

华泰证券股份有限公司

601688

2011 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	6
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、本报告经公司第二届董事会第五次会议、第二届监事会第三次会议审议通过。董事会会议应到董事17人，实到董事12人，徐祖坚、潘剑秋、王树华三位董事和陈瑛明、白维两位独立董事未亲自出席会议，其中：徐祖坚、王树华两位董事书面委托陆建萍董事代为行使表决权，潘剑秋董事书面委托吴万善董事代为行使表决权，陈瑛明独立董事书面委托范从来独立董事代为行使表决权，白维独立董事书面委托陈传明独立董事代为行使表决权。

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：025-83290511、83290788、84457777

传真：025-84579938

电子信箱：jiangjian@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2704室

(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
	2011年6月30日	2010年12月31日	本报告期比上年度期末增减(%)
总资产	92,407,758,346.68	113,462,823,522.12	-18.56
归属于母公司股东权益	33,139,586,845.84	32,881,802,815.08	0.78
归属于母公司股东的每股净资产	5.92	5.87	0.78
项目	2011年1-6月	2010年1-6月	本报告期比上年同期增减(%)
营业利润	1,532,925,517.71	1,779,724,940.54	-13.87
利润总额	1,530,519,123.45	1,778,285,064.83	-13.93
归属于母公司股东的净利润	1,143,575,101.57	1,420,347,648.47	-19.49
扣除非经常性损益后归属于母公司的净利润	1,145,384,089.46	1,421,395,318.04	-19.42

基本每股收益	0.20	0.27	-23.26
扣除非经常性损益后基本每股收益	0.20	0.27	-23.21
稀释每股收益	0.20	0.27	-23.26
加权平均净资产收益率(%)	3.42	5.71	减少 2.29 个百分点
经营活动产生的现金流量净额	-24,435,109,182.86	-13,075,152,793.13	86.88
每股经营活动产生的现金流量净额	-4.36	-2.33	86.88

非经常性损益项目表

非经常性损益项目	2011年1-6月	2010年1-6月	说明
非流动资产处置损益	-238,848.96	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	-2,167,545.30	-1,752,872.83	主要系地方基金、捐赠及税费返还
减：所得税费用影响	-615,885.16	-338,487.34	
归属于少数股东的非经常性损益	18,478.79	-53,718.80	
归属于母公司的非经常性损益	-1,808,987.89	-1,047,669.57	

三、股本变动及股东情况

(一) 公司股份变动情况表：

2011年2月28日，公司986,963,946股有限售条件流通股份在上海证券交易所上市流通，公司的股份结构相应发生变动，见下表：

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	其他	小计	数量	比例(%)
一、有限售条件股份	4,815,438,725	85.99		-986,963,946	-986,963,946	3,828,474,779	68.37
1、国家持股							
2、国有法人持股	4,210,438,234	75.19		-529,629,593	-529,629,593	3,680,808,641	65.73
3、其他内资持股	605,000,491	10.80		-457,334,353	-457,334,353	147,666,138	2.64
其中：							
境内非国有法人持股	605,000,491	10.80		-457,334,353	-457,334,353	147,666,138	2.64
境内自然人持股							
4、外资持股							
其中：							
境外法人持股							
境外自然人持股							
二、无限售条件股份	784,561,275	14.01		986,963,946	986,963,946	1,771,525,221	31.63
1、人民币普通股	784,561,275	14.01		986,963,946	986,963,946	1,771,525,221	31.63
2、境内上市的外资股							
3、境外上市的外资股							
4、其他							
三、股份总数	5,600,000,000	100		0	0	5,600,000,000	100

(二) 主要股东持股情况介绍

1、报告期末股东总数：142777 户。

2、截至 2011 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	0	1367687495	0
江苏交通控股有限公司	国有法人	8.4968	475819370	0	475819370	0
江苏汇鸿国际集团有限公司	国有法人	7.8498	439588150	0	439588150	0
江苏高科技投资集团有限公司	国有法人	7.6089	426096799	0	426096799	0
国华能源投资有限公司	国有法人	6.5187	365048543	0	0	0
江苏省丝绸集团有限公司	国有法人	6.0968	341418259	0	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	0	146149146
上海星聚投资管理有限公司	境内非国有法人	2.5676	143786827	0	143786827	143780000
江苏苏豪国际集团股份有限公司	国有法人	2.3473	131447067	0	131447067	0
金城集团有限公司	国有法人	1.9452	108929397	-2213704	0	0

注 1：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。

注 2：近期经江苏省政府同意，并经江苏省工商行政管理局核准，“江苏省丝绸集团有限公司”更名为“江苏省苏豪控股集团有限公司”，其注册资本从 26369 万元人民币变更为 200000 万元人民币，其出资人仍为江苏省人民政府。2011 年 7 月 6 日，江苏省苏豪控股集团有限公司已在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成了更名手续。

3、截至 2011 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
国华能源投资有限公司	365048543	人民币普通股
江苏宏图高科技股份有限公司	147618708	人民币普通股
金城集团有限公司	108929397	人民币普通股
海澜集团有限公司	91424000	人民币普通股
中国平安人寿保险股份有限公司（见附注）	60080066	人民币普通股
江苏三房巷集团有限公司	45356980	人民币普通股
江苏华西村股份有限公司	45345980	人民币普通股
上海浦东发展银行—长信金利趋势股票型证券投资基金	31629663	人民币普通股
贵州赤天化集团有限责任公司	18557157	人民币普通股
中国工商银行—上证 50 交易型开放式指数证券投资基金	15633028	人民币普通股

注：

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—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、10846671 股、9846671 股和 9846671 股。

4、截至 2011 年 6 月 30 日，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	江苏省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	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
6	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
7	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
8	全国社会保障基金理事会转持三户	67,088,681	2012年7月30日	4,431,531	自持股之日起锁定36个月
			2013年2月26日	62,657,150	自上市之日起锁定36个月
9	江苏开元国际集团轻工工业品进出口股份有限公司	53,568,528	2013年2月26日	53,568,528	自上市之日起锁定36个月
10	江苏舜天国际集团有限公司	51,925,531	2013年2月26日	51,925,531	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

报告期内，公司董事、监事、高级管理人员没有持有公司股份，也未被授予过期权和限制性股票。

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

报告期末,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。在 2011 年证券公司分类监管评级中,公司被评为 A 类 AA 级。

1、报告期内公司总体经营情况

2011 年上半年,我国宏观经济延续了去年三、四季度的温和调整态势,于今年一季度呈现阶段性上扬之后自二季度开始下调。在连续紧缩的货币政策、房地产调控和通胀居高不下的背景下,上证综指和深证成指分别下跌 1.64%和 2.79%。两市股基交易量较去年同期有所增长,直接融资总额较去年同期小幅增长,经纪业务佣金率延续下降趋势,证券公司经纪业务盈利能力受一定影响,但其他主业,特别是自有资金投资快速增长,推动收入增长,行业整体收入较去年同期略增,但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,持续推进转型发展战略,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。

截至 2011 年 6 月 30 日,按合并口径,公司总资产 9,240,775.83 万元,较年初减少 18.56%。2011 年 1—6 月,公司营业收入 339,483.93 万元,较上年同期减少 5.40%;利润总额 153,051.91 万元,较上年同期减少 13.93%;归属于母公司所有者的净利润 114,357.51 万元,较上年同期减少 19.49%。报告期内,公司经营业绩同比下降的主要原因为:经纪业务佣金下滑,投资银行业务承销项目数量、规模较上年同期有所减少,联营企业业绩下滑等。

2、公司主营业务及其经营情况

分行业	营业收入 (万元)	营业支出 (万元)	营业利 润率(%)	营业收入同 比增长(%)	营业支出同 比增长(%)	营业利润率同比增 减 (%)
证券经纪业务	230,011.91	104,754.58	54.46	-10.48	-3.95	减少 3.09 个百分点
投资银行业务	57,868.65	24,771.91	57.19	-18.53	-12.92	减少 2.76 个百分点
证券投资业务	9,810.45	6,503.51	33.71	162.52	38.52	增加 166.23 个百分点
资产管理业务	4,176.43	2,036.41	51.24	-21.96	-17.33	减少 2.73 个百分点

(1) 证券经纪业务

报告期内，证券市场行情先扬后抑，根据沪、深交易所统计数据，两市股基交易量50.06万亿元，较上年同期增长8.7%，但行业平均佣金率延续下降趋势，证券公司经纪业务盈利能力受到一定影响。

报告期内，公司经纪业务按合并口径实现营业收入23.00亿元，同比下降10.48%；营业利润率54.46%，同比减少3.09个百分点。

报告期内，公司经纪业务持续推进转型发展战略，围绕理财服务转型和管理转型强化建设、深化工作。公司以紫金理财服务体系为基础，开展投资顾问业务，全面实行“同类客户、同等服务、同等收费”的业务运营模式，为客户提供专业的一对一顾问服务；结合公司涨乐移动理财的服务优势，全面开展“涨乐宝”营销活动，积极探索战略合作形势下的“大营销”策略；大力推动理财产品销售业务，建立配套的服务支持体系，满足客户多元化理财需求；夯实过程化管理基础，建设常态化跟踪管理的全面绩效评估体系；加快网点建设，优化网点布局，进一步提高经纪业务营销网络覆盖范围及区域竞争力；深入推进精确化管理，探索突出理财服务职能的营业网点建设体系。

报告期内，市场融资融券业务持续快速发展，公司抢抓业务发展机遇，通过稳步有序扩大试点营业部范围、准确锁定目标客户群体、加快开立信用账户等多项措施，积极组织开展融资融券业务推广工作。截至报告期末，公司融资融券余额21.59亿元，占市场融资融券总余额的7.88%。

报告期内，公司期货中间介绍业务按业务规划处于开展有序、发展稳步的良好状态。截至报告期末，公司已有50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、安徽、河南、河北、陕西、

辽宁、黑龙江、内蒙古、宁夏、吉林等14个省市自治区。IB业务处于起步阶段，对公司整体业绩影响不大。公司控股子公司华泰联合证券已有25家证券营业部可开展期货中间介绍业务，业务覆盖广东、广西、四川、湖南、湖北、江西、福建、重庆等8个省市自治区。

合并数据

2011年1—6月			2010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	24,726.96	50.24	A股	23,778.85	52.71
基金	214.82	31.98	基金	634.20	80.98
B股	86.28	51.05	B股	79.55	46.19
权证	391.89	76.72	权证	1,619.86	88.19
债券	61.16	11.47	债券	36.33	7.17
合计	25,481.11	49.86	合计	26,148.79	54.01

母公司数据

2011年1—6月			2010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	17,482.90	35.52	A股	16,679.34	36.97
基金	152.23	22.67	基金	376.92	48.13
B股	60.84	36.00	B股	52.57	30.52
权证	295.81	57.91	权证	1,121.22	61.04
债券	49.03	9.20	债券	29.14	5.75
合计	18,040.81	35.30	合计	18,259.19	37.72

(2) 投资银行业务

报告期内，受二级市场表现低迷的影响，A股市场融资总额与上年同期相比略有下降。其中，新股发行速度基本维持在平稳态势，但由于二季度新股出现大面积破发，一级市场发行市盈率下降，上市公司首发融资额也快速下降。据WIND资讯统计，截至报告期末，A股市场股票融资总额2,971亿元，较上年同期下降6.95%。其中，新股募集资金1,607.75亿元，较上年同期下降24.45%。在持续紧缩的货币政策下，银行补充资本金的诉求强烈，金融债券和次级债券的发行量增长幅度较快。中央企业等高资质发行主体债券发行规模有所减少，地方企业债券逐渐占据企业债券的主导地位。

报告期内，公司投资银行业务按合并口径实现营业收入5.79亿元，同比下降18.53%；营业利润率57.19%，同比减少2.76个百分点。

报告期内，面对跌宕起伏的市场，公司（含华泰联合证券）抢抓市场机

遇，积极推动项目进程，主承销共完成 11 个 IPO 项目，主承销金额 81.58 亿元；主承销 1 个债券发行项目，主承销金额 5 亿元。其中，母公司主承销完成 6 个 IPO 项目，主承销金额 46.89 亿元。

合并数据

承销方式	承销类别	承销次数（次）		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	11	110	815,817.00	6,381,408.00	52,532.58	259,157.38
	增发新股	0	23	0	3,984,301.00	0	39,374.00
	配股	0	30	0	1,002,136.78	0	19,236.96
	可转债	0	8	0	300,800.00	0	11,172.00
	债券发行	1	123	50,000.00	3,417,901.48	1,000.00	37,994.17
	小计	12	294	865,817.00	15,086,547.26	53,532.58	366,934.51
副主承销	新股发行	2	28	4,029.00	243,556.30	706.00	1,065.01
	增发新股	0	3	0	55,903.50	0	169.00
	配股	0	12	0	244,241.00	0	1,811.00
	可转债	0	3	0	13,284.00	0	12.00
	债券发行	0	45	0	362,575.00	0	1,083.72
	小计	2	91	4,029.00	919,559.80	706.00	4,140.73
分销	新股发行	0	160	0	1,875,638.51	0	1,278.42
	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	0	8	0	145,936.00	0	87.54
	债券发行	124	586	3,156,000.00	9,752,462.68	3,022.00	9,731.23
	小计	124	812	3,156,000.00	12,292,341.46	3,022.00	12,218.13

