证券代码:000876　　证券简称:新 希 望　　公告编号:2020-65

新希望六和股份有限公司

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。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人刘畅、主管会计工作负责人王述华及会计机构负责人(会计主管人员)陈静声明: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)	20,568,194,867.98	16,211,692,429.69	26.87%
归属于上市公司股东的净利润(元)	1,626,867,776.40	666,394,021.12	144.13%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润(元)	1,690,460,979.28	723,549,454.53	133.63%
经营活动产生的现金流量净额(元)	157,570,146.85	20,415,409.81	671.82%
基本每股收益(元/股)	0.39	0.16	143.75%
稀释每股收益(元/股)	0.39	0.16	143.75%
加权平均净资产收益率	5.99%	3.09%	增长 2.90 个百分点
	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)	77,788,547,658.22	64,217,666,883.55	21.13%
归属于上市公司股东的净资产(元)	28,509,440,810.68	26,061,689,948.56	9.39%

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)	-61,519,568.30	公司处置固定资产、生产性生物资产、长期股权投资损益。
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)	32,987,332.49	政府补助收益。
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	-7,418,829.04	公司购买交易性金融资产取得的收益。
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-28,638,804.01	主要是畜禽养殖正常死淘支出。
其他符合非经常性损益定义的损益项目	0.00	
减:所得税影响额	-1,070,140.73	
少数股东权益影响额(税后)	73,474.75	
合计	-63,593,202.88	--

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

公司报告期不存在将根据《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、列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

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	77,910	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	
南方希望实业有限公司	境内非国有法人	29.21%	1,231,525,830	0			
新希望集团有限公司	境内非国有法人	24.91%	1,050,163,129	0			
中国证券金融股份有限公司	境内非国有法人	2.98%	125,602,591	0			
西藏思壮投资咨询有限公司	境内非国有法人	2.54%	107,166,626	0			
香港中央结算有限公司	境外法人	2.35%	99,089,553	0			
西藏善诚投资咨询有限公司	境内非国有法人	2.30%	96,852,884	0			
拉萨开发区和之望实业有限公司	境内非国有法人	1.32%	55,559,692	0			
赖大建	境内自然人	1.01%	42,741,359	0			
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	0.98%	41,319,400	0			
中信证券股份有限公司	国有法人	0.81%	34,173,682	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				
南方希望实业有限公司	1,231,525,830	人民币普通股	1,231,525,830				
新希望集团有限公司	1,050,163,129	人民币普通股	1,050,163,129				
中国证券金融股份有限公司	125,602,591	人民币普通股	125,602,591				
西藏思壮投资咨询有限公司	107,166,626	人民币普通股	107,166,626				
香港中央结算有限公司	99,089,553	人民币普通股	99,089,553				
西藏善诚投资咨询有限公司	96,852,884	人民币普通股	96,852,884				
拉萨开发区和之望实业有限公司	55,559,692	人民币普通股	55,559,692				
赖大建	42,741,359	人民币普通股	42,741,359				
中央汇金资产管理有限责任公司	41,319,400	人民币普通股	41,319,400				
中信证券股份有限公司	34,173,682	人民币普通股	34,173,682				
上述股东关联关系或一致行动的说明	新希望集团为南方希望的控股股东,双方互为一致行动人。除此之外,公司未知公司前十大股东是否存在其他关联关系或一致行动的情形。						

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

1、本期货币资金与上期期末比较增加 463,243.83 万元,增幅 80.19%,主要系公司将加大投资,储备货币资金增加所致;

2、本期交易性金融资产与上期期末比较增加 150.76 万元,增幅 32.81%,主要系公司衍生品投资公允价值变动所致;

3、本期应收票据与上期期末比较下降 4,509.22 万元,降幅 70.36%,主要系公司票据结算方式减少所致;

4、本期应收账款与上期期末比较增加 35,969.15 万元,增幅 40.23%,主要系公司在饲料销售上,采取给予客户一定的赊销额度,在年底收回欠款的销售政策,导致应收账款比年初数增长;

