

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不就因本公告全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



Holly Futures

(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司，

中文公司名稱弘業期貨股份有限公司，在香港以Holly Futures (「本公司」) 的名義開展業務)

(股份代號：3678)

截至2021年12月31日止年度之年度業績公告

本公司董事會(「董事會」)謹此宣佈本公司及其附屬公司(「本集團」)截至2021年12月31日止年度之經審核年度業績。本年度業績公告列載本公司2021年年度報告全文，並符合香港聯合交易所有限公司證券上市規則中有關年度業績初步公告附載的資料之要求。本公司審核委員會已連同本公司管理層審閱本集團所採納的會計原則及政策以及截至2021年12月31日止年度的綜合財務報表。外聘核數師信永中和會計師事務所(特殊普通合伙)審閱並同意本集團所採納的會計原則及政策以及截至2021年12月31日止年度的綜合財務報表。

本公司2021年年度報告的印刷版本將於2022年4月底或之前寄發予本公司股東，並可於其時在香港交易及結算所有限公司網站www.hkexnews.hk及本公司網站www.ftol.com.cn閱覽。

承董事會命
董事長
周勇先生

中國，南京
2022年3月29日

於本公告日期，本公司董事會成員包括執行董事周勇先生及周劍秋女士；非執行董事薛炳海先生、姜琳先生及單兵先生；以及獨立非執行董事王躍堂先生、黃德春先生及盧華威先生。

目錄

| | |
|-----|-----------------------|
| 2 | 第一節 重要提示 |
| 3 | 第二節 董事長致辭 |
| 4 | 第三節 釋義 |
| 10 | 第四節 公司資料 |
| 22 | 第五節 財務摘要 |
| 25 | 第六節 管理層討論及分析 |
| 80 | 第七節 董事會報告 |
| 89 | 第八節 其他重要事項 |
| 98 | 第九節 股份變動及主要股東情況 |
| 101 | 第十節 董事、監事、高級管理人員和員工情況 |
| 118 | 第十一節 企業管治報告 |
| 147 | 第十二節 監事會報告 |
| 151 | 第十三節 財務報告 |

重要提示

本公司董事會、監事會及董事、監事、高級管理人員保證年度報告內容的真實、準確、完整，不存在虛假記載誤導性陳述或重大遺漏，並就其承擔個別和連帶的法律責任。

本報告已經公司第四屆董事會第四次會議、第四屆監事會第二次會議審議通過，全體董事和全體監事出席了會議，沒有董事、監事、高級管理人員聲明對本報告內容的真實性、準確性和完整性無法保證或存在異議。

本公司按照中國企業會計準則編製的截至2021年12月31日止年度財務報告經信永中和會計師事務所(特殊普通合伙)審計，並對其出具了無保留意見的審計報告。除特別說明外，本報告所列數據以人民幣為單位。

公司董事長周勇先生、總經理周劍秋女士及財務負責人陳蓉平女士聲明：保證本年度報告中的財務報告真實、準確、完整。

本報告所涉及的未來計劃、發展戰略等前瞻性描述不構成公司對投資者的實質承諾，敬請各投資者注意投資風險。

董事長致辭

歲序常易，華章日新。2021年，弘業期貨默默耕耘，收穫希望；奮發進取，收穫喜悅；揮灑汗水，收穫肯定。在臘盡春近、時光飛逝的2021年中，我們用智慧和拚搏描繪出動人的篇章。

2021年是極不平凡的一年。這一年，我們堅定不移邁出公司發展新步伐，A股IPO獲證監會正式受理、編製完成「十四五」發展戰略規劃、有序推進國企改革三年行動和巡察整改工作；這一年，我們緊扣高質量發展主題，篤行實幹，砥礪前進，業績穩步上升，用行動書寫了弘業期貨人的「不畏艱難、百折不撓、勇往直前」；這一年，新冠疫情多地散發，我們切實加強對疫情防控工作領導，堅持抓早、抓細、抓實、抓嚴，灑下汗水和淚水，收穫喜悅和溫暖；這一年，我們內塑文化，凝聚力量，堅持以人民為中心，紮實開展「我為群眾辦實事」活動，有力踐行「兩在兩同」建新功行動，大力推進南京金融城入駐，同時著力關注提高員工收入和福利待遇，盡力提升職工的獲得感、幸福感；這一年，我們外塑形象，擦亮品牌，秉承期貨服務實體經濟的初心：聚焦「保供穩價」，建設大宗商品金融創新服務生態；以主動管理、機構合作為核心，多模式拓展資產管理業務；聚合私募新星力量，縱深開拓財富管理生態體系、助力共同富裕，「保險+期貨」業務足跡覆蓋全國多地，為「脫貧攻堅」畫下圓滿句號，吹響了「鄉村振興」「共同富裕」的新號角。2021年，公司實現營業收入同比增長5.03%，淨利潤同比增長20.94%，代理成交額同比增長41.42%；日均客戶權益同比增長35.74%；期末客戶權益同比增長38.31%。公司榮獲「中國最佳期貨公司」「江蘇省先鋒企業」以及交易所「優秀會員獎」等30餘項榮譽。

使命重在擔當，實幹造就輝煌。我們在推動高質量發展中積累了良好的基礎，在應對風險挑戰中積累了有效做法，在創新改革中積累了成功的探索經驗。讓我們繼續在公司董事會的堅強領導下，苦幹實幹、勇毅前行，踔厲奮發、篤行不怠，用奮鬥走好新時代「趕考路」！初心如磐，奮楫篤行，志不求易者成，事不避難者進。新的一年，讓我們齊心協力，迎難而上，為推動公司高質量發展努力奮鬥，不斷前行！

周勇

董事長

中國南京，2022年3月29日

釋義

在本年度報告中，除非文義另有所指，下列詞語具有以下含義：

| | | |
|----------------|---|--|
| 愛濤文化集團 | 指 | 愛濤文化集團有限公司(前稱江蘇弘業國際集團有限公司)，一家於1999年1月20日根據中國法律成立的有限公司，為本公司控股股東的全資附屬公司 |
| 公司章程 | 指 | 本公司現行有效的《弘業期貨股份有限公司章程》 |
| 資產管理規模 | 指 | 所管理資產的金額 |
| 董事會 | 指 | 本公司董事會 |
| 期貨業協會、中期協 | 指 | 中國期貨業協會 |
| 中金所 | 指 | 中國金融期貨交易所 |
| 董事長 | 指 | 本公司董事長 |
| 首席風險官 | 指 | 本公司首席風險官 |
| 客戶結餘 | 指 | 經紀客戶為進行交易而存入本公司的現金及現金等價物，包括客戶保證金存款及結算準備金 |
| 佣金收入 | 指 | 期貨公司的佣金收入指(i)期貨公司的期貨經紀業務所得的佣金及手續費收入，與(ii)來自期貨交易所的相關佣金返還的總和 |
| 公司法、中國公司法 | 指 | 《中華人民共和國公司法》，經不時修訂、補充或以其他方式修改 |
| 本公司、公司、我們、弘業期貨 | 指 | 弘業期貨股份有限公司(在香港以「Holly Futures」名義開展業務)，一家於2012年11月29日根據中國法律在中國江蘇成立的股份有限公司，其H股在香港聯交所主板上市 |
| 公司條例 | 指 | 香港法例第622章《公司條例》，經不時修訂、補充或以其他方式修改 |
| 控股股東 | 指 | 除非文義另有所指，否則指蘇豪控股 |

| | | |
|-----------|---|---|
| 《企業管治守則》 | 指 | 《上市規則》附錄十四之《企業管治守則及企業管治報告》(於二零二二年一月一日起更名為《企業管治守則》，而其結構亦重新編排) |
| 中國證監會 | 指 | 中國證券監督管理委員會 |
| 大商所 | 指 | 大連商品交易所 |
| 董事 | 指 | 本公司董事 |
| 內資股 | 指 | 本公司每股面值人民幣1.00元的已發行普通股，以人民幣認購或入賬列作繳足 |
| 報告期末 | 指 | 2021年12月31日 |
| FOF | 指 | 一種專門投資於其他投資基金的基金。並不直接投資股票或債券，其投資範圍僅限於其他基金，通過持有其他證券投資基金而間接持有股票、債券等證券資產，它是結合基金產品創新和銷售渠道創新的基金新品種 |
| 本集團、集團、我們 | 指 | 本公司及其附屬公司 |
| 匯鴻集團 | 指 | 江蘇匯鴻國際集團股份有限公司(前稱江蘇匯鴻股份有限公司)，一家於1992年10月13日在中國成立的有限公司，其後於1994年改制為股份有限公司 |
| 匯鴻國際 | 指 | 江蘇匯鴻國際集團有限公司，一家於1996年12月18日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一，因通過吸收方式與匯鴻集團合併而於2015年9月23日註銷 |
| 港幣 | 指 | 香港法定貨幣 |
| 弘業資本 | 指 | 弘業資本管理有限公司，一家於2013年6月25日根據中國法律成立的有限公司，為本公司的全資附屬公司 |

| | | |
|----------|---|---|
| 弘業股份 | 指 | 江蘇弘業股份有限公司(前稱江蘇省工藝品進出口集團股份有限公司)，一家於1994年6月30日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一及股東 |
| 弘業物流 | 指 | 江蘇弘業國際物流有限公司(前稱江蘇鵬程國際儲運有限公司)，一家於1996年2月12日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一及股東 |
| 弘業國際資管 | 指 | 弘業國際資產管理有限公司，原弘蘇資產管理有限公司，一家於2016年7月7日根據香港法例註冊成立的有限公司，為本公司的全資附屬公司，根據《證券及期貨條例》可進行第4類(就證券提供意見)及第9類(提供資產管理)受規管活動，於2019年12月更名 |
| 弘業國際金融 | 指 | 弘業國際金融控股有限公司，原弘蘇期貨(香港)有限公司，一家於2011年10月20日根據香港法例註冊成立的有限公司，為本公司的全資附屬公司，根據《證券及期貨條例》可進行第1類(證券交易)及第2類(期貨合約交易)受規管活動，於2019年12月更名 |
| 弘蘇實業 | 指 | 江蘇弘蘇實業有限公司，一家於2011年2月23日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一及股東 |
| 香港 | 指 | 中國香港特別行政區 |
| 香港聯交所 | 指 | 香港聯合交易所有限公司 |
| 弘瑞科技創業投資 | 指 | 江蘇弘瑞科技創業投資有限公司，一家於2002年9月29日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一及股東 |
| H股 | 指 | 本公司股本中每股面值人民幣1.00元的境外上市外資普通股，該等股份均在香港聯交所主板上市 |

| | | |
|--------|---|--|
| 介紹經紀 | 指 | 向本公司介紹客戶以賺取佣金的本公司業務夥伴 |
| 江蘇省工商局 | 指 | 江蘇省工商行政管理局 |
| 江蘇弘業 | 指 | 江蘇弘業期貨經紀有限公司(前稱江蘇金陵期貨經紀有限公司、江蘇弘業期貨經紀有限公司及江蘇弘業期貨有限公司)，一家於1995年7月31日根據中國法律成立的有限公司及公司的前身公司，而如文義指其成立前的任何時間，則指其前身公司曾從事的業務 |
| 江蘇省國資委 | 指 | 江蘇省人民政府國有資產監督管理委員會 |
| 江蘇證監局 | 指 | 中國證券監督管理委員會江蘇監管局 |
| 上市日期 | 指 | H股獲准在香港聯交所主板上市及買賣的日期，為2015年12月30日 |
| 《上市規則》 | 指 | 香港聯交所證券上市規則，經不時修訂、補充或以其他方式修改 |
| 手 | 指 | 中國期貨交易所列出的期貨標準數量，為可買賣的最少期貨數量 |
| 《標準守則》 | 指 | 《上市規則》附錄十之《上市發行人董事進行證券交易的標準守則》 |
| 財政部 | 指 | 中華人民共和國財政部 |
| 商務部 | 指 | 中華人民共和國商務部 |
| 淨資本 | 指 | 相等於淨資產減資產調整值加負債調整值減客戶未悉數追加的保證金減／加中國證監會認可或批准的其他調整項目 |

| | | |
|----------------|---|--|
| 中國期貨交易所 | 指 | 中國金融期貨交易所、大連商品交易所、上海期貨交易所、鄭州商品交易所、上海國際能源交易中心、廣州期貨交易所 |
| 中國、我國、全國、國內、境內 | 指 | 中華人民共和國(就本報告而言，香港、中國澳門特別行政區和台灣地區除外) |
| 招股說明書 | 指 | 本公司日期為2015年12月16日之H股招股說明書 |
| PTA | 指 | 精對苯二甲酸 |
| 本報告 | 指 | 本公司2021年度報告 |
| 報告期 | 指 | 截至2021年12月31日止年度 |
| 人民幣 | 指 | 中國法定貨幣 |
| 董事會議事規則 | 指 | 現行有效的《弘業期貨股份有限公司董事會議事規則》 |
| 研發 | 指 | 研究及開發 |
| 國家稅務總局 | 指 | 中華人民共和國國家稅務總局 |
| 結算準備金 | 指 | 留作期貨交易交割結算的不受限制及未動用現金結餘，存入期貨交易所及商業銀行。結算準備金包括客戶結算準備金及我們本身的結算準備金 |
| 香港證監會 | 指 | 香港證券及期貨事務監察委員會 |
| 《證券及期貨條例》 | 指 | 香港法例第571章《證券及期貨條例》，經不時修訂後，補充或以其他方式修改 |
| 上海銘大 | 指 | 上海銘大實業(集團)有限公司，一家於2002年12月26日根據中國法律成立的有限公司，為公司的發起人之一及股東 |
| 股份 | 指 | 內資股及H股 |

| | | |
|-----------|---|--|
| 股東 | 指 | 股份持有人 |
| 上期所 | 指 | 上海期貨交易所 |
| 蘇豪控股 | 指 | 江蘇省蘇豪控股集團有限公司(前稱江蘇省絲綢集團有限公司)，一家於1994年4月29日根據中國法律成立的國有獨資有限公司，為公司的控股股東及發起人之一 |
| 國務院 | 指 | 中華人民共和國國務院 |
| 監事 | 指 | 本公司監事 |
| 監事會 | 指 | 本公司監事會 |
| 鄭商所 | 指 | 鄭州商品交易所 |
| QFII | 指 | 合格的境外機構投資者 |
| RQFII | 指 | 人民幣合格境外機構投資者 |
| IPO | 指 | 首次公開發售 |
| GDR | 指 | 全球存託憑證，是非公開市場用以籌集美元或歐元資金的金融工具 |
| CTA | 指 | 商品交易顧問基金，也稱作管理期貨基金，它是指由專業的資金管理人運用客戶委託的資金自主決定投資於全球期貨市場和期權市場以獲利的並且收取相應管理費用的一種基金組織形式 |
| 固收+ | 指 | 一種投資策略，由固收和浮動收益兩類投資組成，固收是指固定收益的部分，主要投資於債券等固定收益類資產，一般佔到投資比例的80%左右，「+」是指提高收益的部分，主要投資於基金、股票等，一般不超過20% |
| 股票套利+網下打新 | 指 | 股票融券套利策略，疊加網下新股申購策略 |

公司資料

一、公司基本情況簡介

(1) 公司名稱

中文名稱：弘業期貨股份有限公司(為一家於2012年11月29日根據中國法律在中國江蘇成立的股份有限公司，在香港以「HOLLY FUTURES」名義開展業務)

中文簡稱(境內)：弘業期貨

英文名稱：Holly Futures Co., Ltd.

(2) 董事會

執行董事

周 勇先生(董事長)

周劍秋女士

非執行董事

薛炳海先生

單 兵先生

姜 琳先生

獨立非執行董事

王躍堂先生

黃德春先生

盧華威先生

董事會專門委員會

| | |
|---------|--------------------------------------|
| 審核委員會 | 盧華威先生(主席) 薛炳海先生 黃德春先生 |
| 薪酬委員會 | 黃德春先生(主席) 單 兵先生 王躍堂先生 |
| 提名委員會 | 周 勇先生(主席) 王躍堂先生 黃德春先生 |
| 風險管理委員會 | 王躍堂先生(主席) 薛炳海先生 周劍秋女士 姜 琳先生 |

(3) 監事會

虞 虹女士(監事會主席)
陳 亮先生
姚愛麗女士

(4) 法定代表人

周劍秋女士

(5) 註冊資本

人民幣9.07億元

(6) 國內各項業務資格

商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢、資產管理、基金銷售、股票期權交易參與人、銀行間債券交易

(7) 中國總部

公司註冊地址：中國江蘇省南京市中華路50號(郵編：210001)

公司辦公地址：中國江蘇省南京市中華路50號弘業大廈(郵編：210001)

公司網站：www.ftol.com.cn

電子郵箱：zqb@ftol.com.cn

(8) 香港主要營業地址

香港灣仔皇后大道東248號大新金融中心40樓

(9) 董事會秘書

董事會秘書：黃海清先生

聯繫地址：中國江蘇省南京市中華路50號弘業大廈6樓(郵編：210001)

電話：025-52278980

電郵：huanghaiqing@ftol.com.cn

(10) 聯席公司秘書

黃海清先生及陳燕華女士(於2022年2月21日起獲委任，原聯席公司秘書梁穎嫻女士已於2022年2月21日辭任)

(11) 公司授權代表

周劍秋女士、黃海清先生

(12) 公司聘請的法定審計機構

信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)

於《財務匯報局條例》下的認可公眾利益實體核數師

(13) 法律顧問

香港法律：鍾氏律師事務所與德恒律師事務所聯營

中國法律：上海市錦天城(南京)律師事務所

(14) 主要往來銀行

中國銀行股份有限公司

中國建設銀行股份有限公司

中國農業銀行股份有限公司

中國工商銀行股份有限公司

交通銀行股份有限公司

上海浦東發展銀行股份有限公司

中國民生銀行股份有限公司

興業銀行股份有限公司

恒豐銀行股份有限公司

中信銀行股份有限公司

招商銀行股份有限公司

江蘇銀行股份有限公司

南京銀行股份有限公司

中國光大銀行股份有限公司

平安銀行股份有限公司

杭州銀行股份有限公司

華夏銀行股份有限公司

廣發銀行股份有限公司

永隆銀行有限公司

中國銀行(香港)有限公司

(15) 香港H股股份過戶登記處

香港中央證券登記有限公司

(16) 股票代號

03678

二、歷史沿革

公司前身是江蘇金陵期貨經紀有限公司(以下稱「金陵期貨」)，經中國證監會批准於1995年7月31日成立，成立時註冊資本為人民幣1,000萬元，股東為江蘇省冶金物資交易市場(以下稱「冶金物資市場」)和江蘇省有色金屬工業公司(以下稱「江蘇有色」)，分別持有金陵期貨股權的60%和40%。

1999年，冶金物資市場持有的金陵期貨60%的股權及江蘇有色持有的金陵期貨30%的股權轉讓給江蘇省工藝品進出口集團股份有限公司(以下稱「江蘇工藝」，現已更名為江蘇弘業股份有限公司)，江蘇有色持有的金陵期貨10%的股權轉讓給江蘇鵬程國際儲運有限公司(以下稱「鵬程國際」，現已更名為江蘇弘業國際物流有限公司)。轉讓後，公司註冊資本為人民幣1,000萬元，其中：江蘇工藝出資人民幣900萬元，佔註冊資本的90%；鵬程國際出資人民幣100萬元，佔註冊資本的10%。

1999年，公司更名為江蘇弘業期貨經紀有限公司，註冊資本增加至人民幣3,000萬元，由江蘇工藝認繳增資人民幣1,920萬元，鵬程國際認繳增資人民幣80萬元。增資完成後，江蘇工藝出資人民幣2,820萬元，佔註冊資本的94%；鵬程國際出資人民幣180萬元，佔註冊資本的6%。

2001年，弘業股份將其持有江蘇弘業48%的股權轉讓給江蘇弘業國際集團投資管理有限公司(以下稱「弘業投資」)。股權轉讓後，弘業投資出資人民幣1,440萬元，佔註冊資本的48%；弘業股份出資人民幣1,380萬元，佔註冊資本的46%；鵬程國際儲運有限公司出資人民幣180萬元，佔註冊資本的6%。

2006年，江蘇弘業將未分配利潤人民幣800萬元轉增實收資本，註冊資本增加至人民幣3,800萬元，增資完成後，弘業投資出資人民幣1,824萬元，佔註冊資本的48%；弘業股份出資人民幣1,748萬元，佔註冊資本的46%；鵬程國際出資人民幣228萬元，佔註冊資本的6%。

2007年，江蘇弘業註冊資本增加至人民幣5,000萬元，其中由弘業投資認繳人民幣319.5萬元，弘業股份認繳人民幣395.5萬元，弘瑞科技創業投資認繳人民幣245萬元，上海銘大認繳人民幣240萬元。增資完成後，弘業投資出資人民幣2,143.5萬元，佔註冊資本的42.87%；弘業股份出資人民幣2,143.5萬元，佔註冊資本的42.87%；鵬程國際出資人民幣228萬元，佔註冊資本的4.56%；弘瑞科技創業投資出資人民幣245萬元，佔註冊資本的4.90%；上海銘大出資人民幣240萬元，佔註冊資本的4.80%。2008年，江蘇弘業註冊資本增加至人民幣10,800萬元，其中由2007年經審計的資本公積人民幣492萬元與未分配利潤人民幣1,508萬元轉增人民幣2,000萬元註冊資本，同時江蘇弘業的股東現金增資人民幣3,800萬元。增資完成後，各股東投資比例不變。

2009年，江蘇弘業註冊資本增加至人民幣1.38億元。增資完成後，弘業投資出資人民幣6,129.96萬元，佔註冊資本的44.42%；弘業股份出資人民幣6,129.96萬元，佔註冊資本的44.42%；鵬程國際出資人民幣492.48萬元，佔註冊資本的3.57%；弘瑞科技創業投資出資人民幣529.2萬元，佔註冊資本的3.83%；上海銘大出資人民幣518.4萬元，佔註冊資本的3.76%。

2011年，江蘇弘業註冊資本增加至人民幣3.8億元。增資完成後，弘業投資出資人民幣8,265萬元，佔註冊資本的21.75%；弘業股份出資人民幣8,265萬元，佔註冊資本的21.75%；蘇豪控股出資人民幣8,108.12萬元，佔註冊資本的21.34%；弘蘇實業出資人民幣8,021.8萬元，佔註冊資本的21.11%；匯鴻國際出資人民幣3,800萬元，佔註冊資本的10.00%；弘瑞科技創業投資出資人民幣529.2萬元，佔註冊資本的1.39%；上海銘大出資人民幣518.4萬元，佔註冊資本的1.36%；弘業物流出資人民幣492.48萬元，佔註冊資本的1.30%。2011年，江蘇弘業更名為江蘇弘業期貨有限公司，註冊資本及股權結構未發生變化。

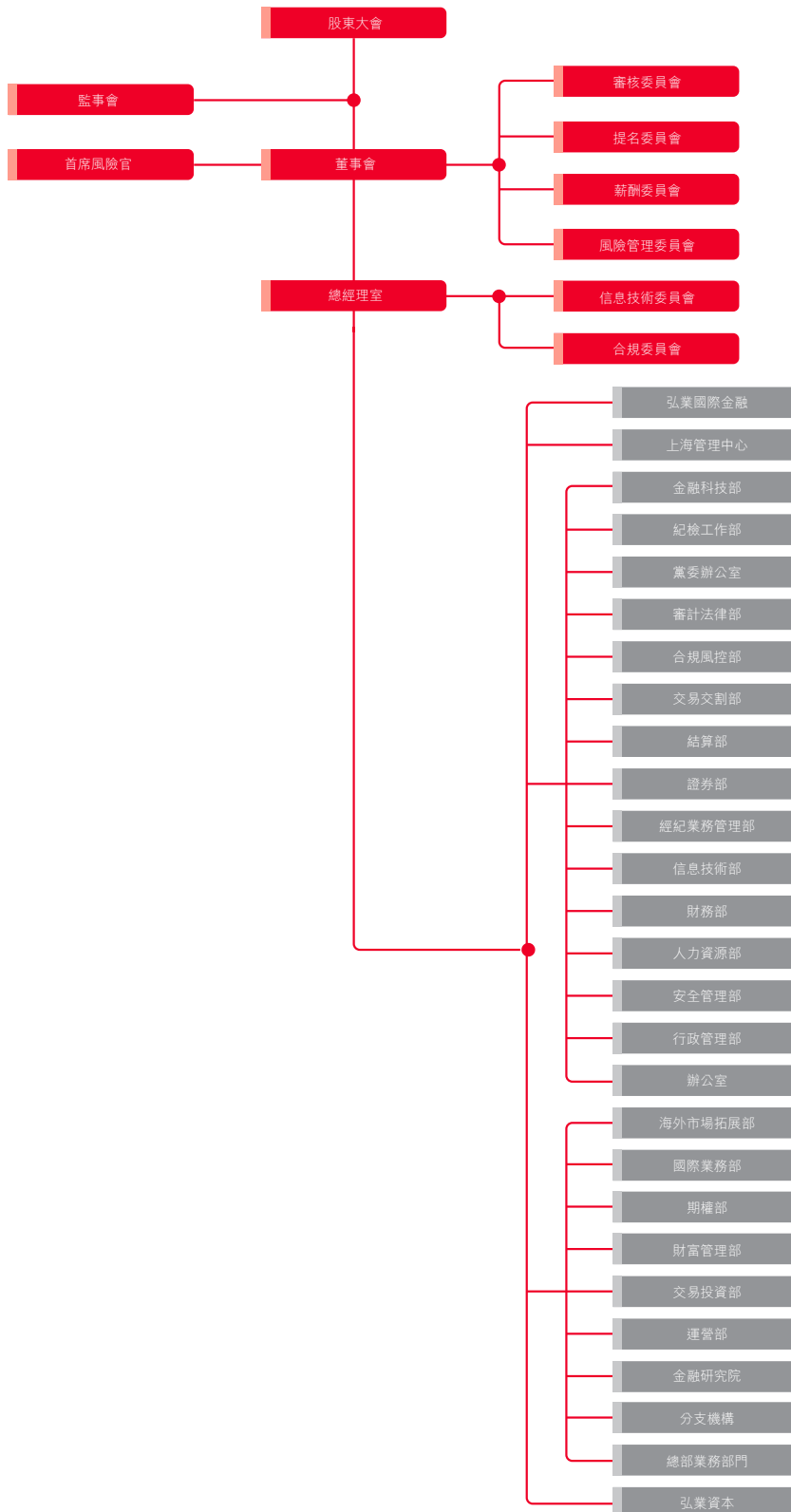
2012年，弘業投資將持有的21.75%的股權轉由蘇豪控股持有，變更後蘇豪控股持有公司43.09%股權。

2012年11月29日，江蘇弘業整體變更為弘業期貨股份有限公司。整體變更後公司總股本為680,000,000股，其中：蘇豪控股持有292,992,674股，佔總股本的43.09%；弘業股份持有147,900,000股，佔總股本的21.75%；弘蘇實業持有143,548,000股，佔總股本的21.11%；匯鴻國際持有68,000,000股，佔總股本的10.00%；弘瑞科技創業投資持有9,469,895股，佔總股本的1.39%；上海銘大持有9,276,631股，佔總股本的1.36%；弘業物流持有8,812,800股，佔總股本的1.30%。

2015年，匯鴻國際被匯鴻集團吸收合併，原匯鴻國際持有的公司68,000,000股股份由匯鴻集團承繼。

2015年8月18日，經中國證監會《關於核准弘業期貨股份有限公司發行境外上市外資股的批覆》（證監許可[2015]1963號）核准，公司發行不超過26,105萬股境外上市外資股，每股面值人民幣1元，全部為普通股。2015年12月30日，公司境外發行股份在香港聯交所主板上市，股票簡稱：弘業期貨，股票代碼：03678。根據國務院國有資產監督管理委員會《關於弘業期貨股份有限公司國有股轉持有關問題的批覆》（國資產權[2015]411號），在本公司完成該次發行後，國有股東江蘇省蘇豪控股集團有限公司、江蘇匯鴻國際集團股份有限公司、江蘇弘瑞科技創業投資有限公司、江蘇弘業國際物流有限公司分別將其持有的17,535,897股、4,069,866股、566,782股、527,455股股份劃轉給全國社會保障基金理事會持有，上述4家劃轉由全國社會保障基金理事會持有的股份合計22,700,000股。上市後公司總股本為907,000,000股，其中：江蘇省蘇豪控股集團有限公司持有275,456,777股，佔總股本的30.37%；江蘇弘業股份有限公司持有147,900,000股，佔總股本的16.31%；江蘇弘蘇實業有限公司持有143,548,000股，佔總股本的15.83%；江蘇匯鴻國際集團股份有限公司持有63,930,134股，佔總股本的7.05%；江蘇弘瑞科技創業投資有限公司持有8,903,113股，佔總股本的0.98%；上海銘大實業(集團)有限公司持有9,276,631股，佔總股本的1.02%；江蘇弘業國際物流有限公司持有8,285,345股，佔總股本的0.91%；江蘇弘業永昌(香港)有限公司持有8,300,000股H股，佔總股本0.92%；公眾股東(H股)合計持有241,400,000H股，佔總股本的26.61%。

三、組織架構



四、附屬公司情況

| 名稱 | 註冊及辦公地址 | 主營業務 | 成立地及 | | 註冊資本 | 持股比例 | 備註 |
|--------|-------------------------------------|---|-------|-------------|-------------|------|---|
| | | | 主要營運地 | 成立時間 | | | |
| 弘業資本 | 中國深圳市前海深港 合作區前灣一路1號 A棟201室 | 基差貿易、合作 套保、倉單服務、 場外衍生品業務、 做市業務 | 中國 | 2013年6月25日 | 人民幣39,000萬元 | 100% | 於2021年8月23日， 本公司增資人民幣 15,000萬元， 註冊資本由人民幣 24,000萬元變更為 人民幣39,000萬元 |
| 弘業國際金融 | 香港灣仔告士打道 42-46號捷利中心 20樓03-05室 | 提供期貨交易、證券 交易 | 香港 | 2011年10月20日 | 港幣19,000萬元 | 100% | 於2015年9月30日被 本公司收購 |
| 弘業國際資管 | 香港灣仔告士打道 42-46號捷利中心 20樓03-05室 | 資產管理、證券投資 諮詢 | 香港 | 2016年7月7日 | 港幣2,000萬元 | 100% | 由弘業國際金融出資 成立並全資持有 |

五、營業部、分公司及其分佈情況

截至報告期末，公司擁有經中國證監會批准成立並位於中國的營業部39家、分公司6家，詳見下表：

| 序號 | 分支機構 | 營業地址 | 設立時間 |
|----|--------|---|-------------|
| 1 | 北京營業部 | 北京市朝陽區建國路118號9層901內B2單元 | 2005年02月02日 |
| 2 | 常熟營業部 | 江蘇省常熟市海虞北路45號(常熟世界貿易中心)A617、A618、A620 | 2013年07月23日 |
| 3 | 常州營業部 | 常州市竹林西路19號天寧時代廣場2號樓1003室 | 2002年09月24日 |
| 4 | 成都營業部 | 成都高新區蜀錦路88號1棟2單元19樓4號 | 2013年01月25日 |
| 5 | 長沙營業部 | 長沙市芙蓉區人民東路99號長房東郡大廈1405 | 2008年12月11日 |
| 6 | 重慶營業部 | 重慶市江北區慶雲路1號18樓單元5 | 2011年12月30日 |
| 7 | 福州營業部 | 福建省福州市鼓樓區五一北路1號力寶天馬廣場19層1907-1908單元 | 2008年11月10日 |
| 8 | 廣州營業部 | 廣州市天河區體育東路138號1201單元 | 2011年03月08日 |
| 9 | 海口營業部 | 海南省海口市龍華區大同路38號財富中心1809室 | 2010年03月25日 |
| 10 | 杭州營業部 | 杭州市上城區海運國際大廈1幢1007室 | 2008年02月20日 |
| 11 | 合肥營業部 | 合肥市蜀山區望江西路129號五彩商業廣場1幢辦707 | 2007年12月26日 |
| 12 | 淮安營業部 | 淮安市清河區淮海第一城辦公樓1111、1112室 | 2012年05月08日 |
| 13 | 濟南營業部 | 濟南市歷下區世茂國際廣場C座910 | 2009年08月07日 |
| 14 | 江陰營業部 | 江陰市澄江中路118號海瀾國貿大廈14樓A座 | 2013年07月23日 |
| 15 | 連雲港營業部 | 江蘇省連雲港市海州區海連東路26號907、908室 | 2011年09月16日 |
| 16 | 南寧營業部 | 南寧市青秀區東葛路118號南寧青秀萬達廣場西1棟2518、2519、2520號 | 2008年09月19日 |

| 序號 | 分支機構 | 營業地址 | 設立時間 |
|----|-----------|---|-------------|
| 17 | 南通營業部 | 南通市姚港路6號 | 2007年09月06日 |
| 18 | 寧波營業部 | 浙江省寧波市高新區萬特商務中心1號樓 | 2011年07月07日 |
| 19 | 青島營業部 | 青島市市南區香港中路10號1號樓2301戶 | 2007年11月26日 |
| 20 | 上海營業部 | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道1589號1210、1211室 | 2007年08月15日 |
| 21 | 深圳營業部 | 深圳市福田區福田街道金田路與福華路交匯處現代商務大廈808A | 2013年02月22日 |
| 22 | 瀋陽營業部 | 瀋陽市和平區南京北街161號嘉潤大廈707室 | 2010年10月11日 |
| 23 | 蘇州營業部 | 蘇州市姑蘇區三香路1338號鉑金大廈2106室 | 2001年12月18日 |
| 24 | 宿遷營業部 | 江蘇省宿遷市浙江大廈商業辦公2401、2402、2403、2404、2418號 | 2010年05月05日 |
| 25 | 太原營業部 | 太原市杏花嶺區府西街9號1幢A座五層A號 | 2012年02月02日 |
| 26 | 泰州營業部 | 泰州市海陵區鼓樓南路607號106室205室 | 2008年07月03日 |
| 27 | 張家港保稅區營業部 | 張家港保稅區濱江大廈糧油市場2406A室 | 2019年08月02日 |
| 28 | 無錫營業部 | 無錫市中山路531-1706、1707室 | 2003年12月12日 |
| 29 | 蕪湖營業部 | 安徽省蕪湖市鏡湖區偉星時代金融中心1004、1005 | 2012年06月28日 |
| 30 | 廈門營業部 | 福建省廈門市思明區廈禾路820號1304室 | 2013年11月18日 |
| 31 | 西安營業部 | 西安市蓮湖區北大街55號新時代廣場13層G號 | 2009年04月10日 |
| 32 | 徐州營業部 | 徐州市鼓樓區淮海東路29號蘇寧廣場裙樓、A樓1-3903、3904、3905室 | 2008年01月04日 |
| 33 | 鹽城營業部 | 鹽城市人民南路1號華邦東廈4樓3A07、3A08室 | 2009年06月16日 |

| 序號 | 分支機構 | 營業地址 | 設立時間 |
|----|--------|---|-------------|
| 34 | 揚州營業部 | 揚州市文昌西路10號紫金廣場803室 | 2002年10月25日 |
| 35 | 宜興營業部 | 宜興市宜城街道教育西路21號宜興國際經貿大廈二樓201室-A | 2013年08月23日 |
| 36 | 張家港營業部 | 張家港市城北路178號 | 2013年09月06日 |
| 37 | 溧陽營業部 | 溧陽市溧城鎮燕山中路28號福田中心辦公2507 | 2017年08月29日 |
| 38 | 海門營業部 | 南通市海門市海門街道南海路965號光華大廈A座507室 | 2018年10月30日 |
| 39 | 鎮江營業部 | 鎮江市潤州區冠城路8號第17層 | 2008年10月31日 |
| 40 | 北京分公司 | 北京市朝陽區建國路118號9層901內C1單元 | 2017年01月24日 |
| 41 | 東北分公司 | 遼寧省大連市沙河口區會展路129號大連國際金融中心A座—大連期貨大廈 2302號房間 | 2008年11月26日 |
| 42 | 江南分公司 | 宜興市宜城街道教育西路21號 | 2016年12月6日 |
| 43 | 上海分公司 | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道1788、1800號塔樓1第20層01單元 | 2016年10月15日 |
| 44 | 深圳分公司 | 深圳市福田區福田街道金田路與福華路交匯處現代商務大廈808B | 2016年07月13日 |
| 45 | 鄭州分公司 | 鄭州市鄭東新區商務外環路30號期貨大廈1006房 | 2008年07月01日 |

財務摘要

一、主要會計數據和財務指標

(若無特別說明，本年度報告所載會計數據和財務指標按照中國財政部頒佈的企業會計準則編製，財務數據以整數列示，部分表格合計數與各類數值直接相加之和在尾數上存在差異，是因四捨五入所致。)

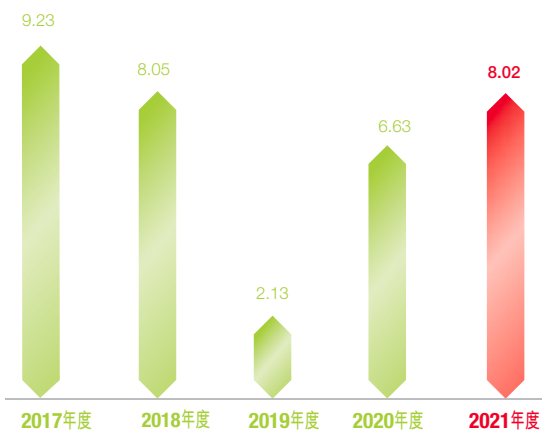
近五年主要會計數據和財務指標

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | | 2019年度 | 2018年度 | 2017年度 |
|-----------------------|----------------|---------|--------|--------|--------|---------|--------|
| | 2021年度 | 2020年度 | 增減金額 | 增幅 | | | |
| 營業收入 | 163,986 | 156,138 | 7,849 | 5.03% | 64,524 | 61,617 | 52,317 |
| 利潤總額 | 10,921 | 9,270 | 1,651 | 17.81% | 4,158 | 10,561 | 12,012 |
| 淨利潤－歸屬於本公司股東 | 8,021 | 6,632 | 1,389 | 20.94% | 2,127 | 8,051 | 9,233 |
| 經營活動產生的淨現金 流入／(流出) | 123,561 | 80,307 | 43,254 | 53.86% | 11,192 | -11,791 | 19,237 |
| 每股收益(人民幣元／股) | | | | | | | |
| 基本每股收益 | 0.0884 | 0.0731 | | | 0.0234 | 0.0888 | 0.1018 |
| 稀釋每股收益 | 0.0884 | 0.0731 | | | 0.0234 | 0.0888 | 0.1018 |
| 盈利能力指標 | | | | | | | |
| 加權平均淨資產收益率 | 4.84% | 4.07% | | | 1.31% | 4.91% | 5.67% |

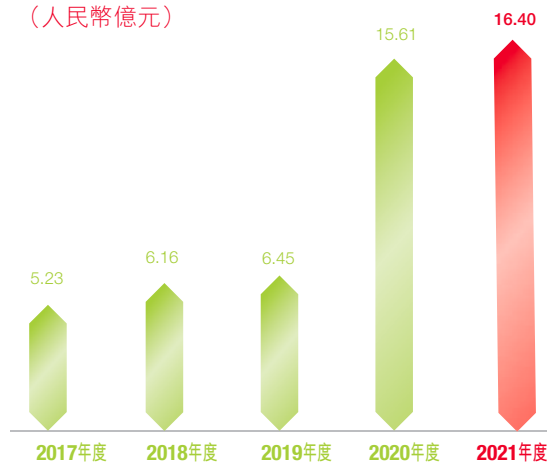
| 規模指標(人民幣萬元) | 2021年比較2020年 | | | | 截至 2019年 12月31日 | 截至 2018年 12月31日 | 截至 2017年 12月31日 |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------|--------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 截至 2021年 12月31日 | 截至 2020年 12月31日 | 增減金額 | 增幅 | | | |
| 資產總額 | 808,310 | 634,916 | 173,394 | 27.31% | 451,077 | 429,675 | 582,904 |
| 負債總額 | 640,093 | 470,249 | 169,844 | 36.12% | 291,180 | 264,926 | 418,687 |
| 應付客戶權益 | 593,063 | 428,784 | 164,279 | 38.31% | 265,955 | 246,532 | 356,612 |
| 歸屬於本公司股東權益 | 168,217 | 164,667 | 3,550 | 2.16% | 159,897 | 164,749 | 164,217 |
| 總股本(千股) | 907,000 | 907,000 | | | 907,000 | 907,000 | 907,000 |
| 歸屬於本公司股東每股淨資產 (人民幣元／股) | | | | | | | |
| | 1.85 | 1.82 | | | 1.76 | 1.82 | 1.81 |
| 資產負債率^{註1} | 22% | 20% | | | 14% | 10% | 27% |

註1：資產負債率=(負債總額－應付客戶權益)／(資產總額－應付客戶權益)

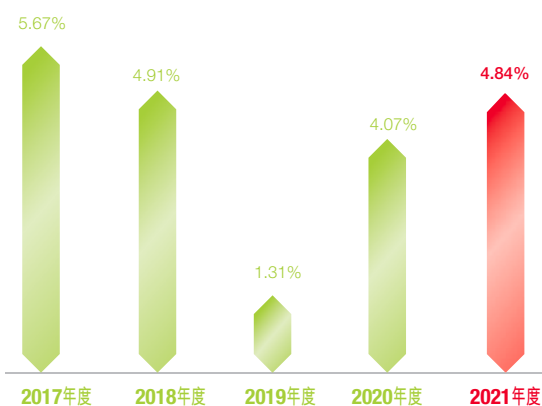
淨利潤—歸屬於本公司股東
(人民幣千萬元)



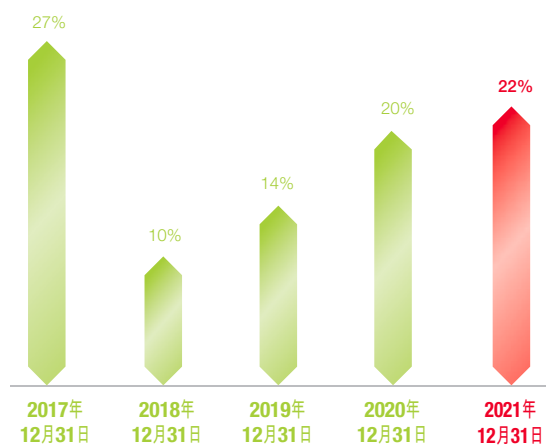
營業收入
(人民幣億元)



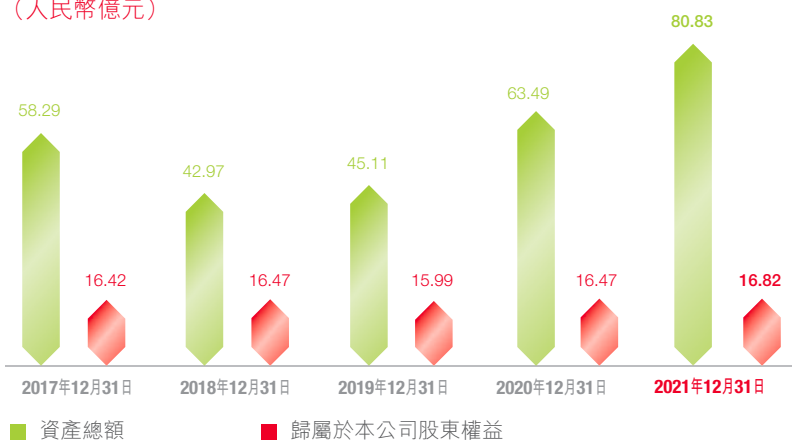
加權平均淨資產收益率



資產負債率



規模指標
(人民幣億元)



■ 資產總額

■ 歸屬於本公司股東權益

二、本公司的淨資本等風險控制指標

2021年12月31日本公司淨資本為人民幣7.09億元，較2020年末的人民幣9.79億元，同比減少人民幣2.70億元。報告期內，本公司淨資本等各項風險控制指標均符合監管要求。（下表列示本公司根據中國會計準則以及中國監管要求所編製的淨資本以及主要監督風險控制指標）

| | 截至 2021年 12月31日 | 截至 2020年 12月31日 (經調整後) | 截至 2020年 12月31日 | 預警標準 | 監管標準 |
|-------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|------|------|
| 淨資本(人民幣百萬元) | 709 | 979 | 962 | 36 | 30 |
| 淨資本／各項風險資本準備之和(%) | 209% | 350% | 344% | 120% | 100% |
| 淨資本／淨資產(%) | 42% | 59% | 58% | 24% | 20% |
| 流動資產／流動負債(%) | 526% | 484% | 453% | 120% | 100% |
| 總負債／淨資產(%) | 21% | 20% | 20% | 120% | 150% |
| 自有結算準備(人民幣百萬元) | 386 | 377 | 377 | — | 10 |

註：根據中國證監會江蘇監管局《關於做好期貨公司監管綜合信息系統上線工作的通知》(蘇證監機構字[2021]14號)的要求，本公司對截至2020年12月31日的淨資本等風險控制指標進行了調整以符合監管機構最新口徑，不表明以前年度指標存在差錯。

管理層討論及分析

一、市場回顧

世界發展環境正面臨「百年未有之大變局」，近年來國際形勢多變急變、黑天鵝灰犀牛事件多出迭出，貿易保護主義單邊主義涌動躁動，全球投資貿易格局、全球科技創新格局、全球金融貨幣格局、全球多元治理體系等都面臨前所未有的大變革。受新冠疫情影響，世界經濟充滿風險和不確定性、國際貿易和投資大幅萎縮、國際金融市場動盪、國際交往受限、經濟全球化遭遇逆流等不利局勢，一些國家保護主義和單邊主義盛行、地緣政治風險上升等不利局面，為全球經濟發展和企業營商環境帶來巨大衝擊。2021年，面對複雜嚴峻的國際環境和國內疫情散發等多重考驗，在以習近平同志為核心的黨中央堅強領導下，各地區各部門認真貫徹落實各項決策部署，堅持穩中求進工作總基調，科學統籌疫情防控和經濟社會發展，紮實做好「六穩」工作，全面落實「六保」任務，加強宏觀政策跨週期調節，加大實體經濟支持力度，國民經濟持續恢復發展，改革開放創新深入推進，民生保障有力有效，構建新發展格局邁出新步伐，高質量發展取得新成效。

全年國內生產總值人民幣1,143,670億元，按不變價格計算，比上年增長8.1%，兩年平均增長5.1%。分季度看，一季度同比增長18.3%，二季度增長7.9%，三季度增長4.9%，四季度增長4.0%。分產業看，第一產業增加值83,086億元，比上年增長7.1%；第二產業增加值450,904億元，增長8.2%；第三產業增加值609,680億元，增長8.2%。具體體現如下：

一、糧食產量再創新高，畜牧業生產穩定增長。全年全國糧食總產量68,285萬噸，比上年增加1,336萬噸，增長2.0%。其中，夏糧產量14,596萬噸，增長2.2%；早稻產量2,802萬噸，增長2.7%；秋糧產量50,888萬噸，增長1.9%。分品種看，稻穀產量21,284萬噸，增長0.5%；小麥產量13,695萬噸，增長2.0%；玉米產量27,255萬噸，增長4.6%；大豆產量1,640萬噸，下降16.4%。全年豬牛羊禽肉產量8,887萬噸，比上年增長16.3%；其中，豬肉產量5,296萬噸，增長28.8%；牛肉產量698萬噸，增長3.7%；羊肉產量514萬噸，增長4.4%；禽肉產量2,380萬噸，增長0.8%。牛奶產量3,683萬噸，增長7.1%；禽蛋產量3,409萬噸，下降1.7%。2021年末，生豬存欄、能繁殖母豬存欄比上年末分別增長10.5%、4.0%。

- 二、工業生產持續發展，高技術製造業和裝備製造業較快增長。全年全國規模以上工業增加值比上年增長9.6%，兩年平均增長6.1%。分三大門類看，採礦業增加值增長5.3%，製造業增長9.8%，電力、熱力、燃氣及水生產和供應業增長11.4%。高技術製造業、裝備製造業增加值分別增長18.2%、12.9%，增速分別比規模以上工業快8.6、3.3個百分點。分產品看，新能源汽車、工業機器人、集成電路、微型計算機設備產量分別增長145.6%、44.9%、33.3%、22.3%。分經濟類型看，國有控股企業增加值增長8.0%；股份制企業增長9.8%，外商及港澳台商投資企業增長8.9%；私營企業增長10.2%。2021年，全國工業產能利用率為77.5%，比上年提高3.0個百分點。
- 三、服務業持續恢復，現代服務業增勢良好。全年第三產業較快增長。分行業看，信息傳輸、軟件和信息技術服務業，住宿和餐飲業，交通運輸、倉儲和郵政業增加值比上年分別增長17.2%、14.5%、12.1%，保持恢復性增長。全年全國服務業生產指數比上年增長13.1%，兩年平均增長6.0%。
- 四、市場銷售規模擴大，基本生活類和升級類商品銷售增長較快。全年社會消費品零售總額440,823億元，比上年增長12.5%；兩年平均增長3.9%。按經營單位所在地分，城鎮消費品零售額381,558億元，增長12.5%；鄉村消費品零售額59,265億元，增長12.1%。按消費類型分，商品零售393,928億元，增長11.8%；餐飲收入46,895億元，增長18.6%。基本生活消費增勢較好，限額以上單位飲料類、糧油食品類商品零售額比上年分別增長20.4%、10.8%。升級類消費需求持續釋放，限額以上單位金銀珠寶類、文化辦公用品類商品零售額分別增長29.8%、18.8%。全年全國網上零售額130,884億元，比上年增長14.1%。其中，實物商品網上零售額108,042億元，增長12.0%，佔社會消費品零售總額的比重為24.5%。
- 五、固定資產投資保持增長，製造業和高技術產業投資增勢較好。全年全國固定資產投資(不含農戶)544,547億元，比上年增長4.9%；兩年平均增長3.9%。分領域看，基礎設施投資增長0.4%，製造業投資增長13.5%，房地產開發投資增長4.4%。全國商品房銷售面積179,433萬平方米，增長1.9%；商品房銷售額181,930億元，增長4.8%。分產業看，第一產業投資增長9.1%，第二產業投資增長11.3%，第三產業投資增長2.1%。民間投資307,659億元，增長7.0%，佔全部投資的56.5%。高技術產業投資增長17.1%，快於全部投資12.2個百分點。其中，高技術製造業、高技術

服務業投資分別增長22.2%、7.9%。高技術製造業中，電子及通信設備製造業、計算機及辦公設備製造業投資分別增長25.8%、21.1%；高技術服務業中，電子商務服務業、科技成果轉化服務業投資分別增長60.3%、16.0%。社會領域投資比上年增長10.7%，其中衛生投資、教育投資分別增長24.5%、11.7%。

- 六、 貨物進出口快速增長，貿易結構持續優化。全年貨物進出口總額391,009億元，比上年增長21.4%。其中，出口217,348億元，增長21.2%；進口173,661億元，增長21.5%。進出口相抵，貿易順差43,687億元。一般貿易進出口增長24.7%，佔進出口總額的比重為61.6%，比上年提高1.6個百分點。民營企業進出口增長26.7%，佔進出口總額的比重為48.6%，比上年提高2個百分點。
- 七、 居民消費價格溫和上漲，工業生產者價格漲幅高位回落。全年居民消費價格(CPI)比上年上漲0.9%。其中，城市上漲1.0%，農村上漲0.7%。分類別看，食品煙酒價格下降0.3%，衣著上漲0.3%，居住上漲0.8%，生活用品及服務上漲0.4%，交通通信上漲4.1%，教育文化娛樂上漲1.9%，醫療保健上漲0.4%，其他用品和服務下降1.3%。在食品煙酒價格中，糧食價格上漲1.1%，鮮菜價格上漲5.6%，豬肉價格下降30.3%。扣除食品和能源價格的核心CPI上漲0.8%。全年工業生產者購進價格比上年上漲11.0%。
- 八、 就業形勢總體穩定，城鎮調查失業率降低。全年城鎮新增就業1,269萬人，比上年增加83萬人。全年全國城鎮調查失業率平均值為5.1%，比上年平均值下降0.5個百分點。其中，本地戶籍人口為5.1%，外來戶籍人口為4.9%。16—24歲人口為14.3%，25—59歲人口為4.4%。全國企業就業人員周平均工作時間為47.8小時。全年農民工總量29,251萬人，比上年增加691萬人，增長2.4%。其中，本地農民工12,079萬人，增長4.1%；外出農民工17,172萬人，增長1.3%。農民工月均收入水平4,432元，比上年增長8.8%。

- 九、居民收入增長與經濟增長基本同步，城鄉居民人均收入比縮小。全年全國居民人均可支配收入35,128元，比上年名義增長9.1%，兩年平均名義增長6.9%；扣除價格因素實際增長8.1%，兩年平均增長5.1%，與經濟增長基本同步。按常住地分，城鎮居民人均可支配收入47,412元，比上年名義增長8.2%，扣除價格因素實際增長7.1%；農村居民18,931元，比上年名義增長10.5%，扣除價格因素實際增長9.7%。城鄉居民人均可支配收入比為2.50，比上年縮小0.06。全國居民人均可支配收入中位數29,975元，比上年名義增長8.8%。按全國居民五等份收入分組，低收入組人均可支配收入8,333元，中間偏下收入組18,446元，中間收入組29,053元，中間偏上收入組44,949元，高收入組85,836元。全年全國居民人均消費支出24,100元，比上年名義增長13.6%，兩年平均名義增長5.7%；扣除價格因素實際增長12.6%，兩年平均增長4.0%。
- 十、人口總量有所增加，城鎮化率繼續提高。年末全國人口(包括31個省、自治區、直轄市和現役軍人的人口，不包括居住在31個省、自治區、直轄市的港澳台居民和外籍人員)141,260萬人，比上年末增加48萬人。全年出生人口1,062萬人，人口出生率為7.52%；死亡人口1,014萬人，人口死亡率為7.18%；人口自然增長率為0.34%。從性別構成看，男性人口72,311萬人，女性人口68,949萬人，總人口性別比為104.88(以女性為100)。從年齡構成看，16—59歲的勞動年齡人口88,222萬人，佔全國人口的比重為62.5%；60歲及以上人口26,736萬人，佔全國人口的18.9%，其中65歲及以上人口20,056萬人，佔全國人口的14.2%。從城鄉構成看，城鎮常住人口91,425萬人，比上年末增加1,205萬人；鄉村常住人口49,835萬人，減少1,157萬人；城鎮人口佔全國人口比重(城鎮化率)為64.72%，比上年末提高0.83個百分點。全國人戶分離人口(即居住地和戶口登記地不在同一個鄉鎮街道且離開戶口登記地半年以上的人口)50,429萬人，比上年增加1,153萬人；其中流動人口38,467萬人，比上年增加885萬人。

二、行業回顧

目前，我國期貨市場主要由商品期貨和金融期貨兩大類交易品種構成。其中，商品期貨是指標的物為實物商品的期貨合約。商品期貨歷史悠久，是期貨市場的最初交易品種，種類豐富多樣，發展到目前已經形成了包括農產品期貨、金屬期貨和能源化工期貨等在內的眾多分類。金融期貨是以金融經濟指標作為標的物的期貨合約，主要包括貨幣期貨、國債期貨、股指期貨等品類。金融期貨在金融市場定價、風險規避等方面有著非常重要的作用，對經濟金融體系產生了深遠的影響。

經過30多年的探索發展，我國期貨市場由無序逐漸走向成熟，逐步進入了健康穩定發展、經濟功能日益顯現的良性軌道。同時，我國期貨市場的國際影響力顯著增強，逐漸成為全球最大的商品期貨交易市場和農產品期貨交易市場。我國的大商所、鄭商所、上期所和中金所在全球衍生品交易所交易量排名均躋身世界前列，在世界期貨市場中佔據重要地位。

2021年，期貨業發展邁上了新台階，期貨市場成交量創歷史新高，全市場資金量正式邁入「萬億元時代」；大宗商品波動劇烈，價格持續走高；交易所和期貨公司陣營同步擴容，服務實體經濟再下一城。具體體現如下：

- 一、期貨市場成交量創歷史新高。2021年，中國期貨市場成交成交量約為75.14億手（單邊，下同），累計成交額約為581.20萬億元，同比分別增長22.13%和32.84%。分交易所看，2021年上期所累計成交量約為23.71億手，累計成交額為193.11萬億元，同比分別增長14.39%和37.92%，分別佔全國市場的31.55%和33.23%。上期能源累計成交量約為0.75億手，累計成交額約為21.47萬億元，同比分別增長33.55%和67.93%，分別佔全國市場的1.00%和3.69%。鄭商所累計成交量約為25.82億手，累計成交額約為108.00萬億元，同比分別增長51.75%和79.73%，分別佔全國市場的34.36%和18.58%。大商所累計成交量約為23.64億手，累計成交額約為140.46萬億元，同比分別增長7.12%和28.62%，分別佔全國市場的31.47%和24.17%。中金所累計成交量約為1.22億手，累計成交額約為118.17萬億元，同比分別增長5.86%和2.37%，分別佔全國市場的1.62%和20.33%。我國期貨市場2021年全年成交規模再創歷史新高，反映出在全球經濟復甦放緩、新冠疫情持續干擾、輸入型通脹壓力不減和國內保供穩價政策調控等複雜情況下，產業客戶和各類避險機構利用期貨期權市場管理現貨價格風險的需求強烈。

- 二、 大宗商品波動劇烈，價格持續走高。從全市場九大板塊表現來看，化工、鋼鐵建材、軟商品和有色金屬四大板塊成交規模錄得大幅增長，鋼材、PTA、甲醇、豆粕、燃料油、菜籽粕、白銀、豆油、棕櫚油、玻璃、純鹼等品種成交量和成交額排名靠前，不銹鋼、紅棗、紙漿、短纖、純鹼、硅鐵等品種成交量和成交額增幅居前，助推全市場成交規模保持增長態勢。金融期貨板塊交易規模也穩中略增，其中上證50股指期貨和2年期國債期貨的成交表現突出，表明金融機構和投資者正在積極利用對沖工具管理股票和債券現貨市場風險。2021年1—5月，需求率先復甦，供需結構性失衡，大宗商品價格持續走高，特別是以鋼材和有色為代表的工業品表現強勁。之後隨著全球經濟復甦邊際放緩以及宏觀政策調控，2021年5月中旬市場出現回調。2021年6—10月，供需結構性不平衡延續，以動力煤、焦煤、焦炭為代表的碳排放相關商品，以甲醇、尿素、乙二醇、純鹼為代表的下游煤化工商品，以及高耗能品種如鋁、合金等供需矛盾凸顯，價格均出現明顯上行。進入四季度以後，國內保供穩價政策逐漸見效，大宗商品價格在10月中旬後出現回調走勢。同時，2021年，商品和股指期權也成交活躍，豆粕、甲醇、玉米、PTA、天然橡膠、鐵礦石期權等成交量排名居前。2021年，我國商品期權市場成交量佔期權市場的98%，成交額佔比79%，持倉量佔比96%，商品期權市場成為推動2021年全市場保持增長的新動力。
- 三、 交易所和期貨公司陣營同步擴容，服務實體經濟再下一城。自2013年始，期貨法便進入了漫長的準備階段，經過八年的打磨，期貨法最終在2021年迎來了實質性突破。2021年4月份，期貨法在十三屆全國人大常委會第二十八次會議進行了初次審議；2021年10月23日，全國人大常委會公佈草案二審稿並向社會公開徵求意見，並將「期貨法」更名為「期貨和衍生品法」；2021年12月份，證監會副主席方星海表示，期貨行業基本法制定取得突破性進展，「期貨和衍生品法」通過一讀和二讀，有望在2022年三讀後正式發佈。2021年1月份，證監會批准設立廣州期貨交易所（下稱「廣期所」），經過短短3個月的準備，4月19日，廣期所正式掛牌，這也意味著在上海期貨交易所、鄭州商品交易所、大連商品交易所和中國金融期貨交易所後，境內第五家期貨交易所面世。廣期所未來產品佈局主要涉及4大板塊、一共16個品種。其中，碳排放期貨等綠色發展類產品是核心戰略板塊，同時，圍繞綠色可持續發展，還將推動二次能源—電力期貨，以及與新能源有關的工業硅、多晶硅、鋰、稀土、鉑和鈮等金屬品種的上市。時隔12年後，期貨公司迎來了第150家，2021年7月24日，山東

港信期貨有限公司正式開業。自2021年1月份生豬期貨率先推出後，花生期貨、棕櫚油期權、原油期權也陸續推出。從意義上來看，四個品種所具備的特徵不盡相同，例如生豬期貨為我國首個活體交割品種，棕櫚油期權為首個國際化期權，原油期權則是我國首批對外開放的期權品種。至此，我國場內期貨期權品種總量已達94個，涵蓋了農產品、有色金屬、鋼鐵、能源、化工、金融等多個領域。

- 四、 全市場資金量正式邁入「萬億元時代」。2021年上半年，在大宗商品價格劇烈波動背景下，企業生產經營風險加劇，急需衍生品等風險管理工具，同時，衍生品天然的風險管理屬性也成為了公募、企業年金和保險資金等中長期資金增值保值需求的重要通道；2021年7月份，我國期貨市場規模已達1.09萬億元，較2020年年初翻了一番，越來越多的機構投資者、中長期資金開始靈活運用股指期貨等金融衍生品對沖風險、獲取收益，實現可持續發展。

三、業務回顧

2021年，在董事會的科學決策、公司經營層的堅強領導下，面對持續蔓延的新冠疫情和錯綜複雜的國際形勢，公司廣大幹部職工深入貫徹落實各項決策部署，以國企改革三年行動為抓手，以「提高效率、增強活力、提升價值」為目標，全面落實管理層決策部署及工作要求，堅持穩字當頭、穩中求進，一著不讓抓好年度重點工作及各項目標任務的落實，全力做好防疫、防汛、保安全，實現公司健康發展的良好開局。2021年，公司實現營業收入同比增長5.03%，代理成交額同比增長41.42%；日均客戶權益同比增長35.74%；期末客戶權益同比增長38.31%。公司榮獲「中國最佳期貨公司」、「江蘇省先鋒企業」以及交易所「優秀會員獎」等30餘項榮譽。

