

公司代码：603093

公司简称：南华期货

南华期货股份有限公司  
2020 年第三季度报告正文



## 一、重要提示

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

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人罗旭峰、主管会计工作负责人王力及会计机构负责人（会计主管人员）夏海波保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第三季度报告未经审计。

## 二、公司主要财务数据和股东变化

### 2.1 主要财务数据

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	19,119,077,746.14	14,050,296,817.62	36.08%
归属于上市公司股东的净资产	2,463,356,266.06	2,427,324,818.64	1.48%
	年初至报告期末 (1-9月)	上年初至上年报告期末 (1-9月)	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	2,144,832,802.45	699,530,489.33	206.61%
	年初至报告期末 (1-9月)	上年初至上年报告期末 (1-9月)	比上年同期增减(%)
营业收入	7,825,629,032.21	7,639,659,688.24	2.43%
归属于上市公司股东的净利润	67,217,747.62	81,050,479.02	-17.07%

归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	56,035,803.40	68,441,698.15	-18.13%
加权平均净资产收益率(%)	2.75%	3.80%	减少1.05个百分点
基本每股收益(元/股)	0.1191	0.1566	-23.95%
稀释每股收益(元/股)	0.1191	0.1566	-23.95%

## 非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额 (7-9月)	年初至报告期末金额 (1-9月)	说明
非流动资产处置损益			
越权审批,或无正式批准文件,或偶发性的税收返还、减免			
计入当期损益的政府补助,但与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	833,870.63	6,588,529.18	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费			
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益			
非货币性资产交换损益			
委托他人投资或管理资产的损益			
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的			

各项资产减值准备			
债务重组损益			
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等			
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益			
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益			
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益			
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益	49,457.21	-150,242.62	
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回			
对外委托贷款取得的损益			
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益			
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响			
受托经营取得的托管费收入			
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	1,153,980.06	463,577.57	

其他符合非经常性损益定义的损益项目	1,800,310.77	4,474,117.22	
少数股东权益影响额(税后)	6,861.31	40,320.59	
所得税影响额	502,475.23	-234,357.72	
合计	4,346,955.21	11,181,944.22	

## 2.2 截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东(或无限售条件股东)持股情况表

单位:股

股东总数(户)		28,037				
前十名股东持股情况						
股东名称(全称)	期末持股数量	比例(%)	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况		股东性质
				股份状态	数量	
横店集团控股有限公司	425,120,900	73.30	425,120,900	无	-	境内非国有法人
东阳市横华投资合伙企业(有限合伙)	24,480,000	4.22	24,480,000	无	-	境内非国有法人
深圳市建银南山投资有限公司	11,500,000	1.98	-	无	-	境内非国有法人
北京怡广投资管理有限公司	10,772,700	1.86	-	无	-	境内非国有法人
浙江横店进出口有限公司	10,000,000	1.72	10,000,000	无	-	境内非国有法人
横店集团东磁股份有限公司	10,000,000	1.72	10,000,000	无	-	境内非国有法人
光大金控(天津)创业投资有限公司	7,048,400	1.22	-	无	-	境内非国有法人
中国建设银行股份有限公司-国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	2,816,754	0.49	-	无	-	其他
浙江领庆创业投资有限公司	2,500,000	0.43	-	无	-	境内非国有法人
李乐宁	1,235,800	0.21	-	无	-	境内自然人
前十名无限售条件股东持股情况						
股东名称	持有无限售条件		股份种类及数量			

	流通股的数量	种类	数量
深圳市建银南山投资有限公司	11,500,000	人民币普通股	11,500,000
北京怡广投资管理有限公司	10,772,700	人民币普通股	10,772,700
光大金控(天津)创业投资有限公司	7,048,400	人民币普通股	7,048,400
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	2,816,754	人民币普通股	2,816,754
浙江领庆创业投资有限公司	2,500,000	人民币普通股	2,500,000
李乐宁	1,235,800	人民币普通股	1,235,800
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	825,000	人民币普通股	825,000
姚毓頔	342,800	人民币普通股	342,800
中国银行股份有限公司—招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	324,800	人民币普通股	324,800
林梦祥	261,300	人民币普通股	261,300
上述股东关联关系或一致行动的说明	横店控股是公司的控股股东；东阳横华是公司管理层的持股平台，横店控股为普通合伙人，并为东阳横华的执行事务合伙人；横店控股直接持有横店东磁 50.02% 股权；横店控股直接持有横店进出口 100% 股权。除上述关系外，未知前十名其他股东之间是否存在关联关系或属于一致行动人。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

