依法认定或经法院生效裁判或仲裁裁决确认后，向天风期货支付未足额缴纳部分及其利息。

本项承诺自天风期货股票在全国中小企业股份转让系统挂牌之日起生效。

三、就其他事项的声明

本公司声明，本公司与大连亚晨集团公司、大连理工高新技术有限公司、北京华实兴业公司之间不存在关联关系，亦不存在其他利益安排。

本公司声明，本公司在受让天风期货股权时，已向股权转让方支付了全部转让对价。”

2、公司在全国股份转让系统挂牌前，本公司控股股东出具了《关于避免同业竞争的承诺函》。具体内容如下：

“1、本公司在中国大陆内，将不直接或间接参与任何在商业上对公司构成直接竞争的业务或活动；将不直接或间接开展对公司有直接竞争或可能构成直接竞争的业务、活动；将不拥有与公司存在竞争关系的任何经济实体、机构、经济组织的控制权；将不以其他形式取得该经济实体、机构、经济组织的控制权。

2、本公司愿意承担因违反上述承诺而给公司造成的全部经济损失。”

此外，公司在全国股份转让系统挂牌前，公司董事、监事、高级管理人员根据全国股份转让系统公开转让的相关要求对挂牌申报文件出具了相关声明和承诺。

报告期内，公司控股股东、董事、监事、高级管理人员均严格履行了上述承诺。

(四) 存续至本期的债券融资情况

单位：元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续时间	是否违约
-	-	其他	100,000,000.00	7.50%	2018年4月27日至2024年4月27日	否

注：本债券为公司于2018年4月27日向控股股东天风证券借入的规模为10000万元人民币的公司次级债务。

债券违约情况：

适用 不适用

第五节 股本变动及股东情况

一、普通股股本情况

(一) 报告期期末普通股股本结构

单位：股

股份性质		期初		本期变动	期末		
		数量	比例		数量	比例	
无限售 条件股 份	无限售股份总数	261,800,000	83.27%	0	261,800,000	83.27%	
	其中：控股股东、实际控制人	145,300,000	46.21%	0	145,300,000	46.21%	
	董事、监事、高管	0	0.00%	0	0	0.00%	
	核心员工	0	0.00%	0	0	0.00%	
有限售 条件股 份	有限售股份总数	52,600,000	16.73%	0	52,600,000	16.73%	
	其中：控股股东、实际控制人	52,600,000	16.73%	0	52,600,000	16.73%	
	董事、监事、高管	0	0.00%	0	0	0.00%	
	核心员工	0	0.00%	0	0	0.00%	
总股本		314,400,000	-	0	314,400,000	-	
普通股股东人数							14

(二) 报告期期末普通股前五名或持股 10%及以上股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例	期末持有 限售股份 数量	期末持有无限 售股份数量
1	天风证券股份有限公司	197,900,000	0	197,900,000	62.94%	52,600,000	145,300,000
2	武汉远洲生物工程有限公司	15,000,000	0	15,000,000	4.77%	0	15,000,000
3	武汉博卓化工有限公司	14,000,000	0	14,000,000	4.45%	0	14,000,000
4	孟辰星	12,500,000	0	12,500,000	3.98%	0	12,500,000
5	湖北银丰天睿资产管理有限公司	12,500,000	0	12,500,000	3.98%	0	12,500,000
合计		251,900,000	0	251,900,000	80.12%	52,600,000	199,300,000
前五名或持股 10%及以上股东间相互关系说明： 截止报告日，公司前五名股东及持股 10%以上股东之间无关联关系。							

二、存续至本期的优先股股票相关情况

□适用 √不适用

三、 控股股东、实际控制人情况

是否合并披露：

是 否

(一) 控股股东情况

公司的控股股东为天风证券股份有限公司，直接持有公司 19790 万股股份，占公司总股本的 62.94%，该股份不存在质押或其他争议事项。

天风证券成立于 2000 年 3 月 29 日，注册号为 91420100711894442U。住所为湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼，法定代表人为余磊，注册资本为 466,200 万元，经营范围为为期货公司提供中间介绍业务（上述经营范围中国家有专项规定的项目经审批后或凭许可证在核定范围与期限内经营）；证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；代销金融产品。（凭许可证在核定范围及期限内经营）。

报告期内，公司控股股东未发生变化。

(二) 实际控制人情况

无

第六节 董事、监事、高级管理人员及核心员工情况

一、董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生日期	学历	任期	是否在公司 领取薪酬
姚广	董事长、法定 代表人	男	1972年12月3日	研究生	2018.5-2021.4	是
吴建钢	董事	男	1972年5月5日	研究生	2018.4-2021.4	否
潘思纯	董事	男	1956年12月23日	本科	2018.4-2021.4	否
张振	董事、总经理	男	1984年4月2日	本科	2018.4-2021.4	是
姜培兴	独立董事	男	1968年7月26日	研究生	2018.4-2021.4	否
戚耕耘	监事会主席	男	1962年6月23日	专科	2018.5-2021.4	是
李继军	监事	男	1969年1月13日	研究生	2018.4-2021.4	是
王欢	职工监事	男	1983年2月10日	本科	2018.4-2021.4	是
黎澄	副总经理、董 事会秘书	女	1984年3月5日	本科	2018.5-2021.5	是
赵德华	副总经理	男	1963年11月4日	研究生	2018.5-2021.5	是
周雷	副总经理	男	1969年6月8日	研究生	2018.5-2021.5	是
吕东	副总经理	男	1971年3月26日	本科	2018.5-2021.5	是
林野	副总经理	女	1968年4月27日	研究生	2018.5-2021.5	是
顾永刚	副总经理	男	1970年9月5日	研究生	2018.5-2021.5	是
陈佳	财务总监	男	1974年12月9日	本科	2018.5-2021.5	是
聂志刚	首席风险官	男	1979年5月23日	研究生	2018.5-2021.5	是
董事会人数：						5
监事会人数：						3
高级管理人员人数：						9

董事、监事、高级管理人员相互间关系及与控股股东、实际控制人间关系：

董事、监事、高级管理人员相互之间无关联方关系；董事吴建钢、潘思纯为控股股东天风证券委派，吴建钢兼任天风证券常务副总裁、潘思纯兼任天风证券监事长；监事会主席戚耕耘兼任天风证券监事。

(二) 持股情况

单位：股

姓名	职务	期初持普通 股股数	数量变动	期末持普通 股股数	期末普通股 持股比例	期末持有股 票期权数量
无	-	0	0	0	0.00%	0
合计	-	0	0	0	0.00%	0

(三) 变动情况

信息统计	董事长是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
------	-----------	--

	总经理是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	首席风险官是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	董事会秘书是否发生变动	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
	财务总监是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：√适用 不适用

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
林野	副总经理、董事会秘书、大连分公司总经理	离任	副总经理、大连分公司总经理	个人原因辞去董事会秘书职务
黎澄	副总经理	新任	副总经理、董事会秘书	因原董事会秘书辞职，董事会决议任命
吕东	总经理助理	新任	副总经理	根据总经理提名，经董事会决议任命
赵蓉	监事	离任	合规稽核部经理	个人原因辞去监事职务
李继军	-	新任	监事	因原监事辞职，股东大会决议任命
刘敏	副总经理	换届	职员	换届离任
程江波	副总经理	换届	职员	换届离任
李昶	副总经理	换届	武汉营业部总经理	换届离任

报告期内新任董事、监事、高级管理人员简要职业经历√适用 不适用

黎澄女士：1984年生，中国国籍，无境外永久居住权，本科学历，曾任内蒙古海矿煤炭能源发展有限公司总经理助理、人福医药集团股份有限公司战略发展部市场管理岗，2009年3月任职于天风证券股份有限公司人力资源部组织发展岗，2012年12月加入天风期货股份有限公司，曾任人力资源部经理、监事，2016年5月起至今任公司副总经理，2018年2月6日起兼任公司董事会秘书。

