证券代码:002961　证券简称:瑞达期货　公告编号:2019-026号

瑞达期货股份有限公司公开发行可转换公司债券预案

二〇一九年十一月

公司声明

1、公司及董事会全体成员保证预案内容真实、准确、完整,并确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2、本次公开发行可转换公司债券后,公司经营与收益的变化,由公司自行负责;因本次公开发行可转换公司债券引致的投资风险,由投资者自行负责。

3、本预案是公司董事会对本次公开发行可转换公司债券的说明,任何与之相反的声明均属不实陈述。

4、投资者如有任何疑问,应咨询自己的股票经纪人、律师、专业会计师或其他专业顾问。

5、本预案所述事项并不代表审批机关对于本次公开发行可转换公司债券相关事项的实质性判断、确认、批准或核准。本预案所述本次公开发行可转换公司债券相关事项的生效和完成尚待取得有关审批机关的批准或核准。

一、本次发行符合《上市公司证券发行管理办法》公开发行可转换公司债券条件的说明

根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》以及《上市公司证券发行管理办法》等法律法规的规定,瑞达期货股份有限公司(以下简称“公司”)对照关于上市公司公开发行可转换公司债券资格和条件的规定,对公司的实际情况逐项自查,认为公司各项条件满足现行法律法规和规范性文件中关于申请公开发行可转换公司债券的有关规定,具备公开发行可转换公司债券的条件。

二、本次发行概况

(一)本次发行证券的种类以及上市交易所

本次发行证券的种类为可转换为公司股票的可转换公司债券(以下简称“可转债”)。该可转债及未来转换的股票将在深圳证券交易所上市。

(二)发行规模

本次拟发行可转换公司债券的发行规模不超过人民币65,000万元(含65,000万元),最终发行规模提请公司股东大会授权公司董事会或其授权人士在上述额度范围内与保荐机构(主承销商)协商确定,且不超中国证监会核准的发行规模。

(三)票面金额和发行价格

本次发行的可转债按面值发行,每张面值为人民币100元。

(四)债券期限

本次发行的可转债期限为自发行之日起六年。

(五)债券利率

本次发行的可转债票面利率的确定方式及每一计息年度的最终利率水平,由公司股东大会授权公司董事会或其授权人士在发行前根据国家政策、市场状况和公司具体情况与保荐机构(主承销商)协商确定。

(六)还本付息的期限和方式

本次发行的可转债采用每年付息一次的付息方式,到期归还所有到期未转股的可转债本金和最后一年利息。

1、年利息计算

年利息指可转债持有人按持有的可转债票面总金额自可转债发行首日起每满一年可享受的当期利息。

年利息的计算公式为:I=B×i

I:指年利息额;

B:指本次发行的可转债持有人在计息年度(以下简称“当年”或“每年”)付息债权登记日持有的可转债票面总金额;

i:指可转债的当年票面利率。

2、付息方式

(1)本次发行的可转债采用每年付息一次的付息方式,计息起始日为可转债发行首日;

(2)付息日:每年的付息日为本次发行的可转债发行首日起每满一年的当日,如该日为法定节假日或休息日,则顺延至下一个交易日,顺延期间不另计息。每相邻的两个付息日之间为一个计息年度;

(3)付息债权登记日:每年的付息债权登记日为每年付息日的前一交易日,公司将在每年付息日之后的5个交易日内支付当年利息。在付息债权登记日前(包括付息债权登记日)申请转换成公司股票的可转债,公司不再向其持有人支付本计息年度及以后计息年度的利息;

(4)可转债持有人所获得利息收入的应付税项由持有人承担。

(七)转股期限

本次发行的可转债转股期自可转债发行结束之日起满六个月后的第一个交易日起至可转债到期日止。

(八)转股价格的确定及其调整

1、初始转股价格的确定依据

本次发行可转债的初始转股价格不低于募集说明书公告日前二十个交易日公司股票交易均价(若在该二十个交易日内发生过因除权、除息引起股价调整的情形,则对调整前交易日的收盘价按经过相应除权、除息调整后的价格计算)和前一个交易日公司股票交易均价中的最高者,具体初始转股价格由公司股东大会授权公司董事会或其授权人士在发行前根据市场状况与保荐机构(主承销商)协商确定。