5、本期预付款项与上期期末比较增加 26,871.25 万元,增幅 41.71%,主要系预付猪苗款、饲料原料款增加所致;

6、本期应收利息与上期期末比较增加 2,449.36 万元,增幅 46.45%,主要系公司存款计提应收利息增加所致;

7、本期存货与上期期末比较增加 307,785.72 万元,增幅 33.07%,主要系公司猪产业消耗性生物资产增加所致;

8、本期生产性生物资产与上期期末比较增加 139,253.83 万元,增幅 55.47%,主要系公司猪产业生产性生物资产增加所致;

9、本期其他非流动资产与上期期末比较增加 73,590.81 万元,增幅 60.86%,主要系公司预付长期资产款项增加所致;

10、本期交易性金融负债与上期期末比较增加 353.50 万元,增幅 67.45%,主要系公司衍生品投资公允价值变动所致;

11、本期应付利息与上期期末比较增加 1,874.96 万元,增幅 40.97%,主要系本报告期计提短期借款及债券利息增加所致;

12、本期一年内到期的非流动负债与上期期末比较下降 39,872.28 万元, 降幅 46.89%,主要系公司本期偿还部分年初的一年内到期的长期借款所致;

13、本期长期借款与上期期末比较增加 402,959.29 万元,增幅 81.33%,主要系公司调整债务结构,长期借款增加所致;

14、本期其他综合收益与上期期末比较下降 14,999.42 万元,降幅 360.89%,主要系公司外币财务报表折算差额影响其他综合收益变动所致;

15、本期提取保险合同准备金净额与同期比较增加 224.82 万元,增幅 76.49%,主要系担保公司提取保险合同准备金增加所致;

16、本期管理费用与同期比较增加 26,249.23 万元,增幅 47.19%,主要系公司大力发展猪产业,公司规模增加,相应费用增加所致;

17、本期研发费用与同期比较增加 1,303.77 万元,增幅 37.92%,主要系公司加大研发投入所致;

18、本期财务费用与同期比较增加 9,344.28 万元,增幅 89.38%,主要系公司债务融资规模增加,导致利息支出增加所致;

19、本期公允价值变动收益与同期比较下降 758.41 万元,降幅 283.78%,主要系公司投资金融产品公允价值变动所致;

20、本期信用减值损失与同期比较增加 1,460.72 万元,增幅 87.19%,主要系公司应收账款计提信用减值损失增加所致;

21、本期资产减值损失与同期比较增加 2,207.42 万元,增幅 145.55%,主要系公司本期部分存货减值损失转回所致;

22、本期资产处置收益与同期比较下降 1,197.34 万元,降幅 32.67%,主要系公司生产性生物资产处置收益影响所致;

23、本期营业外收入与同期比较增加 408.71 万元,增幅 39.47%,主要系公司清理无法支付的应付款项增加所致;

24、本期净利润与同期比较增加 109,479.42 万元,增幅 119.89%,主要原因:一是公司猪产业生猪出栏数量稳步提升,且受行情影响,生猪销售价格持续上涨,公司养猪产业利润同比大幅上涨;二是公司饲料产业不断加强产品研发、市场开发与服务,持续提升饲料产业的产品力、采购力、制造力、服务力,实现销量与利润均较同期有较大幅度增长;

25、本期经营活动产生的现金流量净额与同期比较增加 13,715.47 万元, 增幅 671.829%,主要原因是公司经营利润较同比大幅增加;

26、本期投资活动产生的现金流量净额与同期比较下降 454,267.59 万元,降幅 663.79%,主要系公司猪产业固定资产投入增加所致;

