

证券代码：000900

证券简称：现代投资

公告编号：2020-016

现代投资股份有限公司 2020 年第一季度报告正文

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年报的董事会会议

| 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 |
|-----------|-----------|-----------|--------|
| 靳勇 | 董事 | 因公 | 无 |

公司负责人周志中、主管会计工作负责人颜如意及会计机构负责人(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 | 上年同期 | 本报告期比上年同期增减 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|--------------|
| 营业收入（元） | 2,665,652,187.15 | 1,947,666,024.45 | 36.86% |
| 归属于上市公司股东的净利润（元） | -76,997,776.79 | 286,472,947.18 | -126.88% |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元） | -86,863,639.01 | 275,896,509.28 | -131.48% |
| 经营活动产生的现金流量净额（元） | -252,727,471.96 | -364,101,139.20 | |
| 基本每股收益（元/股） | -0.0507 | 0.1887 | -126.87% |
| 稀释每股收益（元/股） | -0.0507 | 0.1887 | -126.87% |
| 加权平均净资产收益率 | -0.77% | 3.03% | -3.80% |
| | 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） | 46,808,883,477.05 | 35,548,487,463.24 | 31.68% |
| 归属于上市公司股东的净资产（元） | 9,996,768,405.10 | 10,100,607,765.33 | -1.03% |

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） | -14,294.84 | |
| 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） | 12,512,515.37 | |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | 484,871.75 | |
| 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 | -2,443,255.25 | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | 2,481,444.87 | |
| 减：所得税影响额 | 3,334,541.14 | |
| 少数股东权益影响额（税后） | -179,121.46 | |

| | | |
|----|--------------|----|
| 合计 | 9,865,862.22 | -- |
|----|--------------|----|

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 | 1,446,973.82 | 子公司正常业务 |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | 2,701,886.80 | 子公司正常业务 |

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东总数和表决权恢复的优先股股东数量及前 10 名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末普通股股东总数 | 63,004 | 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 | | | |
| 招商局公路网络科技控股股份有限公司 | 国有法人 | 8.04% | 122,050,565 | | | |
| 通辽市蒙古王工贸有限公司 | 境内非国有法人 | 3.66% | 55,500,000 | | | |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 国有法人 | 3.17% | 48,180,150 | | | |
| 白国义 | 境内自然人 | 1.01% | 15,300,000 | | | |
| 嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.94% | 14,300,694 | | | |
| 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 | | | |

| 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 | | | |
|--------------------------|---|--------|-------------|--|--|--|
| 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 | | | |
| 易方达基金—农业银行—易方达中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.87% | 13,157,404 | | | |
| 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 | | | |
| 招商局公路网络科技控股股份有限公司 | 122,050,565 | 人民币普通股 | 122,050,565 | | | |
| 通辽市蒙古王工贸有限公司 | 55,500,000 | 人民币普通股 | 55,500,000 | | | |
| 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 | | | |
| 白国义 | 15,300,000 | 人民币普通股 | 15,300,000 | | | |
| 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 | | | |
| 易方达基金—农业银行—易方达中证金融资产管理计划 | 13,157,404 | 人民币普通股 | 13,157,404 | | | |
| 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 55,500,000 股。白国义通过投资者信用证券账户持有本公司股票 15,300,000 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、公司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

| 项目 | 2020年3月31日 | 2019年12月31日 | 变动比率 | 说明 |
|-------------|-------------------|-------------------|----------|-----------------------------------|
| 货币资金 | 3,436,167,747.50 | 4,930,137,392.43 | -30.30% | 主要系银行类子公司存放中央银行款项减少所致 |
| 预付款项 | 368,206,739.94 | 180,070,260.82 | 104.48% | 主要是贸易子公司预付大宗商品贸易款增加所致 |
| 买入返售金融资产 | 644,000,000.00 | 492,000,000.00 | 30.89% | 主要系银行类子公司买入返售金融资产增加所致 |
| 债权投资 | 2,641,649,598.29 | 1,707,709,957.62 | 54.69% | 主要系银行类子公司购买政策性银行债券增加所致 |
| 无形资产 | 23,852,424,078.90 | 12,964,975,780.62 | 83.98% | 主要系本期新增子公司长韶娄高速公路公司增加无形资产 |
| 递延所得税资产 | 130,897,834.79 | 85,422,180.19 | 53.24% | 主要系本期新增子公司长韶娄高速公路公司增加递延所得税资产 |
| 短期借款 | 2,995,870,594.00 | 1,856,628,600.00 | 61.36% | 主要系本期新增子公司长韶娄高速公路公司增加银行贷款 |
| 向中央银行借款 | 218,000,000.00 | 400,000,000.00 | -45.50% | 主要系银行类子公司向中央银行借款减少 |
| 交易性金融负债 | 138,260,140.11 | 5,307,072.64 | 2505.21% | 主要系期货持仓部分浮动亏损 |
| 应付账款 | 442,550,996.55 | 659,268,439.21 | -32.87% | 主要系怀芷高速公路、溆怀高速公路等路段应付工程款减少所致 |
| 预收款项 | 139,823,951.27 | 61,449,806.66 | 127.54% | 主要系贸易子公司预收大宗商品贸易款增加所致 |
| 应付职工薪酬 | 58,276,141.14 | 122,522,792.97 | -52.44% | 本期支付上年末计提的年终薪酬 |
| 应交税费 | 57,505,075.13 | 112,502,611.67 | -48.89% | 疫情防控期间，高速公路免收通行费，导致应付企业所得税、增值税等减少 |
| 其他应付款 | 3,292,666,327.81 | 840,663,779.61 | 291.67% | 主要系增加应付竞购长韶娄高速公路公司股权款所致 |
| 一年内到期的非流动负债 | 247,320,000.00 | 156,320,000.00 | 58.21% | 本期新增子公司长韶娄高速公路公司 |
| 其他流动负债 | 2,800,656,535.16 | 1,797,758,145.17 | 55.79% | 主要系本期新增超短融资券 |
| 长期借款 | 16,309,195,353.52 | 9,242,445,353.52 | 76.46% | 主要系本期新增子公司长韶娄 |