前二十个交易日公司股票交易均价=前二十个交易日公司股票交易总额/该二十个交易日公司股票交易总量。

前一个交易日公司股票交易均价=前一个交易日公司股票交易总额/该日公司股票交易总量。

2、转股价格的调整方式及计算公式

在本次发行之后,当公司因派送股票股利、转增股本、增发新股或配股、派送现金股利等情况(不包括因本次发行的可转债转股而增加的股本)时,将按下述公式进行转股价格的调整(保留小数点后两位,最后一位四舍五入):

派送股票股利或转增股本:P1=P0/(1+n);

增发新股或配股:P1=(P0+A×k)/(1+k);

上述两项同时进行:P1=(P0+A×k)/(1+n+k);

派送现金股利:P1=P0-D;

上述三项同时进行:P1=(P0-D+A×k)/(1+n+k)。

其中:P0为调整前转股价,n为派送股票股利或转增股本率,k为增发新股或配股率,A为增发新股价或配股价,D为每股派送现金股利,P1为调整后转股价。

当公司出现上述股份和/或股东权益变化时,将依次进行转股价格调整,并在中国证监会指定的上市公司信息披露媒体上刊登公告,并于公告中载明转股价格调整日、调整办法及暂停转股时期(如需)。当转股价格调整日为本次发行的可转债持有人转股申请日或之后,转换股份登记日之前,则该持有人的转股申请按公司调整后的转股价格执行。

当公司可能发生股份回购(因股权激励回购除外)、合并、分立或任何其他情形使公司股份类别、数量和/或股东权益发生变化从而可能影响本次发行的可转债持有人的债权利益或转股衍生权益时,公司将视具体情况按照股票、公正、公允的原则以及充分保护本次发行的可转债持有人权益的原则调整转股价格。有关转股价格调整内容及操作办法将依据届时国家有关法律法规及证券监管部门的相关规定制订。

(九)转股价格向下修正条款

1、修正权限与修正幅度

在本次发行的可转债存续期间,当公司股票在任意连续三十个交易日中有十五个交易日的收盘价低于当期转股价格的85%时,公司董事会有权提出转股价格向下修正方案并提交公司股东大会审议表决。

上述方案须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过方可实施。股东大会进行表决时,持有本次发行的可转债的股东应当回避。修正后的转股价格应不低于前述的股东大会召开日前二十个交易日公司股票交易均价和前一个交易日公司股票交易均价中的最高者。同时,修正后的转股价格不得低于最近一期经审计的每股净资产值和股票面值,调整后的转股价格按四舍五入原则精准到0.01元。

若在前述三十个交易日内发生过转股价格调整的情形,则在转股价格调整日前的交易日按调整前的转股价格和收盘价计算,在转股价格调整日及之后的交易日按调整后的转股价格和收盘价计算。

2、修正程序

如公司决定向下修正转股价格,公司将在中国证监会指定的上市公司信息披露媒体上刊登相关公告,公告修正幅度、股权登记日和暂停转股期间等有关信息(如需)。从股权登记日后的第一个交易日(即转股价格修正日)起,开始恢复转股申请并执行修正后的转股价格。

若转股价格修正日为转股申请日或之后,转换股份登记日之前,该类转股申请应按修正后的转股价格执行。

(十)转股股数确定方式以及转股时不足一股金额的处理方法

本次发行的可转债持有人在转股期内申请转股时,转股数量的计算方式为:Q=V/P,并以去尾法取一股的整数倍。

其中:Q为可转换的股票数量;V为可转债持有人申请转股的可转债票面总金额;P为申请转股当日有效的转股价格。

可转债持有人申请转换成的股份须是整数。转股时不足转换为一股的可转债余额,公司将按照深圳证券交易所等部门的有关规定,在可转债持有人转股当日后的五个交易日内以现金兑付该可转债余额及该余额所对应的当期应计利息。

(十一)赎回条款

1、到期赎回条款

在本次发行的可转债期满后5个交易日内,公司将赎回全部未转股的可转债,具体赎回价格由股东大会授权董事会或其授权人士根据发行时市场情况与保荐机构(主承销商)协商确定。