吕东先生：1971年生，本科学士学位，1991年参加工作，曾就职于杭州微光电子设备厂，1993年7月任职浙江金马期货经纪有限公司市场部副总经理，1998年2月任职深圳彭路得电子设备有限公司浙江办事处营销总监，1999年12月任职南华期货股份有限公司市场总监，2007年7月任职银河期货有限公司上海分公司总经理，2016年8月任职银河德睿资本管理有限公司总经理。2017年9月加入天风期货股份有限公司，2018年2月6日起任公司副总经理。

李继军先生：1969年生，硕士学历，1991年参加工作，1991年至1994年就职于哈尔滨电表仪器厂，1997年至1998年就职于大鹏证券经纪业务部任部门高级经理，1998年至2001年就职于联合证券经纪业务部任部门高级经理，2001年至2003年就职于大通证券旅顺营业部任营业部经理，2003年至2012年就职于天风证券股份有限公司中山路营业部任营业部经理，2012年6月2018年3月任天风证券股份有限公司总裁助理、天风证券上海资产管理分公司总经理，2018年4月15日起任天风期货监事。

二、 员工情况

(一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

按工作性质分类	期初人数	期末人数
研究人员	26	35
财务人员	18	17
业务辅助人员	99	106
行政管理人員	21	25
市场人员	35	42
员工总计	199	225

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	0	1
硕士	52	62
本科	120	132
专科	23	27
专科以下	4	3
员工总计	199	225

员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：

公司在发展过程中始终坚持人力资源是公司发展的第一资源的管理理念。切实保证员工权益，按时向员工支付薪酬，依据国家有关法律、法规及地方相关社会保险政策，为员工办理养老、医疗、工伤、失业、生育等社会保险和住房公积金，为员工代缴代扣个人所得税。

不断丰富、完善人才培养机制，加大对人才的培养力度，制定了系列的培训计划与人才培育项目，多层次、多渠道、多领域、多形式地加强员工培训工作，包括新员工入职培训、在职人员业务培训、市场人员的营销技能培训、管理者提升培训等，不断提高公司员工的整体素质，以实现公司与员工共同成长。

截止报告期末，公司没有需承担费用的离职退休职工。

(二) 核心人员（公司及控股子公司）基本情况

核心员工：

适用 不适用

其他对公司有重大影响的人员（非董事、监事、高级管理人员）：

适用 不适用

核心人员的变动情况：

无

三、 报告期后更新情况

适用 不适用

2018年7月16日，公司首席风险官聂志刚先生因个人原因提出辞职。2018年7月31日，公司第二届董事会第二次会议审议通过《关于任命周雷代为履行首席风险官职责的议案》，同意聂志刚先生

的辞职申请，任命副总经理周雷代为履行首席风险官职责，代为履职时间自决议生效之日起不超过 3 个月。

第七节 财务报告

一、 审计报告

是否审计	否
------	---

二、 财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
流动资产：			
货币资金	第八节 二、(一)	1,257,987,476.33	623,159,281.69
其中：期货保证金存款		1,205,037,978.22	613,330,612.10
应收货币保证金	第八节 二、(二)	617,657,835.36	333,901,136.12
应收质押保证金	第八节 二、(三)	53,261,304.00	15,922,352.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	第八节 二、(四)	49,313,900.00	457,874,263.18
衍生金融资产	第八节 二、(五)	40,779,866.88	
应收票据及应收账款	第八节 二、(十七)	4,002,443.00	4,540,980.05
预付款项	第八节 二、(十七)	17,076,797.37	3,098,593.29
应收结算担保金	第八节 二、(六)	10,057,561.00	10,056,943.70
应收风险损失款			
应收佣金			
应收利息	第八节 二、(七)	4,972,942.28	7,194,914.17
应收股利			
其他应收款	第八节 二、(八)	9,447,939.44	1,854,029.62
买入返售金融资产	第八节 二、(九)		60,000,026.30
存货	第八节 二、(十)	18,472,698.09	
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产	第八节 二、(十七)	2,340,950.96	11,072,073.09
流动资产合计		2,085,371,714.71	1,528,674,593.21
非流动资产：			
可供出售金融资产	第八节 二、(十一)	197,473,880.29	86,193,004.01
持有至到期投资	第八节 二、(十二)		30,000,000.00
长期应收款			
长期股权投资			
期货会员资格投资	第八节 二、(十三)	1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产			
固定资产	第八节 二、(十四)	7,750,880.05	8,981,156.62

在建工程			
无形资产	第八节 二、(十五)	16,299,080.66	16,710,741.51
开发支出			
商誉			
长期待摊费用	第八节 二、(十七)	4,372,876.39	5,162,223.79
递延所得税资产	第八节 二、(十六)	4,193,791.76	658,560.17
其他非流动资产	第八节 二、(十七)	935,390.43	1,803,845.95
非流动资产合计		232,425,899.58	150,909,532.05
资产总计		2,317,797,614.29	1,679,584,125.26
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金	第八节 二、(十八)	1,552,832,834.43	856,351,367.11
应付质押保证金	第八节 二、(十九)	53,261,304.00	15,922,352.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
期货风险准备金	第八节 二、(二十一)	18,322,420.15	17,899,954.73
衍生金融负债		1,054,998.99	
应付票据及应付账款	第八节 二、(二十八)	605,088.89	581,157.27
预收款项		8,616,753.62	
卖出回购金融资产	第八节 二、(二十)		246,354,000.00
应付期货投资者保障基金	第八节 二、(二十二)	20,597.15	50,072.86
应付手续费及佣金	第八节 二、(二十五)	1,209,105.53	1,284,285.65
应付职工薪酬	第八节 二、(二十三)	1,730,821.57	2,122,372.99
应交税费	第八节 二、(二十四)	485,268.43	820,166.19
应付利息		1,335,616.75	597,423.56
应付股利			
其他应付款	第八节 二、(二十六)	25,472,066.82	1,608,137.51
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			
流动负债合计		1,664,946,876.33	1,143,591,289.87
非流动负债：			
长期借款			
应付债券	第八节 二、(二十七)	100,000,000.00	
其中：优先股			
永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债	第八节 二、(十六)	13,586,891.64	426,845.60
其他非流动负债			

非流动负债合计		113,586,891.64	426,845.60
负债合计		1,778,533,767.97	1,144,018,135.47
所有者权益（或股东权益）：			
股本	第八节 二、（二十九）	314,400,000.00	314,400,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	第八节 二、（三十）	124,180,267.29	124,180,267.29
减：库存股			
其他综合收益	第八节 二、（三十一）	2,764,412.92	1,272,301.78
专项储备			
盈余公积	第八节 二、（三十二）	4,273,752.10	4,273,752.10
一般风险准备	第八节 二、（三十三）	5,217,202.26	5,217,202.26
未分配利润	第八节 二、（三十四）	88,428,211.75	86,222,466.36
归属于母公司所有者权益合计		539,263,846.32	535,565,989.79
少数股东权益			
所有者权益合计		539,263,846.32	535,565,989.79
负债和所有者权益总计		2,317,797,614.29	1,679,584,125.26

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

（二） 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
流动资产：			
货币资金		1,207,480,450.18	616,896,697.16
其中：期货保证金存款		1,205,037,978.22	613,330,612.10
应收货币保证金		617,657,835.36	333,901,136.12
应收质押保证金		53,261,304.00	15,922,352.00
存出保证金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		49,313,900.00	398,219,220.00
衍生金融资产			
应收票据及应收账款			
预付款项		4,552,579.31	2,714,484.99
应收结算担保金		10,057,561.00	10,056,943.70
应收风险损失款			
应收佣金			
应收利息		4,972,942.28	7,181,352.53
应收股利			
其他应收款	第八节 八、（一）	1,333,297.03	1,289,166.34

