

华泰证券股份有限公司

601688

2010 年半年度报告

目 录

一、重要提示	2
二、公司基本情况	2
三、股本变动及股东情况	4
四、董事、监事和高级管理人员情况	7
五、董事会报告	7
六、重要事项	18
七、财务会计报告（未经审计）	31
八、备查文件目录	31

一、重要提示

1、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料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。

2、公司负责人和主管会计工作负责人吴万善先生、会计机构负责人舒本娥女士声明：保证本半年度报告中的财务报告真实、完整。

3、本报告经公司第一届董事会第十九次会议、第一届监事会第六次会议审议通过。

4、本公司不存在被控股股东及其关联方非经常性占用资金情况。

5、本公司不存在违反规定决策程序对外提供担保的情况。

6、本公司半年度财务报告未经审计。

二、公司基本情况

（一）公司名称

中文名称：华泰证券股份有限公司

中文简称：华泰证券

英文名称：HUATAI SECURITIES CO., LTD.

英文缩写：HTSC

（二）公司股票简况

股票种类：A股

公司股票上市交易所：上海证券交易所

股票简称：华泰证券

股票代码：601688

（三）公司地址

公司注册地址：江苏省南京市中山东路90号

公司办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

邮政编码：210002

公司国际互联网网址：<http://www.htsc.com.cn>

电子邮箱：webmaster@mail.htsc.com.cn

（四）公司法定代表人：吴万善

（五）公司董事会秘书：姜健

联系地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦（邮政编码：210002）

联系电话：025-84457777

传真：025-84579938

电子信箱：jiangjian@mail.htsc.com.cn

证券事务代表：赵远宽

联系地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦（邮政编码：210002）

联系电话：025-84579943

传真：025-84579938

电子信箱：zhaoyuankuan@mail.htsc.com.cn

（六）公司信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》

登载公司半年度报告的中国证监会指定网站的网址：<http://www.sse.com.cn>

公司半年度报告备置地点：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦27楼

（七）主要财务数据和指标

1、主要会计数据和财务指标

项目	单位:元		币种:人民币
	2010年6月30日	2009年12月31日	本报告期比上年度期末增减(%)
总资产	104,903,215,973.67	98,801,776,569.56	6.18
归属于母公司股东权益	30,653,186,039.61	13,921,314,844.58	120.19
归属于母公司股东的每股净资产	5.47	2.89	89.27
项目	2010年1-6月	2009年1-6月	本报告期比上年同期增减(%)
营业利润	1,779,724,940.54	2,506,451,292.02	-28.99
利润总额	1,778,285,064.83	2,504,924,766.74	-29.01

归属于母公司股东的净利润	1,420,347,648.47	1,754,011,053.88	-19.02
扣除非经常性损益后归属于母公司的净利润	1,421,395,318.04	1,755,758,092.44	-19.04
基本每股收益	0.2661	0.3898	-31.73
扣除非经常性损益后基本每股收益	0.2663	0.3902	-31.75
稀释每股收益	0.2661	0.3898	-31.73
加权平均净资产收益率(%)	5.71	17.53	减少 11.82 个百分点
经营活动产生的现金流量净额	-13,075,152,793.13	7,251,869,950.77	-280.30
每股经营活动产生的现金流量净额	-2.33	1.61	-244.88

非经常性损益项目表

非经常性损益项目	2010 年 1-6 月	说明
非流动资产处置损益	312,997.12	处理固定资产收益
除上述各项之外的其他营业外收支净额	-1,752,872.83	主要系地方基金、捐赠及一次性房补等支出
减：所得税费用影响	-338,487.34	
非经常性损益合计	-1,101,388.37	
其中：归属于母公司的非经常性损益	-1,047,669.57	
归属于少数股东的非经常性损益	-53,718.80	

净资产收益率和每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于普通股股东的净利润	5.71	0.2661	0.2661
扣除非经常性损益后归属于普通股股东的净利润	5.71	0.2663	0.2663

三、股本变动及股东情况

(一) 股本变动情况

2010 年 2 月 9 日，经中国证监会证监许可[2010]138 号文《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复》同意，公司首次公开发行人民币普通股(A 股)78,456.1275 万股，其中，网上资金申购发行的 54,919.3 万股股票已于 2010 年 2 月 26 日起在上海证券交易所上市交易。网下向询价对象配售的 23,536.8275 万股，根据《证券发行与承销管理办法》的有关规定，于 2010 年 5 月 26 日起在上海证券交易所上市交易。根据《境内证券市场转持部分国有股充实全国社会保障基金实施办法》(财企[2009]94 号)和江苏省人民政府国有资产监督管理委员会《关于同意华泰证券股份有限公司国有股转持的批复》(苏国资复[2010]2 号)，本次发行 A 股 78,456.1275 万股，公司 33 家国有股东单位所持的 7,698.5238 万股发行人股份划转由全

国社会保障基金理事会持有，转持股份数量占本次发行股份数量的 9.81%，转持股份均于 A 股发行前顺利完成划转过户。A 股发行完成后，本公司全部股份均登记托管于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。

1、公司股份变动情况表：

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例（%）	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例（%）
一、有限售条件股份	4815438725	100	0	0	0	0	0	4815438725	85.99
1、国家持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2、国有法人持股	4210438234	87.44	0	0	0	0	0	4210438234	75.19
3、其他内资持股	605000491	12.56	0	0	0	0	0	605000491	10.80
其中：									
境内非国有法人持股	605000491	12.56	0	0	0	0	0	605000491	10.80
境内自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、外资持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
其中：									
境外法人持股									
境外自然人持股									
二、无限售条件股份	0	0	784561275	0	0	0	784561275	784561275	14.01
1、人民币普通股	0	0	784561275	0	0	0	784561275	784561275	14.01
2、境内上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
3、境外上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、其他	0	0	0	0	0	0	0	0	0
三、股份总数	4815438725	100	784561275	0	0	0	784561275	5600000000	100

(二) 主要股东持股情况介绍

1、报告期末股东总数：164831 户。

2、截至 2010 年 6 月 30 日，公司前十名股东持股情况：

单位：股

股东名称	股东性质	持股比例（%）	持股总数	报告期内股份变动数量	持有有限售条件股份数量	质押或冻结的股份数量
江苏省国信资产管理集团有限公司	国有法人	24.4230	1367687495	-26226031	1367687495	0
江苏交通控股有限公司	国有法人	8.4968	475819370	-9124053	475819370	0
江苏汇鸿国际集团有限公司	国有法人	7.8498	439588150	-8429303	439588150	0
江苏高科技投资集团	国有法人	7.6089	426096799	-8170600	426096799	0

有限公司						
国华能源投资有限公司	国有法人	6.5187	365048543	-6999972	365048543	0
江苏省丝绸集团有限公司	国有法人	6.0968	341418259	-6546851	341418259	0
江苏宏图高科技股份有限公司	境内非国有法人	2.6360	147618708	0	147618708	144749146
上海星聚投资管理有限公司	境内非国有法人	2.5676	143786827	0	143786827	0
海澜集团有限公司	境内非国有法人	2.4107	135000000	0	135000000	60000000
江苏苏豪国际集团股份有限公司	国有法人	2.3473	131447067	-2014606	131447067	0

注 1：公司前十名股东所持股份均为人民币普通股 A 股，均为有限售条件股份。前十名股东报告期内的股份变动原因，系划转由全国社会保障基金理事会持有，均已于公司 A 股发行前顺利完成划转过户。

注 2：上表中，江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、江苏省丝绸集团有限公司均为江苏省国资委所属独资企业。江苏省丝绸集团有限公司是江苏苏豪国际集团股份有限公司的控股股东，持有其国有法人股 17611.2 万股，占该公司总股本的 69.89%，构成母子公司关系。此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。

3、截至 2010 年 6 月 30 日，公司前十名无限售条件股东持股情况： 单位：股

股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类
中国平安人寿保险股份有限公司（注 3）	59080066	人民币普通股
中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 指数证券投资基金	9846671	人民币普通股
全国社保基金五零一组合	8205559	人民币普通股
光大证券股份有限公司	6564447	人民币普通股
五矿集团财务有限责任公司	4299713	人民币普通股
平安信托投资有限责任公司	3938668	人民币普通股
中国银行—华夏大盘精选证券投资基金	3938668	人民币普通股
招商银行股份有限公司—光大保德信优势配置股票型证券投资基金	3917854	人民币普通股
中国建设银行—宝康消费品证券投资基金	3668424	人民币普通股
中国银行—嘉实沪深 300 指数证券投资基金	3441550	人民币普通股

注 3：上表中，中国平安人寿保险股份有限公司的持股数系“中国平安人寿保险股份有限公司—万能一个险万能”、“中国平安人寿保险股份有限公司—分红一个险分红”、“中国平安人寿保险股份有限公司—分红一团险分红”和“中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红”四个证券帐户的合计持股数，该四个帐户分别持有 29540053 股、9846671 股、9846671 股和 9846671 股。

4、前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	江苏国信资产管理集团有限公司	1,367,687,495	2013 年 2 月 26 日	1,367,687,495	自上市之日起锁定 36 个月
2	江苏交通控股有限公司	475,819,370	2014 年 7 月 30 日	2,327,587	自持股之日起锁定 60 个月
			2013 年 2 月 26 日	473,491,783	自上市之日起锁定 36 个月
3	江苏汇鸿国际集团有限公司	439,588,150	2013 年 2 月 26 日	439,588,150	自上市之日起锁定 36 个月
4	江苏高科技投资集团有限公司	426,096,799	2013 年 2 月 26 日	426,096,799	自上市之日起锁定 36 个月

5	国华能源投资有限公司	365,048,543	2011年2月26日	365,048,543	自上市之日起锁定12个月
6	江苏省丝绸集团有限公司	341,418,259	2013年2月26日	341,418,259	自上市之日起锁定36个月
7	江苏宏图高科技股份有限公司	147,618,708	2011年2月26日	147,618,708	自上市之日起锁定12个月
8	上海星聚投资管理有限公司	143,786,827	2012年12月31日	143,786,827	自持股之日起锁定36个月
9	海澜集团有限公司	135,000,000	2011年2月26日	135,000,000	自上市之日起锁定12个月
10	江苏苏豪国际集团股份有限公司	131,447,067	2013年2月26日	131,447,067	自上市之日起锁定36个月

5、控股股东及实际控制人变化情况

报告期内，公司控股股东及实际控制人未发生变化。

四、董事、监事、高级管理人员情况

(一) 董事、监事、高级管理人员持股情况

公司董事、监事、高级管理人员没有持有公司股份，报告期内未发生变化。

(二) 报告期内董事、监事、高级管理人员变更情况

报告期内公司董事、监事、高级管理人员未发生变更。

五、董事会报告

(一) 报告期内公司经营情况

公司前身是1991年成立的江苏省证券公司，1999年更名为华泰证券有限责任公司，2007年12月改制为股份有限公司。公司是中国证监会首批批准的综合类证券公司，也是中国证券业协会较早评审通过的创新试点证券公司，在2010年证券公司分类监管评级中被评为A类AA级。目前公司注册资本为56亿元，主营业务范围为：证券经纪业务（限江苏、上海、浙江、安徽、山东、黑龙江、吉林、辽宁、北京、天津、河北、河南、陕西、山西、宁夏、内蒙古、甘肃、新疆、青海）；证券自营；证券承销与保荐业务（限上海证券交易所相关业务）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾

问；证券资产管理；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；中国证监会批准的其他业务。

1、公司总体经营情况

2010 年上半年，我国宏观经济在连续四个季度持续反弹并于今年一季度达到阶段性高点之后自二季度开始回调。上证综指和深证成指也于 4 月初开始一路走低。尽管市场交易规模与去年同期基本相当，股票和债券融资总体规模还较去年同期大幅增长，但经纪业务佣金率水平下降，证券投资业务受股指拖累，行业整体业绩较去年同期出现下滑。在复杂多变的 market 环境下，公司按照年初确定的经营思路，坚定不移地推进转型发展步伐，各项业务保持了平稳发展；子公司业务也保持了良好的发展态势。

截止 2010 年 6 月 30 日，公司总资产 10,490,321.60 万元，较年初增长 6.18%。2010 年 1—6 月，营业收入 358,868.06 万元，较上年同期减少 13.93%；利润总额 177,828.51 万元，较上年同期减少 29.01%；归属于母公司所有者的净利润 142,034.76 万元，较上年同期减少 19.02%。报告期公司经营业绩同比下降的主要原因为：由于行业竞争日趋激烈，经纪业务佣金持续下降，公司代理证券买卖业务净收入同比下降了 28.24%；受股市下跌影响，公司股票投资出现一定程度的亏损，投资净收益和公允价值变动净收益同比分别下降了 76.43%和 220.15%。

2、主营业务情况

(1) 证券经纪业务

报告期内，市场行情持续下跌，行业平均佣金率延续了下降的趋势，证券公司经纪业务盈利能力和盈利水平受到了一定影响。

针对市场的变化，报告期内，公司进一步细分客户，加快了紫金理财服务体系的建设和提高理财服务水平，收到了良好的效果，公司经纪业务代理交易基金份额稳步增长。

报告期内，8 家分公司完成设立工作，8 家证券营业部获批新设，6 家证券营业部获得迁址批复，3 家证券服务部规范升级为证券营业部。

报告期内，公司全面推进融资融券业务资格申报和相关准备工作，完成业务试点实施方案专业评价材料申报和答辩，完成有关现场检查、业务测试、技术测试，制定完善相关管理制度和实施方案，持续进行员工培训和投资者教育工作。2010 年 6 月公司获得融资融券业务试点资格后，积极做好业务试点启动的各项准备工作。

报告期内，公司期货中间介绍业务按业务规划有序开展。公司于 2010 年 3 月顺利通过期货中间介绍业务的资格验收，首批已有 21 家证券营业部可开展期货中间介绍业务，业务覆盖江苏、浙江、上海、北京、天津、河南、陕西、辽宁、黑龙江等省市地区。随着股指期货业务总规模的逐步扩大，公司期货中间介绍业务收入也将逐步提高。

合并数据

2010 年 1—6 月			2009 年 1—6 月		
证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)	证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)
A 股	23,778.85	52.71	A 股	22,882.69	51.76
基金	634.20	80.98	基金	773.77	100.48
B 股	79.55	46.19	B 股	79.57	50.12
权证	1,619.86	88.19	权证	5,568.02	114.15
债券	36.33	7.17	债券	69.14	14.95
合计	26,148.79	54.01	合计	29,373.19	58.19

注：2010 年 1-6 月合并代理交易量为华泰证券和华泰联合证券数据（收购出让后口径的数据）；2009 年 1-6 月合并代理交易量为原华泰证券、原信泰证券、原联合证券（收购出让前口径的数据）。

母公司数据

2010 年 1—6 月			2009 年 1—6 月		
证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)	证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)
A 股	16,679.34	36.97	A 股	14,042.22	31.76
基金	376.92	48.13	基金	706.91	91.80
B 股	52.57	30.52	B 股	40.22	25.33
权证	1,121.22	61.04	权证	3,173.80	65.07
债券	29.14	5.75	债券	49.01	10.60
合计	18,259.19	37.72	合计	18,012.16	35.68

注：2010 年 1-6 月母公司代理交易量为与华泰联合证券收购出让后的数据；2009 年 1-6 月母公司代理交易量为未收购出让前的数据。

(2) 投资银行业务

报告期内，新股发行持续活跃，投行股票承销业务大幅增长，据 WIND 统计，

截至 2010 年 6 月 30 日, A 股市场股票承销金额达到 3,193 亿元, 相当于 2009 年全年股票承销金额的近 9 成。报告期内, 企业债券累计发行 1,405.5 亿元, 同比下降 19.1%; 同时, 由于国家有关调控政策出台, 城投债审批放缓直至暂停, 这对城投债类企业债券承销业务产生了不利影响。

报告期内, 面对承销市场有利条件与不利因素, 公司(含华泰联合证券)积极开拓承销业务, 主承销共完成 14 个 IPO 项目、3 个非公开发行股票项目、1 个可转债项目、6 个债券发行项目, 其中, 母公司主承销共完成 6 个 IPO 项目、1 个非公开发行股票项目、3 个债券发行项目。

根据中国证监会证监许可[2009]715 号文和证监许可[2009]717 号文的相关规定, 自 2010 年 1 月 1 日起, 华泰证券专注于上海证券交易所市场的证券承销与保荐业务; 控股子公司华泰联合证券专注于深圳证券交易所市场的证券承销与保荐业务。

合并数据

承销方式	承销类别	承销次数		承销金额(万元)		承销收入(万元)	
		本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
主承销	新股发行	14	84	1,119,003.50	4,312,313.50	55,213.90	137,350.90
	增发新股	3	22	157,670.10	3,884,301.10	4,622.20	37,774.20
	配股	0	28	0	761,613.00	0	16,203.00
	可转债	1	8	67,000.00	300,800.00	2,075.00	11,172.00
	债券发行	6	120	479,000.00	3,149,901.48	6,567.50	34,493.17
	小计	24	262	1,882,673.60	12,408,929.08	68,478.60	236,993.27
副主承销	新股发行	0	26	0	239,527.30	0	359.01
	增发新股	0	3	0	55,903.50	0	169.00
	配股	1	12	184,621.00	244,241.00	1,200.00	1,811.00
	可转债	0	3	0	13,284.00	0	12.00
	债券发行	0	44	0	351,575.00	0	1,056.22
	小计	1	88	184,621.00	904,530.80	1,200.00	3407.23
分销	新股发行	3	153	42,800.00	1,796,505.92	33.26	1,204.11
	增发新股	0	28	0	382,226.97	0	701.00
	配股	0	30	0	136,077.30	0	419.94
	可转债	1	7	25,000.00	133,936.00	10.00	82.54
	债券发行	44	390	1,009,000.00	4,931,962.68	865.86	5,036.23
	小计	48	608	1,076,800.00	7,380,708.87	909.12	7,443.82

母公司数据

承销方式	承销类别	承销次数		承销金额 (万元)		承销收入 (万元)	
		本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
主承销	新股发行	6	49	441,500.00	2,502,020.52	18,344.80	63,929.10
	增发新股	1	5	62,000.00	2,798,382.00	1,500.00	14,030.00
	配股	0	6	0	204,978.54	0	3,088.31
	可转债	0	2	0	72,000.00	0	2,300.00
	债券发行	3	107	300,000.00	2,621,901.48	3,519.00	23,030.67
	小计	10	169	803,500.00	8,199,282.54	23,363.80	106,378.08
副主承销	新股发行	0	20	0	156,626.30	0	248.01
	增发新股	0	1	0	37,975.50	0	5
	配股	1	7	184,621.00	215,438.00	1,200.00	1,220.00
	可转债	0	2	0	10,000.00	0	2.00
	债券发行	0	26	0	216,875.00	0	725.22
	小计	1	56	184,621.00	636,914.80	1,200.00	2,200.23
分销	新股发行	1	98	20,520.00	997,275.92	20.26	618.11
	增发新股	0	16	0	163,906.97	0	62.00
	配股	0	20	0	115,235.30	0	37.94
	可转债	1	3	25,000.00	67,500.00	10.00	36.54
	债券发行	34	306	524,000.00	3,472,462.68	442.86	3,029.23
	小计	36	443	569,520.00	4,816,380.87	473.12	3,783.82