### 2.3 截止报告期末的优先股股东总数、前十名优先股股东、前十名优先股无限售条件股东持股情况表

适用 不适用

## 三、重要事项

### 3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

适用 不适用

资产负债表项目	期末余额	年初余额	变动率	变动原因说明
结算备付金	115,540,677.02	41,501,996.29	178.40%	主要系境外证券业务规模增加
应收质押保证金	919,608,384.00	88,598,728.00	937.95%	主要系本期仓单质押增加
应收风险损失款	1,613,021.83	457,303.14	252.72%	主要系期货客户穿仓金额增加

2020年第三季度报告

应收票据	1,945,003.49	20,731,092.12	-90.62%	主要系票据到期兑付
应收款项融资		4,141,361.05	-100.00%	主要系对应票据均已到期兑付
预付款项	138,741,059.97	86,918,281.49	59.62%	主要系期末基差贸易远期合同增加
其他应收款	581,215,773.80	175,846,874.43	230.52%	主要系境外证券业务客户融资额增加
交易性金融资产	1,045,386,450.10	555,681,148.77	88.13%	主要系套期工具、金融资产投资成本增加
存货	258,712,938.00	668,159,088.03	-61.28%	主要系期末基差贸易业务交付现货
发放贷款及垫款	4,587,166.67	15,733,335.64	-70.84%	主要系本期收回贷款
长期股权投资	3,752,969.41	1,069,879.35	250.78%	主要系公司对外投资增加
应付质押保证金	919,608,384.00	88,598,728.00	937.95%	主要系本期客户仓单质押增加
交易性金融负债	175,511,502.81	105,079,093.68	67.03%	主要系场外衍生品业务销售规模增加
预收款项	49,548,642.93	18,789,363.16	163.71%	主要系期末基差贸易远期合同增加
应付职工薪酬	37,065,715.12	24,247,163.32	52.87%	主要系公司薪酬发放政策调整
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	197,260,226.43	122,020,521.79	61.66%	主要系本期处置金融工具收益增加
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	20,740,298.39	11,577,615.35	79.14%	主要系金融工具产生的公允价值变动增加
提取期货风险准备金	9,832,171.01	6,476,910.22	51.80%	主要系母公司手续费收入增加
税金及附加	3,174,322.77	1,779,680.93	78.36%	主要系收入增加导致税费增加
营业外收入	8,083,741.45	1,109,013.79	628.91%	主要系客户违约赔偿金增加
营业外支出	1,204,803.57	4,594,059.27	-73.77%	主要系待执行合同亏损减少
经营活动产生的现金流量净额	2,144,832,802.45	699,530,489.33	206.61%	主要系客户存入保证金增加
投资活动产生的现金流量净额	-1,358,525,989.08	227,230,058.52	-697.86%	主要系本期银行定期存款增加
筹资活动产生的现金流量净额	-515,328,574.87	547,281,526.28	-194.16%	主要系偿还4.5亿元次级债券

3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

适用 不适用

3.3 报告期内超期未履行完毕的承诺事项

适用 不适用

2016 年 11 月 18 日,本公司全资子公司南华资本公司与浙江省海港投资运营集团有限公司(以下简称海港集团公司)、工银瑞信投资管理有限公司(以下简称工银瑞信公司)共同投资设立浙江海港大宗商品交易中心有限公司,南华资本公司认缴出资比例为 25%,认缴金额为 7500 万元。根据 2017 年 4 月 19 日签订的《浙江海港大宗商品交易中心有限公司股东协议》规定,南华资本公司最迟须于 2018 年 12 月 31 日前实缴出资 3,333.33 万元,截至本报告期末,南华资本公司尚未缴纳出资。根据北京市中喆律师事务所出具的《关于浙江海港大宗商品交易中心有限公司注册资本缴纳的法律意见书》,南华资本公司面临被解除协议或继续履行补缴义务、赔偿海港集团公司及工银瑞信公司实际损失(为诉讼费、律师费等为解决纠纷而支付的合理费用)等法律风险。截至本报告批准报出日,南华资本公司正与相关方就转让所持有的出资权利进行沟通。

### 3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生重大变动的

警示及原因说明

适用 不适用

公司名称	南华期货股份有限公司
法定代表人	罗旭峰
日期	2020 年 10 月 29 日