存货			
持有待售资产			
一年内到期的非流动资产			
其他流动资产		1,980,875.42	61,454,065.49
流动资产合计		1,950,610,744.58	1,447,635,418.33
非流动资产：			
可供出售金融资产		100,816,570.79	338,300.51
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	第八节 八、(二)	164,000,000.00	155,000,000.00
期货会员资格投资		1,400,000.00	1,400,000.00
投资性房地产			
固定资产		5,720,277.59	6,328,385.15
在建工程			
无形资产		9,975,680.20	10,223,065.14
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		2,805,022.37	3,274,584.55
递延所得税资产		232,975.85	501,415.37
其他非流动资产		773,299.03	264,845.95
非流动资产合计		285,723,825.83	177,330,596.67
资产总计		2,236,334,570.41	1,624,966,015.00
流动负债：			
短期借款			
应付货币保证金		1,590,584,175.41	856,351,367.11
应付质押保证金		53,261,304.00	15,922,352.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
期货风险准备金		18,322,420.15	17,899,954.73
衍生金融负债			
应付票据及应付账款			
预收款项			
应付期货投资者保障基金		20,597.15	50,072.86
应付手续费及佣金		1,209,105.53	1,284,285.65
应付职工薪酬		1,524,455.36	2,025,472.06
应交税费		340,906.72	629,451.47
应付利息		1,335,616.75	597,423.56
应付股利			
其他应付款		1,504,611.94	1,590,625.73
持有待售负债			
一年内到期的非流动负债			
其他流动负债			246,354,000.00
流动负债合计		1,668,103,193.01	1,142,705,005.17

非流动负债：			
长期借款			
应付债券		100,000,000.00	
其中：优先股			
永续债			
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
预计负债			
递延收益			
递延所得税负债		204,142.70	
其他非流动负债			
非流动负债合计		100,204,142.70	
负债合计		1,768,307,335.71	1,142,705,005.17
所有者权益			
股本		314,400,000.00	314,400,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		124,180,267.29	124,180,267.29
减：库存股			
其他综合收益		612,428.09	-228.55
专项储备			
盈余公积		4,273,752.10	4,273,752.10
一般风险准备		5,217,202.26	5,217,202.26
未分配利润		19,343,584.96	34,190,016.73
所有者权益合计		468,027,234.70	482,261,009.83
负债和所有者权益合计		2,236,334,570.41	1,624,966,015.00

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

(三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、营业总收入		216,701,433.99	59,333,691.25
手续费及佣金净收入	第八节 二、(三十五)	18,066,826.74	40,457,426.51
其中：经纪业务手续费收入		8,446,850.99	11,115,602.14
资产管理业务收入		8,974,692.75	18,482,441.41
投资咨询业务收入		645,283.00	10,859,382.96
代理销售金融产品收入			
其他代理业务收入			
利息净收入	第八节 二、(三十六)	10,149,225.48	15,942,074.63

投资收益（损失以“-”号填列）	第八节 二、（三十七）	-10,752,213.35	-13,047,953.56
其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	第八节 二、（三十八）	51,739,012.62	12,498,902.19
汇兑收益（损失以“-”号填列）			
其他业务收入		147,498,582.50	3,483,241.48
其中：风险管理业务收入		147,036,909.21	
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
其他收益			
二、营业总成本		203,018,180.67	52,902,296.68
提取期货风险准备金	第八节 二、（四十一）	422,465.42	555,780.12
税金及附加	第八节 二、（三十九）	109,224.89	187,042.68
业务及管理费	第八节 二、（四十）	55,712,120.44	52,715,496.19
资产减值损失	第八节 二、（四十二）	371,335.41	-556,022.31
其他业务成本		146,403,034.51	
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		13,683,253.32	6,431,394.57
加：营业外收入	第八节 二、（四十三）	294,517.53	2,437,931.54
减：营业外支出	第八节 二、（四十四）	2,644,581.40	27,063.00
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,333,189.45	8,842,263.11
减：所得税费用	第八节 二、（四十五）	9,127,444.06	6,700,924.20
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,205,745.39	2,141,338.91
其中：被合并方在合并前实现的净利润			
（一）按经营持续性分类：	-	-	-
1. 持续经营净利润		2,205,745.39	2,141,338.91
2. 终止经营净利润			
（二）按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益			
2. 归属于母公司所有者的净利润		2,205,745.39	2,141,338.91
六、其他综合收益的税后净额		1,492,111.14	205,008.49
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		1,492,111.14	205,008.49
（一）以后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净负债或净资产的变动			

2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
(二) 以后将重分类进损益的其他综合收益		1,492,111.14	205,008.49
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		1,492,111.14	205,008.49
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额			
6. 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		3,697,856.53	2,346,347.40
归属于母公司所有者的综合收益总额		3,697,856.53	2,346,347.40
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		0.01	0.01
(二) 稀释每股收益			

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

(四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、营业收入		21,984,473.20	38,701,922.82
手续费及佣金净收入	第八节 八、(三)	9,094,591.48	21,974,985.10
其中：经纪业务手续费收入		8,449,308.48	11,115,602.14
资产管理业务收入			
投资咨询业务收入		645,283.00	10,859,382.96
代理销售金融产品收入			
其他代理业务收入			
利息净收入		9,533,666.20	15,840,733.19
投资收益（损失以“-”号填列）	第八节 八、(四)	2,278,885.52	886,204.53
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,077,330.00	

其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
其他业务收入			
其中：风险管理业务收入			
资产处置收益（损失以“-”号填列）			
其他收益			
二、营业成本		36,807,059.17	27,695,019.97
提取期货风险准备金		422,465.42	555,780.12
税金及附加		14,341.60	43,145.34
业务及管理费		36,366,375.45	27,090,135.04
资产减值损失		3,876.70	5,959.47
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		-14,822,585.97	11,006,902.85
加：营业外收入		294,517.53	2,388,756.70
减：营业外支出		50,000.00	27,063.00
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,578,068.44	13,368,596.55
减：所得税费用		268,363.33	3,435,703.20
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,846,431.77	9,932,893.35
（一）持续经营净利润		-14,846,431.77	9,932,893.35
（二）终止经营净利润			
六、其他综合收益的税后净额		612,656.64	706.33
（一）以后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净负债或净资产的变动			
2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益		612,656.64	706.33
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		612,656.64	706.33
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额			
6. 其他			

七、综合收益总额		-14,233,775.13	9,933,599.68
八、每股收益：			
（一）基本每股收益			
（二）稀释每股收益			

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

（五）合并现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		24,519,688.51	51,081,055.09
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		663,744,057.33	264,028,874.84
经营活动现金流入小计		688,263,745.84	315,109,929.93
购买商品、接受劳务支付的现金			
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		3,652,458.08	1,609,539.83
以现金支付的业务及管理费		24,697,478.30	16,087,361.85
支付给职工以及为职工支付的现金		32,585,889.56	28,698,499.35
支付的各项税费		707,181.34	14,128,496.92
支付其他与经营活动有关的现金		447,912,036.00	477,102,403.42
经营活动现金流出小计		509,555,043.28	537,626,301.37
经营活动产生的现金流量净额		178,708,702.56	-222,516,371.44
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		468,869,122.06	144,985,892.33
取得投资收益收到的现金		2,062,734.42	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		11,000.00	
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金		18,672,000.00	
投资活动现金流入小计		489,614,856.48	144,985,892.33
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		2,935,364.40	3,577,201.36
投资支付的现金		130,560,000.00	149,450,000.00
质押贷款净增加额			
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		133,495,364.40	153,027,201.36
投资活动产生的现金流量净额		356,119,492.08	-8,041,309.03
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			144,000,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		100,000,000.00	
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		100,000,000.00	144,000,000.00
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金			
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			4,500,000.00
筹资活动现金流出小计			4,500,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		100,000,000.00	139,500,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
五、现金及现金等价物净增加额		634,828,194.64	-91,057,680.47
加：期初现金及现金等价物余额		623,159,281.69	805,815,369.10
六、期末现金及现金等价物余额		1,257,987,476.33	714,757,688.63

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	本期金额	上期金额
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		13,547,216.13	22,106,895.86
收到的税费返还			
收到其他与经营活动有关的现金		512,095,302.33	262,379,700.00
经营活动现金流入小计		525,642,518.46	284,486,595.86
购买商品、接受劳务支付的现金			
客户贷款及垫款净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		3,641,680.19	1,571,303.20
以现金支付的业务及管理费		18,504,435.66	10,059,206.60