2、有条件赎回条款

在本次发行的可转债转股期内,当下述两种情形的任意一种出现时,公司有权决定按照债券面值加当期应计利息的价格赎回全部或部分未转股的可转债:

(1)在本次发行的可转债转股期内,如果公司股票连续三十个交易日中有十五个交易日的收盘价格不低于当期转股价格的130%(含130%);

(2)当本次发行的可转债未转股余额不足3,000万元时。

当期应计利息的计算公式为:IA=B×i×t/365

IA:指当期应计利息;

B:指本次发行的可转债持有人持有的可转债票面总金额;

i:指可转债当年票面利率;

t:指计息天数,即从上一个付息日起至本计息年度赎回日止的实际日历天数(算头不算尾)。

若在前述三十个交易日内发生过转股价格调整的情形,则在调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算,在调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。

(十二)回售条款

1、有条件回售条款

在本次发行的可转换公司债券最后两个计息年度,如果公司股票在任何连续30个交易日的收盘价格低于当期转股价的70%时,可转换公司债券持有人有权将其持有的可转换公司债券全部或部分按面值加上当期应计利息的价格回售给公司。若在上述交易日内发生过转股价格因发生送红股、转增股本、增发新股(不包括因本次发行的可转换公司债券转股而增加的股本)、配股以及派发现金股利等情况而调整的情形,则在调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算,在调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。如果出现转股价格向下修正的情况,则上述“连续30个交易日”须从转股价格调整之后的第一个交易日起重新计算。

本次发行的可转换公司债券最后两个计息年度,可转换公司债券持有人在每年回售条件首次满足后可按上述约定条件行使回售权一次,若在首次满足回售条件而可转换公司债券持有人未在公司届时公告的回售申报期内申报并实施回售的,该计息年度不能再行使回售权,可转换公司债券持有人不能多次行使部分回售权。

2、附加回售条款

若公司未次发行的可转换公司债券募集资金投资项目的实施情况与公司在募集说明书中的承诺情况相比出现重大变化,根据中国证监会的相关规定被视作改变募集资金用途或被中国证监会认定为改变募集资金用途的,可转换公司债券持有人享有一次回售的权利。可转换公司债券持有人有权将其持有的可转换公司债券全部或部分按债券面值加上当期应计利息的价格回售给公司。可转换公司债券持有人有权将其持有的可转换公司债券满足后,可以在公司届时公告的附加回售申报期内申报并实施回售,该次附加回售申报期内不实施回售的,可转换公司债券持有人不能再行使附加回售权。

(十三)转股年度有关股利的归属

因本次发行的可转换转股而增加的公司股票享有与原股票同等的权益,在股利发放的股权登记日下午收市后登记在册的所有普通股股东(含因可转债转股形成的股东)均参与当期股利分配,享有同等权益。

(十四)发行方式及发行对象

本次可转债的具体发行方式由股东大会授权董事会或其授权人士与保荐人(主承销商)协商确定。

本次可转债的发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券账户的自然人、法人、证券投资基金、符合法律规定的其他投资者等(国家法律、法规禁止者除外)。

(十五)向原公司股东配售的安排

本次发行的可转债给予原股东优先配售权。具体优先配售数量由股东大会授权董事会或其授权人士在发行前根据市场情况确定,并在本次发行的可转债发行公告中予以披露。

原股东优先配售之外的余额和原股东放弃优先配售之后的部分,采用网下对机构投资者发售和通过深圳证券交易所交易系统网上发行相结合的方式进行,余额由承销团包销。具体发行方式由股东大会授权董事会或其授权人士与保荐人(主承销商)在发行前协商确定。

(十六)债券持有人会议相关事项

1、债券持有人的权利与义务

(1)债券持有人的权利:

①依照其所持有的可转债数额享有约定利息;

②根据约定条件将所持有的可转债转为公司股票;

③根据约定的条件行使回售权;

④依照法律、行政法规及《公司章程》的规定转让、赠与或质押其所持有的可转换债券;

⑤按约定的期限和方式要求公司偿付可转换债券本息;

⑥依照法律、《公司章程》的规定获得有关信息;

⑦依照法律、行政法规等相关规定参与或委托代理人参与债券持有人会议并行使表决权;