今年新冠疫情對各類企業的經營狀況造成衝擊，面對複雜的經濟形勢和激烈的市場競爭環境，公司深耕本源業務，積極應對、迎難而上、多措並舉，以傳統期貨經紀業務為基礎，以創新業務為新的利潤抓手，以國際化發展為動力，不斷轉型升級，在實體經濟領域深耕細作，以金融科技為引領，推動公司高質量發展。截至2021年12月31日，集團資產總額人民幣80.83億元，相比2020年同期的人民幣63.49億元，同比增長27.31%，歸於本公司淨資產人民幣16.82億元，同比增長2.16%。本集團實現營業收入合計人民幣16.40億元，相比於2020年同期的人民幣15.61億元增長5.03%。歸屬於本公司的淨利潤人民幣0.80億元，比2020年同期的人民幣0.66億元增長20.94%。

經過綜合評估，新冠疫情對公司的財務及營運未造成重大不利影響。信用風險方面，新冠疫情對部分行業和部分客戶的衝擊客觀存在，但由於中國境內疫情防控措施到位且有效，總體來看新冠疫情對境內客戶影響不大，而公司服務的客戶信用風險整體可控，預計未來對公司影響不大。市場風險方面，受疫情反覆影響，生產力減弱，全球經濟疲軟，地緣政治衝突加強，政策變化頻出，市場波動性加劇。資本中介業務保持方向中性，市場波動對其產生的方向性不利影響較小。操作風險方面，疫情期間存在員工現場辦公與居家辦公並存的情形，對業務流程的執行及系統使用帶來一定挑戰。公司已建立相應的管理機制，並持續優化流程、完善工作流程等手段，確保未因疫情發生重大操作風險事件，操作風險總體可控。隨著新冠疫情逐步向好，市場環境趨於平穩，預計新冠疫情對公司總體影響不大。

本集團的主營業務為期貨經紀業務、資產管理業務、大宗商品交易及風險管理業務及金融資產投資(包括證券、基金、銀行委託理財產品、資產管理計劃)等。報告期內，本集團主營業務性質概無重大改變。

(1) 期貨經紀業務

本公司期貨經紀業務包括為中國所有期貨交易所上市的商品期貨以及金融期貨提供經紀業務服務，並向客戶收取一定比例的手續費。截至2021年12月31日止，公司營業網點及分公司共45家，主要分佈在中國各直轄市、江蘇省內和其他經濟發達地區。

於2021年末，本公司客戶權益(未包括股票股權)為人民幣59.31億元，較2020年末客戶權益人民幣42.88億元增長38.31%。集團代理期貨業務產生的手續費及利息收入為人民幣3.49億元，較2020年同期的人民幣2.79億元增長25.09%。公司代理成交額(雙邊統計，下同)人民幣87,153.93億元，較2020年的61,628.98增長41.42%。市場佔有率為0.75%。其中商品期貨代理成交額人民幣82,244.63億元，較2020年的人民幣56,355.71億元增長45.94%；金融期貨代理成交額人民幣4,909.30億元，較2020年的人民幣5,273.27億元下降6.90%；公司代理成交量11,487.99萬手，較2020年的9,574.98萬手增長19.98%。2021年，本公司境內綜合期貨及期權經紀業務佣金率為萬分之0.31，較2020年同期的萬分之0.35下降11.43%。

2022年公司將繼續優化營業網點結構，整合資源，提高在重點區域的服務能力，強化市場營銷推廣，擴展客戶覆蓋範圍。

(2) 資產管理業務

截至2021年12月31日，公司資產管理規模人民幣235.93億元，較2020年末的資產管理規模人民幣221.31億元，同比增長6.61%，位居行業前三；資產管理業務實現手續費收入人民幣1,122萬元，較2020年同期的1,342萬元下降16.39%；合計交易資產管理賬戶38個，備案新增資管產品21個、其中集合產品14個，單一類產品7個，總體運行平穩。

公司不斷豐富資管產品類型，新增備案產品類型涉及純債型、FOF類、CTA類及固收+國債期貨套保套利類，助推資管業務在轉型中尋求發展機遇。一是以債券投資穩規模，著重打造主動管理FOF產品的投研，不斷深化與金融同業機構間的合作，拓展代銷合作渠道，增強客戶黏性。二是與券商、著名三方財富代銷機構強強聯合、優勢互補，挖掘不同策略風格的優秀私募機構，共同推出系列FOF產品。三是充分發揮公司平台優勢，與銀行理財機構加深交流，擬發行股票套利+網下打新產品，為銀行客戶提供穩定收益回報。

(3) 大宗商品交易及風險管理業務

風險管理業務有序發展。弘業資本全年實現營業收入人民幣13.06億元，同比增長4.95%，資產總額人民幣4.38億元，淨資產人民幣4.12億元，其中做市業務利潤貢獻率達41.57%。期現業務通過引進專業團隊，構建「分公司+事業部」的組織架構，業務範圍覆蓋有色、黑色、能化和農產品四大板塊，涉及銅、塑料、棉花、橡膠等11個品種。著力創新期現結合業務模式，為實體企業提供基差報價、基差點價和實物交割等服務。期貨做市業務繼續穩步發展，期貨做市業務實現3個商品期貨交易所全覆蓋，新申請獲得大商所聚丙烯、豆油共2個品種做市商資格，做市品種總數增加至13個。

公司期權業務穩步發展。申請獲得深交所股票期權業務資格。場外期權累計成交名義本金人民幣60.11億元，業務範圍拓展至金融機構客戶。公司注重圍繞國家戰略，響應中央及行業號召，穩步推進「保險+期貨」項目。2021年，我司進一步擴大項目規模和覆蓋範圍，在全國9省24個區縣開展了17個「保險+期貨」項目，為生豬、飼料、橡膠、雞蛋等價值約4個億的農產品提供了價格風險管理服務，賠付金額近900萬，惠及7個原國家級貧困縣，鞏固了脫貧攻堅成果，有力地服務了鄉村振興。其中針對生豬產業價格大幅波動，我司在全國開展了11個試點項目，均產生了賠付，有力地實現了生豬產業鏈的「穩價保供」。2021年我司「保險+期貨」項目連續第四年榮獲南京市金融創新獎。

(4) 金融資產投資

為優化公司資金運作，集團進行了證券、信託、基金及資產管理計劃等多渠道的金融資產投資，在控制風險的前提下，有效配置資金，促進主業發展，提高資金盈利水平。

截至2021年12月末，集團金融資產處置和分紅收益為人民幣2,543萬元，較2020年同期的人民幣3,924萬元降低35.19%。主要是由於受證券市場行情的影響出售交易性金融資產的收益減少。

四、財務報表分析

(i) 財務報表分析

1、 盈利能力情況分析

報告期內，公司夯實經紀業務主業，同時進一步發展創新業務，提升公司的綜合實力，整體經營業績增長較快。本集團實現營業收入總計人民幣16.40億元，同比增長5.03%；實現歸屬於本公司股東的淨利潤人民幣0.80億元，同比增長20.94%；實現每股收益人民幣0.0884元；加權平均淨資產收益率4.84%，同比增長0.77個百分點。

2、 資產結構和資產質量

2021年末，本集團資產總額人民幣80.83億元，較2020年末的人民幣63.49億元，同比增長27.31%；負債總額人民幣64.01億元，較2020年末的人民幣47.02億元，同比增長36.12%，歸屬於上市公司股份的淨資產人民幣16.82億元，較2020年末的人民幣16.47億元，同比增長2.16%。

資產結構保持穩定，資產質量和流動性保持良好。2021年末，集團資產總額同比增加，主要因為客戶權益增加所致。2021年末本集團資產總額中流動資產人民幣77.31億元，佔比95.64%；非流動資產人民幣3.52億元，佔比4.36%。資產總額主要包括現金類資產人民幣68.38億元，佔比84.60%；金融投資類資產人民幣8.55億元，佔比10.57%；應收款項類資產人民幣0.45億元，佔比0.56%；其他資產人民幣3.45億元，佔比4.27%。2021年集團計提信用減值損失，減值金額人民幣27萬元。

2021年末，扣除應付客戶權益的負債為人民幣4.70億元，較2020年末的人民幣4.15億元，同比增長13.42%。增長的主要原因是合併結構化主體產生的交易性金融資產增加。本集團資產負債率為22%，較2020年末的20%增長2個百分點（註：資產負債率=（負債總額－應付客戶權益）／（資產總額－應付客戶權益）；經營槓桿率為1.28倍，較2020年末的1.25倍，同比增長2.22%（註：經營槓桿率=（資產總額－應付客戶權益）／歸屬於本公司股東的權益）。

3、流動性水平管理情況

公司重視流動性管理，遵循全面性、謹慎性和預見性原則，強調資金的安全性、流動性和收益性的有機結合。2021年公司各月流動性監管指標均達到中國證監會監管要求。

4、現金流轉情況

2021年現金及現金等價物淨增加額為人民幣12.51億元。

2021年經營活動產生的現金流量淨額為人民幣12.36億元，2020年同期為人民幣8.03億元，同比增加人民幣4.33億元；2021年投資活動產生現金流量淨額為人民幣-0.25億元，2020年同期產生現金流量淨額為人民幣-3.10億元，同比增長人民幣2.86億元；2021年籌資活動產生現金流量淨額為人民幣0.45億元，2020年同期產生現金流量淨額為人民幣0.04億元，同比增加人民幣0.41億元；2021年匯率變動的影響為人民幣-0.04億元，2020年同期為人民幣-0.15億元，同比增加人民幣0.11億元；2021年現金及現金等價物淨增加額為人民幣12.51億元，2020年同期為人民幣4.82億元，同比增加人民幣7.70億元。

(ii) 利潤表項目情況

2021年度，本集團實現淨利潤人民幣8,021萬元，同比增加人民幣1,389萬元，增長20.94%，主要財務業績如下：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-------------------|----------------|---------|--------|----------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 手續費收入 | 28,583 | 22,946 | 5,637 | 24.57% |
| 利息淨收入 | 8,412 | 7,264 | 1,147 | 15.79% |
| 投資收益 | 2,498 | 3,789 | -1,292 | -34.09% |
| 公允價值變動收益 | -1,801 | 2,020 | -3,821 | -189.16% |
| 匯兌損益 | -146 | -518 | 373 | 71.87% |
| 其他業務收入 | 126,132 | 120,607 | 5,525 | 4.58% |
| 資產處置損益 | -16 | -14 | -2 | -15.27% |
| 其他收益 | 325 | 44 | 281 | 637.91% |
| 營業收入 | 163,986 | 156,138 | 7,849 | 5.03% |
| 提取期貨風險準備金 | 1,099 | 916 | 183 | 19.97% |
| 其他業務成本 | 124,870 | 117,144 | 7,726 | 6.60% |
| 稅金及附加 | 297 | 222 | 75 | 33.81% |
| 業務及管理費用 | 26,702 | 26,860 | -157 | -0.59% |
| 信用減值損失 | 27 | 1,369 | -1,342 | -98.06% |
| 營業支出 | 152,995 | 146,510 | 6,485 | 4.43% |
| 營業外收入 | 177 | 232 | -56 | -23.97% |
| 營業外支出 | 247 | 589 | -343 | -58.14% |
| 利潤總額 | 10,921 | 9,270 | 1,651 | 17.81% |
| 所得稅費用 | 2,900 | 2,638 | 262 | 9.93% |
| 淨利潤 | 8,021 | 6,632 | 1,389 | 20.94% |
| 基本及稀釋每股收益 | 0.0884 | 0.0731 | | |
| 其他綜合收益稅後淨額 | -406 | -955 | 549 | 57.46% |
| 綜合收益總額 | 7,615 | 5,677 | 1,938 | 34.13% |

1、手續費和利息收入

2021年度，本集團實現手續費及佣金淨收入和利息淨收入人民幣36,995萬元，同比增加人民幣6,784萬元，增長22.46%。

2021年、2020年手續費及佣金淨收入佔比為分別77.26%及75.95%，利息淨收入佔比同分別為22.74%及24.05%。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年 | | 2020年 | | 2021年比較2020年 | |
|-----------|---------------|----------------|--------|---------|--------------|--------|
| | 金額 | 佔比 | 金額 | 佔比 | 增減金額 | 增幅 |
| 手續費及佣金淨收入 | 28,583 | 77.26% | 22,946 | 75.95% | 5,637 | 24.57% |
| 利息淨收入 | 8,412 | 22.74% | 7,264 | 24.05% | 1,147 | 15.79% |
| 合計 | 36,995 | 100.00% | 30,210 | 100.00% | 6,784 | 22.46% |

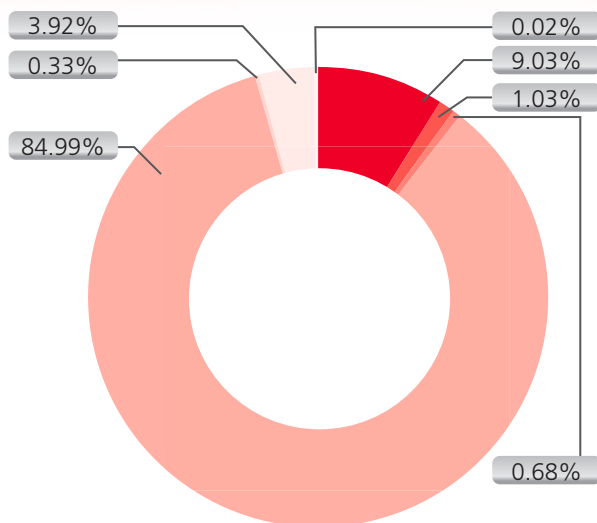
(1) 手續費及佣金淨收入

集團的手續費及佣金淨收入人民幣28,583萬元，同比增加人民幣5,637萬元，增長24.57%。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年 | | 2020年 | | 2021年比較2020年 | |
|------------------|---------------|-------------|--------|--------|--------------|---------|
| | 金額 | 佔比 | 金額 | 佔比 | 增減金額 | 增幅 |
| 商品期貨經紀業務 | 2,581 | 9.03% | 3,201 | 13.95% | -620 | -19.37% |
| 金融期貨經紀業務 | 294 | 1.03% | 422 | 1.84% | -128 | -30.32% |
| 境外期貨經紀業務 | 194 | 0.68% | 244 | 1.06% | -50 | -20.47% |
| 期貨交易所手續費 返還收入 | 24,294 | 84.99% | 17,606 | 76.73% | 6,688 | 37.98% |
| 期權及其他經紀業務 收入 | 93 | 0.33% | 78 | 0.34% | 15 | 19.62% |
| 資產管理業務收入 | 1,122 | 3.92% | 1,342 | 5.85% | -220 | -16.42% |
| 代銷基金業務收入 | 6 | 0.02% | 53 | 0.23% | -47 | -89.48% |
| 手續費總收入 | 28,583 | 100% | 22,946 | 100% | 5,637 | 24.57% |

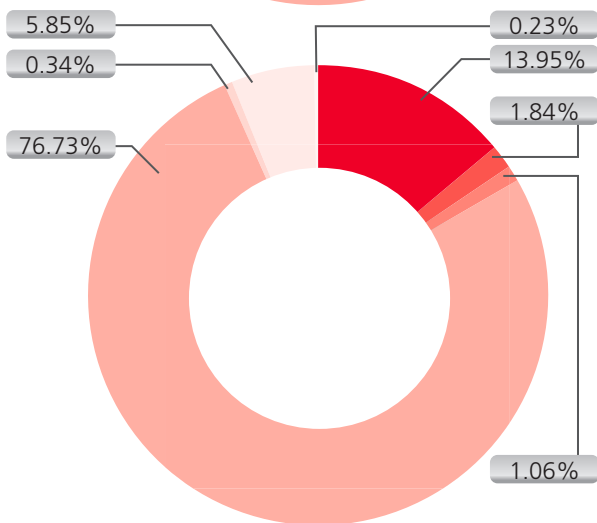
2021年手續費收入

- 商品期貨經紀業務
- 金融期貨經紀業務
- 境外期貨經紀業務
- 期貨交易所手續費返還收入
- 期權及其他經紀業務收入
- 資產管理業務收入
- 代銷基金業務收入



2020年手續費收入

- 商品期貨經紀業務
- 金融期貨經紀業務
- 境外期貨經紀業務
- 期貨交易所手續費返還收入
- 期權及其他經紀業務收入
- 資產管理業務收入
- 代銷基金業務收入



本集團手續費總收入圖表

- ① 期貨業務收入人民幣27,363萬元，同比增加人民幣5,890萬元，增長27.43%，主要包括商品期貨、金融期貨、境外期貨經紀業務手續費收入以及期貨交易所手續費返還收入。其中商品期貨經紀業務手續費收入人民幣2,581萬元，同比減少人民幣620萬元；金融期貨經紀業務手續費收入人民幣294萬元，同比減少人民幣128萬元；境外期貨經紀業務手續費收入人民幣194萬元，同比減少人民幣50萬元，主要是商品期貨經紀手續費收入下降；期貨交易所手續費返還收入人民幣24,294萬元，同比增加人民幣6,688萬元，主要是交易所手續費返還力度較上年增加。
- ② 資產管理業務收入人民幣1,122萬元，同比減少人民幣220萬元，下降16.42%，資產管理業務收入主要由管理費、業績提成構成，管理費依資產管理計劃淨值計提，業績提成依資產管理計劃運行效益計提。截至2021年12月31日，資產管理計劃淨值為人民幣235.93億元，較2020年12月31日的人人民幣221.31億元，同比增加6.61%。資產管理計劃數量由2020年的21個增加到2021年的38個。
- ③ 期權及其他經紀業務收入人民幣93萬元，同比增加人民幣15萬元，增長19.62%。代銷基金業務收入人民幣6萬元，同比減少人民幣47萬元，降低89.48%。此類業務均為近年來集團新型業務，目前在手續費收入中佔比較小。

(2) 利息淨收入

本集團的利息淨收入人民幣8,412萬元，同比增加人民幣1,147萬元，增長15.79%，具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-----------|--------------|-------|-------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 客戶資金存款 | 7,454 | 5,851 | 1,602 | 27.39% |
| 自有資金存款 | 1,026 | 1,477 | -451 | -30.54% |
| 買入返售 | 19 | 49 | -30 | -61.57% |
| 利息支出 | 87 | 113 | -26 | -23.08% |
| 合計 | 8,412 | 7,264 | 1,147 | 15.79% |

利息收入主要來源：①公司自有資金及持有的客戶保證金在金融機構活期及定期存款的利息收入；②買入返售利息收入。利息收入上升主要原因是：公司持有的客戶保證金規模上升，在金融機構的存款利息收入相比2020年增加人民幣1,602萬元，增長27.39%。

2、金融資產收益

2021年度，本集團實現金融資產收益人民幣697萬元，同比減少人民幣5,112萬元，下降88.00%，主要是因為受證券市場行情影響金融資產公允價值下降所致。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-----------|--------------|-------|--------|----------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 投資收益 | 2,498 | 3,789 | -1,291 | -34.09% |
| 公允價值變動損益 | -1,801 | 2,020 | -3,821 | -189.16% |
| 合計 | 697 | 5,809 | -5,112 | -88.00% |

(1) 投資收益

本集團的投資收益人民幣2,498萬元，同比減少人民幣1,292萬元，下降34.09%，具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|----------------|--------------|--------------|---------------|----------------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 金融工具持有期間取得的收益 | | | | |
| — 交易性金融工具 | 3,106 | 2,031 | 1,075 | 52.92% |
| 金融工具處置收益 | | | | |
| — 交易性金融工具 | 2,894 | 7,232 | -4,338 | -59.98% |
| — 衍生金融工具 | -3,456 | -5,339 | 1,882 | 35.26% |
| 權益法核算的長期股權投資收益 | -45 | -134 | 89 | 66.36% |
| 合計 | 2,498 | 3,789 | -1,292 | -34.09% |

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|----------------|--------------|--------------|---------------|----------------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 處置交易性金融資產 | 2,894 | 7,232 | -4,338 | -59.98% |
| 子公司期貨自營及風險管理業務 | -3,456 | -5,339 | 1,882 | 35.26% |
| 股利分配 | 3,106 | 2,031 | 1,075 | 52.92% |
| 權益法核算的長期股權投資收益 | -45 | -134 | 89 | 66.36% |
| 合計 | 2,498 | 3,789 | -1,292 | -34.09% |

2021年集團投資收益主要來源於金融資產處置所得、子公司期貨自營及風險管理業務，較2020年的投資收益下降幅度較大，其中處置交易性金融資產所得、子公司期貨自營及風險管理業務均有所下降。處置交易性金融資產所得減少人民幣4,338萬元，子公司期貨自營及風險管理業務增加人民幣1,882萬元。

金融資產投資業務主要包括股票、基金、信託、資管計劃及債券等處置所得。2021年金融資產投資業務處置交易性金融資產所得同比減少人民幣4,338萬元，下降59.98%，主要原因是本年證券市場行情有所下降，股票、基金等操作獲利空間減少。

2021年集團取得交易性金融資產分紅人民幣3,106萬元，同比增加人民幣1,075萬元，主要來源予集團2021年持有基金產生的分紅收益。

(2) 公允價值變動損益

2021年，集團的公允價值變動損益為人民幣-1,801萬元，同比減少人民幣3,821萬元，下降189.16%。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-----------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 交易性金融資產 | -1,263 | 2,149 | -3,412 | -158.75% |
| 交易性金融負債 | -422 | 102 | -525 | -512.44% |
| 衍生金融資產 | 1,713 | 861 | 852 | 99.01% |
| 衍生金融負債 | -1,829 | -1,092 | -737 | -67.48% |
| 合計 | -1,801 | 2,020 | -3,821 | -189.16% |

3、其他業務淨收入

2021年度，本集團實現其他業務淨收入人民幣1,262萬元，同比減少人民幣2,201萬元，下降63.56%，主要是弘業資本的期現基差貿易業務淨收入及「保險+期貨」業務收到的補貼收入下降。

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|----------------|--------------|---------|--------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 其他業務收入 | 126,132 | 120,607 | 5,525 | 4.58% |
| 其他業務成本 | 124,870 | 117,144 | 7,726 | 6.60% |
| 其他業務淨收入 | 1,262 | 3,463 | -2,201 | -63.56% |

4、其他收入

2021年度，本集團實現其他收入人民幣163萬元，同比增加人民幣652萬元，增幅133.43%，主要原因是政府補助增長以及匯兌損益虧損減少所致。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-------------|--------------|-------|------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 政府補助(含個稅返還) | 325 | 44 | 281 | 637.91% |
| 匯兌損益 | -146 | -518 | 373 | 71.87% |
| 資產處置損益 | -16 | -14 | -2 | -15.27% |
| 其他收入 | 163 | -488 | 652 | 133.43% |

(1) 政府補助

本集團的政府補助(含個稅返還)收入人民幣325萬元，同比增加人民幣281萬元，增長637.91%。政府補助主要來源於：

- 子公司弘業資本獲得稅收返還人民幣262萬元；
- 收到金融創新獎人民幣38萬元；
- 收到期貨市場建設獎勵人民幣10萬元；
- 收到穩崗補貼、以工代訓補貼等收入合計人民幣15萬元。

(2) 匯兌損益

2021年本集團匯兌損益為人民幣-146萬元，產生的主要原因是，公司於2015年末在香港上市，截至2021年12月31日，共有港幣6,905萬元仍未使用。港幣兌人民幣匯率從2020年12月31日的0.84164下降至2021年12月31日的0.81760。2021年集團未使用財務工具對沖匯率波動風險。

5、業務及管理費用

2021年度，本集團營業及管理費用為人民幣26,702萬元，同比下降人民幣157萬元，下降0.59%。具體明細如下表所示：

| 人民幣萬元列示 | 2021年比較2020年 | | | |
|-----------|---------------|---------------|-------------|---------------|
| | 2021年 | 2020年 | 增減金額 | 增幅 |
| 職工薪酬 | 16,704 | 15,449 | 1,255 | 8.12% |
| 辦公費 | 3,771 | 3,724 | 47 | 1.27% |
| 折舊及攤銷 | 2,081 | 2,807 | -726 | -25.86% |
| 租金 | 1,076 | 411 | 665 | 161.83% |
| 財務費用 | 836 | 250 | 587 | 235.02% |
| 諮詢費 | 372 | 1,212 | -840 | -69.34% |
| 維護費 | 287 | 265 | 22 | 8.40% |
| 水電費 | 167 | 105 | 62 | 58.41% |
| 核數師酬金 | 144 | 167 | -23 | -13.54% |
| 保險費 | 124 | 1,391 | -1,268 | -91.12% |
| 研發費用 | 85 | - | 85 | - |
| 修理費 | 64 | 332 | -269 | -80.88% |
| 投資者保障基金 | 49 | 36 | 14 | 38.80% |
| 佣金支出 | 43 | 140 | -97 | -69.58% |
| 其他 | 899 | 571 | 329 | 57.57% |
| 合計 | 26,702 | 26,860 | -157 | -0.59% |

(1) 職工薪酬

職工費用主要包括工資、獎金及津貼、養老金、五險一金等其他社會福利。2021年度集團的職工薪酬人民幣16,704萬元，同比增加人民幣1,255萬元，增長8.12%。主要是因為2020年度因疫情影響，政府減免了公司社會保險支出。

(2) 辦公費用

辦公費用主要包括辦公用品費，信息費、業務招待費、郵電費、差旅費及電子設備運轉等組成。

2021年度集團的辦公費用人民幣3,771萬元，同比增加人民幣47萬元，增長1.27%。

(3) 財務費用

財務費用主要包括貸款利息、銀行手續費等，其中購買金融城辦公用房按揭貸款利息佔比較大。2021年度集團的財務費用人民幣836萬元，同比增加人民幣587萬元，增長235.02%，主要是集團於2021年購買金融城辦公用房申請按揭貸款支付相關利息。

(iii) 資產項目情況

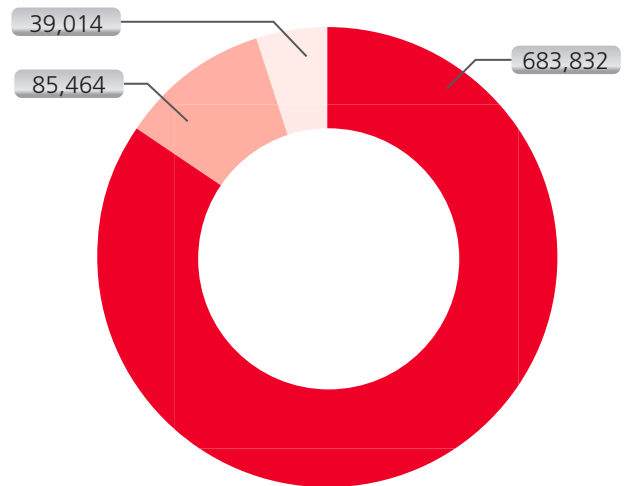
截至2021年12月31日，本集團資產總額為人民幣80.83億元，同比增加人民幣17.34億元，增長27.31%。其中，現金類資產為人民幣68.38億元，同比增長34.35%；金融投資類資產為人民幣8.55億元，同比下降17.85%；其他資產為人民幣3.90億元，同比增長78.15%。本集團主要資產總額變動情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 2021年 | 2020年 | 均按2021年12月31日 比較2020年12月31日 | |
|-----------|----------------|---------|--------------------------------|---------|
| | | | 增減金額 | 增幅 |
| 現金類資產 | 683,832 | 508,978 | 174,854 | 34.35% |
| 金融投資類資產 | 85,464 | 104,038 | -18,574 | -17.85% |
| 其他資產 | 39,014 | 21,900 | 17,114 | 78.15% |
| 合計 | 808,310 | 634,916 | 173,394 | 27.31% |

本集團資產總額的構成情況：

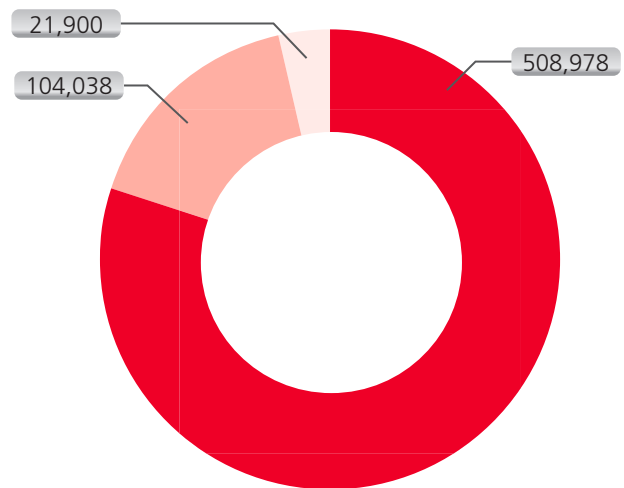
2021年12月31日 資產情況

- 現金類資產
- 金融投資類資產
- 其他資產



2020年12月31日 資產情況

- 現金類資產
- 金融投資類資產
- 其他資產



1、現金類資產

截至2021年12月31日，本集團現金類資產為人民幣68.38億元，佔本集團資產總額的84.60%，同比增加人民幣17.49億元，增長34.35%。本集團現金類資產組合構成情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 | 截至 | 均按2021年12月31日 | |
|-----------|----------------|---------|---------------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 比較2020年12月31日 | |
| | 12月31日 | 12月31日 | 增減金額 | 增幅 |
| 貨幣資金 | 414,364 | 289,430 | 124,935 | 43.17% |
| 應收貨幣保證金 | 202,586 | 213,109 | -10,523 | -4.94% |
| 應收質押保證金 | 66,882 | 6,440 | 60,442 | 938.59% |
| 合計 | 683,832 | 508,978 | 174,854 | 34.35% |

現金類資產變動主要體現在貨幣資金、應收貨幣保證金、應收質押保證金方面，貨幣資金為人民幣41.44億元，佔集團資產總額的51.26%，較2020年相比增加人民幣12.49億元，增長43.17%。應收貨幣保證金人民幣20.26億元，佔集團資產總額的25.06%，較2020年相比減少人民幣1.05億元，下降4.94%。應收質押保證金人民幣6.69億元，佔集團資產總額的8.27%，較2020年相比增加人民幣6.04億元，增長938.59%。

2、金融投資類資產

截至2021年12月31日止，本集團金融投資類資產為人民幣8.55億元，佔本集團資產總額的10.57%，同比減少人民幣1.86億元，下降17.85%。本集團金融投資類資產組合構成情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 | 截至 | 均按2021年12月31日 | |
|-----------|---------------|---------|---------------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 比較2020年12月31日 | |
| | 12月31日 | 12月31日 | 增減金額 | 增幅 |
| 長期股權投資 | 704 | 1,143 | -440 | -38.45% |
| 交易性金融資產 | 84,042 | 101,488 | -17,446 | -17.19% |
| 買入返售金融資產 | 672 | 785 | -113 | -14.44% |
| 衍生金融資產 | 47 | 622 | -575 | -92.51% |
| 合計 | 85,464 | 104,038 | -18,574 | -17.85% |

3、其他資產

截至2021年12月31日止，本集團其他資產為人民幣3.90億元，佔資產總額的4.83%，同比增加人民幣1.71億元，增長78.15%。本集團其他資產組合構成情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 | 截至 | 均按2021年12月31日 | |
|-----------|---------------|--------|---------------|---------|
| | 2021年 | 2020年 | 比較2020年12月31日 | |
| | 12月31日 | 12月31日 | 增減金額 | 增幅 |
| 應收款項 | 4,495 | 6,290 | -1,795 | -28.54% |
| 存貨 | 1 | 4,868 | -4,867 | -99.98% |
| 固定無形使用權資產 | 4,058 | 3,616 | 442 | 12.22% |
| 遞延所得稅資產 | 739 | 823 | -83 | -10.14% |
| 期貨會員資格投資 | 181 | 182 | -1 | -0.66% |
| 其他資產 | 29,540 | 6,121 | 23,419 | 382.60% |
| 合計 | 39,014 | 21,900 | 17,114 | 78.15% |

(iv) 負債項目情況

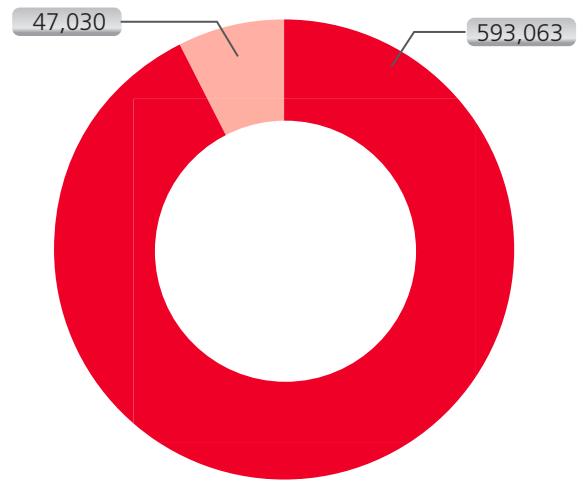
截至2021年12月31日止，本集團負債總額為人民幣64.01億元，同比增加人民幣16.98億元，增長36.12%。其中，應付客戶權益為人民幣59.31億元，同比增長38.31%，主要是由於客戶存入保證金金額增加。本集團主要負債總額變動情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 | 截至 | 均按2021年12月31日 | |
|-----------|----------------|---------|---------------|--------|
| | 2021年 | 2020年 | 比較2020年12月31日 | |
| | 12月31日 | 12月31日 | 增減金額 | 增幅 |
| 應付客戶權益 | 593,063 | 428,784 | 164,279 | 38.31% |
| 其他運營負債 | 47,030 | 41,465 | 5,565 | 13.42% |
| 合計 | 640,093 | 470,249 | 169,844 | 36.12% |

本集團負債總額的構成情況：

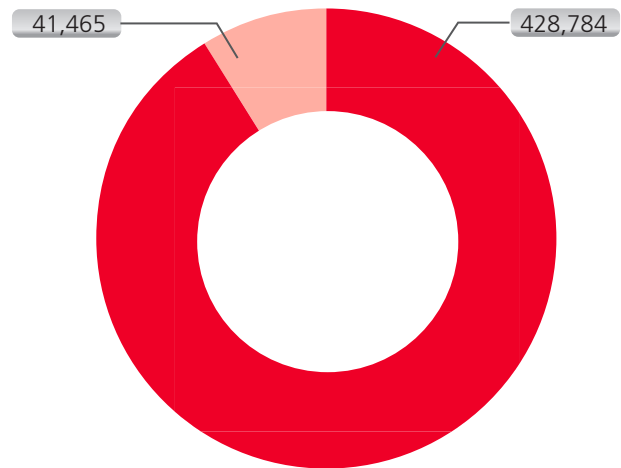
2021年12月31日 負債情況

- 應付客戶權益
- 其他運營負債



2020年12月31日 負債情況

- 應付客戶權益
- 其他運營負債



1、應付客戶權益

截至2021年12月31日止，本集團應付客戶權益為人民幣59.31億元，佔本集團負債總額的92.65%，同比增加人民幣16.43億元，增長38.31%，主要是由於客戶存入保證金金額增加。其中應付貨幣保證金人民幣52.62億元、應付質押保證金人民幣6.69億元。本集團應付客戶權益組合構成情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 2021年 12月31日 | 截至 2020年 12月31日 | 均按2021年12月31日 比較2020年12月31日 | |
|-----------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|--------|
| | | | 增減金額 | 增幅 |
| 法人 | 268,611 | 168,855 | 99,757 | 59.08% |
| 自然人 | 324,452 | 259,929 | 64,522 | 24.82% |
| 合計 | 593,063 | 428,784 | 164,279 | 38.31% |

2、其他運營負債

截至2021年12月31日止，本集團其他運營負債為人民幣4.70億元，佔本集團負債總額的7.35%，同比增加人民幣0.56億元，增長13.42%。本集團其他運營負債組合構成情況如下：

| 人民幣萬元列示 | 截至 2021年 12月31日 | 截至 2020年 12月31日 | 均按2021年12月31日 比較2020年12月31日 | |
|-----------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|---------|
| | | | 增減金額 | 增幅 |
| 金融負債 | 12,061 | 4,341 | 7,720 | 177.82% |
| 其他負債 | 34,969 | 37,124 | -2,155 | -5.80% |
| 合計 | 47,030 | 41,465 | 5,565 | 13.42% |

(v) 權益項目情況

截至2021年12月31日止，本集團權益總額為人民幣16.82億元，同比增加人民幣0.36億元，增長2.16%。
下圖列示出截至所示日期本集團權益構成情況：

| 人民幣萬元列示 | 截至 2021年 12月31日 | 截至 2020年 12月31日 | 均按2021年12月31日 比較2020年12月31日 | |
|---------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------------|-------|
| | | | 增減金額 | 增幅 |
| 股本 | 90,700 | 90,700 | - | 0.00% |
| 儲備 | 77,517 | 73,967 | 3,550 | 4.80% |
| 股東權益合計 | 168,217 | 164,667 | 3,550 | 2.16% |

五、公司分支機構、附屬公司變動及對業績影響**(1) 公司分支機構情況****1、營業部設立和變動情況****(1) 期貨營業部新設及關閉情況**

報告期內，公司未新設營業部，也未關閉營業部。

(2) 營業部遷址情況

公司持續進行營業網點佈局的優化調整。報告期內，有4家營業部變更經營場所，分別為徐州營業部、北京營業部、北京分公司、無錫營業部。

2、分公司設立和變動情況

報告期內，未新設分公司，也未有分公司變動情況。

(2) 附屬公司情況

2021年8月，本公司向弘業資本增資人民幣1.5億元，弘業資本註冊資本由人民幣2.4億元增加至人民幣3.9億元。

(3) 對業績的影響

公司根據整體發展戰略，不斷優化營業網點佈局，努力建設風險可控、管理有效、功能完善、形象鮮明、規模適度以及佈局合理的網點服務體系，充分發揮營業部的整體價值，不斷優化其功能，最終實現營業網點的轉型以及客戶體驗一致性。

六、公司重大投融資情況

(1) 股權融資

報告期內，本公司已就A股發行向中國證監會提交包括A股招股說明書在內的申請材料，本公司於2021年6月29日收到通知，中國證監會已於2021年6月28日受理該申請。有關詳情可參閱公司2021年4月23日的通函及2021年5月14日的投票結果公告。於2022年1月26日，公司收到《中國證監會行政許可申請中止審查通知書》(211614號)，由於中國證監會對信永中和會計師事務所(特殊普通合伙)(本公司有關A股發行的申報會計師)的立案調查，中國證監會中止我公司A股發行審查。於2022年1月29日，公司向中國證監會提交了恢復審查的申請。於2022年2月18日，公司收到中國證監會發出的《中國證監會行政許可申請恢復審查通知書》211614號，通知本公司中國證監會已恢復A股發行審查。於2022年3月17日，本公司A股發行的申請獲得中國證監會第十八屆發行審核委員會2022年第31次工作會議的審核通過。

(2) 債務融資

2021年2月，本公司和弘業資本因在紫金金融中心A4幢(金融城二期)購買辦公用房，向招商銀行股份有限公司南京分行申請按揭貸款，貸款合計人民幣13,985.48萬元，年利率4.5%，貸款期限5年，抵押物為所購買房產的全部權益。

(3) 股權投資

2021年8月，本公司向弘業資本增資人民幣1.5億元，弘業資本註冊資本由人民幣2.4億元增加至人民幣3.9億元。

七、公司重大資產處置、收購、置換、剝離及重組有關附屬公司、聯營公司及合營企業的情況

截至2021年12月31日止年度，公司並無任何有關附屬公司、聯營公司及合營企業的重大收購及出售的事項。

八、業務創新情況及其影響和風險控制

• 業務創新情況及其影響

公司將業務創新置於戰略重點發展地位，報告期內，公司繼續研究和拓展業務創新模式。

1、國際業務功能結構升級

弘業國際金融獲得中國證監會批准的QFII和RQFII資格，QFII類業務鋪墊工作已經完成。弘業國際基金在市場波動加大的情況下保持平穩態勢，其中，廣業基金穩中有升，自2020年10月成立以來累計回報率約23%。陸續開通跨境網下打新、境內可轉債、債券合格投資者等交易權限，產品和合作方式實現多元化。正式開啟香港交易所、芝加哥商業交易所的期權業務。

2、風險管理業務有序發展

弘業資本緊緊圍繞期現業務、做市業務和場外期權三大主業，深化業務佈局，實現營業收入13億元，同比增長4.95%，實現利潤總額人民幣945萬元。其中，期現業務團隊穩定，風控進一步完善，利潤貢獻率達41%，覆蓋有色、黑色、能化和農產品等11個品種；做市品種數量提升至13個，覆蓋三個商品交易所。做市業務成交量同比增長16%，成交金額同比增長51%。場外期權業務品種結構完備，團隊組建完善，運行效率和盈利能力不斷提升，新增成交名義本金超60億元，同比增長60%。深交所股票期權業務正式上線。

3、 財富管理業務穩步提升

在打造「金融超市」理念的指導下，新上線基金產品419隻，代銷基金產品總數1,533隻，實現基金銷售規模1.8億元，位居行業前列。篩選優質私募基金管理人，加大自有資金投資，在投資管計劃及私募資管計劃年化收益率6.67%，贖回產品總收益率8.88%。

● 業務創新風險控制

1、 強化事前制度建設和人員培訓

公司以風險防控為重點，著力完善規章制度和風險控制體系，切實加強源頭治理，有效提升企業管理現代化水平。在新業務開展之前，公司將制定完備的配套制度及合同條款以規範業務操作。同時根據業務性質，選聘合適人員，並加強業務培訓。

2、 加大事中監督

為管控風險，公司加大事中監督。實時關注風險控制，並設置「隔離牆」控制業務風險。

3、 推動落實事後檢查

公司注重自我檢查和責任追究相結合，成立專項風險排查小組，對業務創新進行充分梳理和排查，對發現的問題逐條制定整改措施，並督促完成整改工作，切實有效防範風險。

● 業務創新展望

公司立足客戶需求，創新服務產品，優化「五位一體」服務模式，深入市場，貼近客戶，強化應用場景搭建，有效滿足客戶個性化、差異化和定制化的金融服務需求，為客戶提供有力度、有速度、有溫度的服務，打造創新客戶服務的「弘業模式」。公司以創新業務為新的利潤抓手，以國際化發展為動力，不斷轉型升級，在實體經濟領域深耕細作，以金融科技為引領，在做好傳統經紀業務的基礎上，積極謀劃創新業務，圍繞風險管理、財富管理、資產管理、國際業務等業務，繼續拓展線上、線下兩個平台，運用投行思維，持續推動公司高質量發展。

(一) 資管業務平穩中求突破

不斷豐富資管產品類型，穩步推出衍生品類和「固收+」及FOF產品。以低風險、穩收益產品線為契機，拓展與商業銀行及理財子公司、證券公司、大型三方代銷機構及優質私募機構的對接。擴大公司集合類產品的銷售渠道，提升弘業資管品牌效應。以量化對沖、低風險套利、多策略FOF及打新策略為合作切入點，加大對商業銀行理財子公司及國有企業等大型機構的市場營銷，爭取獲得更多充足穩定的委託資金來源。圍繞北交所、股票套利及高信評債券的投研和交易，加大與集團內部企業間的產品合作。專注於CTA和主動管理，堅持人才培養與引進並舉，有力提升公司自主管理能力，搭建具有自身特色的資產管理團隊。

(二) 風險管理業務精益求精

弘業資本繼續圍繞三大主業跑出加速度，努力成為「專精特新」企業的生力軍。持續深耕產業鏈，對運行平穩的期現業務品種，加大資金投入力度。積極申請商品和金融期權的場內做市商資格，提高做市業務利潤貢獻。優化交易策略，提高盈利水平，力爭場外期權業務成交名義本金邁向新台階。

(三) 財富管理業務搶抓發展新機遇

持續推進公募基金公司設立。以客戶為中心打磨財富產品體系，爭當大類資產配置專家。推進金牌產品線的建設，打造財富金融超市，為客戶提供更加優質的產品。

(四) 深挖國際業務的廣度和深度

加強團隊建設，培養具有自身特色的精英營銷團隊。做大做強主營業務。尋找優質基金合作夥伴，大力配置和營銷基金產品，與國內資管業務形成聯動。聯合香港持牌公司開展IPO承銷保薦業務和債券承銷業務。

九、公司面臨的風險因素，不確定性及對策

公司經營活動面臨的風險主要包括風險管理和內部控制風險、道德風險、市場風險、信用風險、投資風險等。2021年公司採取有效措施，積極主動應對風險，保障了經營活動的安全高效。

(a) 風險管理和內部控制風險

公司依賴風險管理及內部控制制度以及相關人員對於相關制度的嚴格執行來管理風險。公司制定的風險管理及內部控制制度用於識別、監控及控制各種風險，包括市場風險、操作風險、信用風險及合規風險等。但部分風險管理方法是基於內部建立的控制制度、對於過往市場行為的觀察和總結以及標準行業慣例等，在公司業務創新和多元化發展的過程中，可能無法預測未來的風險敞口或者識別意料之外和不可預見的風險。部分風險管理方法依賴於對市場情況及經營狀況相關數據的評估與分析，但對於相關數據的評估和分析可能不準確。此外，隨著市場情況以及監管政策的變化，如果公司不能及時依據未來期貨市場發展及業務擴充而調整完善風險管理及內部控制政策及程序，公司的業務、財務狀況及經營業績可能會受到重大不利影響。

公司的風險管理方法也依賴於執行人員的控制和監督，實際操作中可能會出現錯誤和失誤。儘管公司能夠識別潛在風險，但公司對有關風險的評估及就處理風險採取的相應措施可能並不一定充分有效。由於公司的營業網點分部廣泛，公司無法保證所有員工將全面遵守公司的風險管理及內部控制政策。公司的風險管理及內部控制政策並不一定能保障公司規避全部風險，在此情況下，可能會對公司的業務、財務狀況及經營業績造成不利影響。

(b) 道德風險

道德風險指因未遵守相關法律法規、監督部門或機構的規定、自律行為準則或任何與公司的期貨經紀業務有關的指引而遭受法律制裁、起訴、訴訟索賠、罰款、財務損失以及使名譽受損。道德風險主要與(i)公司的僱員；及(ii)介紹經紀業務。

僱員引發的道德風險包括在未經客戶同意及授權的情況下管理客戶資產、開設賬戶並代表客戶進行交易，其主要指個別員工道德水平不高，不能抵禦充滿誘惑的市場，往往易出現員工違規代客理財、自行開戶交易等行為。目前公司已就工作人員的計算機交易端口透過技術手段予以屏蔽，防範員工在營業場所接受客戶委托代客理財、私自開戶交易。針對員工道德風險，公司從強化內控制度出發，建立了責任追究機制。通過相關部門聯合排查，從源頭杜絕員工開戶交易風險，同時通過加強對員工培訓教育工作，強化道德意識以減低員工發生此類風險的機會。

就介紹經紀而言，公司的道德風險來自：(i)介紹經紀隱瞞其介紹經紀身份，向相關客戶聲稱其為公司的僱員並做出違反法規的事項；(ii)介紹經紀侵犯客戶的利益，私下接受客戶的委託代客理財，在未經客戶同意的情況下進行期貨交易，以從中賺取更多佣金。

在介紹經紀業務方面，公司嚴格把關開戶流程，加強期貨經紀合同的管理，通過回訪使得投資者知曉自己的權益。同時通過持續加強對居間人的管理和風險教育，嚴格執行相關法律法規及居間管理制度，以避免居間業務出現的風險。

(c) 市場風險

市場風險指投資行業的激烈競爭，如利率變動或經濟周期等市場變動導致的收入虧損或減少的可能性。

首先，由於交易集中且價格不斷波動，期貨市場可能使本應在長時間內發生的市場價格波動在極短的時間內發生；其次，保證金製度使得期貨成為一種高槓桿的金融衍生產品；再者，期貨市場允許投機商進入，使市場增加了更多的不確定性與風險。

針對此類風險，公司風控部門通過密切跟蹤市場走勢，監控市場波動，合理調整投資者保證金標準，加強對持倉變化和保證金水平等風險指標的監控，通過適時提高保證金、採取強平等風控措施，依據有關法規規範投資者的交易行為；加大了日常交易中的監控力度，特別是針對熱門品種和合約的異常交易行為監控，對於交易中的對敲行為做到及時發現、及時報告和及時處理；加強對客戶的風險教育工作，提醒投資者做好風險管理，防止投資者因對相關規則的不瞭解及風險防範意識不強而帶來的風險隱患。

(d) 信用風險

當期貨經紀公司接受客戶委托，按照客戶交易指令為其進行期貨交易時，若客戶無法或拒絕履行其合約責任，則期貨公司會遭受損失。來自客戶的信用風險分為兩種，第一種為企業客戶因法人代表更換、所有權變更、業務業績欠佳以及發生其他不可抗力事件而無法履行其合約責任；第二種信用風險來自期貨市場的動盪，導致價格大幅波動，亦使某些客戶無法履行其合約責任。

為控制信用風險，公司嚴格控制開戶流程，落實投資者適當性管理工作。公司將評估每位新客戶的身份、信用度以及其用於期貨交易的資金的充足度。公司亦做好投資者教育與培訓工作，以確保客戶充分瞭解期貨交易相關風險，不斷提高客戶抵禦風險的能力。

(e) 投資風險

投資風險指透過投資發展公司業務導致的投資收入虧損或減少的風險。特別是下列風險：

- 1、 投資目標風險：指投資目標增長及發展的不確定性，包括(但不限於)技術風險、經營風險及財務風險；
- 2、 投資分析風險：指投資項目中進行的不正確或不完整的盡職調查導致的虧損的風險；
- 3、 投資決策風險：指於作出任何決策前有缺陷的決策過程及偏見導致的虧損的風險；
- 4、 項目管理風險：指投資後不充分監督或不當管理以及未能及時發現並控制投資項目的問題而導致的風險；及
- 5、 項目退出風險：指退出虧損投資項目或無法退出投資項目導致的風險。

公司通過資產管理業務投資決策委員會、總經理辦公會、董事會、股東大會等一系列相關權利機構建立健全投資項目的審核和把關，將投資風險降至最低，引入任何投資都將遵循合理程序、訂立全面投資協議以保護公司的合法權利。

(f) 環境、社會及管治風險

本公司董事會對公司的環境、社會及管治策略及匯報承擔全部責任，負責評估及釐定公司有關環境、社會及管治的風險，並確保公司設立合適及有效的環境、社會及管治風險管理及內部監控系統。公司管理層向董事會提供有關係統是否有效的確認。

報告期內，弘業期貨在環境、社會、管治領域新浮現的風險主要為氣候變化風險，本公司《2021年環境、社會及管治報告》(以下簡稱「ESG報告」)詳細介紹了該風險的管理過程及應對與緩解工作。

表1報告期內新浮現ESG風險

| 風險類型 | 風險描述 | 應對或緩解措施 |
|------|--|--|
| 氣候變化 | <ul style="list-style-type: none"> 極端天氣及氣候變化可能影響公司營業部正常運營 碳中和、綠色金融等相關政策引發市場對氣候友好型產品或服務的需求，如無法滿足此期待可能面臨市場風險 | <ul style="list-style-type: none"> 綠色辦公以降低溫室氣體排放 動態識別氣候相關法律法規 選用氣候韌性基礎設施和災備機房 開發綠色低碳相關服務 |

十、公司風險管理體系建設情況

公司風險管理的目標是通過實行全面的風險管理體系，確保業務運營遵守相關法律法規，並將業務運營相關的風險控制在可承受的範圍內，從而實現企業價值實現最大化。公司自2009年監管機構首次推出期貨公司評級以來，過去十三年連續獲中國證監會頒發「A類A級」監管類別。

(1) 風險管理原則

公司重視風險管理體系的重要性，建立該體系用以實現公司的下列業務目標：

- 1、 防止道德、市場、信用及投資風險；
- 2、 確保公司客戶資產及公司自身資產的安全及完整性；
- 3、 確保公司的業務記錄、財務記錄及其他數據的可靠性、完整性及及時性；及
- 4、 加強公司的經營效率及日後業務發展的效率。

公司的風險管理及內部控制體系乃根據下列原則設計：

- 1、 全面性：公司已建立一個全面統一的風險管理體系，其涵蓋公司業務的整個流程、不同部門及單個員工滲透至決策、執行、監察及評估等各流程。各部門及單個員工必須在風險管理流程中擁有一個明確的角色定位及責任劃分。
- 2、 可持續性：公司通過適當監督及評估按可持續基準主動積極設定風險管理目標、實施風險管理措施。
- 3、 獨立性：公司合規風控部、紀檢工作部、審計法律部與其他部門獨立營運，定期檢查、評估及監察適用本公司的多項風險。
- 4、 有效性：風險管理與本公司的業務規模、業務範圍以及實際情況相對應，與實際交付業績的效益結合起來，以便實現本公司的風險管理目標。

公司已建立內部架構及設計業務流程以分散決策制定部門、執行部門以及檢察與評估部門的權力，並在該等部門間實行適當的制衡。

(2) 風險管理體系

公司的風險管理組織架構如下圖所示：



公司的風險管理組織架構包括四個管理層級，即董事會、風險管理委員會、首席風險官以及各業務部門的風控人員。

董事會負責設定風險管理的戰略目標、貫徹風險管理價值觀、任免首席風險官、評估及批准風險管理政策、確保風險管理體系有效實施，並就風險管理體系的有效性提供反饋。

公司的風險管理委員會負責：(i)審閱本公司風險管理策略，包括目標、風險承受能力以及管理及解決重大風險的方案；(ii)分析及評估公司的風險概況及整體風險管理；(iii)就加強公司的風險管理作出建議及意見；及(iv)在資金運用、市場營銷、營運及合規方面監督風險控制體系的實施情況。報告期末，公司的風險管理委員會有四名成員，均擁有學士、碩士或更高學位，一名為高級會計師。公司的風險管理委員會由公司的獨立非執行董事之一王躍堂先生領導。

公司的首席風險官負責確保公司的內部政策得到有效執行及公司的業務政策得到遵守、就本公司制定的重大決策及主要業務活動的風險及對公司管理的遵守情況進行評估並提出意見、檢察及調查有關公司營運的可能的違規情況及風險、向董事會、股東及監管機關獨立報告任何不合規情況以及透過培訓、檢查及監督加強本公司的風險管理。邱相駿先生是公司的首席風險官，在金融業擁有約15年經驗。

各業務部門的風控人員則負責實施風險管理政策。

十一、業內競爭情況及所處市場地位和核心競爭力

• 業內競爭情況

目前，我國期貨市場主要由商品期貨和金融期貨兩大類交易品種構成。其中，商品期貨是指標的物為實物商品的期貨合約。商品期貨歷史悠久，是期貨市場的最初交易品種，種類豐富多樣，發展到目前已經形成了包括農產品期貨、金屬期貨和能源化工期貨等在內的眾多分類。金融期貨是以金融經濟指標作為標的物的期貨合約，主要包括貨幣期貨、國債期貨、股指期貨等品類。金融期貨在金融市場定價、風險規避等方面有著非常重要的作用，對經濟金融體系產生了深遠的影響。

經過30多年的探索發展，我國期貨市場由無序逐漸走向成熟，逐步進入了健康穩定發展、經濟功能日益顯現的良性軌道。同時，我國期貨市場的國際影響力顯著增強，逐漸成為全球最大的商品期貨交易市場和農產品期貨交易市場。我國的大商所、鄭商所、上期所和中金所在全球衍生品交易所交易量排名均躋身世界前列，在世界期貨市場中佔據重要地位。

2021年，期貨業發展邁上了新台階，期貨市場成交量創歷史新高，全市場資金量正式邁入「萬億元時代」；大宗商品波動劇烈，價格持續走高；交易所和期貨公司陣營同步擴容，服務實體經濟再下一城。具體體現如下：

- 一、期貨市場成交量創歷史新高。2021年，中國期貨市場成交量約為75.14億手（單邊，下同），累計成交額約為人民幣581.20萬億元，同比分別增長22.13%和32.84%。分交易所看，2021年上期所累計成交量約為23.71億手，累計成交額為193.11萬億元，同比分別增長14.39%和37.92%，分別佔全國市場的31.55%和33.23%。上期能源累計成交量約為0.75億手，累計成交額約為21.47萬億元，同比分別增長33.55%和67.93%，分別佔全國市場的1.00%和3.69%。鄭商所累計成交量約為25.82億手，累計成交額約為108.00萬億元，同比分別增長51.75%和79.73%，分別佔全國市場的34.36%和18.58%。大商所累計成交量約為23.64億手，累計成交額約為140.46萬億元，同比分別增長7.12%和28.62%，分別佔全國市場的31.47%和24.17%。中金所累計成交量約為1.22億手，累計成交額約為118.17萬億元，同比分別增長5.86%和2.37%，分別佔全國市場的1.62%和20.33%。我國期貨市場2021年全年成交規模再創歷史新高，反映出在全球經濟復甦放緩、新冠疫情持續干擾、輸入型通脹壓力不減和國內保供穩價政策調控等複雜情況下，產業客戶和各類避險機構利用期貨期權市場管理現貨價格風險的需求強烈。

- 二、大宗商品波動劇烈，價格持續走高。從全市場九大板塊表現來看，化工、鋼鐵建材、軟商品和有色金屬四大板塊成交規模錄得大幅增長，鋼材、PTA、甲醇、豆粕、燃料油、菜籽粕、白銀、豆油、棕櫚油、玻璃、純鹼等品種成交量和成交額排名靠前，不銹鋼、紅棗、紙漿、短纖、純鹼、硅鐵等品種成交量和成交額增幅居前，助推全市場成交規模保持增長態勢。金融期貨板塊交易規模也穩中略增，其中上證50股指期貨和2年期國債期貨的成交表現突出，表明金融機構和投資者正在積極利用對沖工具管理股票和債券現貨市場風險。2021年1—5月，需求率先復甦，供需結構性失衡，大宗商品價格持續走高，特別是以鋼材和有色為代表的工業品表現強勁。之後隨著全球經濟復甦邊際放緩以及宏觀政策調控，5月中旬市場出現回調。6—10月，供需結構性不平衡延續，以動力煤、焦煤、焦炭為代表的碳排放相關商品，以甲醇、尿素、乙二醇、純鹼為代表的下游煤化工商品，以及高耗能品種如鋁、合金等供需矛盾凸顯，價格均出現明顯上行。進入四季度以後，國內保供穩價政策逐漸見效，大宗商品價格在10月中旬後出現回調走勢。同時，2021年，商品和股指期權也成交活躍，豆粕、甲醇、玉米、PTA、天然橡膠、鐵礦石期權等成交量排名居前。2021年，我國商品期權市場成交量佔期權市場的98%，成交額佔比79%，持倉量佔比96%，商品期權市場成為推動2021年全市場保持增長的新動力。

- 三、交易所和期貨公司陣營同步擴容，服務實體經濟再下一城。自2013年始，期貨法便進入了漫長的準備階段，經過八年的打磨，期貨法最終在2021年迎來了實質性突破。2021年4月份，期貨法在十三屆全國人大常委會第二十八次會議進行了初次審議；10月23日，全國人大常委會公佈草案二審稿並向社會公開徵求意見，並將「期貨法」更名為「期貨和衍生品法」；12月份，證監會副主席方星海表示，期貨行業基本法制定取得突破性進展，「期貨和衍生品法」通過一讀和二讀，有望在2022年三讀後正式發佈。2021年1月份，證監會批准設立廣州期貨交易所（下稱「廣期所」），經過短短3個月的準備，4月19日，廣期所正式掛牌，這也意味著在上海期貨交易所、鄭州商品交易所、大連商品交易所和中國金融期貨交易所後，境內第五家期貨交易所面世。廣期所未來產品佈局主要涉及4大板塊、一共16個品種。其中，碳排放期貨等綠色發展類產品是核心戰略板塊，同時，圍繞綠色可持續發展，還將推動二次能源—電力期貨，以及與新能源有關的工業硅、多晶硅、鋰、稀土、鉑和鈮等金屬品種的上市。時隔12年後，期貨公司迎來了第150家，2021年7月24日，山東港信期貨有限公司正式開業。自2021年1月份生豬期貨率先推出後，花生期貨、棕櫚油期權、原油期權也陸續推出。從意義上來看，四個品種所具備的特徵不盡相同，例如生豬期貨為我國首個活體交割品種，棕櫚油期權為首個國際化期權，原油期權則是我國首批對外開放的期權品種。至此，我國場內期貨期權品種總量已達94個，涵蓋了農產品、有色金屬、鋼鐵、能源、化工、金融等多個領域。
- 四、全市場資金量正式邁入「萬億元時代」。2021年上半年，在大宗商品價格劇烈波動背景下，企業生產經營風險加劇，急需衍生品等風險管理工具，同時，衍生品天然的風險管理屬性也成為了公募、企業年金和保險資金等中長期資金增值保值需求的重要通道；2021年7月份，我國期貨市場規模已達1.09萬億元，較2020年年初翻了一番，越來越多的機構投資者、中長期資金開始靈活運用股指期貨等金融衍生品對沖風險、獲取收益，實現可持續發展。截至12月初，全國期貨市場資金總量已突破1.2萬億元。

● 所處市場地位

2021年，公司繼續保持發展優勢。依託公司平台、網點佈局、全面牌照資質等多方優勢，充分和互聯網服務相結合，鞏固傳統業務規模，2021年公司代理成交額（雙邊統計，下同）人民幣87,153.93億元，和去年同期的人民幣61,628.98億元相比上升了41.42%；代理成交量114,879,914手，和去年同期的95,749,796手相比上升19.98%。成交額市場佔有率為0.75%。同時積極發展創新業務，保持經營態勢的穩定發展。