| 项目 | 2020年1-3月 | 2019年1-3月 | 增长率 | 高速公路公司增加银行贷款 |
|---------------------|-------------------|------------------|----------|-----------------------|
| 其中：营业收入 | 2,725,318,800.42 | 1,947,666,024.45 | 39.93% | 主要系贸易子公司大宗商品贸易收入增加 |
| 其中：营业成本 | 2,477,122,095.12 | 1,442,190,597.80 | 71.76% | 主要系贸易子公司大宗商品贸易成本增加 |
| 加：其他收益 | 2,115,531.64 | 1,359,991.39 | 55.55% | 期货子公司本期新增做市商政策性返还补贴 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 159,508,961.63 | 44,811,144.55 | 255.96% | 主要系贸易子公司套期保值期货持仓浮盈增加 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -167,425,339.66 | 61,433,761.04 | -372.53% | 主要系贸易子公司套期保值期货持仓浮亏增加 |
| 信用减值损失（损失以“-”号填列） | -59,944,299.07 | | 100.00% | 主要系银行类子公司贷款减值损失变动所致 |
| 资产减值损失（损失以“-”号填列） | -6,852,893.25 | -26,852,988.64 | -74.48% | |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -83,546,656.59 | 369,469,256.49 | -122.61% | 主要系疫情防控期间，高速公路免收通行费所致 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -252,727,471.96 | -364,101,139.20 | 30.59% | 主要系贸易子公司大宗商品贸易现金净流入增加 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -3,215,107,228.30 | 556,836,068.29 | -677.39% | 主要系本期投资长韶娄公司股权支出增加 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 2,152,454,644.17 | 205,806,197.40 | 945.86% | 主要系本期为竞购长韶娄公司股权增加银行贷款 |

二、重要事项进展情况及影响和解决方案的分析说明

√ 适用 □ 不适用

1. 报告期，公司收到《中国证监会行政许可申请终止审查通知书》（[2020]13号），中国证监会决定终止对公司发行股份及支付现金购买资产申请的审查。

2. 报告期，公司以独立方式参与了湖南长韶娄高速公路有限公司100%股权的竞购，并成功成为湖南长韶娄高速公路有限公司100%股权转让项目受让方，该股权竞购成交价格为转让底价382,509.08万元。

3. 报告期，实施疫情期间免收收费公路车辆通行费政策，对公司主业影响较大。根据《交通运输部关于新冠肺炎疫情防控期间免收收费公路车辆通行费的通知》，相关配套保障政策将另行出台。

| 重要事项概述 | 披露日期 | 临时报告披露网站查询索引 |
|------------------------------|-------------|---------------|
| 关于收到《中国证监会行政许可申请终止审查通知书》的公告 | 2020年01月23日 | 公告编号：2020-002 |
| 关于持股5%以上股东增持公司股份比例超过1%的公告 | 2020年02月08日 | 公告编号：2020-003 |
| 关于参与竞购湖南长韶娄高速公路有限公司100%股权的公告 | 2020年02月21日 | 公告编号：2020-005 |

| | | |
|-------------------------------|------------------|---------------|
| 关于竞购湖南长韶娄高速公路有限公司 100%股权的摘牌公告 | 2020 年 03 月 14 日 | 公告编号：2020-010 |
| 关于竞购湖南长韶娄高速公路有限公司 100%股权的进展公告 | 2020 年 03 月 31 日 | 公告编号：2020-011 |