支付给职工以及为职工支付的现金	19,125,929.81	10,112,575.23
支付的各项税费	147,648.95	2,331,714.92
支付其他与经营活动有关的现金	238,375,704.17	472,542,403.42
经营活动现金流出小计	279,795,398.78	496,617,203.37
经营活动产生的现金流量净额	245,847,119.68	-212,130,607.51
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资收到的现金	356,172,158.35	1,660,730.19
取得投资收益收到的现金		
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	11,000.00	
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	356,183,158.35	1,660,730.19
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	2,446,525.01	3,041,109.72
投资支付的现金	109,000,000.00	50,000,000.00
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	111,446,525.01	53,041,109.72
投资活动产生的现金流量净额	244,736,633.34	-51,380,379.53
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金		144,000,000.00
取得借款收到的现金		
发行债券收到的现金	100,000,000.00	
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计	100,000,000.00	144,000,000.00
偿还债务支付的现金		
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		
支付其他与筹资活动有关的现金		4,500,000.00
筹资活动现金流出小计		4,500,000.00
筹资活动产生的现金流量净额	100,000,000.00	139,500,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		
五、现金及现金等价物净增加额	590,583,753.02	-124,010,987.04
加：期初现金及现金等价物余额	616,896,697.16	784,352,749.32
六、期末现金及现金等价物余额	1,207,480,450.18	660,341,762.28

法定代表人：姚广 主管会计工作负责人：陈佳 会计机构负责人：王怡

第八节 财务报表附注

一、 附注事项

(一) 附注事项索引

事项	是或否	索引
1. 半年度报告所采用的会计政策与上年度财务报表是否变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
2. 半年度报告所采用的会计估计与上年度财务报表是否变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
3. 是否存在前期差错更正	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
4. 企业经营是否存在季节性或者周期性特征	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
5. 合并财务报表的合并范围是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
6. 是否存在需要根据规定披露分部报告的信息	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	(二) 1
7. 是否存在半年度资产负债表日至半年度财务报告批准报出日之间的非调整事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
8. 上年度资产负债表日以后所发生的或有负债和或有资产是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
9. 重大的长期资产是否转让或者出售	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
10. 重大的固定资产和无形资产是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
11. 是否存在重大的研究和开发支出	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
12. 是否存在重大的资产减值损失	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
13. 是否存在预计负债	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	

(二) 附注事项详情（如事项存在选择以下表格填列）

1、 分部报告

(1) 分部报告的确定依据与会计政策

本公司的报告分部按照经营业务类型的不同，划分为：期货经纪业务分部、资产管理业务分部和金融贸易业务分部。

(2) 分部报告的财务信息

项 目	资产管理业务	期货经纪业务	金融贸易业务	抵消	合计
一、营业收入	10,419,025.43	21,984,473.20	184,297,935.36		216,701,433.99
手续费及佣金净收入	8,974,692.75	9,094,591.48		-2,457.49	18,066,826.74
投资收益	579,616.12	2,278,885.52	-13,613,172.48	2,457.49	-10,752,213.35
其他收入	864,716.56	10,610,996.20	197,911,107.84		209,386,820.60
二、营业支出	17,145,435.23	36,807,059.17	149,065,686.27		203,018,180.67
三、营业利润	-6,726,409.80	-14,822,585.97	35,232,249.09		13,683,253.32
四、资产总额	154,019,153.55	2,236,334,570.41	129,195,231.31	-201,751,340.98	2,317,797,614.29

五、负债总额	1,487,089.56	1,768,307,335.71	46,490,683.68	-37,751,340.98	1,778,533,767.97
六、补充信息					
资产减值损失	-14,999.03	3,876.70	382,457.74		371,335.41

二、 报表项目注释

(一) 货币资金

项 目	期末余额	期初余额
现金	1,806.60	5,549.14
银行存款	52,947,406.50	9,771,123.00
期货保证金存款	1,205,037,978.22	613,330,612.10
其他货币资金	285.01	51997.45
合 计	1,257,987,476.33	623,159,281.69

(二) 应收货币保证金

项 目	期末余额		
	结算准备金	交易保证金	小计
上海期货交易所	89,374,664.96	70,958,211.35	160,332,876.31
郑州商品交易所	57,579,925.72	45,905,584.80	103,485,510.52
大连商品交易所	53,315,250.44	71,131,406.45	124,446,656.89
中国金融期货交易所	83,897,833.59	92,550,205.40	176,448,038.99
上海国际能源交易中心	44,289,252.65	8,655,500.00	52,944,752.65
合 计	328,456,927.36	289,200,908.00	617,657,835.36

项 目	期初余额		
	结算准备金	交易保证金	小计
上海期货交易所	19,799,246.20	72,203,883.65	92,003,129.85
郑州商品交易所	48,576,801.72	14,139,839.65	62,716,641.37
大连商品交易所	23,056,902.35	48,810,118.75	71,867,021.10
中国金融期货交易所	22,772,958.80	84,541,385.00	107,314,343.80
合 计	114,205,909.07	219,695,227.05	333,901,136.12

(三) 应收质押保证金

1、 按交易所类别列示

项 目	期末余额	期初余额
中国金融期货交易所	24,006,104.00	15,922,352.00
上海期货交易所	29,255,200.00	
合 计	53,261,304.00	15,922,352.00

2、 按质押物类别列示

质押物类别	质押时市值	折扣率	期末市值
17 付息国债 24	20,002,920.00	80.00%	20,021,060.00

08 国债 25	10,003,950.00	80.00%	9,986,570.00
铝	36,634,000.00	80.00%	36,569,000.00
合 计	66,640,870.00	80.00%	66,576,630.00

(四) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

1、按类别列示

类 别	期末余额	期初余额
交易性金融资产	49,313,900.00	457,874,263.18
其中：基金投资		69,655,043.18
债券投资	49,313,900.00	388,219,220.00
合 计	49,313,900.00	457,874,263.18

2、按账面余额和初始成本列示

分 类	期末余额				期初余额			
	成本	公允价值	公允价值变动金额	减值准备	成本	公允价值	公允价值变动金额	减值准备
基金投资					70,000,000.00	69,655,043.18	-344,956.82	
债券投资	50,000,000.00	49,313,900.00	-686,100.00		389,982,650.00	388,219,220.00	-1,763,430.00	
合 计	50,000,000.00	49,313,900.00	-686,100.00		459,982,650.00	457,874,263.18	-2,108,386.82	

(五) 衍生金融资产/负债

类 别	期末余额			
	套期工具		非套期工具	
	公允价值		公允价值	
	资产	负债	资产	负债
期权			40,779,866.88	1,054,998.99

(六) 应收结算担保金

项 目	期末余额	期初余额
中国金融期货交易所	10,057,561.00	10,056,943.70
合 计	10,057,561.00	10,056,943.70

(七) 应收利息

项 目	期末余额	期初余额
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产利息	2,759,356.17	6168373.24

买入返售金融资产利息		115,062.62
持有至到期投资产品利息		13,561.64
其他	2,213,586.11	897,916.67
合 计	4,972,942.28	7,194,914.17

(八) 其他应收款

1、其他应收款分类

类 别	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款				
按组合计提坏账准备的其他应收款	10,123,282.21	100	675,342.77	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款				
合 计	10,123,282.21	100	675,342.77	

类 别	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款				
按组合计提坏账准备的其他应收款	2,129,692.92	100	275,663.30	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款				
合 计	2,129,692.92	100	275,663.30	

2、按组合计提坏账准备的其他应收款

采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

账 龄	期末余额			期初余额		
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面余额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	8,951,171.36	88.42	447,558.57	957,582.03	44.96	47,879.10
1 至 2 年	448,153.03	4.43	44,815.31	448,153.05	21.04	44,815.31
2 至 3 年	596,700.10	5.89	119,340.02	596,700.10	28.02	119,340.02
3 年以上	127,257.72	1.26	63,628.87	127,257.74	5.98	63,628.87
合 计	10,123,282.21	100	675,342.77	2,129,692.92	100	275,663.30

3、其他应收款按款项性质分类

款项性质	期末余额	期初余额
押金	1,822,704.62	1,277,557.34
保证金	7,878,769.28	619,963.98

代收代付社保、公积金	78,303.77	104,232.63
备用金	6,000.00	
其他	337,504.54	127,938.97
合 计	10,123,282.21	2,129,692.92