(3) 证券投资业务

2010 年一季度，中国经济保持了平稳较快的增长态势，二季度随着欧洲主权债务危机的接连爆发和持续恶化，全球金融市场陷入新的震荡，世界经济的复苏前景被蒙上了新的阴影。受外围经济影响，中国经济在发展上显现出更多的复杂性和不确定性，上证指数从 4 月初开始一路走低，三个月跌去 600 多点。2010 年上半年，债券二级市场收益率总体下行，债市小幅上涨，债券市场收益率曲线尤其是中长端呈震荡下行走势，短端受到资金面趋紧影响上行，收益率曲线整体呈平坦化走势。

报告期内，面对不利的市场环境，权益类证券业务坚持价值投资，稳健运作。根据我国调整经济结构的大背景，将有关板块个股作为投资重点，并加大研究力度和配置比例。面对上半年信贷额度控制和房地产调控等措施，做好权益投资比重的控制，避免大幅亏损。同时积极挖掘市场中存在的套利机会，实现部分低风险的绝对收益。在数量化投资方面，运用数学建模和计算机技术，通过数量化选股模型来构建投资组合，并随着市场状态变化结合

机械交易择时系统进行仓位控制。公司积极参与股指期货业务，在中金所开立了证券自营业务股指期货交易编码，获得了套期保值交易额度。固定收益证券投资业务重点投资剩余期限 5 年以内信用债品种，采用短久期策略防御利率上行风险；同时关注超跌利率产品的交易机会，并适当关注可转债。

合并数据

单位：元

项目	2010 年 1—6 月	2009 年 1—6 月
证券投资收益	-58,154,212.17	138,628,240.91
其中：出售交易性金融资产收益	-65,186,621.32	129,834,710.68
出售交易性金融负债收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	-85,273,097.76	1,776,295.73
金融资产持有期间收益	92,308,403.25	7,017,234.50
衍生金融工具的投资收益	-2,896.34	-
公允价值变动损益	-110,862,731.90	92,271,716.45
其中：交易性金融资产	-114,870,971.90	92,271,716.45
交易性金融负债	-	-
衍生金融工具	4,008,240.00	-
合计	-169,016,944.07	230,899,957.36

母公司数据

单位：元

项目	2010 年 1—6 月	2009 年 1—6 月
证券投资收益	-143,434,878.79	96,029,741.40
其中：出售交易性金融资产收益	-139,887,993.46	90,673,102.67
出售交易性金融负债收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	-95,852,392.24	1,776,293.13
金融资产持有期间收益	92,308,403.25	3,580,345.60
衍生金融工具的投资收益	-2,896.34	-
公允价值变动损益	-172,165,101.41	33,995,754.13
其中：交易性金融资产	-176,173,341.41	33,995,754.13
交易性金融负债	-	-
衍生金融工具	4,008,240.00	-
合计	-315,599,980.20	130,025,495.53

(4) 资产管理业务

2010 年上半年，更多的券商进入到资产管理业务领域，产品推出力度加大，产品创新不断推进，竞争较去年更加激烈。

报告期内，公司资产管理业务加快推出新产品，完成首只限额特定产品华泰紫金策略优选集合计划的首发推广和成立工作，首发募集资金 2.82 亿元，第二只限额特定产品华泰紫金智富集合计划进行推广，完成华泰紫金周期轮动集合计划的设计、申报和获批工作，同时继续加强产品创新和产品储备工作，定向资产管理业务稳步推进。截至报告期末，公司合计管理的集合

计划数量达到 9 只，合计管理份额 60.22 亿份，合计管理资产规模 61.84 亿元。

项目	2010 年 1—6 月		2009 年 1—6 月	
	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理业务	61.84	5,308.07	85.30	6,622.16
定向资产管理业务	1.76	43.51	2.21	40.66
专项资产管理业务	-	-	8	10

注：定向资产管理业务含华泰联合证券数据；专项资产管理业务的项目为南通天电销售资产支持收益专项资产管理计划，该计划已于 2009 年 8 月 3 日结束，故报告期内未有该项业务。

3、比较式财务报表中变动幅度超过 30% 以上的项目分析

单位：元

项目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日	增减 (%)	主要原因
结算备付金	7,902,629,172.07	14,413,843,187.41	-45.17	在登记公司缴存的备付金减少
交易性金融资产	8,373,108,513.29	6,159,889,492.29	35.93	交易性金融资产规模增大
买入返售金融资产	1,433,493,789.59	-	100.00	期末买入返售证券增加
可供出售金融资产	3,137,270,982.09	1,259,217,288.77	149.14	可供出售金融资产规模增大
长期股权投资	2,321,938,560.18	1,691,828,410.60	37.24	主要为对江苏银行增资 7 亿元
递延所得税资产	180,516,404.06	346,657,495.59	-47.93	长期股权投资减值损失本期已经税务部门核准，递延所得税资产相应减少
其他资产	820,636,874.50	494,749,331.21	65.87	联营企业已宣告发放尚未收到的股利
短期借款	65,429,250.00	17,609,600.00	271.55	系子公司华泰香港短期借款增加
卖出回购金融资产款	2,979,290,000.00	2,143,415,595.21	39.00	期末卖出回购证券增加
代理承销证券款	20,800,000.00	1,006,228,534.00	-97.93	前期收到的代理承销证券款在本期支付
应交税费	58,676,151.14	485,030,701.03	-87.90	本期递延所得税资产减少，相应应交税费减少，以及前期提取的税金在本期缴纳
应付利息	498,235.33	14,198,041.98	-96.49	支付次级债利息
应付债券	-	1,999,724,222.79	100.00	公司发行的次级债在本期归还
递延所得税负债	9,557,584.13	45,166,266.76	-78.84	金融资产公允价值减少
资本公积	17,188,693,756.96	2,661,404,206.97	545.85	股本溢价所致

注：因利润表未披露上年同期数，故未作利润表变动幅度超过 30% 以上的项目分析。（上海证券交易所《关于做好上市公司 2010 年半年度报告披露工作的通知》第 5 条“上年同期未编制、披露利润表和现金流量表的上市公司，在本次半年报利润表和现金流量表中可不披露上年同期比较数据及相关增减指标”）

4、2010 年 1—6 月公司营业收入、营业利润的分地区报告

单位：元

地区	营业部数量	营业收入	营业利润
江苏省	66	887,795,329.06	549,268,719.38
湖北	28	181,219,065.30	102,368,335.86
广东	28	252,741,139.69	129,767,135.02
上海市	15	156,549,442.15	64,201,125.33
北京市	8	104,133,885.25	52,476,542.81
四川	8	82,926,572.35	47,290,117.97
辽宁	7	51,974,565.21	22,352,962.52
黑龙江	6	39,005,340.13	22,291,853.90
山东	6	38,846,573.71	21,511,061.31
天津	5	46,873,498.43	26,182,884.86
浙江	5	41,262,568.24	18,411,954.93

河南	4	38,646,806.83	16,846,621.28
湖南	4	40,658,608.14	22,413,650.47
江西	3	21,175,439.25	11,417,349.37
广西	3	26,636,463.11	10,946,258.74
福建	3	26,311,861.03	12,183,357.14
吉林	2	21,529,752.65	10,382,016.69
河北	2	16,149,823.70	9,092,495.63
陕西	2	17,375,239.29	9,149,902.10
安徽	2	11,701,990.48	4,306,052.02
海南	2	12,738,878.91	6,324,180.02
宁夏	1	10,749,201.21	6,222,069.47
重庆	1	7,603,945.27	4,006,294.55
内蒙	1	8,167,473.19	5,469,854.85
甘肃省	1	197,830.88	-2,487,764.38
山西省	1	688,452.35	-1,220,979.82
贵州	1	826,573.52	264,212.73
云南	1	1,022,996.79	342,159.78
营业部小计	216	2,145,509,316.12	1,181,780,424.53
香港地区	1	9,090,169.29	1,053,546.46
总部		1,434,081,083.56	596,890,969.55
合计		3,588,680,568.97	1,779,724,940.54

注：上表所列营业部数量为合并报表范围内公司及子公司的营业部数量（含华泰证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、长城伟业期货有限公司、华泰金融控股（香港）有限公司）；该统计表的营业部数量与期末财务报表附注披露的营业部数量不一致，主要原因为部分服务部升级的营业部尚未开始核算；因利润表未披露上年同期数，故未披露上年同期数和增减比例。

5、主要子公司、参股公司的经营情况

（1）华泰联合证券有限责任公司，注册资本 10 亿元人民币，报告期末公司持有其 97.70%的股权。截至 2010 年 6 月 30 日总资产 2,189,423.75 万元，净资产 345,760.75 万元，2010 年 1-6 月营业收入 145,994.85 万元，利润总额 68,900.19 万元，净利润 51,722.82 万元（未经审计）。

主营业务：证券经纪业务（限广东、广西、海南、湖北、湖南、福建、江西、四川、重庆、云南、贵州、西藏）；证券承销与保荐业务（限深圳证券交易所相关业务）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；中国证监会批准的其他业务。

（2）长城伟业期货有限公司，注册资本 3 亿元人民币，报告期末公司持有其 60%的股权。截止 2010 年 6 月 30 日总资产 454,772.19 万元，净资产 38,753.97 万元，2010 年 1-6 月营业收入 10,144.07 万元，利润总额 3,442.91 万元，净利润 2,569.22 万元（未经审计）。

主营业务：商品期货经纪、金融期货经纪。

(3) 华泰金融控股(香港)有限公司, 注册资本 5,000 万港元, 为公司全资子公司。截止 2010 年 6 月 30 日总资产 30,048.10 万港元, 净资产 4,116.98 万港元, 2010 年 1-6 月营业收入 1,036.14 万港元, 利润总额 120.31 万港元, 净利润 120.31 万港元(未经审计)。

业务性质：证券金融。

(4) 华泰紫金投资有限责任公司, 注册资本 2 亿元人民币, 为公司全资子公司。截止 2010 年 6 月 30 日总资产 19,578.59 万元, 净资产 19,557.16 万元, 2010 年 1-6 月营业收入 121.51 万元, 净利润为-155.61 万元(未经审计)。

主营业务：股权投资。

(5) 南方基金管理有限公司, 注册资本 1.5 亿元人民币, 报告期末公司持有其 45%的股权。截止 2010 年 6 月 30 日总资产 255,373.07 万元, 净资产 164,697.72 万元, 2010 年 1-6 月营业收入 80,587.72 万元, 利润总额 30,181.45 万元, 净利润 23,250.20 万元(未经审计)。

主营业务：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

(6) 华泰柏瑞基金管理有限公司, 注册资本 2 亿元人民币, 报告期末公司持有其 49%的股权。截止 2010 年 6 月 30 日总资产 41,415.27 万元, 净资产 36,523.94 万元, 2010 年 1-6 月营业收入 12,995.51 万元, 利润总额为 4,924.59 万元, 净利润为 3,917.92 万元(未经审计)。

主营业务：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会核准的其他业务(涉及许可经营的凭许可证经营)。

(7) 江苏银行股份有限公司, 注册资本 91 亿元人民币, 报告期末公司持有其 7.03%的股权。截止 2010 年 6 月 30 日, 总资产 41,261,005.22 万元,

净资产 2,048,012.45 万元；2010 年 1-6 月营业收入 1,010,852.19 万元，利润总额 265,864.23 万元，净利润 200,149.69 万元（未经审计）。

主营业务：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。

6、公司在经营中出现的问题及应对措施

公司经营中出现的问题：对于证券公司而言，经纪业务仍是主要依赖的传统业务，在激烈的竞争中，佣金率下滑趋势更加明显；投行业务同质化竞争日益加剧；创新业务刚刚起步，对利润的贡献尚不明显。

针对上述问题，公司采取了以下措施：加快转型步伐，坚持以创新化解经营中的问题和困难。公司继续推进紫金理财服务体系的建设和推广，积极提升理财服务能力；公司投行坚持实施行业定位战略，大力开展行业研究，在行业研究的指导下寻找和拓展投行业务，通过努力在所定位行业内已形成一定的客户基础；在巩固和提高传统业务竞争力的同时，公司不断加强产品创新，增加对创新业务的投入，积极推进创新业务的发展，培育新的利润增长点。

7、下半年业务发展规划

面对激烈的市场竞争形势，公司下半年将继续全面推广紫金理财服务体系，深化经纪业务转型；积极构建以客户为中心的业务体系，推动投行业务持续发展；努力应对政策环境变化，保持固定收益业务稳定发展；不断优化投资策略，提高证券投资业务水平；积极优化投资管理，进一步提高客户资产管理业务水平；做好研究和信息技术工作，强化对各项业务发展的支持。

（二）报告期内投资情况

1、募集资金使用情况

经中国证监会证监许可[2010]138号文核准，公司于2010年2月首次公开发行人民币普通股78,456.1275万股，每股发行价格20元，募集资金总额为15,691,225,500.00元，扣除发行费用人民币166,797,636.15元，实际募集资金净额为人民币15,524,427,863.85元。本次募集资金到位情况已经江苏天衡会计师事务所有限公司审验，并于2010年2月12日出具了天衡验字(2010)009号验资报告。

募集资金到位后，公司按照相关要求，规范募集资金管理，并按照招股说明书确定的募集资金投向，有计划地安排资金投入。截止报告期末，公司已动用募集资金98.88亿元，主要用于增加自营业务规模、参与战略配售与定向增发投资、开展股指期货业务和融资融券业务等。其余募集资金仍存放在募集资金专户内，公司将根据相关募投项目的进展和市场的变化情况逐步安排投入。

2、非募集资金投资项目情况

报告期内，公司第一届董事会第十六次会议审议通过了关于公司认购江苏银行股份有限公司（以下简称“江苏银行”）2010年定向募集股份的议案，公司出资7亿元人民币，以每股5元的价格认购江苏银行2010年定向募集股份1.4亿股。以上内容，于2010年3月2日在上海证券交易所网站及中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以《华泰证券股份有限公司第一届董事会第十六次会议决议公告》予以公布。江苏银行于2010年4月19日完成工商变更登记事宜，本次增资后，其注册资本由84亿元人民币变更为91亿元人民币，我公司持有江苏银行的股份由5亿股变更为6.4亿股，占其注册资本的7.03%。以上内容，于2010年4月23日在上海证券交易所网站及中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以《华泰证券股份有限公司关于增资江苏银行股份有限公司进展情况的公告》予以公布。

六、重要事项

(一) 报告期实施的利润分配方案执行情况

报告期内，公司不存在以前期间拟定、在报告期实施的利润分配方案、公积金转增股本方案情况。

(二) 报告期内现金分红政策的执行情况

报告期内，公司未进行现金分红。

(三) 重大诉讼仲裁事项

1、报告期内公司发生的重大诉讼、仲裁事项

报告期内公司未发生重大诉讼、仲裁事项。

2、以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项

(1) 2007 年第二和第三季度，黄冈住房公积金管理中心及其黄州办事处、麻城办事处、武穴办事处、红安办事处先后向黄冈市中级人民法院起诉中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、本公司及本公司黄冈营业部，要求返还合计金额 53742851.4 元的国债。经公司调查并经专业律师机构查证，原告主张的国债系被亚洲证券有限责任公司挪用，与公司无关。亚洲证券挪用国债的事实已经亚洲证券清算组聘请的中审会计师事务所有限公司《关于亚洲证券有限责任公司国债、企业债专项清查报告》(中审审字【2005】第 5156-10-3) 确认；本案起诉前的 2005 年 6 至 8 月，原告已分别就诉讼所涉及国债向亚洲证券清算组申报了债权；上海市第二中级人民法院于 2007 年 5 月依法受理了亚洲证券破产还债一案后，原告又于 2007 年 7 月亦即其起诉公司等后，再次向亚洲证券破产管理人申报了债权。上述事实已充分证明原告的国债系亚洲证券挪用，且原告已明知。

2005 年 4 月，公司按照中国证监会的要求托管亚洲证券经纪业务及其所属营业部，根据证监会《关于委托华泰证券有限责任公司托管亚洲证券有限责任公司经纪业务及所属证券营业部的决定》明确规定：华泰证券不承担亚

洲证券的债权债务；根据证监会《关于证券公司风险处置过程中现场工作组、清算组、托管组职责分工的通知》的规定，管理亚洲证券和处置亚洲证券资产属于亚洲证券清算组的职责。

2009 年 3 月，上述红安办事处向法院申请撤诉并获准。

(2) 公司 2009 年年报中披露了有关 2008 年 4 月 1 日，南京东方制药有限责任公司清算组（下称东方制药清算组）向南京市浦口区人民法院起诉，要求本公司及本公司南京瑞金路营业部向第三人陆春怡赔偿 2000 万元本金及相应损失一案。2010 年 5 月 5 日，法院裁定因原告东方制药公司未在法院规定的期限内补交诉讼费用，该案按自动撤回起诉处理，案件受理费由原告东方制药公司负担。

(3) 2008 年 6 月，公司子公司华泰联合证券以四通集团公司利用本公司营业部实施融资侵害本公司资产为由，向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院根据四通集团公司 2004 年 3 月出具的《承诺函》中有关承担经济损失赔偿责任的承诺，判令其向本公司支付欠款总额人民币 23775.36 万元人民币、利息人民币 2187.72 万元，合计标的人民币约 2.6 亿元。本案于 2009 年 12 月由北京市高级人民法院判决四通集团公司扣减债务 8486.5867 万元，最终需偿还本金 17553.3893 万元及相应利息。该案已于 2010 年 3 月向法院申请执行。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

(4) 公司子公司华泰联合证券因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用营业部资金共 3,720 余万元，以及因其与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从本公司扣划现金 1,738 万元，拒不履行偿债义务为由，于 2003 年 12 月 5 日向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求判令中国华诚集团财务有限责任公司偿还占用资金 3,720 余万元，华诚投资管理有限公司对其承担连带责任；判令华诚投资管理有限公司补足因被法院强制执行划款导致的对我公司出资不足 1,738 万元。法院立案后，由于最高人民法院下文通知各地法院停

止受理、审理、执行对华诚投资管理有限公司及所属公司的诉讼案件，导致该案中止审理。深圳市中级人民法院于 2010 年 3 月恢复审理此案并于 2010 年 4 月一审判决本公司胜诉，要求华诚投资管理有限公司和中国华诚集团财务有限责任公司连带支付本公司 54584314.02 元并承担相应诉讼费 28 万余元。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