母公司数据

承销方式	承销类别	承销次数（次）		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	56	468,855.00	3,060,253.52	32,539.58	103,183.68
	增发新股	0	5	0	2,798,382.00	0	14,030.00
	配股	0	7	0	375,228.32	0	3,935.27
	可转债	0	2	0	72,000.00	0	2,300.00
	债券发行	0	108	0	2,739,901.48	0	24,231.67
	小计	6	178	468,855.00	9,045,765.32	32,539.58	147,680.62
副主承销	新股发行	2	22	4,029.00	160,655.30	706.00	954.01
	增发新股	0	1	0	37,975.50	0	5.00
	配股	0	7	0	215,438.00	0	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	2	58	4,029.00	640,943.80	706.00	2,906.23
分销	新股发行	0	102	0	1,072,621.51	0	678.42
	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	0	3	0	67,500.00	0	36.54
	债券发行	77	433	934,000.00	5,095,962.68	922.00	4,599.23
	小计	77	574	934,000.00	6,515,226.46	922.00	5,414.13

(3) 证券投资业务

报告期内，我国经济增速逐步放缓，全国工业利润增速下降，股市整体处于震荡整理区间，不断收紧的流动性和市场的扩容使二级市场资金供给处于紧张局面。受国内外经济发展环境的复杂性、不稳定性和不确定性因素的影响，沪深 300 指数下跌 2.69%，振幅达 18.1%。因存款准备金率上调和加息等因素影响，债券市场资金面趋紧，债券收益率曲线整体呈上行走势。

报告期内，公司证券投资业务按合并口径实现营业收入 9,810.45 万元，同比增长 162.52%；营业利润率 38.52%，同比增加 166.23 个百分点。

报告期内，公司权益类证券投资业务以追求风险可控下的合理收益为目标，加强趋势研判和价值分析，以挖掘业绩增长确定性高、估值有相对优势的投资品种为主要投资思路，重点投资于商贸、金融、化工等行业。在数量化投资方面，公司建立了较为完善的数量化投资体系，形成了数量化选股和指数化投资的业务模式，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进行仓位控制。在股指期货业务方面，公司根据自营业务仓位情况继续向中金所申请获取股指期货套期保值额度，并根据市场趋势变化，进行股指期货套保交易，充分利用股指期货对冲系统性风险，获取了稳定的投资收益。固定收益类证券投资业务重点投资中短期信用债品种，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，并适当关注可转债的投资机会。

合并数据

单位：元

项目	2011 年 1—6 月	2010 年 1—6 月
证券投资收益	108,904,512.80	-58,154,212.17
其中：出售交易性金融资产收益	-225,154,740.62	-65,186,621.32
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	-166,246,627.93	-85,273,097.76
金融资产持有期间收益	281,773,617.40	92,308,403.25
衍生金融工具的投资收益	218,532,263.95	-2,896.34
公允价值变动损益	-10,800,032.17	-110,862,731.90
其中：交易性金融资产	19,000,647.83	-114,870,971.90
交易性金融负债	-	-
衍生金融工具	-29,800,680.00	4,008,240.00
合计	98,104,480.63	-169,016,944.07

母公司数据

单位：元

项目	2011 年 1—6 月	2010 年 1—6 月
证券投资收益	33,907,263.34	-143,434,878.79
其中：出售交易性金融资产收益	-280,506,676.89	-139,887,993.46
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	-166,760,038.33	-95,852,392.24
金融资产持有期间收益	262,641,714.61	92,308,403.25
衍生金融工具的投资收益	218,532,263.95	-2,896.34
公允价值变动损益	-13,853,044.08	-172,165,101.41
其中：交易性金融资产	15,947,635.92	-176,173,341.41
交易性金融负债	-	-
衍生金融工具	-29,800,680.00	4,008,240.00
合计	20,054,219.26	-315,599,980.20

(4) 资产管理业务

报告期内，更多的券商进入资产管理业务领域，产品推出数量增多，资产管理业务竞争日趋激烈。

报告期内，公司资产管理业务按合并口径实现营业收入 4,176.43 万元，同比下降 21.96%；营业利润 51.24%，同比减少 2.73 个百分点。

报告期内，公司推进投资研究体系改革，推进产品创新，进一步丰富产品类型和投资手段，完成首只 QDII 产品华泰紫金龙-大中华集合计划的首发推广和公告成立工作，首发募集资金 1.92 亿元，完成华泰紫金新兴产业集合计划的首发推广和公告成立工作，首发募集资金 10.06 亿元，限额特定产品华泰紫金套金宝集合计划获得中国证监会设立批复，定向资产管理业务稳步发展。截至报告期末，公司合计管理的集合计划数量达到 13 只，合计管理份额 63.66 亿份，合计管理资产规模 64.27 亿元。

项目	2011 年 1—6 月		2010 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	64.27	4,067.93	61.84	5,308.07
定向资产管理业务	2.60	108.50	1.76	43.51

注：定向资产管理业务 2010 年 1-6 月包括华泰证券和华泰联合证券的数据；2011 年 1-6 月包括华泰证券和华泰金融控股（香港）有限公司的数据（华泰联合证券该项数据为零）。

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：万元

资产负债表项目	2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日	增减	主要原因
结算备付金	454,698.03	2,512,836.03	-81.90%	在登记公司缴存的客户结算资金减少
买入返售金融资产	113,417.27	25,121.02	351.48%	期末买入返售证券增加
应收利息	3,786.04	1,990.91	90.17%	定期存款利息增加
可供出售金融资产	236,064.84	519,075.69	-54.52%	可供出售金融资产中股票投资大幅减少

其他资产	345,424.45	196,554.80	75.74%	融出资金增加以及在建工程投入增加
交易性金融负债	9,668.55	-	0.00%	系买断式回购业务形成的交易性金融负债
卖出回购金融资产款	584,573.30	250,877.45	133.01%	本期卖出回购金融资产规模增加
代理承销证券款	3,727.12	25,565.00	-85.42%	期末尚未结算的代理承销证券款减少
应付利息	240.72	56.17	328.55%	本期增加应付卖出回购利息
递延所得税负债	3,680.89	6,188.44	-40.52%	公司可供出售金融资产公允价值减少导致应纳税暂时性差异确认的递延所得税负债减少
利润表项目	2011年1—6月	2010年1—6月	增减	主要原因
投资净收益	19,249.37	6,790.17	183.49%	主要系股指期货收益增加
公允价值变动净收益	-1,080.00	-11,086.27	-90.26%	公司部分交易性金融资产处置导致公允价值转回
营业外支出	821.34	627.24	30.94%	公司本期捐赠支出较前期增加
少数股东损益	1,164.92	2,217.31	-47.46%	子公司净利润减少导致少数股东损益减少
其他综合收益	-4,645.33	-21,331.39	-78.22%	金融资产公允价值增加

4、公司营业收入、营业利润的分地区情况

(1) 营业收入地区分部情况

地区	2011年1—6月		2010年1—6月		增减百分比
	营业部数量 (家)	营业收入 (元)	营业部数量 (家)	营业收入 (元)	
江苏	68	747,540,819.92	66	887,795,329.06	-15.80%
湖北	28	132,248,630.79	28	181,219,065.30	-27.02%
广东	31	219,592,436.07	28	252,741,139.69	-13.12%
上海	15	120,706,096.40	15	156,549,442.15	-22.90%
北京	8	78,084,692.18	8	104,133,885.25	-25.02%
四川	9	70,816,534.26	8	82,926,572.35	-14.60%
辽宁	8	41,601,937.84	7	51,974,565.21	-19.96%
黑龙江	6	26,083,897.00	6	39,005,340.13	-33.13%
山东	7	29,723,964.06	6	38,846,573.71	-23.48%
天津	5	37,016,748.26	5	46,873,498.43	-21.03%
浙江	7	31,912,929.55	5	41,262,568.24	-22.66%
河南	4	29,533,339.19	4	38,646,806.83	-23.58%
湖南	5	34,389,966.36	4	40,658,608.14	-15.42%
江西	3	15,508,116.29	3	21,175,439.25	-26.76%
广西	3	19,612,403.01	3	26,636,463.11	-26.37%
福建	3	18,147,622.74	3	26,311,861.03	-31.03%
吉林	2	16,687,094.03	2	21,529,752.65	-22.49%
河北	2	11,424,493.65	2	16,149,823.70	-29.26%
陕西	2	14,149,062.79	2	17,375,239.29	-18.57%
安徽	3	9,267,881.04	2	11,701,990.48	-20.80%
海南	2	9,748,934.79	2	12,738,878.91	-23.47%
宁夏	1	9,258,960.37	1	10,749,201.21	-13.86%
重庆	1	6,886,782.12	1	7,603,945.27	-9.43%
内蒙	1	6,724,125.78	1	8,167,473.19	-17.67%
甘肃	1	797,624.28	1	197,830.88	303.18%
山西	1	1,189,826.55	1	688,452.35	72.83%
贵州	2	1,450,476.50	1	826,573.52	75.48%
云南	2	1,575,614.55	1	1,022,996.79	54.02%
营业部小计	230	1,741,681,010.37	216	2,145,509,316.12	-18.82%
香港地区	1	27,133,338.51	1	9,090,169.29	198.49%
总部		1,626,024,955.74		1,434,081,083.56	13.38%
合计		3,394,839,304.62		3,588,680,568.97	-5.40%

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。

(2) 营业利润地区分部情况

地区	2011 年 1—6 月		2010 年 1—6 月		增减百分比
	营业部数量 (家)	营业利润 (元)	营业部数量 (家)	营业利润 (元)	
江苏	68	426,754,413.43	66	549,268,719.38	-22.30%
湖北	28	66,581,653.28	28	102,368,335.86	-34.96%
广东	31	94,693,683.60	28	129,767,135.02	-27.03%
上海	15	38,848,786.17	15	64,201,125.33	-39.49%
北京	8	33,408,614.12	8	52,476,542.81	-36.34%
四川	9	40,698,296.37	8	47,290,117.97	-13.94%
辽宁	8	13,513,741.76	7	22,352,962.52	-39.54%
黑龙江	6	10,481,601.04	6	22,291,853.90	-52.98%
山东	7	14,589,691.05	6	21,511,061.31	-32.18%
天津	5	15,601,652.33	5	26,182,884.86	-40.41%
浙江	7	8,422,421.97	5	18,411,954.93	-54.26%
河南	4	9,717,954.03	4	16,846,621.28	-42.32%
湖南	5	15,063,737.51	4	22,413,650.47	-32.79%
江西	3	6,876,133.36	3	11,417,349.37	-39.77%
广西	3	10,101,932.36	3	10,946,258.74	-7.71%
福建	3	6,288,145.16	3	12,183,357.14	-48.39%
吉林	2	6,357,369.96	2	10,382,016.69	-38.77%
河北	2	5,397,508.81	2	9,092,495.63	-40.64%
陕西	2	7,052,330.86	2	9,149,902.10	-22.92%
安徽	3	2,198,476.00	2	4,306,052.02	-48.94%
海南	2	3,672,319.06	2	6,324,180.02	-41.93%
宁夏	1	4,748,367.26	1	6,222,069.47	-23.69%
重庆	1	3,495,043.65	1	4,006,294.55	-12.76%
内蒙	1	3,809,356.25	1	5,469,854.85	-30.36%
甘肃	1	-1,422,531.72	1	-2,487,764.38	-42.82%
山西	1	-662,595.67	1	-1,220,979.82	-45.73%
贵州	2	-1,320,552.64	1	264,212.73	-599.81%
云南	2	-2,275,930.13	1	342,159.78	-765.17%
营业部小计	230	842,691,619.23	216	1,181,780,424.53	-28.69%
香港地区	1	9,849,978.43	1	1,053,546.46	834.94%
总部		680,383,920.05		596,890,969.55	13.99%
合计		1,532,925,517.71		1,779,724,940.54	-13.87%

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。

5、主要控股公司及参股公司经营情况及业绩分析

(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，华泰证券持有 98% 的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 1,877,613.50 万元，净资产 426,383.34 万元，2011 年 1-6 月营业收入 103,494.81 万元，利润总额 36,119.89 万元，净利润 25,935.56 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) 华泰长城期货有限公司，注册资本 6 亿元人民币，报告期末，华泰证券持有 60%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 626,765.95 万元，净资产 71,003.45 万元，2011 年 1-6 月营业收入 12,131.68 万元，利润总额 2,409.88 万元，净利润 1,615.53 万元（已经审计）。