4、按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况

债务人名称	是否为关联方	款项性质	期末余额	账龄	占其他应收款期末余额合计数的比例 (%)	坏账准备余额
上海引领汽车配件有限公司	否	保证金	5,840,000.00	1 年以内	57.69	292,000.00
湖北省鄂旅投置业有限公司	否	保证金	464,194.80	3 年以内	4.59	92,838.96
重庆商社化工有限公司	否	保证金	449,568.00	1 年以内	4.44	22,478.40
上海三丰置业有限公司	否	押金	316,392.00	2 年以内	3.13	31,639.20
青岛广垦橡胶国际贸易有限公司	否	保证金	230,328.00	1 年以内	2.28	11,516.40
合 计			7,300,482.80		72.13	450,472.96

(九) 买入返售金融资产

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
债券		60,000,026.30
其中：中期票据		60,000,026.30
合 计		60,000,026.30

2、按业务类别列示

业务类别	期末余额	期初余额
银行间买断式买入返售		60,000,026.30
合 计		60,000,026.30

(十) 存货

项目	期末数		
	账面余额	跌价准备	账面余额
库存商品	18,472,698.09	0.00	18,472,698.09
合 计	18,472,698.09	0.00	18,472,698.09

项目	期初数		
	账面余额	跌价准备	账面余额
库存商品			

合 计			
-----	--	--	--

(十一) 可供出售金融资产

1、可供出售金融资产分类

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
公允价值计量：						
集合理财产品	96,657,309.50		96,657,309.50	49,669,385.98		49,669,385.98
私募基金				34,507,318.03		34,507,318.03
信托产品	100,816,570.79		100,816,570.79	2,016,300.00		2,016,300.00
合 计	197,473,880.29		197,473,880.29	86,193,004.01		86,193,004.01

2、期末按公允价值计量的可供出售金融资产

分 类	期末余额			
	权益工具的成本/债务工具的摊余成本	公允价值	累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	减值准备
集合理财产品	93,787,996.39	96,657,309.50	2,869,313.11	
信托产品	100,000,000.00	100,816,570.79	816,570.79	
合 计	193,787,996.39	197,473,880.29	3,685,883.90	

分 类	期初余额			
	权益工具的成本/债务工具的摊余成本	公允价值	累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	减值准备
集合理财产品	48,286,601.64	49,669,385.98	1,382,784.34	
私募基金	34,210,000.00	34,507,318.03	297,318.03	
信托产品	2,000,000.00	2,016,300.00	16,300.00	
合 计	84,496,601.64	86,193,004.01	1,696,402.37	

(十二) 持有至到期投资

项 目	期末余额	期初余额
国债逆回购		30,000,000.00
合 计		30,000,000.00

(十三) 期货会员资格投资

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
大连商品交易所会员资格投资	500,000.00			500,000.00

郑州商品交易所会员资格投资	400,000.00			400,000.00
上海期货交易所会员资格投资	500,000.00			500,000.00
合 计	1,400,000.00			1,400,000.00

(十四) 固定资产

项 目	运输工具	电子设备及其他	合 计
一、账面原值			
1. 期初余额	4,320,578.95	20,566,440.08	24,887,019.03
2. 本期增加金额	978,320.91	439,111.93	1,417,432.84
(1) 购置	978,320.91	439,111.93	1,417,432.84
3. 本期减少金额	84,204.00	125,897.43	210,101.43
(1) 处置	84,204.00	125,897.43	210,101.43
4. 期末余额	5,214,695.86	20,879,654.58	26,094,350.44
二、累计折旧			
1. 期初余额	2,342,669.45	13,563,192.96	15,905,862.41
2. 本期增加金额	281,686.61	2,235,915.17	2,517,601.78
(1) 计提	281,686.61	2,235,915.17	2,517,601.78
3. 本期减少金额	79,993.80		79,993.80
(1) 处置	79,993.80		79,993.80
4. 期末余额	2,544,362.26	15,799,108.13	18,343,470.39
三、减值准备			
1. 期初余额			
2. 本期增加金额			
3. 本期减少金额			
4. 期末余额			
四、账面价值			
1. 期末账面价值	2,670,333.60	5,080,546.45	7,750,880.05
2. 期初账面价值	1,977,909.50	7,003,247.12	8,981,156.62

(十五) 无形资产

项 目	软件使用权	合 计
一、账面原值		
1. 期初余额	22,750,636.22	22,750,636.22
2. 本期增加金额	745,381.39	745,381.39
(1) 购置	745,381.39	745,381.39
3. 本期减少金额		
4. 期末余额	23,496,017.61	23,496,017.61
二、累计摊销		

1. 期初余额	6,039,894.71	6,039,894.71
2. 本期增加金额	1,157,042.24	1,157,042.24
(1) 计提	1,157,042.24	1,157,042.24
3. 本期减少金额		
4. 期末余额	7,196,936.95	7,196,936.95
三、减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
3. 本期减少金额		
4. 期末余额		
四、账面价值		
1. 期末账面价值	16,299,080.66	16,299,080.66
2. 期初账面价值	16,710,741.51	16,710,741.51

(十六) 递延所得税资产和递延所得税负债

1、已确认的递延所得税资产和递延所得税负债

项 目	期末余额	期初余额
递延所得税资产：		
资产减值	221,552.31	128,718.46
可供出售金融资产	0	76.19
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	171,525.00	529,765.52
未弥补的亏损	3,800,714.45	
合 计	4,193,791.76	658,560.17
递延所得税负债：		
可供出售金融资产	921,470.98	424,176.78
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		2,668.82
衍生金融资产—场外期权	12,665,420.66	
合 计	13,586,891.64	426,845.60

2、引起暂时性差异的资产或负债项目对应的暂时性差异

项 目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异：		
资产减值	886,209.23	514,873.82
可供出售金融资产		304.74
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	686,100.00	2,119,062.09
为弥补的亏损	15,202,857.80	
合 计	16,775,167.03	2,634,240.65
应纳税暂时性差异：		

可供出售金融资产	3,685,883.90	1,696,707.11
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		10,675.27
衍生金融资产--场外期权	50,661,682.62	
合 计	54,347,566.52	1,707,382.38

(十七) 其他资产

1、按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
预付账款	17,076,797.37	3,098,593.29
长期待摊费用	4,372,876.39	5,162,223.79
应收账款	4,213,309.46	4,780,190.57
其他流动资产	2,340,950.96	11,072,073.09
其他非流动资产	935,390.43	1,803,845.95
减：减值准备	210,866.46	239,210.52
合 计	28,728,458.15	25,677,716.17

2、应收账款

(1) 应收账款分类

类 别	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的应收账款				
按组合计提坏账准备的应收账款	4,213,309.46	100	210,866.46	5-10
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收账款				
合 计	4,213,309.46	100	210,866.46	

类 别	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的应收账款				
按组合计提坏账准备的应收账款	4,780,190.57	100	239,210.52	5-10
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收账款				
合 计	4,780,190.57	100	239,210.52	

(2) 按组合计提坏账准备的应收账款

采用账龄分析法计提坏账准备的应收账款

账 龄	期末余额			期初余额		
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面余额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	4,209,289.65	99.90	210,464.48	4,776,170.76	99.92	238,808.54
1-2 年	4,019.81	0.10	401.98	4,019.81	0.08	401.98
合 计	4,213,309.46	100.00	210,866.46	4,780,190.57	100.00	239,210.52

3、长期待摊费用

项 目	期初余额	本年增加	本年摊销	其他减少	期末余额
装修改造费	3,639,127.81	89,553.40	682,501.85		3,046,179.36
软件服务费	1,523,095.98	260,839.62	457,238.57		1,326,697.03
合 计	5,162,223.79	350,393.02	1,139,740.42		4,372,876.39

(十八) 应付货币保证金

项 目	期末余额		期初余额	
	户数	金额	户数	金额
自然人	10,396.00	571,063,202.76	10,058.00	263,944,549.00
法人	329.00	981,769,631.67	282.00	592,406,818.11
合 计	10,725.00	1,552,832,834.43	10,340.00	856,351,367.11