(5) 2008 年 11 月 18 日，公司子公司华泰联合证券以中国长城计算机集团公司不履行与本公司之间的合同义务，拖欠本公司款项为由，向深圳市罗湖区法院起诉，请求法院处置变卖其所持本公司的 900 万股股权，将所得款项用于抵偿其对本公司的所欠债务。现法院已立案。于 2009 年 2 月进行了第一次开庭审理，并由法院追加长城财务公司作为第三人。该案目前处于中止审理阶段。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

(四) 公司持有其他上市公司股权、参股金融企业股权情况

1、证券投资情况

序号	证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本 (元)	持有数量 (股)	期末账面价值 (元)	占期末证券投资比例 (%)	报告期损益 (元)
1	股票	600460	士兰微	42,356,729.47	2772920.00	44,477,636.80	5.41	2,134,635.96
2	股票	000978	桂林旅游	34,165,688.91	3547148.00	31,392,259.80	3.82	-3,035,899.27
3	股票	600655	豫园商城	29,798,636.49	1247716.00	27,599,477.92	3.35	-7,670,645.89
4	股票	600888	新疆众和	32,132,691.61	1769427.00	24,984,309.24	3.04	-7,148,382.37
5	股票	601939	建设银行	30,787,627.77	5266799.00	24,753,955.30	3.01	-7,803,031.68
6	股票	000790	华神集团	22,232,478.32	2101750.00	23,224,337.50	2.82	912,933.29
7	股票	000858	五粮液	20,597,337.82	732600.00	17,750,898.00	2.16	-3,916,914.06
8	股票	601668	中国建筑	22,630,000.00	5000000.00	17,550,000.00	2.13	-5,080,245.00
9	股票	000887	中鼎股份	18,527,870.75	1109771.00	16,924,007.75	2.06	-1,195,067.24
10	股票	000527	美的电器	16,940,194.58	1426400.00	16,260,960.00	1.98	-679,234.58
期末持有的其他证券投资				706,034,033.76	/	577,886,037.10	70.23	-93,643,416.31
报告期已出售证券投资损益				/	/	/	/	-167,709,100.00
合计				976,203,289.48	/	822,803,879.41	100.00	-294,834,367.15

注：本表数据中的证券投资包括交易性金融资产中的股票投资和权证、可转债投资。报告期损益，包括报告期公司因持有该证券取得的投资收益及公允价值变动损益。

2、持有其他上市公司股权情况

单位：万元

序号	证券代码	证券简称	最初投资成本 (万元)	占该公司股权比例 (%)	期末账面价值 (万元)	报告期损益 (万元)	报告期所有者权益变动 (万元)	会计科目	来源
1	000629	*ST 钒钛	37,991.31	0.81	37,199.13	42.22	1,502.77	可供出售金融资产	购入
2	600900	长江电力	9,011.36	0.06	8,680.55	-13.96	-330.81	可供出售金融资产	购入
3	601398	工商银行	9,877.02	0.01	7,823.17	0.00	-2,187.41	可供出售金融资产	购入
4	600036	招商银行	7,960.30	0.02	6,521.50	0.00	-1,644.82	可供出售金融资产	购入
5	000729	燕京啤酒	6,174.82	0.27	6,459.18	0.22	222.05	可供出售金融资产	购入
6	600519	贵州茅台	7,825.15	0.05	5,949.58	0.00	-1,875.57	可供出售金融资产	购入
7	601628	中国人寿	6,565.55	0.01	5,840.58	0.00	-724.97	可供出售金融资产	购入
8	000895	双汇发展	5,335.30	0.16	4,976.20	0.00	-359.10	可供出售金融资产	购入
9	600138	中青旅	5,473.21	0.79	4,924.57	0.00	-548.64	可供出售金融资产	购入
10	600276	恒瑞医药	5,168.73	0.17	4,866.76	0.00	-301.97	可供出售金融资产	购入
期末持有的其他证券投资			57,848.17	/	59,527.62	-8,418.30	-10,154.44	可供出售金融资产	购入
合计			159,230.92	/	152,768.84	-8,389.82	-16,402.91		

注：本表数据中的持有其他上市公司股权包括可供出售金融资产中的股票投资。

3、持有非上市金融企业股权情况

持有对象名称	初始投资成本 (元)	持股比例 (%)	期末账面价值 (元)	报告期损益 (元)	报告期所有者权益变动 (元)	会计核算科目	股份来源
华泰联合证券有限责任公司	1,188,874,404.83	97.70	1,188,874,404.83	517,228,224.83	499,419,407.47	长期股权投资	出资购入
长城伟业期货有限公司	186,598,085.65	60	186,598,085.65	25,692,150.52	25,692,150.52	长期股权投资	出资购入
南方基金管理有限公司	886,741,463.93	45	741,740,556.51	237,462,328.34	-360,799,912.99	长期股权投资	出资购入
华泰柏瑞基金管理有限公司	170,863,874.13	49	184,574,931.47	39,179,227.35	27,981,748.99	长期股权投资	出资购入
江苏银行股份有限公司	1,300,000,000.00	7.03	1,300,000,000.00	2,001,496,938.73	5,442,435,490.45	长期股权投资	出资购入
合计	373,307,7828.54		3,601,787,978.46				

注：本表中报告期损益和所有者权益均为未经审计数据。

(五) 报告期内公司收购及出售资产、吸收合并事项

本报告期公司无收购及出售资产、吸收合并事项。

(六) 报告期内公司重大关联交易事项

1、与日常经营相关的关联交易

单位:万元 币种:人民币

关联交易方	关联关系	关联交易内容	关联交易定价原则	关联交易金额	占同类交易金额的比例 (%)
江苏省国信资产管理集团有限公司	参股股东	房租支出	市场原则	127.80	2.80
江苏银行股份有限公司	参股股东	利息收入	市场原则	33.23	0.07
南方基金管理有限公司	联营公司	手续费及佣金收入	市价原则	631.28	9.61
华泰柏瑞基金管理有限公司	联营公司	手续费及佣金收入	市价原则	581.30	8.85

江苏省国信资产管理集团有限公司	参股股东	手续费及佣金收入	市场原则	0.06	
江苏汇鸿国际集团有限公司	参股股东	手续费及佣金收入	市场原则	2.85	0.04
江苏高科技投资集团有限公司	参股股东	手续费及佣金收入	市场原则	0.60	
江苏省丝绸集团有限公司	参股股东	手续费及佣金收入	市场原则	0.12	
合计				1,377.24	21.37

2、关联债权债务往来

单位：万元 币种：港元

关联方	关联关系	向关联方提供资金		关联方向上市公司提供资金	
		发生额	余额	发生额	余额
华泰金融控股(香港)有限公司	全资子公司	6,000	2,000		
关联债权债务形成原因		公司向招商银行南京分行申请并开立金额为港币 2 亿元的备用信用证，为华泰金融控股(香港)有限公司向永隆银行申请额度为港币 8,000.00 万元的贷款提供保证，实际使用贷款港币 6000.00 万元，授信到期日为 2010 年 9 月 25 日。			

3、其他重大关联交易

(1) 向关联方支付次级债利息

关联交易方	关联交易类型	交易内容	定价原则	本期发生额	
				金额(万元)	占同类交易金额的比例(%)
江苏省国信资产管理集团有限公司	借款	次级债利息	市场原则	1,287.41	15.54
江苏交通控股有限公司	借款	次级债利息	市场原则	445.74	5.38
江苏汇鸿国际集团有限公司	借款	次级债利息	市场原则	413.79	5.00
江苏高科技投资集团有限公司	借款	次级债利息	市场原则	401.09	4.84
江苏省丝绸集团有限公司	借款	次级债利息	市场原则	321.38	3.88
江苏银行股份有限公司	借款	次级债利息	市场原则	4,141.67	50.01
合计				7,011.08	84.65

(2) 关联方应收应付款项

项目名称	关联方	期 末	
		金额(万元)	其中：计提减值金额
预付账款	江苏省国信资产管理集团有限公司	93.60	

(七) 重大合同及其履行情况

1、为公司带来的利润达到公司本期利润总额 10% 以上(含 10%) 的托管、承包、租赁事项

(1) 托管情况

本报告期公司无托管事项。

(2) 承包情况

本报告期公司无承包事项。

(3) 租赁情况

本报告期公司无租赁事项。

2、担保情况

单位:万元 币种:港元

公司对控股子公司的担保情况	
报告期末对子公司担保余额合计 (B)	8,000
公司担保总额情况 (包括对控股子公司的担保)	
担保总额 (A+B)	8,000
担保总额占公司净资产的比例(%)	0.26

2009 年香港子公司根据业务发展需要, 向公司提出申请, 拟采用内保外贷形式向香港本地银行申请贷款。经公司 2009 年第一次临时股东大会审议批准, 公司于 2009 年 9 月 25 日与招商银行南京分行签订了信用担保协议, 由公司提供担保, 再由招商银行于同日向永隆银行开出港币 8000 万元的保函, 作为香港子公司向永隆银行申请取得港币 8000 万元后偿贷款的保证。

后因永隆银行内部审核没有同意后偿贷款申请, 只能改成一般流动资金贷款。香港子公司根据自身风险承受能力, 审慎使用该项贷款, 截止 2009 年 12 月 30 日, 香港子公司共使用了港币 2000 万元流动资金贷款。2010 年 1 月 6 日, 香港子公司又从永隆银行申请了港币 4000 万元的流动资金贷款, 主要用于客户融资。截至 2010 年 6 月 30 日一共使用了 6000 万元贷款, 剩余 2000 万元的额度暂未使用。

3、委托理财情况

本报告期公司无委托理财事项。

4、其他重大合同

2009 年 8 月, 公司控股子公司华泰联合证券有限责任公司承租港中旅大厦作为其总部办公地点, 与出租方港中旅(中国)投资有限公司签署房屋租赁合同, 年租金为 13781278.56 元, 合同期限 5 年。

(八) 承诺事项履行情况

1、公司或持股 5%以上股东在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

(1) 公司承诺事项

无。

(2) 持股 5%以上股东承诺事项及履行情况

截至 2010 年 6 月 30 日，公司持股 5%以上的股东共有六家，分别为江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、国华能源投资有限公司、江苏省丝绸集团有限公司，六家股东均承诺在锁定期限内“不转让或者委托他人管理其本次发行前所持有的公司股份，也不由公司回购该部分股份”。其中：

① 江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司四家股东，因受公司实际控制人控制并在公司上市申报前三年内有增持行为，按照中国证监会机构监管要求承诺：锁定期限为自持股之日起 60 个月内；按照上海证券交易所、中国证监会有关规定承诺：锁定期限为自公司股票在证券交易所上市之日起 36 个月内。实际锁定期限视发行时间按照孰长原则执行。

② 国华能源投资有限公司，因公司上市申报前三年内无增持行为，承诺：锁定期限为自公司股票在证券交易所上市之日起 12 个月内。

③ 江苏省丝绸集团有限公司，因受实际控制人控制并在公司上市申报前三年内无增持行为，承诺：锁定期限为自公司股票在证券交易所上市之日起 36 个月内。

报告期内，上述股东均履行了承诺，未减持公司股票。

此外，截止或延续到报告期内，公司持股 5%以上的股东并无其它具体承诺事项。

3、截至半年报披露日，是否存在尚未完全履行的业绩承诺
不适用。

4、截至半年报披露日，是否存在尚未完全履行的注入资产、资产整合承

诺

不适用。

(九) 审计事项：本次半年度财务报告未经审计。

(十) 上市公司及其董事、监事、高级管理人员、公司股东、实际控制人处罚及整改情况

本报告期公司及其董事、监事、高级管理人员、公司股东、实际控制人均未受中国证监会的稽查、行政处罚、通报批评及证券交易所的公开谴责。

(十一) 其他重大事项的说明

1、公司公开发行上市事项

经中国证监会证监许可[2010]138 号文《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复》同意，公司于 2010 年 2 月 9 日以每股人民币 20 元的发行价格首次公开发行了 78,456.1275 万股 A 股，扣除发行费用后实际募集资金人民币 15,524,427,863.85 元。本次公开发行股票后，公司注册资本变更为人民币 56 亿元。经上海证券交易所上证发字[2010]8 号文核准，本次公开发行中网上资金申购发行的 54,919.3 万股股票已于 2010 年 2 月 26 日起在上海证券交易所上市交易。网下向询价对象配售的 23,536.8275 万股，根据《证券发行与承销管理办法》的有关规定，于 2010 年 5 月 26 日起在上海证券交易所上市交易。

2、报告期内证券营业部新设、迁址等变化情况和服务部升级情况

分公司	营业部新设	迁址	服务部规范升级
8	8	6	3

(1) 报告期内分公司设立情况

序号	分公司	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	北京分公司	北京市西城区金融大街 17 号中国人寿中心 17 层	证监许可[2009]1209 号	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日
2	上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号 25 楼 2506、2507 室	证监许可[2009]1209 号	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日
3	辽宁分公司	沈阳市和平区青年大街 322 号	证监许可[2009]1209 号	2009 年 11 月 19 日	2010 年 6 月 3 日
4	天津分公司	天津市红桥区勤俭道 86 号办公楼 4-6 层	证监许可[2009]1209 号	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日
5	南通分公司	南通市姚港路 6 号方天大厦	证监许可[2009]1209 号	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日

6	苏州分公司	苏州市人民路 1925 号	证监许可 [2009]1209 号	可	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日
7	黑龙江分公司	哈尔滨市南岗区大成街 122 号	证监许可 [2009]1209 号	可	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日
8	南京分公司	南京市玄武区长江路 99 号 1104、1105 室	证监许可 [2009]1209 号	可	2009 年 11 月 19 日	2010 年 5 月 28 日

(2) 报告期内营业部新设情况

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰证券股份有限公司启东人民中路证券营业部	江苏省启东市汇龙镇人民中路 505 号	证监许可 [2009]1137 号	2009 年 11 月 2 日	2010 年 2 月 4 日
2	华泰证券股份有限公司靖江人民中路证券营业部	江苏省靖江市人民中路 68 号国贸中心 9 楼	证监许可 [2009]1137 号	2009 年 11 月 2 日	2010 年 2 月 4 日
3	华泰证券股份有限公司兰州酒泉路证券营业部	甘肃省兰州市城关区酒泉路 437-451 号 8 层	证监许可 [2009]1137 号	2009 年 11 月 2 日	2010 年 2 月 8 日
4	华泰证券股份有限公司盘锦石油大街证券营业部	辽宁省盘锦市兴隆台区石油大街 94 号	证监许可 [2010]453 号	2010 年 4 月 12 日	期后办理
5	华泰证券股份有限公司金坛东门大街证券营业部	江苏省金坛市东门大街 500 号	证监许可 [2010]453 号	2010 年 4 月 12 日	期后办理
6	华泰证券股份有限公司南通如东人民路证券营业部	江苏省南通市如东县掘港镇人民路西侧	证监许可 [2010]453 号	2010 年 4 月 12 日	期后办理
7	华泰证券股份有限公司舟山滨港路证券营业部	浙江省舟山市沈家门街道滨港路 283 号	证监许可 [2010]453 号	2010 年 4 月 12 日	期后办理
8	华泰证券股份有限公司永嘉阳光大道证券营业部	浙江省永嘉县瓯北镇新桥村阳光大厦 1 楼店面 7-13 号	证监许可 [2010]453 号	2010 年 4 月 12 日	期后办理

(3) 报告期内营业部迁址情况

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	上海常德路证券营业部	上海市普陀区澳门路 158 号 5 楼	沪证监机构字 [2010]65 号	2010 年 2 月 4 日	期后办理
2	上海徐家汇路证券营业部	上海市宝山区新村路 681 号 11 楼	沪证监机构字 [2010]66 号	2010 年 2 月 4 日	期后办理
3	上海长宁路证券营业部	上海市徐汇区天钥桥路 567 号	沪证监机构字 [2010]67 号	2010 年 2 月 4 日	期后办理
4	上海长江西路证券营业部	上海市共和新路 5199 号 1 楼 B 室、15 楼	沪证监机构字 [2010]298 号	2010 年 5 月 26 日	期后办理
5	南京中山北路证券营业部	江苏省南京市中山北路 301 号	苏证监机构字 [2010]259 号	2010 年 6 月 23 日	期后办理
6	南京中山北路第三证券营业部	江苏省南京市中央路 399 号天正国际广场 6 幢	苏证监机构字 [2010]288 号	2010 年 7 月 2 日	期后办理

(4) 报告期内服务部规范升级情况

序号	服务部名称	规范后名称	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰证券股份有限公司哈尔滨铁路街证券营业部肇东服务部	华泰证券股份有限公司绥化肇东正阳大街证券营业部	黑证监许可字 [2009]117 号	2009 年 12 月 11 日	2010 年 1 月 25 日
2	华泰证券股份有限公司牡丹江平安街证券营业部桦林服务部	华泰证券股份有限公司牡丹江桦林证券营业部	黑证监许可字 [2009]116 号	2009 年 12 月 2 日	2010 年 2 月 1 日

3	南京瑞金路证券营业部梅山证券服务部	南京江宁金箔路证券营业部	苏证监机构字[2010]3号	2010年1月6日	2010年2月1日
---	-------------------	--------------	----------------	-----------	-----------

(5) 报告期内，华泰联合证券有限责任公司营业网点新设、迁址、服务部规范升级等情况

截至 2010 年 6 月底，华泰联合证券有限责任公司开业营业部 67 家，筹建营业部 5 家，服务部升级 4 家。4 月，湖北 8 家网点规范新设工作完成。6 月，经中国证监会证监许可[2010]714 号核准，设立 5 家证券营业部。目前 5 家新设网点正在筹建，还未取得证照，尚未开业。

湖北 8 家网点新设情况如下：

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰联合证券有限责任公司安陆碧涓路证券营业部	湖北省安陆市碧涓路 208 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
2	华泰联合证券有限责任公司大悟城中北路证券营业部	湖北省大悟县城中北路供销社大楼	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
3	华泰联合证券有限责任公司云梦朝阳路证券营业部	湖北省云梦县朝阳路 1 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
4	华泰联合证券有限责任公司巴东楚天路证券营业部	湖北省恩施土家族苗族自治州巴东县楚天路 5 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
5	华泰联合证券有限责任公司建始业州大道证券营业部	湖北省恩施土家族苗族自治州建始县业州大道 47 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
6	华泰联合证券有限责任公司来凤凤翔大道证券营业部	湖北省恩施土家族苗族自治州来凤县凤翔大道 50 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
7	华泰联合证券有限责任公司利川公园路证券营业部	湖北省恩施土家族苗族自治州利川市公园路 1 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日
8	华泰联合证券有限责任公司神农架常青路证券营业部	湖北省神农架林区常青路 10 号	鄂证监机构字[2010]13 号	2010 年 3 月 15 日	2010 年 4 月 12 日

