

南华期货股份有限公司

2020 年年度风险监管指标专项报告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

根据中国证监会《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令第 131 号）等相关规定，南华期货股份有限公司母公司作为从事期货经纪业务、资产管理业务的期货公司，2020 年年度各项监管指标均符合标准，母公司各项数据具体报告如下：

（1）净资本不得低于 3,000 万元，该指标的预警标准为 3,600 万元。公司 2020 年年度净资本为 93,407.20 万元，符合标准。

（2）净资本与风险资本准备总额的比例（净资本/风险资本准备）不得低于 100%，该指标的预警标准为 120%。公司 2020 年 12 月 31 日净资本与风险资本准备总额的比例（净资本/风险资本准备总额）为 219%，符合标准。

（3）净资本与净资产的比例不得低于 20%，该指标的预警标准为 24%。公司 2020 年 12 月 31 日净资本与净资产的比例（净资本/净资产）为 40%，符合标准。

（4）流动资产与流动负债的比例不得低于 100%，该指标的预警标准为 120%。公司 2020 年 12 月 31 日流动资产（不含客户权益）与流动负债（不含客户权益）的比例（流动资产/流动负债）为 467%，符合标准。

（5）负债与净资产的比例不得高于 150%，该指标的预警标准为 120%。公司 2020 年 12 月 31 日负债与净资产的比例（负债/净资产）为 11%，符合标准。

（6）最低限额的结算准备金要求，目前监管指标为 2,280 万元。公司 2020 年 12 月 31 日结算准备金余额为 12,924.22 万元，符合标准。

特此报告。

南华期货股份有限公司董事会

2021 年 3 月 16 日