27、本期筹资活动产生的现金流量净额与同期比较增加 1,085,087.65 万元,增幅 921.36%,主要系公司取得借款增加所致。

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

1、公司股东新希望集团拟于未来 6 个月内以不低于 2 亿元人民币,不超过 4 亿元人民币增持公司股份,增持价格不超过人民币 20.00 元/股(含)。

2、经中国证监会"证监许可[2019]1902 号"文核准,公司于 2020 年 1 月 3 日公开发行了 4,000 万张可转换公司债券,每张面值 100 元,发行总额 400,000 万元。

经深交所"深证上[2020]60 号"文件同意,公司 400,000 万元可转换公司债券于 2020 年 2 月 4 日起在深交所挂牌交易,债券简称"希望转债",债券代码"127015"。可转换公司债券存续的起止日期为 2020 年 1 月 3 日至 2026 年 1 月 2 日,转股的起止日期为 2020 年 7 月 9 日至 2026 年 1 月 2 日。

重要事项概述	披露日期	临时报告披露网站查询索引
公司股东拉萨经济技术开发区新望投资有限公司于 2019 年 8 月 12 日至 11 月 8 日以集中竞价交易方式减持公司股份 9,487,438 股,比例为 0.23%。	2020 年 02 月 12 日	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn);《股东减持计划到期终止的公告》(公告编号:2020-19)
燕君芳、杨凌丰意股权投资管理中心(有限合伙)、杨凌香源股权投资管理中心(有限合伙)、康顺户、雷宁利及燕岁芳合计持有公司的有限售条件股份 12,159,930 股于 2020 年 2 月 25 日解除限售并上市流通。	2020 年 02 月 22 日	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn);《关于非公开发行限售股上市流通的提示性公告》(公告编号:2020-20)
中国银行间市场交易商协会同意接受公司人民币 30 亿元的超短期融资券注册。	2020 年 02 月 26 日	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn);《关于申请发行超短期融资券获准注册的公告》(公告编号:2020-21)
公司控股股东新希望集团有限公司于 2020 年 2 月 26 日至 2 月 27 日通过大宗交易方式累计减持"希望转债"4,300,000 张,占公司发行总量的 10.75%。	2020 年 02 月 29 日	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn);《关于债券持有人减持公司可转换公司债券的公告》(公告编号:2020-23)
公司于 2020 年 3 月 9 日发行 2020 年度第一期中期票据(疫情防控债),发行总额 20 亿元人民币,期限 3 年,利率为 3.43%。	2020 年 03 月 11 日	巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn);《关于公司 2020 年度第一期中期票据(疫情防控债)发行结果的公告》(公告编号:2020-32)

