

证券代码：000900

证券简称：现代投资

公告编号：2018-071

现代投资股份有限公司 2018 年第三季度报告正文

第一节 重要提示

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。

除下列董事外，其他董事亲自出席了审议本次季报的董事会会议

| 未亲自出席董事姓名 | 未亲自出席董事职务 | 未亲自出席会议原因 | 被委托人姓名 |
|-----------|-----------|-----------|--------|
| 张建军 | 董事 | 因公 | 无 |

公司负责人周志中、主管会计工作负责人刘玉新及会计机构负责人(会计主管人员)杨世益声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

是 否

| | 本报告期末 | 上年度末 | 本报告期末比上年度末增减 | |
|---------------------------|-------------------|-------------------|------------------|----------------|
| 总资产（元） | 24,382,315,879.94 | 22,998,026,516.40 | 6.02% | |
| 归属于上市公司股东的净资产（元） | 9,170,499,327.78 | 8,533,393,750.65 | 7.47% | |
| | 本报告期 | 本报告期比上年同期增减 | 年初至报告期末 | 年初至报告期末比上年同期增减 |
| 营业收入（元） | 4,538,841,021.80 | 48.28% | 8,992,171,325.12 | 17.64% |
| 归属于上市公司股东的净利润（元） | 304,994,094.74 | 22.69% | 800,273,390.38 | 22.09% |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元） | 300,126,159.22 | 28.16% | 776,227,750.54 | 23.54% |
| 经营活动产生的现金流量净额（元） | -- | -- | 813,785,681.83 | 13.76% |
| 基本每股收益（元/股） | 0.2009 | 22.65% | 0.5272 | 22.09% |
| 稀释每股收益（元/股） | 0.2009 | 22.65% | 0.5272 | 22.09% |
| 加权平均净资产收益率 | 3.32% | 10.82% | 8.96% | 10.40% |

非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元

| 项目 | 年初至报告期末金额 | 说明 |
|---|---------------|----|
| 非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分） | 2,489,232.37 | |
| 计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外） | 17,868,574.31 | |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | 5,494,320.94 | |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | 3,060,958.16 | |
| 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、交易性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、交易性金融 | 915,239.55 | |

| | | |
|--------------------|---------------|----|
| 负债和可供出售金融资产取得的投资收益 | | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | 639,942.95 | |
| 减：所得税影响额 | 6,424,861.90 | |
| 少数股东权益影响额（税后） | -2,233.46 | |
| 合计 | 24,045,639.84 | -- |

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因

√ 适用 □ 不适用

| 项目 | 涉及金额（元） | 原因 |
|---|----------------|----------|
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | 4,473,943.40 | 子公司经常性业务 |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | 65,066.24 | 子公司经常性业务 |
| 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、交易性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、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 | 114,809,943.46 | 子公司经常性业务 |
| 对外委托贷款取得的损益 | 7,647,733.90 | 子公司经常性业务 |
| 计入当期损益的政府补助中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 | 1,126,290.40 | 子公司经常性业务 |

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东和表决权恢复的优先股股东总数及前 10 名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末普通股股东总数 | 63,927 | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数（如有） | 0 | | | |
|----------------|---------|-----------------------|-------------|--------------|---------|----|
| 前 10 名股东持股情况 | | | | | | |
| 股东名称 | 股东性质 | 持股比例 | 持股数量 | 持有有限售条件的股份数量 | 质押或冻结情况 | |
| | | | | | 股份状态 | 数量 |
| 湖南省高速公路建设开发总公司 | 国有法人 | 27.19% | 412,666,971 | 0 | | |
| 华北高速公路股份有限公司 | 国有法人 | 7.04% | 106,867,207 | 0 | | |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 国有法人 | 3.17% | 48,180,150 | 0 | | |
| 通辽市蒙古王工贸有限公司 | 境内非国有法人 | 2.27% | 34,390,000 | 0 | | |
| 白国义 | 境内自然人 | 1.29% | 19,526,800 | 0 | | |
| 绿地金融投资控股集团有限公司 | 境内非国有法人 | 1.26% | 19,163,735 | 0 | | |
| 嘉实基金—农业银行—嘉实中证 | 其他 | 0.94% | 14,300,694 | 0 | | |