股份回购的实施进展情况

适用 不适用

采用集中竞价方式减持回购股份的实施进展情况

适用 不适用

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

公司报告期不存在公司实际控制人、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。

四、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 | 86,811,175.41 | | -14,919,106.27 | | | | 71,892,069.14 | 其他权益工具投资 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 国通信托方泰一号 | 20,000,000.00 | 公允价值计量 | | 290,985.20 | | 29,800,000.00 | | 290,985.20 | 30,090,985.20 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 民生信托永丰一号 | 10,000,000.00 | 公允价值计量 | | 249,266.03 | | 29,800,000.00 | | 249,266.03 | 30,049,266.03 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 中融信托汇聚金一号 | 29,800,000.00 | 公允价值计量 | | 209,171.50 | | 29,800,000.00 | | 209,171.50 | 30,009,171.50 | 交易性金融资产 | 自有资金 |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|-------------|---|------------------|----------------|--------|----------------|--|---------------|----------------|----------------|-------|---------------|----------------|---------|------|
| 信托产品 | 无 | 国通信托汇金一号 | 29,800,000.00 | 公允价值计量 | | | 194,149.04 | | 29,800,000.00 | | 194,149.04 | 29,994,149.04 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 信托产品 | 无 | 民生信托中民永丰二号 | 29,800,000.00 | 公允价值计量 | | | 180,759.45 | | 29,800,000.00 | | 180,759.45 | 29,980,759.45 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 永安国富 10 号 | 29,500,000.00 | 公允价值计量 | 30,585,600.00 | | -2,324,600.00 | | | | -2,324,600.00 | 28,261,000.00 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 大有-大石 1 号 | 5,000,000.00 | 公允价值计量 | | | | | 5,000,000.00 | | | 5,000,000.00 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 申龙利贞 2 期私募证券投资基金 | 4,000,000.00 | 公允价值计量 | | | | | 4,000,000.00 | | | 4,000,000.00 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 基金 | 无 | 戊戌威尔稳健一号私募证券投资基金 | 4,000,000.00 | 公允价值计量 | | | | | 4,000,000.00 | | | 4,000,000.00 | 交易性金融资产 | 自有资金 |
| 期末持有的其他证券投资 | | | 5,000,000.00 | -- | 66.79 | | | | 88.30 | 66.79 | | 88.30 | -- | -- |
| 合计 | | | 346,825,346.21 | -- | 117,396,842.20 | | -1,200,268.78 | -14,919,106.27 | 162,000,088.30 | 66.79 | -1,200,268.78 | 263,277,488.66 | -- | -- |

五、委托理财

适用 不适用

公司报告期不存在委托理财。

六、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 | 非关联方 | 否 | 期货 | | 2020年01月01日 | 2020年12月31日 | 10,848.15 | 59,684.07 | 79,483.96 | 0 | 16,669.14 | 1.55% | 25,620.88 |
| 大有期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2019年05月01日 | 2020年12月31日 | 391.14 | 4,536.1 | 5,914.83 | | 167.1 | 0.02% | 1,154.7 |
| 中信期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 372 | 2019年04月01日 | 2020年12月31日 | 174.03 | 1,271.32 | 1,242.3 | | 537.73 | 0.05% | 334.68 |
| 方正中期期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 800 | 2019年12月01日 | 2020年12月31日 | 20 | 2,075.33 | 1,467.31 | | 673.33 | 0.06% | 45.31 |
| 海通期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2019年05月01日 | 2020年12月31日 | 580.3 | 490.13 | 1,472.44 | | 88.11 | 0.01% | 490.12 |
| 银河期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 600 | 2019年11月01日 | 2020年12月31日 | 0.08 | 0.08 | 0.09 | | 0.08 | 0.00% | 0 |
| 江海汇鑫期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2019年03月01日 | 2020年12月31日 | 0.03 | 0 | | | 0 | 0.00% | 0 |
| 大有期货有限 | 非关联方 | 否 | 期货 | 99.98 | 2014年07月01日 | 2020年12月31日 | 3,052.07 | 15,031.67 | 24,141.75 | | 2,666.02 | 0.25% | 8,724.04 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|---------------|------|---|----|--------|-------------|-------------|---------|-----------|-----------|--|----------|-------|-----------|
| 公司 | | | | | 日 | 日 | | | | | | | |
| 中粮期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 900 | 2015年06月01日 | 2020年12月31日 | | 1.5 | 0.08 | | 1.64 | 0.00% | 0.22 |
| 国信期货责任有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 400 | 2015年08月01日 | 2020年12月31日 | | 0 | -0.1 | | 0.1 | 0.00% | 0 |
| 中钢期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 500 | 2015年01月01日 | 2020年12月31日 | | | -30.28 | | 30.4 | 0.00% | 0.11 |
| 新湖期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 300 | 2016年01月01日 | 2020年12月31日 | 449.34 | 11,912.04 | 10,117.34 | | 5,555.84 | 0.52% | 3,311.8 |
| 中信期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 10 | 2016年03月01日 | 2020年12月31日 | | | -0.2 | | 0.2 | 0.00% | 0 |
| 时瑞外盘期货 | 非关联方 | 否 | 期货 | 330.17 | 2017年11月01日 | 2020年12月31日 | 941.74 | 15,614.64 | 2,259.07 | | 8,115.53 | 0.75% | -6,181.78 |
| 中国银行股份有限公司OTC | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2016年12月01日 | 2020年12月31日 | 2,114.1 | 6,720 | 568.56 | | 6,383.5 | 0.59% | -1,882.04 |
| 广发期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2018年06月01日 | 2020年12月31日 | 189.57 | 2,596.01 | 2,748.01 | | 49.48 | 0.00% | 11.91 |
| 建信期货有限责任公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2017年07月01日 | 2020年12月31日 | | | -0.2 | | 0.2 | 0.00% | 0 |