⑧法律法规、《公司章程》、可转债募集说明书所赋予的其作为公司债权人的其他权利。

(2)债券持有人的义务:

①遵守公司所发行可转换债券条款的相关规定;

②依其所认购的可转债数额缴纳认购资金;

③除法律法规、《公司章程》、可转债募集说明书另有约定外,不得要求公司提前偿付可转换债券的本金和利息;

④遵守债券持有人会议形成的有效决议;

⑤法律法规、《公司章程》、可转债募集说明书规定的其他义务。

2、债券持有人会议的召开情形

存在下列事项之一,应在债券持有人会议权限范围内召开债券持有人会议:

(1)拟变更可转债募集说明书的约定;

(2)公司未能按期支付本次可转债本息;

(3)公司发生减资(因股权激励回购股份导致的减资除外)、合并、分立、解散或申请破产;

(4)修订《可转换公司债券持有人会议规则》;

(5)发生其他对债券持有人权益有重大实质影响的事项;

(6)根据法律法规、《公司章程》及《可转换公司债券持有人会议规则》的规定,应由债券持有人会议审议并决定的其他事项。

3、债券持有人会议的召集程序

公司董事会负责召集债券持有人会议。

当出现应召开债券持有人会议的事项时,董事会应在30日内召开会议。

董事会不能履行或不履行召集会议职责的,连续90日及以上单独或合计持有未偿还债券总数10%及以上的债券持有人可根据《可转换公司债券持有人会议规则》的规定自行召集会议。

在会议决议公告前,召集会议的债券持有人所持债券数量比例不得低于未偿还债券总数的10%。

(十七)本次募集资金用途

本次发行的可转债所募集资金总额不超过6.5亿元(含6.5亿元),扣除发行费用后拟全部用于补充公司营运资金,在可转债持有人转股后增加公司资本金,以扩大业务规模,优化业务结构,提升公司的市场竞争力和抗风险能力。

(十八)担保事项

本次发行的可转债不提供担保。

(十九)募集资金存管

公司已建立《公司募集资金管理制度》,本次发行的募集资金将存放于公司董事会决定的专项账户中,具体开户事宜在发行前由公司董事会确定,并在发行公告中披露募集资金专项账户的相关信息。

(二十)本次发行方案的有效期限

本次发行可转债决议的有效期为公司股东大会审议通过本次发行方案之日起十二个月。

本次发行可转债方案需经中国证监会核准后方可实施,且最终以中国证监会核准的方案为准。

三、财务会计信息及管理层讨论与分析

(一)公司最近三年及一期的资产负债表、利润表、现金流量表

公司2016年度、2017年度及2018年度财务报表已经致同会计师事务所(特殊普通合伙)(以下简称“致同所”)审计并出具了标准无保留意见的审计报告(致同审字(2019)第350ZA0278号),公司2019年1-9月财务报表未经审计。以下将2016年度、2017年度、2018年度和2019年1-9月简称为“报告期”。