| 金融资产管理计划 | | | | | |
|-----------------------------|---|--------|-------------|---|--|
| 广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.89% | 13,466,034 | 0 | |
| 银华基金—农业银行—银华中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.89% | 13,446,750 | 0 | |
| 南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.87% | 13,206,900 | 0 | |
| 前 10 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数量 | 股份种类 | | | |
| | | 股份种类 | 数量 | | |
| 湖南省高速公路建设开发总公司 | 412,666,971 | 人民币普通股 | 412,666,971 | | |
| 华北高速公路股份有限公司 | 106,867,207 | 人民币普通股 | 106,867,207 | | |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 48,180,150 | 人民币普通股 | 48,180,150 | | |
| 通辽市蒙古王工贸有限公司 | 34,390,000 | 人民币普通股 | 34,390,000 | | |
| 白国义 | 19,526,800 | 人民币普通股 | 19,526,800 | | |
| 绿地金融投资控股集团有限公司 | 19,163,735 | 人民币普通股 | 19,163,735 | | |
| 嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划 | 14,300,694 | 人民币普通股 | 14,300,694 | | |
| 广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划 | 13,466,034 | 人民币普通股 | 13,466,034 | | |
| 银华基金—农业银行—银华中证金融资产管理计划 | 13,446,750 | 人民币普通股 | 13,446,750 | | |
| 南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划 | 13,206,900 | 人民币普通股 | 13,206,900 | | |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 上述股东中，通辽市蒙古王工贸有限公司和白国义为一致行动人。公司未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知其他股东是否属于《上市公司股东持股变动信息披露管理办法》中规定的一致行动人。 | | | | |
| 前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明（如有） | 通辽市蒙古王工贸有限公司通过投资者信用证券账户持有本公司股票 34,390,000 股。白国义通过投资者信用证券账户持有本公司股票 19,520,000 股。 | | | | |

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

是 否

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

2、优先股股东总数及前 10 名优先股股东持股情况表

适用 不适用

第三节 重要事项

一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

单位:元

| 报表项目 | 期末数 | 期初数 | 变动比率（%） | 变动原因 |
|------------------------|------------------|------------------|----------|-----------------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 153,851,969.99 | 230,348,520.01 | -33.21 | 子公司资管产品、基金清仓 |
| 预付账款 | 690,452,084.24 | 46,668,012.09 | 1,379.50 | 预付巴陵农商行投资款及子公司预付大宗商品贸易款增加 |
| 应收利息 | 13,928,322.39 | 7,986,174.77 | 74.41 | 子公司存款、信托理财利息收益增加 |
| 长期应收款 | 111,131,576.55 | 239,548,202.94 | -53.61 | 子公司收回BT、BOT本金 |
| 投资性房地产 | 84,028,442.73 | 63,630,730.24 | 32.06 | 固定资产转入投资性房地产 |
| 在建工程 | 2,578,343,234.50 | 1,863,917,228.67 | 38.33 | 怀芷高速公路建设工程工程款增加 |
| 其他非流动资产 | 234,310,195.42 | 179,816,200.71 | 30.31 | 怀芷高速公路建设预付工程款增加 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 10,087,088.55 | 5,033,698.39 | 100.39 | 子公司期货持仓公允价值变动 |
| 预收账款 | 25,421,296.51 | 39,963,450.97 | -36.39 | 子公司大宗商品贸易预收款减少 |
| 应付职工薪酬 | 34,076,167.89 | 151,386,335.98 | -77.49 | 支付2017年年末计提的职工薪酬 |
| 应付利息 | 25,405,569.34 | 59,736,258.05 | -57.47 | 超短融利息减少 |
| 其他流动负债 | 1,536,200,192.93 | 2,943,954,473.72 | -47.82 | 归还超短融本息 |
| 长期借款 | 8,449,942,903.62 | 6,639,828,660.00 | 27.26 | 增加长期贷款 |
| 专项应付款 | 2,253,771.80 | 1,278,662.91 | 76.26 | 子公司环投专项资金增加 |
| 预计负债 | 582,281.10 | 8,557,081.10 | -93.20 | 上年未决诉讼减少 |
| | 本期数(1-9)月 | 上期数(1-9)月 | 变动比率（%） | 变动原因 |
| 销售费用 | 77,975,318.85 | 22,236,642.17 | 250.66 | 子公司现货贸易业务本期增加玉米非标等农产品品种交易存储 |