网点迁址情况如下：

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰联合证券有限责任公司深圳华强北路证券营业部	深圳市福田区竹子林四路教育科技大厦 10 楼	深证局发[2010]2 号	2010 年 1 月 7 日	2010 年 3 月 10 日
2	华泰联合证券有限责任公司福州六一南路证券营业部	福建省福州市六一中路 382 号光明桥珠宝玉石城 5 楼	闽证监机构字[2010]35 号	2010 年 3 月 2 日	2010 年 4 月 15 日
3	华泰联合证券有限责任公司深圳深南大道证券营业部	深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 7 楼	深证局机构字[2010]67 号	2010 年 3 月 24 日	期后办理
4	华泰联合证券有限责任公司深圳振兴路第二证券营业部	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋三楼	深证局发[2010]145 号	2010 年 5 月 18 号	期后办理

服务部规范情况如下:

序号	服务部名称	规范后名称	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰联合证券有限责任公司成都浣花北路证券营业部华阳证券服务部	华泰联合证券有限责任公司成都双流丁字街证券营业部	川证监机构字[2009]139号	2009年11月26日	2010年1月8日
2	华泰联合证券有限责任公司成都南一环路证券营业部中江县证券服务部	华泰联合证券有限责任公司德阳中江县朝阳南路证券营业部	川证监机构字[2009]117号	2009年12月24日	2010年2月10日
3	华泰联合证券有限责任公司成都梓潼桥西街证券营业部机投证券服务部	华泰联合证券有限责任公司成都晋阳路证券营业部	川证监机构字[2009]146号	2009年12月22日	2010年3月3日
4	华泰联合证券有限责任公司深圳民田路证券营业部西丽证券服务部	华泰联合证券有限责任公司深圳西丽留仙大道证券营业部	深证局发[2010]9号	2010年1月7日	2010年3月17日

3、报告期内公司股指期货 IB 业务情况

2010年3月22日,公司收到中国证监会江苏监管局《关于华泰证券股份有限公司为长城伟业期货有限公司提供中间介绍业务开业验收的意见函》(苏证监函[2010]69号),对公司为长城伟业期货有限公司提供中间介绍业务无异议。报告期内,已有21家营业部获得当地证监局出具的无异议函,业务覆盖江苏、浙江、上海、北京、天津、河南、西安、辽宁、黑龙江等省市地区。

4、集合理财事项

截至报告期末,公司合计管理的集合计划数量达到9只,合计管理份额60.22亿份,合计管理资产规模61.84亿元。报告期内,新增华泰紫金策略优选集合计划,首发募集资金规模为2.82亿元,于2010年2月9日公告成立。第2只限额特定产品紫金智富于2010年5月24日开始推广。5月13日,华泰紫金周期轮动集合计划经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司设立华泰紫金周期轮动集合资产管理计划的批复》(证监许可[2010]636号)获准设立。

5、对外投资事项

(1)报告期内,公司出资7亿元人民币,以每股5元的价格认购江苏银行股份有限公司2010年定向募集股份1.4亿股,公司持有江苏银行的股份由

5 亿股变更为 6.4 亿股，占其注册资本的 7.03%。

(2) 报告期内，公司根据 2009 年第一次临时股东大会决议，使用首次公开发行人民币普通股（A 股）股票的募集资金对长城伟业期货有限公司（以下简称“长城伟业”）进行增资。2010 年 6 月 24 日，中国证监会核准长城伟业注册资本由 3 亿元变更为 6 亿元，并同意其新增的注册资本由我公司以现金方式认缴 1.8 亿元。长城伟业已于报告期后完成了工商变更登记。长城伟业本次增资后，公司持有其股权比例仍为 60%。

(3) 报告期内，公司全资子公司华泰紫金投资有限责任公司投资了昆山世名科技有限公司、江苏中恒宠物用品股份有限公司及苏州浩波科技股份有限公司，投资金额分别为 2000 万元人民币、2320 万元人民币和 1820 万元人民币，所占股份比例分别为 10%、11.11%和 6.80%。

6、报告期内，持有我公司 5%以上股份的股东江苏汇鸿国际集团有限公司，将其于 2008 年 12 月 2 日办理的质押期至 2010 年 12 月 22 日的 5500 万股我公司股份提前办理了相关的解押手续。

7、报告期内，公司参股子公司友邦华泰基金管理有限公司更名为“华泰柏瑞基金管理有限公司”。

8、报告期内，公司收到中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司融资融券业务资格的批复》（证监许可[2010]766 号），同意公司“变更业务范围，增加融资融券业务”。

9、报告期内，根据公司 2009 年度股东大会决议，并经江苏证监局《关于华泰证券股份有限公司偿还次级债务无异议的函》（苏证监函[2010]164 号）同意，公司将 2008 年 11 月借入的人民币 1,999,724,222.79 元次级债务全额提前偿还。

10、受中国东方资产管理公司委托，中国东方资产管理公司长沙办事处于 2010 年 5 月 26 日至 6 月 23 日在湖南省产权交易所公开挂牌转让所持华泰

联合证券 0.3% 股权，我公司参与本次股权转让举牌并最终 935 万元竞得了该部分股权。2010 年 7 月 9 日，我公司与中国东方资产管理公司长沙办事处就上述股权转让签订了《产权交易合同》。目前正在办理股权变更相关手续。

(十二) 信息披露索引

报告期内及截至本报告刊登之日，公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）

上披露的信息如下：

序号	刊登日期	公告事项
1	2010-02-02	华泰证券首次公开发行股票招股意向书
2	2010-02-02	华泰证券首次公开发行股票招股意向书摘要
3	2010-02-02	华泰证券首次公开发行股票招股意向书附录
4	2010-02-02	华泰证券首次公开发行A股发行安排及初步询价公告
5	2010-02-05	华泰证券首次公开发行A股网上路演公告
6	2010-02-08	华泰证券首次公开发行A股投资风险特别公告
7	2010-02-08	华泰证券首次公开发行A股网上资金申购发行公告
8	2010-02-08	华泰证券首次公开发行A股网下发行公告
9	2010-02-11	华泰证券首次公开发行A股定价、网下发行结果及网上中签率公告
10	2010-02-12	华泰证券首次公开发行A股网上资金申购发行摇号中签结果公告
11	2010-02-25	华泰证券公司章程
12	2010-02-25	华泰证券首次公开发行股票招股说明书
13	2010-02-25	华泰证券首次公开发行A股股票上市公告书
14	2010-03-02	华泰证券关于签署募集资金三方监管协议的公告
15	2010-03-02	华泰证券第一届董事会第十六次会议决议公告
16	2010-03-27	华泰证券关于通过为期货公司提供中间介绍业务开业验收的公告
17	2010-04-17	华泰证券第一届董事会第十七次会议决议公告
18	2010-04-17	华泰证券关于预计 2010 年日常关联交易的公告
19	2010-04-17	华泰证券第一届监事会第五次会议决议公告
20	2010-04-17	华泰证券关于召开 2009 年度股东大会的通知
21	2010-04-17	华泰证券第一季度季报
22	2010-04-23	华泰证券关于增资江苏银行股份有限公司进展情况的公告
23	2010-04-23	华泰证券关于新设 5 家证券营业部获批的公告
24	2010-04-29	华泰证券 2009 年度股东大会会议资料
25	2010-04-29	华泰证券年报信息披露重大差错责任追究制度
26	2010-04-29	华泰证券内幕信息知情人登记管理及保密制度
27	2010-04-29	华泰证券重大信息内部报告制度
28	2010-05-04	华泰证券关于友邦华泰基金管理有限公司更名的公告
29	2010-05-08	华泰证券 2009 年度股东大会的法律意见书
30	2010-05-08	华泰证券 2009 年度股东大会决议公告
31	2010-05-18	华泰证券第一届董事会第十八次会议决议公告
32	2010-05-21	华泰证券网下配售A股股票（锁定期 3 个月）上市流通提示性公告
33	2010-06-04	华泰证券关于华泰联合证券新设 5 家证券营业部获批的公告
34	2010-06-10	华泰证券关于获准设立华泰紫金周期轮动集合资产管理计划的公告
35	2010-06-23	华泰证券关于完成融资融券业务工商和监管报备工作的公告
36	2010-06-25	华泰证券关于提前偿还次级债务的公告

37	2010-07-10	华泰证券关于定期披露公司月度经营情况主要财务信息的公告
38	2010-07-10	华泰证券 2010 年 6 月份经营情况主要财务信息
39	2010-07-17	华泰证券关于增资长城伟业期货有限公司的公告

七、财务会计报告

(一) 会计报表 (附后)

(二) 会计报表附注 (附后)

八、备查文件目录

本公司在办公地点备置下列备查文件供股东及投资者查询:

- (一) 载有董事长签名的半年度报告文本;
- (二) 载有董事长、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文;
- (三) 报告期内在中国证监会指定报刊上公开披露过的所有文件文本;
- (四) 公司章程文本;
- (五) 其他有关资料。

华泰证券股份有限公司

董事长:

二〇一〇年八月六日

合并资产负债表（未经审计）

2010 年 6 月 30 日

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	期末余额	年初余额
资产:			
货币资金	五.1	76,784,766,184.68	70,743,834,531.23
其中: 客户资金存款		60,860,070,521.74	65,686,978,117.73
结算备付金	五.2	7,902,629,172.07	14,413,843,187.41
其中: 客户备付金		6,958,981,222.84	10,295,919,199.23
拆出资金			
交易性金融资产	五.3	8,373,108,513.29	6,159,889,492.29
衍生金融资产			
买入返售金融资产	五.4	1,433,493,789.59	
应收利息		15,992,498.34	17,350,639.70
存出保证金	五.5	2,281,276,393.76	2,075,405,098.05
可供出售金融资产	五.6	3,137,270,982.09	1,259,217,288.77
持有至到期投资	五.7	5,000,000.00	5,000,000.00
长期股权投资	五.8	2,321,938,560.18	1,691,828,410.60
投资性房地产	五.9	95,000,106.64	96,739,848.04
固定资产	五.10	1,126,440,482.52	1,064,817,517.94
无形资产	五.11	373,804,444.65	381,102,161.43
其中: 交易席位费		20,772,368.18	24,185,052.80
商誉	五.12	51,341,567.30	51,341,567.30
递延所得税资产	五.13	180,516,404.06	346,657,495.59
其他资产	五.14	820,636,874.50	494,749,331.21
资产总计		104,903,215,973.67	98,801,776,569.56
负债:			
短期借款	五.16	65,429,250.00	17,609,600.00
其中: 质押借款			
拆入资金			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款	五.17	2,979,290,000.00	2,143,415,595.21
代理买卖证券款	五.18	65,765,939,077.45	73,549,104,015.77
代理承销证券款	五.19	20,800,000.00	1,006,228,534.00
应付职工薪酬	五.20	622,657,924.76	579,107,608.05
应交税费	五.21	58,676,151.14	485,030,701.03
应付利息	五.22	498,235.33	14,198,041.98
预计负债	五.23	447,118.94	447,118.94
长期借款			
应付债券	五.24		1,999,724,222.79
递延所得税负债	五.13	9,557,584.13	45,166,266.76
其他负债	五.25	4,492,193,733.65	4,827,652,668.38
负债合计		74,015,489,075.40	84,667,684,372.91
股东权益:			
股本	五.26	5,600,000,000.00	4,815,438,725.00
资本公积	五.27	17,188,693,756.96	2,661,404,206.97
减: 库存股			
盈余公积	五.28	585,109,402.29	585,109,402.29
一般风险准备	五.29	736,005,653.41	736,005,653.41
交易风险准备	五.29	646,121,965.66	646,121,965.66
未分配利润	五.30	5,903,610,015.58	4,483,262,367.11
外币报表折算差额		-6,354,754.29	-6,027,475.86
归属于母公司股东权益合计		30,653,186,039.61	13,921,314,844.58
少数股东权益	四.1	234,540,858.66	212,777,352.07
股东权益合计		30,887,726,898.27	14,134,092,196.65
负债和股东权益总计		104,903,215,973.67	98,801,776,569.56

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

母公司资产负债表（未经审计）

2010 年 6 月 30 日

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	期末余额	年初余额
资产:			
货币资金		53,983,172,510.73	45,044,299,706.56
其中: 客户资金存款		39,666,422,227.12	41,582,967,872.16
结算备付金		9,686,601,029.30	13,652,691,591.21
其中: 客户备付金		8,769,936,507.59	9,755,733,786.36
拆出资金			
交易性金融资产		6,719,107,175.96	3,543,980,104.20
衍生金融资产			
买入返售金融资产		263,260,000.00	
应收利息			
存出保证金		32,688,750.57	22,590,901.09
可供出售金融资产		3,100,928,974.54	1,191,296,037.31
持有至到期投资		5,000,000.00	5,000,000.00
长期股权投资	十一.1	3,854,889,978.46	3,286,179,828.88
投资性房地产		84,639,995.71	88,330,609.37
固定资产		929,547,986.54	896,201,182.39
无形资产		362,759,715.52	370,396,061.94
其中: 交易席位费		19,835,727.72	23,553,071.82
递延所得税资产		61,221,850.85	227,355,867.38
其他资产	十一.2	570,244,574.67	295,108,819.94
资产总计		79,654,062,542.85	68,623,430,710.27
负债:			
短期借款			
其中: 质押借款			
拆入资金			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款		2,429,290,000.00	1,200,000,000.00
代理买卖证券款		48,344,019,291.90	50,020,811,147.25
代理承销证券款			1,000,000,000.00
应付职工薪酬		308,892,371.73	332,242,380.57
应交税费		-51,379,530.36	316,113,358.02
应付利息		440,054.05	14,198,041.98
预计负债		447,118.94	447,118.94
长期借款			
应付债券			1,999,724,222.79
递延所得税负债			35,608,682.63
其他负债		236,685,353.12	1,547,970,896.37
负债合计		51,268,394,659.38	56,467,115,848.55
股东权益:			
股本		5,600,000,000.00	4,815,438,725.00
资本公积		16,984,844,671.14	2,440,155,906.58
减: 库存股			
盈余公积		585,109,402.29	585,109,402.29
一般风险准备		736,005,653.41	736,005,653.41
交易风险准备		646,121,965.66	646,121,965.66
未分配利润		3,833,586,190.97	2,933,483,208.78
股东权益合计		28,385,667,883.47	12,156,314,861.72
负债和股东权益总计		79,654,062,542.85	68,623,430,710.27

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

合并利润表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期金额
一、营业收入		3,588,680,568.97
手续费及佣金净收入	五.31	3,181,334,858.86
其中:代理买卖证券业务净收入		2,417,523,941.34
证券承销业务净收入		710,295,138.94
受托客户资产管理业务净收入		53,515,778.58
利息净收入	五.34	443,389,573.54
投资收益(损失以“-”号填列)	五.35	67,901,656.98
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		126,055,869.15
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	五.36	-110,862,731.90
汇兑收益(损失以“-”号填列)		59,938.79
其他业务收入	五.37	6,857,272.70
二、营业支出		1,808,955,628.43
营业税金及附加	五.38	179,964,455.41
业务及管理费	五.39	1,627,137,752.30
资产减值损失		
其他业务成本	五.40	1,853,420.72
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,779,724,940.54
加:营业外收入	五.41	4,832,522.51
减:营业外支出	五.42	6,272,398.22
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,778,285,064.83
减:所得税费用	五.43	335,764,306.98
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,442,520,757.85
归属于母公司所有者的净利润		1,420,347,648.47
少数股东损益		22,173,109.38
六、每股收益:		
(一)基本每股收益	五.44	0.27
(二)稀释每股收益		0.27
七、其他综合收益	五.45	-213,313,920.08
八、综合收益总额		1,229,206,837.77
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,207,443,331.18
归属于少数股东的综合收益总额		21,763,506.59

法定代表人:吴万善

主管会计工作负责人:吴万善

会计机构负责人:舒本娥

母公司利润表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期金额
一、营业收入		2,016,986,094.49
手续费及佣金净收入	十一.3	1,909,625,712.83
其中:代理买卖证券业务净收入		1,578,997,187.27
证券承销业务净收入		277,415,588.27
受托客户资产管理业务净收入		53,212,937.29
利息净收入		293,889,008.30
投资收益(损失以“-”号填列)	十一.4	-17,379,009.64
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		126,055,869.15
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-172,165,101.41
汇兑收益(损失以“-”号填列)		
其他业务收入		3,015,484.41
二、营业支出		960,835,092.46
营业税金及附加		103,323,913.58
业务及管理费		855,701,693.88
资产减值损失		
其他业务成本		1,809,485.00
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,056,151,002.03
加:营业外收入		4,364,681.69
减:营业外支出		5,159,083.41
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,055,356,600.31
减:所得税费用		155,253,618.12
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		900,102,982.19
六、每股收益:		
(一)基本每股收益		0.17
(二)稀释每股收益		0.17
七、其他综合收益		-195,177,824.29
八、综合收益总额		704,925,157.90

法定代表人:吴万善

主管会计工作负责人:吴万善

会计机构负责人:舒本娥

合并现金流量表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期金额
一、经营活动产生的现金流量:		
销售商品、提供劳务收到的现金		
客户存款和同业存放款项净增加额		-7,783,164,938.51
向中央银行借款净增加额		
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收到原保险合同保费取得的现金		
收到再保险业务现金净额		
保户储金及投资款净增加额		
处置交易性金融资产净增加额		-4,418,430,580.47
收取利息、手续费及佣金的现金		4,569,662,139.28
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		-597,619,384.80
收到的税费返还		7,652.16
收到其他与经营活动有关的现金	五.46	886,636,882.10
经营活动现金流入小计		-7,342,908,230.24
购买商品、接受劳务支付的现金		
客户贷款及垫款净增加额		
存放中央银行和同业款项净增加额		
支付原保险合同赔付款项的现金		
支付利息、手续费及佣金的现金		954,754,411.77
支付保单红利的现金		
支付给职工以及为职工支付的现金		948,508,475.60
支付的各项税费		722,414,426.83
支付其他与经营活动有关的现金	五.47	3,106,567,248.69
经营活动现金流出小计		5,732,244,562.89
经营活动产生的现金流量净额		-13,075,152,793.13
二、投资活动产生的现金流量:		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金		
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		822,739.73
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计		822,739.73
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		214,595,947.66
投资支付的现金		761,400,000.00
质押贷款净增加额		
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计		975,995,947.66
投资活动产生的现金流量净额		-975,173,207.93
三、筹资活动产生的现金流量:		
吸收投资收到的现金		15,532,208,476.60
其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金		
取得借款收到的现金		47,819,650.00
发行债券收到的现金		
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计		15,580,028,126.60
偿还债务支付的现金		1,999,724,222.79
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		
其中:子公司支付给少数股东的股利、利润		
支付其他与筹资活动有关的现金		