2021年，公司連續第十三年獲評中國證監會「A類A級」監管類別。

● 核心競爭力

1、 優越的地理區位

本公司的總部位於江蘇省省會南京市，在江蘇擁有穩固地位。截至報告期末，本公司45家分支機構（包括39家營業部和6家分公司）中，20家位於江蘇省。江蘇省位於我國東部沿海地區，經濟發達。2021年江蘇省生產總值在我國省份排名中名列前茅。在我國穩定經濟增長的推動下，由於江蘇省的優越位置，其為華東重要的製造業中心，有助於其利用大量的經濟及行業機遇。近年來，江蘇省政府不斷出台新政策刺激全省經濟發展，尤其是金融服務行業的發展。在大力實施「穩金融」政策、加大金融開放力度、推進金融供給側結構性改革的大背景下，江蘇不斷建立健全地方金融監管體系，突出抓好一批重大風險隱患防範化解，切實抓好金融等領域風險防控。2017年9月1日，在江蘇省全省金融工作會議上，江蘇省提出要深入貫徹落實全國金融工作會議精神，緊緊圍繞服務實體經濟、防控金融風險、深化金融改革三項任務，努力開創金融改革發展新局面，推動江蘇加快由金融大省向金融強省邁進。江蘇省政府曾發佈《關於加快推進金融改革創新的意見》，促進江蘇省金融控股平台的發展及創新、增強期貨公司、銀行、證券公司、保險公司及信託公司的全面投資能力、進一步提高江蘇省的證券化率。憑借有利的政策條件，本公司將獲得更多市場機會。

在江蘇地區的多家期貨公司中，本公司註冊資本、淨資產、淨資本等多項指標均位居前列。因此，憑借作為江蘇省最大期貨公司的市場地位，憑借對地方市場的深入瞭解，以及對地方市場的強勁客戶需求的敏銳把握，本公司將在未來把握住越來越多的發展機遇。

2、廣泛分佈的營業網絡

公司擁有分支機構共計45家(包括39家營業部和6家分公司)，其中20家位於江蘇省，其餘主要位於北京、廣州、上海和深圳等經濟發達、金融業繁榮地區，實現了對全國金融業發達地區和其他主要地區的覆蓋。此外，本公司的子公司弘業國際金融在香港聯交所、香港期貨交易所及全球其他主要期貨交易所提供證券期貨經紀服務。

本公司期貨分支機構分佈較廣，區位優勢明顯，使得公司能夠獲得發達地區的高端客戶，並受惠於東部沿海地區和中西部地區的城市化及經濟發展成果。公司的營業部分佈和區位覆蓋能夠為本公司客戶提供便利的金融服務，進一步提升本公司的品牌知名度和客戶忠誠度。

3、強大的創新能力保障本公司把握中國期貨行業改革帶來的機遇

隨著我國期貨行業的競爭日益激烈，公司積極把握我國期貨行業改革帶來的新機會，拓寬公司的期貨業務、收益渠道及客戶基礎。2012年7月，中國證監會發佈《期貨公司資產管理業務試點辦法》，並向期貨公司開放資產管理業務資格。2014年12月，中國期貨業協會發佈《期貨公司資產管理業務管理規則(試行)》，允許期貨公司向多個客戶提供資產管理服務；2014年8月，中國期貨業協會發佈《期貨公司設立子公司開展以風險管理服務為主的業務試點工作指引(修訂)》，期貨公司可以通過風險管理子公司從事大宗商品交易及風險管理業務。中國證監會在2014年9月發佈《關於進一步推進期貨經營機構創新發展的意見》，以進一步擴大期貨公司設立風險管理子公司的試點範圍，公司抓住時機，適時開展了包括資產管理、大宗商品交易及風險管理業務在內的各項業務。從2020年1月1日起，期貨公司外資持股比例限制取消，這是期貨行業落實黨中央、國務院進一步擴大金融業對外開放部署的具體舉措。具有良好國際聲譽和經營業績的境外金融機構的加入，將不斷豐富我國期貨市場的參與主體，激發市場競爭活力，助力期貨行業加快構建核心競爭力，進一步提升服務實體經濟的能力。

4、 高效、綜合及穩定的網上交易平台

作為網上期貨交易服務供貨商，公司為客戶提供高效及穩定的交易平台以進行實時交易。通過公司網上交易平台，客戶可在市場開放時實時進行期貨交易，並查閱其賬戶詳細數據及記錄、圖表系統、新聞提要、過往市場數據，並可使用其他服務，如技術分析服務。客戶可通過免費個人計算機軟件交易程序、智能手機應用程序，快速執行交易。

公司維持穩定交易平台的能力是建立及維持客戶忠誠度和吸引新客戶的關鍵因素。公司進一步加大技術投入，著力提升服務質量及客戶體驗，公司的網上交易平台運行穩定且有備份系統支持。從公司網上交易平台運營以來，未發生嚴重影響客戶活動的事件。為確保客戶的交易活動順利進行，公司建立了3個獨立的數據中心，其中1個位於南京，2個位於上海，成功上線上期所、上期所農商行、中金所、鄭商所及大商所極速交易中心，升級完善主要核心業務系統，上線運行恒生個股期權系統等。公司還通過在線雲服務平台，創新推出視頻播報、視頻直播等欄目，定期為投資者發送財經月曆、時下熱點等信息，形成較好的傳播力和影響力。

5、 強大的客戶服務能力

公司為客戶提供客戶服務支持。公司的銷售團隊穩定，公司客戶經理與公司客戶聯繫緊密，通過公司的客戶服務支持，公司能夠利用客戶關係配合在國內的擴張和營運。

公司為客戶提供使用網上交易平台的指導。在交易過程中，公司會就客戶遇到的有關交易系統或客戶的賬戶狀況的技術問題或疑問提供相應服務。公司擁有一支研究團隊，並且在行業內率先建立了國家級博士後工作站，為客戶提供增值信息，如期貨商品的價格趨勢分析。客戶可聯絡公司的客戶經理，討論市場行情和投資策略。

本公司通過400熱線電話、公司微信公眾號、微博公眾號以及手機應用程序弘運通為客戶提供信息諮詢、行情交易、在線開戶等全方位的服務。

6、經驗豐富而穩定的高級管理團隊

本公司擁有一支穩定而經驗豐富的高級管理團隊，在期貨行業擁有數年的工作經驗，並被授予江蘇省國有企業創建「四好」領導班子先進集體稱號。強大而經驗豐富的高級管理團隊是本公司能實現未來長期增長的關鍵因素。

7、全面的業務資質

本公司及子公司在境內外擁有全面的業務資質，實現了從期貨到現貨、從場內到場外、從國內到國際、從在線到線下的全面業務覆蓋。本公司擁有包括：商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢、資產管理、基金銷售、銀行間債券交易以及股票期權交易參與人等中國證監會或行業監管機構頒發的業務資格。

本公司子公司弘業國際金融在香港擁有證券及期貨牌照，可交易或通過代理交易全球主流的境外期貨產品，覆蓋包括CME(芝加哥期貨交易所集團)、LME(倫敦金屬交易所)、HKFE(香港期貨交易所)、Eurex(歐洲期貨交易所)、SGX(新加坡期貨交易所)、TOCOM(東京商品交易所)以及ICE(美國洲際交易所)等全球大型期貨交易所，將來有效對接深港通、滬港通，並代理香港聯交所證券交易、為證券交易提供意見及提供資產管理。

本公司子公司弘業資本，主要從事大宗商品交易及風險管理業務，包括基差貿易、合作套保、場外衍生品業務、做市業務及倉單服務等，是大連商品交易所、鄭州商品交易所和上海期貨交易所13個期貨品種做市商、全國棉花交易市場特別交易商、中國煤炭中心特別交易商、上海期貨交易所標準倉單平台交易商。

十二、公司未來發展的展望

2022年是弘業期貨開啟新時代、邁向新征程的關鍵之年。公司將把握新發展階段，貫徹新發展理念，構建新發展格局，推動高質量發展，促進共同富裕，緊扣控股集團「優勢積聚、業內知名、區域領先」的金融服務主業定位，以及「黨建強、治理優、經營穩、融合好」的發展主題，全面落實管理層各項決策部署，深入強化「五大」經營發展理念，紮實做好「七個堅定不移」，以實幹實績體現公司在「以國內大循環為主體、國內國際雙循環相互促進」的新發展格局下服務實體經濟的責任擔當。

(一) 強化「五大」經營發展理念

持續強化「以合規為底線」的經營理念。合法合規是高壓線，風險控制是生命線。我們要始終對風險保持警惕和謹慎，以「人人都是風險關、人人都是風險官」的理念推動全員風控。通過制度完善、宣講培訓、實時監控、合規審查等方式，對公司經營管理各環節開展從事前到事後的內部監督。加強對重點領域、重點環節管理制度的分析梳理，識別各業務流程和崗位職責中的合規風險點，查漏補缺，完善相關管理措施。深入推進法治企業建設，促進子公司風險管理體系與業務經營管理進一步契合。注重加強企業文化建設和法制宣傳教育，讓「合規、誠信、專業、穩健、擔當」的期貨行業文化理念深入人心。

持續強化「以員工為中心」的管理理念。「國之稱富者，在乎豐民。」共同富裕是我們大家的共同期盼。我們要在做大做好蛋糕的同時，研究分配蛋糕的制度安排，實現職工平均薪酬水平穩步增長，進一步改善員工福利待遇，以實際行動答好「共同富裕」的政治命題。我們還要加大年輕幹部的培養使用力度，保持幹部隊伍的源頭活水，讓更多「千里馬」在弘業期貨「事業平台」上競相奔騰。圍繞集團「四梁八柱」「專精特新」，依託公司「五位一體」戰略，進一步加大對高端人才、創新人才的招引和培養力度，加快打造專業團隊，為各業務部門提供有力支撐。根據控股集團部署，適時推進職業經理人改革，並制定實施兩家子公司職業經理人制度。充分發揮績效考核指揮棒作用和薪酬分配激勵引導作用，讓員工享受更多發展紅利。重視員工職業規劃，關心關愛員工生活，解決員工實際困難。

持續強化「以客戶為中心」的服務理念。立足客戶需求，創新服務產品，優化「五位一體」服務模式，深入市場，貼近客戶，強化應用場景搭建，有效滿足客戶個性化、差異化和定制化的金融服務需求，為客戶提供有力度、有速度、有溫度的服務，打造創新客戶服務的「弘業模式」。

持續強化「以效益為重點」的發展理念。在做好傳統經紀業務的基礎上，積極謀劃創新業務，推動公司實現高質量發展。在資管業務方面，不斷豐富資管產品類型，穩步推出衍生品類和「固收+」及FOF產品。以低風險、穩收益產品線為契機，拓展與商業銀行及理財子公司、證券公司、大型三方代銷機構及優質私募機構的對接。擴大公司集合類產品的銷售渠道，提升弘業的資管品牌效應。以量化對沖、低風險套利、多策略FOF及打新策略為合作切入點，加大對商業銀行理財子公司及國有企業等大型機構的市場營銷，爭取獲得更多充足穩定的委託資金來源。圍繞北交所、股票套利及高信評債券的投研和交易，加大與集團內部企業間的產品合作。專注於CTA和主動管理，堅持人才培養與引進並舉，有力提升公司自主管理能力，搭建具有自身特色的資產管理團隊。風險管理業務方面。弘業資本已列為控股集團提級管理的子企業，要繼續圍繞三大主業跑出加速度，努力成為集團培育的「專精特新」企業的生力軍。持續深耕產業鏈，對運行平穩的期現業務品種，加大資金投入力度。積極申請商品和金融期權的場內做市商資格，提高做市業務利潤貢獻。優化交易策略，提高盈利水平，力爭場外期權業務成交名義本金更上一個台階。財富管理業務方面，持續推進公募基金公司設立。以客戶為中心打磨財富產品體系，爭當大類資產配置專家。推進金牌產品線的建設，打造財富金融超市，為客戶提供更加優質的產品。國際業務方面，加強團隊建設，培養具有自身特色的精英營銷團隊。做大做強主營業務。尋找優質基金合作夥伴，大力配置和營銷基金產品，與國內資管業務形成聯動。聯合香港持牌公司開展IPO承銷保薦業務和債券承銷業務。

持續強化「以黨建為引領」的統籌理念。堅持黨建統領，貫徹黨委把方向、謀大局、定政策、促改革的要求，發揮全面從嚴治黨引領保障作用。完善上下貫通、執行有力的組織體系，提高各級幹部的政治能力和專業化水平。加強幹部職工管理，不斷提高政治判斷力、政治領悟力、政治執行力，確保各項重點工作落實落地。

(二) 紮實做好「七個堅定不移」

堅定不移推進深化改革。全力推進和關注A股IPO工作，早日實現成為首家「A+H」上市的期貨公司。以落實國企改革三年行動計劃為抓手，瞄準發展過程中的痛點、難點、堵點問題精準發力，努力解決一批制約公司創新發展的實際問題。

堅定不移融入大局服務國家戰略。公司是控股集團金融板塊的主力軍，必須從服務國家和全省發展的大局出發，提高站位，提升能力，在「雙碳」戰略、推動鄉村振興、服務實體經濟、節能環保、能源保供等國家戰略中謀篇佈局，把金融服務主業放在新發展格局的戰略大局中來把握。服務好「鄉村振興」戰略。不斷擴展服務外延，創新引入銀行、擔保、龍頭企業等多方參與，積極開發「訂單農業+保險+期貨」「保險+期貨+銀行」等新模式。紮實推進「萬企聯萬村、共走振興路」行動，採取金融助農、產業興農、促農就業等方式，精準助力鄉村振興。服務好「雙碳」目標。習近平總書記強調，實現碳達峰、碳中和是一場廣泛而深刻的經濟社會系統性變革。公司要提前部署碳排放權期貨和電力期貨的前瞻性研究，從運營層面和業務發展角度，投入更多資源、精力，促進綠色金融發展。服務好國家「雙循環」戰略。證監會公佈合格境外投資者可參與金融衍生品交易品種，新增開放商品期貨、商品期權、股指期權三類品種，自2021年11月1日施行。合格境外投資者被允許進入中國期貨市場，這對期貨公司而言，是長期利好的，既可以使期貨市場資金擴容，又可以增加期貨公司獲客渠道。弘業國際金融要發揮好牌照優勢，穩步推進QFII和RQFII業務，爭取在資本市場對外開放的浪潮中搶得先機。

堅定不移加快「科技弘業」建設。緊抓金融科技蓬勃發展的機遇，積極探索金融科技時代下期貨公司的升級方向，搭建具有弘業特色的數字金融平台。深入研究公司長期積累的數據資源、客戶資源，運用大數據分析等方式，構建自動化運維模型，提升金融科技水平。以科技賦能，在逐步實現線上化、自動化的基礎上，向專業化、智能化邁進。

堅定不移提增核心競爭力。期貨公司的核心競爭力主要體現在服務手段和效率上。而研究又是把客戶需求轉化為有效服務的重要環節。我們要堅持以市場為導向，加強事業部建設，繼續苦煉內功，在實戰中不斷提升研究員的研究實力。加大金融研究院對客戶開發和服務的支持力度，加強應用型研究，將研究成果進一步向服務客戶、服務產品轉化，提升公司研發的「變現力」。繼續加強公司在優勢產業的研究能力，充分挖掘、整合行業信息，為客戶提供更具價值的投研報告和策略，更好地發揮期貨為現貨保駕護航的作用。

堅定不移抓安全守底線。深入貫徹習近平總書記關於疫情防控的重要指示要求，嚴格執行控股集團及公司各項防控措施，看好自己的門、管好自己的人、守好自己的陣地。認真履行安全生產主體責任，做到安全投入到位、安全培訓到位、基礎管理到位、應急救援到位，不斷提升企業安全生產能力。

堅定不移全面加強黨的建設。進一步強化黨建和業務深度融合，持之以恆抓好黨建促發展。繼續強化政治擔當，緊緊抓住主體責任這個「牛鼻子」，認真落實「第一議題」制度，切實增強「四個意識」，堅定「四個自信」，做到「兩個維護」。修訂完善「三重一大」決策制度，進一步明確各治理主體之間的權責界限。根據黨委巡察整改質效評估意見，堅決啃下「硬骨頭」，推進巡察整改落地見效。堅持「強基固本」，進一步夯實黨支部在黨的建設工作中的作用。繼續把黨史總結、學習、教育、宣傳引向深入，引導黨員幹部從百年黨史中汲取政治定力、工作智慧和奮進力量。將「兩在兩同」建新功行動與深化黨史學習教育、開展「我為群眾辦實事」實踐活動結合起來，紮實解決一批員工急難愁盼的問題。持續加強黨風廉政建設和反腐敗工作，營造風清氣正的良好氛圍。

堅定不移打造職工「家」文化。堅守發展為民的初心，持續增進員工福祉，充分保障員工權益。加快河西金融城入駐，綜合考量員工訴求，合理佈局，有序開展裝修設計等工作。加強對困難職工、一線職工的關心和關愛，進一步提高員工歸屬感。支持青年工作建設，引導青年員工在改革發展進程中積極作為。充分發揮工會、共青團作用，建立職工閱覽室、黨建工作室、員工活動室等，開展豐富多彩的文體活動，提升企業凝聚力、向心力，營造「團結、卓越、感恩、快樂」的企業文化氛圍。

十三、業務審視

(a) 主要財務比率

| | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------------------------|-------------|-------------|
| 歸屬於本公司股東的每股淨資產(人民幣元/股) | 1.85 | 1.82 |

本集團於2021年12月31日末歸屬於本公司股東的每股淨資產較2020年12月31日增長1.65%。

資產負債率

| | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-----------------------|-------------|-------------|
| 資產負債率(%) ^註 | 22% | 20% |

註： 資產負債率=(負債總額-應付客戶權益)/(資產總額-應付客戶權益)

本集團於2021年12月31日的資產負債率較2020年12月31日有所增加，主要原因是本年新增長期借款以及新增合併結構化主體導致的應付少數投資者權益增加。

加權平均淨資產收益率

| | 2021年 | 2020年 |
|------------|-------|-------|
| 加權平均淨資產收益率 | 4.84% | 4.07% |

本集團2021年度加權平均淨資產收益率較2020年度有所增加，主要原因是本年淨利潤較上年有所增長。

(b) 企業社會責任

1、與僱員之間的關係

員工是本公司寶貴的財富，為公司賴以生存發展的根本，本公司公平對待及尊重員工。人才是強企之基、發展之本和轉型之要。公司堅持以員工為中心，營造以人為本、關愛員工的企業氛圍，全力為員工打造「致富平台」「創業平台」和「事業平台」。2021年內累計有83人入職，截至2021年12月31日員工總人數659名。

公司高度重視人才，進一步拓寬引人渠道，完善育人體系，優化用人機制，為優秀人才提供更為優渥的土壤，最終實現人才強企。一是專業培訓「育才」。堅持把育人鑄魂放在首位，建立多元化的人才培養體系，採取教育培訓、考察調研、人才交流等方式，著力提高各崗位人才的綜合素質和能力。堅持定崗培養與輪崗鍛煉相結合，引導業務骨幹在歷練中成長。公司不斷提高培訓工作的時代性、針對性和有效性，開展內外部培訓70餘場，並選送優秀年輕人參加控股集團中青年幹部培訓班。積極倡導與南京大學、河海大學、南京審計大學等優秀高校持續開展戰略合作，大力實施「素質提升」工程。二是搭建舞台「用才」。堅持「使用是最好的培養」這一原則，重點加大對優秀年輕幹部培養選拔使用力度，構建完善了年輕幹部「選、育、管、用」的培養選拔鏈條。指導人力資源部合理制定業務部門考核辦法、增收節支措施及利潤分配細則等，從考核上激發幹事創業的積極性。公司及所屬子公司實行任期制契約化管理。啟動薪酬制度改革，推動員工與企業的共同發展。三是關懷職工「勵才」。充分發揮工會、共青團等組織的橋樑紐帶作用，持續推進「職工之家」建設。全力推進南京金融城入駐，綜合考量員工訴求，著力為員工提供更好的工作環境。舉辦春日行、端午節包粽子、環湖健康行等喜聞樂見的活動。組織觀看《長津湖》《我和我的父輩》等愛國電影。參加「唱響新時代•邁進新徵程」歌詠比賽，與職工同樂。

公司堅持效率優先、兼顧公平的原則，建立健全績效考核體系。

本公司根據香港及中國的法律、法規和相關政策規定，為員工提供及建立(包括但不限於)公積金、基本醫療保險、養老保險、生育保險、工傷保險、失業保險等法定福利。員工也享受公休、婚假、喪假及產假等休假福利。

多年來，本集團一直通過舉行培訓課程、開展講座講堂等形式打通員工自我提升的通道，籍以提高專業能力。

2、環境保護

本公司旨在盡量減少業務活動對環境的影響並將提醒員工遵循此準則。本公司管理自身業務時奉行低碳減排，節能環保的原則，已採取的相應措施包括：

- 完善公務出行的用車安排，提倡乘坐公共交通工具；
- 鼓勵員工採用雙面打印模式，提醒員工打印及影印時減少浪費；
- 鼓勵員工出門隨手關燈，減少不必要的照明；
- 上線自動化辦公管理系統，提倡電子化辦公，減少紙張的消耗；
- 鼓勵員工自帶水杯，節約一次性紙杯的使用等；及
- 定期開展安全生產隱患大排查，制定專項整治行動方案，加大對安全監管、隱患治理、宣傳教育等方面的投入，確保築牢高質量發展的安全防線。

通過實施相應措施，公司提高了效率，節約了能源，進一步提升了公司整體的環保意識。

3、遵守相關法律及法規

本集團已採納內部控制監督持續遵守相關法律及法規。於報告期內，本集團概無違反有關法律及法規以致對本集團經營業務有重大影響。

4、與客戶及供貨商之關係

本集團與現有及潛在客戶維持良好的關係，有助於公司瞭解市場趨勢、滿足個人客戶及企業客戶多樣化需求、贏得與客戶多次合作機會以及及時調整公司的經營發展策略。由於業務性質的原因，本公司沒有主要供貨商。

十四、報告期後事項

(1) 公司及附屬公司期後投融資行為

無。

董事會報告

本公司董事會欣然提呈本公司截至2021年12月31日止年度的經審核合併財務報表（「財務報表」）。

一、公司主營業務經營情況

列載於本報告第六節「三、業務回顧」。

二、業務審視

列載於本報告第五節「財務摘要」及第六節「十三、業務審視」。

三、公司面對的主要風險及不明朗因素

列載於本報告第六節「九、公司面臨的風險因素，不確定性及對策」、「十、公司風險管理體系建設情況」及「十一、業內競爭情況及所處市場地位和核心競爭力」。

四、報告期後事項及公司未來發展展望

列載於本報告第六節「十二、公司未來發展的展望」及「十四、報告期後事項」。

五、利潤分配及利潤分配預案

本公司已採納股息政策，據此，本公司可通過現金或股份方式向本公司股東派發股息。任何股息分配均應符合本公司組織章程細則的有關規定，分配應實現連續性、穩定性和可持續性。

支付任何股息之建議視乎董事會之絕對酌情權而定，任何末期股息宣派須待股東批准後方可作實。董事會亦應考慮本集團之每股盈利、投資者和股東之合理投資回報，以鼓勵彼等繼續支持本集團的長期發展，本集團之財務狀況和業務計劃，以及市場情況等。

股息政策將不時進行審查，不保證在任何特定時期內會提出或宣布股息。

董事會不建議派發截至二零二一年十二月三十一日之末期股息。

六、發行股份及募集資金使用情況

1. 募集資金使用情況

經中國證監會證監許可[2015]1963號文核准，公司於2015年12月30日於香港聯交所主板上市，共向全球發行2.497億股H股（包括由本公司發售的227,000,000股H股及由售股股東發售的22,700,000股H股），香港公開發售包括的發售股份數目為24,970,000股H股，相當於全球發售的發售股份總數的10%，而國際配售包括的發售股份數目為224,730,000股H股，相當於全球發售的發售股份總數的90%，發行價格為港幣2.43元/股，募集資金總計約港幣6.07億元，本公司所得款項淨額約為港幣5.36億元（經扣除本集團包銷費用及所有相關開支）。

根據招股說明書中對全球發售資金的用途說明，公司募集資金計劃用於：發展本集團的香港及全球期貨業務、發展資產管理業務；發展大宗商品交易及風險管理業務；發展及加強現有期貨經紀業務；購買信息技術設備及軟件及補充本集團的一般營運資金。

本公司募集資金總額扣除各項上市費用、社保轉持繳款及發展公司香港及全球期貨業務部分後匯入中國境內，並兌換為人民幣。

公司於2019年6月6日召開2018年度股東週年大會，將原本擬用於「發展及加強現有期貨經紀業務」的剩餘資金港幣5,000萬元變更為用於「發展香港及全球期貨業務」，並獲得通過。此次變更需經國家外匯管理局、國家發展和改革委員會等相關監管部門核准後方可實施，截至2021年12月31日，公司尚未獲得相關監管部門對上述改變募集資金使用用途申請的批准，主要由於金融企業對外投資審批較為嚴格且當前外匯管制制度從嚴從緊。

2. 募集資金承諾項目使用情況

截至2021年12月31日，上述募集資金已按照招股說明書所列的用途，作如下使用：

| 內容 | 募集資金使用情況匯總(截至2021年12月31日) | | |
|-----------------|---------------------------|----------------|---------------|
| | 可使用金額 港幣：萬元 | 已使用金額 港幣：萬元 | 結餘金額 港幣：萬元 |
| 發展香港及全球期貨業務 | 17,157 | 16,500 | 657 |
| 發展資產管理業務 | 13,404 | 13,404 | - |
| 發展大宗商品交易及風險管理業務 | 10,723 | 9,784 | 939 |
| 發展及加強現有期貨經紀業務* | 5,361 | 52 | 5,309 |
| 購買IT設備及軟件 | 2,681 | 2,681 | - |
| 一般營運資金 | 4,289 | 4,289 | - |
| 合計 | 53,615 | 46,710 | 6,905 |

*附註：獲得監管部門批准，其中港幣5,000萬元將轉為「發展香港及全球期貨業務」。

出於提高資金運用效率的考慮，截至2021年12月31日，本公司將剩餘募集資金以銀行存款的方式存放於大型商業銀行，本公司計劃2022年選擇適當時機，按照招股說明書約定及本公司2018年股東週年大會所修訂(須經監管部門批准)的募集資金淨額及用途，予以使用。

七、董事

公司於報告期內及直至本報告日期止的董事名單、簡歷及變動情況列載於本報告第十節「董事、監事、高級管理人員和員工情況」。

八、董事及監事服務合約

公司所有董事和監事，或其關連的實體均未與公司或公司附屬公司訂立任何在一年內不可在不予賠償(法定補償除外)的情況下終止的服務合約。

九、董事及監事在重要交易、安排或合約中的權益

截至2021年12月31日，公司或附屬公司均未訂立任何令公司董事或監事(或與該董事或監事有關連的實體)於報告期內直接或間接享有重大權益的重要交易、安排或合約。

十、董事在與公司構成競爭的業務中所佔的權益

截至2021年12月31日止，公司概無任何董事在與公司直接或間接構成競爭的業務中持有任何權益。

十一、董事購入股份或債權證的權利

截至2021年12月31日，公司概無授予任何董事或彼等各自配偶或未滿18歲的子女通過購入本公司股份或債券的方式而獲益的權利，或由彼等行使任何該等權利；亦無由本公司或其任何附屬公司作出安排以令董事或彼等各自配偶或未滿18歲的子女於任何其他法人團體獲得該等權利。

十二、董事和最高行政人員於公司及相關法團的股份、相關股份及債券之權益和淡倉

於2021年12月31日，就本公司所獲得的資料及據董事所知，本公司董事及最高行政人員於本公司或其任何相聯法團(定義見《證券及期貨條例》第XV部)的股份、相關股份或債券中概無擁有(i)須根據《證券及期貨條例》第XV部第7及8分部須通知本公司及香港聯交所之權益及淡倉(包括根據《證券及期貨條例》的該等條文被當作或視為擁有的權益或淡倉)，或(ii)須根據《證券及期貨條例》第352條規定須在存置之權益登記冊中記錄，或(iii)須根據《標準守則》的規定需要通知本公司和香港聯交所之權益或淡倉。

十三、購買、出售及贖回證券

截至2021年12月31日止年度內，公司或其附屬公司概無購買、出售或贖回公司任何上市證券。

十四、控股股東於合約之權益

除本報告及招股說明書所披露者外，於報告期末及年內任何時間，公司或其控股公司或任何其附屬公司概無訂立控股股東或其附屬公司於其中擁有重大權益之任何重大合約。

十五、獲准許彌償條文

根據本公司章程，每位董事有權就其任期內，或因執行其職務而可能遭致或發生與此相關之一切損失或責任(按公司條例容許的最大程度)從本公司資產中獲得賠償。公司已就其董事及高級管理人員可能面對因企業活動產生之法律訴訟，為董事及高級管理人員之職責作適當之投保安排。基於董事利益的獲准許彌償條文根據公司條例第470條的規定於董事編製之董事會報告根據公司條例第391(1)(a)條獲通過時生效。

十六、購股權計劃

本公司及其附屬子公司沒有設置購股權計劃。

十七、《避免同業競爭協議》之遵守情況

如公司招股說明書披露，公司於2015年12月8日與蘇豪控股簽立以公司為受益人的不競爭承諾(「不競爭承諾」)。根據不競爭承諾，蘇豪控股及其緊密連絡人(定義見《上市規則》)(公司的附屬公司除外)承諾，除已由招股說明書披露者外，蘇豪控股及其緊密連絡人(定義見《上市規則》)(公司的附屬公司除外)概無以任何形式參與、協助或支持任何第三方經營或參與公司不時從事或考慮從事的業務(即期貨相關金融服務，包括期貨經紀、資產管理及大宗商品交易，以及風險管理業務)構成或將會構成或可能構成直接或間接競爭的任何業務或與當中擁有任何權益。

蘇豪控股已向本公司作出確認，於報告期內蘇豪控股已遵守不競爭承諾項下所作出的所有承諾及規定。公司獨立非執行董事已就蘇豪控股在報告期內遵守和執行不競爭承諾項下所作出的所有承諾及規定進行年度檢閱，確認蘇豪控股已充分遵守該不競爭承諾並無任何違約情形。

十八、其他披露事項

(1) 股本

本集團截至2021年12月31日止年度內的股本變動的詳情載列於本年度報告財務報表附注六、33。

(2) 優先認股權安排

於報告期內，根據中國法律及公司章程的規定，目前公司無優先認股權安排。

(3) 公眾持股量的充足性

於報告期內，根據公司獲得的資料以及董事所知，本公司H股的公眾持股量約為26.61%，符合《上市規則》第8.08條及第13.32條的有關規定。

(4) 管理合約

報告期內，概無訂立或已存在有關本公司全部或任何重大部分業務的管理及行政合約（與各董事、監事及高級管理人員訂立之服務合約除外）。

(5) H股股東稅項減免數據

個人投資者

根據第五屆全國人民代表大會常務委員會於1980年9月10日頒佈，最新於2018年8月31日修訂並於2019年1月1日生效的《中華人民共和國個人所得稅法》及國務院最新於2018年12月18日修訂並於2019年1月1日生效的《中華人民共和國個人所得稅法實施條例》，中國公司支付的股利一般須繳納預扣稅，統一稅率為20.0%。非中國居民的外國個人，從中國公司獲得股利一般須繳納20.0%的個人所得稅，除非獲國務院稅務機關特別豁免或根據適用稅務條約特別扣減。

根據國家稅務總局頒佈的《關於國稅發[1993]045號文件廢止後有關個人所得稅徵管問題的通知》（國稅函[2011]348號），境內非外商投資企業在香港公開發售，其境外居民個人股東可根據其居民身份所屬國家與中國簽署的稅收協議，享受相關稅收優惠。已於香港進行公開發售的境內非外商投資企業向非中國公民的H股個人持有人支付的股利，一般可按10.0%稅率扣繳中國個人所得稅，無需於中國稅務機關辦理申請事宜。如10.0%的稅率不適用，相關企業應：(i)對於身為國外公民而收取股利的H股個人持有人，其國家已與中國訂立稅率低於10.0%的所得稅條約，已於香港進行公開發售的非外商投資企業可代表該等持有人辦理享有更低稅率優惠待遇申請，一經主管稅務機關批准，預扣稅款多扣繳的款項將予以退還；(ii)對於身為國外公民而收取股利的H股個人持有人，其國家已與中國訂立稅率高於10.0%但低於20.0%的所得稅條約，已於香港進行公開發售的非外商投資企業須根據條約協議的稅率預扣稅款，毋須辦理申請；(iii)對於身為國

外公民而收取股利的H股個人持有人，其國家未與中國訂立任何稅務協議或屬其他情況，已於香港進行公開發售的非外商投資企業須預扣稅率為20.0%的稅款。

根據2006年8月21日就所得稅簽署的《內地和香港特別行政區關於對所得避免雙重徵稅和防止偷漏稅的安排》(國稅函[2006]884號)，中國政府可就中國公司應付予香港居民的股利徵稅，但稅額不得超過應付股利總額的10.0%，如香港居民持有中國公司至少25.0%的股權，則有關稅額不得超過中國公司應付股利總額的5.0%。

企業

根據現行有效的《中華人民共和國企業所得稅法》與《中華人民共和國企業所得稅法實施條例》，若非居民企業在中國境內未設立機構、場所，或者雖設立機構、場所但獲得的股利及紅利與其所設機構、場所並無實際關連，則須就其源於中國境內的所得繳納10.0%的企業所得稅。該預扣稅可根據適用避免雙重徵稅條約予以寬減。根據國家稅務總局頒佈並於2008年11月6日生效的《關於中國居民企業向境外H股非居民企業股東派發股利代扣代繳企業所得稅有關問題的通知》(國稅函[2008]897號)，中國居民企業向境外H股非居民企業股東派發2008年及以後年度股利時，則須統一按10.0%的稅率代扣代繳企業所得稅。該預扣稅可根據適用避免雙重徵稅條約予以寬減。

(6) 儲備、可供分配利潤的儲備

本集團截至2021年12月31日止年度內的儲備變動的詳情載列於本年度報告財務報表附註六、38。

(7) 慈善捐款

報告期內，本集團共作出約人民幣3.67萬元之慈善捐款，均為公司員工參與慈善一日捐活動產生。

(8) 主要客戶及供貨商

公司為多個行業中的各類機構和個人客戶提供服務。公司的客戶包括大型企業、中小企業、高淨值客戶和零售客戶，主要客戶位於中國大陸，隨著公司未來拓展海外市場，預期將為更多海外客戶服務。

報告期內，前五大客戶產生的收入及其他收益人民幣5,454,500.73元(期貨手續費淨收入含稅價)元，佔比小於30%。

據董事所知，董事或彼等的任何緊密連絡人或任何擁有本公司已發行股本5%以上權益的股東在報告期內概無於本公司五大客戶擁有任何實益權益。

由於業務性質的原因，本公司沒有主要供貨商。

(9) 物業及設備

本集團截至2021年12月31日止年度內的房屋、廠房以及設備變動的詳情載列於本年度報告財務報表附註六、13。

(10) 履行社會責任情況

公司聚焦鄉村振興，服務「三農」發展。在河南柘城、重慶雲陽、湖南靖州、陝西扶風等9省24個區縣開展17個「保險+期貨」項目，實現賠付金額近人民幣900萬元，惠及參保農戶5,471戶。生豬期貨於2021年1月上市以來，公司在全國6個省19個區縣開展了11個生豬與生豬飼料價格的「保險+期貨」項目。在江蘇鎮江、重慶雲陽實施的生豬「保險+期貨」項目，賠付率分別達91%、134%，為當地養殖戶提供了堅實的收入保障。公司於2021年11月至12月在淮安淮陰、漣水、盱眙三縣以及徐州沛縣開展了生豬「保險+期貨」項目，副省長馬欣於12月赴淮安調研農業農村工作，特別瞭解了當地「保險+期貨」實施情況。在雲南省猛臘縣實施的天然橡膠項目，獲得上海市政府人民幣100萬元的資金支持，並榮獲南京市優秀金融創新項目三等獎。紮實推進「萬企聯萬村、共走振興路」行動，與連雲港灌南縣北陳集鎮邵莊村開展共建。在共建過程中，運用「保險+期貨」、場外期權等工具保障農民種糧收益，並出借資金人民幣16.5萬元助力該村產業發展。適時將該模式從「一司一村」複製到「一司多村」，讓金融活水賦能鄉村發展。公司還選派優秀中層幹部到省派駐村泗洪縣魏圩村擔任第一書記，打通聯繫服務基層群眾「最後一公里」。

同時，公司亦聚焦社會責任，傳承企業擔當。在江蘇證監局的帶領下，公司堅持以維護期貨市場及金融秩序穩定為宗旨，積極配合開展對新紀元期貨的風險處置。安排結算、交易業務骨幹長期駐新紀元期貨。通過派駐幫扶，對維護社會穩定、切實保護投資者合法權益、防範化解金融風險方面起到了積極作用。

(11) 更換核數師

於二零一九年，畢馬威會計師事務所已辭任本公司香港審計師。畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)被任命為本公司唯一審計師。

於二零二一年，公司股東大會審議通過將原畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)變更為信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)，作為公司2021年度財務報告的審計機構。

除上述所披露，於過去三年(包括報告期)，本公司核數師無其他變動。

(12) 更改會計準則及修訂公司章程

公司於2021年5月14日舉行的股東週年大會上通過公司章程的修訂。概無對會計準則作出任何變動。

承董事會
周勇先生
董事長

中國南京，2022年3月29日

其他重要事項

一、公司報告期被處罰或公開譴責的情況

於報告期內，本公司並無被處罰或公開譴責的情況。

二、重大訴訟、仲裁事項

(一) 報告期內新發生的重大訴訟、仲裁案件

無。

(二) 報告期內審結的重大訴訟、仲裁案件

- 1、2020年4月29日，本公司收到南京市棲霞區人民法院寄送的一名原告起訴本公司某員工、本公司侵權責任糾紛案的相關資料，原告訴稱通過案外人與本公司某員工聯繫，該員工向原告等人推薦某交易平台交易，原告交易後產生投資損失及手續費合計人民幣568.9萬元，原告後瞭解到該平台未在我國境內註冊，原告認為該員工與本公司存在欺詐，構成侵權，請求判令：1.該員工賠償投資損失人民幣4,002,240元，手續費人民幣1,686,713.6元，合計人民幣5,688,953.6元；2.本公司承擔連帶賠償責任；3.兩被告承擔訴訟費。經初步核實，原告並非本公司境內期貨客戶，亦非本公司境外子公司弘業國際金融控股有限公司境外期貨客戶，本公司及境外子公司均從未收到過原告的資金。2021年8月31日，本公司收到南京市棲霞區人民法院作出的一審判決，判決認定原告對本公司的訴訟請求不應得到支持，2021年9月22日本公司收到南京市中級人民法院寄來兩份上訴狀，2021年12月10日原告向南京市中級人民法院提出撤回起訴的申請，2021年12月20日，本公司收到南京市中級人民法院裁定書，裁定准予客戶撤回起訴，撤銷一審判決。
- 2、2016年7月，本公司發現發現有一名員工（「A先生」）和其妻子在本公司不知情且未授權批准的情況下將本公司列為保證人，與三名客戶簽訂個人借款合同。其中兩名客戶（「客戶Y」）和（「客戶Z」）案件已審結，第三名客戶案件於2016年12月被天津市靜海區人民法院（「靜海區法院」）駁回起訴。2018年5月25日，該客戶再次向靜海區法院提起民事訴訟，起訴A先生及其妻子、本公司及天津趕大集電子商務有限公司（「趕大集公司」），共涉及兩起訴訟，後原告撤回對趕大集公司的起訴。

第一起訴訟請求為判令A先生及其妻子共同償還原告借款人民幣371.2萬元，並以人民幣371.2萬元為基數按月息2%計算利息，支付自2016年10月27日至實際償還借款日期間利息，本公司承擔連帶給付責任，至2018年5月26日發生的利息人民幣141.056萬元，訴訟標的金額合計人民幣512.256萬元；訴訟費由被告承擔。第二起訴訟請求為判令A先生及其妻子共同償還原告借款人民幣112萬元，並以人民幣100萬元為基數按月息2%計算利息，支付自2016年10月27日至實際償還借款日期間利息，本公司承擔連帶給付責任，至2018年5月26日發生的利息人民幣38萬元，訴訟標的金額合計人民幣150萬元；訴訟費由被告承擔。2020年12月15日，兩案經合併審理後，本公司收到靜海區法院的一審民事判決書：判決A先生及其妻子於本判決生效之日起五日內共同償還原告借款本金446萬元及自2016年10月27日起至實際償還借款之日止的利息(以434萬元為基數，按月利率2%計算)；本公司對A先生及其妻子以上債務中不能清償部分承擔50%的賠償責任。2020年12月28日，本公司向靜海區法院寄送兩案上訴狀。2021年6月22日，本公司收到天津市第二中級人民法院二審判決：駁回上訴，維持原判。

2021年6月30日，本公司向原告支付兩案賠償款人民幣4,701,890.00元，已履行完兩案生效判決確定的給付義務。法院於2021年7月裁定解除對公司賬戶金額共計670萬元的凍結。2021年12月本公司已向天津市高級人民法院提起再審申請，目前法院已受理公司的再審申請。

- 3、弘業資本上海弘蘇經貿分公司(下稱「弘業資本上海分公司」)與某公司就精對苯二甲酸(PTA)採購事宜，因該公司收款後未提供部分貨物，產生糾紛，弘業資本上海分公司於是向南京市秦淮區人民法院提起訴訟，法院於2020年12月23日立案，本案已根據江蘇省高級人民法院於2020年8月31日向全省範圍內各地中級人民法院發出的通知精神移送至江陰市人民法院管轄，訴訟請求為：一、請求確認原告對被告享有人民幣10,713,048.00元及其利息(以人民幣10,713,048.00元為基數，以貸款市場報價利率的1.5倍為標準自2020年6月11日起計算至實際給付之日止)的普通債權；二、判令被告承擔本案訴訟費、保全費等全部訴訟費用。2021年2月3日，江陰市人民法院裁定受理某公司破產重整一案，並於同日指定某律師事務所為某公司管理人。2021年7月7日，弘業資本上海分公司收到一審民事判決書：確認弘業資本上海分公司對某公司享有債權：人民幣10,713,048元及利息。案件受理費、保全費弘業資本上海分公司負擔人民幣1,078元，某公司負擔人民幣90,000元。雙方均未上訴，一審判決已於2021年7月23日生效。2021年7月14日，某公司管理人對弘業資本上海分公司債權的覆審意見為利息人民幣48,590.28元、本金人民幣10,713,048元，合計債權金額人民幣10,761,638.28元。

(三) 報告期內未結的重大訴訟、仲裁案件

- 1、2017年11月3日，本公司北京營業部收到北京市東城區人民法院寄送的客戶L、客戶M起訴本公司北京營業部委託理財合同糾紛兩案傳票及有關材料。兩客戶分別於2005年10月、2007年4月在本公司開立期貨賬戶。兩訴狀指稱本公司一名前僱員向其推銷理財產品，北京營業部未經客戶授權擅自開展期貨交易，以及將客戶賬戶的委託理財資金轉移至北京營業部賬戶進行違規交易，導致客戶資金全部虧損。請求法院：判令本公司北京營業部返還原告理財存款分別為人民幣150萬元、人民幣835.2495萬元及利息，承擔訴訟費。經初步核實，本公司及北京營業部從未與兩客戶簽署過委託理財合同，且本公司嚴格遵守期貨行業相關監管規定，無論是本公司還是分支機構從未開設過期貨賬戶。

兩案分別於2017年11月21日、2017年12月14日進行了管轄權異議談話。2018年1月15日，本公司北京營業部收到管轄權異議的民事裁定書，兩案移送至北京市第二中級人民法院(「北京二中院」)管轄。2018年11月6日，本公司北京營業部收到北京二中院的一審判決，判決駁回兩客戶的全部訴訟請求，案件受理費(已繳納)、鑒定費由兩原告負擔。2019年12月26日，本公司北京營業部收到北京市高級人民法院的二審民事裁定書，裁定撤銷一審判決，兩案發回北京二中院重審。2021年4月14日，本公司北京營業部收到一審民事判決書：本公司北京營業部於本判決生效之日起十日內賠償兩原告合計人民幣196.992萬元。2021年4月28日，本公司北京營業部向法院寄送兩案上訴狀。2021年10月11日，北京市高級人民法院已對兩案開庭審理，目前兩案件處於發回重審後的二審審理中。

(四) 報告期後新發生的重大訴訟、仲裁案件

無。

三、重大合同及履行情況

報告期內，公司無重大托管、承包、租賃事項(金額人民幣1,000萬元以上)及以前期間延續至報告期的此類事項。

四、關聯方情況及關連交易

關連交易

(一) 關連交易

報告期內，本集團嚴格按照《上市規則》和《關連交易管理辦法》開展關連交易。本集團的關連交易主要與本公司的控股股東蘇豪控股及主要股東弘業股份之間發生。其他關聯方交易的情況載於本年度報告財務報表附註十一。本公司就其關連交易或持續性關連交易已符合《上市規則》第14A章的披露規定。

(二) 關連人士

本公司在日常及一般業務過程中與下述關連人士訂立了若干交易：

蘇豪控股

蘇豪控股為由江蘇國資委全資擁有的國有企業，為一家於1994年4月根據中國法律成立的有限責任公司，為本公司發起人之一。於本報告日期，蘇豪控股持有本公司約47.59%的股權，因此為本公司的控股股東。

蘇豪控股為投資控股公司，主要從事(i)金融、實業投資，授權範圍內國有資產的經營、管理；(ii)國貿貿易；(iii)房屋租賃；及(iv)繭絲綢、紡織服裝的生產、研發和銷售。

弘業股份

本公司發起人之一弘業股份為一家於1994年6月30日根據中國法律成立的股份有限公司，並於1997年9月在上海證券交易所上市(證券代碼：600128)。於本報告日期，弘業股份直接持有本公司約16.31%的股權，因此為本公司的主要股東。

弘業股份主要從事(i)承包與其實力、規模、業績相適應的國外工程項目、對外派遣實施上述境外工程所需的勞務人員；(ii)煤炭批發經營；危險化學品批發(具體項目按許可證所列經營)；(iii)乳製品(含嬰幼兒配方奶粉)的批發與零售；II類、III類醫療器械(不包含植入類產品、體外整段試劑及塑料角膜鏡片)；及(iv)實業投資、國內貿易、自營和代理各類商品及技術的進出口業務、房產租賃、商品的網上銷售，網上購物平台的建設、化妝品銷售；初級農產品銷售、散裝食品(含冷藏冷凍食品)、預包裝食品(含冷藏冷凍食品)銷售；國內外工程建設項目招標代理；國際國內招投標代理；消防車、救援及消防設備和器材、安防設備的銷售及維修。

(三) 持續關連交易

1、本集團與蘇豪控股簽署的《蘇豪金融服務框架協議》

由於原有蘇豪金融服務框架協議於2020年12月31日屆滿，且本集團仍繼續提供與蘇豪控股的原有蘇豪金融服務框架協議項下擬進行的類似交易，故本集團與蘇豪控股於2021年4月22日(香港聯交所交易時段結束後)訂立新蘇豪金融服務框架協議。根據該協議，本集團將向蘇豪控股及其附屬公司提供多項金融服務，包括期貨經紀服務、資產管理服務以及大宗商品及風險管理服務。2021年年度上限約為人民幣260萬元，於2021年全年，實際發生額為人民幣5.16萬元。

2、本集團與弘業股份簽署的《弘業物業租賃及管理服務協議》

由於原有弘業物業租賃協議於2020年12月31日屆滿，本集團根據現有弘業物業租賃協議繼續向弘業股份租賃該物業，本集團與弘業股份於2021年5月21日(香港聯交所交易時段結束後)訂立新弘業物業租賃協議。2021年年度上限約為人民幣664.4萬元，於2021年全年，實際發生額為人民幣632.66萬元。

有關詳情請參閱本公司日期為2021年5月21日刊發的公告。

此外，於2021年12月29日(香港聯交所交易時段結束後)，本集團與弘業股份訂立另一份新弘業物業租賃協議，租期由2022年1月1日至2022年12月31日(包括首尾兩日)，為期一年，年租總額約為人民幣6.64百萬元。有關詳情請參閱本公司日期為2021年12月29日刊發的公告。

下表所載為本集團持續關連交易2021年年度限額以及本集團2021年全年所發生之實際關連交易額，於截至2021年12月31日止十二個月期間，本集團發生的持續關連交易已合併計算如下：

| | 2021年 | |
|-------------------------|-----------------|-----------------|
| | 實際金額 (人民幣千元) | 年度上限 (人民幣千元) |
| 1 蘇豪金融服務框架協議 | | |
| 本集團向蘇豪控股及其附屬公司提供勞務產生的收入 | 52 | 2,600 |
| 2 弘業物業租賃及管理服務協議 | | |
| 本集團向弘業股份承租房屋產生的支出 | 6,327 | 6,644 |

本公司董事(包括本公司獨立非執行董事)已檢討上述持續關連交易並確認，該等交易乃遵照下列條件訂立：

- (1) 該等交易乃於本集團日常業務中訂立；
- (2) 該等交易是按照一般商務條款或更佳條款進行；及
- (3) 該等交易是根據有關交易的協議條款進行，而交易條款公平合理，並且符合本公司股東的整體利益。

本公司核數師已審查上述持續關連交易，並向董事會確認：

- (1) 未注意到任何事項，使其相信該等交易未經董事會批准；
- (2) 針對涉及到需要本集團提供貨品或服務的交易，未注意到任何事項，使其相信該等交易在所有重大方面未按照本集團的定價政策進行；
- (3) 未注意到任何事項，使其相信該等交易在所有重大方面未按照相關協議進行；及

- (4) 未注意到任何事項，使其相信各交易的金額已超過其上述各自的年度上限。本公司於報告期內已遵守《上市規則》第14A章規定的披露要求。

五、報告期內收購、兼併或分立情況

無。

六、單項業務資格取得情況

無。

七、主要表外項目

報告期內，公司及附屬公司未發生可能影響財務狀況和經營成果的擔保、抵押等主要表外項目。

八、聘用會計師事務所情況

公司聘用會計師事務所情況及過去更改聘請會計師事務所詳情如下：

根據中華人民共和國財政部頒佈《國有金融企業選聘會計師事務所管理辦法》(財[2020]6號)，金融企業連續聘用同一會計師事務所的期限，原則上不超過五年，連續聘用年限不超過八年。本公司聘用畢馬威會計師事務所已就國內財務報表提供審計服務連續約六年。為符合上述有關規定，本公司已與畢馬威會計師事務所就不再續聘事宜達作一致意見。經公司2021年5月14日舉行的2020年股東週年大會審議批准，公司聘請信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)負責按照中國企業會計準則提供相關審計服務及審閱服務，任期至公司2021年股東週年大會結束之日。

會計師事務所報酬：根據董事會相關授權，公司2021年度外部審計費用為人民幣130萬元，其中H股年度審計及境內年度法定審計費用為人民幣130萬元。2021年度，本公司支付的2021年度審計服務費為人民幣130萬元，並無支付非審計服務費。

九、其他重要事項及期後事項進展情況

(1) 公司及附屬公司董事、監事及高級管理人員變動情況

1、 公司

列載於第十節「董事、監事、高級管理人員和員工情況」。

2、 弘業國際金融

2021年6月28日，吳久鋒先生獲委任董事。

2021年6月28日，賈國榮先生不再擔任董事職務。

2021年9月30日，陳蓉平女士及陳玲女士獲委任董事。

3、 弘業國際資管

無。

4. 弘業資本

2021年4月14日，孫朝旺先生不再擔任弘業資本法定代表人、董事、總經理職務。

2021年9月16日，鄭培光先生不再擔任弘業資本董事長，仍擔任董事職務。

2021年9月16日，吳久鋒先生獲委任法定代表人、董事長、總經理職務。

(2) 公司年度利潤分配預案

2021年利潤分配預案列載於本報告第七節「五、利潤分配及利潤分配預案」。

(3) 附屬公司利潤分配情況

於報告期內，本公司之附屬公司並無利潤分配情況。

(4) 重大投融資行為

- *公司重大投融資行為*

公司重大投融資行為列載於本報告第六節—「管理層討論及分析」。

- *附屬公司重大投融資行為*

附屬公司重大投融資行為列載於本報告第六節—「管理層討論及分析」。

(5) 重大訴訟、仲裁事項

重大訴訟、仲裁事項詳情列在於本報告第八節—「二、重大訴訟、仲裁事項」。

(6) 企業合併或處置附屬公司

於報告期內，本集團並無企業合併或處置附屬公司。

(7) 其他可能對公司的財務狀況、經營成果和現金流量發生重大影響的情況

於報告期內，本集團並無其他可能對公司的財務狀況、經營成果和現金流量發生重大影響的情況。

(8) 期後公司章程及董事會議事規則變動

於報告期後至本報告日期，公司章程及董事會議事規則並無變動。

股份變動及主要股東情況

一、股權架構

本公司截至2021年12月31日的股權架構如下：

| 股東名稱 | 股份類別 | 股份數量 | 佔本公司 已發行股份 總數的概約 百分比(%) ^① |
|----------------|------|--------------------|---|
| 蘇豪控股 | 內資股 | 275,456,777 | 30.37% |
| 弘業股份 | 內資股 | 147,900,000 | 16.31% |
| 弘蘇實業 | 內資股 | 143,548,000 | 15.83% |
| 匯鴻國際 | 內資股 | 63,930,134 | 7.05% |
| 上海銘大實業(集團)有限公司 | 內資股 | 9,276,631 | 1.02% |
| 弘瑞科技創業投資 | 內資股 | 8,903,113 | 0.98% |
| 弘業物流 | 內資股 | 8,285,345 | 0.91% |
| 江蘇弘業永昌(香港)有限公司 | H股 | 8,300,000 | 0.92% |
| 公眾股東 | H股 | 241,400,000 | 26.61% |
| 合計 | | 907,000,000 | 100% |

註： ①該計算乃根據本公司於2021年12月31日已發行股份總數907,000,000股作出。

二、股份變動情況

公司總股數為907,000,000股，報告期內概無變動。

三、主要股東持有本公司股份及相關股份之權益及淡倉

於2021年12月31日，就本公司董事、監事及最高行政人員所知，根據《證券及期貨條例》第XV部第2及3分部須向本公司披露的權益或淡倉，或根據《證券及期貨條例》第336條規定須存置在本公司登記冊中記錄的權益或淡倉所示，主要股東(除本公司董事、監事及最高行政人員外)擁有本公司股份或相關股份的權益或淡倉如下：

| 股東名稱 | 股份類別 | 身份 | 持有的 股份數目 | 佔已發行 股份總額的 概約百分比 ⁽¹⁾ | 佔相關股份 類別中的 概約百分比 ⁽²⁾ |
|---------------------------------------|------|------------------|---------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 蘇豪控股 ⁽³⁾ | 內資股 | 實益擁有人及 受控法團權益 | 431,642,122 (好倉) | 47.59% | 65.67% |
| 弘業股份 | 內資股 | 實益擁有人 | 147,900,000 (好倉) | 16.31% | 22.50% |
| 弘蘇實業 | 內資股 | 實益擁有人 | 143,548,000 (好倉) | 15.83% | 21.84% |
| 深圳昌鴻投資合夥企業(有限合夥) ⁽⁴⁾ | 內資股 | 受控法團權益 | 143,548,000 (好倉) | 15.83% | 21.84% |
| 上海泰合翌天投資合夥企業 (有限合夥) ⁽⁴⁾ | 內資股 | 受控法團權益 | 143,548,000 (好倉) | 15.83% | 21.84% |
| 中山易高投資發展有限公司 ⁽⁴⁾ | 內資股 | 受控法團權益 | 143,548,000 (好倉) | 15.83% | 21.84% |
| 黃捷萍 ⁽⁴⁾ | 內資股 | 受控法團權益 | 143,548,000 | 15.83% | 21.84% |
| 匯鴻國際 | 內資股 | 實益擁有人 | 63,930,134 | 7.05% | 9.73% |
| 徐錫萍 | H股 | 實益擁有人 | 15,234,000 (好倉) | 1.68% | 6.10% |

註：

- (1) 該計算乃根據本公司於2021年12月31日已發行股份總數907,000,000股作出。
- (2) 該計算乃根據本公司於2021年12月31日已發行內資股657,300,000股及已發行H股249,700,000股分別作出。
- (3) 於2021年12月31日，蘇豪控股(i)直接持有275,456,777股內資股；(ii)為弘業股份(直接持有公司147,900,000股內資股)21.81%股權的實益擁有人；及(iii)為愛濤文化集團(被視為於弘業物流直接持有的8,285,345股內資股中擁有權益的公司)100%股權的實益擁有人。如弘業股份之2021年半年報所披露，根據相關中國法律，蘇豪控股被視為弘業股份的控股股東。因此，蘇豪控股被視為於由弘業股份直接持有的公司147,900,000股內資股和由愛濤文化集團間接持有的公司8,285,345股內資股中擁有權益，因此直接及間接於431,642,122股內資股中擁有權益。
- (4) 根據公司現有資料，於2021年12月31日，(i)深圳昌鴻投資合夥企業(有限合夥)持有弘蘇實業99%股權；(ii)上海泰合翌天投資合夥企業(有限合夥)持有深圳昌鴻投資合夥企業(有限合夥)99.71%股權；(iii)中山易高投資發展有限公司持有上海泰合翌天投資合夥企業(有限合夥)79.5%股權；(iv)黃捷萍女士為中山易高投資發展有限公司100%股權的實益擁有人。因此，根據《證券及期貨條例》，深圳昌鴻投資合夥企業(有限合夥)、上海泰合翌天投資合夥企業(有限合夥)、中山易高投資發展有限公司、黃捷萍女士各被視為於弘蘇實業直接持有的143,548,000股內資股中擁有權益。

除上文所披露外，就本公司董事、監事及最高行政人員所知，於2021年12月31日，並無任何其他人士(除本公司董事、監事或最高行政人員外)於本公司股份或相關股份中擁有根據《證券及期貨條例》第XV部第2及3分部須向本公司披露的權益或淡倉，或根據《證券及期貨條例》第336條須存置在本公司登記冊中記錄的權益或淡倉。

報告期末，公司控股股東蘇豪控股持有公司已發行股份總額約47.59%。蘇豪控股成立於1994年4月，註冊資本為人民幣20億元，為江蘇國資委全資擁有的國有企業。蘇豪控股為一家投資控股公司，經營範圍為金融、實業投資，授權範圍內國有資產的經營、管理；國貿貿易；房屋租賃；及繭絲綢、紡織服裝的生產、研發和銷售。

董事、監事、高級管理人員和員工情況

一、現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員基本情況

(1) 董事

| 姓名 | 年齡 | 性別 | 職位 | 委任日期 | 加入集團 公司時間 | 報告期內 領取報酬情況 (人民幣/萬元) | 與其他董事、 監事、高管 關係 | 備註 |
|-----|----|----|----------|-------------|--------------|----------------------------|-----------------------|---------------------|
| 周勇 | 55 | 男 | 董事長兼執行董事 | 2001年1月15日 | 1998年5月 | | 不適用 | |
| 周劍秋 | 52 | 女 | 執行董事兼總經理 | 2015年6月9日 | 1999年3月 | 73.64 | 不適用 | |
| 薛炳海 | 51 | 男 | 非執行董事 | 2012年6月30日 | 2012年6月 | | 不適用 | |
| 姜琳 | 56 | 男 | 非執行董事 | 2019年11月15日 | 2019年11月 | | 不適用 | |
| 單兵 | 54 | 男 | 非執行董事 | 2017年5月26日 | 2017年5月 | | 不適用 | |
| 王躍堂 | 59 | 男 | 獨立非執行董事 | 2018年11月15日 | 2018年11月 | 12.03 | 不適用 | |
| 黃德春 | 56 | 男 | 獨立非執行董事 | 2019年11月15日 | 2019年11月 | 12.03 | 不適用 | |
| 盧華威 | 58 | 男 | 獨立非執行董事 | 2021年12月23日 | 2021年12月23日 | | 不適用 | 於2021年12月23日 獲委任 |
| 林繼陽 | 52 | 男 | 獨立非執行董事 | 2015年6月9日 | 2015年6月 | 12.05 | 不適用 | 已於2021年12月23 日辭任 |

(2) 監事

| 姓名 | 年齡 | 性別 | 職位 | 委任日期 | 加入集團 公司時間 | 報告期內 領取報酬情況 (人民幣/萬元) | 與其他董事、 監事、高管 關係 | 備註 |
|-----|----|----|-------|-------------|--------------|----------------------------|-----------------------|---------------------|
| 虞虹 | 46 | 女 | 監事會主席 | 2019年6月13日 | 2016年7月 | 68.99 | 不適用 | |
| 陳亮 | 40 | 男 | 監事 | 2021年12月23日 | 2021年12月23日 | | 不適用 | 於2021年12月23日 獲委任 |
| 姚愛麗 | 37 | 女 | 監事 | 2019年6月13日 | 2010年6月 | 27.02 | 不適用 | |
| 王健英 | 55 | 女 | 監事 | 2014年12月25日 | 2014年12月 | | 不適用 | 已於2021年12月23 日辭任 |

(3) 高級管理人員

| 姓名 | 年齡 | 性別 | 職位 | 任職起始日期 | 與其他董事、 監事、高管 關係 | 備註 |
|-----|----|----|--------------|-------------------------|-----------------------|----|
| 周劍秋 | 52 | 女 | 執行董事兼總經理 | 2015年5月至今任總經理 | 不適用 | |
| 趙東 | 52 | 男 | 副總經理 | 2014年3月至今任副總經理 | 不適用 | |
| 儲開榮 | 47 | 男 | 副總經理 | 2016年6月至今任副總經理 | 不適用 | |
| 黃海清 | 38 | 男 | 副總經理 | 2020年10月至今任副總經理 | | |
| | | | 董事會秘書兼聯席公司秘書 | 2020年12月至今任董事會秘書兼聯席公司秘書 | | |
| 吳久鋒 | 39 | 男 | 副總經理 | 2020年10月至今任副總經理 | | |
| 陳蓉平 | 52 | 女 | 財務負責人 | 2019年6月至今任財務負責人 | 不適用 | |
| 邱相駿 | 41 | 男 | 首席風險官 | 2017年8月至今任首席風險官 | 不適用 | |