1、资产负债表

(1)合并资产负债表

单位:元

项目	2019.9.30.	2018.12.31.	2017.12.31.	2016.12.31.
资产:				
货币资金	3,267,649,910.24	2,273,340,715.82	3,142,772,920.38	3,506,815,920.44
其中:期货保证金存款	2,655,216,819.91	1,870,556,033.54	2,831,775,089.02	3,292,145,561.58
应收货币保证金	1,575,632,009.56	1,098,863,056.61	1,300,181,650.96	1,132,323,745.79
应收质押保证金	8,434,800.00	12,314,400.00	41,572,000.00	53,640,800.00
交易性金融资产	244,391,671.19	–	–	–
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	–	152,269,852.05	44,025,175.00	30,030,297.50
衍生金融资产	797,868.87	–	390,280.00	
应收结算担保金	11,410,568.37	11,371,240.46	11,476,548.57	10,056,946.89
应收账款	–	–	922,221.64	–
应收利息	–	26,348,189.09	35,719,456.06	13,179,344.43
其他应收款	18,944,463.26	16,271,512.99	7,378,486.40	13,910,297.96
存货	5,851,752.21	–	3,964,461.54	–
可供出售金融资产	–	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
期货会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00	1,400,000.00	1,847,256.00
固定资产	36,858,582.41	39,837,782.64	54,145,367.50	58,218,646.90
在建工程	466,213,416.47	347,253,183.77	180,231,375.96	82,278,071.27
无形资产	336,636,398.47	342,045,231.66	349,109,619.93	356,591,580.93
商誉	5,501,692.30	5,501,692.30	5,501,692.30	5,501,692.30
递延所得税资产	3,576,967.26	3,841,556.04	4,746,466.60	8,247,238.83
其他资产	8,356,467.42	7,195,584.86	7,481,816.27	7,141,167.74
资产总计	5,991,686,533.03	4,341,853,994.09	5,196,008,549.11	5,372,850,051.98
负债:				
应付货币保证金	3,648,597,396.00	2,501,627,491.11	3,568,700,476.89	3,974,648,501.63
应付质押保证金	8,434,800.00	12,314,400.00	41,572,000.00	53,640,800.00
交易性金融负债	56,239,340.16	–	–	
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	–	10,326,211.59	–	–
衍生金融负债	2,024,873.59	2,030,690.00	–	
期货风险准备金	107,463,958.06	101,650,528.31	91,414,250.80	81,258,151.22
应付期货投资者保障基金	129,644.55	134,509.42	144,011.03	403,925.89
应付职工薪酬	6,829,704.79	9,304,351.48	12,361,131.68	13,930,308.43
应交税费	6,984,925.41	5,575,816.15	13,269,136.25	26,543,647.50
应付利息	–	436,691.66	184,906.94	264,672.25
其他应付款	19,438,526.46	14,971,509.79	31,466,226.71	30,361,530.12
预计负债	–	–	3,639,022.98	
长期借款	400,639,000.00	295,000,000.00	130,000,000.00	140,000,000.00
递延所得税负债	3,265,977.40	417,941.76	2,392,733.28	68,251.49
其他负债	50,024,648.47	16,177,156.26	9,880,200.00	8,648,429.37
递延收益	591,680.72	634,974.44	692,699.40	750,424.36
负债合计	4,311,364,484.61	2,970,601,281.97	3,895,685,795.84	4,230,515,642.26
股东权益:				
股本	445,000,000.00	400,000,000.00	400,000,000.00	400,000,000.00
资本公积	266,599,163.15	93,966,238.62	93,966,238.62	93,966,238.62
其他综合收益	4,400,589.51	2,416,908.25	-791,428.05	108,361.12
盈余公积	94,742,909.27	94,742,909.27	81,897,254.64	66,067,018.36
一般风险准备	119,071,380.22	119,071,380.22	106,225,725.59	90,396,489.31
未分配利润	750,478,015.27	661,065,275.76	619,024,959.47	491,807,302.31
归属于母公司股东权益合计	1,680,292,048.42	1,371,262,712.12	1,300,322,753.27	1,142,334,409.72
股东权益合计	1,680,292,048.42	1,371,262,712.12	1,300,322,753.27	1,142,334,409.72
负债和股东权益总计	5,991,686,533.03	4,341,853,994.09	5,196,008,549.11	5,372,850,051.98