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

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	新希望集团有限公司	股份减持 承诺	新希望集团有限公司自获得流通权之日起,在 36 个月内不上市交易或者转让股份。在上述禁售期满后,只有在任一连续 5 个交易日公司股票收盘价达到 6.8 元以上时,方可以不低于 6.8 元挂牌出售原非流通股。公司实施利润分配、资本公积金转增、增发新股、配股、可转换债券转股或全体股东同比例缩股时,上述出售股份的价格将做相应调整。	2006 年 01 月 19 日	无	恪守承诺
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	无	无	无	无	无	无
资产重组时所作承诺	新希望集团有限公司;南方希望实业有限公司;刘永好	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	为维护公司在重大资产重组后的合法权益,以上股东承诺:承诺人目前并没有直接或间接地从事任何与上市公司所从事的业务构成同业竞争的业务活动;在承诺人实际控制上市公司期间,承诺人及承诺人所控制的其他企业(除上市公司外)将不直接或间接从事任何与上市公司构成竞争或可能构成竞争的业务,亦不从事任何可能导致上市公司利益受损的活动。	2010 年 12 月 31 日	无	恪守承诺
	新希望集团有限公司;南方希望实业有限公司	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	为减少和规范公司重大资产重组后可能产生的关联交易,以上股东承诺:尽量避免或减少与上市公司及其下属子公司之间的关联交易;对于无法避免或有合理理由存在的关联交易,将与上市公司依法签订规范的关联交易协议,并按照有关法律、法规、规章、其他规范性文件和公司章程的规定履行批准程序,关联交易价格依照与无关联关系的独立第三方进行相同或相似交易时的价格确定,保证关联交易价格具有公允性;保证按照有关法律、法规和公司章程的规定履行关联交易的信息披露义务;保证不利用关联交易非法转移上市公司的资金、利润,不利用关系交易损害上市公司及非关联股东的利益。	2010 年 12 月 31 日	无	恪守承诺
	新希望集团有限公司;南方希望实业有限公司	其他承诺	公司重大资产重组完成后,南方希望将成为公司股东,新希望集团控制的公司股份进一步增加,新希望集团及南方希望就确保公司独立性事宜承诺如下:一、保证上市公司资产独立;二、保证上市公司的财务独立;三、保证上市公司机构独立;四、保证上市公司业务独立;五、保证上市公司人员相对独立。	2010 年 12 月 31 日	无	恪守承诺
	燕君芳	股份限售承诺	自通过出售本人所持本香农业 12.83%股权所获得新希望发行股份(即 8,755,151 股,系以 8.38 元/股的发行价格进行计算,若该等发行价格因公司出现派发股利、送红股、转增股本等除息、除权变动事项作相应调整时,前述股份数量亦将作相应调整)完成上市之日 36 个月届满之日前,本人不会转让或委托他人管理,也不会要求上市公司收购本人所持有的上市公司本次向本人直接非公开发行的该部分股票。	2017 年 01 月 24 日	2020-02-25	恪守承诺
	康顺户;雷宁利;燕岁芳;杨凌丰意股权投资管理中心(有限合伙);杨凌香源股权投资管理中心(有限合伙)	股份限售承诺	自本次新增股份上市之日 36 个月届满之日前,本人/本企业不会转让或委托他人管理,也不会要求新希望收购新希望本次向本人/本企业直接非公开发行的股票。	2017 年 01 月 24 日	2020-02-25	恪守承诺