| | | | | |
|----------|----------------|---------------|--------|--------------------------|
| | | | | 量,农产品运输费、仓储费用较高 |
| 公允价值变动收益 | -17,634,936.51 | -4,818,133.88 | 266.01 | 子公司期货持仓所产生的浮动亏损 |
| 营业外收入 | 21,396,108.46 | 10,960,247.33 | 95.22 | 税收奖励,处置车辆收入,政府扶持补贴及相关赔偿款 |
| 营业外支出 | 3,018,553.50 | 14,895,633.57 | -79.74 | 固定资产处置费用及路政理赔费用 |

二、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

因筹划重大资产重组,公司股票于2017年10月27日开市起停牌。报告期,交易双方聘请的中介机构基本完成尽职调查、预审及预评估,公司与湘轨控股签订了《资产购买协议》,并公告了重组预案。2018年5月30日,公司股票复牌。截至2018年10月,中介机构完成了尽职调查、审计、评估工作,交易双方签订了《资产购买补充协议》。2018年10月26日,公司公告了重组方案(草案),2018年11月23日召开2018年第二次临时股东大会审议重组相关事项。

| 重要事项概述 | 披露日期 | 临时报告披露网站查询索引 |
|---|-------------|---|
| 关于公司全资子公司现代财富资本管理有限公司对其全资子公司现代商业保理有限公司增资的事项 | 2018年08月21日 | 巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)公告编号:2018-060 |
| 关于公司转让华捷保险代理有限责任公司51%股权的事项 | 2018年08月21日 | 巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)公告编号:2018-061 |
| 现代投资股份有限公司第七届董事会第二十六次会议决议公告、第七届监事会第二十次会议决议公告、关于召开2018年第二次临时股东大会通知公告 | 2018年10月26日 | 巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)公告编号:2018-066、067、068 |

三、公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内超期未履行完毕的承诺事项

√ 适用 □ 不适用

| 承诺事由 | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|--------------------|-----|------|------|------|------|------|
| 股改承诺 | | | | | | |
| 收购报告书或权益变动报告书中所作承诺 | | | | | | |
| 资产重组时所作承诺 | | | | | | |
| 首次公开发行或再融资时所作承诺 | | | | | | |
| 股权激励承诺 | | | | | | |

| | | | | | | |
|---------------|--------------|--|---------------|------------------|-------|------|
| 其他对公司中小股东所作承诺 | 董事、监事、高级管理人员 | | 所持股份在任职期限内不减持 | 2015 年 08 月 27 日 | 任职期限内 | 正在履行 |
| 承诺是否按时履行 | 是 | | | | | |