(2)合并利润表

单位:元

项目	2019年1-9月	2018年度	2017年度	2016年度
一、营业收入	707,470,930.74	471,071,282.06	513,109,226.26	464,284,401.06
手续费收入	139,966,076.34	226,153,367.39	237,899,338.99	282,739,081.20
利息净收入	61,664,283.07	100,775,685.22	125,526,864.77	156,494,284.85
投资收益(损失"-")	8,595,118.53	-3,560,203.68	3,740,928.34	-3,890,502.48
其中:对联营企业和合营企业的投资收益(损失"-")	–	–	–	–
公允价值变动收益(损失"-")	13,210,215.18	-11,015,215.23	14,471,489.65	-1,781,127.90
汇兑收益(损失"-")	-423,072.91	-919,197.30	8,163.81	-84,044.04
其他业务收入	483,847,767.27	148,946,883.40	125,977,770.93	30,772,689.93
资产处置收益	-46,656.35	7,610,890.00	-23,963.71	5,247.46
其他收益	668,179.61	3,078,508.26	5,508,423.58	28,792.04
二、营业支出	686,418,777.14	317,082,810.44	294,456,429.70	180,261,528.09
提取期货风险准备金	5,813,418.75	10,237,509.51	10,156,099.58	10,769,041.07
税金及附加	1,182,920.87	1,740,701.47	2,167,156.14	7,351,679.73
业务及管理费	97,899,010.43	156,581,680.43	156,830,098.42	133,374,888.43
资产减值损失	288,696.68	569,914.00	119,198.38	887,720.12
信用减值损失	-746,744.67	–	–	–
其他业务成本	481,981,475.08	148,963,006.03	125,183,878.18	27,878,298.74
三、营业利润	121,052,153.60	153,988,471.62	218,652,796.56	284,022,872.97
加:营业外收入	5,664.95	3,636,992.44	270,697.23	1,692,830.29
减:营业外支出	583,042.35	847,848.35	5,035,486.37	149,203.22
四、利润总额	120,474,776.20	156,676,615.71	213,888,007.42	285,566,499.96
减:所得税费用	28,161,429.54	41,944,990.16	55,009,877.70	73,082,123.37
五、净利润	92,313,346.66	114,731,625.55	158,878,129.72	212,464,376.58
(一)按经营持续性分类:				
其中:持续经营净利润	92,313,346.66	114,731,625.55	158,878,129.72	212,464,376.58
(二)按所有权归属分类:				
其中:归属于母公司所有者的净利润	92,313,346.66	114,731,625.55	158,878,129.72	212,464,376.58
六、其他综合收益的税后净额	1,981,680.70	3,198,333.30	-889,786.17	-452,328.22
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额	1,981,680.70	3,198,333.30	-889,786.17	-452,328.22
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益	–	–	–	–
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益	1,981,680.70	3,198,333.30	-889,786.17	-452,328.22
1.可供出售金融资产公允价值变动损益	–	–	–	-560,689.34
2.外币财务报表折算差额	1,981,680.70	3,198,333.30	-889,786.17	108,361.12
归属于少数股东的综合收益总额	–	–	–	–
七、综合收益总额	94,295,027.36	117,929,958.85	157,988,343.55	212,012,048.36
归属于母公司股东的综合收益总额	94,295,027.36	117,929,958.85	157,988,343.55	212,012,048.36
归属于少数股东的综合收益总额	–	–	–	–
八、每股收益				
(一)基本每股收益	0.23	0.29	0.40	0.53
(二)稀释每股收益	0.23	0.29	0.40	0.53