	高展河;燕君芳;燕岁芳;杨凌丰意股权投资管理中心(有限合伙);杨凌香源股权投资管理中心(有限合伙)	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	在本方持有上市公司、杨凌本香股份/股权期间: 1、本方、本方关系密切的家庭成员(包括配偶、父母、配偶的父母、兄弟姐妹及其配偶、年满十八周岁的子女及其配偶、配偶的兄弟姐妹和子女配偶的父母、下同)、本方及本方关系密切的家庭成员控制(包括直接控制和间接控制)的企业目前没有、将来也不以任何方式直接或间接从事与上市公司及其控股子公司主要从事的种猪繁育、生猪养殖、屠宰、加工及饲料生产业务(简称"上市公司主营业务")构成同业竞争的任何活动。 2、对本方及本方关系密切的家庭成员控制的下属全资企业、直接或间接控股的企业,本方及本方关系密切的家庭成员将通过派出机构和人员(包括但不限于董事、经理)以及行使控股地位使该等企业履行本承诺函中与本方相同的义务,保证不与上市公司的主营业务发生同业竞争。 3、如本方、本方关系密切的家庭成员、本方及本方关系密切的家庭成员拥有控制权的企业有任何商业机会可从事、参与任何可能与上市公司主营业务构成竞争的活动,则立即将上述商业机会通知上市公司,在通知中所指定的合理期间内,上市公司作出愿意利用该商业机会的肯定答复的,则尽力将该商业机会给予上市公司。 4、本方确认本承诺函所载的每一项承诺均为可独立执行之承诺,任何一项承诺若被视为无效或终止将不影响其他各项承诺的有效性;如违反上述任何一项承诺,本方愿意承担由此给上市公司造成的直接或间接经济损失、索赔责任及与此相关的费用支出。	2016 年 12 月 28 日	无	恪守承诺
	高展河;燕君芳;燕岁芳;杨凌丰意股权投资管理中心(有限合伙);杨凌香源股权投资管理中心(有限合伙)	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	在本方持有上市公司、杨凌本香股份/股权且本方或本方的关联企业被界定为证券监管规则规定的上市公司及其控股子公司的关联方期间: 1、就本方及本方控制的企业(如有)与上市公司及其控股子公司之间已存在及将来不可避免发生的关联交易事项,保证遵循市场交易的公平原则即正常的商业条款与上市公司及其控股子公司发生交易。如未按市场交易的公平原则与上市公司及其控股子公司发生交易,而给上市公司及其控股子公司造成损失或已经造成损失,由本方承担赔偿责任。 2、本方将善意履行作为上市公司股东的义务,充分尊重上市公司的独立法人地位,保障上市公司独立经营、自主决策。本方将严格按照中国《公司法》以及上市公司的公司章程的规定,促使经本方提名的上市公司董事(如有)依法履行其应尽的诚信和勤勉责任。 3、本方及本方的关联企业承诺不以借款、代偿债务、代垫款项或者其他方式占用上市公司资金,也不要求上市公司为本方及本方的关联企业进行违规担保。 4、如果上市公司在今后的经营活动中必须与本方或本方的关联企业发生不可避免的关联交易,本方将促使此等交易严格按照国家有关法律法规、上市公司章程和上市公司的有关规定履行有关程序,在上市公司股东大会对关联交易进行表决时,本方严格履行回避表决的义务;与上市公司依法签订协议,及时进行信息披露;保证按照正常的商业条件进行,且本方及本方的关联企业将不会要求或接受上市公司给予比在任何一项市场公平交易中第三者更优惠的条件,保证不通过关联交易损害上市公司及其他股东的合法权益。 5、本方及本方的关联企业将严格和善意地履行其与上市公司签订的各种关联交易协议。本方及本方的关联企业将不会向上市公司谋求任何超出上述协议规定以外的利益或收益。	2016 年 12 月 28 日	无	恪守承诺
	高展河;燕君芳	其他承诺	1、延安本源黄章猪场项目、延川永香的生态型商品猪养殖小区建设项目、志丹鼎香的生态型生猪养殖基地项目正在办理环评批复,该等建设项目办理环评批复不存在实质性法律障碍。 2、本香农业及其子公司养殖基地、饲料厂、屠宰及肉制品加工厂的排污设施运转正常,未造成重大环境污染事故。 3、我等及相关公司将积极对相关公司的环保设备进行整改、升级、更换等,并积极与政府有关主管部门进行充分协商和沟通,力争早日取得相应的环评批复、环评验收及排污许可,解决该等环保不规范情形。 4、若因本次发行股份支付现金购买资产前相关环保不规范情形导致相关公司被有关政府主管部门处以行政处罚或要求承担其它法律责任,我等将视情况积极采取相关措施,补偿相关公司因此产生的全部经济损失,尽力减轻或消除不利影响。	2016 年 12 月 28 日	2020-02-25	恪守承诺
首次公开发行或再融资时所作承诺	无	无	无	无	无	无
股权激励承诺	无	无	无	无	无	无
其他对公司中小股东所作承诺	无	无	无	无	无	无
承诺是否按时履行	是					
如承诺超期未履行完毕的,应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划	不适用					