项目	附注	本期金额
筹资活动现金流出小计		1,999,724,222.79
筹资活动产生的现金流量净额		13,580,303,903.81
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-260,264.64
五、现金及现金等价物净增加额		-470,282,361.89
加：期初现金及现金等价物余额		85,157,677,718.64
六、期末现金及现金等价物余额		84,687,395,356.75

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

母公司现金流量表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期金额
一、经营活动产生的现金流量:		
客户存款和同业存放款项净增加额		-2,713,700,282.05
处置交易性金融资产净增加额		-5,540,692,093.91
收取利息、手续费及佣金的现金		2,856,050,655.77
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		966,030,000.00
收到其他与经营活动有关的现金		53,444,982.81
经营活动现金流入小计		-4,378,866,737.38
支付利息、手续费及佣金的现金		665,559,498.55
支付给职工以及为职工支付的现金		521,234,699.33
支付的各项税费		467,158,808.12
支付其他与经营活动有关的现金		1,678,710,803.65
经营活动现金流出小计		3,332,663,809.65
经营活动产生的现金流量净额		-7,711,530,547.03
二、投资活动产生的现金流量:		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金		
收到其他与投资活动有关的现金		243,899.73
投资活动现金流入小计		243,899.73
投资支付的现金		700,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		148,415,364.25
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计		848,415,364.25
投资活动产生的现金流量净额		-848,171,464.52
三、筹资活动产生的现金流量:		
吸收投资收到的现金		15,532,208,476.60
发行债券收到的现金		
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计		15,532,208,476.60
偿还债务支付的现金		1,999,724,222.79
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		
支付其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流出小计		1,999,724,222.79
筹资活动产生的现金流量净额		13,532,484,253.81
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		
五、现金及现金等价物净增加额		4,972,782,242.26
加: 期初现金及现金等价物余额		58,696,991,297.77
六、期末现金及现金等价物余额		63,669,773,540.03

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

合并所有者权益变动表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	本期金额									
	归属于母公司所有者权益								少数股东权益	所有者权益合计
	股本	资本公积	减: 库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润	其他		
一、上年年末余额	4,815,438,725.00	2,661,404,206.97		585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	4,483,262,367.11	-6,027,475.86	212,777,352.07	14,134,092,196.65
加: 同一控制下企业合并产生的追溯调整										
会计政策变更										-
前期差错更正										-
其他										
二、本年初余额	4,815,438,725.00	2,661,404,206.97		585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	4,483,262,367.11	-6,027,475.86	212,777,352.07	14,134,092,196.65
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	784,561,275.00	14,527,289,549.99	-	-	-	-	1,420,347,648.47	-327,278.43	21,763,506.59	16,753,634,701.62
（一）净利润							1,420,347,648.47		22,173,109.38	1,442,520,757.85
（二）其他综合收益		-212,577,038.86						-327,278.43	-409,602.79	-213,313,920.08
上述（一）和（二）小计	-	-212,577,038.86	-	-	-	-	1,420,347,648.47	-327,278.43	21,763,506.59	1,229,206,837.77
（三）所有者投入和减少资本	784,561,275.00	14,739,866,588.85		-	-	-	-	-	-	15,524,427,863.85
1. 所有者投入资本	784,561,275.00	14,739,866,588.85								15,524,427,863.85
2. 股份支付计入所有者权益的金额										-
3. 其他										-
（四）利润分配	-	-		-	-	-	-	-	-	-
1. 提取盈余公积										-
2. 提取一般风险准备										-
3. 对所有者（或股东）的分配										-
4. 其他										-
（五）所有者权益内部结转	-	-		-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增资本（或股本）										-
2. 盈余公积转增资本（或股本）										-
3. 盈余公积弥补亏损										-
4. 一般风险准备弥补亏损										
5. 其他										-
四、本期期末余额	5,600,000,000.00	17,188,693,756.96	-	585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	5,903,610,015.58	-6,354,754.29	234,540,858.66	30,887,726,898.27

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

母公司所有者权益变动表（未经审计）

2010 年 1—6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	本期金额							所有者权益合计
	实收资本(或股本)	资本公积	减:库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润	
一、上年年末余额	4,815,438,725.00	2,440,155,906.58		585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	2,933,483,208.78	12,156,314,861.72
加:会计政策变更								-
前期差错更正								-
其它								
二、本年初余额	4,815,438,725.00	2,440,155,906.58		585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	2,933,483,208.78	12,156,314,861.72
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	784,561,275.00	14,544,688,764.56		-	-	-	900,102,982.19	16,229,353,021.75
(一)净利润							900,102,982.19	900,102,982.19
(二)其他综合收益		-195,177,824.29					-	-195,177,824.29
上述(一)和(二)小计	-	-195,177,824.29		-	-	-	900,102,982.19	704,925,157.90
(三)所有者投入和减少资本	784,561,275.00	14,739,866,588.85		-	-	-	-	15,524,427,863.85
1.所有者投入资本	784,561,275.00	14,739,866,588.85						15,524,427,863.85
2.股份支付计入所有者权益的金额								-
3.其他								-
(四)利润分配	-	-		-	-	-	-	-
1.提取盈余公积								-
2.提取一般风险准备								-
3.对所有者(或股东)的分配								-
4.其他								-
(五)所有者权益内部结转								-
1.资本公积转增资本(或股本)	-	-		-	-	-	-	-
2.盈余公积转增资本(或股本)								-
3.盈余公积弥补亏损								-
4.一般风险准备弥补亏损								-
5.其他				-				-
四、本期期末余额	5,600,000,000.00	16,984,844,671.14	-	585,109,402.29	736,005,653.41	646,121,965.66	3,833,586,190.97	28,385,667,883.47

法定代表人:吴万善

主管会计工作负责人:吴万善

会计机构负责人:舒本娥

华泰证券股份有限公司

财务报表附注

一、公司基本情况

华泰证券股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)的前身为江苏省证券公司,经中国人民银行总行批准,于 1991 年 4 月 9 日设立,注册资本为人民币 1,000.00 万元。

1997 年 6 月经公司 1996 年度股东会通过,并经中国人民银行总行银复[1997]501 号文批准,公司实施增资方案,注册资本增至人民币 40,400.00 万元,同时公司更名为“江苏证券有限责任公司”,并于 1998 年 4 月 21 日变更工商注册登记。

1998 年 5 月经公司 1997 年度股东会通过,公司实施增资方案,注册资本增至人民币 82,800.00 万元,并于 1999 年 1 月 18 日变更工商注册登记,注册登记号为:3200001100365。

1999 年 3 月公司经股东会通过并经中国证券监督管理委员会证监机构字[1999]152 号文批准同意,公司的注册资本变更为 85,032.00 万元,同时公司更名为“华泰证券有限责任公司”并于 1999 年 12 月 21 日变更工商注册登记。

2001 年 4 月经公司股东会通过,公司预备实施增资方案,注册资本由人民币 85,032 万元增至 220,000.00 万元,于 2002 年 4 月经中国证监会核准,并于 2002 年 5 月 24 日变更工商注册登记。

2007 年 12 月经公司股东会通过并经中国证券监督管理委员会证监机构字[2007]311 号文批准同意,公司整体变更为股份有限公司,注册资本变更为 450,000.00 万元,并于 2007 年 12 月 7 日变更工商注册登记。

2009 年 7 月经公司股东大会通过并经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]715 号文批准同意,公司注册资本由人民币 450,000.00 万元增至 481,543.8725 万元,并且公司吸收合并信泰证券有限责任公司,变更业务范围,公司于 2009 年 7 月 31 日变更工商注册登记。

2010 年 2 月 9 日,经中国证券监督管理委员会证监发行字[2010]138 号《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复》批准,公司采取“网下向配售对象询价配售和网上向社会公众投资者定价发行相结合”的方式,公开发行人民币普通股(A 股)78,456.1275 万股,并于 2010 年 2 月 26 日在上海证券交易所挂牌交易。公司注册资本变更为人民币 560,000.00 万元,公司于 2010 年 2 月 23 日变更工商注册登记。

2010 年 6 月 4 日,经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]766 号《关于核准华泰证券股份有限公司融资融券资格的批复》批准,公司变更业务范围,增加融资融券业务。公司于 2010 年 6 月 9 日变更工商注册登记。

公司(含子公司华泰联合证券有限责任公司)的经营经营范围包括:证券经纪业务;证券自营;证券承销与保荐业务;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券资产管理;为期货公司提供中间介绍业务;融资融券业务;中国证监会批准的其他业务。

截止 2010 年 6 月 30 日,公司拥有华泰联合证券有限责任公司(原名联合证券有限责任公司)、长城伟业期货有限公司、华泰金融控股(香港)有限公司、华泰紫金投资有限责任公司等四家子公司;

母公司下属 129 家证券营业部，子公司华泰联合证券有限责任公司下属开业营业部 67 家，筹建营业部 5 家，子公司长城伟业期货有限公司下属 25 家营业部；公司拥有南方基金管理有限公司和华泰柏瑞基金管理有限公司（原名友邦华泰基金管理有限公司）两家联营企业。

二、重要会计政策、会计估计和前期差错

1、财务报表的编制基础：公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照《企业会计准则》及其他有关规定进行确认和计量，在此基础上编制财务报表。

2、遵循企业会计准则的声明：公司编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况、经营成果和现金流量的有关信息。

3、汇总会计报表编制方法

公司对总部及其所属营业部的会计报表进行汇总，汇总会计报表的编制以所属单位的个别会计报表为基础，并对公司内部交易事项进行抵销。

4、会计期间

公司以公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止为一个会计年度。

5、记账本位币

公司以人民币为记账本位币。

6、记账基础和会计计量属性

公司以权责发生制为记账基础。

一般采用历史成本对会计要素进行计量，在保证所确定的会计要素金额能够取得并可靠计量时，可以采用重置成本、可变现净值、现值、公允价值对会计要素进行计量。

7、企业合并会计处理方法

（1）同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时的，为同一控制下企业合并。合并方支付的合并对价和合并方取得的资产、负债按账面价值计量。合并方取得的资产、负债账面价值与支付的合并对价账面价值的差额，调整资本公积，资本公积不足以冲减的，调整留存收益。合并方为进行企业合并发生的直接相关费用于发生时计入当期损益。

（2）非同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下企业合并。合并方的合并成本和合并方取得的可辨认资产、负债按合并日的公允价值计量。合并成本大于合并中取得的被合并方可辨认资产、负债公允价值份额的差额，确认为商誉；合并成本小于合并中取得的被合并方可辨认资产、负债公允价值份额的差额，计入当期损益。合并方为进行企业合并发生的直接相关费用于发生时计入合并成本。

8、合并财务报表的编制方法

合并财务报表的合并范围包括本公司及本公司的子公司。子公司的经营成果和财务状况由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

本公司通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，视同被合并子公司

在本公司最终控制方对其实施控制时纳入合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。

本公司通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以合并日确定的各项可辨认资产、负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整，并自合并日起将被合并子公司纳入合并范围。

公司收购股权，股权购买日的确定方法：当收购协议已获股东大会通过，需要经过国家有关主管部门审批的，已获得批准，已与被收购企业办理必要的交接手续，已支付收购价款的大部分，并且有能力、有计划支付剩余款项，公司实际上已经控制被收购企业的经营政策，并从其活动中获得利益或承担风险时，作为认定股权购买日的条件。

子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，在编制合并财务报表时按本公司的会计期间或会计政策对子公司的财务报表进行必要的调整。合并范围内企业之间所有重大交易、余额以及未实现损益在编制合并财务报表时予以抵消。内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则不予抵消。

子公司少数股东应占的权益和损益分别在合并资产负债表中股东权益项目下和合并利润表中净利润项目下单独列示。

如果归属于少数股东的亏损超过少数股东在该子公司所有者权益中所享有的份额，除少数股东有义务且有能力承担的部分外，冲减母公司股东权益。如果子公司以后期间实现利润，在弥补母公司股东权益所承担的属于少数股东的损失之前，所有利润归属于母公司股东权益。

9、现金及现金等价物的确定标准

现金等价物是指本公司持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

10、外币业务和外币报表折算

(1) 外币业务核算

发生外币交易时，采用交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目采用期末即期汇率折算产生的汇兑差额，除根据借款费用核算方法应予资本化外，计入当期损益。

(2) 外币报表折算

A、资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算；

B、利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算；

C、产生的外币财务报表折算差额，在编制合并会计报表时，在所有者权益项目下单独作为“外币报表折算差额”列示。

11、金融资产的确认和计量

公司基于风险管理和投资策略等原因，通过内部书面文件对金融资产进行分类，将金融资产划分为四类：交易性金融资产；持有至到期投资；贷款和应收款项；以及可供出售金融资产。

(1) 交易性金融资产

公司采用近期出售的投资策略而买入的股票、基金、债券等确认为交易性金融资产。这类金融资产按取得时的公允价值入账，交易费用计入当期损益。支付的价款中包含已宣告发放的现金股利或债券利息，确认为应收项目，持有期间取得的利息或红利，确认为投资收益。期末按公允价值与原账面价值的差额确认公允价值变动损益，计入当期损益。售出时，确认投资收益。公司售出的交易性金融资产，以加权平均法结转成本。

(2) 持有至到期投资

公司有明确意图持有至到期且具有固定或可确定回收金额及固定期限的非衍生性金融资产，确认为持有至到期投资。持有至到期投资按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。后续计量采用实际利率法，按摊余成本计量。

(3) 贷款和应收款项

公司发放的贷款或提供劳务形成的应收款项等债权确认为贷款和应收款项。贷款按发放贷款的本金和相关交易费用之和作为初始确认金额，后续计量采用实际利率法，采用摊余成本计量。应收款项按向提供劳务对方应收的合同或协议价款作为初始入账金额。公司收回应收款项时，按取得的价款与应收款项账面价值之间的差额，确认为当期损益。

(4) 可供出售金融资产

没有划分为上述三类金融资产的非衍生性金融资产确认为可供出售金融资产，包括股票、基金、债券等。可供出售金融资产按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额，后续计量以公允价值计量，没有公允价值的按成本计量。处置可供出售金融资产时，按取得的价款与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额，与该金融资产账面价值之间的差额，确认为投资收益。成本的结转采用加权平均法。

(5) 金融资产的重分类

公司改变投资意图时，将持有至到期投资重分类为可供出售金融资产。出售比例累计达到该项资产 80% 以上的持有至到期投资，其剩余部分转入可供出售金融资产，且在本会计年度及以后两个完整的会计年度内不得再将该金融资产划分为持有至到期投资。

公司改变投资意图或公允价值不能可靠计量等，可将可供出售金融资产重分类为持有至到期投资。

12、公允价值的计量

公允价值的初始计量原则上采用以公开市场买入或卖出的价格，适用于金融资产和金融负债。根据谨慎性原则，对公允价值的后续计量方法规定如下：

(1) 股票类金融资产：首次发行未上市的股票，以发行价计算；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；已上市流通股票按照期末收盘价作为公允价值。

(2) 基金类金融资产：封闭型基金，其公允价值参照成份类股票公允价值的计算方法；开放式基金及集合资产管理计划等，以资产负债表日公布的最新净值计算公允价值。

(3) 证券交易所上市债券类金融资产：包括国债、企业债、可转债、金融债等，按最近收盘价作为公允价值。

(4) 银行间市场和场外交易债券类金融资产：包括国债、企业债、短期融资券、特种金融券和中央银行票据等，按持仓成本计算。

(5) 信托产品类金融资产：有交易价的，按收盘价作为公允价值；无交易价的，按成本价作为公允价值。

13、金融资产减值的计量

除交易性金融资产不需要进行减值测试外，其他类的金融资产均应在期末进行减值测试。

持有至到期投资、贷款的减值测试采用未来现金流折现法，资产负债表日，对于持有至到期投资、贷款，收集债务人的经营和信用状况，如果按合同或协议没有收到款项或利息，或债务人发生财务困难的，将根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额计算确认减值损失。

如果可供出售金融资产的发行人或债务人发生严重财务困难，很可能倒闭或进行财务重组等导致公允价值持续下降，预期这种下降趋势属于非暂时性的，可以认定该可供出售金融资产已发生减值，确认减值损失。可供出售金融资产发生减值的，在确认减值损失时，将原直接计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。

对应收款项采用计提坏账准备的方法：

(1) 坏账确认的标准为：

- A、因债务人破产或者死亡，以其破产财产或者遗产清偿后，仍然无法收回；
- B、因债务人逾期未履行偿债义务，并且有明显特征表明无法收回。

(2) 坏账损失的核算采用备抵法，按以下原则计提坏账准备：

A、有确凿证据表明该项应收款项不能收回或收回的可能性不大（如债务单位已撤销、破产、资不抵债、现金流量严重不足、发生严重的自然灾害等原因而在短时间内无法偿付债务），按应收款项余额全额计提坏账准备；

B、应收款项逾期三年以上，预计收回有一定难度的，按应收款项余额的50%计提坏账准备（应收关联公司除外）；

C、其他应收款项（包括应收关联公司款项）按账面余额的3%计提坏账准备。

14、金融负债的确认和计量

金融负债分为交易性金融负债和其他金融负债。

(1) 交易性金融负债

公司将近期回购而承担的金融负债确认为交易性金融负债，包括公司发行或创设的权证。这类金融负债按取得时的公允价值入账，交易费用计入当期损益。后续计量以公允价值计量，其公允价值变动计入当期损益。

(2) 其他金融负债

公司将除交易性金融负债以外的金融负债确认为其他金融负债。其他金融负债按其公允价值和相关交易费用之和作为初始入账金额，采用摊余成本进行后续计量。

(3) 公司为筹集资金而实际发行的债券确认为应付债券，并按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。后续计量采用实际利率法，按摊余成本计量。

15、资产管理业务的会计核算方法

(1) 客户资产管理业务指公司接受委托负责经营管理客户资产的业务，包括定向资产管理业务、集合资产管理业务和专项资产管理业务。本公司受托投资管理业务，接受托的款项同时确认为资产和负债，在表外进行核算。

(2) 公司受托经营的定向资产管理业务独立核算，按实际受托资产的款项，同时确定为一项资产和一项负债。对受托管理的资产进行证券买卖的交易税费、交易佣金的会计核算，比照代买卖证券业务的会计核算进行处理；受托投资证券买卖的损益比照公司自营业务的核算规定进行处理。

(3) 公司的集合资产管理业务，以托管客户为主体或集合计划，比照《证券投资基金会计核算业务指引》核算，独立建账，独立核算，定期与托管人的会计核算和估值结果进行复核。