二、董事、監事和高級管理人員報告期內在股東單位及其他機構任職情況

(1) 董事

| 姓名 | 在本公司職位 | 其他任職機構 | 在其他機構任職職務 |
|-----|----------|---|---|
| 周 勇 | 董事長兼執行董事 | 蘇豪控股 紫金財產保險股份有限公司 | 董事長 董事(已於2021年2月辭任) |
| 周劍秋 | 執行董事兼總經理 | 弘業資本 弘業國際金融 | 董事 董事 |
| 薛炳海 | 非執行董事 | 蘇豪控股 江蘇蘇豪投資集團有限公司 江蘇金蘇證投資發展有限公司 江蘇眾合創業投資有限公司 江蘇紫金農村商業銀行股份有限公司 江蘇蘇豪基盛投資管理有限公司 | 總裁助理 董事長 董事長 董事、總經理 董事 董事長 |
| 姜 琳 | 非執行董事 | 弘業股份 | 總經理、董事 |
| 單 兵 | 非執行董事 | 江蘇弘蘇實業有限公司 | 非執行董事 |
| 王躍堂 | 獨立非執行董事 | 江蘇省國信集團有限公司 上海浦東發展銀行 南京中央商場(集團)股份有限公司 珠海華發實業股份有限公司 | 外部董事 外部董事 獨立董事 獨立董事 |
| 黃德春 | 獨立非執行董事 | 永安期貨股份有限公司 蘇州蘇試試驗集團股份有限公司 上海煦茂信息技術有限公司 世界水谷(南京)書院文化發展有限公司 | 獨立董事 獨立董事 監事 監事 |
| 盧華威 | 獨立非執行董事 | 邦盟匯駿顧問有限公司 山東新華製藥股份有限公司 重慶機電股份有限公司 天福(開曼)控股有限公司 | 主席、執行董事 獨立非執行董事 獨立董事 獨立董事 |

| 姓名 | 在本公司職位 | 其他任職機構 | 在其他機構任職職務 |
|--------------------|---------|---|--|
| 林繼陽 ^(註) | 獨立非執行董事 | 新威國際控股有限公司 高銳中國物聯網國際有限公司 港深聯合物業管理(控股)有限公司 建成控股有限公司 匯財金融投資控股有限公司 | 獨立非執行董事 執行董事兼行政總裁及公司秘書 獨立非執行董事 獨立非執行董事 獨立非執行董事 |

註： 林繼陽先生已於2021年12月23日退任董事。

(2) 監事

| 姓名 | 在本公司職位 | 其他任職機構 | 在其他機構任職職務 |
|--------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|
| 虞 虹 | 監事會主席、 股東代表監事 | 弘業資本 蘇豪控股 | 監事 黨委巡察工作辦公室副主任 |
| 陳 亮 | 股東代表監事 | 利安人壽保險股份有限公司 江蘇匯鴻國際集團股份有限公司 | 監事 投資部副經理 |
| 姚愛麗 | 職工代表監事 | — | — |
| 王健英 ^(註) | 股東代表監事 | 東江環保股份有限公司 中融信佳投資擔保有限公司 | 副總裁、財務負責人董事長 — |

註： 王健英女士已於2021年12月23日退任股東代表監事。

(3) 高級管理人員

| 姓名 | 在本公司職位 | 其他任職機構 | 在其他機構任職職務 |
|-----|--------------------------|--|----------------|
| 周劍秋 | 執行董事兼總經理 | 請參閱上文「董事、監事和高級管理人員 報告期內在股東單位及其他機構任職 情況—董事」分節 | — |
| 趙 東 | 副總經理 | — | — |
| 儲開榮 | 副總經理 | — | — |
| 黃海清 | 副總經理 董事會秘書兼聯席 公司秘書 | — | — |
| 吳久鋒 | 副總經理 | 弘業資本 弘業國際金融 | 董事長、總經理 董事 |
| 陳蓉平 | 財務負責人 | 弘瑞新時代 弘瑞成長 弘業國際金融 | 董事 董事 董事 |
| 邱相駿 | 首席風險官 | 弘業資本 | 董事 |

三、董事、監事及高級管理人員的主要簡歷

董事、監事及高級管理人員在其他機構兼職情況列載於第十節「二、董事、監事和高級管理人員報告期內在股東單位及其他機構任職情況」。

(1) 董事

執行董事

周勇先生，中國國籍，無境外永久居留權，1966年12月出生，55歲，博士學位。

周勇先生為江蘇省人事廳(現為江蘇省人力資源和社會保障廳)認可的正高級經濟師及高級國際商務師以及江蘇省人力資源和社會保障廳認可的研究員。

周勇先生自2001年1月獲委任為本公司董事長兼董事(彼於2015年7月獲指派為執行董事)，主要負責主持及監督本公司全面工作，制定公司戰略規劃，組織召開董事會。周勇先生自1999年2月至2006年6月於江蘇弘業國際集團投資管理有限公司(「弘業投資」)擔任總經理。彼自2006年6月至2010年7月亦任職於江蘇弘業國際集團有限公司，擔任副總裁。周勇先生自2010年7月至2013年5月任蘇豪控股副總裁，自2013年5月至2021年6月任蘇豪控股董事及總裁，自2021年6月至2021年9月任蘇豪控股總裁及董事長，2021年9月至今任蘇豪控股董事長。

周劍秋女士，中國國籍，無境外永久居留權，1969年8月出生，52歲，碩士學位。

周劍秋女士自1990年7月至1995年5月，就職於南京金融高等專科學校，任職科員；自1995年5月至1999年3月，就職於江蘇省國投證券營業部，任職財務主管；自1999年3月至2011年6月，就職於江蘇弘業期貨經紀有限公司，歷任財務部負責人、財務總監、行政總監、副總經理；2011年7月至2012年11月，就職於江蘇弘業期貨有限公司，任職常務副總經理；2012年12月至2015年4月，就職於弘業期貨股份有限公司，任職常務副總經理；2015年5月至今，就職於弘業期貨股份有限公司，任職總經理，為公司法定代表人，於2015年6月被選為執行董事。

非執行董事

薛炳海先生，中國國籍，無境外永久居留權，1970年9月出生，51歲，碩士學位，高級會計師。

薛炳海先生自1995年7月至2007年6月就職於江蘇蘇豪國際集團股份有限公司資產財務部，歷任科員、總經理助理、副總經理；2007年6月至2007年12月，就職於江蘇省蘇豪控股集團有限公司(原江蘇省絲綢集團有限公司)資產財務部，任職副總經理；2008年1月至2013年3月，就職於江蘇省蘇豪控股集團有限公司資產財務部，任職總經理；2008年2月至2013年3月，兼任江蘇蘇豪創業投資有限公司及江蘇蘇豪投資管理有限公司董事、總經理；2008年6月至2013年3月，兼任江蘇蘇豪國際集團股份有限公司財務總監；2013年3月至今，就職於江蘇省蘇豪控股集團有限公司，任職總裁助理，就職於江蘇蘇豪投資集團有限公司，任董事長。

姜琳先生，中國國籍，無境外永久居留權，1965年8月出生，56歲，學士學位。

姜琳先生自1988年7月至1998年4月，在南京食品包裝機械研究所任職，擔任研究室主任；1998年4月至2002年3月，在江蘇弘業股份有限公司任職，先後任辦公室職員、辦公室副主任，同時兼任證券部副經理；2002年3月至2010年2月，在江蘇弘業股份有限公司任職，擔任人事部經理兼證券部經理；2010年2月至2011年2月，在江蘇弘業股份有限公司任職，兼任人事部經理；1999年9月至2014年4月，擔任江蘇弘業股份有限公司董事會秘書；2008年1月至2019年7月，任江蘇弘業股份有限公司副總經理；2019年8月至2020年5月，任江蘇弘業股份有限公司常務副總經理；2019年9月至今，任江蘇弘業股份有限公司董事；2020年5月至今，任江蘇弘業股份有限公司總經理；2020年10月至今，任弘業股份董事會秘書。

單兵先生，中國國籍，無境外永久居留權，1967年12月出生，54歲，碩士學位。

單兵先生自1990年7月至2000年4月就職於南通機床股份有限公司(集團)，任職董事會秘書兼證券部主任、審計處處長；2000年4月至2002年4月，就職於國信證券有限責任公司，任職上海資產管理總部研究負責人兼基金經理；2002年5月至2006年1月，就職於興安證券有限責任公司，任職資產管理部首席研究員、組合投資負責人；2006年4月至2007年6月，就職於上海源吉投資有限公司，任職副總裁兼任投資總監，兼任上海駿鼎投資有限公司投資總監；2007年6月至2013年3月，就職於江蘇瑞華投資控股集團有限公司，任職副總經理兼研究總監；2013年3月至2017年2月，就職於上海凱石益正資產管理有限公司，任職合夥人、副總經理兼投資總監；2017年2月至今，就職於江蘇弘蘇實業有限公司，任職非執行董事。

獨立非執行董事

王躍堂先生，中國國籍，1963年6月出生，58歲。上海財經大學管理學(會計)博士。

王躍堂先生自1985年7月至1990年8月就職於揚州師範學院，任職數學系教師；1990年9月至1993年1月，在南京理工大學攻讀碩士學位；1993年2月至1997年8月，就職於揚州大學，任職會計系教師；1997年9月至2000年6月，在上海財經大學攻讀博士學位；2000年7月至2000年11月，就職於香港嶺南大學，任職研究員；2000年12月至今，就職於南京大學，任職會計系教師，其中2009年1月至2009年6月在美國康奈爾大學做訪問學者。

黃德春先生，中國國籍，無境外永久居留權，1966年2月出生，55歲，博士研究生學位。

黃德春先生自1989年9月至2000年12月，任江蘇財經職業技術學院教師；2002年7月至2004年7月，在江蘇宿遷市經濟貿易委員會掛職副主任；2004年1月至今，任河海大學商學院教師；2004年9月至2006年7月，在南京大學理論經濟學博士後站做博士後；2006年8月至2007年2月，在美國北愛荷華大學(UNI)金融系做訪問學者。

盧華威先生，中國香港籍，擁有英國永久居留權，1963年9月出生，58歲，碩士學位。盧華威先生於1986年畢業於香港中文大學，獲工商管理學士學位，並於1992年畢業於美國新澤西科技學院，獲管理科學碩士學位。盧先生是香港會計師公會的執業會員及美國職業會計師公會的會員，於審核及業務諮詢服務方面擁有逾20年服務經驗。

林繼陽先生，中國國籍，擁有香港永久居留權，1969年7月出生，52歲，碩士學位。林繼陽先生為英國特許公認會計師公會資深會員、香港會計師公會資深會員、香港《證券及期貨條例》第4類(就證券提供意見)及第9類(提供資產管理)受規管活動的持牌人。已於2021年12月23日辭任。

(2) 監事

虞虹女士，中國國籍，無境外永久居留權，1975年8月出生，46歲，碩士學位，研究生學歷。

虞虹女士自1997年7月至1999年6月就職於江蘇省國防科工辦直屬機關黨委、綜合處，任職科員；1999年6月至2000年12月，就職於江蘇省國防資產管理有限公司人資部、綜合部，任職科員；2000年12月至2006年5月，就職於江蘇省國防工業資產管理有限公司，歷任副科長、正科長；2006年5月至2010年8月，就職於江蘇省絲綢集團有限公司，歷任辦公室秘書科科長、人力資源部總經理助理；2010年8月至2015年5月，就職於江蘇蘇豪國際集團股份有限公司，歷任人力資源部副總經理、人力資源部總經理、總經辦主任及黨辦主任；2015年5月至2016年7月，就職於江蘇省蘇豪控股集團有限公司，任職法律部副總經理(主持工作)；2016年7月至今，就職於弘業期貨股份有限公司，先後擔任董事會秘書、黨委副書記、紀委書記；2021年12月至今，就職於蘇豪控股，任黨委巡察工作辦公室副主任。

陳亮先生，中國國籍，無境外永久居留權，1981年3月出生，40歲，碩士學位，研究生學歷。

陳亮自2008年8月至2013年2月就職於江蘇省高科技投資集團，任投資經理；2013年3月至2015年5月，就職於上海復星凱雷股權投資基金，任副總裁；2018年7月至2019年10月，就職於光銀國際資產管理(中國)有限公司，任投資總監；2019年11月至今，就職於江蘇匯鴻國際集團股份有限公司，任投資部副總經理。

姚愛麗女士，中國國籍，無境外永久居留權，1984年10月出生，37歲，碩士學位，研究生學歷。

姚愛麗女士自2010年6月至2014年4月就職於江蘇弘業期貨經紀有限公司，歷任行政人事部員工、主管；2014年5月至今，就職於弘業期貨股份有限公司，歷任辦公室總經理助理、辦公室副主任(主持工作)、辦公室主任兼黨辦主任(部門總經理級)。

王健英女士，中國國籍，無境外永久居留權，1966年10月出生，55歲，研究生學歷，高級會計師。

王健英女士自1986年8月至2000年12月就職於江蘇省外經貿廳，歷任財務處科員、副主任科員、科長；2001年1月至2007年7月，就職於江蘇開元國際集團有限公司，歷任財務部副總經理、總經理；2007年8月至2019年2月，就職於江蘇匯鴻國際集團股份有限公司，歷任總會計師、企管部總經理、運營部總經理；2019年3月至今，就職於東江環保股份有限公司，任副總裁兼財務負責人。已於2021年12月23日辭任。

(3) 高級管理人員

周劍秋女士，有關周劍秋女士的履歷詳情，請參閱上文「董事簡歷－執行董事」分節。

趙東先生，中國國籍，無境外永久居留權，1969年12月出生，52歲，本科學歷。

趙東先生於2014年3月獲委任為公司副總經理，主要分管本公司部分營業部。加入本公司之前，趙東先生自1989年3月至1997年1月為宜興市經濟協作委員會員工；1997年2月至1999年8月，為常州建證期貨公司宜興辦事處市場部員工；1999年9月至2000年4月，就職於無錫利大期貨經紀有限公司，任職市場部經理；2000年5月至2003年9月，就職於宜興華證期貨經紀有限公司，任職市場部經理；2003年10月至2014年3月，就職於華證期貨經紀有限公司，歷任市場部經理、上海營業部負責人、副總經理、總經理；2011年8月至2014年3月，就職於華證期貨有限公司，任職總經理；2014年3月至今，任公司副總經理。

儲開榮先生，中國國籍，無境外永久居留權，1974年7月出生，47歲，本科學歷。

儲開榮先生於2016年6月獲委任為公司副總經理，主要分管公司總部及外地營業部的數個業務部門。儲開榮先生自2004年9月起供職於本公司，先後擔任機構投資部副經理、經理、機構管理部總經理、公司總經理助理以及副總經理等職務。

黃海清先生，中國國籍，無境外永久居留權，1983年3月出生，38歲，碩士學位，研究生學歷。

黃海清先生於2020年10月獲委任為公司副總經理，主要分管部數個綜合部門、業務部門、事業部及團委。黃海清先生自2009年6月至2009年10月任江蘇弘業國際集團服務貿易有限公司員工；自2009年11月至2014年12月任弘業期貨股份有限公司市場總部員工；自2015年1至2015年6月任弘業期貨股份有限公司互聯網業務部部門負責人；自2015年7月至2020年6月任弘業期貨股份有限公司互聯網業務部總經理；自2020年6月至2020年7月任弘業期貨股份有限公司互聯網業務部總經理（總經理助理級待遇）；自2020年7月至2020年11月任弘業期貨股份有限公司金融產業總部負責人（總經理助理級待遇）；2020年10月起任弘業期貨股份有限公司副總經理，2020年12月起任弘業期貨股份有限公司董事會秘書。

吳久鋒先生，中國國籍，無境外永久居留權，1982年2月出生，39歲，本科學歷。

吳久鋒先生於2020年10月獲委任為公司副總經理，主要分管公司資產管理中心、總部數個業務部門、事業部及子公司。吳久鋒先生自2007年10月至2008年3月任江蘇弘業國際集團服務貿易有限公司金融期貨一部員工；自2008年4月至2008年8月任江蘇弘業期貨有限公司金融期貨一部客戶經理；2008年09月至2009年9月任江蘇弘業期貨有限公司金融期貨一部高級客戶經理；自2009年10月至2010年7月任江蘇弘業期貨有限公司金融期貨總部經理助理；自2010年8月至2012年2月任江蘇弘業期貨有限公司金融期貨總部副經理；自2012年2月至2015年7月任弘業期貨股份有限公司金融期貨總部副總經理；自2015年7月至2020年11月任弘業期貨股份有限公司金融期貨總部總經理；2016年6月至2020年10月弘業期貨股份有限公司總經理助理；自2020年10月至今任弘業期貨股份有限公司副總經理。

陳蓉平女士，中國國籍，無境外永久居留權，1969年3月出生，52歲，本科學歷，高級會計師。

陳蓉平女士自1990年8月至2009年4月，就職於江蘇弘業股份公司，任職財務部經理助理；2009年4月至2013年6月，就職於江蘇弘業國際集團有限公司，任職資產財務部經理；2013年6月至2015年6月，就職於江蘇省蘇豪控股集團有限公司，先後任職正科級紀檢員、監察室主任助理；2015年6月至2019年1月，就職於江蘇蘇豪投資集團有限公司，任職財務部負責人兼資產財務部總經理；2019年1月至2019年5月，就職於江蘇蘇豪國際集團股份有限公司黨委委員、財務總監；2019年6月至今，就職於弘業期貨股份有限公司，任職黨委委員、財務負責人。

邱相駿先生，中國國籍，無境外永久居留權，1980年5月出生，41歲，研究生學歷。

邱相駿先生於2017年8月獲委任為公司首席風險官，主要負責公司的合規及風險管理。邱相駿先生自2008年1月起供職於本公司，先後擔任稽核部經理助理、副經理，合規審計部副經理、經理，審計法律部經理，交易交割部負責人兼公司總經理助理，公司首席風險官。

四、報告期內董事、監事和高級管理人員變動情況

(1) 董事變動情況

2021年12月23日，林繼陽先生因任期屆滿辭任公司獨立董事；同日，盧華威先生獲委任為公司獨立董事。

(2) 監事變動情況

2021年12月23日，王健英女士因工作原因辭任公司股東代表監事；同日，陳亮先生獲委任為公司股東代表監事。

(3) 高級管理人員變動情況

無。

五、董事、監事和高級管理人員薪酬管理情況

(1) 董事、監事和高級管理人員薪酬制度及決策程序

公司董事的薪酬與考核由董事會薪酬委員會提出方案，由股東大會審議決定；監事的薪酬由股東大會審議決定；高級管理人員的薪酬與考核由董事會薪酬委員會提出方案，由董事會決定。

(2) 董事、監事和高級管理人員薪酬確定依據

公司內部董事、監事薪酬根據公司股東大會關於董監事薪酬決議，並結合公司經營業績、崗位職責、工作表現及市場環境等因素確定。獨立非執行董事由董事會薪酬委員會根據行業市場水平制定方案，並經股東大會通過實施。公司高級管理人員薪酬及獎懲事項根據董事會決議並結合公司考核激勵約束機制方案確定。

(3) 非現金薪酬情況

目前公司未施行股權激勵制度，無非現金薪酬。

(4) 董事、監事和高級管理人員薪酬支付情況

公司董事、監事及高級管理人員2021年薪酬總額為人民幣5,835.10千元。董事、監事薪酬支付情況詳見本節「一、現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員基本情況」。

截至2021年12月31日止年度按金額等級劃分，在本公司領取薪酬的董事、監事的酬金載列如下：

| 薪酬等級(人民幣) | 人數 |
|-------------------|----|
| 0-500,000 | 4 |
| 500,001-1,000,000 | 2 |

截至2021年12月31日止年度按金額等級劃分本公司高級管理人員的酬金載列如下：

| 薪酬範圍(人民幣) | 人數 |
|-------------------|----|
| 0-500,000 | 3 |
| 500,001-1,000,000 | 4 |
| 1,000,000以上 | 0 |

六、員工及薪酬情況

(1) 員工人數及構成

報告期末，本公司共有全日及半日員工586人，附屬公司共有全日及半日員工73人，構成情況如下：

弘業期貨股份有限公司及其附屬公司人員統計表

| 員工數量(人) | | 659 | |
|---------|-------------|-------|--------|
| 用工形式項目 | | 全日及半日 | |
| 項目 | 分類 | 人數 | 佔比 |
| 學歷結構 | 博士研究生 | 4 | 0.61% |
| | 碩士研究生 | 128 | 19.42% |
| | 大學本科 | 438 | 66.46% |
| | 專科及以下 | 89 | 13.51% |
| 崗位分類 | 期貨經紀業務 | 367 | 55.69% |
| | 資產管理業務 | 26 | 3.95% |
| | 商品交易和風險管理業務 | 48 | 7.28% |
| | 期權業務 | 3 | 0.46% |
| | 境外業務 | 33 | 5.01% |
| | 研究 | 25 | 3.79% |
| | 審計法律、風險管理 | 15 | 2.28% |
| | 信息技術 | 31 | 4.70% |
| | 財務會計 | 45 | 6.83% |
| | 行政 | 66 | 10.02% |
| 年齡 | 35歲及以下 | 397 | 60.24% |
| | 36歲至40歲 | 150 | 22.76% |
| | 41歲至50歲 | 90 | 13.66% |
| | 51歲及以上 | 22 | 3.34% |

(2) 員工薪酬

公司員工薪酬由基本工資、津貼、績效獎金和福利構成。基本工資是薪酬構成中相對固定的部份，是員工基本收入。津貼包括特殊崗位津貼、專業技術人才津貼等，是基本工資的補充。績效獎金根據績效考核結果進行分配，向業績突出的業務一線及員工傾斜。截至2021年12月31日止年度員工成本總額(包括董事酬金)約為人民幣1.67億元，具體情況列載於本報告財務報表附註六、25。

公司按照國家相關規定為員工建立社會保險、住房公積金等法定福利，同時為提高員工的福利保障水平，公司還為員工提供企業年金、補充醫療保險等福利。

(3) 退休福利

本集團為中國內地的全職員工提供了政府規定的養老保險金計劃，即本集團根據員工薪金總額的一定比例，按月向政府規定的社會保險機構繳納養老保險金，員工退休後，由政府承擔向其支付養老金的義務。根據上述設定提存計劃，本集團無須就超出上述供款的退休後福利承擔責任。向該等計劃提供的供款於發生時計入費用。

(4) 培訓計劃

為不斷提升公司幹部員工的專業能力和職業素養，公司建立了分層分類、統籌兼顧的培訓計劃。

對經營管理人員重點開展以提高證券期貨行業發展認知、管理理論與技能戰略思維能力、經營管理能力等內容的培訓；對各業務條線和部門的員工重點開展以強化業務知識、提高產品開發、營銷技巧和服務能力等內容的培訓。同時，鼓勵員工通過自學、參加職業資格考試等方式進行自主學習，及時更新專業知識，特別是對考取期貨投資分析、基金從業資格、香港期貨從業等資格的員工給予獎勵。

(5) 最高五位酬金人士

五名最高薪酬人士中，概無人士為董事(其酬金在本報告財務報表附註十五、(二)中披露)。酬金總和如下：

(單位：人民幣千元)

| | 2021年 | 2020年 |
|-----------|-----------------|-----------------|
| 薪金、津貼與福利 | 1,742.42 | 1,192.21 |
| 酌情花紅 | 5,384.58 | 3,639.91 |
| 養老金計劃供款 | 191.62 | 13.26 |
| 總計 | 7,318.63 | 4,845.38 |

該等人士的酬金介乎以下範圍：

| | 2021年 人數 | 2020年 人數 |
|-------------------------|-------------|-------------|
| 0港幣至1,000,000港幣 | 0 | 3 |
| 1,000,001港幣至1,500,000港幣 | 0 | 1 |
| 1,500,001港幣至2,000,000港幣 | 5 | 1 |
| 2,000,001港幣至2,500,000港幣 | 0 | 0 |
| 總計 | 5 | 5 |

報告期內概無已付或應付該等人士的薪酬，以作為退休金或吸引加盟或於加盟本集團後的獎勵或離職補償。

企業管治報告

一、公司治理概況

作為在香港上市、註冊在國內的公司，公司嚴格遵守上市地和國內的法律、法規及規範性文件的要求，依法合規運作，始終致力維護和提升公司良好的社會形象。公司根據《公司法》、《證券法》等法律法規以及監管規定，形成了股東大會、董事會、監事會、管理層之間分權制衡、各司其職的公司治理結構，確保了公司的規範運作。公司股東大會、董事會、監事會的會議召集召開程序、表決程序合法有效，公司信息披露真實、準確、及時、完整，投資者關係管理高效務實，公司治理科學、嚴謹、規範。公司已採納了《企業管治守則》內的守則條文。於報告期內，公司嚴格遵守《企業管治守則》，遵守了全部守則條文，並達到了《企業管治守則》中所列明的絕大多數建議最佳常規條文的要求。自2022年1月1日起，《上市規則》附錄十四已更名，其結構亦已重新編號。

二、企業管治與環境、社會及管治之間的聯繫

企業管治可說是董事會制定決策和開展業務的框架。整個董事會所有人均會專注於為股東創造長期的可持續增長，並為所有相關持份者創造長期價值。有效的企業管治架構有助公司了解、評估並管理風險和機會(包括環境和社會風險及機會)。董事會負責設定風險管理的戰略目標、貫徹風險管理價值觀、評估及批准風險管理政策、確保風險管理體系有效實施，並就風險管理體系的有效性提供反饋。有關本集團業務面對的主要風險請參閱列載於本報告第六節管理層討論及分析「九、公司面臨的風險因素，不確定性及對策」，有關截至2021年12月31日止年度的環境、社會及管治事項詳情，請參閱本公司另行刊發的環境、社會及管治報告。

三、股東與股東大會

(1) 股東大會權利

股東大會作為公司的最高權力機構，根據公司章程以及股東大會議事規則等規定，依法履行股東大會的職權。公司嚴格按照規定召集、召開股東大會，確保所有股東享有平等地位，充分行使股東權利。2021年公司共召開股東大會3次，詳細解答了股東關注的問題，認真聽取股東對公司發展的意見和建議。

(2) 股東大會會議情況

報告期內，公司共召開3次股東大會，會議情況和決議內容如下：

2021年1月28日，本公司召開2021年第一次臨時股東大會，會議審議通過以下議案：《關於購買紫金金融中心辦公用房的議案》。

2021年5月14日，本公司召開2020年股東週年大會，會議審議通過以下議案：《關於公司首次公開發行A股股票並上市的議案》；《關於提請公司股東大會授權公司董事會全權辦理公司首次公開發行A股股票並上市相關事宜的議案》；《關於公司首次公開發行A股股票募集資金投資項目可行性分析報告的議案》；《關於公司A股股票發行攤薄即期回報的影響及填補措施的議案》；《關於公司A股股票發行後三年內股票價格穩定方案的議案》；《關於公司首次公開發行A股股票並上市後三年分紅回報規劃的議案》；《關於公司在A股發行文件中作出公開承諾事項的議案》；《關於制定公司A股發行並上市後生效的關聯(連)交易管理制度的議案》；《關於制定公司A股發行並上市後生效的獨立董事制度的議案》；《關於制定公司A股發行並上市後生效的募集資金管理制度的議案》；《關於弘業期貨股份有限公司首次公開發行股票前滾存未分配利潤或累計未彌補虧損歸屬的議案》；《關於建議修訂本公司現行公司章程的議案》；《關於制定公司A股股票上市後適用的公司章程及其附件的議案》；《關於制定於A股發行並上市後生效的本公司股東大會議事規則的議案》；《關於制定於A股發行並上市後生效的本公司董事會議事規則的議案》；《關於制定於A股發行並上市後生效的本公司監事會議事規則的議案》；《關於建議修訂本公司現行股東大會議事規則議案》；《關於建議修訂本公司現行董事會議事規則的議案》；《關於公司2020年度報告的議案》；《關於本公司截至2020年12月31日止年度之財務決算報告的議案》；《關於本公司截至2020年12月31日止年度之董事會報告的議案》；《關於本公司截至2020年12月31日止年度之監事會報告的議案》；《關於本公司截至2020年12月31日止年度的利潤分配方案及宣派末期股息的議案》；《關於公司前次募集資金使用情況報告的議案》；《關於聘任信永中和會計師事務所為本公司核數師，任期直至本公司下屆股東週年大會結束時為止，並授權本公司總經理辦公會議釐定其酬金的議案》；《關於授權董事會釐定本公司董事及監事截至2020年12月31日止年度的薪酬組合的議案》

2021年12月23日，本公司召開2021年第二次臨時股東大會，會議審議通過以下議案：《關於選舉公司第四屆董事會成員的議案》；《關於選舉公司第四屆監事會成員的議案》。

四、董事會及履行職責情況

(1) 董事會及管理層各自職責

董事會和管理層的權力和職責已在公司章程中進行了明確規定，以確保為良好的公司管治和內部控制提供充分的平衡和制約機制。董事會負責召集股東大會，並向股東大會報告工作；執行股東大會的決議；決定公司的經營計劃和投資方案；制定公司的年度財務預算方案、決算方案；制定公司的利潤分配方案和彌補虧損方案；制定公司增加或者減少註冊資本、發行公司債券或其他證券及上市方案；擬訂公司重大收購、收購本公司股票或者合併、分立、解散及變更公司形式的方案；在股東大會授權範圍內，決定公司對外投資、收購出售資產、資產抵押、委託理財、關聯交易等事項；決定公司內部管理機構的設置；聘任或者解聘總經理、首席風險官、董事會秘書；根據董事長或總經理的提名，聘任或者解聘公司副總經理、財務負責人等高級管理人員，並決定其報酬事項和獎懲事項；制訂公司的基本管理制度；制訂章程的修改方案；管理公司信息披露事項；向股東大會提請聘請或更換為公司審計的會計師事務所；聽取公司首席風險官、總經理的工作匯報並檢查其工作；按照監管部門規定，批准公司須由董事會批准的分支機構設立；審閱《上市規則》下公司任何主要交易、非常重大的出售事項、非常重大的收購事項、反收購行動，並提請股東批准；審閱《上市規則》下公司任何除主要交易、非常重大的出售事項、非常重大的收購事項、反收購行動外的須予公佈的交易；批准按《上市規則》無需股東大會批准或公告的關聯交易；審閱按《上市規則》需股東大會批准的關聯交易；制定及檢討公司的企業管治政策及常規，並向董事會提出建議；檢討及監察董事及高級管理人員的培訓及持續專業發展；制定、檢討及監察員工及董事的操守準則；檢討及監察公司在遵守法律及監管規定方面的政策及常規等；及檢討公司遵守《企業管治守則》的情況及在《企業管治報告》內的披露。

管理層主要工作內容包括：傳達貫徹各監管部門(中國證監會、江蘇證監局、中國期貨業協會、江蘇省期貨業協會等)等上級單位的重要指示、決定和工作部署；落實公司董事會的決定、決議和工作部署；擬訂公司戰略規劃草案並向董事會提出戰略規劃建議；擬訂公司年度經營計劃方案並提交董事會審議，制定落實年度經營計劃的工作部署；擬訂公司年度投資計劃，審核子公司年度投資計劃，提交董事會審議；根據董事會審議通過的投資計劃制定相應的實施方案。擬定公司年度財務預算、決算方案和彌補虧損方案，提請董事會審議；擬訂公司改制、破產、兼併重組、資產調整、產權轉讓、資產質押、處置、核銷、拍賣等方案，並提交董事會審議及報送控股集團；根據管理權限，在授權範圍內研究審議子公司改制、破產、兼併重組、資產調整、產權轉讓、資產質押、處置、核銷、拍賣等方案，並按有關規定提交董事會審議及報送上級單位；擬訂公司對外借貸、融資、擔保計劃並提交董事會審議；研究批准子公司的借貸、融資、擔保等計劃，審批超計劃借貸、融資、擔保等事項；擬訂公司管理機構和人員編製調整、設置方案及基本管理制度並提交董事會審議，研究制定具體經營管理規定；根據公司與子公司、分支機構管理權限的劃分，行使公司管理總部的職權，依法對公司下屬子公司、分支機構進行管理等。

(2) 董事會的組成

董事會不斷完善董事會議事規則，充分發揮專門委員會的專業優勢，進一步提高董事會的決策效率和決策水平。公司獨立非執行董事忠實履行職責，維護公司整體利益，尤其關注中小股東權益，保障了董事會決策的獨立性和科學性。

目前，公司董事會由8名董事組成，其中，2名執行董事(周勇先生(董事長)、周劍秋女士)，3名非執行董事(薛炳海先生、姜琳先生、單兵先生)，3名獨立非執行董事(王躍堂先生、黃德春先生、盧華威先生)，目前獨立非執行董事人數符合《上市規則》、公司章程等相關規定。

董事由股東大會選舉產生，每屆任期三年，董事任期屆滿可連選連任。截至2021年12月31日止年度，公司確認收到每名獨立非執行董事根據《上市規則》第3.13條就其獨立性而作出的年度確認函，公司並確認各獨立非執行董事的獨立於公司身份。

董事會成員之間概無存有任何關係(包括財務、業務、家屬或其他重大／相關的關係)。

各董事之履歷詳情載於第十節第三分節「董事、監事及高級管理人員的主要簡歷」。

(3) 董事投保安排

公司為董事、監事及高級管理人員投保了董監高責任險，管理董事、監事及高級管理人員在履職過程中可能產生的法律風險和監管風險，進一步促進董事、監事及高級管理人員充分履職、勤勉盡責。

(4) 董事會會議情況

報告期內，公司共召開9次董事會，會議情況和決議內容如下：

2021年2月3日，本公司召開第三屆董事會第二十一次會議，會議審議通過以下議案：《關於弘業資本管理有限公司申請向江蘇省蘇豪控股集團有限公司借款的議案》；《關於公司成立行政管理部的議案》；《關於公司成立安全管理部的議案》；《關於宜興營業部資產報廢的議案》。

2021年3月26日，本公司召開第三屆董事會第二十二次會議，會議審議通過以下議案：《關於公司首次公開發行A股股票並上市的議案》；《關於提請公司股東大會授權公司董事會全權辦理公司首次公開發行A股股票並上市相關事宜的議案》；《關於公司首次公開發行A股股票募集資金投資項目可行性分析報告的議案》；《關於公司A股股票發行攤薄即期回報的影響及填補措施的議案》；《關於公司A股股票發行後三年內股票價格穩定方案的議案》；《關於公司首次公開發行A股股票並上市後三年分紅回報規劃的議案》；《關於公司在A股發行文件中作出公開承諾事項的議案》；《關於制定公司關聯(連)交易管理制度的議案》；《關於制定公司獨立董事制度的議案》；《關於制定公司募集資金管理制度的議案》；《關於弘業期貨股份有限公司首次公開發行股票前滾存未分配利潤或累計未彌補虧損歸屬的議案》；《關於修改公司現行公司章程及其附件的議案》；《關於制定公司A股股票上市後適用的公司章程及其附件的議案》；《關於公司截至2020年12月31日止經審計之年度業績公告及2020年度報告草案的議案》；《關於《弘業期貨股份有限公司2020年度董事會報告》的議案》；《關於《弘業期貨股份有限公司2020年度財務決算報告》的議案》；《關於公司2020年度利潤分配預案的議案》；《關於公司2020年淨資本等各項風險監管指標情況報告的議案》；《關於公司前次募集資金使用情況報告的議案》；《關於弘業期貨2020年度內部審計工作情況匯報及2021年度內

部審計計劃的議案》；《關於審議更改公司在香港的主要營業地址名稱的議案》；《關於聘任公司2021年度會計師事務所及其酬金的議案》；《關於弘業期貨財務工作管理制度修訂的議案》；《關於授權總經理辦公會審議運用公司自有資金進行投資的議案》；《關於公司董事、監事及高級管理人員2020年度薪酬待遇的議案》；《關於制定《弘業期貨股份有限公司經理層成員任期制、契約化改革工作實施方案》的議案》；《關於公司召開2020年度股東大會、2021年第一次內資股類別股東會議及2021年第一次H股類別股東會議的議案》。

2021年5月21日，本公司召開第三屆董事會第二十三次會議，會議審議通過以下議案：《關於公司與江蘇弘業股份有限公司房屋租賃關連交易的議案》；《關於對弘業資本實施增資的議案》；《關於審議及批准公司截至2018年、2019年及2020年12月31日止年度中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案》；《關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案》。

2021年6月30日，本公司召開第三屆董事會第二十四會議，會議審議通過以下議案：《關於審議《弘業期貨股份有限公司2020年度環境、社會及管治報告》的議案》。

2021年8月26日，本公司召開第三屆董事會第二十五次會議，會議審議通過以下議案：《關於審議及批准公司截至2021年6月30日止六個月之未經審核綜合中期業績公告草案及中期報告草案的議案》；《關於考慮派發截至2021年6月30日止六個月之中期股息的議案》；《關於公司2021年上半年淨資本等各項風險監管指標情況報告的議案》；《關於金融城辦公大樓出租第22層並承租第31-33層的議案》；《關於修訂《弘業期貨股份有限公司違規經營投資責任追究實施辦法》的議案》；《關於修訂弘業期貨股份有限公司合同管理辦法(試行)的議案》；《關於制定弘業期貨股份有限公司審計整改工作考核辦法(試行)的議案》；《弘業期貨2021年上半年內部審計工作情況匯報及下半年內部審計工作計劃》。

2021年9月15日，本公司召開第三屆董事會第二十六次會議，會議審議通過以下議案：《關於審議及批准公司截至2018年、2019年、2020年12月31日、2021年6月30日中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案》；《關於公司前次募集資金使用情況報告的議案》；《關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案》。

案》；《關於確定2020年度弘業期貨領導班子副職(包括黨委副書記、紀委書記、財務負責人)年度薪酬分配系數的議案》；《關於制定董事會授權公司經理層清單的議案》。

2021年11月15日，本公司召開第三屆董事會第二十七次會議，會議審議通過以下議案：《關於公司召開2021年第二次臨時股東大會的議案》；《關於弘業資本管理有限公司申請向江蘇省蘇豪控股集團有限公司借款的議案》。

2021年12月1日，本公司召開第三屆董事會第二十八次會議，會議審議通過以下議案：《關於選舉公司第四屆董事會成員的議案》。

2021年12月23日，本公司召開第四屆董事會第一次會議，會議審議通過以下議案：《關於選舉公司第四屆董事會董事長的議案》；《關於公司第四屆董事會各專門委員會人員組成的議案》；《關於修訂公司《反洗錢考評及獎懲管理辦法》的議案》；《關於審議公司《洗錢和恐怖融資風險自評估報告》的議案》；《關於審議弘業期貨股份有限公司與江蘇弘業股份有限公司房屋租賃關連交易的議案》。

(5) 獨立非執行董事對公司有關事項提出異議的情況

無。

(6) 董事出席董事會及股東大會情況**1、 董事出席董事會會議、投票表決情況**

於報告期內，各董事出席會議及投票表決情況的記錄載列如下：

| 姓名 | 應出席 董事會 次數 | 親自出席 次數 | 委託出席 次數 | 缺席 次數 | *應表決 議案數 | 實際表決 議案數 | 備註 |
|-----|------------------|------------|------------|----------|-------------|-------------|-----------------|
| 周 勇 | 9 | 9 | 0 | 0 | 50 | 50 | 部分關聯交易議案迴避表決 |
| 周劍秋 | 9 | 9 | 0 | 0 | 57 | 57 | |
| 薛炳海 | 9 | 9 | 0 | 0 | 50 | 50 | 部分關聯交易議案迴避表決 |
| 姜 琳 | 9 | 9 | 0 | 0 | 50 | 50 | 部分關聯交易議案迴避表決 |
| 單 兵 | 9 | 9 | 0 | 0 | 57 | 57 | |
| 王躍堂 | 9 | 9 | 0 | 0 | 57 | 57 | |
| 林繼陽 | 8 | 8 | 0 | 0 | 52 | 52 | 於2021年12月23日辭任 |
| 黃德春 | 9 | 9 | 0 | 0 | 57 | 57 | |
| 盧華威 | 1 | 1 | 0 | 0 | 5 | 5 | 於2021年12月23日獲委任 |

* 部分董事因關連交易而需要迴避表決，故應表決議案數少於實際參會議案數。

2、董事出席股東大會情況

於報告期內，各董事出席股東大會的記錄載列如下：

| 姓名 | 應出席股東 | | | 備註 |
|-----|-------|--------|------|-----------------|
| | 大會次數 | 親自出席次數 | 缺席次數 | |
| 周 勇 | 3 | 2 | 1 | |
| 周劍秋 | 3 | 3 | 0 | |
| 薛炳海 | 3 | 3 | 0 | |
| 姜 琳 | 3 | 3 | 0 | |
| 單 兵 | 3 | 3 | 0 | |
| 王躍堂 | 3 | 3 | 0 | |
| 林繼陽 | 3 | 3 | 0 | 於2021年12月23日辭任 |
| 黃德春 | 3 | 3 | 0 | |
| 盧華威 | 0 | 0 | 0 | 於2021年12月23日獲委任 |

(7) 董事培訓情況

所有董事已提供參加培訓的記錄，公司已依據《企業管治守則》中的守則條文A.6.5(其自2022年1月1日起已獲重新編號為守則條文C.1.4)規定安排或者提供相應培訓。

今年由於新冠疫情，律師無法到場培訓，改為在線學習培訓資料。截至2021年12月31日止年度，所有董事參與了鍾氏律師事務所與德恒律師事務所聯營進行的香港聯交所主板上市公司之責任的培訓，瞭解學習了近期執法案例、《上市規則》更新等資料。

五、董事會專門委員會及履行職責情況

公司設立董事會審核委員會、董事會提名委員會、董事會薪酬委員會、董事會風險管理委員會四個董事會專門委員會。

截至報告期末及至本報告日期，人員組成如下表所示：

| 委員會名稱 | 委員名單(截至報告期末) | 委員名單(截至本報告日期) |
|----------------|------------------------------|------------------------------|
| 審核委員會 | 盧華威(主席) 薛炳海 黃德春 | 盧華威(主席) 薛炳海 黃德春 |
| 薪酬委員會 | 黃德春(主席) 王躍堂 單 兵 | 黃德春(主席) 王躍堂 單 兵 |
| 提名委員會 | 周 勇(主席) 王躍堂 黃德春 | 周 勇(主席) 王躍堂 黃德春 |
| 風險管理委員會 | 王躍堂(主席) 周劍秋 薛炳海 姜 琳 | 王躍堂(主席) 周劍秋 薛炳海 姜 琳 |

(1) 審核委員會

本公司根據於2015年5月19日通過的董事會決議並根據《上市規則》第3.21條和3.22條之規定成立了審核委員會(「審核委員會」)，並以書面釐定其職權範圍。審核委員會的書面職責範圍已參照《企業管治守則》中的守則條文C.3.3(其自2022年1月1日起已獲重新編號為守則條文D.3.3)和守則條文C.3.7(其自2022年1月1日起已獲重新編號為守則條文D.3.7)獲採納。其職權範圍於本公司及香港聯交所網站可取得。

審核委員會的主要職責權限為：提請董事會委任及更換外聘核數師；監督實施內部審核制度；負責內部審核部與外聘核數師的聯絡；審核財務資料及相關披露；及董事會批授的其他職責。截至2021年12月31日，審核委員會由三名成員組成，包括兩名獨立非執行董事，分別為盧華威先生(主席)和黃德春先生，以及一名非執行董事薛炳海先生。

報告期內，審核委員會舉行4次會議。截至2021年12月31日止年度內，董事會概無於外部核數師的選擇、委任、指定或解聘事宜與審核委員會持不同意見。

(2) 薪酬委員會

本公司根據於2015年5月19日通過的董事會決議及《上市規則》第3.25及3.26條之規定成立薪酬委員會(「薪酬委員會」)，並已採納書面職權範圍。薪酬委員會書面職權範圍已參照《企業管治守則》中的守則條文B.1.2(其自2022年1月1日起已獲重新編號為守則條文E.1.2)獲採納。其職權範圍可於本公司及香港聯交所網站取得。

薪酬委員會的主要職責權限為：制定、審核公司有關董事及高級管理層薪酬的政策及架構並就此向董事會提供推薦意見；釐定每名董事及高級管理層成員的特定薪酬組合條款；參考董事會決定的公司目標，審批績效薪酬；及董事會批授的其他職責。執行董事的薪酬乃基於其技能、知識、個人表現及貢獻、該董事責任及職責的範圍，並考慮到公司的業績表現及市場行情釐定。獨立非執行董事的薪酬政策是要確保獨立非執行董事對參與公司事務包括其參加各董事委員會所作出的努力以及付出的時間得到充分的補償。獨立非執行董事的薪酬乃根據其技能、經驗、知識、責任和市場趨勢釐定。截至2021年12月31日，薪酬委員會由三名成員組成，包括兩名為獨立非執行董事，分別為黃德春先生(主席)和王躍堂先生，以及一名非執行董事單兵先生。

董事薪酬的詳情載於本年度報告合併財務報表附註十五、(二)。報告期內，薪酬委員會舉行3次會議。

薪酬委員會已採納由其檢討管理層所提出有關執行董事及高層管理人員的薪酬建議後，向董事會作提出建議的模式。董事會擁有最終權力以批准經薪酬委員會提出的薪酬建議。

(3) 提名委員會

本公司已於2015年5月19日成立了提名委員會(「提名委員會」)，並根據《企業管治守則》中的守則條文A.5.2(其自2022年1月1日起已獲重新編號為守則條文B.3.1)以書面釐定其職權範圍。其職權範圍可於本公司及香港聯交所網站取得。

提名委員會的主要職責權限為：定期審核董事會的架構、人數及組成並就任何建議變動向董事會提供推薦意見；物色、甄選提名董事職位的個人或就其甄選向董事會提供意見；評估獨立非執行董事的獨立性；就有關委任、重新委任及罷免董事的事宜向董事會提供意見；及董事會批授的其他職責。截至2021年12月31日，提名委員會由三名成員組成，包括一名執行董事周勇先生(主席)及兩名獨立非執行董事，分別為黃德春先生和王躍堂先生。

報告期內，提名委員會舉行1次會議。

在物色合適的董事候選人時，提名委員會將會根據候選人的技能、經驗、教育背景、專業知識、個人誠信和承諾時間，以及根據本公司需求和該職位所須遵循的其他相關法律法規的要求來執行選拔程序。所有候選人必須能夠滿足《上市規則》第3.08和3.09條所規定之標準。將被委任為獨立非執行董事的候選人亦須滿足《上市規則》第3.13條規定的獨立性標準。合資格的候選人將推薦董事會批准，並提呈予股東大會審議。

根據公司章程第101條及102條規定，公司董事應當具備以下條件：

- (一) 具有從事期貨、證券等金融業務或者法律、會計業務3年以上經驗，或者經濟管理工作5年以上經驗；
- (二) 具有大學專科以上學歷。

董事由股東大會選舉產生，任期3年。董事任期屆滿，可以連選連任。

有關提名委員會提名董事候選人的意圖以及候選人表明願意接受提名的書面通知，給予公司有關提名及接受提名的通知期限應當不少於7日。該7日通知期的開始日應當不早於指定進行該項選舉的會議通知發出次日，結束日不遲於股東大會召開7日前。

董事長、副董事長由全體董事的過半數選舉和罷免，董事長、副董事長任期3年，可以連選連任。股東大會在遵守有關法律、行政法規規定的前提下，可以以普通決議的方式將任何任期末屆滿的董事罷免(但依據任何合同可提出的索償要求不受此影響)。

根據提名委員會議事規則，提名委員會研究擬定公司董事、高級管理人員的選擇標準、程序及方法，向董事會提出建議。並且提名委員會有權廣泛物色合格的董事和高級管理人員的人選，對董事候選人和高級管理人員人選進行初步審查並向董事會提出建議。公司於2021年提名盧華威先生擔任公司獨立非執行董事，提名委員會按上述有關標準、程序及方法挑選，亦召開了提名委員會會議審議通過，並提呈予董事會審議。

(4) 風險管理委員會

本公司根據於2015年5月19日通過的董事會決議成立了風險管理委員會(「風險管理委員會」)，並以書面釐定其職權範圍。

風險管理委員會的主要職責權限為：定期識別公司業務經營中的現有及潛在風險；審閱和評估風險管理策略，並作出建議；建立預防風險管理和內部控制制度，並提供解決方案；及董事會授予的其他職權。

截至2021年12月31日，風險管理委員會由四名董事組成，其中包括執行董事周劍秋女士、兩名非執行董事薛炳海先生及姜琳先生，以及一名獨立非執行董事王躍堂先生(主席)。

報告期內，風險管理委員會舉行2次會議。

(5) 各專門委員會會議情況

2021年3月26日，薪酬委員會審議通過了《關於公司董事、監事及高級管理人員2020年度薪酬待遇的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年9月15日，薪酬委員會審議通過了《關於確定2020年度公司領導班子副職(包括黨委副書記、紀委書記、財務負責人)年度薪酬分配系數的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年11月15日，薪酬委員會審議通過了《關於確定第四屆董事會獨立非執行董事薪酬的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年11月15日，提名委員會審議通過了《關於更換獨立董事的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年3月25日，審核委員會審議通過了《關於公司截至2020年12月31日止經審計之年度業績公告及2020年度報告草案的議案》、《關於《弘業期貨股份有限公司2020年度財務決算報告》的議案》、《關於《弘業期貨股份有限公司前次募集資金使用情況報告》的議案》、《關於聘任公司2021年度會計師事務所及其酬金的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年5月21日，審核委員會審議通過了《關於審議及批准公司截至2018年、2019年及2020年12月31日中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年8月26日，審核委員會審議通過了《關於審議及批准公司截至2021年6月30日止六個月之中國會計準則下未經審核綜合中期業績公告草案及中期報告草案的議案》、《關於弘業期貨2021年上半年內部審計工作情況匯報及下半年內部審計計劃的議案》、《關於制定弘業期貨股份有限公司審計整改工作考核辦法(試行)的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年9月15日，審核委員會審議通過了《關於審議及批准公司截至2018年、2019年、2020年12月31日、2021年6月30日中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案》；《關於公司前次募集資金使用情況報告的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年3月26日，風險管理委員會審議通過了《關於公司2020年淨資本等各項風險監管指標情況報告的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

2021年8月25日，風險管理委員會審議通過了《關於公司2021年上半年淨資本等各項風險監管指標情況報告的議案》，於當天，委員會相關委員及主席均參加了會議。

六、董事長及總經理

本公司董事長和總經理職務分別由不同人士擔任，以確保各自職責的獨立性和授權的分佈平衡，董事長由周勇先生擔任，總經理由周劍秋女士擔任。董事長和總經理分工明確，各自的職責權限在公司章程中予以清晰列示。董事長周勇先生領導董事會確定公司的發展戰略，確保董事會的有效運作及履行職責，並就董事會職責範圍內的事項進行充分討論，確保董事獲得其決策所需的信息真實、準確、完整、及時，確保公司遵循良好的企業管治程序，確保董事會決策符合公司及全體股東的最佳利益。總經理周劍秋女士是公司的法定代表人，主要主持公司的經營管理工作，組織實施董事會決議，向董事會報告工作。

七、非執行董事及獨立非執行董事

截至報告期末，公司共有非執行董事3名，獨立非執行董事3名。報告期內，公司一直遵守《上市規則》有關委任至少3名獨立非執行董事之規定，且其中一名擁有合適的專業資格或為會計或相關財務管理專業。公司與每名非執行董事均訂立一份委任函，任期為三年。任職情況見本報告第十節「一、現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員基本情況」。

八、監事會及履行職責情況

(1) 監事會的職責

監事會向股東大會負責，主要職責權限：檢查公司的財務；對公司董事、總經理和其他高級管理人員執行公司職務的行為進行監督，對違反法律、行政法規、公司章程或者股東大會決議的董事、高級管理人員提出罷免的建議；當公司董事、總經理和其他高級管理人員的行為損害公司的利益時，要求前述人員予以糾正；核對董事會擬提交股東大會的財務報告、營業報告和利潤分配方案等財務數據，發現疑問的，可以公司名義委託註冊會計師、執業審計師幫助覆審；提議召開臨時股東大會會議，在董事會不履行召集和主持股東大會會議職責時召集和主持股東大會會議；代表公司與董事、高級管理人員交涉或者對董事、高級管理人員起訴；向股東大會提出提案；及提議召開董事會臨時會議等。

(2) 監事會會議情況及監事出席情況

監事會根據相關法規及公司章程履行相關職責。報告期內，監事會共召開6次會議。會議主要情況如下：

2021年3月26日，本公司召開第三屆監事會第十次會議，會議審議通過以下議案：《關於公司首次公開發行A股股票並上市的議案》、《關於提請公司股東大會授權公司董事會全權辦理公司首次公開發行A股股票並上市相關事宜的議案》、《關於公司首次公開發行A股股票募集資金投資項目可行性分析報告的議案》、《關於公司A股股票發行攤薄即期回報的影響及填補措施的議案》、《關於公司A股股票發行後三年內股票價格穩定方案的議案》、《關於公司首次公開發行A股股票並上市後三年分紅回報規劃的議案》、《關於《弘業期貨股份有限公司前次募集資金使用情況報告》的議案》、《關於公司在A股發行文件中作出公開承諾事項的議案》、《關於公司首次公開發行股票前滾存利潤分配以及方案的議案》、《關於修改公司現行公司章程及其附件的議案》、《關於制定公司A股股票上市後適用的公司章程及其附件的議案》、《關於《弘業期貨股份有限公司2020年度監事會工作報告》的議案》、《關於公司截至2020年12月31日止經審計之年度業績公告及2020年度報告草案的議案》、《關於公司2020年度利潤分配預案的議案》、《關於《弘業期貨股份有限公司2020年度財務決算報告》的議案》。

2021年5月21日，本公司召開第三屆監事會第十一次會議，會議審議通過以下議案：《關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案》。

2021年8月26日，本公司召開第三屆監事會第十二次會議，會議審議通過以下議案：《關於審議及批准公司截至2021年6月30日止六個月之香港會計準則下未經審核綜合中期業績公告草案及中期報告草案的議案》、《關於考慮派發截至2021年6月30日止六個月之中期股息的議案》。

2021年9月15日，本公司召開第三屆監事會第十三次會議，會議審議通過以下議案：《關於審議及批准公司截至2018年、2019年、2020年12月31日、2021年6月30日中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案》、《關於公司前次募集資金使用情況報告的議案》、《關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案》。

2021年12月1日，本公司召開第三屆監事會第十四次會議，會議審議通過以下議案：《關於選舉公司第四屆監事會成員的議案》。

2021年12月23日，本公司召開第四屆監事會第一次會議，會議審議通過以下議案：《關於選舉公司第四屆監事會主席的議案》。

| 姓名 | 應出席會議次數 | 實際出席次數 | 備註 |
|-----|---------|--------|-----------------|
| 虞 虹 | 6 | 6 | |
| 王健英 | 5 | 5 | 於2021年12月23日辭任 |
| 姚愛麗 | 6 | 6 | |
| 陳 亮 | 1 | 1 | 於2021年12月23日獲委任 |

九、其他有關事項

(1) 股東權利

公司嚴格按照公司章程、股東大會議事規則等相關規定召集、召開股東大會，確保所有股東，特別是中小股東享有平等的地位，充分行使股東權利。公司全體董事、監事及高級管理人員均按公司章程的規定出席公司股東大會，回答股東的問題。

(2) 遵守《標準守則》

公司已就董事、監事進行證券交易採納《上市規則》附錄十所載的《標準守則》。公司已就遵守《標準守則》的事宜向所有董事和監事作出特定查詢，所有董事和監事皆確認於報告期內完全遵守《標準守則》所載的標準。

公司亦已就監管僱員有可能掌握公司或其證券的未公佈的股價敏感數據採納標準守則。於報告期內，公司並未獲悉任何相關僱員違反標準守則的事件。

董事會會不時檢查公司的治理狀況和運作情況，以符合《上市規則》有關規定並保障股東利益。

(3) 董事就財務報表所承擔的責任

以下所載的董事對財務報表的責任聲明，應與本報告中獨立審計師報告的註冊會計師責任聲明一併閱讀。兩者的責任聲明應當分別獨立理解。

公司全體董事確認其有責任為每一財政年度編製能真實反映公司經營成果的財務報表。於報告期內，就董事所知，並無需要報告的可能對公司的持續經營產生重大不利影響的事件或情況。

(4) 審計機構聘任情況及薪酬

2021年，公司聘請信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)為公司2021年度外部審計機構，負責按照中國企業會計準則提供相關審計、審閱服務。審計服務相關費用列示於本報告第八節「八、聘用會計師事務所情況」。

(5) 審核委員會之審閱

審核委員會已審閱本集團所採納的會計原則及政策以及本公司截至2021年12月31日止年度合併財務報表。

(6) 公司秘書

本公司的董事會秘書兼其中一名聯席公司秘書黃海清先生負責就企業管治事宜向董事會提出建議，並確保遵循董事會的政策及程序、適用法律、規則及法規。為維持良好的企業管治並確保符合《上市規則》及適用香港法律，本公司亦委聘方圓企業服務集團(香港)有限公司前總監梁穎嫻女士擔任另一名聯席公司秘書，協助黃海清先生履行其作為本公司董事會秘書、聯席公司秘書的職責。自二零二二年二月二十一日起，梁穎嫻女士辭任而陳燕華女士獲委任為聯席公司秘書一職。本公司的主要聯絡人為本公司董事會秘書兼另一名聯席公司秘書黃海清先生。根據《上市規則》第3.29條的要求，截至2021年12月31日止年度，黃海清先生及梁穎嫻女士均接受了不少於15個小時之相關專業培訓。

(7) 與股東的溝通

股東大會是公司的最高權力機構，股東通過股東大會行使權力。公司制定了相應的制度確保股東大會召集、召開的合規性，公司在公司章程中明確規定了股東所享有的權利，確保股東尤其是中小股東的知情權，對所有股東均平等對待。

根據公司章程，本公司召開年度股東大會，應當於會議召開不少於20個工作日前發出書面通知；召開臨時股東大會，應當於會議召開不少於10個工作日或15日(以較長者為準)前以公告方式通知各股東。將會議擬審議的事項以及開會的日期和地點告知所有在冊股東。擬出席股東大會的股東，應當於會議通知列明的期限內，將出席會議的書面回覆送達本公司。

公司董事會與股東保持持續的溝通，信息會通過公司財務報告、週年股東大會和其他臨時股東大會，以及提交給香港聯交所的披露信息傳達給股東。公司鼓勵股東參與股東大會，或者委任代理代表參加和在會議上投票。

公司在公司網站www.ftol.com.cn具有專門的投資者關係板塊並定期更新信息。公司向香港聯交所發布的信息也會登載於公司網站上。所有與公司相關的新聞發佈、業績公告等都可以在公司網站上查閱。

本公司召開股東大會，董事會、監事會以及單獨或者合併持有本公司3%或以上股份的股東，有權以書面形式向本公司提出新的提案，本公司應當將提案中屬股東大會職責範圍內的事項，列入該次會議的議程。

單獨或者合計持有本公司3%以上股份的股東，可以在股東大會召開10日前提出臨時提案並書面提交召集人。召集人應當在收到提案後2日內發出股東大會補充通知，公告臨時提案的內容。

股東大會通知中未列明或不符合本章程規定的提案，股東大會不得進行表決並作出決議。

任何有權出席股東大會並有權表決的股東，有權委任一人或者數人（該人可以不是股東）作為其股東代理人，代為出席和表決。該股東代理人依照該股東的委託，可以行使下列權利：

- 1、 該股東在股東大會上的發言權；
- 2、 自行或者與他人共同要求以投票方式表決；及
- 3、 除非依據適用的證券上市規則或其他證券法律法規另有規定外，以舉手或者投票方式行使表決權，但是委任的股東代理人超過一人時，該等股東代理人只能以投票方式行使表決權。

股東應當以書面形式委託代理人，由委託人簽署或者由其以書面形式委託的代理人簽署；委託人為法人的，應當加蓋法人印章或者由其董事或者正式委任的代理人簽署。

股東要求召集臨時股東大會或者類別股東會議，應當按照下列程序辦理：

1. 單獨或合計持有有表決權的股份10%或以上的兩個或者兩個以上的股東，可以簽署一份或者數份同樣格式內容的書面要求，提請董事會召集臨時股東大會或者類別股東會議，並闡明會議的議題。董事會在收到前述書面要求後應當盡快召集臨時股東大會或者類別股東會議。前述持股數按股東提出書面要求日計算；及
2. 如果董事會在收到前述書面要求後30日內沒有發出召集會議的通告，提出該要求的股東可以在董事會收到該要求後四個月內自行召集會議，召集的程序應當盡可能與董事會召集股東大會的程序相同。

股東因董事會未應前述要求舉行會議而自行召集並舉行會議的，其所發生的合理費用，應當由本公司承擔，並從本公司欠付失職董事的款項中扣除。

同時，股東可依據公司章程於本公司需選舉董事時，在屆時召開的股東大會(包括股東週年大會及臨時股東大會)上提名人選參選本公司董事職位，並應當按照下列程序辦理：

- (1)、 單獨或者合計持有公司3%以上股份的股東，在股東大會召開10日前提出提名董事候選人的提案。

依據：公司章程第66條規定，公司召開股東大會，董事會、監事會以及單獨或者合併持有公司3%以上股份的股東，有權以書面形式向公司提出新的提案，公司應當將提案中屬股東大會職責範圍內的事項，列入該次會議的議程。單獨或者合計持有公司3%以上股份的股東，可以在股東大會召開10日前提出臨時提案並書面提交召集人。召集人應當在收到提案後2日內發出股東大會補充通知，公告臨時提案的內容。

- (2)、 由股東大會審議董事候選人議案，並選舉產生董事。依據：公司章程第61條規定，股東大會行使下列職權：

- (一) 決定公司的經營方針和投資計劃；
- (二) 選舉和更換非由職工代表擔任的董事，決定有關董事的報酬事項；
- (三) 選舉和更換由股東代表出任的監事，決定有關監事的報酬事項；

.....