四、对 2018 年度经营业绩的预计

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大幅度变动的警示及原因说明

适用 不适用

五、证券投资情况

适用 不适用

单位：元

| 证券品种 | 证券代码 | 证券简称 | 最初投资成本 | 会计计量模式 | 期初账面价值 | 本期公允价值变动损益 | 计入权益的累计公允价值变动 | 本期购买金额 | 本期出售金额 | 报告期损益 | 期末账面价值 | 会计核算科目 | 资金来源 |
|-------|--------|------------------|----------------|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|----------|------|
| 境内外股票 | 601901 | 方正证券 | 179,925,346.21 | 公允价值计量 | 68,988,350.47 | | 59,676,425.08 | | | | 59,676,425.08 | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 永富 10 号 | 49,500,000.00 | 公允价值计量 | 49,995,000.00 | 297,000.00 | | | | 297,000.00 | 50,292,000.00 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 华鑫信托*复兴 38 号信托计划 | 30,000,000.00 | 成本法计量 | | | | 30,000,000.00 | 1,768,867.92 | 1,768,867.92 | 30,000,000.00 | 其他资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 大步二号 | 30,000,000.00 | 成本法计量 | | | | 30,000,000.00 | 2,237,841.24 | 660,377.36 | 28,422,536.12 | 其他资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 华鑫信托*复兴 37 号信托计划 | 20,000,000.00 | 成本法计量 | | | | 20,000,000.00 | 1,709,589.05 | 1,709,589.05 | 20,000,000.00 | 其他资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 华鑫信托*华鹏 71 号信托计划 | 30,000,000.00 | 成本法计量 | | -10,000,000.00 | | 30,000,000.00 | 884,433.96 | 884,433.96 | 20,000,000.00 | 其他资产 | 自有资金 |
| 境内外 | 600886 | 国投电 | 15,045,000.00 | 公允价 | 14,680,000.00 | 680,000.00 | | | | 680,000.00 | 15,360,000.00 | 交易性 | 自有资 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-------------|--------|------------------------|--------------------|------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|-----------------|----------|
| 股票 | | 力 | 157.87 | 值计量 | 000.00 | .00 | | | | .00 | 000.00 | 金融资 产 | 金 |
| 其他 | 无 | 精选旗 舰一号 | 1,000,0 00.00 | 公允价 值计量 | 999,900 .00 | 304,600 .00 | | 14,000, 000.00 | | 304,600 .00 | 15,304, 500.00 | 交易性 金融资 产 | 自有资 金 |
| 境内外 股票 | 601009 | 南京银 行 | 4,692,3 76.00 | 公允价 值计量 | 11,610,0 00.00 | -135,00 0.00 | | | | -135,00 0.00 | 11,475,0 00.00 | 交易性 金融资 产 | 自有资 金 |
| 基金 | 003871 | 华泰柏 瑞天添 宝货币 B | 10,000, 000.00 | 公允价 值计量 | | 24,961. 80 | | 10,000, 000.00 | | 24,961. 80 | 10,024, 961.80 | 交易性 金融资 产 | 自有资 金 |
| 期末持有的其他证券投资 | | | 438,463 ,835.90 | -- | 130,726 ,435.74 | -1,455,0 21.05 | | 188,652 ,650.00 | 244,088 ,856.21 | -665,39 5.00 | 75,193, 725.91 | -- | -- |
| 合计 | | | 808,626 ,715.98 | -- | 276,999 ,686.21 | -10,283, 459.25 | 59,676, 425.08 | 322,652 ,650.00 | 250,689 ,588.38 | 5,529,4 35.09 | 335,749 ,148.91 | -- | -- |