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 3 亿港元，报告期末，华泰证券持有 100%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 74,890.19 万港元，净资产 30,299.18 万港元，2011 年 1-6 月营业收入 3,436.14 万港元，利润总额 975.67 万港元，净利润 975.67 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 5 亿元人民币，报告期末，华泰证券持有 100%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 55,835.93 万元，净资产 54,272.66 万元，2011 年 1-6 月营业收入 855.07 万元，净利润 434.66 万元（未经审计）。

主营业务为：股权投资，股权投资的财务顾问服务；将闲置资本金投资于依法公开发行的国债、投资级公司债、货币市场基金、央行票据等风险较低、流动性较强的证券，以及证券公司经批准设立的集合资产管理计划、专项资产管理计划。

(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，华泰证券持有 45%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 283,977.84 万元，净资产 188,761.97 万元，2011 年 1-6 月营业收入 85,295.26 万元，利润总额 25,465.83 万元，净利润 20,171.22 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，华泰证券持有 49%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 44,808.51 万

元，净资产 39,719.62 万元，2011 年 1-6 月营业收入 13,078.36 万元，利润总额 3,185.41 万元，净利润 2,513.92 万元(未经审计)。

主营业务：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务（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，华泰证券持有 7.03%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 47,036,289.43 万元，净资产 2,562,544.90 万元，2011 年 1-6 月营业收入 1,515,781.40 万元，利润总额 389,617.26 万元，净利润 291,795.14 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、承销短期融资券；买卖政府债券、金融债券、企业债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务、代客理财、代理销售基金、代理销售贵金属、代理收付和保管集合资金信托计划；提供保险箱业务；办理委托存贷款业务；从事银行卡业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；结售汇、代理远期结售汇；国际结算；自营及代客外汇买卖；同业外汇拆借；买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；资信调查、咨询、见证业务；网上银行；经银行业监督管理机构和有关部门批准的其他业务。

（8）华泰金控投资咨询（深圳）有限公司，注册资本 1,000 万港元，报告期末，华泰金融控股（香港）有限公司持有 100%的股权。截至 2011 年 6 月 30 日，公司总资产 680.71 万元人民币，净资产 678.79 万元人民币。2011 年 1-6 月，营业收入-1.72 万元人民币，利润总额-164.19 万元人民币，净利润-164.19 万元人民币（未经审计）。

主营业务：项目投资信息咨询、企业管理咨询、经济信息咨询、市场营销策划等。

6、公司在经营中出现的问题及应对措施

报告期内，公司经营中存在的问题主要表现为：在激烈的行业竞争下，经纪业务佣金率下滑的状况依然存在，投资者日益多元化的理财需求也对公司提出了新的要求；公司上市后，资本规模扩大，整体盈利能力与资本规模不相适应，公司盈利能力有待进一步提高。

针对上述问题，公司主要采取了以下措施：

公司加快理财转型，以客户需求为中心，对公司理财体系进行全面梳理，构建基于专业化投资能力的人员、知识及支持配套体系，积极提升理财服务能力，同时公司大力开展多元化业务品种，强化紫金理财产品销售，为客户提供多样化的产品及业务选择。公司努力提高传统业务能力，大力拓展创新业务，在壮大传统业务规模的基础上，着力筹备和拓展各项创新业务，丰富盈利模式，为公司培育新的盈利增长点，提升公司整体盈利能力，实现上市公司规模经济效应。

（二）报告期内投资情况

1、募集资金使用情况

报告期内，公司未募集资金，公司实际使用以前期间募集的资金 14.09 亿元（含募集资金利息 3,817.45 万元），募集资金具体使用情况如下：

项目	投资金额（万元）	投入时间
投资金浦产业投资基金管理有限公司	900	2011年3月31日
投资上海金融发展投资基金	30,000	2011年4月25日
补充营运资金	110,000	自2011年1月至6月共2次
合计	140,900	

截至报告期末，公司累计使用募集资金 155.994 亿元（含募集资金利息 3,817.45 万元），公司首发募集资金本金已全部使用完毕，公司募集资金存储专户结余资金余额 7,932 万元，均为募集资金利息。

报告期内，公司严格执行《募集资金管理制度》、与保荐人及开户银行签订的三方监管协议和相关证券监管法规等，规范募集资金管理，未发生违反相关规定及协议的情况。公司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，未发生变更募集资金用途的情况。

公司募集资金主要用于增加公司主要业务的营运资金、增加创新业务投入资金和补充子公司资本金。其中，大部分资金无法单独计算投资收益，部分可以单独计算投资收益的项目因投入时间较短，相关投资收益的产生需要一个过程，对公司收入的贡献度还未有明显体现。

2、非募集资金投资项目情况

无。

六、重要事项

(一) 报告期实施的利润分配方案执行情况

公司 2010 年度股东大会审议通过公司 2010 年度利润分配方案：本次利润分配以 2010 年末总股本 5,600,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 1.5 元（含税），共计分配现金红利 840,000,000 元，剩余未分配利润全部结转以后年度分配。

公司于 2011 年 6 月 15 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）上发布了利润分配实施公告，股权登记日为 2011 年 6 月 20 日，除息日为 2011 年 6 月 21 日，现金红利发放日为 2011 年 6 月 27 日。

2011 年半年度公司未拟定利润分配预案、公积金转增股本预案。

(二) 报告期内现金分红政策的执行情况

公司 2010 年度的现金分红已于 2011 年 6 月 27 日执行完毕。

(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

(1) 2011 年 5 月，本公司收到上海市浦东新区人民法院开庭通知，上海钰霖投资咨询有限公司起诉我公司下属上海陆家嘴东路证券营业部，要求营业部支付服务费 4056149 元。经查，该纠纷起因于上海钰霖投资咨询有限公司不具备从事证券服务的资质，本公司营业部根据相关法律法规及监管机

关的规定，终止了与其签订的服务协议，上海钰霖投资咨询有限公司遂诉诸法院。该纠纷尚在审理过程中。

2、公司以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项

(1) 2010 年 6 月，世纪证券有限责任公司以于 1995 年与本公司建立期货交易委托代理关系、向本公司交付了交易保证金为由，向南京市中级人民法院起诉，要求本公司返还所欠其期货交易保证金余额计人民币 5021800 元及相关利息共计 5157099 元。该纠纷尚在审理过程中。

3、控股子公司华泰联合证券有限责任公司报告期内发生的重大诉讼、仲裁事项

(1) 因北京华资银团集团一直未按协议履行对公司的还款义务，公司子公司华泰联合证券于 2011 年 1 月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计 3457.89 万元，2011 年 2 月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付欠款 2430 万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011 年 6 月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判，该案目前正在执行中。

4、控股子公司华泰联合证券有限责任公司以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项

(1) 与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案

华泰联合证券公司原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用公司资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出 (2001) 深中法经一初第 315 号民事判决书和 (2002) 深中法经一初第 430 号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还公司 7,345 万元及其利息和 9,940 万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。对于另一案，公司于 2008 年 6 月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向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。该案于 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，该案目前正在执行中。

(2) 与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限公司债权债务纠纷案

因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用公司营业部资金共 3,720 余万元，以及因它与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从公司三家营业部及华泰联合证券公司本部扣划现金共 1,738 万元，中国华诚集团财务有限责任公司拒不履行偿债义务，华泰联合证券公司于 2003 年 12 月向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司承担连带清偿责任。立案后，由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、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，该案一直处于中止审理阶段。2009 年 5 月，法院裁定华诚投资管理有限公司进入破产清算程序，华泰联合证券公司已于 2009 年 8 月向破产清算组申报债权本息 12598 万元，但由于债权未经法院判决，债权待确认。2010 年 3 月深圳中级人民法院恢复审理，一审判决结果支持公司全部诉讼请求，要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司连带支付公司 5458.4 万元，并承担诉讼费 28.2 万元，公司已就上述债权和诉讼费向华诚投资管理有限公司破产清算组申报破产债权。

(3) 与中国长城计算机集团公司债权债务纠纷案

中国长城计算机集团公司不履行与公司之间的合同义务，2008 年 11 月，华泰联合证券公司向深圳市罗湖区法院起诉，请求法院处置变卖其所持公司的 900 万股股权（经 2005 年缩股后变更为 270 万股），将所得款项用于抵偿其对公司的所欠债务。2009 年 2 月该案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。该案已于 2009 年 7 月开庭审理完毕，2009 年 8 月，法院裁定中止审理。中止审理期间，双方至今一直就相关事宜进行协商。

(4) 与北京北大方正集团公司债权债务纠纷案

北京北大方正集团公司不履行与公司之间的合同义务，华泰联合证券公司于 2008 年 11 月向深圳市罗湖区法院起诉，请求法院处置变卖其所持公司的 900 万股股权（经 2005 年缩股后变更为 270 万股），将所得款项用于抵偿其对公司的所欠债务。法院立案后，主持双方达成和解，并出具民事调解书确认对方对公司的全部债务。该案目前正在执行中。

(5) 与广州珠江实业集团有限公司债权债务纠纷案

广州珠江实业集团有限公司拖欠公司 1500 万元欠款，华泰联合证券公司于 2008 年 12 月向广州市越秀区人民法院起诉，请求法院判令其偿还公司所欠款项。法院立案后，主持双方达成和解，并出具民事调解书确认对方对公司的全部债务。该案目前正在执行中。

上述 5 起纠纷案均为 2004 年以前发生的历史遗留事项，华泰联合证券公司已于以前年度全额计提了坏账准备。

(6) 与北京东阳影视实力文化传播有限公司资产管理纠纷案

2010 年 11 月，华泰联合证券公司原定向资产管理业务客户北京东阳实力影视文化传播有限公司起诉公司，要求公司赔偿其资产管理账户亏损、返还业绩报酬并支付律师费成本，共计 600.2 万元。该案已由中国国际经济贸易仲裁委员会受理，并与 2011 年 5 月开庭完毕，待裁决中。鉴于目前无法确定该案判决结果，可能承担的义务也无法可靠计量，因此未在会计上做“预计负债”处理。

(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	初始投资金额(元)	持有数量	期末账面价值(元)	占期末证券总投资比例	报告期损益(元)
1	可转债	113002	工行转债	363,083,836.06	3,147,090	373,874,292.00	15.34%	-12,552,798.94
2	股票	600773	西藏城投	127,216,519.41	5,728,067	135,182,381.20	5.55%	7,965,861.79
3	可转债	110015	石化转债	122,537,618.93	1,188,420	128,337,475.80	5.26%	5,799,856.87

华泰证券股份有限公司 2011 年半年度报告

4	股票	600496	精工钢构	88,912,905.36	7,477,412	94,140,617.08	3.86%	7,887,908.79
5	股票	002477	雏鹰农牧	65,843,195.66	2,321,556	74,243,360.88	3.05%	8,400,165.22
6	可转债	113001	中行转债	63,266,539.90	580,270	61,293,920.10	2.51%	-2,588,004.20
7	股票	002526	山东矿机	66,441,116.52	2,578,829	56,992,120.90	2.34%	-9,448,995.62
8	股票	600597	光明乳业	68,991,514.95	6,959,975	55,192,601.75	2.26%	-13,818,547.57
9	股票	600063	皖维高新	55,400,450.06	4,652,353	54,665,147.75	2.24%	-735,302.31
10	股票	002273	水晶光电	55,629,229.73	1,456,926	52,230,797.10	2.14%	-16,432,821.25
期末持有的其他证券投资				1,393,144,838.83		1,351,609,155.15	53.71%	55,332,686.58
报告期已出售证券投资损益								-158,393,217.81
合计				2,470,467,765.41		2,437,761,869.71	100%	-128,583,208.45

2、持有其他上市公司股权情况

序号	证券代码	证券简称	初始投资金额(元)	占该公司股权比例	期末账面值(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
1	002024	苏宁电器	239,031,790.96	0.27%	237,735,986.25	0.00	-2,955,087.67	可供出售金融资产	购买
2	000725	京东方A	176,090,359.67	0.50%	185,854,092.06	1,046.16	9,763,732.39		购买
3	601318	中国平安	159,608,193.93	0.04%	144,810,000.00	-25,303,836.08	-2,091,086.78		购买
4	002206	海利得	130,200,000.00	2.35%	132,405,000.00	0.00	2,205,000.00		非公开增发
5	600087	长航油运	140,750,000.00	1.33%	130,950,000.00	0.00	-9,800,000.00		非公开增发
6	600739	辽宁成大	139,283,519.83	0.47%	119,904,096.60	0.00	-19,379,423.23		购买
7	600682	南京新百	114,811,540.18	3.01%	113,376,091.40	789,801.42	-1,435,448.78		购买
8	000869	张裕A	100,968,117.79	0.21%	109,577,005.20	655,614.34	7,235,245.72		购买
9	600660	福耀玻璃	101,284,745.82	0.43%	89,509,167.16	6,510,277.21	-9,100,775.17		购买
10	000786	北新建材	64,813,849.90	0.79%	72,138,326.50	2,469,733.33	6,337,303.91		购买
其他			520,782,163.16		556,336,929.33	-152,386,199.88	-13,844,399.62		
合计			1,887,624,281.24		1,892,596,694.50	-167,263,563.50	-33064939.23		