- (十三) 審議代表公司有表決權的股份3%以上的股東的提案；

.....

- (十九) 審議法律、行政法規、部門規章、公司股票上市地上市規則或公司章程規定應當由股東大會作出決議的其他事項。

(3)、 董事由股東大會選舉產生，任期3年。

依據：公司章程第102條規定，董事由股東大會選舉產生，任期3年。董事任期屆滿，可以連選連任。

有關提名董事候選人的意圖以及候選人表明願意接受提名的書面通知，給予公司有關提名及接受提名的通知期限應當不少於7日。該7日通知期的開始日應當不早於指定進行該項選舉的會議通知發出次日，結束日不遲於股東大會召開7日前。

股東大會由董事長主持並擔任大會主席；董事長不能出席大會的，由半數以上董事共同推舉一名董事主持並擔任會議主席；董事會未指定會議主席的，出席會議的股東可以選舉主席；如果因任何理由，股東無法選舉一人擔任主席，應當由出席會議的持有最多股份的股東(包括股東代理人)擔任會議主席。監事會自行召集的股東大會，由監事會主席主持並擔任會議主席。監事會主席不能履行職務或不履行職務時，由半數以上監事共同推舉的一名監事主持並擔任會議主席。股東自行召集的股東大會，由召集人推舉代表主持。召開股東大會時，會議主持人違反議事規則使股東大會無法繼續進行的，經現場出席股東大會有表決權過半數的股東同意，股東大會可推舉一人擔任會議主持人，繼續開會。

公司有專人負責與股東的溝通聯絡，對於股東的意見及建議公司高度重視，對於股東的合理要求，公司盡量、及時滿足。

公司在網站www.ftol.com.cn中建立了「投資者關係」欄目，刊登公司的公告、財務數據等信息。股東也可直接致電公司查詢相關信息，公司會及時以適當方式處理上述查詢。具體聯繫方式詳見本報告第四節「一、公司基本情況簡介」部分。

公司歡迎所有股東出席股東大會，並在允許的範圍內為股東出席會議提供便利。公司董事、監事和高級管理人員會列席股東大會，董事會將在會上回答提問，公司管理層也將確保外聘核數師出席股東週年大會回答股東所提出的相關問題。

(8) 投資者關係活動

公司始終把持續提升股東價值放在首位，高度重視投資者關係管理工作，逐步建立與投資者之間通暢的雙向溝通渠道，不斷完善公司的治理結構。報告期內，通過開展電話、電子郵件、接待來訪等形式與投資者進行交流，平等對待全體投資者，確保所有股東能夠充分行使自己的權利。報告期內，公司嚴格遵守法律法規和監管規定，真實、準確、完整、及時地進行信息披露，確保投資者及時瞭解公司重大事項，最大程度保護投資者的利益。

(9) 董事會成員多元化政策

本公司已根據《企業管治守則》守則條文A.5.6守則條文(其自2022年1月1日起已獲重新列入為強制性披露要求J段)採納董事會成員多元化政策。

公司董事會成員多元化政策概要如下：本公司瞭解並深信董事會成員多元化對公司幫助良多，並視董事會成員的多元化為維持公司競爭優勢的重要元素。本公司在組成董事會時，從多個方面考慮董事會成員的多元化，包括但不限於性別、年齡、文化及教育背景、專業經驗、技能、知識、服務任期及其他。董事會成員的聘任均以用人唯才為原則，並在考慮具體人選時，盡可能按照董事會整體運作所需要的才能、技能及經驗水平而作出，以保持董事會成員的適當平衡。

本公司董事會提名委員會審查及評估董事會組成，並就聘任本公司新董事向董事會作出推薦建議。本公司董事會提名委員會每年就達致董事會成員多元化的所有可計量目標進行討論，並向董事會提出有關目標建議。

為落實董事會多元化政策，下列可計量目標已獲採納：

- 1、 至少三分之一的董事會成員為獨立非執行董事；
- 2、 董事均具有大學專科以上學歷，其中有多人具有碩士、博士學歷；
- 3、 至少有一名董事會成員已取得會計或其他專業資格；及
- 4、 至少有一名董事會成員是女性。

於本年報日期，董事會由八名董事組成，其中有一名女性董事，三名為獨立非執行董事，借此提升對管理程序的嚴格審查及監控。董事會不論在性別、年齡、文化與教育背景、專業經驗、技能、知識以及服務年期各方面均達到了多元化的標準。

提名委員會滿意現時董事會的組成，並認為符合本公司指定的董事會成員多元化政策。

(10) 性別多元化

在引進和培養員工過程中，公司堅持「平等就業、公平提拔」的原則，樹立員工多元化理念，堅決抵制以年齡、性別、婚姻狀況、殘疾、家庭狀況、種族、膚色、血統、國籍、族群、或宗教為由的歧視、騷擾和誹謗。截至2021年12月31日，本公司在職員工總數為659人，其中女性僱員為305人，佔比為46%。本公司董事、監事、高級管理人員中女性比例如下表所示。本公司另行刊發的環境、社會和管治報告內會詳細介紹本公司性別多元化理念、管治方針與舉措。

表2董事、監事、高級管理人員中女性比例

| | 董事 | 監事 | 高級管理人員 |
|------|-------|-------|--------|
| 女性比例 | 12.5% | 66.7% | 28.6% |

(11) 公司章程

2021年5月14日，公司於股東週年大會上審議通過了對公司章程的修訂。

(12) 風險管理及內部控制

1、 內部控制制度建設情況

公司自設立以來一直注重內部規章制度和管理體制的建設，通過持續制定和有效實施各項內控制度，不斷完善內控機制，為公司的規範發展奠定了堅實的基礎。

公司歷來十分重視合規經營與風險管理，嚴格按照監管部門的要求以及《期貨交易管理條例》、《期貨公司監督管理辦法》等法律法規，建立健全內部控制制度。通過加強首席風險官與合規部門的日常檢查與監督，提高各項內控制度的執行力，確保公司合規穩健發展，並把內部控制的建設始終貫穿於公司經營發展過程之中。

截至報告期末，公司已建立與自身業務性質、規模和複雜程度相適應的內部控制體系，保障公司經營管理合法合規、資產安全、財務報告及相關信息真實完整，提高經營效率和效果。

報告期內，公司已建立重大信息內部監控系統，處理及發佈股價敏感數據的程序和內部監控措施。

公司按照監管要求建立健全了信息隔離牆、內幕信息知情人登記管理等制度，防範了敏感信息的不當使用和傳播。同時，公司按照法律、法規、《上市規則》和公司章程及信息披露管理辦法等的規定，真實、準確、完整、及時地進行信息披露，確保所有投資者有平等的機會及時獲得公司有關信息。

依據全面性、可持續性、獨立性、有效性原則，公司建立的風險管理及內部控制組織架構包括了四個管理層級，分別為：董事會、風險管理委員會、首席風險官及各業務部門的風控負責人。風險管理體系建設情況詳見本報告第六節「十、公司風險管理體系建設情況」。

董事會負責維持本集團穩健及有效的風險管理及內部監控系統。適當地識別及管理可能影響本集團表現的主要風險，並定期審閱及更新。

同時，公司內部設有審計法律部，具有內部審核職能，負責對本公司的內部監控及風險管理系統是否充足及效能進行獨立監督。其基於最新的風險審閱中識別的主要風險每年制定年度內部審計計劃，從財務收支、開展管理制度和業務流程、績效考核管理、專項審計等多方面全方位衡量公司內部審計有效性，審計法律部負責具體實施。該內部審計計劃可根據持續風險審閱程序的成果予以更改，就內部審計計劃的任何建議變動均按照公司相關制度要求進行呈報。

公司在處理及發佈內幕消息時，嚴格遵守《上市規則》相關條例。首先，公司管理層對相關信息做專項討論；同時，相關部門衡量時間節點及披露內容，並與公司律師及時溝通、討論披露事宜；最後，在內幕消息的制備過程中，公司會發送給各位董事審閱並確認。通過上述程序，力保股價敏感數據、須予披露信息等及時、準確的發佈。

截至本報告日期，董事會轄下的風險管理委員會聽取了首席風險官2021年度工作報告，對公司經營管理的合法合規性和風險管理狀況進行檢討，公司認為風險管理及內部監控系統充分及有效。董事會認為該等系統旨在管理而非消除未能達成業務目標的風險，只能就不會有重大的失實陳述或損失作出合理而非絕對的保證。

2、其他事項報告

(1) 合規體系建設情況

報告期內，在監管部門的持續監管和正確指導下，公司嚴格按照有關法律法規和準則，認真組織落實各項監管自律要求，深入開展各項合規工作，持續完善公司合規管理機制，著力提升公司對合規風險的控制水平。

建立健全合規管理組織架構。公司構建了董事會、董事會風險管理委員會、首席風險官、合規風控部、審計法律部及各分支機構合規崗多層級合規管理組織體系，稽核工作在首席風險官領導下具體開展，公司在新設分支機構時均及時配備合規人員，在合規管理方面受合規風控部指導並向其報告工作，各層級職責明確，溝通報告路徑通暢。

公司為實現合規經營目標，制定了包括《合規管理辦法》在內的全面、規範、可行的合規管理制度、規則和流程，構建較為科學的合規管理體系。合規管理覆蓋了公司所有業務、所有部門和全體員工，貫穿決策、執行、監督、反饋等各個環節。在展業過程中，執行制度規範，實現對合規風險的有效識別、評估和管理，為公司依法合規經營提供了有效支持和監督，使公司自身的經營行為符合法律、法規和準則以及內部規章制度，培育和形成了以合規文化為基礎的企業文化。

(2) 持續完善公司合規管理制度體系

公司高度重視對內部控制的建立與實施情況的監督檢查，通過持續開展內部審計監督檢查、定期開展內部控制評價，實現對內部控制持續有效運行的監督和評價，對內部控制缺陷進行持續改進。

(一) 不斷強化內部審計監督作用

- 1、 建立健全高效的內部審計體系。公司設立了審計法律部，配備內部審計人員，建立健全內部審計工作規章制度。公司設立審核委員會，聘用適應審計任務需要的、合理的、穩定的人員，如審計、法律、經濟、管理和財務等方面的專業人員，獨立開展工作，行使內部監督權。審計法律部在公司審核委員會的領導下，依照國家和地方政府及境外各地區、國家的法律、法規和公司的規章制度，獨立開展工作，行使內部監督權。審核委員會通過審議內審工作情況匯報及計劃等完成具體的審計工作並直接向治理層報告。內部審計工作計劃，按照公司相關制度要求進行審議後，開展內審工作，強化審計監督。

公司審計法律部通過規範化的審計監督，幫助公司加強內部控制，指導公司加強財務管理和內部控制工作，會同公司總結企業管理的經驗，提出改善經營管理的意見和建議，為實現管理最優化、提高公司的經濟效益服務。內部審計工作實行以《內部審計報告》以及其他書面文件形式為主的報告制度，並按照制度要求向董事會報送審計工作情況。

- 2、 不斷加強內審監督檢查力度。公司審計法律部負責具體實施公司內部審計工作，形成了適應自身內控體系建設需要的內部審計工作機制，積極開展常規審計和專項審計工作，嚴格按照公司內部審計管理辦法和流程開展審計工作，審計範圍涵蓋公司業務、分支機構、崗位的內部控制和風險管理過程。對審計中發現的問題和缺陷及時提出審計意見和建議，並通過建立整改台賬和開展後續審計確保審計結果的有效落實。

2021年度，公司內審部門繼續深化內審管理體系建設，全面履行和落實審計監督職能，堅持以監督評價風險管理、提高內部控制水平為主線，在實際審計工作中加強了審計力度、頻度和深度，擴大內審覆蓋面和精細度，創新審計思路，改進審計方法，並加強了後續整改落实的力度，持續提升審計工作質效，為公司健康穩健運行提供了保障。

（二）不斷完善內部控制評價體系

- 1、不斷加強內部控制評價力度。公司依據相關規章制度的規定，建立了較為有效的內控評價體系，確定了內部控制評價方法和操作流程。同時持續開展內部控制自評價並實施整改，公司制定了內部控制缺陷評價標準，並每年度開展公司範圍的內部控制評價工作，評價範圍覆蓋公司總部和各分支機構，業務範圍公司各業務板塊和重要業務管理活動。2021年，公司已經根據基本規範、評價指引及其他相關法律法規的要求，對公司截至2021年12月31日的內部控制設計與運行的有效性進行了自我評價，並聘請信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)對公司與財務報表相關的內部控制進行審核，並對存在問題實施整改，內部控制的有效性進一步增強。
- 2、進一步完善內控評價機制，拓寬評價覆蓋面。於2021年，公司不斷完善內控評價機制，改進評價方法，增強技術手段，充分借鑒國際先進的方法開展評價，持續改善公司內部控制管理狀況，不斷提升對各類風險管理水平。

監事會報告

2021年，監事會按照有關公司監事會根據公司法及公司章程於股東大會所獲授權，全面履行了對公司董事會成員、公司經理以及其他高級管理人員的監督職能。

一、監事會的工作情況

2021年度共召開第三屆監事會監事會議5次、第四屆監事會監事會議1次，具體情況如下：

| 時間 | 屆次 | 參會人員 | 會議議題 |
|----------------|-----------------|----------------|--|
| 2021年 3月26日 | 第三屆監事會 第十次會議 | 虞虹、王健英、 姚愛麗 | <ol style="list-style-type: none"> 關於公司首次公開發行A股股票並上市的議案 關於提請公司股東大會授權公司董事會全權辦理公司首次公開發行A股股票並上市相關事宜的議案 關於公司首次公開發行A股股票募集資金投資項目可行性分析報告的議案 關於公司A股股票發行攤薄即期回報的影響及填補措施的議案 關於公司A股股票發行後三年內股票價格穩定方案的議案 關於公司首次公開發行A股股票並上市後三年分紅回報規劃的議案 關於《弘業期貨股份有限公司前次募集資金使用情況報告》的議案 關於公司在A股發行文件中作出公開承諾事項的議案 關於公司首次公開發行股票前滾存利潤分配以及方案的議案 關於修改公司現行公司章程及其附件的議案 關於制定公司A股股票上市後適用的公司章程及其附件的議案 |

| 時間 | 屆次 | 參會人員 | 會議議題 |
|-----------------|------------------|----------------|--|
| | | | 12. 關於《弘業期貨股份有限公司2020年度監事會工作報告》的議案 |
| | | | 13. 關於公司截至2020年12月31日止經審計之年度業績公告及2020年度報告草案的議案 |
| | | | 14. 關於公司2020年度利潤分配預案的議案 |
| | | | 15. 關於《弘業期貨股份有限公司2020年度財務決算報告》的議案 |
| 2021年 5月21日 | 第三屆監事會 第十一次會議 | 虞虹、王健英、 姚愛麗 | 1. 關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案 |
| 2021年 8月26日 | 第三屆監事會 第十二次會議 | 虞虹、王健英、 姚愛麗 | 1. 關於審議及批准公司截至2021年6月30日止六個月之香港會計準則下未經審核綜合中期業績公告草案及中期報告草案的議案 |
| | | | 2. 關於考慮派發截至2021年6月30日止六個月之中期股息的議案 |
| 2021年 9月15日 | 第三屆監事會 第十三次會議 | 虞虹、王健英、 姚愛麗 | 1. 關於審議及批准公司截至2018年、2019年、2020年12月31日、2021年6月30日中國會計準則下A股IPO申報會計師報告草稿的議案 |
| | | | 2. 關於公司前次募集資金使用情況報告的議案 |
| | | | 3. 關於審議確認公司報告期內關聯交易的議案 |
| 2021年 12月1日 | 第三屆監事會 第十四次會議 | 虞虹、王健英、 姚愛麗 | 1. 關於選舉公司第四屆監事會成員的議案 |
| 2021年 12月23日 | 第四屆監事會 第一次會議 | 虞虹、陳亮、 姚愛麗 | 1. 關於選舉公司第四屆監事會主席的議案 |

二、監事會對公司依法運作情況的獨立意見

監事會認為：

- 1、 2021年度公司在全體股東的關心和支持下，通過公司全體員工的勤奮努力工作，按照公司法和公司章程依法進行運作，經營決策程序合法、規範，取得了理想的業績成果。
- 2、 公司董事會能按照公司法、《期貨交易管理條例》、《上市規則》等有關法律法規及公司章程規範運作，公司決策程序合法；公司董事及經理層等高級管理人員能夠依照法律法規和公司章程的規定開展各項工作，正確行使職權，勤勉盡責，未發現有違反法律、法規、公司章程或損害公司及股東利益的行為。

三、監事會對檢查公司財務情況的獨立意見

2021年度，公司以重要性為基礎，遵循謹慎性原則，認真執行會計準則。報告期內，公司財務結構合理，資產狀況良好，年度財務報告能夠真實、準確地反映公司的財務狀況和經營成果。信永中和會計師事務所（特殊普通合夥）對本公司出具了標準無保留意見的審計報告。

四、監事會對公司募集資金實際投入情況的獨立意見

報告期內，監事會監督公司的募集資金使用管理情況，監事會認為：在募集資金的管理上，公司嚴格按照招股書披露的內容執行，募集資金使用符合公司項目計劃和決策審批程序，不存在違規佔用募集資金的行為。

五、監事會對內部控制自我評價報告的審閱情況

監事會對公司進行了審閱，並認為公司已在所有重大方面建立了適當的內部控制制度，內部控制管理體系運行有效，確保了內部控制制度的貫徹執行和生產經營活動的正常開展。

六、股東大會通過的決議案的執行情況

監事會成員對提交予股東大會的決議案的內容並無異議。監事會監督股東大會通過的各項決議案的執行情況，並認為董事會能夠認真執行有關決議。

承監事會
虞虹
主席

中國南京，2022年3月29日

審計報告

弘業期貨股份有限公司全體股東：

一、審計意見

我們審計了弘業期貨股份有限公司(以下簡稱「弘業期貨公司」或「公司」)財務報表，包括2021年12月31日的合併及母公司資產負債表，2021年度的合併及母公司利潤表、合併及母公司現金流量表、合併及母公司股東權益變動表，以及相關財務報表附註。

我們認為，後附的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編製，公允反映了弘業期貨公司2021年12月31日的合併及母公司財務狀況以及2021年度的合併及母公司經營成果和現金流量。

二、形成審計意見的基礎

我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的「註冊會計師對財務報表審計的責任」部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。按照中國註冊會計師職業道德守則，我們獨立於弘業期貨公司，並履行了職業道德方面的其他責任。我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。

三、關鍵審計事項

關鍵審計事項是我們根據職業判斷，認為對本期財務報表審計最為重要的事項。這些事項的應對以對財務報表整體進行審計並形成審計意見為背景，我們不對這些事項單獨發表意見。

| 1. 手續費收入的確認 | |
|---|--|
| 關鍵審計事項 | 審計中的應對 |
| <p>如財務報表附註「四、25」和附註「六、39」所述2021年度，弘業期貨公司手續費收入為28,582.94萬元，手續費收入是公司關鍵業績指標之一。</p> <p>弘業期貨公司的手續費收入主要包括期貨經紀業務收入、投資諮詢業務收入及資產管理業務收入。</p> <p>期貨經紀業務收入於代理交易發生日予以確認；投資諮詢業務和資產管理業務收入在本集團有權根據協議取得收入時確認。</p> <p>由於手續費收入是公司關鍵業績指標之一，且存在可能操縱收入確認時點以達到特定目標或預期的固有風險，同時確定手續費收入的確認時點會涉及管理層判斷，可能對公司的淨利潤產生重大影響，因此，我們將手續費收入的確認識別為關鍵審計事項。</p> | <p>針對手續費收入作為關鍵審計事項執行的主要審計程序包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) 瞭解與手續費收入確認相關的關鍵內部控制，評價這些控制的設計，確定其是否得到執行，並測試相關內部控制的運行有效性。 (2) 針對處理與手續費收入相關交易的關鍵信息技術系統，我們利用本所內部信息技術專家的工作，評價和測試該系統關於信息系統應用的關鍵內部控制的設計和運行有效性。 (3) 對於期貨經紀業務收入，從公司交易結算系統獲取留存手續費明細與賬面數據進行核對；獲取全國期貨市場成交數據，將公司期貨成交數據、手續費收入趨勢與全國市場趨勢進行比較分析；將賬面數據與結算數據進行比較，對期貨經紀手續費收入進行截止測試。 (4) 對於資產管理業務收入，抽取樣本，核對管理費和業績報酬的費率與合同約定是否一致，並獲取公司全部資產管理計劃清單，按不同收費標準，對相關收入進行測算。 (5) 對於投資諮詢業務收入，抽取部分業務項目，檢查弘業期貨公司與客戶簽訂的合同，核實相關收入確認與合同條款是否一致，並評價相關收入確認是否符合公司關於收入確認的會計政策。 |

| 2. 以公允價值計量的金融工具估值 | |
|---|---|
| 關鍵審計事項 | 審計中的應對 |
| <p>如財務報表附註「四、18」、財務報表附註「六、5、9、21」和財務報表附註「十」所述，截至2021年12月31日，弘業期貨公司金融工具中，以公允價值計量的金融資產的公允價值分別為人民幣84,088.55萬元，以公允價值計量的金融負債的公允價值分別為人民幣8,798.53萬元。</p> <p>由於公司金融工具的估值是基於市場數據與估值模型的結合，通常需要輸入較多的變量。在這些輸入值當中，大部分輸入值均取自於流動市場的現有數據。如對於第三層次的金融工具而言，可觀察的市場數據無法使用，會涉及重大判斷及估計。</p> <p>由於涉及金額較大，且鑒於評估特定金融工具的價值所涉及的複雜程度，以及管理層在確定估值方法所採用的輸入值時所運用判斷的依賴程度，我們將以公允價值計量的金融工具的估值識別為關鍵審計事項。</p> | <p>針對以公允價值計量的金融工具估值關鍵審計事項執行的主要審計程序包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) 瞭解與金融工具公允價值的估值相關的關鍵內部控制，評價這些控制的設計，確定其是否得到執行； (2) 通過將弘業期貨公司採用的公允價值與公開可獲取的市場數據進行比較，評價對所有在活躍市場交易的金融工具的估值； (3) 就公允價值屬於第二層次和第三層次的金融工具，通過合理的審計抽樣方法選取樣本，獲取樣本與估值相關的基礎信息並識別與金融工具估值相關的條件，評價管理層採用的估值方法、估值模型和輸入值的適當性；在此基礎上進行獨立估值，並將我們的估值結果與弘業期貨公司的估值結果進行比較。具體程序包括：將弘業期貨公司使用的估值方法、估值模型與市場通常使用方法、模型進行對比評價，測試估值過程中使用的輸入值，應用估值方法、估值模型重新測算金融工具公允價值； (4) 評價在財務報表中的相關披露是否按照企業會計準則的要求反映了金融工具的估值風險。 |

| 3. 結構化主體的合併 | |
|---|---|
| 關鍵審計事項 | 審計中的應對 |
| <p>如財務報表附註「四、6合併財務報表的編製方式」和附註「四、33主要會計估計及判斷」所述的會計政策及財務報表附註「八、(一)在子公司中的權益」和附註「八、(三)未納入合併財務報表範圍的結構化主體」。結構化主體通常是為實現具體且明確的利潤目標而設計並成立的，並在確定的投資範圍內開展業務活動。弘業期貨公司可以通過發起設立、持有投資或保留權益份額等方式在結構化主體中享有權益。這些結構化主體主要包括資產管理計劃、信託產品或理財產品。</p> <p>當判斷是否應該將結構化主體納入弘業期貨公司的合併範圍時，管理層考慮弘業期貨公司對結構化主體相關活動擁有的權利，享有的可變回報，以及通過運用該權利而影響其可變回報的能力。</p> <p>由於在確定是否應將結構化主體納入弘業期貨公司的合併範圍時涉及重大的管理層判斷，且合併結構化主體可能對合併資產負債表產生重大影響，我們將弘業期貨公司結構化主體的合併識別為關鍵審計事項。</p> | <p>針對以結構化主體的合併關鍵審計事項執行的主要審計程序包括：</p> <p>(1) 瞭解和評價有關結構化主體合併的關鍵財務報告內部控制的設計和運行；</p> <p>(2) 對新設的所有結構化主體執行以下程序：</p> <p>1) 檢查相關合同、內部記錄及向投資者披露的信息，以瞭解結構化主體的設立目的和弘業期貨公司對結構化主體的參與程度，並評價管理層關於弘業期貨公司對結構化主體是否擁有權力的判斷；</p> <p>2) 檢查結構化主體對風險和報酬的結構設計，以評價管理層就弘業期貨公司因參與結構化主體的相關活動而擁有的對該主體的風險敞口、權力及對可變回報的影響所作的判斷；</p> <p>3) 檢查管理層對結構化主體的分析，包括定性分析和弘業期貨公司對享有結構化主體的經濟利益的比重及可變動性的計算，以評價管理層關於弘業期貨公司影響其來自結構化主體可變回報的能力所作的判斷；</p> <p>4) 評價管理層就是否應合併結構化主體所作的判斷；</p> <p>(3) 對以前年度設立且在本年仍然存續的結構化主體，詢問管理層相關合同和內部文檔當年是否發生變化，選取樣本獲取並檢查相關合同和內部文檔，評價該結構化主體的會計處理是否仍然恰當；</p> <p>(4) 評價財務報表中針對結構化主體的相關披露是否符合企業會計準則的要求。</p> |

四、管理層和治理層對財務報表的責任

弘業期貨公司管理層(以下簡稱管理層)負責按照企業會計準則的規定編製財務報表，使其實現公允反映，並設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。

在編製財務報表時，管理層負責評估弘業期貨公司的持續經營能力，披露與持續經營相關的事項(如適用)，並運用持續經營假設，除非管理層計劃清算弘業期貨公司、終止運營或別無其他現實的選擇。

治理層負責監督弘業期貨公司的財務報告過程。

五、註冊會計師對財務報表審計的責任

我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證，並出具包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證，但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致，如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策，則通常認為錯報是重大的。

在按照審計準則執行審計工作的過程中，我們運用職業判斷，並保持職業懷疑。同時，我們也執行以下工作：

- (1) 識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險，設計和實施審計程序以應對這些風險，並獲取充分、適當的審計證據，作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或凌駕於內部控制之上，未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。
- (2) 瞭解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序。
- (3) 評價管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。

五、註冊會計師對財務報表審計的責任(續)

- (4) 對管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對弘業期貨公司持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的信息。然而，未來的事項或情況可能導致弘業期貨公司不能持續經營。
- (5) 評價財務報表的總體列報、結構和內容，並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。
- (6) 就弘業期貨公司中實體或業務活動的財務信息獲取充分、適當的審計證據，以對財務報表發表審計意見。我們負責指導、監督和執行公司審計，並對審計意見承擔全部責任。

我們與治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。

我們還就已遵守與獨立性相關的職業道德要求向治理層提供聲明，並與治理層溝通可能被合理認為影響我們獨立性的所有關係和其他事項，以及相關的防範措施(如適用)。

從與治理層溝通的事項中，我們確定哪些事項對本期財務報表審計最為重要，因而構成關鍵審計事項。我們在審計報告中描述這些事項，除非法律法規禁止公開披露這些事項，或在極少數情形下，如果合理預期在審計報告中溝通某事項造成的負面後果超過在公眾利益方面產生的益處，我們確定不應在審計報告中溝通該事項。

信永中和會計師事務所(特殊普通合夥)

中國註冊會計師：張玉虎(項目合夥人)

中國註冊會計師：樂永亮

中國 北京

二〇二二年三月二十九日

合併資產負債表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 31日12月2021年 | 31日12月2020年 |
|-------------|------|-------------------------|------------------|
| 資產： | | | |
| 貨幣資金 | 六、1 | 4,143,641,973.33 | 2,894,295,423.20 |
| 其中：期貨保證金存款 | | 3,959,706,206.55 | 2,660,162,679.92 |
| 應收貨幣保證金 | 六、2 | 2,025,860,140.16 | 2,131,088,863.50 |
| 應收質押保證金 | 六、3 | 668,817,393.60 | 64,396,384.00 |
| 應收結算擔保金 | 六、4 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 衍生金融資產 | 六、5 | 465,835.77 | 6,219,924.42 |
| 應收款項 | 六、6 | | 6,841,752.75 |
| 其他應收款 | 六、7 | 24,951,725.11 | 36,060,100.00 |
| 買入返售金融資產 | 六、8 | 6,719,000.00 | 7,853,000.00 |
| 金融投資： | | | |
| 交易性金融資產 | 六、9 | 840,419,634.46 | 1,014,876,858.36 |
| 存貨 | 六、10 | 9,531.74 | 48,676,714.04 |
| 長期股權投資 | 六、11 | 7,036,127.76 | 11,431,418.75 |
| 期貨會員資格投資 | 六、12 | 1,808,800.00 | 1,820,820.00 |
| 固定資產 | 六、13 | 14,899,414.00 | 15,406,337.98 |
| 使用權資產 | 六、14 | 24,655,989.58 | 18,898,649.52 |
| 無形資產 | 六、15 | 1,025,204.63 | 1,857,065.39 |
| 商譽 | | | |
| 遞延所得稅資產 | 六、16 | 7,394,041.07 | 8,228,720.18 |
| 其他資產 | 六、17 | 295,396,263.71 | 61,209,766.78 |
| 資產總計 | | 8,083,101,074.92 | 6,349,161,798.87 |

| 項目 | 附註 | 31日12月2021年 | 31日12月2020年 |
|------------------|------|-------------------------|------------------|
| 負債： | | | |
| 短期借款 | 六、18 | | 2,052,060.00 |
| 應付貨幣保證金 | 六、19 | 5,261,811,881.42 | 4,247,090,138.08 |
| 應付質押保證金 | 六、20 | 668,817,393.60 | 40,750,944.00 |
| 交易性金融負債 | 六、21 | 86,471,254.16 | |
| 衍生金融負債 | 六、5 | 1,514,054.34 | 7,594,514.81 |
| 賣出回購金融資產 | 六、22 | 32,625,838.11 | 35,819,204.28 |
| 期貨風險準備金 | 六、23 | 151,215,411.17 | 140,221,598.23 |
| 應付期貨投資者保障基金 | 六、24 | 522,926.88 | 369,776.02 |
| 應付職工薪酬 | 六、25 | 20,659,015.94 | 26,279,433.60 |
| 應交稅費 | 六、26 | 6,015,879.24 | 28,658,451.44 |
| 應付款項 | 六、27 | | 7,373,441.99 |
| 合同負債 | 六、28 | 1,000,000.00 | 1,859,630.01 |
| 其他應付款 | 六、29 | 26,281,420.68 | 140,609,535.53 |
| 預計負債 | 六、30 | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |
| 長期借款 | 六、31 | 117,197,967.93 | |
| 租賃負債 | 六、32 | 24,831,103.80 | 19,347,767.49 |
| 遞延所得稅負債 | | | |
| 其他負債 | | | |
| 負債合計 | | 6,400,934,068.24 | 4,702,494,071.37 |
| 股東權益： | | | |
| 股本 | 六、33 | 907,000,000.00 | 907,000,000.00 |
| 資本公積 | 六、34 | 537,826,419.52 | 533,124,529.52 |
| 減：庫存股 | | | |
| 其他綜合收益 | 六、35 | -7,385,168.45 | -3,692,964.07 |
| 盈餘公積 | 六、36 | 66,606,194.62 | 58,426,314.46 |
| 一般風險準備 | 六、37 | 92,485,771.99 | 84,305,891.83 |
| 未分配利潤 | 六、38 | 85,633,789.00 | 67,503,955.76 |
| 歸屬於母公司所有者權益合計 | | 1,682,167,006.68 | 1,646,667,727.50 |
| 少數股東權益 | | | |
| 所有者權益合計 | | 1,682,167,006.68 | 1,646,667,727.50 |
| 負債和股東權益總計 | | 8,083,101,074.92 | 6,349,161,798.87 |

母公司資產負債表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 31日12月2021年 | 31日12月2020年 |
|-------------|------|-------------------------|------------------|
| 資產： | | | |
| 貨幣資金 | | 4,038,043,781.83 | 2,833,195,961.37 |
| 其中：期貨保證金存款 | | 3,933,237,738.95 | 2,644,187,524.11 |
| 應收貨幣保證金 | | 1,963,110,837.41 | 2,080,281,631.24 |
| 應收質押保證金 | | 668,817,393.60 | 64,396,384.00 |
| 應收結算擔保金 | | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 衍生金融資產 | | | |
| 應收款項 | | | |
| 其他應收款 | | 12,925,889.39 | 11,855,879.63 |
| 買入返售金融資產 | | 6,719,000.00 | 7,853,000.00 |
| 金融投資： | | | |
| 交易性金融資產 | | 672,947,193.56 | 877,206,629.58 |
| 存貨 | | | |
| 長期股權投資 | 十六、1 | 553,278,207.57 | 407,673,498.56 |
| 期貨會員資格投資 | | 1,400,000.00 | 1,400,000.00 |
| 固定資產 | | 14,621,800.48 | 14,930,892.15 |
| 使用權資產 | | 23,052,131.01 | 15,586,598.97 |
| 無形資產 | | 534,644.63 | 1,352,081.39 |
| 商譽 | | | |
| 遞延所得稅資產 | | 4,412,785.28 | 5,037,888.73 |
| 其他資產 | | 245,798,360.21 | 51,250,553.33 |
| 資產總計 | | 8,225,662,024.97 | 6,392,020,998.95 |

| 項目 | 附註 | 31日12月2021年 | 31日12月2020年 |
|------------------|----|-------------------------|------------------|
| 負債： | | | |
| 短期借款 | | | |
| 應付貨幣保證金 | | 5,510,697,950.46 | 4,347,104,746.35 |
| 應付質押保證金 | | 668,817,393.60 | 64,396,384.00 |
| 交易性金融負債 | | | |
| 衍生金融負債 | | | |
| 賣出回購金融資產 | | 32,625,838.11 | 34,197,000.00 |
| 期貨風險準備金 | | 151,215,411.17 | 140,221,598.23 |
| 應付期貨投資者保障基金 | | 522,926.88 | 369,776.02 |
| 應付職工薪酬 | | 20,160,381.89 | 25,612,318.28 |
| 應交稅費 | | 4,763,065.21 | 21,588,141.97 |
| 應付款項 | | | |
| 合同負債 | | | |
| 其他應付款 | | 19,411,278.81 | 84,740,615.66 |
| 預計負債 | | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |
| 長期借款 | | 97,775,228.50 | |
| 租賃負債 | | 23,223,933.96 | 15,994,832.46 |
| 遞延所得稅負債 | | | |
| 其他負債 | | | |
| 負債合計 | | 6,531,183,329.56 | 4,738,692,988.86 |
| 股東權益： | | | |
| 股本 | | 907,000,000.00 | 907,000,000.00 |
| 資本公積 | | 531,424,379.33 | 526,722,489.33 |
| 減：庫存股 | | | |
| 其他綜合收益 | | 70.39 | -371,801.28 |
| 盈餘公積 | | 66,606,194.62 | 58,426,314.46 |
| 一般風險準備 | | 92,485,771.99 | 84,305,891.83 |
| 未分配利潤 | | 96,962,279.08 | 77,245,115.75 |
| 所有者權益合計 | | 1,694,478,695.41 | 1,653,328,010.09 |
| 負債和股東權益總計 | | 8,225,662,024.97 | 6,392,020,998.95 |

合併利潤表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------------------------|------|-------------------------|------------------|
| 一、營業總收入 | | 1,639,864,789.14 | 1,561,379,595.38 |
| 手續費及佣金淨收入 | 六、39 | 285,829,444.17 | 229,458,231.66 |
| 其中：經紀業務手續費淨收入 | | 274,613,207.74 | 216,042,713.56 |
| 資產管理業務手續費淨收入 | | 11,216,236.43 | 13,415,518.10 |
| 利息淨收入 | 六、40 | 84,118,225.19 | 72,644,679.32 |
| 其中：利息收入 | | 84,984,002.21 | 73,770,163.00 |
| 利息支出 | | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 投資收益(損失以「-」號填列) | 六、41 | 24,976,761.56 | 37,893,784.42 |
| 其中：對聯營企業和合營企業的投資收益 | | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 以攤餘成本計量的金融資產終止確認產生的收益(損失以「-」號填列) | | | |
| 其他收益 | 六、42 | 3,254,738.51 | 441,073.63 |
| 公允價值變動收益(損失以「-」號填列) | 六、43 | -18,008,681.86 | 20,197,295.96 |
| 匯兌收益(損失以「-」號填列) | 六、44 | -1,458,080.09 | -5,183,313.77 |
| 其他業務收入 | 六、45 | 1,261,316,136.31 | 1,206,069,904.43 |
| 資產處置收益(損失以「-」號填列) | 六、46 | -163,754.65 | -142,060.27 |
| 二、營業總支出 | | 1,529,950,777.86 | 1,465,104,523.25 |
| 提取期貨風險準備金 | 六、47 | 10,993,812.94 | 9,163,823.19 |
| 稅金及附加 | 六、48 | 2,971,314.32 | 2,220,613.95 |
| 業務及管理費 | 六、49 | 267,024,622.37 | 268,599,105.55 |
| 信用減值損失 | 六、50 | 265,097.38 | 13,685,328.79 |
| 其他資產減值損失 | | | |
| 其他業務成本 | 六、51 | 1,248,695,930.85 | 1,171,435,651.77 |
| 三、營業利潤(虧損以「-」號填列) | | 109,914,011.28 | 96,275,072.13 |
| 加：營業外收入 | 六、52 | 1,765,121.69 | 2,321,684.15 |
| 減：營業外支出 | 六、53 | 2,466,949.47 | 5,893,309.71 |
| 四、利潤總額(虧損總額以「-」號填列) | | 109,212,183.50 | 92,703,446.57 |
| 減：所得稅費用 | 六、54 | 29,000,712.03 | 26,380,991.31 |
| 五、淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | 80,211,471.47 | 66,322,455.26 |
| (一)按經營持續性分類 | | | |
| 1.持續經營淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | 80,211,471.47 | 66,322,455.26 |
| 2.終止經營淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | | |
| (二)按所有權歸屬分類 | | | |
| 1.歸屬於母公司所有者的淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | 80,211,471.47 | 66,322,455.26 |
| 2.少數股東損益(淨虧損以「-」號填列) | | | |

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------------|----|----------------------|---------------|
| 六、其他綜合收益的稅後淨額 | | -4,064,082.29 | -9,552,739.27 |
| 歸屬於母公司所有者的其他綜合收益稅後淨額 | | | |
| (一)不能重分類進損益的其他綜合收益 | | | |
| 1.重新計量設定受益計劃變動額 | | | |
| 2.權益法下不能轉損益的其他綜合收益 | | | |
| 3.其他權益工具投資公允價值變動 | | | |
| 4.企業自身信用風險公允價值變動 | | | |
| 5.其他 | | | |
| (二)將重分類進損益的其他綜合收益 | | -4,064,082.29 | -9,552,739.27 |
| 1.權益法下可轉損益的其他綜合收益 | | -6.24 | 172,785.28 |
| 2.其他債權投資公允價值變動 | | | |
| 3.金融資產重分類計入其他綜合收益的金額 | | | |
| 4.現金流量套期儲備 | | | |
| 5.外幣財務報表折算差額 | | -4,064,076.05 | -9,725,524.55 |
| 6.其他 | | | |
| 歸屬於少數股東的其他綜合收益的稅後淨額 | | | |
| 七、綜合收益總額 | | 76,147,389.18 | 56,769,715.99 |
| (一)歸屬於母公司所有者的綜合收益總額 | | 76,147,389.18 | 56,769,715.99 |
| (二)歸屬於少數股東的綜合收益總額 | | | |
| 八、每股收益 | | | |
| (一)基本每股收益 | | 0.0884 | 0.0731 |
| (二)稀釋每股收益 | | 0.0884 | 0.0731 |

母公司利潤表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------------------------|------|-----------------------|----------------|
| 一、營業總收入 | | 352,036,845.50 | 359,182,398.05 |
| 手續費及佣金淨收入 | 十六、2 | 232,114,496.99 | 196,471,452.72 |
| 其中：經紀業務手續費淨收入 | | 219,932,010.59 | 182,961,013.63 |
| 資產管理業務手續費淨收入 | | 12,182,486.40 | 13,510,439.09 |
| 利息淨收入 | 十六、3 | 82,986,347.83 | 71,512,685.65 |
| 其中：利息收入 | | 83,852,124.85 | 72,638,169.33 |
| 利息支出 | | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 投資收益(損失以「-」號填列) | 十六、4 | 43,018,315.81 | 78,319,576.16 |
| 其中：對聯營企業和合營企業的投資收益 | | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 以攤餘成本計量的金融資產終止確認產生的收益(損失以「-」號填列) | | | |
| 其他收益 | | 631,333.55 | 436,480.63 |
| 公允價值變動收益(損失以「-」號填列) | 十六、5 | -6,835,739.24 | 9,889,309.94 |
| 匯兌收益(損失以「-」號填列) | | -1,793,647.68 | -4,659,568.32 |
| 其他業務收入 | | 2,079,492.89 | 7,354,521.54 |
| 資產處置收益(損失以「-」號填列) | | -163,754.65 | -142,060.27 |
| 二、營業總支出 | | 242,822,657.31 | 248,839,414.53 |
| 提取期貨風險準備金 | | 10,993,812.94 | 9,163,823.19 |
| 稅金及附加 | | 1,290,582.70 | 1,244,837.09 |
| 業務及管理費 | | 230,257,780.00 | 237,836,228.57 |
| 信用減值損失 | | 280,481.67 | 594,525.68 |
| 其他資產減值損失 | | | |
| 其他業務成本 | | | |

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------------------|----|-----------------------|----------------|
| 三、營業利潤(虧損以「-」號填列) | | 109,214,188.19 | 110,342,983.52 |
| 加：營業外收入 | | 1,604,440.41 | 1,471,037.99 |
| 減：營業外支出 | | 2,416,949.47 | 5,627,448.65 |
| 四、利潤總額(虧損總額以「-」號填列) | | 108,401,679.13 | 106,186,572.86 |
| 減：所得稅費用 | | 26,602,877.57 | 26,759,484.18 |
| 五、淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | 81,798,801.56 | 79,427,088.68 |
| (一)持續經營淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | 81,798,801.56 | 79,427,088.68 |
| (二)終止經營淨利潤(淨虧損以「-」號填列) | | | |
| 六、其他綜合收益的稅後淨額 | | -6.24 | 172,785.28 |
| (一)不能重分類進損益的其他綜合收益 | | | |
| 1.重新計量設定受益計劃變動額 | | | |
| 2.權益法下不能轉損益的其他綜合收益 | | | |
| 3.其他權益工具投資公允價值變動 | | | |
| 4.企業自身信用風險公允價值變動 | | | |
| 5.其他 | | | |
| (二)將重分類進損益的其他綜合收益 | | -6.24 | 172,785.28 |
| 1.權益法下可轉損益的其他綜合收益 | | -6.24 | 172,785.28 |
| 2.其他債權投資公允價值變動 | | | |
| 3.金融資產重分類計入其他綜合收益的金額 | | | |
| 4.現金流量套期儲備 | | | |
| 5.外幣財務報表折算差額 | | | |
| 6.其他 | | | |
| 七、綜合收益總額 | | 81,798,795.32 | 79,599,873.96 |

合併現金流量表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|-----------------------|------|-------------------------|------------------|
| 一、經營活動產生的現金流量： | | | |
| 銷售商品、提供勞務收到的現金 | | 1,420,813,014.24 | 1,359,060,774.08 |
| 收取利息、手續費及佣金的現金 | | 364,515,103.25 | 297,674,881.89 |
| 應收貨幣保證金及應收質押保證金淨減少額 | | - | |
| 應付貨幣保證金及應付質押保證金淨增加額 | | 1,642,788,192.94 | 1,628,293,250.40 |
| 使用受限制的貨幣資金淨減少額 | | 19,622,205.54 | |
| 原始到期日三個月以上的定期存款淨減少額 | | | |
| 收到其他與經營活動有關的現金 | 六、55 | 105,262,388.22 | 127,703,833.14 |
| 經營活動現金流入小計 | | 3,553,000,904.19 | 3,412,732,739.51 |
| 購買商品、接受勞務支付的現金 | | 1,355,853,953.58 | 1,321,289,127.85 |
| 支付利息、手續費及佣金的現金 | | 538,731.14 | 1,708,894.45 |
| 應收貨幣保證金及應收質押保證金淨增加額 | | 499,820,816.29 | 906,890,908.24 |
| 應付貨幣保證金及應付質押保證金淨減少額 | | | |
| 處置風險管理業務相關金融資產淨減少額 | | 31,755,179.85 | 49,200,774.63 |
| 使用受限制的貨幣資金淨增加額 | | | 17,977,026.20 |
| 支付給職工以及為職工支付的現金 | | 173,504,332.86 | 130,607,423.51 |
| 以現金支付的業務及管理費 | | 65,923,485.57 | 69,602,983.51 |
| 支付的各種稅費 | | 66,241,905.00 | 22,134,135.51 |
| 支付的其他與經營活動有關的現金 | 六、55 | 123,755,513.90 | 90,254,811.46 |
| 經營活動現金流出小計 | | 2,317,393,918.19 | 2,609,666,085.36 |
| 經營活動產生的現金流量淨額 | | 1,235,606,986.00 | 803,066,654.15 |

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|-------------------------------|------|-------------------------|------------------|
| 二、投資活動產生的現金流量： | | | |
| 收回投資收到的現金 | | 3,307,423,310.44 | 4,835,317,474.51 |
| 取得投資收益收到的現金 | | 29,124,530.92 | 20,110,106.61 |
| 處置聯營企業收回的現金 | | 2,560.77 | |
| 取得聯營企業分紅收到的現金 | | - | |
| 處置固定資產、無形資產和 其他長期資產收回的現金淨額 | | 125,716.71 | 33,019.79 |
| 收到其他與投資活動有關的現金 | | | |
| 投資活動現金流入小計 | | 3,336,676,118.84 | 4,855,460,600.91 |
| 投資支付的現金 | | 3,118,059,490.75 | 5,154,403,983.21 |
| 購建固定資產、無形資產和 其他長期資產支付的現金 | | 243,341,303.65 | 11,457,875.49 |
| 投資聯營企業支付的現金 | | | |
| 支付其他與投資活動有關的現金 | | | |
| 投資活動現金流出小計 | | 3,361,400,794.40 | 5,165,861,858.70 |
| 投資活動產生的現金流量淨額 | | -24,724,675.56 | -310,401,257.79 |
| 三、籌資活動產生的現金流量： | | | |
| 吸收投資收到的現金 | | | |
| 取得借款收到的現金 | | 239,854,840.00 | 52,052,060.00 |
| 賣出回購業務收到的現金淨額 | | | 34,693,720.60 |
| 收到其他與籌資活動有關的現金 | | 4,701,890.00 | |
| 籌資活動現金流入小計 | | 244,556,730.00 | 86,745,780.60 |
| 償還債務支付的現金 | | 124,980,914.00 | 50,000,000.00 |
| 分配股利、利潤或償付利息支付的現金 | | 51,845,151.76 | 9,842,361.12 |
| 償還租賃負債本金和利息支付的現金 | | 15,312,755.80 | 22,957,714.84 |
| 賣出回購業務支付的現金淨額 | | 4,059,143.19 | |
| 支付其他與籌資活動有關的現金 | 六、55 | 3,535,000.00 | |
| 籌資活動現金流出小計 | | 199,732,964.75 | 82,800,075.96 |
| 籌資活動產生的現金流量淨額 | | 44,823,765.25 | 3,945,704.64 |
| 四、匯率變動對現金及現金等價物的影響 | | -4,376,690.34 | -14,946,050.58 |
| 五、現金及現金等價物淨增加額 | | 1,251,329,385.35 | 481,665,050.42 |
| 加：期初現金及現金等價物餘額 | | 2,854,855,864.32 | 2,373,190,813.90 |
| 六、期末現金及現金等價物餘額 | 六、55 | 4,106,185,249.67 | 2,854,855,864.32 |

母公司現金流量表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|-----------------------|----|-------------------------|------------------|
| 一、經營活動產生的現金流量： | | | |
| 銷售商品、提供勞務收到的現金 | | | |
| 收取利息、手續費及佣金的現金 | | 311,468,093.22 | 270,902,260.97 |
| 應收貨幣保證金及應收質押保證金淨減少額 | | | |
| 應付貨幣保證金及應付質押保證金淨增加額 | | 1,768,014,213.71 | 1,634,589,008.27 |
| 使用受限制的貨幣資金淨減少額 | | 23,638,399.93 | |
| 原始到期日三個月以上的定期存款淨減少額 | | | |
| 收到其他與經營活動有關的現金 | | 9,242,626.67 | 73,909,124.04 |
| 經營活動現金流入小計 | | 2,112,363,333.53 | 1,979,400,393.28 |
| 購買商品、接受勞務支付的現金 | | | |
| 支付利息、手續費及佣金的現金 | | 538,731.14 | 1,708,894.45 |
| 應收貨幣保證金及應收質押保證金淨增加額 | | 487,250,215.77 | 877,498,629.60 |
| 應付貨幣保證金及應付質押保證金淨減少額 | | | |
| 處置風險管理業務相關金融資產淨減少額 | | | |
| 使用受限制的貨幣資金淨增加額 | | | 17,707,777.13 |
| 支付給職工以及為職工支付的現金 | | 153,937,959.41 | 113,125,532.85 |
| 以現金支付的業務及管理費 | | 52,515,201.22 | 64,156,351.54 |
| 支付的各種稅費 | | 56,106,832.51 | 15,607,315.63 |
| 支付的其他與經營活動有關的現金 | | 78,067,095.03 | 1,956,036.73 |
| 經營活動現金流出小計 | | 828,416,035.08 | 1,091,760,537.93 |
| 經營活動產生的現金流量淨額 | | 1,283,947,298.45 | 887,639,855.35 |

| 項目 | 附註 | 2021年度 | 2020年度 |
|-------------------------------|----|-------------------------|------------------|
| 二、投資活動產生的現金流量： | | | |
| 收回投資收到的現金 | | 3,244,085,630.62 | 4,675,682,983.00 |
| 取得投資收益收到的現金 | | 27,909,922.32 | 18,824,903.01 |
| 處置聯營企業收回的現金 | | 2,560.77 | |
| 取得聯營企業分紅收到的現金 | | | |
| 處置固定資產、無形資產和其他 長期資產收回的現金淨額 | | 125,721.76 | 33,019.79 |
| 收到其他與投資活動有關的現金 | | | |
| 投資活動現金流入小計 | | 3,272,123,835.47 | 4,694,540,905.80 |
| 投資支付的現金 | | 3,029,781,223.64 | 4,980,118,292.83 |
| 購建固定資產、無形資產和 其他長期資產支付的現金 | | 197,676,553.87 | 11,186,398.43 |
| 取得子公司及其他營業單位支付的現金淨額 | | 150,000,000.00 | |
| 支付其他與投資活動有關的現金 | | | |
| 投資活動現金流出小計 | | 3,377,457,777.51 | 4,991,304,691.26 |
| 投資活動產生的現金流量淨額 | | -105,333,942.04 | -296,763,785.46 |
| 三、籌資活動產生的現金流量： | | | |
| 吸收投資收到的現金 | | | |
| 取得借款收到的現金 | | 117,037,680.00 | |
| 賣出回購業務收到的現金淨額 | | | 33,071,516.32 |
| 收到其他與籌資活動有關的現金 | | 4,701,890.00 | |
| 籌資活動現金流入小計 | | 121,739,570.00 | 33,071,516.32 |
| 償還債務支付的現金 | | 19,506,280.00 | |
| 分配股利、利潤或償付利息支付的現金 | | 49,409,744.55 | 9,070,000.00 |
| 償還租賃負債本金和利息支付的現金 | | 12,824,465.20 | 21,123,879.20 |
| 賣出回購業務支付的現金淨額 | | 2,436,938.91 | |
| 支付其他與籌資活動有關的現金 | | 3,535,000.00 | |
| 籌資活動現金流出小計 | | 87,712,428.66 | 30,193,879.20 |
| 籌資活動產生的現金流量淨額 | | 34,027,141.34 | 2,877,637.12 |
| 四、匯率變動對現金及現金等價物的影響 | | -1,793,647.68 | -4,659,568.32 |
| 五、現金及現金等價物淨增加額 | | 1,210,846,850.07 | 589,094,138.69 |
| 加：期初現金及現金等價物餘額 | | 2,794,025,651.56 | 2,204,931,512.87 |
| 六、期末現金及現金等價物餘額 | | 4,004,872,501.63 | 2,794,025,651.56 |

合併所有者權益變動表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 2021年度 | | | | | | | | |
|-----------------------|----------------|----------------|-------|---------------|---------------|---------------|----------------|--------|------------------|
| | 歸屬於母公司所有者權益 | | | | | | | | |
| | 實收資本 | 資本公積 | 減：庫存股 | 其他綜合收益 | 盈餘公積 | 一般風險準備 | 未分配利潤 | 少數股東權益 | 所有者權益合計 |
| 一、上年年末餘額 | 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：會計政策變更 | | | | | | | | | - |
| 前期差錯更正 | | | | | | | | | - |
| 其他 | | | | 371,877.91 | | | -371,877.91 | | - |
| 二、本年期初餘額 | 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、本期增減變動金額(減少以[-]號填列) | - | 4,701,890.00 | - | -4,064,082.29 | 8,179,880.16 | 8,179,880.16 | 18,501,711.15 | | 35,499,279.18 |
| (一)綜合收益總額 | | | | -4,064,082.29 | | | 80,211,471.47 | | 76,147,389.18 |
| (二)所有者投入和減少資本 | - | 4,701,890.00 | | | | | | | 4,701,890.00 |
| 1、所有者投入的普通股 | | | | | | | | | - |
| 2、其他權益工具持有者投入資本 | | | | | | | | | - |
| 3、股份支付計入所有者權益的金額 | | - | | | | | | | - |
| 4、其他 | | 4,701,890.00 | | | | | | | 4,701,890.00 |
| (三)利潤分配 | - | - | | | 8,179,880.16 | 8,179,880.16 | -61,709,760.32 | | -45,350,000.00 |
| 1、提取盈餘公積 | | | | | 8,179,880.16 | | -8,179,880.16 | | |
| 2、提取一般風險準備 | | | | | | 8,179,880.16 | -8,179,880.16 | | |
| 3、對所有者的分配 | | | | | | | -45,350,000.00 | | -45,350,000.00 |
| 4、其他 | - | | | | | | | | |
| (四)所有者權益內部結轉 | - | - | | | | | | | - |
| 1、資本公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | | - |
| 2、盈餘公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | | - |
| 3、盈餘公積彌補虧損 | | | | | | | | | - |
| 4、設定受益計劃變動額結轉留存收益 | | | | | | | | | |
| 5、其他綜合收益結轉留存收益 | | | | | | | | | |
| 6、其他 | | | | | | | | | - |
| (五)其他 | | | | | | | | | - |
| 四、本期期末餘額 | 907,000,000.00 | 537,826,419.52 | - | -7,385,168.45 | 66,606,194.62 | 92,485,771.99 | 85,633,789.00 | | 1,682,167,006.68 |

| 項目 | 2020年度 | | | | | | | | |
|------------------------------|----------------|----------------|-------|---------------|---------------|---------------|----------------|--------|------------------|
| | 歸屬於母公司所有者權益 | | | | | | | | |
| | 實收資本 | 資本公積 | 減：庫存股 | 其他綜合收益 | 盈餘公積 | 一般風險準備 | 未分配利潤 | 少數股東權益 | 所有者權益合計 |
| 一、上年年末餘額 | 907,000,000.00 | 533,124,529.52 | - | 5,859,775.20 | 50,483,605.59 | 76,363,182.96 | 26,136,918.24 | | 1,598,968,011.51 |
| 加：會計政策變更 | | | | | | | - | | - |
| 前期差錯更正 | | | | | | | | | - |
| 其他 | | | | | | | | | |
| 二、本年期初餘額 | 907,000,000.00 | 533,124,529.52 | - | 5,859,775.20 | 50,483,605.59 | 76,363,182.96 | 26,136,918.24 | | 1,598,968,011.51 |
| 三、本期增減變動金額(減少以“-”號填列) | - | - | - | -9,552,739.27 | 7,942,708.87 | 7,942,708.87 | 41,367,037.52 | | 47,699,715.99 |
| (一)綜合收益總額 | | | | -9,552,739.27 | | | 66,322,455.26 | | 56,769,715.99 |
| (二)所有者投入和減少資本 | - | - | | | | | | | - |
| 1、所有者投入的普通股 | | | | | | | | | - |
| 2、其他權益工具持有者投入資本 | | | | | | | | | - |
| 3、股份支付計入所有者權益的金額 | | | | | | | | | - |
| 4、其他 | | | | | | | | | - |
| (三)利潤分配 | - | - | | | 7,942,708.87 | 7,942,708.87 | -24,955,417.74 | | -9,070,000.00 |
| 1、提取盈餘公積 | | | | | 7,942,708.87 | | -7,942,708.87 | | - |
| 2、提取一般風險準備 | | | | | | 7,942,708.87 | -7,942,708.87 | | - |
| 3、對所有者的分配 | | | | | | | -9,070,000.00 | | -9,070,000.00 |
| 4、其他 | | | | | | | | | - |
| (四)所有者權益內部結轉 | - | - | | | | | | | - |
| 1、資本公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | | - |
| 2、盈餘公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | | - |
| 3、盈餘公積彌補虧損 | | | | | | | | | - |
| 4、設定受益計劃變動額結轉留存收益 | | | | | | | | | - |
| 5、其他綜合收益結轉留存收益 | | | | | | | | | - |
| 6、其他 | | | | | | | | | - |
| (五)其他 | | | | | | | | | - |
| 四、本期期末餘額 | 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 |

母公司所有者權益變動表

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

編製單位：弘業期貨股份有限公司

單位：人民幣元

| 項目 | 2021年度 | | | | | | | 所有者權益合計 |
|------------------------------|----------------|----------------|-------|-------------|---------------|---------------|----------------|------------------|
| | 實收資本 | 資本公積 | 減：庫存股 | 其他綜合收益 | 盈餘公積 | 一般風險準備 | 未分配利潤 | |
| 一、上年年末餘額 | 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：會計政策變更 | | | | | | | | - |
| 前期差錯更正 | | | | | | | | - |
| 其他 | | | | 371,877.91 | | | -371,877.91 | |
| 二、本年期初餘額 | 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、本期增減變動金額(減少以“-”號填列) | - | 4,701,890.00 | - | -6.24 | 8,179,880.16 | 8,179,880.16 | 20,089,041.24 | 41,150,685.32 |
| (一)綜合收益總額 | | | | -6.24 | | | 81,798,801.56 | 81,798,795.32 |
| (二)所有者投入和減少資本 | - | 4,701,890.00 | | | | | | 4,701,890.00 |
| 1、所有者投入的普通股 | | | | | | | | - |
| 2、其他權益工具持有者投入資本 | | | | | | | | - |
| 3、股份支付計入所有者權益的金額 | | - | | | | | | - |
| 4、其他 | | 4,701,890.00 | | | | | | 4,701,890.00 |
| (三)利潤分配 | - | - | | | 8,179,880.16 | 8,179,880.16 | -61,709,760.32 | -45,350,000.00 |
| 1、提取盈餘公積 | | | | | 8,179,880.16 | | -8,179,880.16 | - |
| 2、提取一般風險準備 | | | | | | 8,179,880.16 | -8,179,880.16 | - |
| 3、對所有者的分配 | | | | | | | -45,350,000.00 | -45,350,000.00 |
| 4、其他 | | | | | | | | - |
| (四)所有者權益內部結轉 | - | - | | | | | | - |
| 1、資本公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | - |
| 2、盈餘公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | - |
| 3、盈餘公積彌補虧損 | | | | | | | | - |
| 4、設定受益計劃變動額結轉留存收益 | | | | | | | | - |
| 5、其他綜合收益結轉留存收益 | | | | | | | | - |
| 6、其他 | | | | | | | | - |
| (五)其他 | | | | | | | | - |
| 四、本期期末餘額 | 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 |

| 項目 | 2020年度 | | | | | | | |
|------------------------------|----------------|----------------|-------|-------------|---------------|---------------|----------------|------------------|
| | 實收資本 | 資本公積 | 減：庫存股 | 其他綜合收益 | 盈餘公積 | 一般風險準備 | 未分配利潤 | 所有者權益合計 |
| 一、上年年末餘額 | 907,000,000.00 | 526,722,489.33 | - | -544,586.56 | 50,483,605.59 | 76,363,182.96 | 22,773,444.81 | 1,582,798,136.13 |
| 加：會計政策變更 | | | | | | | - | - |
| 前期差錯更正 | | | | | | | | - |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本年期初餘額 | 907,000,000.00 | 526,722,489.33 | - | -544,586.56 | 50,483,605.59 | 76,363,182.96 | 22,773,444.81 | 1,582,798,136.13 |
| 三、本期增減變動金額(減少以[-]號填列) | - | - | - | 172,785.28 | 7,942,708.87 | 7,942,708.87 | 54,471,670.94 | 70,529,873.96 |
| (一)綜合收益總額 | | | | 172,785.28 | | | 79,427,088.68 | 79,599,873.96 |
| (二)所有者投入和減少資本 | - | - | | | | | | - |
| 1、所有者投入的普通股 | | | | | | | | - |
| 2、其他權益工具持有者投入資本 | | | | | | | | - |
| 3、股份支付計入所有者權益的金額 | | - | | | | | | - |
| 4、其他 | | | | | | | | - |
| (三)利潤分配 | - | - | | | 7,942,708.87 | 7,942,708.87 | -24,955,417.74 | -9,070,000.00 |
| 1、提取盈餘公積 | | | | | 7,942,708.87 | | -7,942,708.87 | - |
| 2、提取一般風險準備 | | | | | | 7,942,708.87 | -7,942,708.87 | - |
| 3、對所有者的分配 | | | | | | | -9,070,000.00 | -9,070,000.00 |
| 4、其他 | | | | | | | | - |
| (四)所有者權益內部結轉 | - | - | | | | | | - |
| 1、資本公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | - |
| 2、盈餘公積轉增資本(或股本) | | | | | | | | - |
| 3、盈餘公積彌補虧損 | | | | | | | | - |
| 4、設定受益計劃變動額結轉留存收益 | | | | | | | | - |
| 5、其他綜合收益結轉留存收益 | | | | | | | | - |
| 6、其他 | | | | | | | | - |
| (五)其他 | | | | | | | | - |
| 四、本期期末餘額 | 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 |