四、证券投资情况

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在证券投资。

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

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
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 01 月 10 日	2020 年 03 月 18 日		154.37	209.61				55.24
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 19 日	2020 年 03 月 19 日		33.06	33.43				0.37
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 25 日	2020 年 03 月 25 日		35.68	33.75				-1.93
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 18 日	2020 年 03 月 26 日		166.31	200.01				33.7
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 27 日	2020 年 03 月 30 日		52.17	53.92				1.75
鲁证期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 25 日	2020 年 06 月 30 日		205.93	205.55		-42.4		-42.78
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 02 月 07 日	2020 年 03 月 19 日		19.39	3.13				-16.26
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 01 月 15 日	2020 年 03 月 09 日		8.53	3.51				-5.02
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 01 月 15 日	2020 年 03 月 30 日		21.01	7.01				-14
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 03 月 19 日	2020 年 03 月 26 日		7.16	3.93				-3.23
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 03 月 19 日	2020 年 03 月 30 日		19.5	8.51				-10.99
鲁证期货股份有限公司	无	否	期权合约		2020 年 03 月 25 日	2020 年 06 月 30 日		30.17	60.15		-30.16		-0.18
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 12 月 23 日	2020 年 05 月 31 日		571.88	586.61				14.73
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 12 月 23 日	2020 年 09 月 30 日		345.15	346.94				1.79
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 12 月 28 日	2020 年 03 月 31 日	1	95.42	73.73				-22.69
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 10 月 31 日	2020 年 05 月 31 日	-11.81	1,391.65	1,314.91		-63.4		-128.33
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 12 月 25 日	2020 年 09 月 30 日	-8.79	930.61	941.72		-137.3		-117.4
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 13 日	2021 年 01 月 31 日		101.91	101.85		-23		-23.06
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 10 月 08 日	2020 年 01 月 31 日	4.29	82.93	52.72				-34.5
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 12 月 25 日	2020 年 05 月 30 日	12.12	1,781.46	2,725.45		-455.95		475.92
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2019 年 11 月 13 日	2020 年 09 月 30 日	-21.91	1,743.9	779.3		346.6		-596.09
金瑞期货股份有限公司	无	否	期货合约		2020 年 03 月 31 日	2020 年 09 月 30 日		54.63	54.6		7.4		7.37
INTL FCStone Financial Inc.	无	否	期货		2019 年 01 月 01 日	2020 年 06 月 30 日							-38.33
星展银行	无	否	利率掉期		2019 年 04 月 29 日	2020 年 04 月 29 日	66.98		-31.44		33.7		-64.72
法国农业信贷银行	无	否	利率掉期		2019 年 04 月 29 日	2020 年 04 月 29 日	49.18		-31.52		33.6		-47.1
星展银行	无	否	利率掉期		2019 年 04 月 29 日	2020 年 05 月 05 日	133.15		-58.59		69.65		-122.09
JPM 摩根大通	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 16 日	2020 年 06 月 19 日					-123.84		-123.84
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 25 日	2020 年 06 月 19 日					16.6		16.6
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 19 日	2020 年 07 月 07 日					-0.93		-0.93
Westpac 西太平洋银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 05 日	2020 年 10 月 09 日					3.86		3.86