3、持有非上市金融企业股权情况

单位：人民币元

持有对象名称	初始投资成本	持股比例	期末账面值	报告期损益	报告期所有者权益变动	会计核算科目	股份来源
华泰联合证券有限责任公司	1,198,691,904.83	98%	1,198,691,904.83	254,168,507.17	—	长期股权投资	出资购入
华泰长城期货有限公司	366,598,085.65	60%	366,598,085.65	9,693,203.51	—	长期股权投资	出资购入
南方基金管理有限公司	152,791,751.36	45%	865,488,630.92	64,199,075.32	43,577,563.99	长期股权投资	出资购入
华泰柏瑞基金管理有限公司	101,838,099.60	49%	198,749,402.26	11,823,422.30	-4,027,929.40	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	—	—	长期股权投资	出资购入
合计	3,119,919,841.44		3,929,528,023.66	339,884,208.3	39,549,634.59		

注：①金融企业包括证券公司、商业银行、保险公司、期货公司、信托公司等；

②期末账面价值应当扣除已计提的减值准备；

③报告期损益指：该项投资对公司本报告期合并净利润的影响。

(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	房屋租赁支出	市场原则	98.28	0.98
江苏银行股份有限公司	参股股东	存款利息收入	市场原则	353.24	0.52
南方基金管理有限公司	联营公司	席位分仓佣金收入	市价原则	524.27	5.94
华泰柏瑞基金管理有限公司	联营公司	席位分仓佣金收入	市价原则	190.26	2.15
合计				1,166.05	

2、关联债权债务往来

单位:人民币万元

关联方	向关联方提供资金		关联方向公司提供资金	
	发生额	余额	发生额	余额
南方基金管理有限公司	524.27	0		
华泰柏瑞基金管理有限公司	190.26	0		
江苏省国信资产管理集团有限公司			320.09	320.09
合计	714.53	0	320.09	320.09

3、其他重大关联交易

无。

(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

本报告期公司无重大担保事项。

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

2010 年 7 月 30 日，公司与中国江苏国际经济技术合作公司签订了《华泰证券广场施工总承包合同》。报告期内该合同正常履行，截至报告期末，已完成华泰证券广场工程桩基施工、部分土方挖运及部分水平支撑的施工。报告期内，公司已按约支付总承包合同价款 808.59 万元。截至报告期末，公司已按约累计支付总承包合同价款 12382.43 万元。

(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 2011 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。公司已向上海证券交易所申请该部分股权于 2011 年 2 月 28 日起可上市流通。

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。

2、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。

3、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、报告期内证券营业部新设、迁址等变化情况

(1) 华泰证券情况

分公司新设	营业部新设	营业部迁址	分公司迁址
0	2	11	3

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马鞍山营业部	安徽省马鞍山市花山区珍珠园二村 10 栋 5-6 号	证监许可 [2010]1805 号	2010 年 12 月 13 日	2011 年 6 月 24 日
2	华泰证券股份有限公司临沂证券营业部	山东省临沂市罗庄区罗庄街道办事处罗六路中段西侧	证监许可 [2010]1805 号	2010 年 12 月 13 日	2011 年 6 月 24 日

注：经中国证监会 2010 年 12 月 13 日“证监许可[2010]1805 号”文批准，同意华泰证券股份有限公司在安徽省马鞍山市花山区、山东省临沂市罗庄区各设立 1 家营业部，2011 年 6 月 24 日获得证券经营许可证。

营业部迁址情况

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	更换许可证日期
1	华泰证券股份有限公司石家庄中华北大街证券营业部	河北省石家庄市中华北大街 50 号军创国际大厦 1 层、19 层	冀证监发 [2010]200 号	2010 年 9 月 27 日	2011 年 1 月 13 日
2	华泰证券股份有限公司北京农展南路证券营业部	北京市朝阳区农展馆南路 13 号瑞辰国际中心 F1-6、F1-7、F2-1 室	京证机构发 [2010]199 号	2010 年 11 月 18 日	2011 年 2 月 9 日
3	华泰证券股份有限公司哈尔滨民益街证券营业部	黑龙江省哈尔滨市南岗区民益街 76 号网通大厦 3 楼	黑证监许可字 [2010]60 号	2010 年 11 月 15 日	2011 年 2 月 16 日
4	华泰证券股份有限公司北京广渠门内大街证券营业部	北京市崇文区广渠门内大街 43 号雍贵中心 C 座 1-2 层	京证机构发 [2010]158 号	2010 年 9 月 16 日	2011 年 2 月 17 日
5	华泰证券股份有限公司南京广州路证券营业部	江苏省南京市广州路 177 号 5 楼	苏证监机构字 [2010]563 号	2010 年 12 月 14 日	2011 年 3 月 7 日
6	华泰证券股份有限公司泰州迎春西路证券营业部	江苏省泰州市海陵区迎春西路 71 号	苏证监机构字 [2010]462 号	2010 年 10 月 26 日	2011 年 3 月 21 日
7	华泰证券股份有限公司南京汉中门大街证券营业部	江苏省南京市汉中门大街 81 号	苏证监机构字 [2011]21 号	2010 年 1 月 17 日	2011 年 3 月 7 日
8	华泰证券股份有限公司张家港金港镇长江中路证券营业部	江苏省张家港市金港镇长江中路 251 号	苏证监机构字 [2011]42 号	2011 年 1 月 24 日	2011 年 6 月 7 日
9	华泰证券股份有限公司哈尔滨宣化街证券营业部	黑龙江省哈尔滨市南岗区宣化街 239 号傲城国际	黑证监许可字 [2011]1 号	2011 年 1 月 20 日	2011 年 4 月 13 日
10	华泰证券股份有限公司镇江长江路证券营业部	江苏省镇江市长江路 11 号	苏证监机构字 [2011]85 号	2011 年 2 月 22 日	2011 年 4 月 13 日
11	华泰证券股份有限公司溧阳南大街证券营业部	江苏省溧阳市南大街 91 号	苏证监机构字 [2011]248 号	2011 年 5 月 25 日	期后办理

注：1、经河北证监局 2010 年 9 月 27 日“冀证监发[2010]200 号”文批准，华泰证券股份有限公司石家庄中山西路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司石家庄中华北大街证券营业部”，地址为河北省石家庄市中华北大街 50 号军创国际大厦 1 层、19 层，2011 年 1 月 13 日获得证券经营许可证。

2、经北京证监局 2010 年 11 月 18 日“京证机构发[2010]199 号”文批准，华泰证券股份有限公司北京北三环东路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司北京农展南路证券营业部”，地址为北京市朝阳区农展馆南路 13 号瑞辰国际中心 F1-6、F1-7、F2-1 室，2011 年 2 月 9 日获得证券经营许可证。

3、经黑龙江证监局 2010 年 11 月 15 日“黑证监许可字[2010]60 号”文批准，华泰证券股份有限公司哈尔滨铁路街证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司哈尔滨民益街证券营业

部”，地址为黑龙江省哈尔滨市南岗区民益街 76 号网通大厦 3 楼，2011 年 2 月 16 日获得证券经营许可证。

4、经北京证监局 2010 年 9 月 16 日“京证机构发[2010]158 号”文批准，华泰证券股份有限公司北京莲花池东路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司北京广渠门内大街证券营业部”，地址为北京市崇文区广渠门内大街 43 号雍贵中心 C 座 1-2 层，2011 年 2 月 17 日获得证券经营许可证。

5、经江苏证监局 2010 年 12 月 14 日“苏证监机构字[2010]563 号”文批准，华泰证券股份有限公司南京北京西路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司南京广州路证券营业部”，地址为江苏省南京市广州路 177 号 5 楼，2011 年 3 月 7 日获得证券经营许可证。

6、经江苏证监局 2010 年 10 月 26 日“苏证监机构字[2010]462 号”文批准，华泰证券股份有限公司泰州迎春西路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址为江苏省泰州市海陵区迎春西路 71 号，2011 年 3 月 21 日获得证券经营许可证。

7、经江苏证监局 2011 年 1 月 17 日“苏证监机构字[2011]21 号”文批准，华泰证券股份有限公司南京大桥南路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司南京汉中门大街路证券营业部”，地址为江苏省南京市汉中门大街 81 号，2011 年 3 月 7 日获得证券经营许可证。

8、经江苏证监局 2011 年 1 月 24 日“苏证监机构字[2011]42 号”文批准，华泰证券股份有限公司张家港金港镇长江中路证券营业部同城迁址开业，地址为江苏省张家港市金港镇长江中路 251 号，2011 年 6 月 7 日获得证券经营许可证。

9、经黑龙江证监局 2011 年 1 月 20 日“黑证监许可字[2011]1 号”文批准，华泰证券股份有限公司哈尔滨大成街证券营业部同城迁址开业，地址为黑龙江省哈尔滨市南岗区宣化街 239 号傲城国际，2011 年 4 月 13 日获得证券经营许可证。

10、经江苏证监局 2011 年 2 月 22 日“苏证监机构字[2011]85 号”文批准，华泰证券股份有限公司镇江中山东路证券营业部同城迁址开业，地址为江苏省镇江市长江路 11 号，2011 年 4 月 13 日获得证券经营许可证。

11、经江苏证监局 2011 年 5 月 25 日“苏证监机构字[2011]248 号”文批准，华泰证券股份有限公司常州北大街证券营业部同辖区迁址开业，地址为江苏省溧阳市南大街 91 号，证券经营许可证更换期后办理完毕。

分公司迁址情况

序号	分公司	地址	批复文号	批复日期	更换许可证日期
1	苏州分公司	江苏省苏州市新市路 102 号	苏证监机构字[2010]582 号	2010 年 12 月 22 日	2011 年 3 月 7 日
2	黑龙江分公司	黑龙江省哈尔滨市南岗区宣化街 239 号傲城国际 B 栋三层	黑证监许可字[2011]2 号	2011 年 1 月 20 日	2011 年 3 月 14 日
3	辽宁分公司	辽宁省沈阳市和平区青年大街 320 号（群楼 201）	辽证监许可[2011]8 号	2011 年 3 月 10 日	2011 年 6 月 15 日

1、经江苏证监局 2010 年 12 月 22 日“苏证监机构字[2010]582 号”文批准，华泰证券股份有限公司苏州分公司同城迁址开业，地址为江苏省苏州市新市路 102 号，2011 年 3 月 7 日获得证券经营许可证。

2、经黑龙江证监局 2011 年 1 月 20 日“黑证监许可字[2011]2 号”文批准，华泰证券股份有限公司黑龙江分公司同城迁址开业，地址为黑龙江省哈尔滨市南岗区宣化街 239 号傲城国际 B 栋三层，2011 年 3 月 14 日获得证券经营许可证。

3、经辽宁证监局 2011 年 3 月 10 日“辽证监许可[2011]8 号”文批准，华泰证券股份有限公司辽宁分公司同城迁址开业，地址为辽宁省沈阳市和平区青年大街 320 号（群楼 201），2011 年 6 月 15 日获得证券经营许可证。

(2) 华泰联合证券有限责任公司情况

分公司新设	营业部新设	营业部迁址	分公司迁址
0	5	5	0

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	华泰联合证券有限责任公司重庆红锦大道证券营业部	重庆渝北区红锦大道 559 号 3-2-1	证监许可 [2011]120 号	2011 年 1 月 20 日	期后办理
2	华泰联合证券有限责任公司漳州九龙大道证券营业部	漳州市龙文区九龙大道浦东大厦第九层南侧 (906-912 号)	证监许可 [2011]120 号	2011 年 1 月 20 日	期后办理
3	华泰联合证券有限责任公司广州花都迎宾大道证券营业部	广州花都区新华街迎宾大道 66 号正盛商务大厦 B 座 2 楼 09 房	证监许可 [2011]120 号	2011 年 1 月 20 日	期后办理
4	华泰联合证券有限责任公司佛山顺德新桂中路证券营业部	佛山市顺德区大良府又新桂路明日广场一座 1901 办公室	证监许可 [2011]120 号	2011 年 1 月 20 日	期后办理
5	华泰联合证券有限责任公司汕头长平东路证券营业部	汕头市龙湖区金碧庄东区 1-4 幢 201 铺面 (新城市广场 2 楼 B 区 202)	证监许可 [2011]120 号	2011 年 1 月 20 日	期后办理

注：经中国证监会 2011 年 1 月 24 日下发的“证监许可[2011]120 号”文批准，同意华泰联合证券有限责任公司在广东广州花都区、汕头龙湖区、佛山顺德区、福建漳州龙文区、重庆两江新区各设立 1 家营业部，证券经营许可证期后办理。