| | | | | | | | | | | | | | |
|------------------|------|---|----|--------|-------------|-------------|----------|-----------|-----------|--|-----------|-------|------------|
| 方正中期期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 300 | 2017年06月01日 | 2020年12月31日 | 1,301.57 | 5,889.99 | 7,328.71 | | 0.2 | 0.00% | 137.34 |
| 国泰君安期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 250 | 2017年07月01日 | 2020年12月31日 | 19.71 | | -57.49 | | 186.6 | 0.02% | 109.41 |
| 江海汇鑫期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 500 | 2017年09月01日 | 2020年12月31日 | | 1,000 | 1,199.9 | | 67.37 | 0.01% | 267.27 |
| 工商银行OTC | 非关联方 | 否 | 期货 | 356.85 | 2017年08月01日 | 2020年12月31日 | 1,938.75 | 24,143.6 | -7,572.63 | | 17,770.86 | 1.65% | -15,884.12 |
| 银河期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2017年09月01日 | 2020年12月31日 | 2,095.08 | 57,513.4 | 58,527.59 | | 1,070.94 | 0.10% | -9.94 |
| 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 | 2020年12月31日 | | 5,000 | 8,303.06 | | 0.7 | 0.00% | 3,303.77 |
| 鲁证期货股份有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 200 | 2018年05月01日 | 2020年12月31日 | 3,077.48 | 46,216.05 | 52,205.57 | | 1,335.36 | 0.12% | 4,247.39 |
| 国投安信期货有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 2 | 2018年05月01日 | 2020年12月31日 | 210.63 | 12,089.59 | 12,269.33 | | 43.76 | 0.00% | 12.88 |
| 五矿 | 非关 | 否 | 期货 | 200 | 2018 | 2020 | 3,016. | 22,047 | 24,411. | | 6,410. | 0.60% | 5,758. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|--|------|---|----|--|------------------|------------------|----------|------------|------------|---|-----------|-------|-----------|
| 经易期货有限公司 | 关联方 | | | | 年 09 月 01 日 | 年 12 月 31 日 | 37 | .01 | 59 | | 07 | 29 | |
| 海通期货股份有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 400 | 2018 年 11 月 01 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 1,976.26 | 122,183.12 | 122,257.65 | | 3,952.15 | 0.37% | 2,050.43 |
| INTC FCST ONE LTD | 非关联方 | 否 | 期货 | 672.35 | 2019 年 03 月 01 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 1,420.17 | 3,660.98 | -828.17 | | 1,051.68 | 0.10% | -4,857.64 |
| 渤海期货股份有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 1,500 | 2019 年 06 月 01 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 534.33 | 50,190.62 | 49,809.64 | | 2,596.82 | 0.24% | 1,681.51 |
| 山东招金集团有限公司 | 非关联方 | 否 | 期货 | 300 | 2019 年 03 月 01 日 | 2020 年 12 月 31 日 | | 400 | 400 | | | 0.00% | |
| MAREX FINANCIAL LIMITED | 非关联方 | 否 | 期货 | 1.4 | 2019 年 09 月 01 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 1.4 | 2,196.77 | 2,091.24 | | 241.46 | 0.02% | 134.53 |
| 合计 | | | | 11,094.75 | -- | -- | 34,352.3 | 472,464.02 | 459,730.95 | 0 | 75,666.37 | 7.03% | 28,581.07 |
| 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） | | | | <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p> | | | | | | | | | |

| | |
|---|------------------------------|
| 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 |

七、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

适用 不适用

公司报告期内未发生接待调研、沟通、采访等活动。

八、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。

九、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。