(4) 合同到期公司与委托单位结算时，按合同规定比例计算的应由公司享有收益，确认当期收益。

16、长期股权投资的核算方法

(1) 长期股权投资分为对子公司投资、对合营企业投资、对联营企业投资和对被投资企业不具有控制、共同控制或重大影响，且在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益性投资（其他股权投资）。

(2) 长期股权投资的初始计量

①企业合并形成的长期股权投资的初始计量

A、同一控制下企业合并形成的长期股权投资，以在合并日取得被合并方所有者权益账面价值的份额作为初始投资成本，为进行企业合并发生的各项直接相关费用于发生时计入当期损益。

B、非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，以企业合并成本作为初始投资成本。企业合并成本包括付出的资产、发生或承担的负债、发行的权益性证券的公允价值，以及为进行企业合并发生的各项直接相关费用。

②企业合并以外其他方式取得的长期股权投资的初始计量

A、以支付现金取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为初始投资成本，包括购买过程中支付的手续费等必要支出。

B、以发行权益性证券方式取得的长期股权投资，按照发行的权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

C、投资者投入的长期股权投资，按照投资合同或协议约定的价值作为初始投资成本，但合同或协议约定价值不公允的除外。

D、以非货币资产交换方式取得的长期股权投资，如果该项非货币资产交换具有商业实质且换入资产或换出资产的公允价值能够可靠计量，则以换入资产或换出资产的公允价值和相关税费作为初始投资成本，公允价值与换出资产的账面价值的差额计入当期损益；如果该项非货币性资产交换不同时具备上述两个条件，则以换出资产的账面价值和相关税费作为初始投资成本。

E、以债务重组方式取得的长期股权投资，按取得的长期股权投资的公允价值作为初始投资成本，初始投资成本与重组债权账面价值之间的差额计入当期损益。

(3) 长期股权投资的后续计量

①对子公司投资和其他股权投资采用成本法核算。

按照应享有被投资单位宣告分派的现金股利或利润的份额，确认投资收益。

②对合营企业投资和对联营企业投资采用权益法核算。

按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额，确认投资收益。上述被投资单位的净损益，根据在取得投资时被投资单位资产负债的公允价值为基础进行调整。

对于被投资单位除净损益以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。处置该项投资时，将原计入资本公积的部分按相应比例转入当期损益。

(4) 长期股权投资的减值准备

①期末，如果对子公司投资、对合营企业投资和对联营企业投资存在减值迹象，则估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

②其他股权投资发生减值时，按照类似的金融资产的市场收益率对未来现金流量确定的现值低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

上述长期股权投资减值准备不得转回。

(5) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

对被投资单位具有共同控制，是指按照合同约定对某项经济活动所共有的控制，仅在与该项经济活动相关的重要财务和生产经营决策需要分享控制权的投资方一致同意时存在。

对被投资单位具有重大影响，是指对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。

17、投资性房地产的核算方法

(1) 投资性房地产分为已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权和已出租的建筑物。

(2) 投资性房地产按照取得时的成本进行初始计量。

(3) 本公司采用成本模式对投资性房地产进行后续计量。

①对于建筑物，参照固定资产的后续计量政策进行折旧。

②对于土地使用权，参照无形资产的后续计量政策进行摊销。

(4) 投资性房地产的减值准备

期末，如果投资性房地产存在减值迹象，则估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

上述投资性房地产减值准备不得转回。

18、固定资产的核算方法

(1) 固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

(2) 固定资产按照取得时的成本进行初始计量。

(3) 本公司采用直线法计提固定资产折旧，各类固定资产预计使用寿命、预计净残值率和年折旧率如下：

固定资产类别	预计使用寿命	预计净残值率	年折旧率
房屋及建筑物	35 年	3%	2.77%

固定资产类别	预计使用寿命	预计净残值率	年折旧率
电子设备	5 年	3%	19.40%
运输设备	5-8 年	3%	12.13%-19.40%
办公设备	5 年	3%	19.40%
其他设备	5 年	3%	19.40%

(4) 固定资产减值准备

期末，如果固定资产存在减值迹象，则估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

上述固定资产减值准备不得转回。

19、无形资产的核算方法

(1) 无形资产按照取得时的成本进行初始计量。

(2) 无形资产的摊销方法

①对于使用寿命有限的无形资产，在使用寿命期限内，采用直线法摊销。

其中：沪深交易所交易席位费按 10 年摊销；土地使用权按 50 年摊销，外购软件等按 10 年摊销。

②对于使用寿命不确定的无形资产不予摊销，于每年年度终了，对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核，如果有证据表明其使用寿命是有限的，则估计其使用寿命，并按其估计使用寿命进行摊销。

(3) 无形资产减值准备

①期末，如果使用寿命有限的无形资产存在减值迹象，则估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

②对于使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，都将于期末进行减值测试，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的差额确认为减值损失，计入当期损益。

上述无形资产减值准备不得转回。

20、商誉的核算办法

非同一控制下的企业合并，合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。

商誉在确认以后，持有期间不作摊销，每一个会计年度年末，按照账面价值与可收回金额孰低的原则计量，对于可收回金额低于账面价值的部分，计提减值准备，有关减值准备在提取以后，不能够转回。

21、长期待摊费用的摊销方法

长期待摊费用按其受益期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益的，则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

22、预计负债的确认原则

(1) 与或有事项相关的义务同时满足下列条件的，应当确认为预计负债：

- ①该义务是企业承担的现时义务；
- ②履行该义务很可能导致经济利益流出企业；

③该义务的金额能够可靠地计量。

(2) 预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定。

在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

①或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定；

②或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

23、收入的确认方法

(1)代理买卖证券业务的手续费收入在与客户办理买卖证券款项清算时确认收入；

(2)代兑付证券的手续费收入在代兑付证券业务基本完成，与委托方结算时确认收入；

(3)买入返售证券收入在证券返售到期时，按返售价格与买入成本的差额确认收入；

(4)证券承销、保荐业务按照提供劳务收入确认的条件，视提供劳务交易的结果是否能够可靠估计，合理确认；

(5)利息收入在与金融机构结算利息时确认收入；

(6) 咨询服务等业务以劳务已提供、视提供劳务交易的结果是否能够可靠估计，合理确认。

24、所得税会计处理方法

本公司采用资产负债表债务法进行所得税会计处理。

资产、负债的账面价值与其计税基础存在可抵扣暂时性差异的，以未来期间很可能取得的用以抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限，确认由可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产。

资产、负债的账面价值与其计税基础存在应纳税暂时性差异的，确认由应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债。

适用税率的确定：确认递延所得税资产、负债时，以预期收回资产或清偿债务期间的适用所得税税率为基础计算确定。

25、一般风险准备金的计算标准

一般按不低于税后利润的 10% 提取，累计达到注册资本的 50% 时不再提取。

26、交易风险准备金的计算标准

按税后利润的 10% 提取。

27、主要会计政策、会计估计的变更

本期无会计政策、会计估计变更。

三、税项

(一) 母公司（主要税种及税率）

1、营业税：按应纳税营业收入（扣除相关费用后的净额）的 5% 计缴。

2、企业所得税：

按应纳税所得额的 25% 计缴。根据国家税务总局国税发[2008]28 号《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理暂行办法》要求，公司总部和各分支机构全面实行统一计算、分级管理、就地预缴、汇

总清算的企业所得税征收办法。

3、地方税及附加：按照应纳营业额的 7% 缴纳城市维护建设税；按照应纳营业额的 4% 缴纳教育费附加。

(二) 控股子公司（主要税种及税率）

1、华泰联合证券有限责任公司（以下简称“华泰联合证券”或“联合证券”）

税 种	计税依据	税 率
营业税	应税营业收入	5%
城市维护建设税	应纳营业税	7%（深圳 1%）
教育费附加	应纳营业税	3%
企业所得税	应纳税所得额	25%（除深圳市、海口市外）
企业所得税	应纳税所得额	2009 年度 20%、2010 年度 22%（深圳市、海口市）

2、长城伟业期货有限公司（以下简称“长城伟业”）

税 种	计税依据	税 率
营业税	手续费净收入	5%
城市维护建设税	应纳营业税	7%（深圳 1%，东莞 5%）
教育费附加	应纳营业税	3%（东莞 4%）
企业所得税	应纳税所得额	25%

3、华泰金融控股（香港）有限公司（以下简称“华泰（香港）公司”）

税 种	计税依据	税 率
利得税	营业利润	最高税率 16.5%
物业税	换取物业使用权的成本	15%

4、华泰紫金投资有限责任公司（以下简称“华泰紫金公司”）

税 种	计税依据	税 率
企业所得税	应纳税所得额	25%

四、企业合并及合并财务报表

1、子公司情况

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司

①华泰金融控股（香港）有限公司

子公司全称	华泰金融控股（香港）有限公司
子公司类型	全资子公司
注册地	香港
业务性质	证券业
注册资本	港币 5,000 万元
经营范围	证券金融

子公司全称	华泰金融控股（香港）有限公司
期末实际出资额	港币 5,000 万元
实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	零
持股比例(%)	100
表决权比例(%)	100
是否合并报表	是
少数股东权益	零
少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	零
从母公司所有者权益冲减子公司少数股东分担的本期亏损超过少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额后的余额	零

②华泰紫金投资有限责任公司

子公司全称	华泰紫金投资有限责任公司
子公司类型	全资子公司
注册地	南京
业务性质	投资公司
注册资本	人民币 20,000 万元
经营范围	股权投资
期末实际出资额	人民币 20,000 万元
实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	零
持股比例(%)	100
表决权比例(%)	100
是否合并报表	是
少数股东权益	零
少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	零
从母公司所有者权益冲减子公司少数股东分担的本期亏损超过少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额后的余额	零

(2) 非同一控制下企业合并取得的子公司

①华泰联合证券有限责任公司

子公司全称	华泰联合证券有限责任公司
子公司类型	控股子公司
注册地	深圳
业务性质	证券业
注册资本	人民币 100,000 万元
经营范围	证券经纪业务（限广东、广西、海南、湖北、湖南、福建、江西、四川、重庆、云南、贵州、西藏），证券的承销与保荐业务（限深圳证券交易所相关业务）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；中国证监会批准的其他业务。
期末实际出资额	人民币 118,887 万元
实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	无
持股比例(%)	97.70
表决权比例(%)	97.70
是否合并报表	是
少数股东权益	79,524,972.73 元

子公司全称	华泰联合证券有限责任公司
少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	零
从母公司所有者权益冲减子公司少数股东分担的本期亏损超过少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额后的余额	零

②长城伟业期货有限公司

子公司全称	长城伟业期货有限公司
子公司类型	控股子公司
注册地	广州
业务性质	期货公司
注册资本	人民币 30,000 万元
经营范围	商品期货经纪、金融期货经纪
期末实际出资额	人民币 18,660 万元
实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	零
持股比例(%)	60
表决权比例(%)	60
是否合并报表	是
少数股东权益	155,015,885.93 元
少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	零
从母公司所有者权益冲减子公司少数股东分担的本期亏损超过少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额后的余额	零

2、境外经营实体主要报表项目的折算汇率

本公司境外经营实体外币财务报表按以下方法折算为人民币财务报表，资产负债表中的所有资产、负债类项目按资产负债表日的即期汇率折算；除未分配利润项目外的股东权益项目按发生时的即期汇率折算，利润表所有项目及反映利润分配发生额的项目按交易发生日的即期汇率折算。

资产负债表日外币对人民币汇率按照国家外汇管理局发布的中间价或根据美元对人民币的基准汇率和国家外汇管理局提供的美元对其他主要外币汇率进行套算，按照套算后的汇率作为折算汇率。

五、合并财务报表主要项目注释

(如无特别注明，以下货币单位均为人民币元)

1、货币资金

项目	币种	2010 年 6 月 30 日			2009 年 12 月 31 日		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
现金	人民币	2,409,236.57		2,409,236.57	1,362,169.50		1,362,169.50
小计				2,409,236.57	-		1,362,169.50
银行存款							
其中：公司自有				15,800,483,276.71			5,055,375,830.62
	人民币	15,569,863,217.85		15,569,863,217.85	4,802,138,312.37		4,802,138,312.37
	美元	26,183,268.24	6.7909	178,240,179.13	26,088,109.36	6.8282	178,134,828.35
	港币	59,624,605.34	0.87239	52,379,879.73	85,296,330.25	0.88048	75,102,689.90

项目	币种	2010年6月30日			2009年12月31日		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
客户存款				60,860,070,521.74			65,686,978,117.73
	人民币	59,874,231,031.77		59,874,231,031.77	64,613,496,210.96		64,613,496,210.96
	美元	83,886,914.17	6.7909	570,593,793.55	95,029,817.65	6.8282	648,882,603.32
	港币	489,949,357.22	0.87239	415,245,696.42	482,227,608.60	0.88048	424,599,303.45
小计				76,660,553,798.45			70,742,353,948.35
其他货币资金		121,803,149.66		121,803,149.66	118,413.38	-	118,413.38
小计				121,803,149.66		-	118,413.38
合计				76,784,766,184.68			70,743,834,531.23

2、 结算备付金

项目	币种	2010年6月30日			2009年12月31日		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
其中：公司备付金	人民币	943,647,949.23		943,647,949.23	4,117,923,988.18		4,117,923,988.18
小计				943,647,949.23			4,117,923,988.18
客户备付金	人民币	6,856,517,571.41		6,856,517,571.41	10,229,983,317.04		10,229,983,317.04
	美元	9,426,446.83	6.7909	73,268,000.23	6,618,932.98	6.8282	45,195,398.19
	港币	31,681,690.25	0.87239	29,195,651.20	23,555,348.10	0.88048	20,740,484.00
小计				6,958,981,222.84			10,295,919,199.23
合计				7,902,629,172.07			14,413,843,187.41

3、 交易性金融资产

项目	2010年6月30日		2009年12月31日	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
债券	7,035,659,119.18	7,089,659,529.86	4,036,176,787.53	4,049,506,703.14
基金	130,551,434.00	124,453,280.43	1,601,621,096.83	1,627,059,606.37
权益工具	957,226,246.25	804,224,990.38	402,970,751.20	374,429,417.78
国债	354,502,929.75	354,770,712.62	108,658,133.94	108,893,765.00
合计	8,477,939,729.18	8,373,108,513.29	6,149,426,769.50	6,159,889,492.29

4、 买入返售金融资产

(1) 按金融资产分类

项目	2010年6月30日	2009年12月31日
买入返售证券	1,433,493,789.59	-
合计	1,433,493,789.59	-

(2) 按交易对手分类

项目	2010年6月30日	2009年12月31日
银行金融机构	1,250,233,789.59	-
非银行金融机构	183,260,000.00	-
合计	1,433,493,789.59	-

5、存出保证金

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
交易保证金	333,903,730.07	318,757,545.81
履约保证金	4,000,000.00	4,000,000.00
期货公司保证金	1,943,372,663.69	1,752,647,552.24
合 计	2,281,276,393.76	2,075,405,098.05

6、可供出售金融资产

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
	公允价值	公允价值
债券	1,381,071,508.24	452,400.00
其中：国债		
权益工具	1,627,878,709.82	1,094,473,840.21
其中：基金	100,190,271.32	15,872,000.00
其他	128,320,764.03	16,4291,048.56
合 计	3,137,270,982.09	1,259,217,288.77

7、持有至到期投资

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
企业债券	5,000,000.00	5,000,000.00
持有至到期投资合计	5,000,000.00	5,000,000.00
减：持有至到期投资减值准备		
持有至到期投资账面价值	5,000,000.00	5,000,000.00

8、长期股权投资

(1) 分类情况

项 目	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	金额	减值准备	金额	减值准备
按成本法核算的长期股权投资	1,426,061,834.86	30,438,762.66	664,661,834.86	30,438,762.66
按权益法核算的长期股权投资	926,315,487.98	-	1,057,605,338.40	-
合 计	2,352,377,322.84	30,438,762.66	1,722,267,173.26	30,438,762.66

(2) 按成本法核算的长期股权投资主要单位列示如下：

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	初始投资金额	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
江苏银行股份有限公司	7.03%	1,300,000,000.00	600,000,000.00	700,000,000.00	-	1,300,000,000.00
深圳市巨田投资有限 责任公司	3.78%	22,666,762.00	22,666,762.00	-	-	22,666,762.00
通鼎光电	2.49%	20,000,000.00	20,000,000.00	-	-	20,000,000.00
世名科技	10.00%	20,000,000.00	-	20,000,000.00	-	20,000,000.00
浩波科技	6.80%	18,200,000.00		18,200,000.00		18,200,000.00
中恒宠物	11.11%	23,200,000.00	-	23,200,000.00	-	23,200,000.00
其他法人股投资	-	21,995,072.86	21,995,072.86		-	21,995,072.86

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	初始投资金额	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
合计		1,426,061,834.86	664,661,834.86	761,400,000.00	-	1,426,061,834.86

(3) 按权益法核算的长期股权投资

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	2009 年 12 月 31 日	本期权益增减额	本期红利	本期转让	2010 年 6 月 30 日
南方基金管理有限公司	45.00%	886,741,463.93	57,499,092.58	202,500,000.00	-	741,740,556.51
华泰柏瑞基金管理有限 公司	49.00%	170,863,874.47	13,711,057.00	-	-	184,574,931.47
合 计		1,057,605,338.40	71,210,149.58	202,500,000.00	-	926,315,487.98

(4) 长期股权投资减值准备

被投资单位名称	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
深圳市巨田投资有限责任公司	22,666,762.00			22,666,762.00
其他投资	7,772,000.66			7,772,000.66
合 计	30,438,762.66			30,438,762.66

9、投资性房地产

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
原 值				
房屋建筑物	116,373,948.94			116,373,948.94
累计折旧				
房屋建筑物	17,713,551.56	1,739,741.40		19,453,292.96
减值准备				
房屋建筑物	1,920,549.34			1,920,549.34
账面价值				
房屋建筑物	96,739,848.04			95,000,106.64

10、 固定资产

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
原 值				
房屋及建筑物	731,318,169.53	51,672,881.77		782,991,051.30
电子设备	703,199,930.10	71,270,493.93	19,820,878.45	754,649,545.58
运输设备	111,092,723.31	38,997,915.36	13,013,771.27	137,076,867.40
办公设备	58,470,262.88	8,248,085.29	1,965,488.79	64,752,859.38
其他设备	6,610,087.15	1,431,325.40	903,966.66	7,137,445.89
合 计	1,610,691,172.97	171,620,701.75	35,704,105.17	1,746,607,769.55
累计折旧				
房屋及建筑物	160,208,213.24	10,220,601.18	-	170,428,814.42
电子设备	292,061,056.08	67,570,704.54	7,967,117.55	351,664,643.07
运输设备	61,571,856.70	9,476,557.43	10,100,146.58	60,948,267.55
办公设备	27,417,269.76	5,485,691.48	586,200.01	32,316,761.24
其他设备	4,615,259.25	793,079.20	599,537.70	4,808,800.75