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	华泰联合证券有限责任公司大悟西岳大道证券营业部	湖北省大悟县西岳大道	鄂证监机构字 [2011]28 号	2011 年 3 月 31 日	2011 年 5 月 19 日
2	华泰联合证券有限责任公司武穴永宁大道证券营业部	湖北省武穴市永宁大道东 55 号	鄂证局机构字 [2011]29 号	2011 年 3 月 31 日	2011 年 5 月 19 日
3	华泰联合证券有限责任公司应城东大街证券营业部	湖北省应城市东大街 13 号	鄂证局机构字 [2011]27 号	2011 年 3 月 31 日	2011 年 5 月 19 日
4	华泰联合证券有限责任公司广州东风西路证券营业部	广州市东风西路 233 号千树盘福大厦 7 楼	广东证监函 [2011]322 号	2011 年 4 月 14 日	2011 年 6 月 13 日
5	华泰联合证券有限责任公司成都蜀金路证券营业部	成都市青羊区蜀金路 1 号金沙万瑞中心 C 座 3、4 楼	川证监机构 [2011]20 号	2011 年 4 月 26 日	2011 年 6 月 13 日

注：1、经湖北证监局 2011 年 3 月 31 日“鄂证监机构字[2011]28 号”文批准，华泰联合证券有限责任公司大悟城中北路证券营业部新址开业，更名为“华泰联合证券有限责任公司大悟西岳大道证券营业部”，地址为湖北省大悟县西岳大道，2011 年 5 月 19 日获得证券经营许可证。

2、经湖北证监局 2011 年 3 月 31 日“鄂证监机构字[2011]29 号”文批准，华泰联合证券有限责任公司武穴民主路证券营业部新址开业，更名为“华泰联合证券有限责任公司武穴永宁大道证券营业部”，地址为湖北省武穴市永宁大道东 55 号，2011 年 5 月 19 日获得证券经营许可证。

3、经湖北证监局 2011 年 3 月 31 日“鄂证监机构字[2011]27 号”文批准，华泰联合证券有限责任公司应城蒲阳大道证券营业部新址开业，更名为“华泰联合证券有限责任公司应城东大街证券营业部”，地址为湖北省应城市东大街 13 号，2011 年 5 月 19 日获得证券经营许可证。

4、经广东证监局 2011 年 4 月 14 日“广东证监函[2011]322 号”文批准，华泰联合证券有限责任公司广州荔湾路证券营业部新址开业，更名为“华泰联合证券有限责任公司东风西路证券营业部”，地址为广州市东风西路 233 号千树盘福大厦 7 楼，2011 年 6 月 13 日获得证券经营许可证。

5、经四川证监局 2011 年 4 月 26 日“川证监机构[2011]20 号”文批准，华泰联合证券有限责任公司成都浣花北路证券营业部新址开业，更名为“华泰联合证券有限责任公司成都蜀金路证券营业部”，

2、报告期内，公司控股子公司华泰紫金投资有限责任公司完成“注册资本”、“经营范围”及“住所”的工商登记变更。“注册资本”由 2 亿元人民币增加至 5 亿元人民币；“经营范围”由“股权投资”变更为“股权投资；股权投资的财务顾问服务；将闲置资本金投资于依法公开发行的国债、投资级公司债、货币市场基金、央行票据等风险较低、流动性较强的证券；以及证券公司经批准设立的集合资产管理计划、专项资产管理计划”。“住所”由“南京市汉中路 180 号 19 层”变更为“南京市中山东路 90 号 2706 室”。

3、报告期内，公司控股子公司华泰长城期货有限公司原总经理袁小文女士辞职，华泰长城期货有限公司聘任李杰先生为总经理。

4、根据中国证监会《关于同意华泰证券股份有限公司对华泰金融控股(香港)有限公司进行增资的复函》(机构部部函[2010]551 号)和公司 2009 年第一次临时股东大会审议通过的《关于华泰证券股份有限公司首次公开发行人民币普通股(A 股)股票募集资金投资项目的议案》，公司对全资子公司华泰金融控股(香港)有限公司增资 10 亿港元，并分阶段实施，首先出资 2.5 亿港元将其注册资本由 5000 万港元增至 3 亿港元。报告期内，该增资事项已获香港特别行政区公司注册处核准，并已报香港证监会备案。

(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：

事项	刊载的报刊名称及版面	刊载日期	刊载的互联网网站及检索路径
华泰证券关于增资华泰紫金投资有限责任公司的公告	中国证券报 B009、上海证券报 B19、证券日报 A4、证券时报 A12	2011-01-06	上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年 12 月份经营情况主要财务信息		2011-01-13	上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)
华泰证券关于增资华泰金融控股(香港)有限公司的公告	中国证券报 A24、上海证券报 24、证券日报 E8、证券时报 B016	2011-01-15	上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)
华泰证券关于华泰联合证券新设 5 家证券营业部	中国证券报 B004、上海证券报 25、证券日报 A4、证券时报 B005	2011-02-12	上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)

获批的公告			
华泰证券 2011 年 1 月份经营情况主要财务信息		2011-02-12	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券有限售条件流通股上市流通提示性公告	中国证券报 B004、上海证券报 B30、证券日报 F3、证券时报 D012	2011-02-22	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年 2 月份经营情况主要财务信息		2011-03-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年 3 月份经营情况主要财务信息		2011-04-13	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券年报		2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券年报摘要	中国证券报 B069\B070 上海证券报 17\18\19\20、证券日报 C5\C6\C7、证券时报 B45\B46\B47	2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第一季度季报	中国证券报 B069、上海证券报 17、证券日报 C8、证券时报 B45	2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第二届董事会第二次会议决议公告	中国证券报 B071、上海证券报 17、证券日报 C9、证券时报 B47	2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第二届监事会第二次会议决议公告	中国证券报 B071、上海证券报 18、证券日报 C9、证券时报 B47	2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度控股股东及其他关联方资金占用情况的专项说明		2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度社会责任报告		2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券内部控制审核报告		2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券关于召开 2010 年度股东大会的通知	中国证券报 B071、上海证券报 18、证券日报 C8、证券时报 B47	2011-04-16	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券关于投资上海金融发展投资基金并参与金浦产业投资基金管理有限公司增资的公告	中国证券报 B004、上海证券报 136、证券日报 C10、证券时报 B5	2011-04-23	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券关于获准设立华泰紫金新兴产业集合资产管理计划的公告	中国证券报 B004、上海证券报 136、证券日报 C10、证券时报 B5	2011-04-23	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第二届董事会第三次会议决议公告	中国证券报 B004、上海证券报 136、证券日报 C10、证券时报 B5	2011-04-23	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度股东大会会议资料		2011-04-29	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年 4 月份经营情况主要财务信息		2011-05-10	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度股东大会的法律意见书		2011-05-11	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度股东大会决议公告	中国证券报 B008、上海证券报 B25、证券日报 E3、证券时报 D25	2011-05-11	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券董事会秘书工作细则		2011-05-14	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第二届董事会第四次会议决议公告	中国证券报 B012、上海证券报 24、证券日报 B3、证券时报 B020	2011-05-14	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年 5 月份经营情况主要财务信息		2011-06-09	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2010 年度利润分配实施公告	中国证券报 B004、上海证券报 B16、证券日报 E4、证券时报 D012	2011-06-15	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券关于股东江苏省丝绸集团有限公司更名的提示性公告	中国证券报 B005、上海证券报 B24、证券日报 E11、证券时报 D16	2011-07-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)

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:

二〇一一年八月六日

合并资产负债表（未经审计）

2011 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	合并		母公司	
	2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日	2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日
资产:				
货币资金	54,619,768,021.97	59,464,526,447.88	37,820,424,106.98	41,196,494,791.95
其中: 客户资金存款	43,772,867,371.73	48,488,098,229.14	29,884,648,483.33	33,421,723,415.64
结算备付金	4,546,980,345.36	25,128,360,266.58	3,882,292,664.41	20,384,685,838.37
其中: 客户备付金	4,071,961,106.84	24,145,978,623.13	3,424,001,468.72	19,722,272,656.64
拆出资金	-	-	-	-
交易性金融资产	17,829,297,813.42	13,916,093,453.66	15,185,230,093.51	12,098,808,228.77
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,134,172,688.07	251,210,172.60	9,900,000.00	-
应收利息	37,860,403.68	19,909,087.76	26,707,941.68	3,922,488.00
存出保证金	3,794,807,315.45	3,135,591,448.28	163,954,351.66	268,264,171.01
可供出售金融资产	2,360,648,383.41	5,190,756,894.78	2,237,682,635.41	5,027,279,637.31
持有至到期投资	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
长期股权投资	2,793,311,105.38	2,503,738,973.17	5,006,030,023.66	4,716,457,891.45
投资性房地产	94,494,685.24	97,732,662.84	86,016,559.40	87,608,454.73
固定资产	1,178,839,693.38	1,227,173,831.90	952,830,852.46	988,241,001.92
无形资产	370,556,980.90	376,080,963.25	347,913,998.86	355,369,219.65
其中: 交易席位费	13,165,081.70	16,794,101.78	12,693,524.37	16,228,633.62
商誉	51,341,567.30	51,341,567.30	-	-
递延所得税资产	136,434,890.95	129,759,764.38	10,844,590.59	7,582,061.79
其他资产	3,454,244,452.17	1,965,547,987.74	2,763,760,439.23	1,339,541,665.97
资产总计	92,407,758,346.68	113,462,823,522.12	68,498,588,257.85	86,479,255,450.92
负债:				
短期借款	-	-	-	-
其中: 质押借款	-	-	-	-
拆入资金	-	-	-	-
交易性金融负债	96,685,483.06	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	5,845,732,995.00	2,508,774,465.75	4,319,649,000.00	2,308,774,465.75
代理买卖证券款	45,519,443,683.96	69,106,705,060.17	32,850,163,379.97	51,508,702,219.62
代理承销证券款	37,271,200.00	255,650,000.00	-	-
应付职工薪酬	689,773,889.86	870,774,080.93	308,740,809.48	420,751,923.93
应交税费	755,063,470.59	605,750,156.93	687,134,339.63	405,304,712.19
应付利息	2,407,171.38	561,700.06	2,407,171.38	53,551.81
预计负债	447,118.94	447,118.94	447,118.94	447,118.94
长期借款	-	-	-	-
应付债券	-	-	-	-
递延所得税负债	36,808,925.60	61,884,446.63	7,555,781.31	22,885,152.34
其他负债	5,915,247,106.54	6,812,488,392.74	298,478,047.94	1,814,736,376.71
负债合计	58,898,881,044.93	80,223,035,422.15	38,474,575,648.65	56,481,655,521.29
所有者权益:				
股本	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
资本公积	17,375,048,347.05	17,415,179,706.11	17,121,926,359.20	17,128,060,442.84
减: 库存股	-	-	-	-
盈余公积	821,991,327.95	821,991,327.95	821,991,327.95	821,991,327.95
一般风险准备	972,887,579.07	972,887,579.07	972,887,579.07	972,887,579.07
交易风险准备	883,003,891.32	883,003,891.32	883,003,891.32	883,003,891.32
未分配利润	7,501,238,026.34	7,197,662,924.77	4,624,203,451.66	4,591,656,688.45
外币报表折算差额	-14,582,325.89	-8,922,614.14	-	-
归属于母公司所有者权益合计	33,139,586,845.84	32,881,802,815.08	30,024,012,609.20	29,997,599,929.63
少数股东权益	369,290,455.91	357,985,284.89	-	-

项目	合并		母公司	
	2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日	2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日
所有者权益合计	33,508,877,301.75	33,239,788,099.97	30,024,012,609.20	29,997,599,929.63
负债和所有者权益总计	92,407,758,346.68	113,462,823,522.12	68,498,588,257.85	86,479,255,450.92