六、委托理财

适用 不适用

公司报告期不存在委托理财。

七、衍生品投资情况

适用 不适用

单位：万元

| 衍生品 投资操 作方名 称 | 关联关 系 | 是否关 联交易 | 衍生品 投资类 型 | 衍生品 投资初 始投资 金额 | 起始日 期 | 终止日 期 | 期初投 资金额 | 报告期 内购入 金额 | 报告期 内售出 金额 | 计提减 值准备 金额 (如有) | 期末投 资金额 | 期末投 资金额 占公司 报告期 末净资 产比例 | 报告期 实际损 益金额 |
|------------------------|----------|------------|-----------------|-------------------------|---------------------|---------------------|--------------|------------------|------------------|--------------------------|--------------|--|-------------------|
| 大有期 货 | 关联方 | 否 | 期货 | | 2018年 01月01 日 | 2018年 09月30 日 | 5,685.4 5 | 195,765 .6 | 206,547 .13 | | 5,035.6 3 | 7.76% | 10,131. 71 |
| 国联期 货 | 非关联 方 | 否 | 期货 | | 2018年 01月01 日 | 2018年 09月30 日 | 0 | 52,965. 8 | 52,741. 58 | | 206.7 | 0.32% | -17.52 |
| 国富期 货 | 非关联 方 | 否 | 期货 | | 2018年 01月01 日 | 2018年 09月30 日 | 0 | 2,473.4 | 2,467.3 2 | | 0 | 0.00% | -6.08 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|------------|------|---|----|--------|---------------------|---------------------|--------------|---------------|---------------|---|--------------|-------|---------------|
| 兴证期货 | 非关联方 | 否 | 期货 | | 2018年 01月01 日 | 2018年 09月30 日 | 0 | 57,178. 7 | 57,069. 62 | | 129.08 | 0.20% | 20 |
| 大有期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 99.98 | 2014年 07月01 日 | 2018年 12月31 日 | 0 | 200 | 188.94 | | 0 | 0.00% | -11.06 |
| 中粮期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 900 | 2015年 06月01 日 | 2018年 12月31 日 | 1,676.2 8 | 23,772. 26 | 25,045. 03 | | 1,675.5 4 | 3.76% | 1,272.0 3 |
| 国信期货责任有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 400 | 2015年 08月01 日 | 2018年 12月31 日 | | 2,134.8 1 | 1,983.7 2 | | 0 | 0.00% | -151.09 |
| 中钢期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 500 | 2015年 01月01 日 | 2017年 12月31 日 | 0 | 0 | 0.69 | | 0 | 0.00% | 0.69 |
| 经易金业有限责任公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 1,000 | 2016年 06月01 日 | 2017年 12月31 日 | 988.01 | 0 | 944.13 | | 0 | 0.00% | -43.88 |
| 铜冠金源期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 600 | 2016年 07月01 日 | 2017年 06月30 日 | 0 | 0 | 0 | | 0 | 0.00% | 0 |
| 新湖期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 300 | 2016年 01月01 日 | 2018年 10月31 日 | 0 | 301.1 | 244.45 | | 0 | 0.00% | -56.65 |
| 中信期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 10 | 2016年 03月01 日 | 2018年 12月31 日 | 46.68 | 23,005. 48 | 22,464. 01 | | 1,621.6 2 | 3.64% | 1,033.4 7 |
| AMT 外盘期货 | 非关联方 | 否 | 期货 | 489.38 | 2015年 07月01 日 | 2018年 12月31 日 | 0 | 2,819.9 5 | 418.73 | | 0 | 0.00% | -2,401.2 2 |
| 时瑞外盘期货 | 非关联方 | 否 | 期货 | 330.17 | 2017年 11月01 日 | 2018年 12月31 日 | 326.7 | 4,827.9 7 | | 0 | 202.48 | 0.00% | -5,618.2 7 |
| GF FUTURES | 非关联方 | 否 | 期货 | 665.11 | 2016年 07月01 日 | 2018年 12月31 日 | | 2,448.7 8 | 1,851.4 5 | | | 0.00% | -597.33 |
| 中国银行股份 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2017年 07月01 日 | 2018年 12月31 日 | 800 | 13,070 | 13,628. | | 507.33 | 1.14% | 265.91 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|------|---|----|--------|-------------|-------------|----------|-----------|-----------|--|----------|--------|-----------|
| 有限公司 OTC | 方 | | | | 日 | 日 | | | 58 | | | | |
| 广发期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2018年06月01日 | 2018年12月31日 | | 200 | 228.78 | | 0 | 0.00% | 28.78 |