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
合 计	545,873,655.03	93,546,633.84	19,253,001.84	620,167,287.03
减值准备				
房屋及建筑物	-			
电子设备	-			
运输设备	-			
办公设备	-			
其他设备	-			
合 计	-			
账面价值				
房屋及建筑物	571,109,956.29			612,562,236.88
电子设备	411,138,874.02			402,984,902.51
运输设备	49,520,866.61			76,128,599.85
办公设备	31,052,993.12			32,436,098.14
其他设备	1,994,827.90			2,328,645.14
合 计	1,064,817,517.94			1,126,440,482.52

11、 无形资产

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
原 值				
土地使用权	359,161,122.60	-	-	359,161,122.60
交易席位费[注]	125,598,474.71	-	3,802.30	125,594,672.41
软件支出等	47,534,043.41	3,805,700.00	-	51,339,743.41
合 计	532,293,640.72	3,805,700.00	3,802.30	536,095,538.42
累计摊销				
土地使用权	13,362,205.53	4,188,069.86	-	17,550,275.39
交易席位费	101,413,421.91	3,408,882.32	-	104,822,304.23
软件支出等	36,415,851.85	3,502,662.30	-	39,918,514.15
合 计	151,191,479.29	11,099,614.48	-	162,291,093.77
减值准备				
土地使用权	-			
交易席位费	-			
软件支出等	-			
合 计	-			
账面价值				
土地使用权	345,798,917.07			341,610,847.21
交易席位费	24,185,052.80			20,772,368.18
软件支出等	11,118,191.56			11,421,229.26
合 计	381,102,161.43			373,804,444.65

[注]交易席位费

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
一、原价合计	125,598,474.71		3,802.30	125,594,672.41

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
1. 上海证券交易所	82,507,452.82			82,507,452.82
其中：A 股	75,477,156.76			75,477,156.76
B 股	7,030,296.06			7,030,296.06
2. 深圳证券交易所	41,927,196.29			41,927,196.29
其中：A 股	41,077,196.29			41,077,196.29
B 股	850,000.00			850,000.00
3.其他交易所	1,163,825.60		3,802.30	1,160,023.30
二、累计摊销额合计	101,413,421.91	3,408,882.32		104,822,304.23
1. 上海证券交易所	65,295,172.41	2,204,876.96		67,500,049.37
其中：A 股	59,747,648.21	1,967,578.52		61,715,226.73
B 股	5,547,524.20	237,298.44		5,784,822.64
2. 深圳证券交易所	35,373,969.27	1,204,005.37		36,577,974.64
其中：A 股	34,643,969.27	1,204,005.37		35,847,974.64
B 股	730,000.00			730,000.00
3.其他交易所	744,280.23			744,280.23
三、交易席位费账面价值合计	24,185,052.80			20,772,368.18
1. 上海证券交易所	17,212,280.41			15,007,403.46
其中：A 股	15,729,508.55			13,761,930.04
B 股	1,482,771.86			1,245,473.42
2. 深圳证券交易所	6,553,227.02			5,349,221.65
其中：A 股	6,433,227.02			5,229,221.65
B 股	120,000.00			120,000.00
3.其他交易所	419,545.37			415,743.07

12、 商誉

项 目	联合证券	长城伟业	2010 年 6 月 30 日
原始投资金额	702,563,500.00	29,580,000.00	732,143,500.00
购入时按净资产享有权益	651,474,060.20	29,326,040.43	680,800,100.63
购入时溢价	51,089,439.80	253,959.57	51,343,399.37
减：已摊销		1,832.07	1,832.07
减值准备			
已转销			
净 额	51,089,439.80	252,127.50	51,341,567.30

13、递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 已确认的递延所得税资产和递延所得税负债

项目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
递延所得税资产：		
交易性金融资产	31,597,690.55	7,142,513.59

项目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
应收帐款	119,098,959.35	119,098,959.35
可供出售金融资产	21,753,606.51	-
长期股权投资	6,880,689.47	6,880,689.47
固定资产	422,520.85	422,520.85
以后年度可弥补亏损	762,937.33	770,012.33
其他	-	212,342,800.00
小 计	180,516,404.06	346,657,495.59
递延所得税负债:	-	-
交易性金融资产	-	10,584,920.90
可供出售金融资产	9,557,584.13	34,581,345.86
小 计	9,557,584.13	45,166,266.76

14、其他资产

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
应收款项 A	340,887,202.43	242,573,039.72
应收股利 B	202,500,000.00	
其他流动资产	28,439,423.11	29,057,539.10
在建工程	36,103,499.51	17,210,626.68
固定资产清理	174,065.35	160,154.25
长期待摊费用	210,395,213.76	204,347,872.17
其他非流动资产	2,137,470.34	1,400,099.29
合 计	820,636,874.50	494,749,331.21

(A)应收款项

(1) 分类情况:

类 别	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	金额	比例	金额	比例
1 年以内	208,654,046.87	23.85%	136,922,688.23	17.63%
1 - 2 年	30,302,820.17	3.46%	4,178,859.09	0.54%
2 - 3 年	4,021,043.96	0.46%	40,100,000.40	5.16%
3 年以上	631,923,947.75	72.23%	595,386,148.32	76.67%
应收款项小计	874,901,858.75	100.00%	776,587,696.04	100.00%
减: 应收款项坏账准备	534,014,656.32	-	534,014,656.32	-
合 计	340,887,202.43	-	242,573,039.72	-

(2) 应收款项中, 金额较大的单位欠款情况:

单位名称	金 额	款项性质
四通集团公司	223,213,149.14	占用子公司华泰联合证券原受托管理营业部资金及账外融资等

单位名称	金 额	款项性质
华诚投资管理有限公司	65,606,551.91	占用子公司华泰联合证券原受托管理营业部资金等
亚洲证券清算组[注]	63,530,884.33	待弥补客户资金缺口
深圳众禄投资顾问有限公司	52,225,861.51	子公司华泰联合证券往来款
天津南大科技有限公司	30,869,930.42	子公司华泰联合证券代垫款项
合 计	435,446,377.31	

[注]系公司接收原亚洲证券证券类资产并入待弥补资金缺口。

(B)应收股利

本公司应收股利为联营企业南方基金已宣告尚未发放的股利。

15、资产减值准备

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期计提	本期减少		2010 年 6 月 30 日
			转回	转销	
坏账准备	534,014,656.32				534,014,656.32
长期股权投资减值准备	30,438,762.66				30,438,762.66
投资性房地产减值准备	1,920,549.34				1,920,549.34
合 计	566,373,968.32				566,373,968.32

16、短期借款

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
保证借款	65,429,250.00	17,609,600.00
合 计	65,429,250.00	17,609,600.00

17、卖出回购金融资产款

(1) 按性质分类:

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
债券	2,979,290,000.00	2,143,415,595.21
合 计	2,979,290,000.00	2,143,415,595.21

(2) 按交易方分类:

交易类别	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
银行金融机构	1,250,000,000.00	1,945,200,000.00
非银行金融机构	1,729,290,000.00	198,215,595.21
合 计	2,979,290,000.00	2,143,415,595.21

18、代理买卖证券款

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
个人客户	64,558,002,052.37	68,904,514,744.21
法人客户	1,207,937,025.08	4,644,589,271.56
合 计	65,765,939,077.45	73,549,104,015.77

19、代理承销证券款

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
股票	20,800,000.00	6,228,534.00
债券		
其中：企业债		1,000,000,000.00
合 计	20,800,000.00	1,006,228,534.00

20、应付职工薪酬

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
工资、奖金、津贴和补贴	547,267,166.15	767,890,679.28	724,622,818.07	590,535,027.36
职工福利费	26,391.75	2,491,649.32	2,518,637.77	-596.70
社会保险费	4,259,116.44	15,231,115.78	13,386,401.40	6,103,830.82
住房公积金	381,186.82	5,442,427.37	5,443,223.02	380,391.17
工会经费	13,745,248.79	8,895,246.51	9,624,221.91	13,016,273.39
职工教育经费	13,428,498.10	6,502,137.93	7,307,637.31	12,622,998.72
合 计	579,107,608.05	806,453,256.19	762,902,939.48	622,657,924.76

21、应交税费

税 种	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
营业税	29,359,896.63	56,908,041.73
城建税	1,316,725.99	3,416,986.62
所得税	17,407,060.56	305,299,385.29
客户资金利息税	1,096,584.60	378,333.58
个人所得税	11,913,391.29	112,927,445.33
其他	-2,417,507.93	6,100,508.48
合 计	58,676,151.14	485,030,701.03

22、应付利息

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
应付债券利息		14,198,041.98
其他	498,235.33	-
合 计	498,235.33	14,198,041.98

23、预计负债

项 目	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
原信泰证券诉讼赔款	447,118.94			447,118.94
合 计	447,118.94			447,118.94

24、应付债券

债券名称	面值	发行日期	债券期限	2009 年 12 月 31 日	本期偿还金额	2010 年 6 月 30 日
次级债券	1,999,724,222.79	2008 年 11 月 24 日	10 年	1,999,724,222.79	1,999,724,222.79	-

25、其他负债

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
应付款项	308,220,475.28	1,646,002,184.63
应付股利	19,749,082.37	19,729,238.75
代兑付债券款	15,100,585.64	17,595,595.26
期货风险准备金	26,248,603.45	17,899,062.73
预提费用	587,502.72	420,920.03
期货公司客户保证金	4,113,876,855.77	3,115,183,214.80
其他	8,410,628.42	10,822,452.18
期应付款		-
合 计	4,492,193,733.65	4,827,652,668.38

26、股本

股东类别	2010 年 6 月 30 日	比例	2009 年 12 月 31 日	比例
有限售条件股份				
境内法人持股	4,815,438,725.00	85.99%	4,815,438,725.00	100.00%
其他				
有限售条件股份合计	4,815,438,725.00	85.99%	4,815,438,725.00	100.00%
无限售条件股份				
人民币普通股	784,561,275.00	14.01%		
无限售条件股份合计	784,561,275.00	14.01%		
合 计	5,600,000,000.00	100.00%	4,815,438,725.00	100.00%

注：经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]138 号文核准，公司于 2010 年 2 月首次公开发行人民币普通股 78,456.1275 万股，每股发行价格 20 元。本次募集资金到位情况已经天衡会计师事务所有限公司审验，并于 2010 年 2 月 12 日出具了天衡验字（2010）009 号验资报告。

27、资本公积

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
股本溢价	17,200,549,379.50	2,460,682,790.65
其他资本公积	-11,855,622.54	200,721,416.32
合 计	17,188,693,756.96	2,661,404,206.97

28、盈余公积

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
法定盈余公积	585,109,402.29	585,109,402.29
任意盈余公积		
合 计	585,109,402.29	585,109,402.29

29、一般风险准备、交易风险准备

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
一般风险准备	736,005,653.41	736,005,653.41
交易风险准备	646,121,965.66	646,121,965.66

30、未分配利润

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
年初未分配利润	4,483,262,367.11	1,603,244,722.84
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,420,347,648.47	3,795,291,501.09
资本公积弥补亏损		
减：提取法定盈余公积		283,757,863.81
提取一般风险准备		283,757,863.81
提取交易风险准备金		347,758,129.20
对股东的分配		
转增股本		
未分配利润	5,903,610,015.58	4,483,262,367.11
其中：应付现金股利		

31、手续费及佣金净收入

项 目	2010 年 1-6 月
手续费及佣金收入	3,898,022,940.95
— 证券承销业务	740,639,190.81
— 证券经纪业务	2,845,615,640.10
— 受托客户资产管理业务	53,515,778.58
— 开放式基金分仓及代销收入	158,381,564.38
— 期货公司收入	99,870,767.08
手续费及佣金支出	716,688,082.09
— 证券经纪业务手续费支出	685,993,464.35
— 其他	30,694,617.74
手续费及佣金净收入	3,181,334,858.86

32、受托客户资产管理业务

资产项目	2009 年 12 月 31 日	2010 年 6 月 30 日	负债项目	2009 年 12 月 31 日	2010 年 6 月 30 日
受托管理资金存款	4,178,934,828.76	1,964,964,076.15	受托管理资金	13,342,354,071.32	6,189,369,316.63
客户结算备付金	94,746,770.89	35,308,621.68	应付款项	1,175,059,651.02	195,023,026.66
存出与托管客户资金	5,462,123,913.47	524,493,607.91			
应收款项	7,395,315.59	9,094,208.10			
受托投资	4,774,212,893.63	3,850,531,829.45			
其中：投资成本	4,295,807,861.27	4,181,177,445.36			
已实现未结算损益	478,405,032.36	-330,645,615.91			

资产项目	2009年12月31日	2010年6月30日	负债项目	2009年12月31日	2010年6月30日
合 计	14,517,413,722.34	6,384,392,343.29	合 计	14,517,413,722.34	6,384,392,343.29

33、受托客户资产管理业务手续费及佣金收入

项 目	2010年1-6月
定向资产管理业务	435,128.07
专项资产管理业务	
集合资产管理业务	53,080,650.51
合 计	53,515,778.58

34、利息净收入

项 目	2010年1-6月
利息收入	670,281,055.98
-存放同业	669,932,361.46
-其他	348,694.52
利息支出	226,891,482.44
-拆借资金	-
-客户资金	127,187,933.98
-债券利息	68,647,183.76
-卖出回购金融资产	24,697,526.07
-其他	6,358,838.63
利息净收入	443,389,573.54

35、投资净收益

项 目	2010年1-6月
联营企业和合营企业的投资收益	126,055,869.15
出售交易性金融资产的投资收益	-65,186,621.32
交易性金融负债形成的投资收益	
出售可供出售金融资产的投资收益	-85,273,097.76
出售持有至到期金融资产的投资收益	
金融资产持有期间取得的收益	92,308,403.25
持有至到期投资持有期间取得的收益	
衍生金融工具的投资收益	-2,896.34
其 他	
合 计	67,901,656.98

36、公允价值变动净收益

项 目	2010年1-6月
交易性金融资产公允价值变动收益	-114,870,971.90
交易性金融负债公允价值变动收益	-
衍生金融工具公允价值变动收益	4,008,240.00
融出证券公允价值变动收益	

项 目	2010 年 1-6 月
合 计	-110,862,731.90

37、其他业务收入

项 目	2010 年 1-6 月
房屋租赁收入	3,855,922.75
其他	3,001,349.95
合 计	6,857,272.70

38、营业税金及附加

项 目	2010 年 1-6 月
营业税	163,922,385.21
城建税	9,057,303.37
教育费附加	5,648,551.33
其他	1,336,215.50
合 计	179,964,455.41

39、业务及管理费

公司发生的主要业务及管理费如下：

类 别	2010 年 1-6 月
职工工资	725,808,758.63
劳务费	92,369,511.04
咨询费	22,156,171.90
投资者保护基金	59,792,660.26
劳动保险金	87,150,760.44
房屋租赁费	84,955,468.28
邮电通讯费	50,077,104.81
业务招待费	61,183,741.94
差旅费	33,865,865.51
固定资产折旧费	81,369,253.30
其他	328,408,456.19
合 计	1,627,137,752.30

40、其他业务成本

项 目	2010 年 1-6 月
房屋销售成本	1,547,778.06
其 他	305,642.66
合 计	1,853,420.72

41、营业外收入

项 目	2010 年 1-6 月
印花税及个人所得税返还收入	128,750.36
固定资产处置净收入	422,447.66

其 他	4,281,324.49
合 计	4,832,522.51

42、营业外支出

项 目	2010 年 1-6 月
处理固定资产净损失	109,450.54
捐赠支出	2,664,810.00
一次性房补	1,279,320.22
其 他	2,218,817.46
合 计	6,272,398.22

43、所得税费用

项 目	2010 年 1-6 月
当期所得税	370,804,404.84
递延所得税	-35,040,097.86
合 计	335,764,306.98

44、基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

项 目	2010 年 1-6 月
归属于母公司所有者的净利润	1,420,347,648.47
股本(加权平均)	5,338,479,575.00
每股收益	0.2661
稀释每股收益	0.2661

注：基本每股收益按照归属于本公司普通股股东的当期净利润，除以发行在外普通股的加权平均数计算。

45、其他综合收益

项 目	2010 年 1-6 月
可供出售金融资产公允价值变动净额	-204,918,290.32
权益法下被投资单位其他股东权益变动的影响	-54,845,719.57
与计入股东权益项目相关的所得税影响	46,777,368.24
其他	-327,278.43
合 计	-213,313,920.08

46、收到其他与经营活动有关的现金

项 目	2010 年 6 月 30 日
期货公司保证金	807,968,529.52
代理承销证券款	14,571,466.00
存出保证金本期净收回	
其他业务收入	6,857,272.70
营业外收入	4,246,030.35
往来	52,993,583.53
合 计	886,636,882.10

47、支付其他与经营活动有关的现金

项 目	2010 年 6 月 30 日
直接支付的费用	597,331,986.49
支付的开放式基金	1,276,197,634.21
支付投资者保护基金	58,836,407.22
支付的证券承销款净额	1,000,000,000.00
其他业务支出	305,642.66
营业外支出	3,651,282.79
支付的往来款	139,583,821.92
支付的存出保证金	15,146,184.26
其他	15,514,289.14
合 计	3,106,567,248.69

48、现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

项 目	2010 年 1-6 月
1、将净利润调节为经营活动的现金流量	
净利润	1,442,520,757.85
加：计提的资产减值准备	-
固定资产折旧	84,736,490.15
无形资产摊销	11,073,568.69
长期待摊费用摊销	38,964,821.41
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-147,646.93
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	110,862,731.90
财务费用（收益以“-”号填列）	-
投资损失（收益以“-”号填列）	-126,558,439.12
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	166,134,016.53
递延所得税负债的增加(减少以“-”号填列)	-35,608,682.63
存货的减少(增加以“-”号填列)	-
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-5,839,091,183.75
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	-8,927,979,288.44
其他	-59,938.79
经营活动产生的现金流量净额	-13,075,152,793.13
2、不涉及现金收支的投资和筹资活动	
债务转为资本	
一年内到期的可转换公司债券	
融资租入固定资产	
3、现金及现金等价物净增加情况	
现金的期末余额	76,784,766,184.68
减：现金的期初余额	70,743,834,531.23
加：现金等价物的期末余额	7,902,629,172.07
减：现金等价物的期初余额	14,413,843,187.41
现金及现金等价物净增加额	-470,282,361.89