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）

2011 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	合并		母公司	
	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月
一、营业收入	3,394,839,304.62	3,588,680,568.97	2,208,295,600.42	2,016,986,094.49
手续费及佣金净收入	2,649,935,404.17	3,181,334,858.86	1,735,540,456.36	1,909,625,712.83
其中：代理买卖证券业务净收入	2,029,484,614.97	2,417,523,941.34	1,355,623,028.19	1,578,997,187.27
证券承销业务净收入	578,686,479.56	710,295,138.94	338,329,938.25	277,415,588.27
受托客户资产管理业务净收入	41,764,309.64	53,515,778.58	41,587,489.92	53,212,937.29
利息净收入	560,226,809.06	443,389,573.54	374,340,607.15	293,889,008.30
投资收益（损失以“-”号填列）	192,493,710.42	67,901,656.98	109,929,760.96	-17,379,009.64
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	76,022,497.62	126,055,869.15	76,022,497.62	126,055,869.15
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,800,032.17	-110,862,731.90	-13,853,044.08	-172,165,101.41
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-4,840,722.20	59,938.79	-	-
其他业务收入	7,824,135.34	6,857,272.70	2,337,820.03	3,015,484.41
二、营业支出	1,861,913,786.91	1,808,955,628.43	1,066,416,484.45	960,835,092.46
营业税金及附加	178,543,964.93	179,964,455.41	118,977,100.84	103,323,913.58
业务及管理费	1,679,287,049.86	1,627,137,752.30	945,657,533.06	855,701,693.88
资产减值损失	-580,107.75	-	-	-
其他业务成本	4,662,879.87	1,853,420.72	1,781,850.55	1,809,485.00
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	1,532,925,517.71	1,779,724,940.54	1,141,879,115.97	1,056,151,002.03
加：营业外收入	5,806,996.09	4,832,522.51	3,989,734.62	4,364,681.69
减：营业外支出	8,213,390.35	6,272,398.22	7,813,998.98	5,159,083.41
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,530,519,123.45	1,778,285,064.83	1,138,054,851.61	1,055,356,600.31
减：所得税费用	375,294,773.81	335,764,306.98	265,508,088.40	155,253,618.12
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,155,224,349.64	1,442,520,757.85	872,546,763.21	900,102,982.19
归属于母公司所有者的净利润	1,143,575,101.57	1,420,347,648.47	872,546,763.21	900,102,982.19
少数股东损益	11,649,248.07	22,173,109.38	-	-
六、每股收益：	-	-	-	-
（一）基本每股收益	0.20	0.27	-	-
（二）稀释每股收益	-	-	-	-
七、其他综合收益	-46,453,310.86	-213,313,920.08	-6,452,246.64	-195,177,824.29
八、综合收益总额	1,108,771,038.78	1,229,206,837.77	866,094,516.57	704,925,157.90
归属于母公司所有者的综合收益总额	1,097,465,867.76	1,207,443,331.18	866,094,516.57	704,925,157.90
归属于少数股东的综合收益总额	11,305,171.02	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

合并现金流量表（未经审计）

2011 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	合并		母公司	
	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月
一、经营活动产生的现金流量:				
处置交易性金融资产净增加额	-	-	-	-
收取利息、手续费及佣金的现金	4,109,418,486.41	4,569,662,139.28	2,698,384,463.81	2,856,050,655.77
拆入资金净增加额	-	-	-	-
回购业务资金净增加额	2,463,896,013.78	-	2,010,874,534.25	966,030,000.00
销售商品、提供劳务收到的现金	-	-	-	-
收到的税费返还	2,283,283.43	7,652.16	2,283,283.43	7,652.16
代理买卖证券款净增加额	-	-	-	-
收到的其他与经营活动有关的现金	296,183,669.47	886,636,882.10	134,120,213.97	53,437,330.65
经营活动现金流入小计	6,871,781,453.09	5,456,306,673.54	4,845,662,495.46	3,875,525,638.58
处置交易性金融资产净减少额	1,360,763,722.54	4,418,430,580.47	591,082,380.12	5,540,692,093.91
支付利息、手续费及佣金的现金	928,471,484.67	954,754,411.77	608,949,298.37	665,559,498.55
购买商品、接受劳务支付的现金	-	-	-	-
支付给职工以及为职工支付的现金	685,997,301.54	948,508,475.60	159,771,744.22	521,234,699.33
支付的各项税费	884,658,753.06	722,414,426.83	624,344,979.05	467,158,808.12
回购业务支付的现金净额	-	597,619,384.80	-	-
代理买卖证券款净减少额	23,587,261,376.21	7,783,164,938.51	18,658,538,839.65	2,713,700,282.05
支付的其他与经营活动有关的现金	3,859,737,997.93	3,106,567,248.69	3,115,221,451.87	1,678,710,803.65
经营活动现金流出小计	31,306,890,635.95	18,531,459,466.67	23,757,908,693.28	11,587,056,185.61
经营活动产生的现金流量净额	-24,435,109,182.86	-13,075,152,793.13	-18,912,246,197.82	-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	293,380,171.80	-	270,125,146.47	-
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	6,077,795.10	822,739.73	320,663.48	243,899.73
投资活动现金流入小计	299,457,966.90	822,739.73	270,445,809.95	243,899.73
投资支付的现金	309,000,000.00	761,400,000.00	309,000,000.00	700,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	142,042,882.38	214,595,947.66	98,743,543.55	148,415,364.25
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	-	-	-	-
支付的其他与投资活动有关的现金	27,809.56	-	-	-
投资活动现金流出小计	451,070,691.94	975,995,947.66	407,743,543.55	848,415,364.25
投资活动产生的现金流量净额	-151,612,725.04	-975,173,207.93	-137,297,733.60	-848,171,464.52
三、筹资活动产生的现金流				

项目	合并		母公司	
	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	2010 年 1-6 月
量:				
吸收投资收到的现金	-	15,532,208,476.60	-	15,532,208,476.60
其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金	-	-	-	-
发行债券收到的现金	-	-	-	-
收到其他与筹资活动有关的现金	-	47,819,650.00	-	-
筹资活动现金流入小计	-	15,580,028,126.60	-	15,532,208,476.60
偿还债务支付的现金	-	1,999,724,222.79	-	1,999,724,222.79
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	828,919,927.51	-	828,919,927.51	-
其中:子公司支付给少数股东的股利	-	-	-	-
支付其他与筹资活动有关的现金	-	-	-	-
筹资活动现金流出小计	828,919,927.51	1,999,724,222.79	828,919,927.51	1,999,724,222.79
筹资活动产生的现金流量净额	-828,919,927.51	13,580,303,903.81	-828,919,927.51	13,532,484,253.81
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-10,497,126.72	-260,264.64		
五、现金及现金等价物净增加额	-25,426,138,962.13	-470,282,361.89	-19,878,463,858.93	4,972,782,242.26
加:期初现金及现金等价物余额	84,592,887,329.46	85,157,677,718.64	61,581,180,630.32	58,696,991,297.77
六、期末现金及现金等价物余额	59,166,748,367.33	84,687,395,356.75	41,702,716,771.39	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）

2011 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	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	5,600,000,000.00	17,415,179,706.11	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,197,662,924.77	-8,922,614.14	357,985,284.89	33,239,788,099.97
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	5,600,000,000.00	17,415,179,706.11		821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,197,662,924.77	-8,922,614.14	357,985,284.89	33,239,788,099.97
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-40,131,359.06	-	-	-	-	303,575,101.57	-5,659,711.75	11,305,171.02	269,089,201.78
(一) 净利润							1,143,575,101.57		11,649,248.07	1,155,224,349.64
(二) 其他综合收益		-40,449,522.06						-5,659,711.75	-344,077.05	-46,453,310.86
上述(一)和(二)小计	-	-40,449,522.06	-	-	-	-	1,143,575,101.57	-5,659,711.75	11,305,171.02	1,108,771,038.78
(三) 所有者投入和减少资本	-	318,163.00		-	-		-	-	-	318,163.00
1. 所有者投入资本	-	-							-	-
2. 股份支付计入所有者权益的金额										-
3. 其他		318,163.00							-	318,163.00
(四) 利润分配	-	-		-	-	-	-840,000,000.00	-	-	-840,000,000.00
1. 提取盈余公积				-			-			-
2. 提取一般风险准备					-		-			-
3. 对所有者的分配						-	-840,000,000.00		-	-840,000,000.00
4. 其他										
(五) 所有者权益内部结转	-	-		-	-		-	-	-	-
1. 资本公积转增股本										-
2. 盈余公积转增股本										-
3. 盈余公积弥补亏损										-
4. 一般风险准备弥补亏损										-
5. 其他										-
四、本期末余额	5,600,000,000.00	17,375,048,347.05	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,501,238,026.34	-14,582,325.89	369,290,455.91	33,508,877,301.75

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

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	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. 对所有者的分配										-
4. 其他										-
(五) 所有者权益内部结转	-	-		-	-		-	-	-	-
1. 资本公积转增股本										-
2. 盈余公积转增股本										-
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）

2011 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	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	所有者权益合计
一、上年年末余额	5,600,000,000.00	17,128,060,442.84		821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	4,591,656,688.45	29,997,599,929.63
加：会计政策变更								-
前期差错更正								-
其它								
二、本年初余额	5,600,000,000.00	17,128,060,442.84		821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	4,591,656,688.45	29,997,599,929.63
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-6,134,083.64		-	-	-	32,546,763.21	26,412,679.57
（一）净利润							872,546,763.21	872,546,763.21
（二）其他综合收益		-6,452,246.64					-	-6,452,246.64
上述（一）和（二）小计	-	-6,452,246.64		-	-	-	872,546,763.21	866,094,516.57
（三）所有者投入和减少资本	-	318,163.00		-	-	-	-	318,163.00
1. 所有者投入资本	-	-						-
2. 股份支付计入所有者权益的金额								-
3. 其他		318,163.00						318,163.00
（四）利润分配	-	-		-	-	-	-840,000,000.00	-840,000,000.00
1. 提取盈余公积				-			-	-
2. 提取一般风险准备					-		-	-
3. 对所有者的分配						-	-840,000,000.00	-840,000,000.00
4. 其他								
（五）所有者权益内部结转								-
1. 资本公积转增股本	-	-		-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本								-
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	17,121,926,359.20	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	4,624,203,451.66	30,024,012,609.20

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	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	所有者权益合计
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. 对所有者的分配								-
4. 其他								-
（五）所有者权益内部结转								-
1. 资本公积转增股本	-	-		-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本								-
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 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 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 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 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 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 万元，并于 2007 年 12 月 7 日变更工商注册登记，注册登记号为：320000000000192。

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 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。

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的批复》批准，公司于 2010 年 2 月 9 日，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 万元，公司于 2010 年 2 月 23 日领取了变更后的企业法人营业执照。

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。

本公司的权力机构是股东大会，实行董事会领导下的总裁负责制，董事会下设合规与风险管理委

员会、审计委员会、发展战略委员会、提名委员会、薪酬与考核委员会。公司根据总体发展规划和业务发展的具体情况，下设董事会办公室、合规与风险管理部、稽查部、经纪业务总部、投资银行管理总部、固定收益部、证券投资部、金融创新部、资产管理总部、机构业务部、融资融券部、研究所、理财服务中心、运营中心、信息技术部、计划财务部、人力资源部、办公室、党群工作部、企划部、督导室、综合事务部、深圳办事处、南京分公司、苏州分公司、南通分公司、上海分公司、北京分公司、天津分公司、辽宁分公司、黑龙江分公司等部门。

截止 2011 年 6 月 30 日，公司拥有华泰联合证券有限责任公司、华泰长城期货有限公司（原名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、华泰金控投资咨询（深圳）有限公司等五家子公司；母公司下属 131 家证券营业部，子公司华泰联合证券有限责任公司下属 72 家证券营业部，子公司华泰长城期货有限公司下属 27 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：

本公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则，以及其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相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性的，为同一控制下企业合并。

合并方在企业合并中取得的资产和负债，按合并日在被合并方的账面价值计量。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足以冲减的，调整留存收益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

（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。

购买方支付的合并成本是为取得被购买方控制权而支付的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。

购买方在购买日对合并成本进行分配，确认所取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值。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；合并成本小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，计入当期损益。

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，以购买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，并自购买日起将被合并子公司纳入合并范围。

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。

子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余额应当冲减少数股东权益。

9、现金及现金等价物的确定标准

现金是指库存现金及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指持有的期限短、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）外币交易的会计处理

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。

于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，除根据借款费用核算方法应予资本化的，计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算。

(2) 外币报表折算

境外经营的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，股东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。境外经营的利润表中的收入和费用项目，采用平均汇率折算。上述折算产生的外币报表折算差额，在股东权益中单独列示。

11、金融工具

(1) 金融工具的确认和终止确认

当本公司成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

满足下列条件的，终止确认金融资产（或金融资产的一部分，或一组类似金融资产的一部分）：

①收取金融资产现金流量的权利届满；

②转移了收取金融资产现金流量的权利，或在“过手”协议下承担了及时将收取的现金流量全额支付给第三方的义务；并且实质上转让了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，或虽然实质上既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但放弃了对该金融资产的控制。

公司已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。如果现有金融负债被同一债权人以实质上几乎完全不同条款的另一金融负债所取代，或现有负债的条款几乎全部被实质性修改，则此类替换或修改作为终止确认原负债和确认新负债处理，差额计入当期损益。

(2) 金融资产的分类和计量方法

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。

（3）金融负债的分类和计量方法

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债和初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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。

（4）公允价值的确定方法

公允价值的估值原则

存在活跃市场的金融资产或金融负债，采用活跃市场中的报价确定其公允价值。有充足证据表明市场报价不能真实反映公允价值的，则在谨慎性原则的基础上采用适当的估值技术，确定公允价值。