(十九) 应付质押保证金

项 目	期末余额		期初余额	
	户数	金额	户数	金额
法人	3.00	53,261,304.00	1.00	15,922,352.00
合 计	3.00	53,261,304.00	1.00	15,922,352.00

(二十) 卖出回购金融资产款

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
债券		246,354,000.00
其中：短期融资券		196,654,000.00
中期票据		49,700,000.00
合 计		246,354,000.00

2、按业务类别列示

业务类别	期末余额	期初余额
银行间质押式卖出回购		246,354,000.00

合 计		246,354,000.00
-----	--	----------------

(二十一) 期货风险准备金

项目	期初余额	本期增加额	本期使用额	期末余额	计提方法	计提比例 (%)
期货风险准备金	17,899,954.73	422,465.42		18,322,420.15	按手续费净收入计提	5

(二十二) 应付期货投资者保障金

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
应付期货投资者保障金	50,072.86	20,382.28	49,857.99	20,597.15

(二十三) 应付职工薪酬

1、应付职工薪酬分类列示

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
一、短期薪酬	2,122,372.99	28,493,794.39	28,885,345.81	1,730,821.57
二、离职后福利-设定提存计划		2,467,096.69	2,467,096.69	
三、辞退福利项目		126,545.49	126,545.49	
合 计	2,122,372.99	31,087,436.57	31,478,987.99	1,730,821.57

2、短期职工薪酬情况

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	2,098,478.39	24,631,609.91	25,023,145.22	1,706,943.08
2、职工福利费		1,067,395.39	1,067,395.39	
3、社会保险费		1,288,598.99	1,288,598.99	
其中： 医疗保险费		1,140,540.55	1,140,540.55	
工伤保险费		32,834.25	32,834.25	
生育保险费		115,224.19	115,224.19	
4、住房公积金		1,434,670.52	1,434,670.52	
5、工会经费和职工教育经费	23,894.60	71,519.58	71,535.69	23,878.49
合 计	2,122,372.99	28,493,794.39	28,885,345.81	1,730,821.57

3、设定提存计划情况

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		2,395,743.54	2,395,743.54	
2、失业保险费		71,353.15	71,353.15	
合 计		2,467,096.69	2,467,096.69	

(二十四) 应交税费

项 目	期末余额	期初余额
增值税	109,286.33	182,278.63
城市建设税	16,407.06	21,417.55
企业所得税	0.00	17,995.55
教育费附加	6,698.92	8,574.61
个人所得税	273,760.15	539,947.25
其他税费	79,115.97	49,952.60
合 计	485,268.43	820,166.19

(二十五) 应付手续费及佣金

项 目	期末余额	期初余额
应付佣金	1,209,105.53	1,284,285.65
合 计	1,209,105.53	1,284,285.65

(二十六) 其他应付款

款项性质	期末余额	期初余额
应付长期资产采购款	213,350.00	230,915.36
代扣代缴款	1,084,596.91	1,029,452.64
增资保证金		
装修待付款	14,500.00	
保证金	23,947,144.00	
其他	212,475.91	347,769.51
合 计	25,472,066.82	1,608,137.51

(二十七) 应付债券

债券类型	发行日期	到期日期	票面利率	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
次级债券	2018.4.27	2024.4.27	7.50%	0.00	100,000,000.00		100,000,000.00
合 计				0.00	100,000,000.00		100,000,000.00

(二十八) 其他负债

1、按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
应付账款	605,088.89	581,157.27
合 计	605,088.89	581,157.27

2、应付账款按账龄列示

账 龄	期末余额	期初余额
1 年以内	254,564.11	126,358.98
1-2 年	350,524.78	392,798.29
2-3 年		62,000.00
合 计	605,088.89	581,157.27

(二十九) 股本

投资者名称	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
天风证券股份有限公司	197,900,000.00			197,900,000.00
四川孚和投资有限公司	4,500,000.00			4,500,000.00
武汉光谷创业投资有限公司	10,000,000.00			10,000,000.00
武汉远洲生物工程有限公司	15,000,000.00			15,000,000.00
武汉合信实业有限公司	11,500,000.00			11,500,000.00
湖北鑫伟德化工有限公司	11,500,000.00			11,500,000.00
武汉博卓化工有限公司	14,000,000.00			14,000,000.00
湖北银丰天睿资产管理有限公司	12,500,000.00			12,500,000.00
望岳投资天增一号私募基金	6,250,000.00			6,250,000.00
孟辰星	12,500,000.00			12,500,000.00
郭晓斌	5,000,000.00			5,000,000.00
钱正华	5,000,000.00			5,000,000.00
俞建	5,000,000.00			5,000,000.00
王桂明	3,750,000.00			3,750,000.00
合 计	314,400,000.00			314,400,000.00

(三十) 资本公积

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
资本溢价	124,180,267.29			124,180,267.29
合 计	124,180,267.29			124,180,267.29

(三十一) 其他综合收益

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
可供出售金融资产公允价值变动形成的利得或损失	1,272,301.78	1,492,111.14		2,764,412.92
合 计	1,272,301.78	1,492,111.14		2,764,412.92

(三十二) 盈余公积

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
法定盈余公积	4,273,752.10			4,273,752.10
合 计	4,273,752.10			4,273,752.10

(三十三) 一般风险准备

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
一般风险准备	5,217,202.26			5,217,202.26
合 计	5,217,202.26			5,217,202.26

(三十四) 未分配利润

项 目	期末余额	
	金 额	提取或分配比例
调整前上期末未分配利润	86,222,466.36	
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	86,222,466.36	
加：本期归属于母公司所有者的净利润	2,205,745.39	—
减：提取法定盈余公积		10%
提取风险准备金		10%
提取任意盈余公积		
应付普通股股利		
转作股本的普通股股利		
其他减少		
期末未分配利润	88,428,211.75	

(三十五) 手续费净收入

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
交易手续费净收入	3,550,096.30	5,145,811.53
交易手续费返还	4,896,754.69	5,969,790.61
资产管理业务收入	8,974,692.75	18,482,441.41
投资咨询服务收入	645,283.00	10,859,382.96
合 计	18,066,826.74	40,457,426.51

(三十六) 利息净收入

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
利息收入		
1.存放金融同业利息收入	14,315,302.29	15,980,311.26

2.买入返售金融资产利息收入	419,245.47	
利息收入小计	14,734,547.76	15,980,311.26
利息支出		
1.债券利息支出	1,335,616.75	
2. 卖出回购金融资产利息支出	2,648,358.78	
3.其他	601,346.75	38,236.63
利息支出小计	4,585,322.28	38,236.63
利息净收入	10,149,225.48	15,942,074.63

(三十七) 投资收益

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
1. 金融工具持有期间取得的分红和利息	6,630,282.78	886,550.67
其中：可供出售金融资产	16,354.72	886,550.67
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6,613,928.06	
持有至到期投资		
2. 处置收益	-17,382,496.13	-13,934,504.23
其中：可供出售金融资产	521,988.93	-1,446,962.37
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-4,261,380.63	-12,487,541.86
持有至到期投资	36,758.30	
衍生金融工具—股指期货价差收入	2,060,137.27	
衍生金融工具—期权	-15,740,000.00	
3. 流动资产/非流动资产产生的投资收益		
合 计	-10,752,213.35	-13,047,953.56

(三十八) 公允价值变动收益

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,077,330.00	12,498,902.19
衍生金融工具—场外期权	50,661,682.62	
合 计	51,739,012.62	12,498,902.19

(三十九) 税金及附加

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
城建税	36,814.20	87,462.35
教育费附加	15,129.18	36,171.27
印花税	42,551.65	23,596.04
其他	14,729.86	39,813.02
合 计	109,224.89	187,042.68