財務報表附註

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

一、公司基本情況

弘業期貨股份有限公司(以下簡稱「本公司」或「公司」，在包含子公司時統稱「本集團」)是一家註冊於南京市中華路50號的股份有限公司，註冊資本人民幣9.07億元，法定代表人：周劍秋。公司統一社會信用代碼為91320000100022362N，經營期貨業務許可證號為30870000。本公司前身為成立於1995年7月的「江蘇金陵期貨經紀有限公司」。

1999年12月，本公司名稱變更為「江蘇弘業期貨經紀有限公司」(以下簡稱「有限公司」)由原江蘇金陵期貨有限公司於1999年12月14日更名而來，原註冊資本人民幣3,000萬元，其中江蘇弘業股份有限公司(原江蘇省工藝品進出口集團股份有限公司)出資人民幣2,820萬元，佔註冊資本的94%；江蘇弘業國際物流有限公司(原江蘇鵬程國際儲運有限公司)出資人民幣180萬元，佔註冊資本的6%。

2001年根據有限公司股東會決議及有關股權轉讓協議，江蘇弘業股份有限公司將其持有有限公司48%的股權轉讓給江蘇弘業國際集團投資管理有限公司。股權轉讓後，江蘇弘業國際集團投資管理有限公司出資人民幣1,440萬元，佔註冊資本的48%；江蘇弘業股份有限公司出資人民幣1,380萬元，佔註冊資本的46%；江蘇弘業國際物流有限公司出資人民幣180萬元，佔註冊資本的6%。

2006年，經有限公司股東會決議同意，以未分配利潤轉增實收資本人民幣800萬元，註冊資本變更為人民幣3,800萬元，其中，江蘇弘業國際集團投資管理有限公司出資人民幣1,824萬元，佔註冊資本的48%；江蘇弘業股份有限公司出資人民幣1,748萬元，佔註冊資本的46%；江蘇弘業國際物流有限公司出資人民幣228萬元，佔註冊資本的6%。

2007年，經本公司股東會決議同意，增加註冊資本人民幣1,200萬元，註冊資本變更為人民幣5,000萬元，其中，江蘇弘業國際集團投資管理有限公司出資人民幣2,143.50萬元，佔註冊資本的42.87%；江蘇弘業股份有限公司出資人民幣2,143.50萬元，佔註冊資本的42.87%；江蘇弘業國際物流有限公司出資人民幣228萬元，佔註冊資本的4.56%；江蘇弘瑞科技創業投資有限公司出資人民幣245萬元，佔註冊資本的4.90%；上海銘大實業(集團)有限公司出資人民幣240萬元，佔註冊資本的4.80%。

2008年，經有限公司股東會決議同意，增加註冊資本人民幣5,800萬元，註冊資本變更為人民幣10,800萬元，各股東投資比例不變。

一、公司基本情況(續)

2009年，經有限公司股東會決議同意，增加註冊資本人民幣3,000萬元，註冊資本變更為人民幣13,800萬元，其中，江蘇弘業國際集團投資管理有限公司出資人民幣6,129.96萬元，佔註冊資本的44.42%；江蘇弘業股份有限公司出資人民幣6,129.96萬元，佔註冊資本的44.42%；江蘇弘業國際物流有限公司出資人民幣492.48萬元，佔註冊資本的3.57%；江蘇弘瑞科技創業投資有限公司出資人民幣529.20萬元，佔註冊資本的3.83%；上海銘大實業(集團)有限公司出資人民幣518.40萬元，佔註冊資本的3.76%。

2011年4月25日，經有限公司股東會決議同意，增加註冊資本人民幣24,200萬元，註冊資本變更為人民幣38,000萬元。其中，江蘇弘業國際集團投資管理有限公司出資人民幣8,265.00萬元，佔註冊資本的21.75%；江蘇弘業股份有限公司出資人民幣8,265.00萬元，佔註冊資本的21.75%；江蘇弘業國際物流有限公司出資人民幣492.48萬元，佔註冊資本的1.30%；江蘇弘瑞科技創業投資有限公司出資人民幣529.20萬元，佔註冊資本的1.39%；上海銘大實業(集團)有限公司出資人民幣518.40萬元，佔註冊資本的1.36%；江蘇省蘇豪控股集團有限公司(以下簡稱「蘇豪控股」)(原江蘇省絲綢集團有限公司)出資人民幣8,108.12萬元，佔註冊資本的21.34%；江蘇弘蘇實業有限公司出資人民幣8,021.80萬元，佔註冊資本的21.11%；江蘇匯鴻國際集團有限公司出資人民幣3,800.00萬元，佔註冊資本的10.00%。

2012年8月20日，經江蘇省人民政府國有資產監督管理委員會蘇國資復[2012] 78號《關於同意變更江蘇弘業期貨有限公司部分國有股權持有人的批覆》同意，將江蘇弘業國際集團投資管理有限公司持有有限公司21.75%的股權變更為由蘇豪控股持有，有限公司於2012年11月21日辦理了工商變更登記手續，變更後蘇豪控股持有有限公司43.09%股份。

2012年11月，有限公司股東共同簽署《關於整體變更設立弘業期貨股份有限公司的發起人協議》，將有限公司整體變更為弘業期貨股份有限公司。根據發起人協議的約定，有限公司股東以經審計的淨資產並經相應調整後折合股本人民幣680,000,000.00元，股份總額為680,000,000股，每股面值為人民幣1元，均為普通股，剩餘淨資產值超過股本總額的部分人民幣350,124,231.10元計入公司的「資本公積—股本溢價」。

整體變更後公司股本為680,000,000股，其中：蘇豪控股持有292,992,674股，佔總股本的43.09%；江蘇弘業股份有限公司持有147,900,000股，佔總股本的21.75%；江蘇弘蘇實業有限公司持有143,548,000股，佔總股本的21.11%；江蘇匯鴻國際集團有限公司持有68,000,000股，佔總股本的10.00%；江蘇弘瑞科技創業投資有限公司持有9,469,895股，佔總股本的1.39%；上海銘大實業(集團)有限公司持有9,276,631股，佔總股本的1.36%；江蘇弘業國際物流有限公司持有8,812,800股，佔總股本的1.30%。

一、公司基本情況(續)

2015年8月18日，經中國證監會《關於核准弘業期貨股份有限公司發行境外上市外資股的批覆》(證監許可[2015] 1963號)核准，公司發行不超過26,105萬股境外上市外資股，每股面值人民幣1元，全部為普通股。2015年12月31日，公司境外發行股份在香港聯交所主板上市，股票簡稱：弘業期貨，股票代碼：03678，根據國務院國有資產監督管理委員會《關於弘業期貨股份有限公司國有股轉持有關問題的批覆》(國資產權[2015] 411號)，在本公司完成該次發行後，國有股東蘇豪控股、江蘇匯鴻國際集團股份有限公司、江蘇弘瑞科技創業投資有限公司和江蘇弘業國際物流有限公司將其持有的部分股份劃轉給全國社會保障基金理事會持有，合計22,700,000股。本公司全球公開發售H股股份(其中包括國有股減持部分)249,700,000股，股票面值為人民幣1元，發行價格為每股港幣2.43元，共募集資金港幣6.07億元。上市後公司總股本為907,000,000股，其中：公眾股東(H股)股東合計持有249,700,000股，佔總股本的27.53%。

本公司的總部設於南京，截至2021年12月31日止，本公司在全國共設有6家分公司和39家營業部。本公司的經營範圍：商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢、資產管理、基金銷售(依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動)。

二、合併財務報表範圍

公司合併財務報表範圍包括直接或間接控制的子公司和結構化主體。

詳見本附註「七、合併報表範圍的變動」及本附註「八、在其他主體中的權益」相關內容。

三、財務報表的編製基礎

(一) 編製基礎

本集團財務報表以持續經營為基礎，根據實際發生的交易和事項，按照財政部頒佈的《企業會計準則》及相關規定，並基於本附註「四、重要會計政策及會計估計」所述會計政策和會計估計編製。

(二) 持續經營

本集團自本報告期末至少12個月內具備持續經營能力，無影響持續經營能力的重大事項。

四、重要會計政策及會計估計

1、 遵循企業會計準則的聲明

本集團編製的財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本集團的財務狀況、經營成果和現金流量等有關信息。

2、 會計年度

本集團的會計期間為公歷1月1日至12月31日。

3、 營業週期

本集團以12個月為營業週期，營業週期起止日為1月1日至12月31日。

4、 記賬本位幣

本公司的記賬本位幣為人民幣，編製財務報表採用的貨幣為人民幣。本公司及本集團子公司選定記賬本位幣的依據是主要業務收支的計價和結算幣種。本集團的部分子公司採用本公司記賬本位幣以外的貨幣作為記賬本位幣，在編製本財務報表時，這些子公司的外幣財務報表按照附註四、8進行了折算。

5、 同一控制下和非同一控制下企業合併的會計處理方法

(1) 同一控制下的企業合併

參與合併的企業在合併前後均受同一方或相同的多方最終控制，且該控制並非暫時性的，為同一控制下的企業合併。

公司在同一控制下的企業合併中取得的資產和負債，按照合併日被合併方所有者權益在最終控制方合併財務報表中的賬面價值的份額計量，取得的淨資產賬面價值與支付的合併對價賬面價值(或發行股份面值總額)的差額，調整資本公積；資本公積不足沖減的，調整留存收益。

公司為同一控制下的企業合併發生的審計評估費、法律諮詢費等各項直接相關費用，於發生時計入當期損益。為企業合併發行的債券或承擔其他債務支付的手續費、佣金等，計入所發行債券及其他債務的初始計量金額。企業合併中發行權益性證券發生的手續費、佣金等費用，抵減權益性證券溢價收入，溢價收入不足沖減的，沖減留存收益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

5、同一控制下和非同一控制下企業合併的會計處理方法(續)

(1) 同一控制下的企業合併(續)

同一控制下的企業合併形成母子公司關係的，公司編製合併日的合併資產負債表、合併利潤表和合併現金流量表。因被合併方採用的會計政策與公司不一致的，在合併日按照公司會計政策對被合併方的財務報表相關項目進行調整，以調整後的賬面價值計量。合併利潤表包括參與合併各方自合併當期期初至合併日所發生的收入、費用和利潤。被合併方在合併前實現的淨利潤，在合併利潤表中單列項目反映。合併現金流量表包括參與合併各方自合併當期期初至合併日的現金流量。

(2) 非同一控制下的企業合併

參與合併的企業在合併前後不受同一方或相同的多方最終控制，為非同一控制下的企業合併。

非同一控制下的企業合併下，公司在購買日對作為企業合併對價付出的資產、發生或承擔的負債按照公允價值計量，公允價值與其賬面價值的差額，計入當期損益。對合併成本大於合併中取得的被購買方可辨認淨資產公允價值份額的差額，確認為商譽。合併成本小於合併中取得的被購買方可辨認淨資產公允價值份額的差額，計入當期損益。

公司為非同一控制下的企業合併發生的審計、法律服務、評估諮詢等中介費用以及其他相關管理費用，於發生時計入當期損益；作為合併對價發行的權益性證券或債務性證券的交易費用，計入權益性證券或債務性證券的初始確認金額。

非同一控制下的企業合併形成母子公司關係的，公司設置備查簿，記錄企業合併中取得的子公司各項可辨認資產、負債及或有負債等在購買日的公允價值。編製合併財務報表時，以購買日確定的各項可辨認資產、負債及或有負債的公允價值為基礎對子公司的財務報表進行調整。

四、重要會計政策及會計估計(續)

6、合併財務報表的編製方法

(1) 合併範圍的確定原則

合併財務報表的合併範圍以控制為基礎予以確定。控制是指投資方擁有對被投資方的權力，通過參與被投資方的相關活動而享有可變回報，並且有能力運用對被投資方的權力影響其回報金額。

(2) 合併財務報表所採用的會計方法

本集團合併財務報表按照《企業會計準則第33號—合併財務報表》及相關規定的要求編製，合併時合併範圍內的所有重大內部交易和往來業務已抵銷。子公司的股東權益中不屬於母公司所擁有的部分作為「少數股東權益」在合併財務報表中股東權益項下單獨列示。子公司當期淨損益中屬於少數股東權益的份額，在合併利潤表中淨利潤項目下以「少數股東損益」項目列示。少數股東分擔的子公司的虧損超過了少數股東在該子公司期初股東權益中所享有的份額，其餘額仍沖減少數股東權益。

子公司與本公司採用的會計政策不一致的，在編製合併財務報表時，按照本公司的會計政策對子公司財務報表進行必要的調整。

對於非同一控制下企業合併取得的子公司，在編製合併財務報表時，以購買日可辨認淨資產公允價值為基礎對其個別財務報表進行調整；對於同一控制下企業合併取得的子公司，在編製合併財務報表時，視同合併後形成的報告主體自最終控制方開始實施控制時一直是一體化存續下來的，對合併資產負債表的期初數進行調整，同時對比較報表的相關項目進行調整。

對於購買子公司少數股權或因處置部分股權投資但沒有喪失對該子公司控制權的交易，作為權益性交易核算，調整歸屬於母公司股東權益和少數股東權益的賬面價值以反映其在子公司中相關權益的變化。少數股東權益的調整額與支付／收到對價的公允價值之間的差額調整資本公積，資本公積不足沖減的，調整留存收益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

6、 合併財務報表的編製方法(續)

因處置部分股權投資或其他原因喪失了對原有子公司控制權的，剩餘股權按照其在喪失控制權日的公允價值進行重新計量。處置股權取得的對價與剩餘股權公允價值之和，減去按原持股比例計算應享有原子公司自購買日開始持續計算的淨資產的份額之間的差額，計入喪失控制權當期的投資收益。與原有子公司股權投資相關的其他綜合收益，在喪失控制權時轉為當期投資收益。

7、 現金及現金等價物

現金及現金等價物包括庫存現金、可以隨時用於支付的存款以及持有期限短、流動性強、易於轉換為已知金額現金、價值變動風險很小的投資。

8、 外幣業務和外幣報表折算

公司對外幣業務採用分賬制進行核算。外幣業務發生時，分別不同的幣種按照原幣記賬。資產負債表日，分別外幣貨幣性項目和外幣非貨幣性項目進行處理：外幣貨幣性項目按資產負債表日即期匯率(中國人民銀行公佈的人民幣匯率中間價)折算，外幣非貨幣性項目按交易日即期匯率折算，產生的匯兌差額計入當期損益。

對於境外經營，本集團在編製財務報表時將其記賬本位幣折算為人民幣，折算方法為：資產負債表中的資產和負債項目，採用資產負債表日的即期匯率折算，所有者權益項目除「未分配利潤」項目外，其他項目採用發生時的即期匯率折算。利潤表中的收入和費用項目，採用交易發生日的即期匯率或即期匯率的近似匯率折算。產生的差額作為未實現匯兌損益確認為其他綜合收益並在合併報表所有者權益項目下單獨列示。

9、 營業部的資金管理、交易清算原則

本公司的營業部資金由總部統一調撥，營業部客戶的交易由總部統一結算，營業部按規定做好交易定單、結算單的客戶確認工作。

四、重要會計政策及會計估計(續)

10、客戶期貨保證金

(1) 客戶期貨保證金的分類

本公司的客戶期貨保證金包括貨幣保證金和質押保證金。貨幣保證金系本公司代理客戶交易收到貨幣形式的期貨保證金，質押保證金系本公司代理客戶交易收到的有價證券，該有價證券用於沖抵期貨保證金。

(2) 客戶期貨保證金的管理

本公司客戶期貨保證金採取專戶存放、定向劃轉、封閉運行的管理辦法，與自有資金嚴格分離。

本公司對客戶期貨保證金實行獨立建檔，每日無負債結算。根據逐日盯市制度對客戶期貨交易盈虧進行結算；根據與客戶約定的手續費標準及客戶當日成交量(或成交額)計算交易手續費。

(3) 客戶期貨保證金的核算

1) 客戶貨幣保證金

本公司接受客戶委託收到貨幣保證金並存入指定銀行賬戶時，本公司確認為貨幣資金及應付貨幣保證金。當本公司接受客戶委託代理進行期貨交易時，本公司確認期貨交易所核定的應收貨幣保證金，並相應減少貨幣資金。本公司代理與客戶進行清算時，如客戶當日的期貨合約實現盈利，按期貨結算機構結算單據列明的盈利金額扣減應向客戶收取的佣金後，增加應收貨幣保證金及應付貨幣保證金；如客戶當日的期貨合約發生虧損，按期貨結算機構結算單據列明的虧損金額加應向客戶收取的佣金後減少應收貨幣保證金及應付貨幣保證金。

2) 客戶質押保證金

本公司接受客戶委託向期貨交易所提交有價證券辦理充抵保證金業務時，按期貨交易所核定的充抵保證金金額確認應收質押保證金及應付質押保證金。本公司接受客戶委託通過期貨交易所代理交易時，其會計處理與客戶貨幣保證金相同。有價證券價值發生增減變化時，期貨交易所相應調整核定的充抵保證金金額，本公司按調整增減數相應增減應收質押保證金及應付質押保證金。當期貨交易所將有價證券退還給客戶時，本公司按期貨交易所核定的充抵保證金額，相應減少應收質押保證金及應付質押保證金。

四、重要會計政策及會計估計(續)

11、質押品的管理

本公司接受的質押品為交易所註冊的標準倉單。本公司對客戶交存的質押品按照期貨交易所的規定及時辦理質押手續。在客戶發生損失而客戶不能及時追加保證金時，本公司按協議規定強制平倉，並依法處置質押品，其處置質押品所得收入，用以彌補損失後，多餘部分歸還客戶。

12、實物交割的核算方法

在期貨合約到期時，根據各期貨交易所制訂的規則和程序進行實物交割，分別按照買入交割和賣出的交割的實際發生額核算。

13、存貨

存貨包括大宗商品現貨，按成本進行初始計量。存貨成本包括採購成本和使存貨達到目前場所和狀態所發生的其他支出。發出存貨的實際成本採用先進先出法計量。

資產負債表日，存貨按照成本與可變現淨值孰低計量。可變現淨值，是指在日常活動中，存貨的估計售價減去估計的銷售費用以及相關稅費後的金額。為執行銷售合同或者勞務合同而持有的存貨，其可變現淨值以合同價格為基礎計算。當持有存貨的數量多於相關合同訂購數量的，超出部分的存貨的可變現淨值以一般銷售價格為基礎計算。按單個存貨項目計算的成本高於其可變現淨值的差額，計提存貨跌價準備，計入當期損益。

本集團存貨盤存制度為永續盤存制。

14、長期股權投資

(1) 長期股權投資成本確定

1) 通過企業合併形成的長期股權投資

對於同一控制下的企業合併形成的對子公司的長期股權投資，本公司按照合併日取得的被合併方所有者權益在最終控制方合併財務報表中的賬面價值的份額作為長期股權投資的初始投資成本。長期股權投資初始投資成本與支付對價賬面價值之間的差額，調整資本公積中的股本溢價；資本公積中的股本溢價不足沖減時，調整留存收益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

14、長期股權投資(續)

(1) 長期股權投資成本確定(續)

2) 其他方式取得的長期股權投資

對於通過企業合併以外的其他方式取得的長期股權投資，在初始確認時，對於以支付現金取得的長期股權投資，本集團按照實際支付的購買價款作為初始投資成本；對於發行權益性證券取得的長期股權投資，本集團按照發行權益性證券的公允價值作為初始投資成本。

(2) 長期股權投資後續計量及損益確認方法

1) 對子公司的投資

在本公司個別財務報表中，本公司採用成本法對子公司的長期股權投資進行後續計量，對被投資單位宣告分派的現金股利或利潤由本公司享有的部分確認為當期投資收益，但取得投資時實際支付的價款或對價中包含的已宣告但尚未發放的現金股利或利潤除外。

對子公司的投資按照成本減去減值準備後在資產負債表內列示。

對子公司投資的減值測試方法及減值準備計提方法參見「附註四、19」。

在本集團合併財務報表中，對子公司的長期股權投資按「附註四、6」進行處理。

2) 對聯營企業的投資

聯營企業指本集團能夠對其施加重大影響(參見「附註四、14(3)」)的企業。

後續計量時，對聯營企業的長期股權投資採用權益法核算，除非投資符合持有待售的條件。

本集團在採用權益法核算時的具體會計處理包括：

- 1 對於長期股權投資的初始投資成本大於投資時應享有被投資單位可辨認淨資產公允價值份額的，以前者作為長期股權投資的成本；對於長期股權投資的初始投資成本小於投資時應享有被投資單位可辨認淨資產公允價值份額的，以後者作為長期股權投資的成本，長期股權投資的成本與初始投資成本的差額計入當期損益。

14、長期股權投資(續)

(2) 長期股權投資後續計量及損益確認方法(續)

2) 對聯營企業的投資(續)

- 2 取得對聯營企業投資後，本集團按照應享有或應分擔的被投資單位實現的淨損益和其他綜合收益的份額，分別確認投資損益和其他綜合收益並調整長期股權投資的賬面價值；按照被投資單位宣告分派的利潤或現金股利計算應分得的部分，相應減少長期股權投資的賬面價值。對聯營企業除淨損益、其他綜合收益和利潤分配以外所有者權益的其他變動(以下簡稱「其他所有者權益變動」)，本集團按照應享有或應分擔的份額計入股東權益，並同時調整長期股權投資的賬面價值。
- 3 在計算應享有或應分擔的被投資單位實現的淨損益、其他綜合收益及其他所有者權益變動的份額時，本集團以取得投資時被投資單位可辨認淨資產公允價值為基礎，按照本集團的會計政策或會計期間進行必要調整後確認投資收益和其他綜合收益等。本集團與聯營企業之間內部交易產生的未實現損益按照應享有的比例計算歸屬於本集團的部分，在權益法核算時予以抵銷。內部交易產生的未實現損失，有證據表明該損失是相關資產減值損失的，則全額確認該損失。
- 4 本集團對聯營企業發生的淨虧損，除本集團負有承擔額外損失義務外，以長期股權投資的賬面價值以及其他實質上構成對聯營企業淨投資的長期權益減記至零為限。聯營企業以後實現淨利潤的，本集團在收益分享額彌補未確認的虧損分擔額後，恢復確認收益分享額。

本集團對聯營企業投資的減值測試方法及減值準備計提方法參見「附註四、19」。

(3) 確定對被投資單位具有重大影響的判斷標準

重大影響指本集團對被投資單位的財務和經營政策有參與決策的權力，但並不能夠控制或者與其他方一起共同控制這些政策的制定。

四、重要會計政策及會計估計(續)

15、固定資產

(1) 固定資產確認條件

固定資產指本集團為提供勞務或經營管理而持有的，使用壽命超過一個會計年度的有形資產。

外購固定資產的初始成本包括購買價款、相關稅費以及使該資產達到預定可使用狀態前所發生的可歸屬於該項資產的支出。

對於構成固定資產的各組成部分，如果各自具有不同使用壽命或者以不同方式為本集團提供經濟利益，適用不同折舊率或折舊方法的，本集團分別將各組成部分確認為單項固定資產。

對於固定資產的後續支出，包括與更換固定資產某組成部分相關的支出，在與支出相關的經濟利益很可能流入本集團時資本化計入固定資產成本，同時將被替換部分的賬面價值扣除；與固定資產日常維護相關的支出在發生時計入當期損益。

固定資產以成本減累計折舊及減值準備後在資產負債表內列示。

(2) 固定資產的折舊方法

本集團將固定資產的成本扣除預計淨殘值和累計減值準備後在其使用壽命內按年限平均法計提折舊，除非固定資產符合持有待售的條件。

各類固定資產的使用壽命、殘值率和折舊率分別為：

| 固定資產 | 使用壽命 | 殘值率 | 折舊率 |
|------|------|-------|---------|
| 運輸工具 | 10年 | 5% | 9.5% |
| 辦公設備 | 4-5年 | 0%-5% | 19%-25% |
| 電子設備 | 3-5年 | 0%-5% | 19%-33% |

本集團至少在每年年度終了對固定資產的使用壽命、預計淨殘值和折舊方法進行覆核。

(3) 減值測試方法及減值準備計提方法

固定資產減值測試方法及減值準備計提方法參見「附註四、19」。

四、重要會計政策及會計估計(續)

15、固定資產(續)

(4) 固定資產處置

固定資產滿足下述條件之一時，本集團會予以終止確認。

- 1 固定資產處於處置狀態；
- 2 該固定資產預期通過使用或處置不能產生經濟利益。

報廢或處置固定資產項目所產生的損益為處置所得款項淨額與項目賬面金額之間的差額，並於報廢或處置日在損益中確認。

16、無形資產

無形資產以成本減累計攤銷(僅限於使用壽命有限的無形資產)及減值準備(參見「附註四、19」)在資產負債表內列示。對於使用壽命有限的無形資產，本集團將無形資產的成本扣除預計淨殘值和累計減值準備後按直線法在預計使用壽命期內攤銷，除非該無形資產符合持有待售的條件。

各項無形資產的攤銷年限分別為：

| 無形資產 | 攤銷年限 |
|------|------|
| 軟件 | 2-4年 |
| 客戶關係 | 3.5年 |

17、商譽

因非同一控制下企業合併形成的商譽，其初始成本是合併成本大於合併中取得的被購買方可辨認淨資產公允價值份額的差額。

本集團對商譽不攤銷，以成本減累計減值準備(參見「附註四、19」)在資產負債表內列示。商譽在其相關資產組或資產組組合處置時予以轉出，計入當期損益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具

本集團的金融工具包括貨幣資金、應收貨幣保證金、交易性金融資產、衍生金融資產、買入返售金融資產、應收款項、其他應收款、應付貨幣保證金、應付期貨投資者保障基金、交易性金融負債、衍生金融負債、應付職工薪酬、其他應付款及股本等。

(1) 金融資產及金融負債的確認和初始計量

金融資產和金融負債在本集團成為相關金融工具合同條款的一方時，於資產負債表內確認。

除不具有重大融資成分的應收賬款外，在初始確認時，金融資產及金融負債均以公允價值計量。對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產或金融負債，相關交易費用直接計入當期損益；對於其他類別的金融資產或金融負債，相關交易費用計入初始確認金額。對於不具有重大融資成分的應收賬款，本集團根據附註四、25的會計政策確定的交易價格進行初始計量。

(2) 金融資產的分類和後續計量

1) 本集團金融資產的分類

本集團通常根據管理金融資產的業務模式和金融資產的合同現金流量特徵，在初始確認時將金融資產分為不同類別：以攤餘成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。

除非本集團改變管理金融資產的業務模式，在此情形下，所有受影響的相關金融資產在業務模式發生變更後的首個報告期間的第一天進行重分類，否則金融資產在初始確認後不得進行重分類。

本集團將同時符合下列條件且未被指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，分類為以攤餘成本計量的金融資產：

- 1 本集團管理該金融資產的業務模式是以收取合同現金流量為目標；
- 2 該金融資產的合同條款規定，在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(2) 金融資產的分類和後續計量(續)

1) 本集團金融資產的分類(續)

本集團將同時符合下列條件且未被指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，分類為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產：

- 1 本集團管理該金融資產的業務模式既以收取合同現金流量為目標又以出售該金融資產為目標；
- 2 該金融資產的合同條款規定，在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。

對於非交易性權益工具投資，本集團可在初始確認時將其不可撤銷地指定為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產。該指定在單項投資的基礎上作出，且相關投資從發行者的角度符合權益工具的定義。

除上述以攤餘成本計量和以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產外，本集團將其餘所有的金融資產分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。在初始確認時，如果能夠消除或顯著減少會計錯配，本集團可以將本應以攤餘成本計量或以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產不可撤銷地指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。

管理金融資產的業務模式，是指本集團如何管理金融資產以產生現金流量。業務模式決定本集團所管理金融資產現金流量的來源是收取合同現金流量、出售金融資產還是兩者兼有。本集團以客觀事實為依據、以關鍵管理人員決定的對金融資產進行管理的特定業務目標為基礎，確定管理金融資產的業務模式。

本集團對金融資產的合同現金流量特徵進行評估，以確定相關金融資產在特定日期產生的合同現金流量是否僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。其中，本金是指金融資產在初始確認時的公允價值；利息包括對貨幣時間價值、與特定時期未償付本金金額相關的信用風險、以及其他基本借貸風險、成本和利潤的對價。此外，本集團對可能導致金融資產合同現金流量的時間分佈或金額發生變更的合同條款進行評估，以確定其是否滿足上述合同現金流量特徵的要求。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(2) 金融資產的分類和後續計量(續)

2) 本集團金融資產的後續計量

1 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產

初始確認後，對於該類金融資產以公允價值進行後續計量，產生的利得或損失(包括利息和股利收入)計入當期損益，除非該金融資產屬於套期關係的一部分。

2 以攤餘成本計量的金融資產

初始確認後，對於該類金融資產採用實際利率法以攤餘成本計量。以攤餘成本計量且不屬於任何套期關係的一部分的金融資產所產生的利得或損失，在終止確認、按照實際利率法攤銷或確認減值時，計入當期損益。

3 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債權投資

初始確認後，對於該類金融資產以公允價值進行後續計量。採用實際利率法計算的利息、減值損失或利得及匯兌損益計入當期損益，其他利得或損失計入其他綜合收益。終止確認時，將之前計入其他綜合收益的累計利得或損失從其他綜合收益中轉出，計入當期損益。

4 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具投資

初始確認後，對於該類金融資產以公允價值進行後續計量。股利收入計入損益，其他利得或損失計入其他綜合收益。終止確認時，將之前計入其他綜合收益的累計利得或損失從其他綜合收益中轉出，計入留存收益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(3) 金融負債的分類和後續計量

本集團將金融負債分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債及以攤餘成本計量的金融負債。

1 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債

該類金融負債包括交易性金融負債(含屬於金融負債的衍生工具)和指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。

初始確認後，對於該類金融負債以公允價值進行後續計量，除與套期會計有關外，產生的利得或損失(包括利息費用)計入當期損益。

2 以攤餘成本計量的金融負債

初始確認後，對其他金融負債採用實際利率法以攤餘成本計量。

(4) 抵銷

金融資產和金融負債在資產負債表內分別列示，沒有相互抵銷。但是，同時滿足下列條件的，以相互抵銷後的淨額在資產負債表內列示：

- 1 本集團具有抵銷已確認金額的法定權利，且該種法定權利是當前可執行的；
- 2 本集團計劃以淨額結算，或同時變現該金融資產和清償該金融負債。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(5) 金融資產和金融負債的終止確認

滿足下列條件之一時，本集團終止確認該金融資產：

- 1 收取該金融資產現金流量的合同權利終止；
- 2 該金融資產已轉移，且本集團將金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬轉移給轉入方；
- 3 該金融資產已轉移，雖然本集團既沒有轉移也沒有保留金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬，但是未保留對該金融資產的控制。

金融資產轉移整體滿足終止確認條件的，本集團將下列兩項金額的差額計入當期損益：

- 1 被轉移金融資產在終止確認日的賬面價值；
- 2 因轉移金融資產而收到的對價，與原直接計入其他綜合收益的公允價值變動累計額中對應終止確認部分的金額(涉及轉移的金融資產為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債權投資)之和。

金融負債(或其一部分)的現時義務已經解除的，本集團終止確認該金融負債(或該部分金融負債)。

(6) 減值

本集團以預期信用損失為基礎，對下列項目進行減值會計處理並確認損失準備：

- 1 以攤餘成本計量的金融資產；
- 2 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債權投資。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(6) 減值(續)

本集團持有的其他以公允價值計量的金融資產不適用預期信用損失模型，包括以公允價值計量且其變動計入當期損益的債權投資或權益工具投資，指定為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具投資，以及衍生金融資產。

預期信用損失，是指以發生違約的風險為權重的金融工具信用損失的加權平均值。信用損失，是指本集團按照原實際利率折現的、根據合同應收的所有合同現金流量與預期收取的所有現金流量之間的差額，即全部現金短缺的現值。

在計量預期信用損失時，本集團需考慮的最長期限為企業面臨信用風險的最長合同期限(包括考慮續約選擇權)。

整個存續期預期信用損失，是指因金融工具整個預計存續期內所有可能發生的違約事件而導致的預期信用損失。

未來12個月內預期信用損失，是指因資產負債表日後12個月內(若金融工具的預計存續期少於12個月，則為預計存續期)可能發生的金融工具違約事件而導致的預期信用損失，是整個存續期預期信用損失的一部分。

對於應收賬款，本集團始終按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量其損失準備。本集團基於歷史信用損失經驗、使用準備矩陣計算上述金融資產的預期信用損失，相關歷史經驗根據資產負債表日借款人的特定因素、以及對當前狀況和未來經濟狀況預測的評估進行調整。

除應收賬款，本集團對滿足下列情形的金融工具按照相當於未來12個月內預期信用損失的金額計量其損失準備，對其他金融工具按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量其損失準備：

- 1 該金融工具在資產負債表日只具有較低的信用風險；或
- 2 該金融工具的信用風險自初始確認後並未顯著增加。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(6) 減值(續)

如果金融工具的違約風險較低，借款人在短期內履行其合同現金流量義務的能力很強，並且即便較長時期內經濟形勢和經營環境存在不利變化但未必一定降低借款人履行其合同現金流量義務的能力，該金融工具被視為具有較低的信用風險。

本集團通過比較金融工具在資產負債表日發生違約的風險與在初始確認日發生違約的風險，以確定金融工具預計存續期內發生違約風險的相對變化，以評估金融工具的信用風險自初始確認後是否已顯著增加。

在確定信用風險自初始確認後是否顯著增加時，本集團考慮無須付出不必要的額外成本或努力即可獲得的合理且有依據的信息，包括前瞻性信息。本集團考慮的信息包括：

- 1 債務人未能按合同到期日支付本金和利息的情況；
- 2 已發生的或預期的金融工具的外部或內部信用評級(如有)的嚴重惡化；
- 3 已發生的或預期的債務人經營成果的嚴重惡化；
- 4 現存的或預期的技術、市場、經濟或法律環境變化，並將對債務人對本集團的還款能力產生重大不利影響。

根據金融工具的性質，本集團以單項金融工具或金融工具組合為基礎評估信用風險是否顯著增加。以金融工具組合為基礎進行評估時，本集團可基於共同信用風險特徵對金融工具進行分類，例如逾期信息和信用風險評級。

本集團認為金融資產在下列情況發生違約：

- 1 交易對手方不大可能全額支付其對本集團的欠款，該評估不考慮本集團採取例如變現抵押品(如果持有)等追索行動；或
- 2 金融資產逾期超過90天。

四、重要會計政策及會計估計(續)

18、金融工具(續)

(6) 減值(續)

本集團在資產負債表日評估以攤餘成本計量的金融資產和以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債權投資是否已發生信用減值。當對金融資產預期未來現金流量具有不利影響的一項或多項事件發生時，該金融資產成為已發生信用減值的金融資產。金融資產已發生信用減值的證據包括下列可觀察信息：

- 1 發行方或債務人發生重大財務困難；
- 2 債務人違反合同，如償付利息或本金違約或逾期等；
- 3 本集團出於與債務人財務困難有關的經濟或合同考慮，給予債務人在任何其他情況下都不會做出的讓步；
- 4 債務人很可能破產或進行其他財務重組；
- 5 發行方或債務人財務困難導致該金融資產的活躍市場消失。

為反映金融工具的信用風險自初始確認後的變化，本集團在每個資產負債表日重新計量預期信用損失，由此形成的損失準備的增加或轉回金額，應當作為減值損失或利得計入當期損益。對於以攤餘成本計量的金融資產，損失準備抵減該金融資產在資產負債表中列示的賬面價值；對於以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債權投資，本集團在其他綜合收益中確認其損失準備，不抵減該金融資產的賬面價值。

如果本集團不再合理預期金融資產合同現金流量能夠全部或部分收回，則直接減記該金融資產的賬面餘額。這種減記構成相關金融資產的終止確認。這種情況通常發生在本集團確定債務人沒有資產或收入來源可產生足夠的現金流量以償還將被減記的金額。但是，被減記的金融資產仍可能受到本集團催收到期款項相關執行活動的影響。

已減記的金融資產以後又收回的，作為減值損失的轉回計入收回當期的損益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

19、除存貨及金融資產外的其他資產減值

本集團在資產負債表日根據內部及外部信息以確定下列資產是否存在減值的跡象，包括：

- 1 固定資產
- 2 使用權資產
- 3 無形資產
- 4 商譽
- 5 長期股權投資等

本集團對存在減值跡象的資產進行減值測試，估計資產的可收回金額。此外，無論是否存在減值跡象，本集團於每年年度終了對商譽估計其可回收金額。本集團依據相關資產組或者資產組組合能夠從企業合併的協同效應中的受益情況分攤商譽賬面價值，並在此基礎上進行商譽減值測試。

可收回金額是指資產(或資產組、資產組組合，下同)的公允價值(參見「附註四、20」)減去處置費用後的淨額與資產預計未來現金流量的現值兩者之間較高者。

資產組由創造現金流入相關的資產組成，是可以認定的最小資產組合，其產生的現金流入基本上獨立於其他資產或者資產組。

資產預計未來現金流量的現值，按照資產在持續使用過程中和最終處置時所產生的預計未來現金流量，選擇恰當的稅前折現率對其進行折現後的金額加以確定。

可收回金額的估計結果表明，資產的可收回金額低於其賬面價值的，資產的賬面價值會減記至可收回金額，減記的金額確認為資產減值損失，計入當期損益，同時計提相應的資產減值準備。與資產組或者資產組組合相關的減值損失，先抵減分攤至該資產組或者資產組組合中商譽的賬面價值，再根據資產組或者資產組組合中除商譽之外的其他各項資產的賬面價值所佔比重，按比例抵減其他各項資產的賬面價值，但抵減後的各資產的賬面價值不得低於該資產的公允價值減去處置費用後的淨額(如可確定的)、該資產預計未來現金流量的現值(如可確定的)和零三者之中最高者。

資產減值損失一經確認，在以後會計期間不會轉回。

四、重要會計政策及會計估計(續)

20、公允價值的計量

除特別聲明外，本集團按下述原則計量公允價值：

公允價值是指市場參與者在計量日發生的有序交易中，出售一項資產所能收到或者轉移一項負債所需支付的價格。

本集團估計公允價值時，考慮市場參與者在計量日對相關資產或負債進行定價時考慮的特徵(包括資產狀況及所在位置、對資產出售或者使用的限制等)，並採用在當前情況下適用並且有足夠可利用數據和其他信息支持的估值技術。使用的估值技術主要包括市場法、收益法和成本法。

21、職工薪酬

(1) 短期薪酬

本集團在職工提供服務的會計期間，將實際發生或按規定的基準和比例計提的職工工資、獎金、醫療保險費、工傷保險費和生育保險費等社會保險費和住房公積金，確認為負債，並計入當期損益或相關資產成本。

(2) 離職後福利－設定提存計劃

本集團所參與的設定提存計劃包括：

- 1 本集團所參與的設定提存計劃是按照中國有關法規要求，本集團職工參加的由政府機構設立管理的社會保障體系中的基本養老保險。基本養老保險的繳費金額按國家規定的基準和比例計算。
- 2 根據《企業年金試行辦法》的有關規定，本集團職工參加的經職工代表大會討論通過並報送勞動保障行政部門的企業年金計劃。企業年金的繳費金額按年金計劃方案計算。

本集團在職工提供服務的會計期間，將應繳存的金額確認為負債，並計入當期損益或相關資產成本。

四、重要會計政策及會計估計(續)

21、職工薪酬(續)

(3) 辭退福利

本集團在職工勞動合同到期之前解除與職工的勞動關係，或者為鼓勵職工自願接受裁減而提出給予補償的建議，在下列兩者孰早日，確認辭退福利產生的負債，同時計入當期損益：

- 1 本集團不能單方面撤回解除勞動關係計劃或裁減建議所提供的辭退福利時；
- 2 本集團有詳細、正式的涉及支付辭退福利的重組計劃；並且，該重組計劃已開始實施，或已向受其影響的各方通告了該計劃的主要內容，從而使各方形成了對本集團將實施重組的合理預期時。

22、期貨風險準備金

(1) 計提方法和用途

根據財商字[1997] 44號《關於〈商品期貨交易財務管理暫行規定〉的通知》的規定，風險準備金按代理手續費收入減去應付期貨交易所手續費後的淨收入的5%提取。期貨風險準備金專門用於抵補本公司錯單交易等的損失，當其餘額達到本公司註冊資本的10倍時，不再提取。

當發生以下情況時確認風險損失，沖減期貨風險準備金：1 錯單合約平倉產生虧損；2 因本公司自身原因造成的無法追究責任的風險損失；3 無法收回的墊付因客戶責任造成的風險損失。

(2) 核算方法

本公司按上述規定以代理手續費收入減去應付期貨交易所手續費後的淨收入的5%提取期貨風險準備金，計提額計入當期損益，並同時計入「期貨風險準備金」項目。當符合使用用途而動用期貨風險準備金時，期貨風險準備金餘額以減計至零為限，超出部分計入當期損益。

四、重要會計政策及會計估計(續)

23、所得稅

除因企業合併和直接計入股東權益(包括其他綜合收益)的交易或者事項產生的所得稅外，本集團將當期所得稅和遞延所得稅計入當期損益。

當期所得稅是按本年度應稅所得額，根據稅法規定的稅率計算的預期應交所得稅，加上以往年度應付所得稅的調整。

資產負債表日，如果本集團擁有以淨額結算的法定權利並且意圖以淨額結算或取得資產、清償負債同時進行時，那麼當期所得稅資產及當期所得稅負債以抵銷後的淨額列示。

遞延所得稅資產與遞延所得稅負債分別根據可抵扣暫時性差異和應納稅暫時性差異確定。暫時性差異是指資產或負債的賬面價值與其計稅基礎之間的差額，包括能夠結轉以後年度的可抵扣虧損和稅款抵減。遞延所得稅資產的確認以很可能取得用來抵扣可抵扣暫時性差異的應納稅所得額為限。

如果不屬於企業合併交易且交易發生時既不影響會計利潤也不影響應納稅所得額(或可抵扣虧損)，則該項交易中產生的暫時性差異不會產生遞延所得稅。商譽的初始確認導致的暫時性差異也不產生相關的遞延所得稅。

資產負債表日，本集團根據遞延所得稅資產和負債的預期收回或結算方式，依據已頒佈的稅法規定，按照預期收回該資產或清償該負債期間的適用稅率計量該遞延所得稅資產和負債的賬面金額。

資產負債表日，本集團對遞延所得稅資產的賬面價值進行覆核。如果未來期間很可能無法獲得足夠的應納稅所得額用以抵扣遞延所得稅資產的利益，則減記遞延所得稅資產的賬面價值。在很可能獲得足夠的應納稅所得額時，減記的金額予以轉回。

資產負債表日，遞延所得稅資產及遞延所得稅負債在同時滿足以下條件時以抵銷後的淨額列示：

- 1 納稅主體擁有以淨額結算當期所得稅資產及當期所得稅負債的法定權利；
- 2 並且遞延所得稅資產及遞延所得稅負債是與同一稅收征管部門對同一納稅主體徵收的所得稅相關或者是對不同的納稅主體相關，但在未來每一具有重要性的遞延所得稅資產及負債轉回的期間內，涉及的納稅主體意圖以淨額結算當期所得稅資產和負債或是同時取得資產、清償負債。

四、重要會計政策及會計估計(續)

24、預計負債

如果與或有事項相關的義務是本集團承擔的現時義務，且該義務的履行很可能會導致經濟利益流出本集團，以及有關金額能夠可靠地計量，則本集團會確認預計負債。

預計負債按照履行相關現時義務所需支出的最佳估計數進行初始計量。對於貨幣時間價值影響重大的，預計負債以預計未來現金流量折現後的金額確定。在確定最佳估計數時，本集團綜合考慮了與或有事項有關的風險、不確定性和貨幣時間價值等因素。所需支出存在一個連續範圍，且該範圍內各種結果發生的可能性相同的，最佳估計數按照該範圍內的中間值確定；在其他情況下，最佳估計數分別下列情況處理：

- 1 或有事項涉及單個項目的，按照最可能發生金額確定；
- 2 或有事項涉及多個項目的，按照各種可能結果及相關概率計算確定。

本集團在資產負債表日對預計負債的賬面價值進行覆核，並按照當前最佳估計數對該賬面價值進行調整。

25、收入

收入是本集團在日常活動中形成的、會導致股東權益增加且與股東投入資本無關的經濟利益的總流入。

本集團在履行了合同中的履約義務，即在客戶取得相關商品或服務的控制權時，確認收入。

合同中包含兩項或多項履約義務的，本集團在合同開始日，按照各單項履約義務所承諾商品或服務的單獨售價的相對比例，將交易價格分攤至各單項履約義務，按照分攤至各單項履約義務的交易價格計量收入。

交易價格是本集團因向客戶轉讓商品或服務而預期有權收取的對價金額，不包括代第三方收取的款項。本集團確認的交易價格不超過在相關不確定性消除時累計已確認收入極可能不會發生重大轉回的金額。預期將退還給客戶的款項作為退貨負債，不計入交易價格。合同中存在重大融資成分的，本集團按照假定客戶在取得商品或服務控制權時即以現金支付的應付金額確定交易價格。該交易價格與合同對價之間的差額，在合同期間內採用實際利率法攤銷。合同開始日，本集團預計客戶取得商品或服務控制權與客戶支付價款間隔不超過一年的，不考慮合同中存在的重大融資成分。

四、重要會計政策及會計估計(續)

25、收入(續)

滿足下列條件之一時，本集團屬於在某一段時間內履行履約義務，否則，屬於在某一時點履行履約義務：

- 1 客戶在本集團履約的同時即取得並消耗本集團履約所帶來的經濟利益；
- 2 客戶能夠控制本集團履約過程中在建的商品；
- 3 本集團履約過程中所產出的商品具有不可替代用途，且本集團在整個合同期間內有權就累計至今已完成的履約部分收取款項。

對於在某一時段內履行的履約義務，本集團在該段時間內按照履約進度確認收入。履約進度不能合理確定時，本集團已經發生的成本預計能夠得到補償的，按照已經發生的成本金額確認收入，直到履約進度能夠合理確定為止。

對於在某一時點履行的履約義務，本集團在客戶取得相關商品或服務控制權時點確認收入。在判斷客戶是否已取得商品或服務控制權時，本集團會考慮下列跡象：

- 1 本集團就該商品或服務享有現時收款權利；
- 2 本集團已將該商品的實物轉移給客戶；
- 3 本集團已將該商品的法定所有權或所有權上的主要風險和報酬轉移給客戶；
- 4 客戶已接受該商品或服務等。

本集團已向客戶轉讓商品或服務而有權收取對價的權利(且該權利取決於時間流逝之外的其他因素)作為合同資產列示，合同資產以預期信用損失為基礎計提減值。本集團擁有的、無條件(僅取決於時間流逝)向客戶收取對價的權利作為應收款項列示。本集團已收或應收客戶對價而應向客戶轉讓商品或服務的義務作為合同負債列示。

四、重要會計政策及會計估計(續)

25、收入(續)

與本集團取得收入的主要活動相關的具體會計政策描述如下：

(1) 手續費收入

期貨及期權經紀手續費收入於代理交易發生日予以確認。根據期貨及期權代理合同，本集團按向客戶收取的手續費，扣減代收的支付給交易所的手續費部分之後的淨額確認手續費收入。

交易所手續費返還減收在本集團收到交易所的返還減收時確認。

資產管理業務手續費在本集團有權根據資產管理協議取得收入時確認。

風險管理業務收入本集團按風險管理業務合同的約定確認收入。

(2) 利息收入

利息收入是按借出貨幣資金的時間和實際利率計算確定。

(3) 投資收益

處置金融工具產生的損益及獲得股利分紅於交易日確認投資收益。

(4) 公允價值變動損益

金融工具公允價值變動產生的損益於資產負債表日按公允價值與賬面價值之間的差額確認。

(5) 其他業務收入

其他業務收入主要系銷售商品收入及諮詢服務收入。對於銷售商品，本集團按照合同收取貨款後，將現貨貨權轉移給客戶，客戶取得商品的控制權，本集團確認收入。對於諮詢服務收入，本集團根據提供諮詢服務的履約進度確認收入。

四、重要會計政策及會計估計(續)

26、政府補助

政府補助是本集團從政府無償取得的貨幣性資產或非貨幣性資產，但不包括政府以投資者身份向本集團投入的資本。政府撥入的投資補助等專項撥款中，國家相關文件規定作為資本公積處理的，也屬於資本性投入的性質，不屬於政府補助。

政府補助在能夠滿足政府補助所附條件，並能夠收到時，予以確認。

政府補助為貨幣性資產的，按照收到或應收的金額計量。政府補助為非貨幣性資產的，按照公允價值計量。

本集團取得的、用於購建或以其他方式形成長期資產的政府補助作為與資產相關的政府補助。本集團取得的與資產相關之外的其他政府補助作為與收益相關的政府補助。與資產相關的政府補助，本集團將其確認為遞延收益，並在相關資產使用壽命內按照合理、系統的方法分期計入其他收益或營業外收入。與收益相關的政府補助，如果用於補償本集團以後期間的相關成本費用或損失的，本集團將其確認為遞延收益，並在確認相關成本費用或損失的期間，計入其他收益或營業外收入；否則直接計入其他收益或營業外收入。

27、佣金費用

本集團與居間人簽訂居間協議，支付給居間人的佣金列支於業務及管理費用。

28、一般風險準備金

本公司根據《金融企業財務規則》及《金融企業財務規則—實施指南》規定，按照當期淨利潤的10%提取一般風險準備。

29、租賃

租賃，是指在一定期間內，出租人將資產的使用權讓與承租人以獲取對價的合同。

在合同開始日，本集團評估合同是否為租賃或者包含租賃。如果合同中一方讓渡了在一定期間內控制一項或多項已識別資產使用的權利以換取對價，則該合同為租賃或者包含租賃。

四、重要會計政策及會計估計(續)

29、租賃(續)

為確定合同是否讓渡了在一定期間內控制已識別資產使用的權利，本集團進行如下評估：

- 1 合同是否涉及已識別資產的使用。已識別資產可能由合同明確指定或在資產可供客戶使用時隱性指定，並且該資產在物理上可區分，或者如果資產的某部分產能或其他部分在物理上不可區分但實質上代表了該資產的全部產能，從而使客戶獲得因使用該資產所產生的幾乎全部經濟利益。如果資產的供應方在整個使用期間擁有對該資產的實質性替換權，則該資產不屬於已識別資產；
- 2 承租人是否有權獲得在使用期間內因使用已識別資產所產生的幾乎全部經濟利益；
- 3 承租人是否有權在該使用期間主導已識別資產的使用。

合同中同時包含多項單獨租賃的，承租人和出租人將合同予以分拆，並分別各項單獨租賃進行會計處理。合同中同時包含租賃和非租賃部分的，承租人和出租人將租賃和非租賃部分進行分拆。在分拆合同包含的租賃和非租賃部分時，承租人按照各租賃部分單獨價格及非租賃部分的單獨價格之和的相對比例分攤合同對價。

1) 本集團作為承租人

在租賃期開始日，本集團對租賃確認使用權資產和租賃負債。使用權資產按照成本進行初始計量，包括租賃負債的初始計量金額、在租賃期開始日或之前支付的租賃付款額(扣除已享受的租賃激勵相關金額)，發生的初始直接費用以及為拆卸及移除租賃資產、復原租賃資產所在場地或將租賃資產恢復至租賃條款約定狀態預計將發生的成本。

本集團使用直線法對使用權資產計提折舊。對能夠合理確定租賃期屆滿時取得租賃資產所有權的，本集團在租賃資產剩餘使用壽命內計提折舊。否則，租賃資產在租賃期與租賃資產剩餘使用壽命兩者孰短的期間內計提折舊。使用權資產按附註四、19所述的會計政策計提減值準備。

四、重要會計政策及會計估計(續)

29、租賃(續)

1) 本集團作為承租人(續)

租賃負債按照租賃期開始日尚未支付的租賃付款額的現值進行初始計量，折現率為租賃內含利率。無法確定租賃內含利率的，採用本集團增量借款利率作為折現率。

本集團按照固定的週期性利率計算租賃負債在租賃期內各期間的利息費用，並計入當期損益或相關資產成本。未納入租賃負債計量的可變租賃付款額在實際發生時計入當期損益或相關資產成本。

租賃期開始日後，發生下列情形的，本集團按照變動後租賃付款額的現值重新計量租賃負債：

- 1 根據擔保餘值預計的應付金額發生變動；
- 2 用於確定租賃付款額的指數或比率發生變動；
- 3 本集團對購買選擇權、續租選擇權或終止租賃選擇權的評估結果發生變化，或續租選擇權或終止租賃選擇權的實際行使情況與原評估結果不一致。

在對租賃負債進行重新計量時，本集團相應調整使用權資產的賬面價值。使用權資產的賬面價值已調減至零，但租賃負債仍需進一步調減的，本集團將剩餘金額計入當期損益。

本集團已選擇對短期租賃(租賃期不超過12個月的租賃)和低價值資產租賃不確認使用權資產和租賃負債，並將相關的租賃付款額在租賃期內各個期間按照直線法計入當期損益或相關資產成本。

30、利潤分配

資產負債表日後，經審議批准的利潤分配方案中擬分配的利潤，不確認為資產負債表日的負債，在附註中單獨披露。

四、重要會計政策及會計估計(續)

31、關聯方

一方控制、共同控制另一方或對另一方施加重大影響，以及兩方或兩方以上同受一方控制、共同控制的，構成關聯方。關聯方可為個人或企業。僅僅同受國家控制而不存在其他關聯方關係的企業，不構成關聯方。

此外，本集團同時根據證監會頒佈的《上市公司信息披露管理辦法》確定本集團或本公司的關聯方。

32、分部報告

本集團以內部組織結構、管理要求、內部報告制度為依據確定經營分部。如果兩個或多個經營分部存在相似經濟特徵且同時在各單項產品或勞務的性質、生產過程的性質、產品或勞務的客戶類型、銷售產品或提供勞務的方式、生產產品及提供勞務受法律及行政法規的影響等方面具有相同或相似性的，可以合併為一個經營分部。本集團以經營分部為基礎考慮重要性原則後確定報告分部。

本集團在編製分部報告時，分部間交易收入按實際交易價格為基礎計量。編製分部報告所採用的會計政策與編製本集團財務報表所採用的會計政策一致。

33、主要會計估計及判斷

編製財務報表時，本集團管理層需要運用估計和假設，這些估計和假設會對會計政策的應用及資產、負債、收入及費用的金額產生影響。實際情況可能與這些估計不同。本公司管理層對估計涉及的關鍵假設和不確定性因素的判斷進行持續評估。會計估計變更的影響在變更當期和未來期間予以確認。

下列會計估計及關鍵假設存在導致未來期間的資產及負債賬面價值發生重大調整的重要風險。

(1) 金融資產減值準備

本集團以預期信用損失為基礎，對債權投資、其他債權投資、開展融資類業務(含融資融券、約定購回、股票質押回購等)形成的資產，以及貨幣市場拆出(借出)資金或證券、應收款項和應收融資租賃款等進行減值處理並確認損失準備。

四、重要會計政策及會計估計(續)

33、主要會計估計及判斷(續)

(1) 金融資產減值準備(續)

本集團基於上述金融資產的分類與性質，結合自身風險管理實踐及減值指引的相關要求，以概率加權平均為基礎，綜合考慮貨幣時間價值和在資產負債表日無須付出不必要的額外成本或努力即可獲得的有關過去事項、當前狀況以及未來經濟狀況預測的合理且有依據的信息，建立預期信用損失模型計量上述金融工具的減值損失。預期信用損失模型的相關假設、參數、數據來源和計量程序均需本公司作出專業的判斷，這些相關因素假設的變化會對金融工具的預期信用損失計算結果產生影響。

本集團採用預期信用損失模型對金融資產的減值進行評估，應用預期信用損失模型需要做出重大判斷和估計如違約概率、違約損失率及信用風險是否顯著增加，需考慮所有合理且有依據的信息，包括前瞻性信息。在做出該等判斷和估計時，本公司根據歷史還款數據結合經濟政策、宏觀經濟指標、行業風險等因素推斷債務人信用風險的預期變動。

(2) 除金融資產之外的非流動資產減值

本集團於資產負債表日對除金融資產之外的非流動資產判斷是否存在可能發生減值的跡象。在進行減值測試時，當資產或資產組的賬面價值高於可收回金額，表明發生了減值。預計未來現金流量現值時，管理層必須估計該項資產或資產組的預計未來現金流量，並選擇恰當的折現率確定未來現金流量的現值。

(3) 金融工具的公允價值

對於缺乏活躍市場的金融工具，本集團運用估值方法確定其公允價值。估值方法包括參照在市場中具有完全信息且有買賣意願的經濟主體之間進行公平交易時確定的交易價格，參考市場上另一類似金融工具的公允價值，或運用現金流量折現分析及期權定價模型進行估算。估值方法在最大程度上利用可觀察市場信息，然而，當可觀察市場信息無法獲得時，管理層將對估值方法中包括的重大不可觀察信息作出估計。

(4) 所得稅及遞延所得稅

本集團需要對某些交易未來的稅務處理作出判斷以確認所得稅。本集團根據有關稅收法規，謹慎判斷交易對應的所得稅影響並相應地計提所得稅。遞延所得稅資產只會在有可能有未來應納稅利潤並可用作抵銷有關暫時性差異時才可確認。對此需要就某些交易的稅務處理作出重大判斷，並需要就是否有足夠的未來應納稅利潤以抵銷遞延所得稅資產的可能性作出重大的估計。

四、重要會計政策及會計估計(續)

33、主要會計估計及判斷(續)

(5) 合併範圍的確定

評估本集團是否作為投資者控制被投資企業時須考慮所有事實及情況。控制的定義包含以下三項要素：1) 擁有對被投資者的權力；2) 通過參與被投資者的相關活動而享有可變回報；3) 有能力運用對被投資者的權力影響其回報的金額。倘若有事實及情況顯示上述一項或多項要素發生了變化，則本集團需要重新評估其是否對被投資企業構成控制。

對於本集團管理並投資的結構化主體，本集團會評估其所持有結構化主體連同其管理人報酬所產生的可變回報的最大風險敞口是否足夠重大以致表明本集團對結構化主體擁有控制權。若本集團對管理的結構化主體擁有控制權，則將結構化主體納入合併財務報表的合併範圍。

34、主要會計政策的變更

(1) 重要會計政策變更

無

五、稅項

主要稅種及稅率

本公司及子公司適用的主要稅種及其稅率列示如下：

| 稅種 | 計稅依據 | 稅率 |
|---------|--|-----------|
| 增值稅 | 按稅法規定的應稅服務收入及銷售貨物收入為基礎計算銷項稅額，在扣除當期允許抵扣的進項稅額後，差額部分應交增值稅 | 6%、9%、13% |
| 城市維護建設稅 | 按實際繳納的增值稅計徵入 | 7% |
| 教育費附加 | 按實際繳納的增值稅計徵入 | 3% |
| 地方教育費附加 | 按實際繳納的增值稅計徵入 | 2% |

本公司及本公司的境內子公司弘業資本管理有限公司(以下簡稱「弘業資本」)的法定稅率為25%，本公司的境外子公司弘業國際金融控股有限公司(以下簡稱「弘業國際金控」)及弘業國際資產管理有限公司(以下簡稱「弘業國際資產」)的法定稅率為16.5%。

六、財務報表項目註釋

1、貨幣資金錶

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------------|-------------------------|------------------|
| 現金 | | |
| 銀行存款 | 4,073,372,703.29 | 2,865,678,274.33 |
| 其中：期貨保證金 | 3,959,706,206.55 | 2,660,162,679.92 |
| 自有資金 | 113,666,496.74 | 205,515,594.41 |
| 其他貨幣資金 | 37,885,031.15 | 13,872,280.30 |
| 貨幣資金應計利息 | 32,384,238.89 | 14,744,868.57 |
| 合計 | 4,143,641,973.33 | 2,894,295,423.20 |
| 其中：存放在境外的款項總額 | 66,665,380.23 | 47,283,118.77 |

(1) 期貨保證金存款明細

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------|-------------------------|------------------|
| 中信銀行 | 1,054,078,895.82 | 1,175,941,243.75 |
| 民生銀行 | 883,884,376.49 | 598,246,980.25 |
| 興業銀行 | 1,157,480,298.10 | 264,330,493.23 |
| 浦發銀行 | 115,589,915.20 | 234,823,286.55 |
| 交通銀行 | 678,396,184.79 | 234,384,743.43 |
| 廣發銀行 | 185,620.99 | 47,069,114.68 |
| 中國銀行 | 32,236,681.18 | 31,944,736.25 |
| 中國農業銀行 | 8,220,606.60 | 22,120,070.68 |
| 中國建設銀行 | 8,958,007.41 | 19,734,353.28 |
| 招商銀行 | 5,155,922.79 | 14,566,900.53 |
| 中國工商銀行 | 10,389,858.47 | 11,282,972.50 |
| 平安銀行 | 1,572,620.46 | 3,439,058.67 |
| 中國光大銀行 | 3,557,218.25 | 2,278,726.12 |
| 合計 | 3,959,706,206.55 | 2,660,162,679.92 |

(2) 期末使用受限資金情況

詳見本附註「六、56」。

六、財務報表項目註釋(續)