金融工具不存在活跃市场的，采用适当的估值技术，审慎确定其公允价值。

对于没有报价且其公允价值不能可靠计量的金融资产投资，按成本计量。

具体投资品种的估值方法

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；非公开发行有明确锁定期的股票，按以下规定确定公允价值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用相应的估值技术确定估值日该股票的公允价值。

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、特种金融债和中央银行票据等，采用中央国债登记结算有限责任公司公布的债券估值作为公允价值。

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。

⑥创设发行认购权证时，应按实际收到的款项，反映为“交易性金融负债”，会计期末，认购权证按认购权证最后一个交易日的加权平均价计量，前后两个会计期末加权平均价的差额应当计入当期损益；如遇认购权证的加权平均价显著偏离按 B-S 期权定价模型计算确定的价值，公司按 B-S 期权定价模型计算确定的价值计量。

创设发行认沽权证时，应按实际收到的款项，反映为“交易性金融负债”，会计期末，认沽权证按认沽权证最后一个交易日的加权平均价计量，前后两个会计期末加权平均价的差额应当计入当期损益；如遇认沽权证的加权平均价显著偏离按 B-S 期权定价模型计算确定的价值，公司按 B-S 期权定价模型计算确定的价值计量。

（5）金融资产减值

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。

12、应收款项坏账准备的确认标准和计提方法

（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。

如果某项应收款项的可收回性与其他各项应收款项存在明显的差别, 导致该项应收款项如果按照账龄分析及上述标准计提坏账准备无法真实地反映其可收回金额的, 将采用个别认定法计提坏账准备。

13、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, 按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。

14、客户交易结算资金核算办法

(1) 公司代理客户的交易结算资金, 全额存入指定的商业银行账户, 实行专户管理, 与证券交易所清算的资金单独存入指定清算银行。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为一项负债, 与客户进行相关的清算。

(2) 公司接受客户委托通过证券交易所代理买卖证券, 与客户清算时如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额, 按清算日买卖证券成交价的差额, 加代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费减少客户交易结算资金; 如买入证券成交总额小于卖出证券成交总额, 按清算日买卖证券成交价的差额, 减代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费增加客户交易结算资金。

(3) 公司于每季度末按规定向客户统一结息时, 增加客户交易结算资金。

15、代理发行证券核算办法

代理发行证券根据发行人确定的发售方式, 按以下规定分别进行核算:

(1) 以全额包销方式进行代理发行证券的业务, 公司在收到代发行人发售的证券时, 按承购价同时确认为一项资产和一项负债。发行期结束后, 如有未售出的证券, 按承购价转为公司的交易性金融资产或可供出售金融资产。

(2) 以余额包销方式进行代理发行证券的业务, 公司在收到代发行人发售的证券时, 按委托方约定的发行价格同时确认为一项资产和一项负债。发行期结束后, 如有未售出的证券, 按约定的

发行价格转为公司的交易性金融资产或可供出售金融资产。

(3) 以代销方式进行代理发行证券的业务，公司在收到代发行人发售的证券时，按委托方约定的发行价格同时确认为一项资产和一项负债。

16、代兑付债券核算办法

公司接受客户代理兑付其到期债券，按兑付方式分为代垫资金兑付和预收资金兑付。

17、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) 长期股权投资的投资成本确定

①企业合并形成的长期股权投资的投资成本确定

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投资成本。

②企业合并以外其他方式取得的长期股权投资的投资成本确定

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投资成本，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。

18、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。

19、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	30-35 年	3%	2.77%-3.23%
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。

20、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。

21、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。

22、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。

23、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。

24、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) 委托资产管理收入按合同约定方式确认当期收入；
- (7) 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。

25、政府补助会计处理方法

与收益相关的政府补助，如果用于补偿本公司以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关费用的期间，计入当期损益；如果用于补偿本公司已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

与资产相关的政府补助，确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内平均分配，计入当期损益。但是，按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

26、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。

27、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。

28、交易风险准备金的计算标准

按税后利润的 10% 提取。

29、主要会计政策、会计估计的变更

(1) 补充金融资产的估值

公司补充新增业务所产生的金融资产估值计量规定，对于非公开发行有明确锁定期的股票，按以下方法确定公允价值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应按以下公式确定该股票的价值： $FV=C+(P-C)\times(DI-Dr) / DI$

其中：FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；DI 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数。

(2) 修改部分金融资产公允价值的估值

因银行间市场债券交易无公开的统一市场价，公司原采用以下估值方式确定其公允价值：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，当持仓成本高于发行价格时，以发行价格作为公允价值；当持仓成本低于发行价格时，以持仓成本作为公允价值。

现中央国债登记结算有限责任公司每日会公布相应的债券估值，为便于与同行业数据比较，公司对估值办法进行变更，银行间市场债券的公允价值采用中央国债登记结算有限责任公司公布的债券估值。

本次变更属于会计估计变更，采用未来适用法处理，无需对以前年度进行追溯调整。

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：按照应纳营业税额的 7% 缴纳城市维护建设税；按照应纳营业税额的 5%（原税率 4%，自本年 2 月起调增 1%）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”）

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	5%
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%、2011 年度 24%（深圳市、海口市）

2、华泰长城期货有限公司（以下简称“华泰长城”）

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	4%（东莞 5%）
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%

5、华泰金控投资咨询（深圳）有限公司（以下简称“华泰金控公司”）

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 30,000 万元
经营范围	证券金融
期末实际出资额	港币 30,000 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 50,000 万元
经营范围	股权投资
期末实际出资额	人民币 50,000 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%

子公司全称	华泰紫金投资有限责任公司
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

③华泰金控投资咨询（深圳）有限公司

子公司全称	华泰金控投资咨询（深圳）有限公司
子公司类型	全资子公司的全资子公司
注册地	深圳
业务性质	咨询
注册资本	港币 1,000 万元
经营范围	项目投资信息咨询，企业管理咨询，经济信息咨询，市场营销策划
期末实际出资额	港币 1,000 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 119,869 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 (%)	98.00%
表决权比例 (%)	98.00%
是否合并报表	是
少数股东权益	8,527.67 万元
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华泰长城期货有限公司

子公司全称	华泰长城期货有限公司
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 60,000 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 36,660 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	28,401.38 万元
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	期末余额			年初余额		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
现金	人民币	2,098,643.62		2,098,643.62	1,287,799.08		1,287,799.08
小计				2,098,643.62			1,287,799.08
银行存款							
公司自有：				10,830,184,346.44			10,618,291,148.82
	人民币	10,593,655,446.09		10,593,655,446.09	10,257,234,160.40		10,257,234,160.40
	美元	22,476,105.61	6.4716	145,456,365.07	20,143,915.80	6.6227	133,407,111.14
	港币	109,514,833.19	0.8316	91,072,535.28	267,533,247.31	0.85093	227,649,877.28
客户资金存款：				43,772,867,371.73			48,488,098,229.14
	人民币	42,830,486,254.41		42,830,486,254.41	47,409,542,445.87		47,409,542,445.87
	美元	75,429,337.11	6.4716	488,148,498.04	89,434,470.70	6.6227	592,297,922.67
	港币	546,215,270.90	0.8316	454,232,619.28	571,456,875.27	0.85093	486,257,860.60

项目	币种	期末余额			年初余额		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
小计				54,603,051,718.17			59,106,389,377.96
其他货币资金		14,617,660.18		14,617,660.18	356,849,270.84		356,849,270.84
小计				14,617,660.18			356,849,270.84
合计				54,619,768,021.97			59,464,526,447.88

截止期末余额，货币资金余额中除华泰（香港）公司等值人民币229,328,311.65元的外币存放在香港外，无抵押、冻结等对变现有限制或存放境外、或存在潜在回收风险的款项。

2、 结算备付金

项目	币种	期末余额			年初余额		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
公司备付金：							
	人民币	475,019,238.52		475,019,238.52	982,381,643.45		982,381,643.45
小计				475,019,238.52			982,381,643.45
客户备付金：							
	人民币	3,894,067,643.21		3,894,067,643.21	24,020,749,923.70		24,020,749,923.70
	美元	22,702,142.55	6.4716	146,919,185.73	13,443,399.90	6.62270	89,031,604.53
	港币	37,246,606.42	0.8316	30,974,277.90	42,539,775.42	0.85093	36,197,094.90
小计				4,071,961,106.84			24,145,978,623.13
合计				4,546,980,345.36			25,128,360,266.58

3、 交易性金融资产

项 目	期末余额		年初余额	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
企业债券	15,646,363,107.36	15,776,408,408.02	10,717,432,654.00	10,778,026,958.85
基金	255,748,882.95	254,986,949.81	289,465,558.02	291,046,744.18
权益工具	1,741,921,806.67	1,696,338,360.59	2,206,008,433.77	2,209,896,810.91
国债	100,986,288.92	101,564,095.00	637,909,728.18	637,122,939.72
合 计	17,745,020,085.90	17,829,297,813.42	13,850,816,373.97	13,916,093,453.66

4、 衍生金融资产

衍生金融资产期末余额为 0，其项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间抵销后的净额为 0，为便于报表使用人理解，在本附注中按下列格式，对衍生金融资产项下的股指期货投资作相关披露和说明。

期末股指期货投资情况

品种	代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
沪深 300 指数	IF1107	IF1107	830.00	758,404,200.00	-20,469,720.00
沪深 300 指数	IF1108	IF1108	17.00	15,580,500.00	-564,900.00
沪深 300 指数	IF1109	IF1109	137.00	126,111,240.00	7,104,240.00
沪深 300 指数	IF1112	IF1112	3.00	2,805,480.00	264,300.00
合计				902,901,420.00	-13,666,080.00
减：可抵消股指期货暂收暂付款					-13,666,080.00
股指期货投资净额：					-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5、买入返售金融资产

(1) 按金融资产分类

项目	期末余额	年初余额
买入返售证券	1,134,172,688.07	251,210,172.60
合计	1,134,172,688.07	251,210,172.60

(2) 按交易对手分类

项目	期末余额	年初余额
银行金融机构	-	-
非银行金融机构	1,134,172,688.07	251,210,172.60
合计	1,134,172,688.07	251,210,172.60

6、存出保证金

项目	期末余额	年初余额
交易保证金	479,052,782.88	616,855,236.15
履约保证金	2,000,000.00	2,000,000.00
期货公司保证金	3,313,754,532.57	2,516,736,212.13
合计	3,794,807,315.45	3,135,591,448.28

7、可供出售金融资产

项 目	期末余额		年初余额	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
债券			452,400.00	465,356.74
股票[注]	2,090,866,319.04	2,150,865,721.74	4,814,454,098.56	4,967,155,031.97
基金	13,130,000.00	12,611,000.00	13,130,000.00	14,780,000.00
其他	193,596,490.32	197,171,661.67	193,596,490.32	208,356,506.07
合 计	2,297,592,809.36	2,360,648,383.41	5,021,632,988.88	5,190,756,894.78

[注]：(1) 截止 2011 年 6 月末，可供出售金融资产余额中，融出证券 16,071,817.27 元。

证券名称	证券代码	期末市值
中信证券	600030	3,451,877.40

招商银行	600036	300,762.00
贵州茅台	600519	4,721,874.41
工商银行	601398	1,058,804.00
紫金矿业	601899	2,896,000.00
万科 A	00002	1,008,380.75
吉林敖东	000623	2,107,126.71
苏宁电器	002024	388,143.00
金风科技	002202	138,849.00
合 计		16,071,817.27

(2) 存在限售期限的可供出售金融资产

证券名称	证券代码	限售解禁日期
长航油运	600087	2012 年 3 月 3 日
海利得	002206	2012 年 4 月 1 日
美晨科技	300237	2011 年 9 月 29 日
ST 秋林	600891	于 2012 年 3 月 1 日内完成向颐和黄金定向送股事项，方可由秋林公司董事会向上海证券交易所提出其所持股份上市流通的申请。
汉盛基金	500005	封闭式基金发起人持有的份额，2014 年 5 月 17 日到期
汉兴基金	500015	封闭式基金发起人持有的份额，2014 年 12 月 30 日到期
鸿阳基金	184728	封闭式基金发起人持有的份额，2016 年 12 月 9 日到期。

8、持有至到期投资

项 目	期末余额	年初余额
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

9、长期股权投资

(1) 分类情况

项 目	期末余额		年初余额	
	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	1,736,845,072.86	7,772,000.66	1,450,511,834.86	30,438,762.66
按权益法核算的长期股权投资	1,064,238,033.18	-	1,083,665,900.97	-
合 计	2,801,083,106.04	7,772,000.66	2,534,177,735.83	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	持股比例	表决权比例	投资成本	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
江苏银行股份有限公司	7.03%	7.03%	1,300,000,000.00	1,300,000,000.00	-	-	1,300,000,000.00