(四十) 业务及管理费

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
业务及管理费	55,712,120.44	52,715,496.19
其中：		
工资	24,631,609.91	21,514,424.74
佣金	997,000.05	1,623,254.69
差旅费	1,432,049.22	1,731,448.86
网络服务费	1,756,692.22	1,520,193.30
咨询费	480,795.87	3,041,710.94
固定资产折旧费	2,517,601.78	2,076,685.75
办公费	272,968.49	603,698.95
业务招待费	1,898,056.93	1,265,223.23
期货投资者保障基金	17,560.13	10,901.37
其他	21,707,785.84	19,327,954.36

(四十一) 提取期货风险准备金

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
提取期货风险准备金	422,465.42	555,780.12
合 计	422,465.42	555,780.12

(四十二) 资产减值损失

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
坏账损失	371,335.41	-556,022.31
合 计	371,335.41	-556,022.31

(四十三) 营业外收入

1、营业外收入明细

项 目	2018年1-6月		2017年1-6月	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	发生额	计入当期非经常性损益的金额
政府补助	275,247.00	275,247.00	2,379,700.00	2,379,700.00
其他	19,270.53	19,270.53	58,231.54	58,231.54
合 计	294,517.53	294,517.53	2,437,931.54	2,437,931.54

2. 政府补助明细

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月	与资产相关/与收益相关
虹口区促进金融业发展的财政扶持资金		2,379,700.00	与收益相关
虹口区专项奖励资金	260,000.00		与收益相关

稳定岗位补贴	15,247.00		与收益相关
合 计	275,247.00	2,379,700.00	

(四十四) 营业外支出

项 目	2018年1-6月		2017年1-6月	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产损坏报废损失			27,063.00	27,063.00
对外捐赠	2,644,581.40	2,644,581.40		
其他				
合 计	2,644,581.40	2,644,581.40	27,063.00	27,063.00

(四十五) 所得税费用

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
本期所得税费用		3,437,193.07
递延所得税费用	9,127,444.06	3,263,731.13
合 计	9,127,444.06	6,700,924.20

(四十六) 现金流量表补充资料

1、现金流量表补充资料

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
1. 将净利润调节为经营活动的现金流量:		
净利润	2,205,745.39	2,141,338.91
资产减值准备	371,335.41	-556,022.31
固定资产折旧	2,509,956.64	2,076,685.75
无形资产摊销	1,156,799.54	889,429.61
长期待摊费用摊销	1,221,872.14	1,515,970.02
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益)		27,063.00
固定资产报废损失		
公允价值变动损失(减:收益)	-51,739,012.62	-12,498,902.19
投资损失(减:收益)	10,752,213.35	13,047,953.56
财务费用		
递延所得税资产的减少(减:增加)	-3,535,307.78	3,261,425.15
递延所得税负债的增加(减:减少)	12,662,751.84	2,305.98
交易性金融资产的减少(减:增加)		
经营性应收项目的减少(减:增加)	-291,880,279.67	281,534,367.71
经营性应付项目的增加(减:减少)	494,982,628.32	-513,957,986.63

其他		
经营活动产生的现金流量净额	178,708,702.56	-222,516,371.44
2. 不涉及现金收支的投资和筹资活动		
债券转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入的固定资产		
3. 现金及现金等价物净增加情况		
现金的期末余额	1,257,987,476.33	714,757,688.63
减：现金的期初余额	623,159,281.69	805,815,369.10
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	634,828,194.64	-91,057,680.47

2、现金及现金等价物

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
一、现金	1,257,987,476.33	714,757,688.63
其中：库存现金	1,806.60	6,118.24
可随时用于支付的银行存款	1,257,985,384.72	714,751,570.39
可随时用于支付的其他货币资金	285.01	
二、现金等价物		
其中：3个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	1,257,987,476.33	714,757,688.63

三、在其他主体中的权益

在子公司中的权益

子公司名称	注册地	主要经营地	业务性质	持股比例（%）		取得方式
				直接	间接	
天示（上海）企业管理有限公司	上海	上海	金融贸易	100.00		设立
深圳天风天成资产管理有限公司	深圳	深圳、上海	资产管理	100.00		设立

四、关联方关系及其交易

（一） 本公司的母公司

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本公司的持股比例(%)	母公司对本公司的表决权比例(%)
天风证券股份有限公司	湖北武汉	证券业务	4,662,000,000.00	62.94	62.94

(二) 关联方交易

1、购销商品、提供和接受劳务的关联交易

关联方企业名称	关联交易内容	2018年1-6月	2017年1-6月
天风证券股份有限公司	投资咨询费收入		7,085,798.04
天风证券股份有限公司	期货交易手续费收入	78,227.44	239,558.77
天风证券股份有限公司	购买证券公司理财产品的投资收益	327,358.47	882,061.74
天风证券股份有限公司	应付债券	100,000,000.00	
天风证券股份有限公司	次级债利息支出	1,335,616.75	

2、持有关联方的产品

关联方企业名称	产品品种	2018年6月30日	2017年12月31日
天风证券股份有限公司	天风证券天象量化套利1号集合资产管理计划	41,566,447.81	41,441,949.27
天风证券股份有限公司	天风证券汇盈1号集合资产管理计划		338,300.51

3、其他关联交易

公司全资子公司深圳天风天成资产管理有限公司(以下简称“天风天成”)2017年为公司控股股东天风证券股份有限公司(以下简称“天风证券”)设立定向资产管理计划立心1号资产管理计划,截止2018年6月30日该定向资产管理计划受托资金本金为220,598,916.30元,规模为227,270,984.67元,报告期内计提了该定向资产管理计划管理费458,007.22元。

(三) 关联方应收应付款项

项目名称	关联方企业名称	2018年6月30日账面余额	2017年12月31日账面余额
其他应付款	天风证券股份有限公司	838,033.29	837,645.02
应付货币保证金	天风证券股份有限公司	291,125,685.34	216,760,290.59
应付债券	天风证券股份有限公司	100,000,000.00	
合计	—	391,963,718.63	217,597,935.61

五、承诺及或有事项

(一) 承诺事项

截止资产负债表日，公司无重大需披露的承诺事项。

(二) 或有事项

截止资产负债表日，公司无重大需披露的或有事项。

六、资产负债表日后事项

截止报告日，公司无重大需披露的其他资产负债表日后事项。

七、其他重要事项

(一) 前期会计差错

报告期内，公司无前期会计差错更正事项。

(二) 分部报告

1、分部报告的确定依据与会计政策

本公司的报告分部按照经营业务类型的不同，划分为：期货经纪业务分部、资产管理业务分部和金融贸易业务分部。

2、分部报告的财务信息

项 目	资产管理业务	期货经纪业务	金融贸易业务	抵消	合计
一、营业收入	10,419,025.43	21,984,473.20	184,297,935.36		216,701,433.99
手续费及佣金净收入	8,974,692.75	9,094,591.48		-2,457.49	18,066,826.74
投资收益	579,616.12	2,278,885.52	-13,613,172.48	2,457.49	-10,752,213.35
其他收入	864,716.56	10,610,996.20	197,911,107.84		209,386,820.60
二、营业支出	17,145,435.23	36,807,059.17	149,065,686.27		203,018,180.67
三、营业利润	-6,726,409.80	-14,822,585.97	35,232,249.09		13,683,253.32
四、资产总额	154,019,153.55	2,236,334,570.41	129,195,231.31	-201,751,340.98	2,317,797,614.29
五、负债总额	1,487,089.56	1,768,307,335.71	46,490,683.68	-37,751,340.98	1,778,533,767.97
六、补充信息					

资产减值损失	-14,999.03	3,876.70	382,457.74		371,335.41
--------	------------	----------	------------	--	------------

八、母公司重要财务报表项目注释

(一) 其他应收款

1、其他应收款分类

类 别	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款				
按组合计提坏账准备的其他应收款	1,579,100.43	100	245,803.40	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款				
合 计	1,579,100.43	100	245,803.40	

类 别	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款				
按组合计提坏账准备的其他应收款	1,531,093.04	100.00	241,926.70	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款				
合 计	1,531,093.04	100.00	241,926.70	