| 建信期货有限责任公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2017年07月01日 | 2018年12月31日 | 4,298.01 | 11,560 | 19,627.56 | | 124.79 | 0.28% | 3,894.34 |
| 方正中期期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 300 | 2017年06月01日 | 2018年12月31日 | 4,185.61 | 20,966.83 | 19,895.66 | | 3,941.57 | 8.85% | -1,315.21 |
| 国泰君安期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 250 | 2017年07月01日 | 2018年12月31日 | 1,938.34 | 1,800 | 6,358.91 | | 644.37 | 1.45% | 3,264.94 |
| 江海汇鑫期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 500 | 2017年09月01日 | 2018年12月31日 | 2,626.56 | 53,034.81 | 58,660.52 | | 2,327.69 | 5.22% | 5,326.83 |
| 工商银行 OTC | 非关联方 | 否 | 期货 | 356.85 | 2017年08月01日 | 2018年12月31日 | | 2,315.82 | 1,898.9 | | 1,099.44 | 2.47% | 682.53 |
| 银河期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2017年09月01日 | 2018年12月31日 | 3,490.31 | 22,768.05 | 25,596.28 | | 2,569.39 | 5.77% | 1,907.31 |
| 无锡市不锈钢电子交易中心有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 700 | 2018年05月01日 | 2018年12月31日 | | 1,900 | 2,628.37 | | 0 | 0.00% | 728.37 |
| 鲁证期货股份有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2018年05月01日 | 2018年12月31日 | | 10,410.99 | 3,723.94 | | 7,512.76 | 16.86% | 825.7 |
| 国投安信期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 2 | 2018年05月01日 | 2018年12月31日 | | 1 | 1 | | 0 | 0.00% | 0 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|----|--------------|---------------------|---------------------|---------------|----------------|----------------|--|---------------|--------|---------------|
| 五矿经 易期货 有限公 司 | 非关联 方 | 否 | 期货 | 200 | 2018年 09月05 日 | 2018年 12月31 日 | 0 | 1,318.6 | 28.29 | | 1,431.8 4 | 3.21% | 141.53 |
| 上海期 货交易 所 | 非关联 方 | 否 | 期货 | 450 | 2018年 09月01 日 | 2018年 12月31 日 | 0 | 895.74 | 534.74 | | 361 | 0.81% | 0 |
| 中泰证 券股份 有限公 司 | 非关联 方 | 否 | 基金 | 0 | 2018年 05月01 日 | 2018年 12月31 日 | | 300 | 295.32 | | 0 | 0.00% | -4.68 |
| 合计 | | | | 9,053.4 9 | -- | -- | 26,061. 95 | 508,435 .69 | 525,073 .65 | | 29,391. 23 | 61.74% | 19,301. 15 |
| 衍生品投资资金来源 | 自有资金 | | | | | | | | | | | | |
| 涉诉情况（如适用） | 不适用 | | | | | | | | | | | | |
| 报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明（包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等） | 衍生品投资主要为子公司日常经营。衍生品的交易均以期现套利、对冲交易为原则。选择流动性好、成交活跃的品种。在头寸的监控上实行逐日报告制度，严控单边头寸风险及操作风险，所有保证金、期货仓单交割货款全部通过大型期货公司交易，有效控制资金风险、法律风险。 | | | | | | | | | | | | |
| 已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况，对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定 | 交易的品种均为市场活跃品种，交易日按交易所价格交易并结算 | | | | | | | | | | | | |
| 报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明 | 会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比未发生重大变化 | | | | | | | | | | | | |
| 独立董事对公司衍生品投资及风险控制情况的专项意见 | 无 | | | | | | | | | | | | |

八、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

√ 适用 □ 不适用

| 接待时间 | 接待方式 | 接待对象类型 | 调研的基本情况索引 |
|-------------|------|--------|--|
| 2018年08月29日 | 访谈 | 上海证券报 | 中证网 http://news.cnstock.com/paper,2018-08-31,1052203.htm?from=singlemessage |

九、违规对外担保情况

□ 适用 √ 不适用

公司报告期无违规对外担保情况。

十、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

适用 不适用

公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金。