Westpac 西太平洋银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 25 日	2020 年 10 月 09 日					-0.58		-0.58
Westpac 西太平洋银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 04 日	2020 年 04 月 07 日					8.21		8.21
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 09 日	2020 年 04 月 07 日					5.63		5.63
JPM 摩根大通	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 04 日	2020 年 04 月 14 日					7.58		7.58
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 04 日	2020 年 04 月 14 日					7.99		7.99
JPM 摩根大通	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 09 日	2020 年 04 月 14 日					18.23		18.23
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 09 日	2020 年 04 月 23 日					6.58		6.58
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 12 日	2020 年 04 月 23 日					8.2		8.2
JPM 摩根大通	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 12 日	2020 年 05 月 22 日					22.43		22.43
JPM 摩根大通	无	否	外汇远期		2020 年 03 月 09 日	2020 年 10 月 09 日					13.92		13.92
CA	无	否	外汇远期		2019 年 05 月 06 日	2020 年 01 月 03 日	-81.85		-81.85				
CA	无	否	外汇远期		2019 年 05 月 13 日	2020 年 01 月 03 日	-92.4		-92.4				
UOB	无	否	外汇远期		2019 年 06 月 03 日	2020 年 01 月 03 日	-291.07		-291.07				
ANZ	无	否	外汇远期		2019 年 07 月 05 日	2020 年 01 月 02 日	87.15		87.15				
CA	无	否	外汇远期		2019 年 08 月 05 日	2020 年 01 月 03 日	97.8		97.8				
SCB	无	否	外汇远期		2019 年 08 月 02 日	2020 年 01 月 03 日	-7.6		-7.6				
CA	无	否	外汇远期		2019 年 11 月 26 日	2020 年 01 月 15 日	7.76		0.07				-7.69
ANZ 澳新银行	无	否	外汇远期		2019 年 12 月 18 日	2020 年 01 月 10 日	-2.28		-9.19				-6.91
ANZ 澳新银行	无	否	外汇远期		2019 年 12 月 18 日	2020 年 02 月 10 日	-5.38		-26.97				-21.59
ANZ 澳新银行	无	否	外汇远期		2019 年 12 月 18 日	2020 年 01 月 10 日	-0.98		-4.79				-3.81
BNP 法巴银行	无	否	外汇远期		2020 年 02 月 06 日	2020 年 03 月 20 日			2.07				2.07
合计				0	--	--	-64.64	7,852.82	7,352.01		-267.38	0.00%	-741.88
衍生品投资资金来源	公司自筹												
涉诉情况(如适用)	不适用												
衍生品投资审批董事会公告披露日期(如有)	2018 年 08 月 31 日												
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)	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) 一、风险分析 商品期货套期保值操作可以有效管理原材料的采购价格风险,特别是减少原料大幅下跌时,较高的库存带来的跌价损失对公司的影响,但同时也会存在一定风险: 1、价格异常波动风险:理论上,各交易品种在交割期的期货市场价格和现货市场价格将会回归一致,极个别的非理性市场情况下,可能出现期货和现货价格在交割期仍然不能回归,因此出现系统性风险事件,从而对公司的套期保值操作方案带来影响,甚至造成损失。 2、资金风险:期货交易按照公司下达的操作指令,如投入金额过大,可能造成资金流动性风险,甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。 3、技术风险:可能因为计算机系统不完备导致技术风险。为防范汇率及利率波动对公司利润和股东权益造成不利影响,公司需要开展保值型汇率和利率的资金交易业务,以减少外汇与利率风险敞口,但同时在存在一定风险: 1、市场风险。保值型资金交易业务的合约汇率/利率与到期日实际汇率/利率的差异将产生投资损益;在保值型资金交易业务的存续期内,每一会计期间将产生重估损益,至到期日重估损益的累计值等于投资损益。 2、流动性风险。保值型外汇资金交易业务以公司外汇收支预算为依据,与实际外汇收支相匹配,以保证在交割时拥有足额资金供清算,或选择净额交割衍生品,以减少到期日现金流需求;保值型利率资金交易业务均将按照利率差额的净额来进行交割。 3、履约风险。公司保值型资金交易业务交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行,基本不存在履约风险。 4、其它风险。在开展业务时,如操作人员未按规定程序进行保值型资金交易业务操作或未充分理解衍生品信息,将带来操作风险;如交易合同条款的不明确,将可能面临法律风险。 二、风险管理策略 商品期货套期保值风险管理策略: 1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配,严格控制期货头寸。 2、严格控制套期保值的资金规模,合理计划和使用保证金,严格按照公司期货交易管理制度规定下达操作指令,根据规定进行审批后,方可进行操作。 3、公司已制定了《衍生品投资管理制度》及《期货管理制度》,对套期保值业务作出了明确规定,设立了专门的期货操作团队、期货操作监控团队和相应的业务流程,通过实行授权和岗位牵制,以及进行内部审计等措施进行控制。 4、建立了主要品种中长期走势预警机制,按照市场价格走势的监控机制,由公司期货操作和监控团队定期对主要品种的未来一个时期的走势进行预判,以保证期货品种在异常波动时作出及时判断和处置。 保值型资金交易业务风险管理策略: 1、公司开展的保值型资金交易业务以减少汇率波动对公司影响为目的,禁止任何风险投机行为;公司保值型资金交易业务额不得超过经董事会或股东大会批准的授权额度上限;公司不得进行带有杠杆的资金交易行为。 2、公司业务工作小组在开展资金交易业务前需进行交易业务的风险分