2、應收貨幣保證金

(1) 按交易所／清算商分類情況

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------------------------------|-------------------------|------------------|
| 上海期貨交易所 | 186,376,259.43 | 515,339,412.89 |
| 大連商品交易所 | 654,164,795.52 | 608,526,653.82 |
| 鄭州商品交易所 | 498,143,426.63 | 386,679,174.75 |
| 中國金融期貨交易所 | 399,286,033.93 | 337,670,752.88 |
| 中國證券登記結算有限責任公司 | 103,385,291.13 | 89,795,175.78 |
| 上海國際能源交易中心 | 121,755,030.77 | 142,270,461.12 |
| R.J.O'Brien & Associates LLC | 640,197.99 | 655,159.69 |
| PHILLIP FUTURES PTE LTD | 27,200,217.85 | 10,754,284.01 |
| Phillip Commodities(HK) Limited | 8,854,413.76 | 4,197,030.91 |
| Marex Financial | 11,734,143.13 | 8,370,091.38 |
| G.H.Financials(HongKong)Limited | 17,614,078.04 | 29,504,731.12 |
| PHILLIP SECURITIES PTE LTD | 8,846.86 | |
| 小計 | 2,029,162,735.04 | 2,133,762,928.35 |
| 減：減值準備 | 3,302,594.88 | 2,674,064.85 |
| 合計 | 2,025,860,140.16 | 2,131,088,863.50 |

(2) 按類別分類情況

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|----------|-------------------------|------------------|
| 結算準備金 | 343,966,861.36 | 469,449,597.42 |
| 交易保證金 | 1,619,143,976.05 | 1,610,832,033.82 |
| 境外期貨經紀公司 | 66,051,897.63 | 53,481,297.11 |
| 小計 | 2,029,162,735.04 | 2,133,762,928.35 |
| 減：減值準備 | 3,302,594.88 | 2,674,064.85 |
| 合計 | 2,025,860,140.16 | 2,131,088,863.50 |

六、財務報表項目註釋(續)

3、應收質押保證金

(1) 交易所明細

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------|----------------|---------------|
| 上海期貨交易所 | 428,672,112.00 | 40,750,944.00 |
| 鄭州商品交易所 | 79,350,321.60 | 23,645,440.00 |
| 大連商品交易所 | 160,794,960.00 | |
| 合計 | 668,817,393.60 | 64,396,384.00 |

(2) 質押品明細

| 質押品種類 | 2021年12月31日市值 | 折扣率 | 2021年12月31日金額 |
|----------------------|----------------|-----|----------------|
| 上海期貨交易所 | | | |
| 其中：2021年記賬式付息(八期)國債 | 100,280,000.00 | 80% | 80,224,000.00 |
| 2020年記賬式付息(八期)國債 | 433,741,000.00 | 80% | 346,992,800.00 |
| 標準倉單錫 | 1,819,140.00 | 80% | 1,455,312.00 |
| 鄭州商品交易所 | | | |
| 其中：2020年記賬式付息(十一期)國債 | 99,187,902.00 | 80% | 79,350,321.60 |
| 大連商品交易所 | | | |
| 其中：2016年記賬式付息(十期)國債 | 101,169,800.00 | 80% | 80,935,840.00 |
| 2020年記賬式付息(三期)國債 | 99,823,900.00 | 80% | 79,859,120.00 |
| 合計 | 836,021,742.00 | | 668,817,393.60 |

(續)

| 質押品種類 | 2020年12月31日市值 | 折扣率 | 2020年12月31日金額 |
|-----------|---------------|-----|---------------|
| 上海期貨交易所 | | | |
| 其中：標準倉單鉛 | 44,115,000.00 | 80% | 35,292,000.00 |
| 標準倉單銀 | 5,018,400.00 | 80% | 4,014,720.00 |
| 標準倉單錫 | 1,805,280.00 | 80% | 1,444,224.00 |
| 鄭州商品交易所 | | | |
| 其中：標準倉單棉花 | 29,556,800.00 | 80% | 23,645,440.00 |
| 合計 | 80,495,480.00 | | 64,396,384.00 |

六、財務報表項目註釋(續)

4、應收結算擔保金

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-----------|---------------|---------------|
| 中國金融期貨交易所 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 合計 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |

5、衍生金融工具

| 項目 | 2021年12月31日 | | |
|----------|------------------|---------------|---------------|
| | 名義金額 | 公允價值 | |
| | | 資產 | 負債 |
| 商品衍生金融工具 | | | |
| 其中：期貨合約 | 1,155,503,009.85 | 38,764,426.92 | 40,975,213.10 |
| 期權合約 | 1,188,697,480.04 | 465,835.77 | 1,514,054.34 |
| 合計 | 2,344,200,489.89 | 39,230,262.69 | 42,489,267.44 |
| 減：結算金額 | | 38,764,426.92 | 40,975,213.10 |
| 淨額 | | 465,835.77 | 1,514,054.34 |

(續)

| 項目 | 2020年12月31日 | | |
|----------|------------------|---------------|---------------|
| | 名義金額 | 公允價值 | |
| | | 資產 | 負債 |
| 商品衍生金融工具 | | | |
| 其中：期貨合約 | 2,871,361,685.00 | 15,878,000.00 | 16,605,795.00 |
| 期權合約 | 424,085,189.06 | 6,219,924.42 | 7,594,514.81 |
| 合計 | 3,295,446,874.06 | 22,097,924.42 | 24,200,309.81 |
| 減：結算金額 | | 15,878,000.00 | 16,605,795.00 |
| 淨額 | | 6,219,924.42 | 7,594,514.81 |

六、財務報表項目註釋(續)

6、應收款項

(1) 明細情況

| 類別 | 2021年12月31日 | | | | |
|----------------|-------------|-------|------|---------|------|
| | 賬面餘額 | | 壞賬準備 | | 賬面價值 |
| | 金額 | 比例(%) | 金額 | 計提比例(%) | |
| 按組合計提壞賬準備的應收賬款 | - | | - | | - |
| 組合：應收貨款 | - | | - | | - |
| 合計 | - | | - | - | - |

(續)

| 類別 | 2020年12月31日 | | | | |
|----------------|--------------|--------|------------|---------|--------------|
| | 賬面餘額 | | 壞賬準備 | | 賬面價值 |
| | 金額 | 比例(%) | 金額 | 計提比例(%) | |
| 按組合計提壞賬準備的應收賬款 | 7,201,845.00 | 100.00 | 360,092.25 | 5.00 | 6,841,752.75 |
| 組合：應收貨款 | 7,201,845.00 | 100.00 | 360,092.25 | 5.00 | 6,841,752.75 |
| 合計 | 7,201,845.00 | 100.00 | 360,092.25 | - | 6,841,752.75 |

六、財務報表項目註釋(續)

6、應收款項(續)

(2) 採用組合計提壞賬準備的應收賬款

| 賬齡 | 2021年12月31日 | | |
|-----------|-------------|------|---------|
| | 應收賬款 | 壞賬準備 | 計提比例(%) |
| 1年以內(含1年) | - | - | |
| 合計 | - | - | - |

(續)

| 賬齡 | 2020年12月31日 | | |
|-----------|--------------|------------|---------|
| | 應收賬款 | 壞賬準備 | 計提比例(%) |
| 1年以內(含1年) | 7,201,845.00 | 360,092.25 | 5.00 |
| 合計 | 7,201,845.00 | 360,092.25 | - |

7、其他應收款

(1) 明細情況

| 類別 | 2021年12月31日 | | | | |
|-----------------|---------------|--------|---------------|---------|---------------|
| | 賬面餘額 | | 壞賬準備 | | 賬面價值 |
| | 金額 | 比例(%) | 金額 | 計提比例(%) | |
| 按單項計提壞賬準備的其他應收款 | 10,713,048.00 | 30.33 | 9,106,090.80 | 85.00 | 1,606,957.20 |
| 按組合計提壞賬準備的其他應收款 | 24,613,016.83 | 69.67 | 1,268,248.92 | 5.15 | 23,344,767.91 |
| 組合：無風險組合 | 4,880,716.81 | 13.82 | - | | 4,880,716.81 |
| 保證金及押金 | 11,273,842.21 | 31.91 | 563,692.10 | 5.00 | 10,710,150.11 |
| 其他組合 | 8,458,457.81 | 23.94 | 704,556.82 | 8.33 | 7,753,900.99 |
| 合計 | 35,326,064.83 | 100.00 | 10,374,339.72 | - | 24,951,725.11 |

六、財務報表項目註釋(續)

7、其他應收款(續)

(1) 明細情況(續)

(續)

| 類別 | 2020年12月31日 | | | | |
|-----------------|---------------|--------|---------------|---------|---------------|
| | 賬面餘額 | | 壞賬準備 | | 賬面價值 |
| | 金額 | 比例(%) | 金額 | 計提比例(%) | |
| 按單項計提壞賬準備的其他應收款 | 10,713,048.00 | 23.02 | 9,106,090.80 | 85.00 | 1,606,957.20 |
| 按組合計提壞賬準備的其他應收款 | 35,819,244.89 | 76.98 | 1,366,102.09 | 3.81 | 34,453,142.80 |
| 組合：無風險組合 | 14,030,579.95 | 30.15 | - | | 14,030,579.95 |
| 保證金及押金 | 10,138,972.35 | 21.79 | 506,948.62 | 5.00 | 9,632,023.73 |
| 其他組合 | 11,649,692.59 | 25.04 | 859,153.47 | 7.37 | 10,790,539.12 |
| 合計 | 46,532,292.89 | 100.00 | 10,472,192.89 | - | 36,060,100.00 |

(2) 採用單項計提壞賬準備的應收賬款

| 單位名稱 | 2021年12月31日 | | | |
|--------------|---------------|--------------|---------|-------------------|
| | 其他應收款 | 壞賬準備 | 計提比例(%) | 計提理由 |
| 漢邦(江陰)石化有限公司 | 10,713,048.00 | 9,106,090.80 | 85.00 | 經營不善， 預計無法全額收回 |
| 合計 | 10,713,048.00 | 9,106,090.80 | - | - |

(續)

| 單位名稱 | 2020年12月31日 | | | |
|--------------|---------------|--------------|---------|-------------------|
| | 其他應收款 | 壞賬準備 | 計提比例(%) | 計提理由 |
| 漢邦(江陰)石化有限公司 | 10,713,048.00 | 9,106,090.80 | 85.00 | 經營不善， 預計無法全額收回 |
| 合計 | 10,713,048.00 | 9,106,090.80 | - | - |

註：詳見附註「十二、1、(2)」。

六、財務報表項目註釋(續)

7、其他應收款(續)

(3) 減值準備變動情況

| 項目 | 2021年1-12月 | | | 合計 |
|------|------------------|----------------------------|----------------------------|---------------|
| | 第一階段 | 第二階段 | 第三階段 | |
| | 未來12個月 預期信用損失 | 整個存續期 預期信用損失 未發生信用減值 | 整個存續期 預期信用損失 已發生信用減值 | |
| | 年初餘額 | 1,366,102.09 | | |
| 本年計提 | -97,853.17 | | | -97,853.17 |
| 年末餘額 | 1,268,248.92 | | 9,106,090.80 | 10,374,339.72 |

(4) 按類別分析

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-----------------|---------------|---------------|
| PTA現貨交易應退貨款 | 10,713,048.00 | 10,713,048.00 |
| 應收基金及資管計劃分紅及贖回款 | 1,471,741.45 | 10,462,798.73 |
| 應收證券清算款 | 3,408,975.36 | 8,631,466.93 |
| 應收場外期權保證金 | 6,849,475.86 | 5,566,455.58 |
| 押金 | 4,424,366.35 | 4,572,516.77 |
| 其他 | 8,458,457.81 | 6,586,006.88 |
| 小計 | 35,326,064.83 | 46,532,292.89 |
| 減：減值準備 | 10,374,339.72 | 10,472,192.89 |
| 合計 | 24,951,725.11 | 36,060,100.00 |

8、買入返售金融資產

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-------|--------------|--------------|
| 國債逆回購 | 6,719,000.00 | 7,853,000.00 |
| 合計 | 6,719,000.00 | 7,853,000.00 |

買入返售金融資產於2021年12月31日不存在明顯的減值跡象，故未計提減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

9、交易性金融資產

(1) 按項目列示

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------------------------|-----------------------|------------------|
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 | | |
| 債務工具投資 | 223,644,052.46 | 203,866,828.83 |
| 權益工具投資 | 616,775,582.00 | 811,010,029.53 |
| 合計 | 840,419,634.46 | 1,014,876,858.36 |

(2) 有承諾條件或存在限制的交易性金融資產情況見附註「六、56」所有權或使用權受到限制的資產。

10、存貨

(1) 存貨分類

| 項目 | 2021年12月31日 | | |
|------|-----------------|------|-----------------|
| | 賬面餘額 | 跌價準備 | 賬面價值 |
| 庫存商品 | 9,531.74 | | 9,531.74 |
| 合計 | 9,531.74 | | 9,531.74 |

(續)

| 項目 | 2020年12月31日 | | |
|------|---------------|------|---------------|
| | 賬面餘額 | 跌價準備 | 賬面價值 |
| 庫存商品 | 48,676,714.04 | | 48,676,714.04 |
| 合計 | 48,676,714.04 | | 48,676,714.04 |

(2) 報告各期末存貨未發現減值跡象，未計提存貨減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

11、長期股權投資

(1) 長期股權投資分類

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------------|---------------------|---------------|
| 按權益法核算長期股權投資 | 7,036,127.76 | 11,431,418.75 |
| 長期股權投資合計 | 7,036,127.76 | 11,431,418.75 |
| 減：長期股權投資減值準備 | | |
| 長期股權投資淨值 | 7,036,127.76 | 11,431,418.75 |

(2) 按權益法核算的長期股權投資

| 被投資單位 | 2020年 12月31日 金額 | 本年增減變動 | | | | | | | | 2021年 12月31日 金額 | 2021年 12月31日 減值準備 |
|---------------------|-----------------------|--------------|------|---------------------|--------------|--------|---------------------|------------|----|-----------------------|-------------------------|
| | | 追加投資 | 減少投資 | 權益法下 確認的 投資損益 | 其他綜合 收益調整 | 其他權益變動 | 宣告發放 現金股利 或利潤 | 計提 減值準備 | 其他 | | |
| 一、合營企業 | | | | | | | | | | | |
| 二、聯營企業 | | | | | | | | | | | |
| 江蘇弘瑞新時代創業 投資有限公司 | 5,379,849.71 | | | -592,738.57 | | | | | | 4,787,111.14 | |
| 江蘇弘瑞成長創業 投資有限公司 | 6,051,569.04 | 3,943,560.77 | | 141,014.59 | -6.24 | | | | | 2,249,016.62 | |
| 合計 | 11,431,418.75 | 3,943,560.77 | | -451,723.98 | -6.24 | | | | | 7,036,127.76 | |

六、財務報表項目註釋(續)

12、期貨會員資格投資

(1) 明細情況

| 項目 | 2021年12月31日 | | |
|----------|--------------|------|--------------|
| | 賬面餘額 | 減值準備 | 賬面價值 |
| 期貨會員資格投資 | 1,808,800.00 | | 1,808,800.00 |
| 合計 | 1,808,800.00 | | 1,808,800.00 |

(續)

| 項目 | 2020年12月31日 | | |
|----------|--------------|------|--------------|
| | 賬面餘額 | 跌價準備 | 賬面價值 |
| 期貨會員資格投資 | 1,820,820.00 | | 1,820,820.00 |
| 合計 | 1,820,820.00 | | 1,820,820.00 |

(2) 按交易所分類

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------|--------------|--------------|
| | 上海期貨交易所 | 500,000.00 |
| 大連商品交易所 | 400,000.00 | 500,000.00 |
| 鄭州商品交易所 | 500,000.00 | 400,000.00 |
| 香港期貨交易所 | 408,800.00 | 420,820.00 |
| 合計 | 1,808,800.00 | 1,820,820.00 |

(3) 報告各期末期貨會員資格投資未發現減值跡象，未計提減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

13、固定資產

(1) 固定資產明細表

| 項目 | 運輸工具 | 辦公設備 | 電子設備 | 合計 |
|--------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| 一、賬面原值 | | | | |
| 1.2020年12月31日餘額 | 4,530,441.60 | 3,263,590.26 | 45,897,192.25 | 53,691,224.11 |
| 2.本期增加金額 | | 12,028.06 | 6,164,951.85 | 6,176,979.91 |
| (1)購置 | | 12,028.06 | 6,164,951.85 | 6,176,979.91 |
| (2)在建工程轉入 | | | | |
| 3.本期減少金額 | | 2,626,073.96 | 1,695,930.91 | 4,322,004.87 |
| (1)處置或報廢 | | 2,626,073.96 | 1,695,930.91 | 4,322,004.87 |
| (2)轉入在建工程 | | | | |
| 4.外幣報表折算差異 | | -2,497.22 | -44,255.11 | -46,752.33 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 4,530,441.60 | 647,047.14 | 50,321,958.08 | 55,499,446.82 |
| 二、累計折舊 | | | | |
| 1.2020年12月31日餘額 | 3,681,326.03 | 2,648,466.99 | 31,955,093.11 | 38,284,886.13 |
| 2.本期增加金額 | 138,022.77 | 100,822.01 | 6,254,522.37 | 6,493,367.15 |
| (1)計提 | 138,022.77 | 100,822.01 | 6,254,522.37 | 6,493,367.15 |
| 3.本期減少金額 | | 2,515,656.62 | 1,627,830.75 | 4,143,487.37 |
| (1)處置或報廢 | | 2,515,656.62 | 1,627,830.75 | 4,143,487.37 |
| (2)轉入在建工程 | | | | |
| 4.外幣報表折算差異 | | -1,821.75 | -32,911.34 | -34,733.09 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 3,819,348.80 | 231,810.63 | 36,548,873.39 | 40,600,032.82 |
| 三、減值準備 | | | | |
| 四、賬面價值 | | | | |
| 1. 2021年12月31日賬面價值 | 711,092.80 | 415,236.51 | 13,773,084.69 | 14,899,414.00 |
| 2. 2020年12月31日賬面價值 | 849,115.57 | 615,123.27 | 13,942,099.14 | 15,406,337.98 |

(2) 報告各期末無未辦妥產權證書的固定資產。

(3) 報告各期末固定資產未發現減值跡象，未計提固定資產減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

14、使用權資產

(1) 使用權資產明細表

| 項目 | 房屋租賃 | 合計 |
|--------------------|---------------|---------------|
| 一、賬面原值 | | |
| 1.2020年12月31日餘額 | 55,560,609.47 | 55,560,609.47 |
| 2.本期增加金額 | 19,466,705.15 | 19,466,705.15 |
| (1)租入 | 19,466,705.15 | 19,466,705.15 |
| (2)企業合併增加 | | |
| 3.本期減少金額 | | |
| (1)處置 | | |
| 4.外幣報表折算差異 | -145,607.27 | -145,607.27 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 74,881,707.35 | 74,881,707.35 |
| 二、累計折舊 | | |
| 1. 2020年12月31日餘額 | 36,661,959.95 | 36,661,959.95 |
| 2.本期增加金額 | 13,614,762.05 | 13,614,762.05 |
| (1)計提 | 13,614,762.05 | 13,614,762.05 |
| 3.本期減少金額 | | |
| (1)處置 | | |
| 4.外幣報表折算差異 | -51,004.23 | -51,004.23 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 50,225,717.77 | 50,225,717.77 |
| 三、減值準備 | | |
| 四、賬面價值 | | |
| 1. 2021年12月31日賬面價值 | 24,655,989.58 | 24,655,989.58 |
| 2. 2020年12月31日賬面價值 | 18,898,649.52 | 18,898,649.52 |

(2) 報告各期末使用權資產未發現減值跡象，未計提使用權資產減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

15、無形資產

(1) 無形資產明細表

| 項目 | 軟件 | 客戶關係 | 合計 |
|--------------------|--------------|--------------|---------------|
| 一、賬面原值 | | | |
| 1.2020年12月31日餘額 | 7,881,641.78 | 6,100,000.00 | 13,981,641.78 |
| 2.本期增加金額 | | | |
| (1)購置 | | | |
| 3.本期減少金額 | 137,735.82 | | 137,735.82 |
| (1)處置或報廢 | 137,735.82 | | 137,735.82 |
| 4.外幣報表折算差異 | -17,429.21 | | -17,429.21 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 7,726,476.75 | 6,100,000.00 | 13,826,476.75 |
| 二、累計攤銷 | | | |
| 1. 2020年12月31日餘額 | 6,024,576.39 | 6,100,000.00 | 12,124,576.39 |
| 2.本期增加金額 | 706,482.90 | | 706,482.90 |
| (1)計提 | 706,482.90 | | 706,482.90 |
| 3.本期減少金額 | 26,781.96 | | 26,781.96 |
| (1)處置或報廢 | 26,781.96 | | 26,781.96 |
| 4.外幣報表折算差異 | -3,005.21 | | -3,005.21 |
| 5.2021年12月31日餘額 | 6,701,272.12 | 6,100,000.00 | 12,801,272.12 |
| 三、減值準備 | | | |
| 四、賬面價值 | | | |
| 1. 2021年12月31日賬面價值 | 1,025,204.63 | | 1,025,204.63 |
| 2. 2020年12月31日賬面價值 | 1,857,065.39 | | 1,857,065.39 |

(2) 報告各期末無形資產未發現減值跡象，未計提無形資產減值準備。

六、財務報表項目註釋(續)

16、遞延所得稅資產

(1) 未經抵銷的遞延所得稅資產

| 項目 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|------------------|---------------|--------------|---------------|---------------|
| | 可抵扣暫時性差異 | 遞延所得稅資產 | 可抵扣暫時性差異 | 遞延所得稅資產 |
| 應付職工薪酬 | 19,655,122.19 | 4,913,780.55 | 25,156,871.24 | 6,289,217.81 |
| 信用減值損失 | 10,326,151.10 | 2,581,537.78 | 10,347,043.88 | 2,586,760.97 |
| 預提費用 | 3,300,766.11 | 825,191.53 | 4,525,520.73 | 1,131,380.18 |
| 預計負債 | 1,969,920.97 | 492,480.24 | 4,467,575.89 | 1,116,893.97 |
| 衍生金融工具公允價值變動 | 3,305,416.91 | 826,354.23 | 2,102,385.39 | 525,596.35 |
| 交易性金融資產/負債公允價值變動 | | | 908,422.21 | 227,105.55 |
| 租賃 | 171,802.95 | 42,950.74 | 408,233.50 | 102,058.38 |
| 合計 | 38,729,180.23 | 9,682,295.07 | 47,916,052.84 | 11,979,013.21 |

(2) 未經抵銷的遞延所得稅負債

| 項目 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|------------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| | 應納稅暫時性差異 | 遞延所得稅負債 | 應納稅暫時性差異 | 遞延所得稅負債 |
| 衍生金融工具公允價值變動 | | | | |
| 交易性金融資產/負債公允價值變動 | 9,153,015.98 | 2,288,254.00 | 15,001,172.12 | 3,750,293.03 |
| 合計 | 9,153,015.98 | 2,288,254.00 | 15,001,172.12 | 3,750,293.03 |

(3) 以抵銷後淨額列示的遞延所得稅資產或負債

| 項目 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|---------|---------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|
| | 遞延所得稅資產和負債2021年12月31日互抵金額 | 抵銷後遞延所得稅資產或負債2021年12月31日餘額 | 遞延所得稅資產和負債2020年12月31日互抵金額 | 抵銷後遞延所得稅資產或負債2020年12月31日餘額 |
| 遞延所得稅資產 | -2,288,254.00 | 7,394,041.07 | -3,750,293.03 | 8,228,720.18 |
| 遞延所得稅負債 | -2,288,254.00 | | -3,750,293.03 | |

六、財務報表項目註釋(續)

16、遞延所得稅資產(續)

(4) 未確認的遞延所得稅資產明細

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------|----------------|---------------|
| 商譽減值準備 | 53,167,251.21 | 53,167,251.21 |
| 可抵扣虧損 | 58,466,875.71 | 40,995,924.94 |
| 合計 | 111,634,126.92 | 94,163,176.15 |

(5) 未確認遞延所得稅資產的可抵扣虧損將於以下年度到期

由於弘業國際金控不是很可能獲得可用於抵扣有關虧損的未來應稅利潤，因此本集團尚未就弘業國際金控累積可抵扣虧損確認遞延所得稅資產。根據現行稅法，這些可抵扣虧損自發生年度起可無限期結轉以扣減稅款。

17、其他資產

(1) 明細情況

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------------|----------------|---------------|
| 預付款項 | 281,485,696.70 | 44,093,175.32 |
| 待攤費用 | 6,995,142.68 | 8,174,721.86 |
| 待退、待抵扣及待結算稅金 | 1,960,559.20 | 7,532,600.17 |
| 海外期貨交易所押金 | 1,369,016.07 | 1,409,269.43 |
| 其他 | 3,585,849.06 | |
| 合計 | 295,396,263.71 | 61,209,766.78 |

預付款項主要為公司預付南京金融城建設發展股份有限公司的購房款，用於購買南京河西紫金金融中心房產。

六、財務報表項目註釋(續)

18、短期借款

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|-------------|--------------|
| 質押借款 | | 2,052,060.00 |
| 合計 | | 2,052,060.00 |

19、應付貨幣保證金

(1) 按客戶類別列示

| 客戶類別 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| | 戶數 | 金額 | 戶數 | 金額 |
| 自然人 | 85,991 | 3,244,516,564.70 | 82,930 | 2,599,294,685.74 |
| 法人 | 3,070 | 2,017,295,316.72 | 2,891 | 1,647,795,452.34 |
| 合計 | 89,061 | 5,261,811,881.42 | 85,821 | 4,247,090,138.08 |

(2) 按交易所列示

| 交易所 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|--------------------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| | 戶數 | 金額 | 戶數 | 金額 |
| 境內期貨交易所 | | | | |
| 其中：上海期貨交易所 | 2,062 | 520,554,746.95 | 2,110 | 443,111,322.60 |
| 大連商品交易所 | 2,590 | 507,598,638.10 | 2,694 | 387,852,642.14 |
| 中國金融期貨交易所 | 330 | 362,963,783.28 | 287 | 333,299,674.48 |
| 鄭州商品交易所 | 2,819 | 419,692,429.65 | 3,265 | 277,827,552.05 |
| 上海國際能源交易中心 | 106 | 35,442,258.80 | 73 | 31,005,172.50 |
| 中國證券登記結算 有限責任公司 | 16 | 7,519,835.67 | 20 | 2,824,859.00 |
| 小計 | 7,923 | 1,853,771,692.45 | 8,449 | 1,475,921,222.77 |
| 境外期貨經紀公司 | 2,095 | 89,679,035.34 | 2,060 | 62,112,764.04 |
| 合計 | 10,018 | 1,943,450,727.79 | 10,509 | 1,538,033,986.81 |

註：按交易所列示的客戶保證金不包括存入銀行應付客戶保證金及存放交易所的結算準備金。

六、財務報表項目註釋(續)

20、應付質押保證金

(1) 按客戶類別列示

| 客戶類別 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|------|-------------|----------------|-------------|---------------|
| | 戶數 | 金額 | 戶數 | 金額 |
| 法人 | 5 | 668,817,393.60 | 3 | 40,750,944.00 |
| 合計 | 5 | 668,817,393.60 | 3 | 40,750,944.00 |

(2) 按交易所列示

| 交易所 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------|----------------|---------------|
| 上海期貨交易所 | 428,672,112.00 | 40,750,944.00 |
| 大連商品交易所 | 160,794,960.00 | |
| 鄭州商品交易所 | 79,350,321.60 | |
| 合計 | 668,817,393.60 | 40,750,944.00 |

21、交易性金融負債

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------------------------|---------------|-------------|
| 指定以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債 | 86,471,254.16 | |
| 其中：應付款項 | 86,471,254.16 | |

對於指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債，公允價值的變動情況如下表所示：

| 項目 | 2021年12月31日 公允價值變動額 | 因自身信用風險變動 引起的公允價值 累計變動額 |
|------|------------------------|-------------------------------|
| 應付款項 | 4,224,539.06 | 無 |

截止2021年12月31日，指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債的賬面價值與按合同約定到期應支付債權人金額之間無差額。

六、財務報表項目註釋(續)

22、賣出回購金融資產款

(1) 按業務類別列示

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|---------------|---------------|
| 債券 | 32,625,838.11 | 34,197,000.00 |
| 交易現貨 | | 1,622,204.28 |
| 合計 | 32,625,838.11 | 35,819,204.28 |

(2) 擔保物信息

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|---------------|---------------|
| 債券 | 54,775,333.50 | 54,333,333.42 |
| 交易現貨 | | 1,838,027.90 |
| 合計 | 54,775,333.50 | 56,171,361.32 |

23、期貨風險準備金

(1) 明細情況

| 項目 | 2020年 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 2021年 12月31日餘額 |
|---------|-------------------|---------------|------|-------------------|
| 期貨風險準備金 | 140,221,598.23 | 10,993,812.94 | | 151,215,411.17 |
| 合計 | 140,221,598.23 | 10,993,812.94 | | 151,215,411.17 |

24、應付期貨投資者保障基金

(1) 明細情況

| 項目 | 2020年 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 2021年 12月31日餘額 |
|-------------|-------------------|------------|------------|-------------------|
| 應付期貨投資者保障基金 | 369,776.02 | 522,906.25 | 369,755.39 | 522,926.88 |
| 合計 | 369,776.02 | 522,906.25 | 369,755.39 | 522,926.88 |

註：根據2016年11月8日證監會頒佈的證監會令第129號《關於修改〈期貨投資者保障基金管理暫行辦法〉的決定》，自2016年12月8日起，本公司繳納比率為代理交易額的千萬分之六變更為億分之六。

六、財務報表項目註釋(續)

25、應付職工薪酬

(1) 應付職工薪酬分類

| 項目 | 2020年 | | | 2021年 |
|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------------|
| | 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 12月31日餘額 |
| 一、短期薪酬 | 26,279,433.60 | 148,751,777.47 | 154,372,195.13 | 20,659,015.94 |
| 二、離職後福利—設定提存計劃 | | 19,121,242.60 | 19,121,242.60 | |
| 三、辭退福利 | | | | |
| 合計 | 26,279,433.60 | 167,873,020.07 | 173,493,437.73 | 20,659,015.94 |

(2) 短期薪酬

| 項目 | 2020年 | | | 2021年 |
|-------------|---------------|----------------|----------------|----------------------|
| | 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 12月31日餘額 |
| 工資、獎金、津貼和補貼 | 25,782,825.92 | 124,818,332.81 | 130,479,381.05 | 20,121,777.68 |
| 職工福利費 | | 2,226,588.57 | 2,226,588.57 | |
| 社會保險費 | | 10,782,691.20 | 10,782,691.20 | |
| 其中：醫療保險費 | | 10,054,172.88 | 10,054,172.88 | |
| 工傷保險費 | | 161,827.24 | 161,827.24 | |
| 生育保險費 | | 566,691.08 | 566,691.08 | |
| 住房公積金 | | 8,335,028.98 | 8,335,028.98 | |
| 工會經費和職工教育經費 | 496,607.68 | 2,589,135.91 | 2,548,505.33 | 537,238.26 |
| 合計 | 26,279,433.60 | 148,751,777.47 | 154,372,195.13 | 20,659,015.94 |

(3) 設定提存計劃

| 項目 | 2020年 | | | 2021年 |
|--------|----------|---------------|---------------|----------|
| | 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 12月31日餘額 |
| 基本養老保險 | | 12,900,139.56 | 12,900,139.56 | |
| 失業保險費 | | 403,971.67 | 403,971.67 | |
| 企業年金繳費 | | 5,817,131.37 | 5,817,131.37 | |
| 合計 | | 19,121,242.60 | 19,121,242.60 | |

六、財務報表項目註釋(續)

26、應交稅費

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-----------|--------------|---------------|
| 企業所得稅 | 4,087,590.83 | 20,942,367.18 |
| 增值稅 | 1,771,663.92 | 7,465,193.64 |
| 稅金及附加 | 148,589.64 | 231,960.64 |
| 代扣代繳個人所得稅 | 8,034.85 | 18,929.98 |
| 合計 | 6,015,879.24 | 28,658,451.44 |

27、應付款項

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|-------------|--------------|
| 採購現貨 | | 7,373,441.99 |
| 合計 | | 7,373,441.99 |

28、合同負債

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|--------------|--------------|
| 預收貨款 | 1,000,000.00 | 1,859,630.01 |
| 合計 | 1,000,000.00 | 1,859,630.01 |

29、其他應付款

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-------------|---------------|----------------|
| 待結算資產管理計劃款項 | 1,085,141.20 | 68,226,995.45 |
| 應付標準倉單質押款 | | 37,271,225.33 |
| 應付保證金 | 2,034,551.68 | 13,900,529.62 |
| 聯營企業預分紅款 | | 3,791,000.00 |
| 應付佣金 | 1,452,492.29 | 1,565,749.01 |
| 應付審計費 | 1,641,219.20 | 1,500,000.00 |
| 應付代銷基金款 | 600,109.87 | 50,000.00 |
| 應付風險抵押款 | 4,247,710.09 | 3,513,161.44 |
| 其他 | 15,220,196.35 | 10,790,874.68 |
| 合計 | 26,281,420.68 | 140,609,535.53 |

六、財務報表項目註釋(續)

30、預計負債

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------|---------------------|--------------|
| 預計訴訟損失 | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |
| 合計 | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |

註： 詳見附註「十二、1、(1)」。

31、長期借款

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|-----------------------|-------------|
| 抵押借款 | 117,197,967.93 | |
| 合計 | 117,197,967.93 | |

註： 長期借款用於向南京金融城建設發展股份有限公司支付購房款以購買南京河西紫金金融中心房產並進行預告登記，長期借款的抵押物為預告登記的房產。

32、租賃負債

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|----------|----------------------|---------------|
| 1年內 | 11,051,398.16 | 11,717,703.90 |
| 1-2年 | 7,408,033.43 | 6,495,388.72 |
| 2-5年 | 6,371,672.21 | 1,134,674.87 |
| 租賃負債賬面價值 | 24,831,103.80 | 19,347,767.49 |

六、財務報表項目註釋(續)

33、股本

| 股東名稱 | 2020年 12月31日餘額 | 本期變動增減(+、-) | | | | | 小計 | 2021年 12月31日餘額 |
|----------------|-------------------|-------------|------|-------|------|------|-----------------------|-------------------|
| | | 發行新股 | 送股 | 公積金轉股 | 其他 | | | |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | 275,456,777.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 275,456,777.00 | |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 147,900,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 147,900,000.00 | |
| 江蘇弘蘇實業有限公司 | 143,548,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 143,548,000.00 | |
| 江蘇匯鴻國際集團股份有限公司 | 63,930,134.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 63,930,134.00 | |
| 上海銘大實業(集團)有限公司 | 9,276,631.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 9,276,631.00 | |
| 江蘇弘瑞科技創業投資有限公司 | 8,903,113.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 8,903,113.00 | |
| 江蘇弘業國際物流有限公司 | 8,285,345.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 8,285,345.00 | |
| 港股流通股 | 249,700,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 249,700,000.00 | |
| 合計 | 907,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 907,000,000.00 | |

34、資本公積

| 項目 | 2020年 12月31日餘額 | 本期增加 | 本期減少 | 2021年 12月31日餘額 |
|-------|-------------------|--------------|------|-----------------------|
| | | | | |
| 其他(注) | | 4,701,890.00 | | 4,701,890.00 |
| 合計 | 533,124,529.52 | 4,701,890.00 | 0.00 | 537,826,419.52 |

註： 本期新增系本公司控股股東江蘇省蘇豪控股集團有限公司補償本公司訴訟損失，詳見附註「十一、(二)、6」。

財務報表附註

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

六、財務報表項目註釋(續)

35、其他綜合收益

| 項目 | 2020年 12月31日餘額 | 其他變動 | 2021年 1月1日餘額 | 2021年1-12月 | | | | | | 2021年 12月31日餘額 |
|------------------------|-------------------|---------------|-----------------|-------------------|------------------------------------|----------------------------------|-------------|---------------|---------------|-------------------|
| | | | | 本年 所得稅前 發生額 | 減：前期計入 其他綜合收益 當期轉入 當期轉入損益 | 減：前期計入 其他綜合收益 當期轉入 留存收益 | 減： 所得稅費用 | 稅後歸屬 於母公司 | 稅後歸屬於 少數股東 | |
| 一、不能重分類進損益 的其他綜合收益 | | | | | | | | | | |
| 二、將重分類進損益的 其他綜合收益 | | | | | | | | | | |
| 其中：權益法下可轉損益 的其他綜合收益 | -371,801.28 | 371,877.91 | 76.63 | -6.24 | | | | -6.24 | | 70.39 |
| 外幣財務報表折算差額 | -3,321,162.79 | -3,321,162.79 | -4,064,076.05 | | | | | -4,064,076.05 | | -7,385,238.84 |
| 其他 | | | | | | | | | | |
| 其他綜合收益合計 | -3,692,964.07 | 371,877.91 | -3,321,086.16 | -4,064,082.29 | | | | -4,064,082.29 | | -7,385,168.45 |

註：本集團聯營企業江蘇弘瑞新時代創業投資有限公司於2021年1月1日執行新金融工具準則導致其他綜合收益變動。

六、財務報表項目註釋(續)

36、盈餘公積

| 項目 | 2020年 | 本期增加 | 本期減少 | 2021年 |
|--------|---------------|---------------------|-------------|----------------------|
| | 12月31日餘額 | | | 12月31日餘額 |
| 法定盈餘公積 | 58,426,314.46 | 8,179,880.16 | 0.00 | 66,606,194.62 |
| 合計 | 58,426,314.46 | 8,179,880.16 | 0.00 | 66,606,194.62 |

37、一般風險準備

| 項目 | 2020年 | 本期增加 | 本期減少 | 2021年 |
|--------|---------------|---------------------|-------------|----------------------|
| | 12月31日餘額 | | | 12月31日餘額 |
| 一般風險準備 | 84,305,891.83 | 8,179,880.16 | 0.00 | 92,485,771.99 |
| 合計 | 84,305,891.83 | 8,179,880.16 | 0.00 | 92,485,771.99 |

38、未分配利潤

| 項目 | 2021年12月31日 |
|-------------------|----------------------|
| 上期期末餘額 | 67,503,955.76 |
| 加：其他(注) | -371,877.91 |
| 本期期初餘額 | 67,132,077.85 |
| 加：本期歸屬於母公司所有者的淨利潤 | 80,211,471.47 |
| 減：提取法定盈餘公積 | 8,179,880.16 |
| 提取一般風險準備 | 8,179,880.16 |
| 應付普通股股利 | 45,350,000.00 |
| 本期期末餘額 | 85,633,789.00 |

註： 詳見本附註「六、35」。

六、財務報表項目註釋(續)

39、手續費及佣金淨收入

(1) 手續費及佣金淨收入情況

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|--------------|-----------------------|----------------|
| 經紀手續費淨收入 | 31,677,823.64 | 39,994,727.86 |
| 交易所減收手續費收入 | 242,935,384.10 | 176,047,985.70 |
| 經紀業務手續費淨收入小計 | 274,613,207.74 | 216,042,713.56 |
| 資產管理業務收入 | 11,216,236.43 | 13,415,518.10 |
| 合計 | 285,829,444.17 | 229,458,231.66 |

(2) 分行政區域營業部及手續費及佣金淨收入情況

| 行政區域名稱 | 2021年度 | | 2020年度 | |
|--------|-----------|-----------------------|--------|----------------|
| | 營業部家數 | 手續費及 佣金淨收入 | 營業部家數 | 手續費及 佣金淨收入 |
| 江蘇省 | 22 | 228,254,395.16 | 22 | 174,384,644.69 |
| 福建省 | 2 | 8,142,191.25 | 2 | 10,228,973.73 |
| 上海市 | 2 | 5,969,734.05 | 2 | 7,551,840.14 |
| 浙江省 | 2 | 7,355,252.53 | 2 | 6,959,628.21 |
| 河南省 | 1 | 4,326,767.65 | 1 | 5,417,131.25 |
| 廣東省 | 3 | 3,219,301.20 | 3 | 2,772,203.59 |
| 北京市 | 2 | 2,287,775.74 | 2 | 2,754,255.85 |
| 中國香港 | 1 | 1,940,420.31 | 1 | 2,441,834.79 |
| 山東省 | 2 | 5,538,829.87 | 2 | 2,422,804.46 |
| 陝西省 | 1 | 4,001,717.60 | 1 | 2,390,309.22 |
| 安徽省 | 2 | 2,968,667.91 | 2 | 2,261,947.07 |
| 遼寧省 | 2 | 2,767,997.90 | 2 | 1,961,438.74 |
| 廣西省 | 1 | 2,267,712.72 | 1 | 1,866,009.54 |
| 湖南省 | 1 | 2,482,675.78 | 1 | 1,851,347.59 |
| 重慶市 | 1 | 1,649,449.92 | 1 | 1,249,918.52 |
| 四川省 | 1 | 691,652.07 | 1 | 1,165,762.23 |
| 山西省 | 1 | 1,272,397.79 | 1 | 976,117.84 |
| 海南省 | 1 | 692,504.72 | 1 | 802,064.20 |
| 合計 | 48 | 285,829,444.17 | 48 | 229,458,231.66 |

六、財務報表項目註釋(續)

40、利息淨收入

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------------|----------------------|---------------|
| 利息收入 | | |
| 其中：客戶資金存款利息收入 | 74,536,722.34 | 58,512,840.45 |
| 自有資金存款利息收入 | 10,260,687.14 | 14,771,813.54 |
| 買入返售利息收入 | 186,592.73 | 485,509.01 |
| 利息收入合計 | 84,984,002.21 | 73,770,163.00 |
| 利息支出 | | |
| 其中：賣出回購利息支出 | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 利息支出合計 | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 利息淨收入 | 84,118,225.19 | 72,644,679.32 |

41、投資收益

(1) 投資收益明細情況

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------------|-----------------------|----------------|
| 成本法核算的長期股權投資收益 | | |
| 權益法核算的長期股權投資收益 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 其中：聯營企業投資收益 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 合營企業投資收益 | | |
| 處置長期股權投資產生的投資收益 | | |
| 金融工具投資收益 | 25,428,485.54 | 39,236,675.22 |
| 其中：金融工具持有期間取得的收益 | 31,055,469.27 | 20,308,573.76 |
| — 交易性金融工具 | 31,055,469.27 | 20,308,573.76 |
| 處置收益 | -5,626,983.73 | 18,928,101.46 |
| — 衍生金融工具 | -34,564,921.92 | -53,389,309.84 |
| — 交易性金融工具 | 28,937,938.19 | 72,317,411.30 |
| 其他 | | |
| 合計 | 24,976,761.56 | 37,893,784.42 |

六、財務報表項目註釋(續)

41、投資收益(續)

(2) 對聯營企業的投資收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|-----------------|-------------|---------------|
| 江蘇弘瑞新時代創業投資有限公司 | -592,738.57 | -1,701,152.21 |
| 江蘇弘瑞成長創業投資有限公司 | 141,014.59 | 358,261.41 |
| 合計 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |

(3) 本公司不存在投資收益匯回的重大限制。

42、其他收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------|--------------|------------|
| 政府補助 | 3,197,691.90 | 441,073.63 |
| 個稅返還 | 57,046.61 | |
| 合計 | 3,254,738.51 | 441,073.63 |

(1) 2021年政府補助明細

| 補助項目 | 與資產相關/ 金額 收益相關 | | 下文機關 | 批准文件 |
|----------|-------------------|-------|---------------------------|-----------------------------------|
| | 金額 | 收益相關 | | |
| 穩崗補貼 | 13,140.28 | 與收益相關 | 江蘇省人民政府 | 省政府關於落實就業優先政策進一步做好穩就業工作的實施意見 |
| 穩崗補貼 | 2,953.31 | 與收益相關 | 廣東省人民政府 | 廣東省人民政府關於印發廣東省進一步穩定和促進就業若干政策措施的通知 |
| 期貨市場建設獎勵 | 100,000.00 | 與收益相關 | 大連市金融發展局 | 關於兌現期貨市場建設獎勵的通知 |
| 以工代訓 | 3,000.00 | 與收益相關 | 連雲港市人力資源和社會保障局 連雲港市財政局 | 市人力資源社會保障局市財政局關於實施企業穩崗擴崗專項支持計劃的通知 |
| 穩崗補貼 | 664.68 | 與收益相關 | 安徽省人力資源和社會保障廳 安徽省財政廳 | 關於使用省級就業風險儲備金支持中小微企業穩定就業崗位的通知 |
| 穩崗補貼 | 2,256.76 | 與收益相關 | 合肥市人力資源和社會保障局 合肥市財政局 | 合肥市「迎新春、送溫暖、穩崗留工」行動計劃 |

六、財務報表項目註釋(續)

42、其他收益(續)

(1) 2021年政府補助明細(續)

| 補助項目 | 與資產相關/ 金額 收益相關 | | 下文機關 | 批准文件 |
|--------|-------------------|-------|---|---|
| | 金額 | 收益相關 | | |
| 金融創新獎 | 377,358.49 | 與收益相關 | 南京市地方金融監督管理局 南京市財政局 | 關於對2020年度南京市優秀金融創新項目 予以表揚的通報 |
| 稅收返還 | 2,622,446.18 | 與收益相關 | 財政部/稅務總局 | 財政部國家稅務總局關於廣東橫琴新區福 建平潭綜合實驗區深圳前海深港現代服 務業合作區企業所得稅優惠政策及優惠 目錄的通知 |
| 穩崗補貼 | 36,168.43 | 與收益相關 | 江蘇省人力資源和社會保障廳 江蘇省發展和改革委員會江 蘇省教育廳江蘇省財政廳中 國人民解放軍江蘇省軍區動 員局 | 省人力資源社會保障廳省發展改革省委省教 育廳省財政廳省軍區動員局關於延續實 施部分減負穩崗擴就業政策措施的通知 |
| 穩崗補貼 | 2,373.36 | 與收益相關 | 廣西壯族自治區人力資源和社 會保障廳廣西壯族自治區財 政廳 | 廣西壯族自治區人力資源和社會保障廳廣 西壯族自治區財政廳關於做好2021年失 業保險減負穩崗擴就業工作有關問題的 通知 |
| 穩崗補貼 | 2,453.00 | 與收益相關 | 瀋陽市人力資源和社會保障局 瀋陽市財政局 | 瀋陽市人力資源和社會保障局瀋陽市財政 局關於提高我市失業保險穩崗補貼返還 比例的通知 |
| 失業保險補貼 | 6,377.00 | 與收益相關 | 寧波市人力資源和社會保障局 寧波市財政局人民銀行寧波 市中心支行 | 市人力資源和社會保障局市財政局人民銀 行市中心支行關於印發《關於進一步做好 穩就業工作實施細則》的通知 |

六、財務報表項目註釋(續)

42、其他收益(續)

(1) 2021年政府補助明細(續)

| 補助項目 | 與資產相關/ 金額 收益相關 | | 下文機關 | 批准文件 |
|------|-------------------|-------|--|---|
| | 金額 | 收益相關 | | |
| 穩崗補貼 | 2,439.48 | 與收益相關 | 安徽省人力資源和社會保障廳 安徽省財政廳安徽省發展和 改革委員會安徽省教育廳中 國人民解放軍安徽省軍區動 員局 | 關於貫徹落實人力資源社會保障部等部門 延續實施部分減負穩崗擴就業政策措施 的通知 |
| 穩崗補貼 | 8,901.90 | 與收益相關 | 揚州市人力資源和社會保障局 | 揚州市人力資源和社會保障局關於應對疫 情影響做好企業用工保障工作的通知 |
| 穩崗補貼 | 3,184.25 | 與收益相關 | 人力資源社會保障部國家發展 改革委教育部財政部中央軍 委國防動員部 | 人力資源社會保障部國家發展改革委教育 部財政部中央軍委國防動員部關於延續 實施部分減負穩崗擴就業政策措施的通 知 |
| 穩崗補貼 | 53.68 | 與收益相關 | 深圳市人力資源和社會保障局 | 深圳市人力資源和社會保障局關於延續實 施穩崗擴圍政策的通知 |
| 穩崗補貼 | 5,334.55 | 與收益相關 | 浙江省人力資源和社會保障廳 浙江省發展和改革委員會浙 江省教育廳浙江省財政廳國 家稅務總局浙江省稅務局浙 江省人民政府徵兵辦公室 | 浙江省人力資源和社會保障廳等6部門關於 延續實施部分減負穩崗擴就業政策措施 的通知 |

六、財務報表項目註釋(續)

42、其他收益(續)

(1) 2021年政府補助明細(續)

| 補助項目 | 與資產相關/ 金額 收益相關 | | 下文機關 | 批准文件 |
|--------|-------------------|-------|---|---|
| | 金額 | 收益相關 | | |
| 穩崗補貼 | 955.10 | 與收益相關 | 連雲港市人力資源和社會保障 局連雲港市發展和改革委員 會連雲港市教育局連雲港市 財政局連雲港市人民政府徵 兵辦公室 | 關於延續實施部分減負穩崗擴就業政策措 施的通知 |
| 穩崗補貼 | 1,169.00 | 與收益相關 | 山西省人力資源和社會保障廳 山西省發展和改革委員會山 西省教育廳山西省財政廳山 西省軍區動員局 | 關於延續實施部分減負穩崗擴就業政策措 施的通知 |
| 穩崗補貼 | 1,562.45 | 與收益相關 | 淮安市人力資源和社會保障局 淮安市財政局 | 關於實施企業穩崗擴崗專項支持計劃的通 知 |
| 以工代訓補貼 | 4,900.00 | 與收益相關 | 瀋陽市人力資源和社會保障局 瀋陽市財政局 | 瀋陽市人力資源和社會保障局瀋陽市財政 局關於進一步做好「以工代訓」的通知 |
| 合計 | 3,197,691.90 | | | |

43、公允價值變動收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------------------------------|-----------------------|----------------|
| 交易性金融資產 | -12,627,523.44 | 21,494,125.35 |
| 其中：指定以公允價值計量且其變動計入 當期損益的金融資產 | -12,627,523.44 | 21,494,125.35 |
| 交易性金融負債 | -4,224,539.06 | 1,024,271.00 |
| 其中：指定以公允價值計量且其變動計入 當期損益的金融負債 | -4,224,539.06 | 1,024,271.00 |
| 衍生金融資產 | 17,132,338.27 | 8,608,984.42 |
| 衍生金融負債 | -18,288,957.63 | -10,930,084.81 |
| 合計 | -18,008,681.86 | 20,197,295.96 |

六、財務報表項目註釋(續)

44、匯兌收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------|---------------|---------------|
| 匯兌收益 | -1,458,080.09 | -5,183,313.77 |
| 合計 | -1,458,080.09 | -5,183,313.77 |

45、其他業務收入

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------|------------------|------------------|
| 現貨銷售收入 | 1,259,236,643.42 | 1,198,714,914.97 |
| 諮詢費收入及其他 | 2,079,492.89 | 7,354,989.46 |
| 合計 | 1,261,316,136.31 | 1,206,069,904.43 |

46、資產處置收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------|-------------|-------------|
| 處置固定資產處置收益 | -163,754.65 | -142,060.27 |
| 合計 | -163,754.65 | -142,060.27 |

47、提取期貨風險準備金

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|-----------|---------------|--------------|
| 提取期貨風險準備金 | 10,993,812.94 | 9,163,823.19 |
| 合計 | 10,993,812.94 | 9,163,823.19 |

48、稅金及附加

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------|--------------|--------------|
| 城市維護建設稅 | 1,222,988.07 | 912,569.52 |
| 教育費附加 | 523,689.81 | 389,494.01 |
| 地方教育費附加 | 349,126.64 | 259,662.72 |
| 其他 | 875,509.80 | 658,887.70 |
| 合計 | 2,971,314.32 | 2,220,613.95 |

六、財務報表項目註釋(續)

49、業務及管理費用

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------|----------------|----------------|
| 職工薪酬 | 167,041,955.13 | 154,491,445.69 |
| 辦公費 | 37,710,646.16 | 37,239,373.37 |
| 折舊及攤銷 | 20,814,612.10 | 28,073,970.29 |
| 租金 | 10,761,540.27 | 4,110,197.69 |
| 保險費 | 1,235,676.27 | 13,911,174.21 |
| 諮詢費 | 5,155,452.04 | 13,785,765.45 |
| 修理費 | 635,653.20 | 3,324,455.16 |
| 維護費 | 2,874,383.51 | 2,651,594.24 |
| 財務費用 | 8,363,233.47 | 2,496,315.08 |
| 佣金支出 | 425,474.42 | 1,398,791.81 |
| 投資者保障基金 | 493,308.90 | 355,421.54 |
| 研發費用 | 851,347.96 | |
| 水電費 | 1,669,058.53 | 1,053,601.64 |
| 其他 | 8,992,280.41 | 5,706,999.38 |
| 合計 | 267,024,622.37 | 268,599,105.55 |

50、信用減值損失

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|-------------|-------------|---------------|
| 應收貨幣保證金減值損失 | 715,601.00 | 2,825,554.10 |
| 應收賬款壞賬損失 | -360,092.25 | 360,092.25 |
| 其他應收款壞賬損失 | -90,411.37 | 10,499,682.44 |
| 合計 | 265,097.38 | 13,685,328.79 |

51、其他業務成本

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|--------|------------------|------------------|
| 現貨銷售成本 | 1,248,695,930.85 | 1,171,435,651.77 |
| 合計 | 1,248,695,930.85 | 1,171,435,651.77 |

六、財務報表項目註釋(續)

52、營業外收入

(1) 營業外收入明細

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|-------|--------------|--------------|
| 政府補助 | 58,100.00 | 758,767.82 |
| 交易所贊助 | 1,565,262.96 | 1,430,379.64 |
| 其他 | 141,758.73 | 132,536.69 |
| 合計 | 1,765,121.69 | 2,321,684.15 |

(續)

| 項目 | 其中：計入當期非經常性損益的金額 | |
|-------|------------------|--------------|
| | 2021年度 | 2020年度 |
| 政府補助 | 58,100.00 | 758,767.82 |
| 交易所贊助 | 1,565,262.96 | 1,430,379.64 |
| 其他 | 141,758.73 | 132,536.69 |
| 合計 | 1,765,121.69 | 2,321,684.15 |

(2) 2021年度政府補助明細

| 補助項目 | 與資產相關/ 與收益相關 | | 下文機關 | 批准文件 |
|-----------------------|-----------------|-------|-----------|-----------------|
| | 金額 | | | |
| 香港特別行政區政府 防疫抗疫基金補助 | 58,100.00 | 與收益相關 | 香港特別行政區政府 | 香港特別行政區政府防疫抗疫基金 |
| 合計 | 58,100.00 | | | |

六、財務報表項目註釋(續)

53、營業外支出

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------|--------------|--------------|
| 捐贈和贊助支出 | 50,000.00 | 1,000,000.00 |
| 預計負債 | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |
| 訴訟賠償款 | 234,314.11 | |
| 其他 | 212,714.39 | 425,733.82 |
| 合計 | 2,466,949.47 | 5,893,309.71 |

(續)

| 項目 | 其中：計入當期非經常性損益的金額 | |
|---------|------------------|--------------|
| | 2021年度 | 2020年度 |
| 捐贈和贊助支出 | 50,000.00 | 1,000,000.00 |
| 預計負債 | 1,969,920.97 | 4,467,575.89 |
| 訴訟賠償款 | 234,314.11 | |
| 其他 | 212,714.39 | 425,733.82 |
| 合計 | 2,466,949.47 | 5,893,309.71 |

54、所得稅費用

(1) 所得稅費用組成

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------|---------------|---------------|
| 當期所得稅費用 | 28,166,032.89 | 34,248,081.32 |
| 遞延所得稅費用 | 834,679.14 | -7,867,090.01 |
| 合計 | 29,000,712.03 | 26,380,991.31 |

六、財務報表項目註釋(續)

54、所得稅費用(續)

(2) 會計利潤與所得稅費用調整過程

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------------------------------|-----------------------|---------------|
| 本期合併利潤總額 | 109,212,183.50 | 92,703,446.57 |
| 按法定/適用稅率計算的所得稅費用 | 27,303,045.88 | 23,175,861.64 |
| 子公司適用不同稅率的影響 | 1,481,980.55 | -160,444.07 |
| 研發費用加計扣除的影響 | -159,627.74 | |
| 非應稅收入的影響 | -3,313,638.62 | -1,148,974.07 |
| 不可抵扣的成本、費用和損失的影響 | 812,444.66 | 4,785,543.12 |
| 使用前期未確認遞延所得稅資產的可抵扣虧損的影響 | | -270,995.31 |
| 本期未確認遞延所得稅資產的可抵扣暫時性差異 或可抵扣虧損的影響 | 2,876,507.30 | |
| 所得稅費用 | 29,000,712.03 | 26,380,991.31 |

55、現金流量表補充資料

(1) 收到/支付的其他與經營/投資/籌資活動有關的現金

1) 收到的其他與經營活動有關的現金

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------|-----------------------|----------------|
| 收到證券清算款或贖回款 | 5,222,491.57 | |
| 待結算資產管理計劃款項 | | 68,226,995.45 |
| 收到標準倉單質押款 | | 37,271,225.33 |
| 收到的保證金及佣金 | | 15,466,278.63 |
| 收到結構化主體其他持有人資金 | 82,246,715.10 | |
| 營業外收入及其他收益 | 5,019,860.20 | 2,762,757.78 |
| 其他 | 12,773,321.35 | 3,976,575.95 |
| 合計 | 105,262,388.22 | 127,703,833.14 |

六、財務報表項目註釋(續)

55、現金流量表補充資料(續)

(1) 收到/支付的其他與經營/投資/籌資活動有關的現金(續)

2) 支付的其他與經營活動有關的現金

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------|-----------------------|---------------|
| 支付結構化主體其他持有人資金 | | 59,998,245.76 |
| PTA業務支付的預付貨款 | | 10,713,048.00 |
| 支付待結算款項 | 57,600,687.10 | |
| 支付標準倉單質押款 | 37,271,225.33 | |
| 支付的保證金及佣金 | 16,753,570.18 | |
| 支付證券清算款或贖回款 | | 8,631,466.93 |
| 捐贈和贊助支出 | 50,000.00 | 1,000,000.00 |
| 訴訟賠償款 | 4,467,575.89 | |
| 其他 | 7,612,455.40 | 9,912,050.77 |
| 合計 | 123,755,513.90 | 90,254,811.46 |

3) 收到的其他與籌資活動有關的現金

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|--------|---------------------|--------|
| 訴訟損失補償 | 4,701,890.00 | |
| 合計 | 4,701,890.00 | |

4) 支付的其他與籌資活動有關的現金

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|--------|---------------------|--------|
| 融資相關費用 | 3,535,000.00 | |
| 合計 | 3,535,000.00 | |

六、財務報表項目註釋(續)

55、現金流量表補充資料(續)

(2) 合併現金流量表補充資料

| 項目 | 2021年度 |
|---------------------------------|-------------------------|
| 1. 將淨利潤調節為經營活動現金流量： | |
| 淨利潤 | 80,211,471.47 |
| 加：資產減值準備 | - |
| 信用減值損失 | 265,097.38 |
| 固定資產折舊、油氣資產折耗、生產性生物資產折舊 | 6,493,367.15 |
| 使用權資產折舊 | 13,614,762.05 |
| 無形資產攤銷 | 706,482.90 |
| 長期待攤費用攤銷 | - |
| 處置固定資產、無形資產和其他長期資產的損失(收益以「-」填列) | 163,754.65 |
| 固定資產報廢損失(收益以「-」填列) | - |
| 公允價值變動損失(收益以「-」填列) | 16,852,062.50 |
| 財務費用(收益以「-」填列) | 7,399,920.29 |
| 匯兌損失 | 1,458,080.09 |
| 投資損失(收益以「-」填列) | -55,248,950.22 |
| 遞延所得稅資產的減少(增加以「-」填列) | 834,679.11 |
| 遞延所得稅負債的增加(減少以「-」填列) | - |
| 存貨的減少(增加以「-」填列) | 48,667,182.30 |
| 經營性應收項目的減少(增加以「-」填列) | -504,711,405.70 |
| 經營性應付項目的增加(減少以「-」填列) | 1,607,227,484.80 |
| 利息淨收入 | 679,184.29 |
| 期貨風險準備金的計提 | 10,993,812.94 |
| 其他 | - |
| 經營活動產生的現金流量淨額 | 1,235,606,986.00 |
| 2. 不涉及現金收支的重大投資和籌資活動： | |
| 債務轉為資本 | |
| 一年內到期的可轉換公司債券 | |
| 融資租入固定資產 | |
| 3. 現金及現金等價物淨變動情況： | |
| 現金的期末餘額 | 4,106,185,249.67 |
| 減：現金的期初餘額 | 2,854,855,864.32 |
| 加：現金等價物的期末餘額 | |
| 減：現金等價物的期初餘額 | |
| 現金及現金等價物淨增加額 | 1,251,329,385.35 |

六、財務報表項目註釋(續)

55、現金流量表補充資料(續)

(3) 現金和現金等價物

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|----------------|------------------|------------------|
| 現金 | | |
| 其中：庫存現金 | | |
| 可隨時用於支付的銀行存款 | 4,068,300,218.52 | 2,840,983,584.02 |
| 可隨時用於支付的其他貨幣資金 | 37,885,031.15 | 13,872,280.30 |
| 現金等價物 | | |
| 期末現金和現金等價物餘額 | 4,106,185,249.67 | 2,854,855,864.32 |

56、所有權或使用權受到限制的資產

| 項目 | 2021年12月31日 賬面價值 | 受限原因 |
|---------|---------------------|----------|
| 貨幣資金 | 787,041.31 | 產品募集資金賬戶 |
| 貨幣資金 | 4,285,443.46 | 場外期權保證金 |
| 交易性金融資產 | 54,775,333.50 | 賣出回購交易質押 |