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	2010 年 1-6 月
一、现金	76,784,766,184.68
其中：库存现金	2,409,236.57
可随时用于支付的银行存款	76,660,553,798.45
可随时用于支付的其他货币资金	121,803,149.66
可用于支付的存放中央银行款项	
存放同业款项	
拆放同业款项	
二、现金等价物	7,902,629,172.07
其中：三个月内到期的债券投资	
三、现金及现金等价物余额	84,687,395,356.75
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物	

六、关联方关系及其交易

1、关联方的认定标准

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响的，构成关联方。

2、关联方

(1) 存在控制关系的关联方

单位：人民币万元

关联方名称	组织机构代码	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	与本公司关系	持本公司股权比例或本公司持股比例	享有表决权比例
华泰联合证券	27943491-3	深圳	马昭明	金融	100,000	子公司	97.70%	97.70%
长城伟业	100022258	广州	吴建党	金融	30,000	子公司	60.00%	60.00%
华泰（香港）公司	37387817-00 0-11-07-7	香港	张海波	金融	5,045	子公司	100.00%	100.00%
华泰紫金公司	67982047-7	南京	张海波	股权投资	20,000	子公司	100.00%	100.00%

(2) 不存在控制关系的关联方

①本公司的联营企业有关信息披露格式如下：

单位：人民币万元

被投资单位名称	组织机构代码	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	本公司持股比例	本公司在被投资单位表决权比例	期末资产总额	期末负债总额	期末净资产总额	本年营业收入总额	本期净利润
南方基金管理有限公司	279533137	深圳	吴万善	基金管理	15000	45%	45%	255373.07	90675.35	164697.72	80577.19	23746.23
华泰柏瑞基金管理有限公司	71785177-7	上海	齐亮	基金管理	20000	49%	49%	41415.27	4891.33	36523.94	12995.51	3917.92

②其他关联方

持有本公司 5% 以上的股东及本公司持有 5% 以上股份的公司

关联方名称	与本公司关系	组织机构代码
江苏省国信资产管理集团有限公司	持有本公司股份 24.42%， 第一大股东	73572480-0
江苏交通控股有限公司	持有本公司股份 8.50%	13476706-3
江苏汇鸿国际集团有限公司	持有本公司股份 7.85%	13479189-9
江苏高科技投资集团有限公司	持有本公司股份 7.61%	13475957-3
国华能源投资有限公司	持有本公司股份 6.52%	71092159-2
江苏省丝绸集团有限公司	持有本公司股份 6.10%	13477712-2
江苏省国际信托投资有限公司	公司第一大股东的子公司	13478047-9
江苏省国信创业投资公司	公司第一大股东的子公司	71407548-5
江苏省投资管理有限责任公司	公司第一大股东的子公司	13479781-x
江苏银行股份有限公司	公司持有其股份 7.03%	79654459-8

3、关联方交易

(1) 收取的手续费及佣金收入

单位：人民币万元

关联方名称	2010 年 1-6 月
南方基金管理有限公司	631.28
华泰柏瑞基金管理有限公司	581.30
江苏省国信资产管理集团有限公司	0.06
江苏汇鸿国际集团有限公司	2.85
江苏高科技投资集团有限公司	0.60
江苏省丝绸集团有限公司	0.12

(2) 收取的利息收入

单位：人民币万元

关联方	2010 年 1-6 月
江苏银行股份有限公司	33.23

(3) 向公司关联方定向发行次级债券及支付利息

单位：人民币万元

关联方名称	面额	支付利息 2010 年 1-6 月
江苏省国信资产管理集团有限公司	31,084.27	1,287.41
江苏交通控股有限公司	10,762.33	445.74
江苏汇鸿国际集团有限公司	9,990.79	413.79
江苏高科技投资集团有限公司	9,684.16	401.09

关联方名称	面额	支付利息 2010 年 1-6 月
江苏省丝绸集团有限公司	7,759.62	321.38
江苏银行股份有限公司	100,000.00	4,141.67
合 计	169,281.17	7011.08
占公司全部同类交易的金额比例	84.65%	84.65%

注：公司向关联方定向发行的次级债券已于 2010 年 6 月全部归还。

(4) 支付的房租

单位：人民币万元

关联方名称	2010 年 1-6 月
江苏省国信资产管理集团有限公司	127.80
合 计	127.80

4、关联方往来

(1) 代买卖证券款余额

单位：人民币万元

关联方名称	期末余额
南方基金管理有限公司	3.95
华泰柏瑞基金管理有限公司	150.36
江苏省国信资产管理集团有限公司	602.65
江苏交通控股有限公司	0.34
江苏汇鸿国际集团有限公司	100.79
江苏高科技投资集团有限公司	32.00
江苏省丝绸集团有限公司	78.36
江苏银行股份有限公司	197.93

(2) 持有关联方发行的基金

单位：人民币万元

关联方名称	期末余额		
	基金名称	持有份额（万份）	持有成本
华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰柏瑞量化	1,199.92	1,199.90

(3) 关联方往来款项余额

单位：人民币万元

关联方名称	款项性质	期末余额
江苏省国信资产管理集团有限公司	预付房租款	93.60
江苏银行股份有限公司	存款	204,082.54

5、为关联方担保

公司向招商银行南京分行申请并开立金额为港币 2 亿元的备用信用证，为华泰金融控股（香港）

有限公司向永隆银行申请额度为港币 8,000.00 万元的贷款提供保证, 实际使用贷款港币 6000.00 万元, 授信到期日为 2010 年 9 月 25 日。

七、或有事项

截至报告日止, 公司未决诉讼情况如下:

1、2007 年第二和第三季度, 黄冈住房公积金管理中心及其黄州办事处、麻城办事处、武穴办事处、红安办事处先后向黄冈市中级人民法院起诉中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、本公司及本公司黄冈营业部, 要求返还合计金额 53742851.4 元的国债。经公司调查并经专业律师机构查证, 原告主张的国债系被亚洲证券有限责任公司挪用, 与公司无关。亚洲证券挪用国债的事实已经亚洲证券清算组聘请的中审会计师事务所有限公司《关于亚洲证券有限责任公司国债、企业债专项清查报告》(中审审字【2005】第 5156-10-3) 确认; 本案起诉前的 2005 年 6 至 8 月, 原告已分别就诉讼所涉及国债向亚洲证券清算组申报了债权; 上海市第二中级人民法院于 2007 年 5 月依法受理了亚洲证券破产还债一案后, 原告又于 2007 年 7 月亦即其起诉公司等后, 再次向亚洲证券破产管理人申报了债权。上述事实已充分证明原告的国债系亚洲证券挪用, 且原告已明知。

2005 年 4 月, 公司按照中国证监会的要求托管亚洲证券经纪业务及其所属营业部, 根据证监会《关于委托华泰证券有限责任公司托管亚洲证券有限责任公司经纪业务及所属证券营业部的决定》明确规定: 华泰证券不承担亚洲证券的债权债务; 根据证监会《关于证券公司风险处置过程中现场工作组、清算组、托管组职责分工的通知》的规定, 管理亚洲证券和处置亚洲证券资产属于亚洲证券清算组的职责。

2009 年 3 月, 上述红安办事处向法院申请撤诉并获准。

2、2008 年 6 月, 公司子公司华泰联合证券以四通集团公司利用本公司营业部实施融资侵害本公司资产为由, 向北京市高级人民法院提起诉讼, 请求法院根据四通集团公司 2004 年 3 月出具的《承诺函》中有关承担经济损失赔偿责任的承诺, 判令其向本公司支付欠款总额人民币 23775.36 万元人民币、利息人民币 2187.72 万元, 合计标的人民币约 2.6 亿元。本案于 2009 年 12 月由北京市高级人民法院判决四通集团公司扣减债务 8486.5867 万元, 最终需偿还本金 17553.3893 万元及相应利息。该案已于 2010 年 3 月向法院申请执行。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

3、公司子公司华泰联合公司因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用营业部资金共 3,720 余万元, 以及因其与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从本公司扣划现金 1,738 万元, 拒不履行偿债义务为由, 于 2003 年 12 月 5 日向深圳市中级人民法院提起诉讼, 要求判令中国华诚集团财务有限责任公司偿还占用资金 3,720 余万元, 华诚投资管理有限公司对其承担连带责任; 判令华诚投资管理有限公司补足因被法院强制执行划款导致的对我公司出资不足 1,738 万元。法院立案后, 由于最高人民法院下文通知各地法院停止受理、审理、执行对华诚投资管理有限公司及所属公司的诉讼案件, 导致该案中止审理。深圳市中级人民法院于 2010 年 3 月恢复审理此案并于 2010 年 4 月一审判决本公司胜诉, 要求华诚投资管理有限公司和中国华诚集团财务有限责任公司连带支付本公司 54584314.02 元并承担相应诉讼费 28 万余元。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

4、2008 年 11 月 18 日, 公司子公司华泰联合公司以中国长城计算机集团公司不履行与本公司之

间的合同义务，拖欠本公司款项为由，向深圳市罗湖区法院起诉，请求法院处置变卖其所持本公司的 900 万股股权，将所得款项用于抵偿其对本公司的所欠债务。现法院已立案。于 2009 年 2 月进行了第一次开庭审理，并由法院追加长城财务公司作为第三人。该案目前处于中止审理阶段。截止 2010 年 6 月末华泰联合证券已对上述款项计提了全额坏账准备。

八、承诺事项

截止报告日，公司无承诺事项。

九、资产负债表日后非调整事项

无资产负债表日后非调整事项。

十、其他重要事项

(如无特别注明，以下货币单位均为人民币元)

1、以公允价值计量的资产和负债：

项目	2009 年 12 月 31 日	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	2010 年 6 月 30 日
金融资产					
1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	6,159,889,492.29	-115,293,938.68			8,373,108,513.29
2.衍生金融资产					
3.可供出售金融资产	1,259,217,288.77		-57,757,679.16		3,137,270,982.09
金融资产小计	7,419,106,781.06	-115,293,938.68	-57,757,679.16		11,510,379,495.38
投资性房地产					
上述合计	7,419,106,781.06				11,510,379,495.38
金融负债					

2、外币金融资产和外币金融负债

项目	2009 年 12 月 31 日	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	2010 年 6 月 30 日
金融资产					
1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	875,637.36	-94,889.00			-
2.衍生金融资产					
3.贷款和应收款	27,435,051.84				123,086,229.98
4.可供出售金融资产					
5.持有至到期投资					
金融资产小计	28,310,689.20	-94,889.00			123,086,229.98
金融负债					

3、2010 年 6 月经中国证监会证监许可字[2010]855 号文批复同意，长城伟业期货有限公司注

册资本增加 30,000.00 万元，其中本公司于 7 月出资 18,000.00 万元，公司出资比例为 60%。

4、2010 年 7 月长城伟业期货有限公司宣告发放 2009 年度红利 4,800.00 万元，公司出资 60%，收到红利 2,880.00 万元。

十一、母公司财务报表主要项目注释

1、长期投资

(1) 分类情况

项 目	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	金额	减值准备	金额	减值准备
按成本法核算的长期股权投资	2,934,713,213.14	6,138,722.66	2,234,713,213.14	6,138,722.66
按权益法核算的长期股权投资	926,315,487.98	-	1,057,605,338.40	-
合 计	3,861,028,701.12	6,138,722.66	3,292,318,551.54	6,138,722.66

(2)按成本法核算的长期股权投资主要单位列示

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日
江苏银行股份有限公司	7.03%	600,000,000.00	700,000,000.00	-	1,300,000,000.00
长城伟业期货有限公司	60%	186,598,085.65	-	-	186,598,085.65
华泰金融控股（香港）有限公司	100%	50,445,000.00	-	-	50,445,000.00
华泰联合证券有限责任公司	97.70%	1,188,874,404.83	-	-	1,188,874,404.83
华泰紫金投资有限责任公司	100%	200,000,000.00	-	-	200,000,000.00
其他法人股投资		8,795,722.66	-	-	8,795,722.66
合 计		2,234,713,213.14	700,000,000.00	-	2,934,713,213.14

(3)按权益法核算的长期股权投资

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	2009 年 12 月 31 日	本期权益增减额	本期红利	本期转让	2010 年 6 月 30 日
南方基金管理有限公司	45.00%	886,741,463.93	57,499,092.58	202,500,000.00	-	741,740,556.51
华泰柏瑞基金公司	49.00%	170,863,874.47	13,711,057.00	-	-	184,574,931.47
合 计		1,057,605,338.40	71,210,149.58	202,500,000.00	-	926,315,487.98

(4) 长期股权投资减值准备

被投资单位名称	2009 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2010 年 6 月 30 日	计提原因
盐城商业大厦股份有限公司	2,455,530.00			2,455,530.00	对方净资产为负数
天津农药股份有限公司	2,295,000.00			2,295,000.00	对方净资产为负数
天津津泰橡胶股份有限公司	687,600.00			687,600.00	对方净资产为负数
其他投资	700,592.66			700,592.66	信泰并入、南京新百公司
合 计	6,138,722.66			6,138,722.66	

2、其他资产

项 目	2010 年 6 月 30 日	2009 年 12 月 31 日
应收款项 [A]	189,335,942.92	93,914,038.91
其他流动资产	4,398,068.15	6,125,709.01
在建工程	32,203,372.98	17,210,626.68
应收股利 [B]	202,500,000.00	
长期待摊费用	141,807,190.62	177,858,445.34
合 计	570,244,574.67	295,108,819.94

[A] 应收款项

(1) 分类情况

类 别	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	金额	比例	金额	比例
1 年以内	132,772,957.22	0.54583213	40,462,484.03	27.37%
1 - 2 年	6,830,659.41	2.81%	1,329,392.93	0.90%
2 - 3 年	1,171,577.80	0.48%	25,740,655.89	17.41%
3 年以上	102,473,507.83	42.13%	80,295,052.91	54.32%
应收款项小计	243,248,702.26	100.00%	147,827,585.76	100.00%
减：应收款项坏账准备	53,912,759.34	-	53,913,546.85	-
合 计	189,335,942.92	-	93,914,038.91	-

(2) 应收款项中，金额较大的单位欠款情况如下

单 位 名 称	金 额	款 项 性 质
华泰联合证券有限公司	76,152,673.79	待收交换营业部差额款
亚洲清算组	63,530,884.33	待弥补资金缺口
应收存出保证金	16,668,143.65	往来款
交通银行	12,000,000.00	承销佣金
五星高能	5,580,000.00	代垫付的企业债券兑付款
合 计	173,931,701.77	

[B] 应收股利系联营企业南方基金已宣告尚未发放的红利。

3、手续费及佣金净收入

项 目	2010 年 1-6 月
手续费及佣金收入	2,374,917,959.52
— 证券承销业务	283,874,178.95
— 证券经纪业务	1,980,986,476.62
— 受托客户资产管理业务	53,563,503.16
— 开放式基金分仓及代销收入	56,493,800.79
— 期货公司收入	-
手续费及佣金支出	465,292,246.69
— 证券经纪业务手续费支出	458,833,656.01
— 其他	6,458,590.68
手续费及佣金净收入	1,909,625,712.83

4、投资净收益

项 目	2010 年 1-6 月
联营企业和合营企业的投资收益	126,055,869.15
出售交易性金融资产的投资收益	-139,887,993.46
交易性金融负债形成的投资收益	-
出售可供出售金融资产的投资收益	-95,852,392.24
出售持有至到期金融资产的投资收益	-
交易性金融资产持有期间取得的收益	92,308,403.25
可供出售金融资产持有期间取得的收益	
持有至到期投资持有期间取得的收益	
其 他[注]	-2,896.34
合 计	-17,379,009.64

5、现金流量表补充资料

项 目	2010 年 1-6 月
1、将净利润调节为经营活动的现金流量	
净利润	900,102,982.19
加：计提的资产减值准备	-
固定资产折旧	61,999,667.95
无形资产摊销	7,517,346.42
长期待摊费用摊销	24,849,715.65
处置固定资产、无形资产和其他长期资产损失（收益以“-”号填列）	-
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	172,165,101.41
财务费用（收益以“-”号填列）	-
投资损失（收益以“-”号填列）	-126,055,869.15
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	166,134,016.53
递延所得税负债的增加(减少以“-”号填列)	-35,608,682.63
存货的减少(增加以“-”号填列)	-
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-5,525,720,111.44
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	-3,356,914,713.96
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	-7,711,530,547.03
2、不涉及现金收支的投资和筹资活动	
债务转为资本	-
一年内到期的可转换公司债券	-
融资租入固定资产	
3、现金及现金等价物净增加情况	-
现金的期末余额	53,983,172,510.73
减：现金的期初余额	45,044,299,706.56
加：现金等价物的期末余额	9,686,601,029.30
减：现金等价物的期初余额	13,652,691,591.21
现金及现金等价物净增加额	4,972,782,242.26

十二、补充资料

1、当期非经常性损益明细表

非经常性损益明细项目	2010 年 1-6 月
非流动资产处置损益	312,997.12
除上述各项之外的其他营业外收支净额	-1,752,872.83
减：所得税费用影响	-338,487.34
非经常性损益合计	-1,101,388.37
其中：归属于母公司的非经常性损益	-1,047,669.57
归属于少数股东的非经常性损益	-53,718.80

2、受托资产管理业务

(1) 截止 2010 年 6 月 30 日，公司所管理的受托资产管理计划情况如下：

计划名称	成立时间	资产市值(元)	计划份额(份)	计划单位净值(元)
集合资产管理计划				
华泰紫金 1 号[注 1]	2005 年 12 月 6 日	432,309,919.01	381,951,602.75	1.1318
华泰紫金 2 号[注 1]	2006 年 8 月 7 日	1,175,956,830.49	1,148,281,641.04	1.0241
华泰紫金 3 号	2007 年 3 月 6 日	1,149,862,770.24	1,105,049,204.51	1.0406
华泰紫金鼎步步为盈子计划	2008 年 10 月 21 日	456,328,494.64	421,110,016.10	1.0836
华泰紫金鼎造福桑梓子计划	2008 年 10 月 21 日	311,595,620.74	302,128,727.66	1.0313
华泰紫金鼎锦上添花子计划	2009 年 3 月 19 日	346,332,386.67	363,363,306.50	0.9531
华泰紫金优债精选	2009 年 5 月 12 日	962,688,378.65	945,794,304.00	1.0179
华泰紫金现金管家	2009 年 8 月 25 日	1,089,667,739.33	1,072,717,513.86	1.0158
	2010 年 02 月 09 日	259,734,334.29	281,764,507.49	0.9218
合 计		6,184,476,474.06	6,022,160,823.91	
定向资产管理业务[注 2]		171,377,801.73		

[注 1]公司在其管理的华泰紫金 1 号及 2 号成立时分别持有 22,893,412.29 份及 100,000,000.00 份，并承诺在管理期间不赎回。

[注 2]定向资产管理业务系公司为特定客户提供的专项资产管理业务。

华泰证券股份有限公司

2010年8月6日