(3)合并现金流量表

单位:元

项目	2019年1-9月	2018年度	2017年度	2016年度
一、经营活动产生的现金流量:				
收取利息、手续费及佣金的现金	199,696,263.75	349,850,560.60	366,049,779.80	472,319,782.81
收到其他与经营活动有关的现金	1,982,648,330.35	977,212,190.81	197,040,100.63	4,631,833,172.52
经营活动现金流入小计	2,182,344,594.10	1,327,062,744.41	563,089,880.43	5,104,152,955.33
支付给职工以及为职工支付的现金	42,715,994.74	58,794,038.85	67,272,736.31	66,432,065.98
以现金支付的业务及管理费	62,214,964.28	113,264,629.42	64,223,715.90	60,576,439.14
支付的各项税费	29,202,480.77	60,601,627.65	75,472,566.26	119,629,185.27
支付其他与经营活动有关的现金	2,444,384,406.54	1,258,772,461.03	1,781,223,270.64	2,750,036,719.38
经营活动现金流出小计	2,578,517,846.33	1,491,432,756.95	1,988,190,277.31	2,992,674,409.77
经营活动产生的现金流量净额	-396,173,252.23	-164,370,012.54	-1,425,100,396.88	2,111,478,545.56
二、投资活动产生的现金流量:				
收回投资收到的现金	546,483,340.29	545,071,114.93	31,622,322.15	39,775,174.13
取得投资收益收到的现金	1,614,277.00	1,065,027.21	706,205.00	842,016.25
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金	–	8,712,952.00	4,670.00	38,780.00
收到其他与投资活动有关的现金	1,703,867.57	264,318.88	434,661.89	52,473,504.90
投资活动现金流入小计	549,801,484.86	556,113,413.02	32,767,859.04	93,129,475.28
投资支付的现金	740,096,462.86	629,738,763.71	28,501,066.66	22,485,429.85
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	66,988,085.85	153,203,088.78	91,796,713.60	59,615,729.11
支付其他与投资活动有关的现金	650,000.00	400,000.00	15,000,000.00	–
投资活动现金流出小计	808,634,548.71	783,341,852.49	135,297,780.26	82,101,158.96
投资活动产生的现金流量净额	-258,833,063.85	-228,228,439.47	-102,529,921.22	11,028,316.32
三、筹资活动产生的现金流量:				
吸收投资收到的现金	230,650,000.00	–	–	–
取得借款收到的现金	105,000,000.00	165,000,000.00	90,000,000.00	40,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	156,005,493.00	10,500,000.00	–	–
筹资活动现金流入小计	490,605,493.00	175,500,000.00	90,000,000.00	40,000,000.00
偿还债务所支付的现金	–	–	100,000,000.00	–
分配股利、利润或偿付利息所支付的现金	12,094,016.68	57,809,536.09	10,472,630.54	7,501,868.77
其中:子公司支付少数股东的现金股利	–	–	–	–
支付其他与筹资活动有关的现金	19,833,228.53	402,800.00	936,400.00	380,000.00
筹资活动现金流出小计	31,927,262.21	58,212,336.09	111,409,030.54	7,881,868.77
筹资活动产生的现金流量净额	458,728,240.79	117,287,663.91	-21,409,030.54	32,118,131.23
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	468.64	7,703,826.50	-9,829,471.26	574,518.16
五、现金及现金等价物净增加额	-196,277,619.66	-277,606,961.60	-1,568,868,819.90	2,156,199,511.27
加:期初现金及现金等价物余额	845,366,480.03	1,122,973,441.63	2,691,842,261.53	535,642,750.26
六、期末现金及现金等价物余额	649,088,860.48	845,366,480.03	1,122,973,441.63	2,691,842,261.53

(4)母公司资产负债表

单位:元

项目	2019.9.30.	2018.12.31.	2017.12.31.	2016.12.31.
资产:				
货币资金	3,061,794,167.25	2,091,668,518.65	2,931,563,346.74	3,511,978,181.95
其中:期货保证金存款	2,570,825,249.56	1,761,909,227.64	2,690,615,284.31	3,224,515,558.94
应收货币保证金	1,536,034,986.45	1,041,589,356.17	1,223,977,611.76	1,075,812,030.53
应收质押保证金	8,434,800.00	12,314,400.00	41,572,000.00	53,640,800.00
交易性金融资产	222,375,276.36	–	–	–
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	–	146,471,861.41	32,853,988.00	10,440,880.00
应收结算担保金	10,067,560.37	10,056,940.46	10,056,943.70	10,056,946.89
应收利息		25,634,785.22	35,719,456.06	13,179,344.43
其他应收款	320,368,500.67	306,640,210.71	298,662,435.79	288,719,527.73
长期股权投资	325,457,130.01	225,457,130.01	225,457,130.01	170,287,070.01
期货会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00	1,400,000.00	1,400,000.00
固定资产	36,846,267.41	39,804,573.29	53,900,508.48	57,838,091.31
无形资产	5,378,973.93	5,187,015.86	4,783,682.45	3,797,921.78
递延所得税资产	2,468,401.27	3,018,244.25	4,409,106.97	6,871,834.20
其他资产	7,284,386.13	5,949,561.36	4,546,012.87	5,962,742.29
资产总计	5,627,900,438.94	3,915,192,586.29	4,868,902,221.83	5,209,975,371.12
负债:				
应付货币保证金	3,720,257,613.93	2,394,733,694.46	3,378,243,488.27	3,762,162,108.46
应付质押保证金	8,434,800.00	12,314,400.00	41,572,000.00	53,640,800.00
期货风险准备金	107,463,958.06	101,650,528.31	91,414,250.80	81,258,151.22
应付期货投资者保障基金	129,644.55	134,509.42	144,011.03	403,925.89
应付职工薪酬	5,940,411.62	8,223,731.73	11,121,547.50	13,025,730.97
应交税费	6,239,494.78	5,531,608.00	13,136,727.70	25,899,408.28
应付利息	–	–	–	207,777.81
其他应付款	7,660,742.69	12,829,963.36	29,663,731.81	13,672,151.03
预计负债	–	–	3,391,961.32	–
长期借款	–	–	–	100,000,000.00
递延所得税负债	3,265,500.18	415,363.43	2,264,538.10	–
递延收益	591,680.72	634,974.44	692,699.40	750,424.36
负债合计	3,860,083,846.30	2,536,468,784.15	3,571,634,965.93	4,071,010,478.02
股东权益:				
股本	445,000,000.00	400,000,000.00	400,000,000.00	400,000,000.00
资本公积	266,599,163.15	93,966,238.62	93,966,238.62	93,966,238.62
盈余公积	94,742,909.27	94,742,909.27	81,897,254.64	66,067,018.36
一般风险准备	119,071,380.22	119,071,380.22	106,225,725.59	90,396,489.31
未分配利润	752,403,140.00	670,953,274.13	615,188,037.06	488,546,146.81
股东权益合计	1,677,816,592.64	1,378,723,802.24	1,297,277,255.90	1,138,964,893.10
负债和股东权益总计	5,527,900,438.94	3,915,192,586.29	4,868,902,221.83	5,209,975,371.12