57、外幣貨幣性項目

(1) 外幣貨幣性項目

| 項目 | 2021年12月31日 外幣餘額 | 折算匯率 | 2021年12月31日 折算人民幣餘額 |
|---------|---------------------|----------|------------------------|
| 貨幣資金 | | | |
| 其中：美元 | 3,931,333.12 | 6.3757 | 25,065,000.57 |
| 港幣 | 87,154,013.92 | 0.8176 | 71,257,121.78 |
| 日元 | 187,664.00 | 0.055415 | 10,399.40 |
| 應收貨幣保證金 | | | |
| 其中：美元 | | | |
| 港幣 | 76,748,168.73 | 0.8176 | 62,749,302.75 |

(2) 重要的境外經營實體

| 單位名稱 | 主要經營地 | 記賬本位幣 | 記賬本位幣選擇依據 |
|--------------|-------|-------|------------|
| 弘業國際金融控股有限公司 | 香港 | 港幣 | 記賬本位幣為當地貨幣 |

七、合併報表範圍的變動

(一) 非同一控制下企業合併

本集團2021年度無通過非同一控制下企業合併取得的子公司。

(二) 同一控制下企業合併

本集團2021年度無通過同一控制下企業合併取得的子公司。

(三) 反向收購

本集團2021年度無通過反向收購取得的子公司。

(四) 處置子公司

本集團2021年度無處置子公司。

(五) 其他原因的合併範圍變動

1、 新設子公司

2021年度無新設子公司且納入合併範圍的主體。

2、 註銷或其他方式減少子公司

2021年度無註銷或其他方式減少子公司。

3、 結構化主體

2021年度本集團新納入合併範圍的結構化主體共9個，分別為「弘業科創量化優選1號資產管理計劃」、「弘業瑞鑫1號集合資產管理計劃」、「弘業價值成長CTA1號集合資產管理計劃」、「弘業景信一期FOF集合資產管理計劃」、「弘業私享三號FOF集合資產管理計劃」、「弘業宏錫量化CTA2號集合資產管理計劃」、「弘業穩健成長CTA2集合資管計劃」和子公司作為管理人的「弘業國際固定收益基金」、「弘業廣業基金SP」合併上述結構化主體對本集團2021年度的財務狀況、經營成果和現金流量影響並不重大。

八、在其他主體中的權益

(一) 在子公司中的權益

1、企業集團的構成

(1) 子公司

| 子公司名稱 | 主要 經營地 | 註冊地 | 業務性質 | 持股比例 | | 取得方式 |
|--------------|-----------|-----|-----------------|------|------|-----------|
| | | | | 直接 | 間接 | |
| 弘業資本管理有限公司 | 南京 | 深圳 | 大宗商品交易 及風險管理 | 100% | 100% | 設立 |
| 弘業國際金融控股有限公司 | 香港 | 香港 | 期貨經紀 | 100% | 100% | 同一控制下企業合併 |
| 弘業國際資產管理有限公司 | 香港 | 香港 | 資產管理 | 100% | 100% | 設立 |
| 弘業國際基金系列SPC | 香港 | 開曼 | 基金投資 | 100% | 100% | 設立 |
| 弘業國際固定收益基金 | 香港 | 開曼 | 基金投資 | 100% | 100% | 設立 |

(2) 結構化主體

按照《企業會計準則第33號—合併財務報表》的規定，本集團將管理人為本集團或者本集團作為主要責任人、且本集團以自有資金參與、並滿足新修訂準則規定「控制」定義的結構化主體納入合併報表範圍。

2021年12月31日，合併資產管理計劃及基金的淨資產規模為172,600,027.13人民幣元，同時，本集團在合併資產管理計劃及基金中所持有權益的賬面價值為86,128,772.98人民幣元，該權益在財務報告中計入交易性金融資產、貨幣資金、其他應收款以及其他應付款。

八、在其他主體中的權益(續)

(一) 在子公司中的權益(續)

(2) 結構化主體(續)

| 結構化主體名稱 | 類型 | 本集團期末實際出資額 |
|---------------------|--------|-----------------|
| 弘業科創量化優選1號資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣510.72萬元 |
| 弘業瑞鑫1號集合資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣500.00萬元 |
| 弘業價值成長CTA1號集合資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣500.00萬元 |
| 弘業景信一期FOF集合資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣500.00萬元 |
| 弘業私享三號FOF集合資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣400.00萬元 |
| 弘業宏錫量化CTA2號集合資產管理計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣200.00萬元 |
| 弘業穩健成長CTA2集合資管計劃 | 資產管理計劃 | 人民幣500.01萬元 |
| 弘業固定收益基金 | 基金 | 美元3,560,695.53元 |
| 弘業廣業基金SP | 基金 | 美元3,128,802.70元 |
| 弘業國際環球機遇基金SP | 基金 | 美元2,547,179.40元 |

2、 本集團不存在重要的非全資子公司。

3、 本集團不存在向納入合併財務報表範圍的結構化主體提供的財務支持或其他支持。

4、 本集團不存在在子公司的所有者權益份額發生變化且仍控制子公司的情况。

八、在其他主體中的權益(續)

(二) 在合營企業或聯營企業中的權益

1、重要的聯營企業

| 聯營企業名稱 | 主要經營地 | 註冊地 | 業務性質 | 持股比例(%) | | 對聯營企業投資的會計處理方法 |
|-----------------|-------|-----|-------|---------|----|----------------|
| | | | | 直接 | 間接 | |
| 江蘇弘瑞新時代創業投資有限公司 | 江蘇 | 江蘇 | 風險投資等 | 22.00 | | 權益法 |
| 江蘇弘瑞成長創業投資有限公司 | 江蘇 | 江蘇 | 風險投資等 | 9.901 | | 權益法 |

註：本集團及本公司在報告期持有江蘇弘瑞成長創業投資有限公司(以下簡稱「弘瑞成長」)9.901%的股權。依據弘瑞成長的公司章程，本集團及本公司指派一名董事會成員。本集團及本公司通過參加對被投資公司的生產經營決策，對其產生重大影響。因此，弘瑞成長作為聯營企業計入本集團及本公司的財務報表。

2、重要的聯營企業的主要財務信息

| 項目 | 2021年12月31日／2021年度 | | |
|--------|--------------------|---------------|---------------|
| | 弘瑞新時代 | 弘瑞成長 | 合計 |
| 流動資產 | 17,802,195.29 | 485,712.72 | 18,287,908.01 |
| 非流動資產 | 3,972,811.66 | 22,917,595.05 | 26,890,406.71 |
| 資產合計 | 21,775,006.95 | 23,403,307.77 | 45,178,314.72 |
| 流動負債 | 15,410.85 | 688,025.68 | 703,436.53 |
| 非流動負債 | | 236.97 | 236.97 |
| 負債合計 | 15,410.85 | 688,262.65 | 703,673.50 |
| 淨利潤 | -2,694,266.22 | 3,765,368.27 | 1,071,102.05 |
| 綜合收益總額 | -2,694,266.22 | 3,765,305.28 | 1,071,039.06 |

八、在其他主體中的權益(續)

(二) 在合營企業或聯營企業中的權益(續)

3、不重要的聯營企業的匯總信息

無

4、合營企業或聯營企業向本公司轉移資金的能力未受到限制。

5、本集團不存在合營企業或聯營企業發生的超額虧損。

6、本集團無與合營企業投資相關的未確認承諾。

7、本集團無與合營企業或聯營企業投資相關的或有負債。

(三) 未納入合併財務報表範圍的結構化主體

2021年12月31日，本集團發起設立但未納入合併財務報表範圍的結構化主體的淨資產規模為人民幣23,505,414,715.31元。

本集團通過直接持有投資而在第三方機構發起設立的結構化主體中享有權益。本集團通過直接持有投資而在第三方機構發起設立的結構化主體中的權益在本集團合併資產負債表中的相關資產負債項目及其賬面價值/最大損失敞口列示如下：

| 項目 | 2021年12月31日 交易性金融資產 | 2020年12月31日 交易性金融資產 |
|--------|------------------------|------------------------|
| 基金 | 486,081,988.72 | 657,936,247.67 |
| 信託計劃 | 126,522,054.80 | 122,180,718.27 |
| 資產管理計劃 | 20,966,041.70 | 59,736,311.27 |
| 理財產品 | | 8,446,452.00 |
| 合計 | 633,570,085.22 | 848,299,729.21 |

報告期各期末，本集團因投資上述基金、信託計劃、資產管理計劃以及理財產品而可能遭受損失的最大風險敞口為其在報告日的公允價值。

九、金融工具及風險管理

本集團從事風險管理的目標是在風險和收益之間取得適當的平衡，力求降低金融風險對本集團財務業績的不利影響。基於該風險管理目標，本集團已制定風險管理政策以辨別和分析本集團所面臨的風險，設定適當的風險可接受水平並設計相應的內部控制程序，以監控本集團的風險水平。本集團會定期審閱這些風險管理政策及有關內部控制系統，以適應市場情況或本集團經營活動的改變。

(一) 市場風險

1、匯率風險

由於本集團主要業務集中在中國大陸且以人民幣結算，因此除由於發行股票所形成的港幣銀行存款外，本集團無重大匯率風險。匯率風險主要是由港元和美元引起的。由於大多由發行股票而取得的貨幣資金已在報告期內轉換為人民幣，且目前涉及美元業務較少，因此匯率風險較低。

- (1) 出於列報考慮，風險敞口金額以人民幣列示，以資產負債表日即期匯率折算。外幣報表折算差額未包括在內。本集團於年末各外幣資產負債項目匯率風險敞口如下：

| 項目 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | 外幣餘額 | 折算人民幣餘額 | 外幣餘額 | 折算人民幣餘額 |
| 貨幣資金 | | | | |
| 港幣 | 67,679,206.96 | 55,334,519.61 | 77,675,872.85 | 65,375,121.63 |
| 美元 | 44,625.80 | 284,520.73 | 44,716.04 | 291,767.66 |

- (2) 本集團適用的人民幣對外幣的匯率分析

| 項目 | 平均匯率 | | 報告日中間匯率 | |
|----|--------|---------|-------------|-------------|
| | 2021年度 | 2020年度 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
| 港幣 | 0.8300 | 0.88932 | 0.8176 | 0.84164 |
| 美元 | 6.4512 | 6.8976 | 6.3757 | 6.5249 |

九、金融工具及風險管理(續)

(一) 市場風險(續)

1、 匯率風險(續)

(3) 敏感性分析

假定除匯率以外的其他風險變量不變，於年末人民幣對港幣及美元的匯率變動使人民幣升值10%將導致本集團股東權益和淨利潤的減少情況如下。此影響按資產負債表日即期匯率折算為人民幣列示。

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|----------|----------------------|---------------|
| 淨利潤及股東權益 | | |
| 港幣項目 | -4,150,088.97 | -4,903,134.12 |
| 美元項目 | -21,339.05 | -21,882.57 |

在假定其他變量保持不變的前提下，人民幣對港幣、美元的匯率變動使人民幣貶值10%將導致本集團股東權益和淨利潤的變化和上表列示的金額相同但方向相反。

上表顯示了於報告期末港幣、美元兌換成人民幣時，匯率變化對本集團的淨利潤及股東權益的即時影響。

上述敏感性分析是假設資產負債表日匯率發生變動，以變動後的匯率對資產負債表日本集團或本公司持有的、面臨匯率風險的金融工具進行重新計量得出的。上述分析不包括外幣報表折算差異。之前期間的分析基於同樣的假設和方法。

2、 利率風險

固定利率和浮動利率的帶息金融工具分別使本集團面臨公允價值利率風險及現金流量利率風險。本集團根據市場環境來決定固定利率與浮動利率工具的比例並通過定期審閱與監察維持適當的固定和浮動利率工具組合。本集團並未以衍生金融工具對沖利率風險。

九、金融工具及風險管理(續)

(一) 市場風險(續)

2、利率風險(續)

(1) 本集團於年末持有的計息金融工具

| 項目 | 2021年12月31日 | | 2020年12月31日 | |
|---------------------|---------------|-------------------------|--------------|-------------------------|
| | 實際利率 | 金額 | 實際利率 | 金額 |
| 固定利率金融工具 | | | | |
| 金融資產 | | | | |
| 貨幣資金 | | | | |
| 其中：期貨保證金 | 2.45%-3.40% | 3,665,000,000.00 | 2.00%-3.75% | 2,070,000,000.00 |
| 自有資金 | | | | |
| 應收貨幣保證金及 應收質押保證金 | 1.66%-1.85% | 514,930,761.04 | 1.66%-1.95% | 493,095,037.42 |
| 買入返售金融資產 | 3.157%-3.517% | 6,719,000.00 | 3.16%-3.17% | 7,853,000.00 |
| 交易性金融資產 | | | | |
| 其中：交易性債券 | 1.00%-7.50% | 97,121,997.66 | 0.08%-7.00% | 81,686,110.56 |
| 信託計劃 | 4.20%-8.10% | 126,522,054.80 | 7.30%-8.10% | 122,180,718.27 |
| 金融負債 | | | | |
| 短期借款 | | | 3.65% | 2,052,060.00 |
| 賣出回購金融資產款 | 2.847%-3.905% | 32,601,000.00 | 2.98%-3.63% | 35,819,204.28 |
| 長期借款 | 4.50% | 116,925,986.00 | | |
| 淨額 | | 4,559,820,799.50 | | 2,812,686,130.53 |
| 浮動利率金融工具 | | | | |
| 金融資產 | | | | |
| 貨幣資金 | | | | |
| 其中：期貨保證金 | 0.001%-2.25% | 294,706,206.55 | 0.001%-2.70% | 590,162,679.92 |
| 自有資金 | 0.001%-1.95% | 113,666,496.74 | 0.001%-2.70% | 205,515,594.41 |
| 其他貨幣資金 | 0.35% | 37,885,031.15 | 0.35% | 13,872,280.30 |
| 淨額 | | 446,257,734.44 | | 809,550,554.63 |

九、金融工具及風險管理(續)

(一) 市場風險(續)

2、 利率風險(續)

(2) 敏感性分析

① 固定利率金融工具的公允價值敏感性分析

截至2021年12月31日，在其他變量不變的情況下，假定利率上升100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤減少人民幣1,333,005.60元；假定利率下降100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤增加人民幣1,371,022.67元。

截至2020年12月31日，在其他變量不變的情況下，假定利率上升100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤減少人民幣410,516.11元；假定利率下降100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤增加人民幣424,170.35元。

② 浮動利率金融工具的現金流敏感性分析

截至2021年12月31日，在其他變量不變的情況下，假定利率上升100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤增加人民幣3,346,933.01元；假定利率下降100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤下降人民幣2,222,815.52元。

截至2020年12月31日，在其他變量不變的情況下，假定利率上升100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤增加人民幣6,071,546.62元；假定利率下降100個基點將會導致本集團股東權益和淨利潤下降人民幣4,704,079.15元。

對於資產負債表日持有的、使本集團面臨現金流量利率風險的浮動利率非衍生工具，上述敏感性分析中的淨利潤及股東權益的影響是上述利率變動對按年度估算的利息費用或收入的影響。之前年度的分析基於同樣的假設和方法。

3、 其他價格風險

其他價格風險是指本集團所持權益類金融工具的公允價值或未來現金流量因除市場利率和外匯匯率以外的市場價格因素變動而發生波動的風險。本集團主要投資於證券交易所上市的股票、基金等，所面臨的最大市場價格風險由所持有的金融工具的公允價值決定。

九、金融工具及風險管理(續)

(一) 市場風險(續)

3、其他價格風險

敏感性分析

下列分析用於顯示在所有其他參數保持不變的情況下，股票價格和商品價格上下波動10%對本集團淨利潤和權益的影響。

| 項目 | 淨利潤 | |
|---------|----------------------|---------------|
| | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
| 股票價格的變化 | | |
| 上升10% | 6,790,065.90 | 3,935,216.16 |
| 下降10% | -6,790,065.90 | -3,935,216.16 |
| 商品價格的變化 | | |
| 上升10% | 3,945,856.95 | 9,017,367.31 |
| 下降10% | -3,945,856.95 | -9,017,367.31 |

(續)

| 項目 | 股東權益 | |
|---------|----------------------|---------------|
| | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
| 股票價格的變化 | | |
| 上升10% | 6,790,065.90 | 3,935,216.16 |
| 下降10% | -6,790,065.90 | -3,935,216.16 |
| 商品價格的變化 | | |
| 上升10% | 3,945,856.95 | 9,017,367.31 |
| 下降10% | -3,945,856.95 | -9,017,367.31 |

敏感性分析表明，假定股市指數和大宗商品期貨市場在相關期間結束時出現變化且已用於重新測量本集團所持有的上述金融工具(可導致本集團在相關期間結束時出現股票和大宗商品價格風險)，則可能出現本集團淨利潤和股東權益的暫時變化。同時，假定本集團的股權投資和對沖投資之公允價值將依據相關股市指數和大宗商品期貨價格之間歷史相關性而變化，所有其他參數保持不變。之前年度的分析基於同樣的假設和方法。

九、金融工具及風險管理(續)

(二) 信用風險

信用風險，是指金融工具的一方不能履行義務，造成另一方發生財務損失的風險。本集團的信用風險主要來自貨幣資金、應收貨幣保證金、買入返售金融資產、交易性金融資產、衍生金融資產、其他應收款和其他資產等。管理層會持續監控這些信用風險的敞口。

本集團所承受的最大信用風險敞口為資產負債表中每項金融資產(包括衍生金融工具)的賬面金額。

本集團除現金以外的貨幣資金主要存放於信用良好的金融機構，因此管理層認為貨幣資金及相應產生的利息不存在重大的信用風險。

對於存放於境內交易所等金融機構的應收貨幣保證金，本集團認為這些金融機構具有較高信譽和資產狀況，存在較低的信用風險。

對於存放於境外期貨交易經紀商的應收貨幣保證金，本集團於報告期末以謹慎原則參考歷史信用損失經驗，結合當前狀況以及對未來經濟狀況的預測，按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計提損失準備。

對於應收賬款和其他應收款，本集團定期對採用信用方式交易的客戶進行評估。根據評估結果，本集團選擇與經認可的且信用良好的客戶進行交易，並對應收賬款和其他應收款的餘額進行監控。對於應收賬款和其他應收款，本集團於報告期末以謹慎原則參考歷史信用損失經驗，結合當前狀況以及對未來經濟狀況的預測，通過違約風險敞口和未來12個月內或整個存續期預期信用損失率，計算預期信用損失及計提減值準備。對於已發生信用減值的應收款項，本集團會採取書面催款或法律仲裁等方式積極催款，在考慮可收回金額後以整個存續期內預期信用損失的金額計提損失準備。

九、金融工具及風險管理(續)

(二) 信用風險(續)

截至2021年12月31日，本集團無對外擔保，因此，在不考慮可利用的擔保物或其他信用增級的情況下，本集團資產負債表日最大信用風險敞口為本集團金融資產的賬面金額減去相應的減值準備。本集團最大信用風險敞口列示如下：

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|----------|-------------------------|------------------|
| 貨幣資金 | 4,143,641,973.33 | 2,894,295,423.20 |
| 應收貨幣保證金 | 2,025,860,140.16 | 2,131,088,863.50 |
| 交易性金融資產 | 840,419,634.46 | 1,014,876,858.35 |
| 應收質押保證金 | 668,817,393.60 | 64,396,384.00 |
| 衍生金融資產 | 465,835.77 | 6,219,924.42 |
| 買入返售金融資產 | 6,719,000.00 | 7,853,000.00 |
| 應收款項 | 24,951,725.11 | 42,901,852.75 |
| 最大風險敞口合計 | 7,710,875,702.43 | 6,161,632,306.22 |

(三) 流動性風險

流動性風險，是指企業在履行以交付現金或其他金融資產的方式結算的義務時發生資金短缺的風險。本公司及各子公司負責自身的現金管理工作，包括現金盈餘的短期投資和籌借貸款以應付預計現金需求(如果借款額超過某些預設授權上限，便需獲得本公司董事會的批准)。本集團的政策是定期監察其流動資金需求，確保其維持充裕的現金儲備，以滿足短期和長期流動資金需求。

本集團於資產負債表日的金融負債按未折現的合同現金流量(包括按合同利率(如果是浮動利率則按年末的現行利率)計算的利息)的剩餘合約期限，以及被要求支付的最早日期如下：

九、金融工具及風險管理(續)

(三) 流動性風險(續)

1、2021年12月31日

| 項目 | 即期 | 1年內 | 1年至5年以內 | 合計 | 資產負債表 賬面價值 |
|-------------|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 應付貨幣保證金 | 5,261,811,881.42 | | | 5,261,811,881.42 | 5,261,811,881.42 |
| 應付質押保證金 | 668,817,393.60 | | | 668,817,393.60 | 668,817,393.60 |
| 應付期貨投資者保障基金 | | 522,926.88 | | 522,926.88 | 522,926.88 |
| 賣出回購金融資產款 | | 32,625,838.11 | | 32,625,838.11 | 32,625,838.11 |
| 交易性金融負債 | | 86,471,254.16 | | 86,471,254.16 | 86,471,254.16 |
| 衍生金融負債 | | 1,514,054.34 | | 1,514,054.34 | 1,514,054.34 |
| 應付職工薪酬 | | 20,659,015.94 | | 20,659,015.94 | 20,659,015.94 |
| 其他應付款 | | 26,281,420.68 | | 26,281,420.68 | 26,281,420.68 |
| 租賃負債 | | 11,974,787.90 | 14,433,350.15 | 26,408,138.05 | 24,831,103.80 |
| 長期借款 | | 32,859,584.76 | 95,283,813.50 | 128,143,398.26 | 117,197,967.93 |
| 合計 | 5,930,629,275.02 | 212,908,882.77 | 109,717,163.65 | 6,253,255,321.44 | 6,240,732,856.86 |

2、2020年12月31日

| 項目 | 即期 | 1年內 | 1年至5年以內 | 合計 | 資產負債表 賬面價值 |
|-------------|------------------|----------------|--------------|------------------|------------------|
| 應付貨幣保證金 | 4,247,090,138.08 | | | 4,247,090,138.08 | 4,247,090,138.08 |
| 應付質押保證金 | 40,750,944.00 | | | 40,750,944.00 | 40,750,944.00 |
| 應付期貨投資者保障基金 | | 369,776.02 | | 369,776.02 | 369,776.02 |
| 短期借款 | | 2,055,343.30 | | 2,055,343.30 | 2,052,060.00 |
| 賣出回購金融資產款 | | 35,912,721.98 | | 35,912,721.98 | 35,819,204.28 |
| 應付賬款 | | 7,373,441.99 | | 7,373,441.99 | 7,373,441.99 |
| 應付職工薪酬 | | 26,279,433.60 | | 26,279,433.60 | 26,279,433.60 |
| 其他應付款 | | 140,609,535.53 | | 140,609,535.53 | 140,609,535.53 |
| 租賃負債 | | 14,069,265.76 | 6,213,995.71 | 20,283,261.47 | 19,347,767.49 |
| 合計 | 4,287,841,082.08 | 226,669,518.18 | 6,213,995.71 | 4,520,724,595.97 | 4,519,692,300.99 |

九、金融工具及風險管理(續)

(四) 操作風險

操作風險是指由於公司內部流程設置不合理，員工操作失誤或未嚴格執行流程、信息技術系統問題以及外部事件等導致公司損失的風險。針對操作風險，集團建立合規、適用、清晰的日常運作制度體系，制定嚴格的業務流程和權限劃分，完善業務制度，重要崗位採用雙人覆核，減少人為疏忽的概率，並建立健全績效考核機制。同時通過建立應急預案、開展系統測試，加強應急備份通道建設等方式，避免交易、風控系統差錯導致的風險。加強內部培訓，持續提升員工專業能力，減少產品設計等方面定價錯誤的概率和可能性。

十、公允價值的披露管理

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次

1、以公允價值計量的資產和負債的年末公允價值

| 項目 | 2021年12月31日公允價值匯總 | | | 合計 |
|----------------------|-------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 第一層次 公允價值計量 | 第二層次 公允價值計量 | 第三層次 公允價值計量 | |
| 一、持續的公允價值計量 | | | | |
| 金融資產 | | | | |
| (一)交易性金融資產 | 464,733,109.40 | 229,998,295.90 | 145,688,229.16 | 840,419,634.46 |
| 1、債務工具投資 | 72,444,667.66 | 24,677,330.00 | 126,522,054.80 | 223,644,052.46 |
| 2、權益工具投資 | 392,288,441.74 | 205,320,965.90 | 19,166,174.36 | 616,775,582.00 |
| (二)衍生金融資產 | 34,302.50 | | 431,533.27 | 465,835.77 |
| 持續以公允價值計量的 金融資產總額 | 464,767,411.90 | 229,998,295.90 | 146,119,762.43 | 840,885,470.23 |
| 金融負債 | | | | |
| (一)交易性金融負債 | | | 86,471,254.16 | 86,471,254.16 |
| (二)衍生金融負債 | 342,139.17 | | 1,171,915.17 | 1,514,054.34 |
| 持續以公允價值計量的 金融負債總額 | 342,139.17 | - | 87,643,169.33 | 87,985,308.50 |
| 二、非持續的公允價值計量 | | | | |
| 非持續以公允價值計量 的資產總額 | | | | |
| 非持續以公允價值計量 的負債總額 | | | | |

十、公允價值的披露管理(續)

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次(續)

1、以公允價值計量的資產和負債的年末公允價值(續)

(續)

| 項目 | 2020年12月31日公允價值匯總 | | | 合計 |
|----------------------|-------------------|----------------|----------------|------------------|
| | 第一層次 公允價值計量 | 第二層次 公允價值計量 | 第三層次 公允價值計量 | |
| 一、持續的公允價值計量 | | | | |
| 金融資產 | | | | |
| (一)交易性金融資產 | 591,656,495.01 | 257,613,635.36 | 165,606,727.99 | 1,014,876,858.36 |
| 1、債務工具投資 | 56,425,900.56 | 25,260,210.00 | 122,180,718.27 | 203,866,828.83 |
| 2、權益工具投資 | 535,230,594.45 | 232,353,425.36 | 43,426,009.72 | 811,010,029.53 |
| (二)衍生金融資產 | 2,219,480.00 | | 4,000,444.42 | 6,219,924.42 |
| 持續以公允價值計量的 金融資產總額 | 593,875,975.01 | 257,613,635.36 | 169,607,172.41 | 1,021,096,782.78 |
| 金融負債 | | | | |
| (一)衍生金融負債 | 1,590,820.00 | | 6,003,694.81 | 7,594,514.81 |
| 持續以公允價值計量的 金融負債總額 | 1,590,820.00 | | 6,003,694.81 | 7,594,514.81 |
| 二、非持續的公允價值計量 | | | | |
| 非持續以公允價值計量的資產總額 | | | | |
| 非持續以公允價值計量的負債總額 | | | | |

在報告期內，本集團不存在第一層級與第二層級之間的轉換以及其他層級向第三層級的轉入或轉出的情況。本集團的政策為於報告期末識別各層級之間實際出現的層級轉換。

(1) 第一層次的公允價值計量

在活躍市場交易的金融工具的公允價值通過其在活躍市場的報價進行確定。活躍市場報價是指容易獲取的、及時的交易所、券商、經紀人、行業協會、定價機構及監管機構等的報價，並且此類報價能夠代表實際發生的公平市場交易的價格。

十、公允價值的披露管理(續)

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次(續)

1、以公允價值計量的資產和負債的年末公允價值(續)

(2) 第二層次的公允價值計量

未在活躍市場交易的金融工具的公允價值通過使用價值評估方法進行確定。此類價值評估方法採用可行且不依賴實體特定估計的數據，在最大程度上使用可觀測市場數據。如果金融工具的公允價值所需所有重要參數均可觀測，則該金融工具包含在第二層級範圍內。如果一個或多個重要參數未基於可觀測市場數據，則該金融工具應包含在第三層級範圍內。

報告期末，本集團金融工具的價值評估方法如下所述：

對於上市股票而言，公允價值基於報告期結束日股票買賣差價的收盤價確定。如果在報告期結束日無市場報價且在最近交易日之後經濟環境出現重大變化，則採用價值評估方法確定公允價值。

對於交易所上市的投資基金，公允價值依據報告期結束日或最近交易日的買賣差價的收盤價確定。對於未上市開放式基金，公允價值通過基於報告期結束日的淨資產價值報價確定。

對於通過場外交易市場交易的期貨，公允價值通過使用基於具有類似特性的可觀測大宗商品期貨市場的價值評估方法確定。

對於公開市場的債券投資，公允價值是採用相關債券登記結算機構估值系統的報價，相關報價機構在形成報價過程中採用了反映市場狀況的可觀察輸入值。

對於不存在公開市場的資產管理計劃，公允價值通過基於報告期結束日的淨資產價值報價確定。

在報告期間，本集團上述持續第二層次公允價值計量所使用的估值技術並未發生變更。

十、公允價值的披露管理(續)

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次(續)

1、以公允價值計量的資產和負債的年末公允價值(續)

(3) 第三層次的公允價值計量

對於第三層次金融工具，本集團通過現金流折現模型及其他類似評估方法確定其價值。是否分類為第三層次評估方法一般基於非可觀測市場數據對整個公允價值計量的重要性。下表顯示了第三層次主要金融工具的相關價值評估方法和參數：

| 金融工具 | 價值評估方法 | 重大不可觀測參數 | 不可見參數與公允價值的關係 |
|--------------------------|--|----------|-----------------------------|
| 資產管理計劃、信託計劃、理財產品和資產支持證券 | 現金流折現模型 | 風險調整折現率 | 風險調整折現率越高，公允價值越低 |
| 場外期權 | 彭博社OVML功能，布萊克斯科爾PDE、克拉克尼爾森有限差分法求解偏微分方程 | 隱含波動率 | 隱含波動率越高，公允價值越高 |
| 交易性金融負債其中：指定以公允價值計量的應付款項 | 底層金融工具估值與合約分配法 | 合約分配率 | 合約分配率越高，公允價值越高(收益時)/越低(虧損時) |

報告期末，上述持續第三層次公允價值計量的資產和負債的公允價值的估值技術並未發生變更。

十、公允價值的披露管理(續)

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次(續)

1、以公允價值計量的資產和負債的年末公允價值(續)

(3) 第三層次的公允價值計量(續)

持續的第三層次公允價值計量的資產和負債的年初餘額與年末餘額之間的調節信息如下：

| 項目 | 2021年1月1日 | 本年利得或 損失總額 計入損益 | 購買 | 結算與出售 | 2021年12月31日 | 對於期末持有的 資產和承擔的 負債，計入損益 的當期末實現 利得或損失 |
|---|----------------|-----------------------|----------------|----------------|----------------|---|
| 金融資產 | | | | | | |
| 交易性金融資產 | | | | | | |
| 其中：債務工具投資 | 122,180,718.27 | 7,624,006.07 | 200,000,000.00 | 203,282,669.54 | 126,522,054.80 | 1,522,054.80 |
| 權益工具投資 | 43,426,009.72 | 3,031,143.71 | 9,000,000.00 | 36,290,979.07 | 19,166,174.36 | 834,327.77 |
| 衍生金融資產 | 4,000,444.42 | -3,568,911.15 | | | 431,533.27 | 431,533.27 |
| 金融資產小計 | 169,607,172.41 | 7,086,238.63 | 209,000,000.00 | 239,573,648.61 | 146,119,762.43 | 2,787,915.84 |
| 金融負債 | | | | | | |
| 交易性金融負債 | | | | | | |
| 其中：指定以公允價值 計量且其變動 計入當期損益 的金融負債 | | 4,224,539.06 | 82,246,715.10 | | 86,471,254.16 | 4,224,539.06 |
| 衍生金融負債 | 6,003,694.81 | -4,831,779.64 | | | 1,171,915.17 | 1,171,915.17 |
| 金融負債小計 | 6,003,694.81 | -607,240.58 | 82,246,715.10 | | 87,643,169.33 | 5,396,454.23 |
| 淨額 | 163,603,477.60 | 7,693,479.21 | 126,753,284.90 | 239,573,648.61 | 58,476,593.10 | -2,608,538.39 |

十、公允價值的披露管理(續)

(一) 以公允價值計量的資產和負債的金額和公允價值計量層次(續)

2、 不以公允價值計量的金融資產和金融負債的公允價值情況

本集團或本公司不以公允價值計量的金融資產和金融負債主要包括：貨幣資金、應收貨幣保證金、應收質押保證金、應收結算擔保金、買入返售金融資產、其他應收款、應付貨幣保證金、應付質押保證金、應付期貨投資者保障基金、應付賬款、應付職工薪酬和其他應付款等。報告期末，以上金融資產和金融負債的賬面價值與公允價值之間無重大差異。

十一、關聯方及關聯交易

(一) 關聯方關係

1. 控股股東及最終控制方

(1) 控股股東及最終控制方

| 母公司名稱 | 註冊地 | 業務性質 | 註冊資本 | 母公司對本公司的持股比例 | 母公司對本公司的表決權比例 | 本公司最終控制方 |
|---------------|-----|---|------------------|--------------|---------------|----------|
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | 江蘇省 | 金融、實業投資，授權範圍內國有資產的經營、管理；國貿貿易；房屋租賃；繭絲綢、紡織服裝的生產、研發和銷售 | 2,000,000,000.00 | 30.37% | 30.37% | 江蘇省人民政府 |

(2) 控股股東的註冊資本變化情況

無

2、 本公司的子公司情況

公司的子公司情況詳見附註「七、(一)」及「八、(一)」。

十一、關聯方及關聯交易(續)

(一) 關聯方關係(續)

3、 本公司的聯營企業情況

公司的合營和聯營企業情況詳見附註「八、(二)」。

4、 公司其他重要關聯方情況

| 其他關聯方名稱 | 關聯關係 |
|--------------------|-----------------|
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | 本集團及本公司股東 |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 本集團及本公司股東 |
| 弘業資本管理有限公司 | 本公司全資子公司 |
| 弘業國際金融控股有限公司 | 本公司全資子公司 |
| 江蘇匯鴻國際集團中鼎控股股份有限公司 | 本集團及本公司股東控股子公司 |
| 江蘇弘瑞成長創業投資有限公司 | 本集團及本公司聯營企業 |
| 江蘇蘇豪投資集團有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪國際集團股份有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪尚品有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪輕紡有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 愛濤文化集團有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇愛濤文化產業有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇金融控股有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇弘業環保科技產業有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇省化肥工業有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪資產運營集團有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪傳媒有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇蘇豪健康產業有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 江蘇康泓汽車服務有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 海安市蘇豪制絲有限公司 | 受同一最終控股公司控制 |
| 張某 | 關鍵管理人員關係密切的家庭成員 |
| 儲某某 | 關鍵管理人員關係密切的家庭成員 |

十一、關聯方及關聯交易(續)

(二) 關聯交易

1、接受勞務

| 關聯方 | 關聯交易內容 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------|--------|---------------------|--------------|
| 江蘇金融控股有限公司 | 勞務費 | 713,685.00 | 525,183.36 |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 服務費 | 23,815.63 | 202,571.93 |
| 江蘇愛濤文化產業有限公司 | 裝修及採購費 | 296,486.11 | 4,294.00 |
| 江蘇蘇豪尚品有限公司 | 宣傳費 | 70,718.57 | 104,732.00 |
| 江蘇蘇豪傳媒有限公司 | 會議費 | | 48,396.23 |
| 江蘇蘇豪健康產業有限公司 | 採購款 | | 44,601.77 |
| 江蘇蘇豪輕紡有限公司 | 宣傳費 | | 6,600.00 |
| 江蘇弘業環保科技產業有限公司 | 採購款 | 2,185.84 | 142,539.38 |
| 江蘇蘇豪國際集團股份有限公司 | 宣傳費 | | 74,942.64 |
| 海安市蘇豪制絲有限公司 | 服務費 | 34,017.69 | |
| 江蘇康泓汽車服務有限公司 | 服務費 | | 2,830.19 |
| 合計 | | 1,140,908.84 | 1,156,691.50 |

2、提供勞務

| 關聯方 | 關聯交易內容 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------------|-----------|------------------|-----------|
| 儲某某 | 手續費收入 | 2,591.75 | 4,873.51 |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | 資管業務收入/其他 | | 35,948.70 |
| 愛濤文化集團有限公司 | 資管業務收入 | 25,824.87 | |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 資管業務收入 | 25,824.51 | |
| 江蘇省化肥工業有限公司 | 手續費收入 | 5,679.72 | 2,433.96 |
| 合計 | | 59,920.85 | 43,256.17 |

十一、關聯方及關聯交易(續)

(二) 關聯交易(續)

3、關聯租賃

| 出租方名稱 | 租賃資產種類 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------|-----------|---------------------|--------------|
| 江蘇弘業股份有限公司 | 房屋租賃費 | 6,326,619.28 | |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 使用權資產 | | 6,435,781.59 |
| 江蘇弘業股份有限公司 | 使用權資產財務費用 | | 170,739.16 |
| 合計 | | 6,326,619.28 | 6,606,520.75 |

4、關鍵管理人員薪酬

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------|---------------------|--------------|
| 關鍵管理人員薪酬 | 5,206,557.52 | 4,631,774.42 |

5、關聯方拆借資金

(1) 向關聯方借入資金

| 關聯方名稱 | 2021年度 | | | 年末餘額 |
|---------------|--------|-----------------------|-----------------------|------|
| | 年初餘額 | 本年增加 | 本年減少 | |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 | |
| 合計 | | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 | |

(續)

| 關聯方名稱 | 2020年 | | | 年末餘額 |
|---------------|-------|---------------|---------------|------|
| | 年初餘額 | 本年增加 | 本年減少 | |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 | |
| 合計 | | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 | |

十一、關聯方及關聯交易(續)

(二) 關聯交易(續)

5、關聯方拆借資金

(2) 關聯方資金佔用利息

| 關聯方 | 2021年度 | 2020年度 | 說明 |
|-----------------|---------------------|------------|---|
| 關聯方資金佔用 利息支出 | 1,716,666.66 | 772,361.12 | <p>2021年本公司第三屆董事會第二十七次會議，審議通過了《關於弘業資本管理有限公司申請向江蘇省蘇豪控股集團有限公司借款的議案》，同意借款5000萬元資金，借款利率6%，借款期限為11月29號至12月31日。</p> <p>2021年本公司第三屆董事會第二十一次會議，審議通過了《關於弘業資本管理有限公司申請向江蘇省蘇豪控股集團有限公司借款的議案》，同意借款5000萬元資金，借款利率6%，借款期限半年。借款期限為3月12號至9月11日。</p> <p>2020年本公司第三屆董事會第十六次會議，審議通過了《關於弘業資本管理有限公司申請向江蘇省蘇豪控股集團有限公司借款的議案》，同意借款5000萬元資金，借款利率4.15%，借款期限四個月。</p> |

十一、關聯方及關聯交易(續)

(二) 關聯交易(續)

6、關聯方訴訟損失補償

| 關聯方 | 2021年度 | 說明 |
|---------------|--------------|--|
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | 4,701,890.00 | 2021年6月1日江蘇省蘇豪控股集團有限公司出具《承諾函》，就本公司天津營業部前負責人馬某擅自以本公司名義對外簽署資產管理合同並加蓋涉嫌偽造的本公司公章而導致的本公司作為被告的民事訴訟案件以及擅自以本公司天津營業部的名義為其個人借款提供擔保並加蓋本公司天津營業部財務專用章而導致的本公司作為被告的民事訴訟案件(不包括目前已經審理終結的案件)，如本公司根據審理法院作出的生效判決應支付任何金錢賠償、和解款項、罰款，在本公司支付後，江蘇省蘇豪控股集團有限公司將根據本公司的書面通知全額補償本公司。本公司於2021年6月30日根據法院判決支付賠償款合計4,701,890元，江蘇省蘇豪控股集團有限公司於2021年9月27日全額補償給公司。 |

7、其他關聯交易

| 關聯方 | 科目 | 關聯交易內容 | 2021年度 | 2020年度 |
|----------------|--------|------------|----------------|---------------|
| 江蘇弘業股份有限公司 | 不適用 | 淨投資/處置資管計劃 | 15,000,000.00 | |
| 愛濤文化集團有限公司 | 不適用 | 淨投資/處置資管計劃 | | -5,752,596.68 |
| 江蘇愛濤文化產業有限公司 | 不適用 | 淨投資/處置資管計劃 | 15,000,000.00 | |
| 江蘇蘇豪資產運營集團有限公司 | 不適用 | 淨投資/處置資管計劃 | -10,001,000.00 | 10,000,000.00 |
| 江蘇蘇豪傳媒有限公司 | 業務及管理費 | 期刊發表文章 | 754.72 | |

十一、關聯方及關聯交易(續)

(三) 關聯方往來餘額

1、應付關聯方款項

| 項目 | 關聯方 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|---------|--------------------|---------------------|--------------|
| 其他應付款 | 江蘇弘瑞成長創業投資有限公司 | | 3,791,000.00 |
| 應付貨幣保證金 | 儲某某 | | 2,314,711.34 |
| 應付貨幣保證金 | 張某 | | 1,134.49 |
| 應付貨幣保證金 | 江蘇蘇豪國際集團股份有限公司 | 1,001.00 | 1,001.00 |
| 應付貨幣保證金 | 江蘇匯鴻國際集團中鼎控股股份有限公司 | 1,001.00 | 1,001.00 |
| 應付貨幣保證金 | 江蘇省化肥工業有限公司 | 2,843,893.50 | 101,101.00 |
| 應付貨幣保證金 | 愛濤文化集團有限公司 | 1,500.00 | 1,500.00 |

2、應收關聯方款項

| 項目 | 關聯方 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|------|------------|-------------|-------------|
| 預付款項 | 江蘇弘業股份有限公司 | | 453,350.32 |

3、其他

| 關聯方 | 科目 | 關聯交易內容 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------------|---------|--------|-------------|--------------|
| 江蘇蘇豪投資集團有限公司 | 交易性金融資產 | 理財產品 | | 8,446,452.00 |

十二、或有事項

1、重要的未決訴訟或仲裁

- (1) 於2017年9月，本公司的兩名客戶焦某和邢某向北京市東城區人民法院對本公司北京營業部提起法律訴訟，案由為委託理財合同糾紛，指稱本公司一名前僱員向其推銷理財產品，北京營業部未經客戶授權擅自開展期貨交易，以及將客戶賬戶的委託理財資金轉移至北京營業部賬戶進行違規交易，導致客戶賬戶資金全部虧損。

焦某的訴訟請求為：1 請求判令償還理財存款人民幣835.2495萬元及利息；及2 被告承擔訴訟費用。邢某的訴訟請求為：1 請求判令償還理財存款人民幣150萬元及利息；及2 被告承擔訴訟費用。本公司於2018年11月6日收到北京市第二中級人民法院寄送的一審民事判決書，判決駁回客戶的全部訴訟請求。本公司於2019年12月26日收到北京市高級人民法院寄送的二審民事裁定書，法院裁定撤銷一審判決，發回北京市第二中級人民法院重審。2020年5月20日、11月25日該案發回重審後開庭。2021年4月，北京二中院分別做出判決，判決本公司北京營業部分別賠償焦某、邢某投資損失167.01萬元和29.98萬元，判令焦某及邢某承擔全部訴訟費。本公司已提起上訴，目前處於二審審理過程中。

截至2021年12月31日，本公司綜合考慮各種因素以謹慎原則對上述判決損失計提預計負債人民幣1,969,920.97元。

十二、或有事項(續)

1、重要的未決訴訟或仲裁(續)

- (2) 2020年12月，弘業資本上海分公司向南京市秦淮區人民法院提起訴訟(本案已根據江蘇省高級人民法院於2020年8月31日向全省範圍內各地中級人民法院發出的通知移送至江陰市人民法院管轄)，訴訟請求為：要求漢邦(江陰)石化有限公司(以下稱漢邦石化)償還10,713,048.00元及利息並承擔案件受理費、保全費等全部訴訟費。江陰市人民法院於2021年7月2日作出判決，判決弘業資本上海分公司享有10,713,048.00元及利息。江陰市人民法院於2021年2月3日做出(2021)蘇0281破8號《決定書》，漢邦石化目前處於破產重整階段，並由江蘇謀盛律師事務所擔任管理人。弘業資本已提交債權申報文件。2021年7月14日，漢邦石化管理人對弘業資本上海分公司債權的覆審意見為本金10,713,048.00元及利息48,590.28元，合計債權金額10,761,638.28元。

本公司基於相關事實情況和謹慎性原則，在2020年財務報表中就該案單項計提壞賬準備9,106,090.80元。

除上文所述事項外，截止2021年12月31日，本集團未涉及預期會對財務狀況及經營業績造成重大不利影響的任何重大法律、仲裁或行政訴訟事件。

2、其他或有事項

截至2021年12月31日，本集團無需要披露的其他或有事項。

十三、承諾事項

1、已簽訂的尚未履行或尚未完全履行的對外投資合同

| 資本承擔 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|-----------|----------------|----------------|
| 已簽訂但未執行合同 | 42,000,000.00 | 42,000,000.00 |
| 已授權但未簽訂合同 | 78,000,000.00 | 78,000,000.00 |
| 合計 | 120,000,000.00 | 120,000,000.00 |

十四、資產負債表日後事項

截止本報告出具日，本集團無重大資產負債表日後事項。

十五、其他重要事項

(一) 分部報告

本集團擁有期貨經紀及資產管理業務部和大宗商品交易及風險管理業務部共2個報告分部。每個報告分部為單獨的業務分部，提供不同的產品和勞務，由於每個分部需要不同的技術及市場策略而需要進行單獨的管理。

期貨經紀及資產管理業務部代表客戶參與大宗商品期貨與金融期貨的交易，同時，其參與基於資產規模與客戶需求的資產管理產品與服務的開發與銷售。此外，資產管理計劃、銀行理財產品、上市與非上市證券、信託計劃、基金、衍生金融工具的投資活動也由本分部執行。

大宗商品交易及風險管理業務部參與提供大宗商品購買和轉售、期貨套利、期現基差貿易和套期保值服務。

分部經營成果是指各個分部產生的收入(包括對外交易收入及分部間的交易收入)，扣除各個分部發生的費用、歸屬於各分部的資產發生的折舊和攤銷及減值損失、直接歸屬於某一分部的銀行存款及銀行借款所產生的利息淨支出後的淨額。分部之間收入的轉移定價按照與其他對外交易相似的條款計算。本集團並沒有將營業外收支及所得稅費用分配給各分部。

十五、其他重要事項(續)

(一) 分部報告(續)

1、按業務類型的各報告分部利潤(虧損)、資產及負債信息

1) 2021年度報告分部

| 項目 | 期貨經紀及 資產管理業務 | 大宗商品交易及 風險管理業務 | 分部間抵消 | 合計 |
|----------------------|------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 對外營業收入 | 411,895,684.32 | 1,227,969,104.82 | | 1,639,864,789.14 |
| 分部間營業收入 | -55,180,894.56 | 49,005,175.92 | 6,175,718.64 | |
| 營業支出 | -262,473,249.48 | -1,267,477,528.38 | | -1,529,950,777.86 |
| 營業外收支 | -652,480.20 | -49,347.58 | | -701,827.78 |
| 利潤總額 | 93,589,060.08 | 9,447,404.78 | 6,175,718.64 | 109,212,183.50 |
| 所得稅費用 | -26,602,877.57 | -2,397,834.46 | | -29,000,712.03 |
| 淨利潤 | 66,986,182.51 | 7,049,570.32 | 6,175,718.64 | 80,211,471.47 |
| 資產總額 | 7,991,732,879.36 | 437,645,198.45 | -346,277,002.89 | 8,083,101,074.92 |
| 負債總額 | 6,713,658,400.72 | 25,840,771.90 | -338,565,104.38 | 6,400,934,068.24 |
| 其他重要項目： | | | | |
| 其中：利息淨收入 | 82,546,020.25 | 1,572,204.94 | | 84,118,225.19 |
| 折舊和攤銷 | 20,792,967.40 | 21,644.70 | | 20,814,612.10 |
| 除長期股權投資外 非流動資產增加額 | 6,176,979.91 | | | 6,176,979.91 |

十五、其他重要事項(續)

(一) 分部報告(續)

1、按業務類型的各報告分部利潤(虧損)、資產及負債信息(續)

2) 2020年度報告分部

| 項目 | 期貨經紀及 資產管理業務 | 大宗商品交易及 風險管理業務 | 分部間抵消 | 合計 |
|----------------------|------------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 對外營業收入 | 407,961,646.94 | 1,153,417,948.44 | | 1,561,379,595.38 |
| 分部間營業收入 | -26,785,714.18 | 44,527,482.29 | -17,741,768.11 | |
| 營業支出 | -269,789,017.29 | -1,199,169,656.92 | 3,854,150.96 | -1,465,104,523.25 |
| 營業外收支 | -3,312,765.24 | -258,860.32 | | -3,571,625.56 |
| 利潤總額 | 108,074,150.23 | -1,483,086.51 | -13,887,617.15 | 92,703,446.57 |
| 所得稅費用 | -26,759,484.18 | 378,492.87 | | -26,380,991.31 |
| 淨利潤 | 81,314,666.05 | -1,104,593.64 | -13,887,617.15 | 66,322,455.26 |
| 資產總額 | 6,223,161,721.61 | 331,217,874.61 | -205,217,797.35 | 6,349,161,798.87 |
| 負債總額 | 4,814,738,787.01 | 79,085,464.56 | -191,330,180.20 | 4,702,494,071.37 |
| 其他重要項目： | | | | |
| 其中：利息淨收入 | 71,674,505.48 | 970,173.84 | | 72,644,679.32 |
| 折舊和攤銷 | 28,053,472.71 | 20,497.58 | | 28,073,970.29 |
| 除長期股權投資外 非流動資產增加額 | 11,428,119.76 | 29,755.73 | | 11,457,875.49 |

2、按地區的各報告分部利潤(虧損)、資產及負債信息

本集團按不同地區列示的有關取得的對外交易收入信息如下。對外交易收入是按接受服務或購買產品的客戶的所在地進行劃分。

| 項目 | 對外交易收入總額 | |
|------|-------------------------|------------------|
| | 2021年 | 2020年 |
| 中國大陸 | 1,641,744,358.73 | 1,541,232,853.85 |
| 中國香港 | -1,879,569.59 | 20,146,741.53 |
| 合計 | 1,639,864,789.14 | 1,561,379,595.38 |

十五、其他重要事項(續)

(二) 董事薪酬

1、 董事酬金

依照《香港公司法》第383節第一條以及公司法規第二部分「有關董事薪金披露信息」所披露的董事酬金詳情如下：

| 項目 | 董事袍金 | 薪金、津貼及 其他福利 | 酌情花紅 | 退休福利 計劃供款 | 合計 |
|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------|---------------------|
| 本年發生額 | | | | | |
| 主席 | | | | | |
| —周勇 | | | | | |
| 執行董事 | | | | | |
| —周劍秋 | | 383,159.00 | 353,240.00 | | 736,399.00 |
| 非執行董事 | | | | | |
| —薛炳海 | | | | | |
| —單兵 | | | | | |
| —姜琳 | | | | | |
| 獨立非執行董事 | | | | | |
| —王躍堂 | 120,283.32 | | | | 120,283.32 |
| —林繼陽(注) | 120,504.83 | | | | 120,504.83 |
| —黃德春 | 120,283.32 | | | | 120,283.32 |
| —盧華威(注) | | | | | |
| 合計 | 361,071.47 | 383,159.00 | 353,240.00 | | 1,097,470.47 |
| 上年發生額 | | | | | |
| 主席 | | | | | |
| —周勇 | | | | | |
| 執行董事 | | | | | |
| —周劍秋 | | 330,000.00 | 62,903.99 | | 392,903.99 |
| 非執行董事 | | | | | |
| —薛炳海 | | | | | |
| —單兵 | | | | | |
| —姜琳 | | | | | |
| 獨立非執行董事 | | | | | |
| —王躍堂 | 120,697.36 | | | | |
| —林繼陽 | 120,697.36 | | | | |
| —黃德春 | 120,000.00 | | | | |
| 合計 | 361,394.72 | 330,000.00 | 62,903.99 | | 392,903.99 |

註： 盧華威於2021年12月23日任命為獨立非執行董事，林繼陽發於2021年12月23日辭任獨立非執行董事。

十五、其他重要事項(續)

(二) 董事薪酬(續)

1、 董事酬金(續)

報告期內，所有非獨立董事(周劍秋除外)均未在服務本集團時收到任何袍金或酬金，此乃由於彼等自本集團的最終控股公司蘇豪控股獲取袍金或酬金。

2、 五位最高薪酬人士

本年度薪酬最高的前五位中，無董事(上年度：無)，其董事的薪酬載於附註「十五、(二)、1」。其他5位(上年度：5位)的薪酬如下：

| 項目 | 本年發生額 | 上年發生額 |
|----------|---------------------|--------------|
| 薪金、津貼及福利 | 1,742,421.29 | 1,192,213.95 |
| 酌情花紅 | 5,384,587.25 | 3,639,905.08 |
| 養老金計劃供款 | 191,620.80 | 13,257.92 |
| 合計 | 7,318,629.34 | 4,845,376.95 |

薪酬範圍：

| 項目 | 本年人數 | 上年人數 |
|-------------------------|----------|------|
| 港幣1,000,000以 | | 3 |
| 港幣1,000,001至港幣1,500,00 | | 1 |
| 港幣1,500,001至港幣2,000,000 | 5 | 1 |
| 港幣2,000,001至港幣2,500,000 | | |

3、 於往績記錄期，概無任何董事放棄或同意放棄任何薪酬。於往績記錄期，本公司概無向任何董事、監事或五位最高薪酬人士支付任何薪酬，作為吸引彼等加入或於加入本公司時的獎勵或作為離職補償。

(三) 截至2021年12月31日，本集團無其他需披露的重要事項。

十六、母公司財務報表主要項目註釋

1、長期股權投資

(1) 長期股權投資分類

| 項目 | 2021年12月31日 | 2020年12月31日 |
|--------------|-----------------------|----------------|
| 對子公司投資 | 546,242,079.81 | 396,242,079.81 |
| 對聯營、合營企業投資 | 7,036,127.76 | 11,431,418.75 |
| 長期股權投資合計 | 553,278,207.57 | 407,673,498.56 |
| 減：長期股權投資減值準備 | | |
| 長期股權投資淨值 | 553,278,207.57 | 407,673,498.56 |

(2) 對子公司投資

| 被投資單位 | 2020年 | | 本期減少 | 2021年 | 2021年度 | 2021年 |
|--------------|----------------|----------------|------|-----------------------|--------|--------|
| | 12月31日餘額 | 本期增加 | | 12月31日餘額 | 計提減值準備 | 12月31日 |
| 弘業資本管理有限公司 | 240,000,000.00 | 150,000,000.00 | | 390,000,000.00 | | |
| 弘業國際金融控股有限公司 | 156,242,079.81 | | | 156,242,079.81 | | |
| 合計 | 396,242,079.81 | 150,000,000.00 | | 546,242,079.81 | | |

(3) 對聯營、合營企業投資

| 被投資單位 | 2020年 12月31日 金額 | 本年增減變動 | | | | | | | 2021年 12月31日 減值準備 |
|---------------------|-----------------------|--------------|------|---------------------|--------------|--------|---------------------|------------|-------------------------|
| | | 追加投資 | 減少投資 | 權益法下 確認的 投資損益 | 其他綜合 收益調整 | 其他權益變動 | 宣告發放 現金股利 或利潤 | 計提 減值準備 | |
| 聯營企業 | | | | | | | | | |
| 江蘇弘瑞新時代創業 投資有限公司 | 5,379,849.71 | | | -592,738.57 | | | | | 4,787,111.14 |
| 江蘇弘瑞成長創業 投資有限公司 | 6,051,569.04 | 3,943,560.77 | | 141,014.59 | -6.24 | | | | 2,249,016.62 |
| 合計 | 11,431,418.75 | 3,943,560.77 | | -451,723.98 | -6.24 | | | | 7,036,127.76 |

十六、母公司財務報表主要項目註釋(續)

2、手續費及佣金淨收入

(1) 手續費及佣金淨收入情況

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------|-----------------------|----------------|
| 經紀業務手續費淨收入 | 219,932,010.59 | 182,961,013.63 |
| 資產管理業務收入 | 12,182,486.40 | 13,510,439.09 |
| 合計 | 232,114,496.99 | 196,471,452.72 |

(2) 分行政區域營業部及手續費收入情況

| 行政區域名稱 | 2021年度 | | 2020年度 | |
|--------|-----------|-----------------------|--------|----------------|
| | 營業部家數 | 手續費收入 | 營業部家數 | 手續費收入 |
| 江蘇省 | 21 | 176,479,868.29 | 21 | 143,839,700.54 |
| 福建省 | 2 | 8,142,191.25 | 2 | 10,228,973.73 |
| 上海市 | 2 | 5,969,734.05 | 2 | 7,551,840.14 |
| 浙江省 | 2 | 7,355,252.53 | 2 | 6,959,628.21 |
| 河南省 | 1 | 4,326,767.65 | 1 | 5,417,131.25 |
| 廣東省 | 3 | 3,219,301.20 | 3 | 2,772,203.59 |
| 北京市 | 2 | 2,287,775.74 | 2 | 2,754,255.85 |
| 山東省 | 2 | 5,538,829.87 | 2 | 2,422,804.46 |
| 陝西省 | 1 | 4,001,717.60 | 1 | 2,390,309.22 |
| 安徽省 | 2 | 2,968,667.91 | 2 | 2,261,947.07 |
| 遼寧省 | 2 | 2,767,997.90 | 2 | 1,961,438.74 |
| 廣西省 | 1 | 2,267,712.72 | 1 | 1,866,009.54 |
| 湖南省 | 1 | 2,482,675.78 | 1 | 1,851,347.59 |
| 重慶市 | 1 | 1,649,449.92 | 1 | 1,249,918.52 |
| 四川省 | 1 | 691,652.07 | 1 | 1,165,762.23 |
| 山西省 | 1 | 1,272,397.79 | 1 | 976,117.84 |
| 海南省 | 1 | 692,504.72 | 1 | 802,064.20 |
| 合計 | 46 | 232,114,496.99 | 46 | 196,471,452.72 |

十六、母公司財務報表主要項目註釋(續)

3、利息淨收入

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|---------------|----------------------|---------------|
| 利息收入 | | |
| 其中：客戶資金存款利息收入 | 74,535,104.12 | 49,216,475.00 |
| 自有資金存款利息收入 | 9,130,428.00 | 21,908,294.41 |
| 買入返售利息收入 | 186,592.73 | 1,513,399.92 |
| 利息收入合計 | 83,852,124.85 | 72,638,169.33 |
| 利息支出 | | |
| 其中：賣出回購利息支出 | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 利息支出合計 | 865,777.02 | 1,125,483.68 |
| 利息淨收入 | 82,986,347.83 | 71,512,685.65 |

4、投資收益

(1) 投資收益明細情況

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------------|----------------------|---------------|
| 成本法核算的長期股權投資收益 | | |
| 權益法核算的長期股權投資收益 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 其中：聯營企業投資收益 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |
| 合營企業投資收益 | | |
| 處置長期股權投資產生的投資收益 | | |
| 金融工具投資收益 | 43,470,039.79 | 79,662,466.96 |
| 其中：金融工具持有期間取得的收益 | 15,746,710.20 | 18,339,394.00 |
| — 交易性金融工具 | 15,746,710.20 | 18,339,394.00 |
| 處置收益 | 27,723,329.59 | 61,323,072.96 |
| — 交易性金融工具 | 27,723,329.59 | 61,323,072.96 |
| 合計 | 43,018,315.81 | 78,319,576.16 |

十六、 母公司財務報表主要項目註釋(續)

4、 投資收益(續)

(2) 對聯營企業的投資收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|-----------------|-------------|---------------|
| 江蘇弘瑞新時代創業投資有限公司 | -592,738.57 | -1,701,152.21 |
| 江蘇弘瑞成長創業投資有限公司 | 141,014.59 | 358,261.41 |
| 合計 | -451,723.98 | -1,342,890.80 |

(3) 本公司不存在投資收益匯回的重大限制。

5、 公允價值變動收益

| 項目 | 2021年度 | 2020年度 |
|------------------------------|---------------|--------------|
| 交易性金融資產 | -6,835,739.24 | 9,889,309.94 |
| 其中：指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 | -6,835,739.24 | 9,889,309.94 |
| 合計 | -6,835,739.24 | 9,889,309.94 |

十七、 財務報告批准

本財務報告於2022年3月29日由本公司董事會批准報出。

財務報表補充資料

(除特別注明外，金額單位為人民幣元)

1、非經常性損益表

按照中國證券監督管理委員會《公開發行證券的公司信息披露解釋性公告第1號—非經常性損益(2008)》的規定，本集團非經常性損益如下：

| 項目 | 2021年度 |
|--------------------------|--------------|
| 非流動資產處置損益 | -163,754.65 |
| 越權審批或無正式批准文件或偶發性的稅收返還、減免 | |
| 計入當期損益的政府補助 | 3,255,791.90 |
| 除上述各項之外的其他營業外收入和支出 | -702,881.17 |
| 其他符合非經常性損益定義的損益項目 | |
| 小計 | 2,389,156.08 |
| 減：所得稅影響額 | 596,458.10 |
| 少數股東權益影響額(稅後) | |
| 歸屬於母公司所有者的非經常性損益合計 | 1,792,697.98 |

2、淨資產收益率及每股收益

按照中國證監會《公開發行證券的公司信息披露編報規則第九號—淨資產收益率和每股收益的計算及披露》(2010修訂)的要求，本公司淨資產收益率及每股收益如下：

| 報告期利潤 | 報告期 | 加權平均 淨資產收益率(%) | 每股收益 | |
|----------------------------|--------|-------------------|--------|--------|
| | | | 基本每股收益 | 稀釋每股收益 |
| 歸屬於母公司股東的淨利潤 | 2021年度 | 4.84 | 0.0884 | 0.0884 |
| 扣除非經常性損益後歸屬於 於母公司股東的淨利潤 | 2021年度 | 4.73 | 0.0865 | 0.0865 |

弘業期貨股份有限公司

2022年3月29日