2、按组合计提坏账准备的其他应收款

采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

账 龄	期末余额			期初余额		
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面余额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	423,595.13	26.83	21,179.76	375,587.74	24.53	17,303.06
1 至 2 年	446,547.48	28.28	44,654.75	446,547.48	29.17	44,654.75
2 至 3 年	581,700.10	36.83	116,340.02	581,700.10	37.99	116,340.02
3 年以上	127,257.72	8.06	63,628.87	127,257.72	8.31	63,628.87
合 计	1,579,100.43	100.00	245,803.40	1,531,093.04	100.00	241,926.70

3、其他应收款按款项性质分类

款项性质	期末余额	期初余额
押金	837,617.56	733,532.26
保证金	586,241.28	619,963.98
代收代付社保、公积金	25,452.88	54,979.42
备用金	6,000.00	
其他	123,788.71	122,617.38
合 计	1,579,100.43	1,531,093.04

4、按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况

债务人名称	是否 为关 联方	款项 性质	期末余额	账龄	占其他应收款期 末余额合计数的 比例(%)	坏账准备 余额
湖北省鄂旅投置业集团有限公司	否	保证 金	464,194.80	3 年以内	29.4	92,838.96
上海三丰置业有限公司	否	押金	316,392.00	2 年以内	20.04	31,639.20
上海期货交易所	否	欠款	111,301.67	1 年以内	7.05	5,565.08
湖北省鄂旅投物业管理有限公司	否	押金	92,838.96	3 年以内	5.88	18,567.79
郝林科	否	押金	80,514.44	2 年以内	5.1	8,051.44
合 计		—	1,065,241.87		67.47	156,662.47

(二) 长期股权投资

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	164,000,000.00		164,000,000.00	155,000,000.00		155,000,000.00
合 计	164,000,000.00		164,000,000.00	155,000,000.00		155,000,000.00

1、对子公司投资

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减 值准备	减值准备期末 余额
深圳天风天成资产管理 有限公司	105,000,000.00			105,000,000.00		
天示(上海)企业管 理有限公司	50,000,000.00	9,000,000.00		59,000,000.00		
合 计	155,000,000.00	9,000,000.00		164,000,000.00		

(三) 手续费净收入

项 目	2018 年 1-6 月	2017 年 1-6 月
交易手续费净收入	3,552,553.79	5,145,811.53
交易手续费返还	4,896,754.69	5,969,790.61

投资咨询服务收入	645,283.00	10,859,382.96
合 计	9,094,591.48	21,974,985.10

(四) 投资收益

项 目	2018年1-6月	2017年1-6月
1. 金融工具持有期间取得的分红和利息	6,613,928.06	886,550.67
其中：可供出售金融资产		886,550.67
交易性金融资产	6,613,928.06	
2. 处置收益	-4,335,042.54	-346.14
其中：可供出售金融资产	327282.28	-346.14
交易性金融资产	-4,662,324.82	
合 计	2,278,885.52	886,204.53

九、补充资料

(一) 当前非经常性损益明细表

项 目	金 额	备注
1. 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	6,576.21	
2. 计入当期损益的政府补助，但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	275,247.00	
3. 除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-2,631,887.08	
减：所得税影响额		
合 计	-2,350,063.87	

(二) 净资产收益率和每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)		基本每股收益	
	2018年1-6月	2017年1-6月	2018年1-6月	2017年1-6月
归属于公司普通股股东的净利润	0.41	0.52	0.007	0.008
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	0.85	0.08	0.014	0.001

十、比较期间数据变动情况

(一) 资产负债表项目

项目	期末余额	期初余额	变动情况 (%)	变动原因
货币资金	1,257,987,476.33	623,159,281.69	101.87	客户权益大幅增加
其中：期货保证金存款	1,205,037,978.22	613,330,612.10	96.47	客户权益大幅增加
应收货币保证金	617,657,835.36	333,901,136.12	84.98	客户权益大幅增加
应收质押保证金	53,261,304.00	15,922,352.00	234.51	客户权益大幅增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	49,313,900.00	457,874,263.18	-89.23	银行间债券市场业务规模收缩
预付款项	17,076,797.37	3,098,593.29	451.11	风险管理子公司现货贸易预付货款大幅增加
应收利息	4,972,942.28	7,194,914.17	-30.88	银行间债券市场业务规模收缩
其他应收款	9,447,939.44	1,854,029.62	409.59	风险管理子公司现货贸易保证金大幅增加
买入返售金融资产		60,000,026.30	-100.00	银行间债券市场逆回购业务收缩
其他流动资产	2,340,950.96	11,072,073.09	-78.86	银行活期理财规模下降
可供出售金融资产	197,473,880.29	86,193,004.01	129.11	信托，集合理财产品投资均大幅增加
持有至到期投资		30,000,000.00	-100.00	国债逆回购到期赎回
递延所得税资产	4,193,791.76	658,560.17	536.81	未弥补亏损导致的可抵扣暂时性差异大幅增加
应付货币保证金	1,552,832,834.43	856,351,367.11	81.33	客户净入金大幅增加
应付质押保证金	53,261,304.00	15,922,352.00	234.51	客户净入金大幅增加
卖出回购金融资产		246,354,000.00	-100.00	银行间债券市场回购业务规模收缩
应付期货投资者保障基金	20,597.15	50,072.86	-58.87	投保计提比例下调
应付利息	1,335,616.75	597,423.56	123.56	次级债利息支出增加
其他应付款	25,472,066.82	1,608,137.51	1,483.95	风险管理子公司现货业务、期权业务的结算款和保证金大幅增加
递延所得税负债	13,586,891.64	426,845.60	3,083.09	期权业务的公允价值变动收益大幅增加

其他综合收益	2,764,412.92	1,272,301.78	117.28	可供出售金融资产公允价值上涨
--------	--------------	--------------	--------	----------------

(二) 利润表项目

项目	本期金额	上期金额	变动情况 (%)	变动原因
手续费及佣金净收入	18,066,826.74	40,457,426.51	-55.34	经纪业务手续费收入，资管业务收和投资咨询收入均同比下滑
其中：经纪业务手续费收入	8,446,850.99	11,115,602.14	-24.01	2018年上半年商品期货期权成交额1,624.27亿元，较上年同比增长1.27%，商品期货期权手续费率较上年同比下降22.03%，手续费净收入减少241.41万元；金融期货成交额1,511.45亿元，较上年同比下降29.11%，金融期货手续费率较上年同比下降8.98%，手续费净收入减少25.46万元。
资产管理业务收入	8,974,692.75	18,482,441.41	-51.44	监管政策发生变化，资产管理行业管理规模普遍下降；公司受托资金减少，管理规模下降；市场行情发生变化，资产管理行业管理费率下调
投资咨询业务收入	645,283.00	10,859,382.96	-94.06	市场推广不足
利息净收入	10,149,225.48	15,942,074.63	-36.34	银行间回购业务和次级债导致利息支出大幅上涨
公允价值变动收益	51,739,012.62	12,498,902.19	313.95	风险管理子公司期权业务估值浮盈大幅增加
其他业务收入	147,498,582.50	3,483,241.48	4,134.52	风险管理子公司现货贸易收入大幅增加
资产减值损失	371,335.41	556,022.31	166.78	其他应收款规模大幅上涨，其他应收款根据账龄相应计提的坏账准备大幅增加。
其他业务成本	146,403,034.51	-	-	风险管理子公司现货贸易成本大幅增加
营业外收入	294,517.53	2,437,931.54	-87.92	政府补助大幅下降
营业外支出	2,644,581.40	27,063.00	9,671.94	对外捐赠支出大幅增加

(三) 现金流量表项目

项目	本期金额	上期金额	变动情况 (%)	变动原因
收取利息、手续费及佣金的现金	24,519,688.51	51,081,055.09	-52.00	手续费及佣金净收入和利息净收入同比下降

收到其他与经营活动有关的现金	663,744,057.33	264,028,874.84	151.39	客户权益大幅增加
支付利息、手续费及佣金的现金	3,652,458.08	1,609,539.83	126.93	利息支出大幅上涨
以现金支付的业务及管理费	24,697,478.30	16,087,361.85	53.52	业务及管理费支付上涨
收回投资收到的现金	468,869,122.06	144,985,892.33	223.39	银行间债券市场业务交易量较去年大幅增加

天风期货股份有限公司
2018年8月21日