(5)母公司利润表

单位:元

项目	2019年1-9月	2018年度	2017年度	2016年度
一、营业收入	206,879,282.65	323,513,375.52	370,017,855.11	441,062,034.16
手续费收入	131,606,269.18	219,894,582.01	229,801,333.00	282,267,836.09
利息净收入	58,795,349.88	98,048,677.14	125,577,884.43	156,489,585.46
投资收益(损失"-")	3,568,671.01	2,682,576.03	181,397.48	1,870,927.50
其中:对联营企业和合营企业的投资收益(损失"-")	–	–	–	–
公允价值变动收益(损失"-")	11,661,546.98	-7,396,698.66	9,220,448.61	461,770.15
汇兑收益(损失"-")	-362,923.36	-396,483.19	-247,678.28	-62,094.54
其他业务收入	–	–	–	–
资产处置收益	-46,656.35	7,610,890.00	-23,963.71	5,247.46
其他收益	668,025.31	3,069,830.19	5,508,423.58	28,792.04
二、营业支出	96,746,678.14	156,161,416.20	153,325,899.57	149,008,429.07
提取期货风险准备金	5,813,418.75	10,237,509.51	10,156,099.58	10,769,041.07
税金及附加	785,402.41	1,473,544.43	1,840,622.25	7,103,048.78
业务及管理费	89,785,327.71	143,124,353.06	141,504,043.08	130,525,490.80
资产减值损失	362,529.27	326,009.20	-174,865.34	610,848.82
其他业务成本	–	–	–	–
三、营业利润	109,132,604.51	168,351,959.32	216,691,955.54	292,053,605.09
加:营业外收入	5,664.96	3,445,127.41	172,816.22	1,698,225.46
减:营业外支出	582,842.36	771,843.89	4,493,695.79	153,226.96
四、利润总额	108,555,427.02	171,025,242.84	212,371,157.97	293,498,603.59
减:所得税费用	27,105,561.15	42,568,695.50	54,068,795.17	73,745,090.57
五、净利润	81,449,865.87	128,456,546.34	158,302,362.80	219,753,563.02
六、其他综合收益的税后净额	–	–	–	-379,506.78
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益	–	–	–	–
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益	–	–	–	-379,506.78
1.可供出售金融资产公允价值变动损益	–	–	–	-379,506.78
2.外币财务报表折算差额	–	–	–	–
七、综合收益总额	81,449,865.87	128,456,546.34	158,302,362.80	219,374,057.24

(6)母公司现金流量表

单位:元

项目	2019年1-9月	2018年度	2017年度	2016年度
一、经营活动产生的现金流量:				
收取利息、手续费及佣金的现金	192,967,490.48	341,451,066.89	357,930,400.19	471,829,446.23
收到其他与经营活动有关的现金	1,344,274,315.79	906,774,963.17	55,156,780.42	4,577,510,535.71
经