被投资单位名称	持股比例	表决权比例	投资成本	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
深圳市巨田投资有限责任公司	3.78%	3.78%	22,666,762.00	22,666,762.00	-	22,666,762.00	-
苏州世名科技股份有限公司	10.00%	10.00%	20,000,000.00	20,000,000.00	-	-	20,000,000.00
苏州浩波科技股份有限公司	5.93%	5.93%	18,200,000.00	18,200,000.00	-	-	18,200,000.00
江苏中恒宠物用品股份有限公司	11.11%	11.11%	23,200,000.00	23,200,000.00	-	-	23,200,000.00
江苏天容集团股份有限公司	5.93%	5.93%	44,450,000.00	44,450,000.00	-	-	44,450,000.00
其他法人股投资			21,995,072.86	21,995,072.86	309,000,000.00	-	330,995,072.86
合计			1,450,511,834.86	1,450,511,834.86	309,000,000.00	22,666,762.00	1,736,845,072.86

(3) 按权益法核算的长期股权投资

被投资单位名称	持股比例	表决权比例	投资成本	年初余额
南方基金管理有限公司	45.00%	45.00%	857,250,015.50	892,711,991.61
华泰柏瑞基金管理有限公司	49.00%	49.00%	165,256,241.16	190,953,909.36
合计			1,022,506,256.66	1,083,665,900.97

(续上表)

被投资单位名称	本期增加	本期减少	期末余额	本期现金红利
南方基金管理有限公司	107,776,639.31	-	865,488,630.92	135,000,000.00
华泰柏瑞基金管理有限公司	7,795,492.90	-	198,749,402.26	-
合计	115,572,132.21	-	1,064,238,033.18	135,000,000.00

(4) 长期股权投资减值准备

被投资单位名称	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额	计提原因
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	-	22,666,762.00	7,772,000.66	

10、 投资性房地产

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原值				
房屋建筑物	122,724,974.26	-	2,548,960.90	120,176,013.36
累计折旧				
房屋建筑物	23,071,762.08	1,635,373.61	946,356.91	23,760,778.78
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	97,732,662.84			94,494,685.24

11、 固定资产

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原 值				

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
房屋及建筑物	842,657,154.16	847,937.26	364,945.62	843,140,145.80
电子设备	822,829,464.35	51,116,303.60	15,174,203.08	858,771,564.87
运输设备	142,093,468.51	11,542,265.24	3,998,749.51	149,636,984.24
办公设备	51,868,918.72	3,747,097.56	379,423.34	55,236,592.94
其他设备	10,135,163.92	420,750.64	166,494.72	10,389,419.84
合 计	1,869,584,169.66	67,674,354.30	20,083,816.27	1,917,174,707.69
累计折旧				
房屋及建筑物	188,135,142.87	11,846,568.38	-	199,981,711.25
电子设备	366,475,025.93	78,821,882.43	6,541,685.24	438,755,223.12
运输设备	55,857,155.90	7,785,617.97	1,934,982.22	61,707,791.65
办公设备	26,748,501.84	5,554,906.22	296,349.06	32,007,059.00
其他设备	5,194,511.22	729,792.89	41,074.82	5,883,229.29
合 计	642,410,337.76	104,738,767.89	8,814,091.34	738,335,014.31
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	654,522,011.29			643,158,434.55
电子设备	456,354,438.42			420,016,341.75
运输设备	86,236,312.61			87,929,192.59
办公设备	25,120,416.88			23,229,533.94
其他设备	4,940,652.70			4,506,190.55
合 计	1,227,173,831.90			1,178,839,693.38

12、 无形资产

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原 值				
土地使用权	359,161,122.60	-	-	359,161,122.60
交易席位费[注]	125,584,586.21	-	81,075.70	125,503,510.51
软件支出等	65,629,407.34	8,587,918.00	344,757.66	73,872,567.68
合 计	550,375,116.15	8,587,918.00	425,833.36	558,537,200.79
累计摊销				
土地使用权	21,148,049.99	3,597,774.60	-	24,745,824.59
交易席位费	108,790,484.43	3,547,944.38	-	112,338,428.81
软件支出等	44,355,618.48	6,540,348.01	-	50,895,966.49
合 计	174,294,152.90	13,686,066.99	-	187,980,219.89
减值准备				
土地使用权	-	-	-	-
交易席位费	-	-	-	-

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
软件支出等	-	-	-	-
合 计	-	-	-	-
账面价值				
土地使用权	338,013,072.61			334,415,298.01
交易席位费	16,794,101.78			13,165,081.70
软件支出等	21,273,788.86			22,976,601.19
合 计	376,080,963.25			370,556,980.90

[注]交易席位费

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、原价	125,584,586.21	-	81,075.70	125,503,510.51
1.上海证券交易所	82,507,452.82	-	42,000.00	82,465,452.82
A 股	75,477,156.76	-	42,000.00	75,435,156.76
B 股	7,030,296.06	-	-	7,030,296.06
2.深圳证券交易所	41,927,196.29	-	30,000.00	41,897,196.29
A 股	41,077,196.29	-	30,000.00	41,047,196.29
B 股	850,000.00	-	-	850,000.00
3.其他交易所	1,149,937.10	-	9,075.70	1,140,861.40
二、累计摊销额	108,790,484.43	3,547,944.38	-	112,338,428.81
1.上海证券交易所	70,701,242.49	2,479,558.01	-	73,180,800.50
A 股	64,613,963.67	2,143,055.67	-	66,757,019.34
B 股	6,087,278.82	336,502.34	-	6,423,781.16
2.深圳证券交易所	37,344,961.71	791,788.50	-	38,136,750.21
A 股	36,554,961.71	791,788.50	-	37,346,750.21
B 股	790,000.00	-	-	790,000.00
3.其他交易所	744,280.23	276,597.87	-	1,020,878.10
三、交易席位费账面价值合计	16,794,101.78	-	-	13,165,081.70
1.上海证券交易所	11,806,210.33	-	-	9,284,652.32
A 股	10,863,193.09	-	-	8,678,137.42
B 股	943,017.24	-	-	606,514.90
2.深圳证券交易所	4,582,234.58	-	-	3,760,446.08
A 股	4,522,234.58	-	-	3,700,446.08
B 股	60,000.00	-	-	60,000.00
3.其他交易所	405,656.87	-	-	119,983.30

13、 商誉

项 目	联合证券	华泰长城	合 计
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

项 目	联合证券	华泰长城	合 计
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
净 额	51,089,439.80	252,127.50	51,341,567.30

因企业合并形成的商誉账面价值按照预计未来现金流量现值进行计算，其可收回金额高于账面价值，未发生减值。

14、 递延所得税资产/递延所得税负债

已确认的递延所得税资产和递延所得税负债

项 目	期末余额	年初余额
递延所得税资产：		
交易性金融资产	-	-
应收帐款	123,824,930.48	120,562,401.69
长期股权投资	7,366,690.27	7,366,690.26
以后年度可弥补亏损	168,917.82	172,840.05
投资性房地产	460,931.84	460,931.84
衍生金融工具	3,416,520.00	
其他	1,196,900.54	1,196,900.54
小 计	136,434,890.95	129,759,764.38
递延所得税负债：		
交易性金融资产	17,908,507.33	16,093,216.17
可供出售金融资产	18,900,418.27	41,757,580.46
衍生金融工具	-	4,033,650.00
小 计	36,808,925.60	61,884,446.63

(2) 应纳税暂时性差异和可抵扣暂时性差异明细

项 目	金 额
可抵扣暂时性差异	
应收帐款	501,351,601.09
长期股权投资	7,772,000.66
以后年度可弥补亏损	1,023,744.36
投资性房地产	1,920,549.34
衍生金融工具	13,666,080.00
其他	4,987,085.56
小 计	530,721,061.01
应纳税暂时性差异	
交易性金融资产	81,224,715.61
可供出售金融资产	97,590,439.25
小 计	178,815,154.86

15、 其他资产

项 目	期末余额	年初余额
应收股利 A	135,000,000.00	-
应收款项 B	644,862,324.20	606,829,322.88
在建工程 C	275,644,224.06	209,470,195.60
融出资金 D	2,145,630,787.88	864,507,049.62
长期待摊费用 E	223,875,093.13	244,913,732.65
其他流动资产 F	28,172,277.55	38,183,592.39
固定资产清理	-340,254.65	244,094.60
其他非流动资产	1,400,000.00	1,400,000.00
合 计	3,454,244,452.17	1,965,547,987.74

(A) 应收股利：系应收本期南方基金分配股利。

(B) 应收款项

(1) 分类情况：

类 别	期末余额			年初余额		
	应收账款余额	比例	坏账准备余额	应收账款余额	比例	坏账准备余额
合同期内	567,002,255.22	49.86%	1,701,006.77	533,236,765.58	48.12%	1,599,710.30
超过合同期	570,199,046.07	50.14%	490,637,970.32	574,908,158.39	51.88%	499,715,890.79
无合同期	35,000.00	0.00%	35,000.00	35,000.00	0.00%	35,000.00
合 计	1,137,236,301.29	100.00%	492,373,977.09	1,108,179,923.97	100.00%	501,350,601.09

(2) 逾期应收款项明细列示：

类 别	期末余额	年初余额
逾期买入返售证券	-	-
其他逾期应收款	570,234,046.07	574,943,158.39
合 计	570,234,046.07	574,943,158.39

(3) 逾期应收款项账龄分析：

账龄	期末余额		年初余额	
	金额	比例	金额	比例
1 年以内	-	-	-	-
1 - 2 年	10,962,673.43	1.92%	10,429,495.82	1.81%
2 - 3 年	7,335,806.74	1.29%	3,431,997.33	0.60%
3 年以上	551,935,565.90	96.79%	561,081,665.24	97.59%
合 计	570,234,046.07	100.00%	574,943,158.39	100.00%

(4) 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	223,133,149.14	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
预提基金席位分仓佣金	70,700,564.35	基金公司租用交易席位的佣金收入
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
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

单位名称	金 额	款项性质
证券投资者保护基金	22,844,695.07	待弥补客户资金缺口
合 计	413,154,890.89	

(C) 在建工程

(1) 分类情况

项 目	期末余额			年初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
华泰证券广场	205,663,427.24		205,663,427.24	156,650,977.40		156,650,977.40
其他工程	69,980,796.82		69,980,796.82	52,819,218.20		52,819,218.20
合 计	275,644,224.06		275,644,224.06	209,470,195.60		209,470,195.60

(2) 在建工程本期变动情况

项 目	预算数	年初余额	本期增加	本期转入 固定资产	本 期 其他减少	期末余额
华泰证券广场	16.38 亿元	156,650,977.40	44,237,667.98			200,888,645.38
其他工程	-	52,819,218.20	28,223,910.44	946,410.70	5,341,139.26	74,755,578.68
合 计		209,470,195.60	72,461,578.42	946,410.70	5,341,139.26	275,644,224.06

(续上表)

项 目	工程投入占 预算比 (%)	工程进度	利息资本化 累计金额	其中: 本期利息 资本化金额	本期利息 资本化率	资金来源
华泰证券广场	12.26	12.26	-	-	-	自筹
其他工程			-	-	-	自筹
合 计			-	-	-	

(3) 期末在建工程不存在需要减值准备的情况。

(D) 融出资金

(1) 客户融资买入证券市值前十名情况

项 目	2011 年 6 月 30 日市值
民生银行	117,103,677.66
中国平安	111,568,140.45
中信证券	86,367,697.80
特变电工	70,961,616.83
兴业银行	70,057,218.04
潞安环能	68,970,524.39
山东黄金	54,133,852.28
江西铜业	51,519,730.48
中国建筑	47,468,289.96
紫金矿业	46,752,915.40
合 计	724,903,663.29

(2) 融资融券担保物情况

项 目	2011 年 6 月 30 日市值
资金	178,954,686.62

证券	6,186,926,842.24
合 计	6,365,881,528.86

(E) 长期待摊费用

项 目	原始发生额	年初余额	本期增加	本期摊销额	累计摊销额	期末余额	剩余摊销年限
房屋装修费	310,333,491.61	233,964,520.06	22,736,997.16	44,192,449.61	97,824,424.00	212,509,067.61	
其 他	40,428,294.68	10,949,212.59	2,238,653.29	1,821,840.36	29,062,269.16	11,366,025.52	
合 计	350,761,786.29	244,913,732.65	24,975,650.45	46,014,289.97	126,886,693.16	223,875,093.13	

(F) 其他流动资产

项 目	期末余额	年初余额
待转承销费用	12,607,581.85	9,899,728.20
待摊费用	12,854,070.86	26,780,696.88
其他	2,710,624.84	1,503,167.31
合 计	28,172,277.55	38,183,592.39

16、 资产减值准备

项 目	年初余额	本期计提	本期减少[注]		期末余额
			转回	转销	
坏账准备	501,350,601.09	115,494.63		9,092,118.63	492,373,977.09
长期股权投资减值准备	30,438,762.66			22,666,762.00	7,772,000.66
投资性房地产减值准备	1,920,549.34				1,920,549.34
合 计	533,709,913.09	115,494.63		31,758,880.63	502,066,527.09

[注]资产减值准备本期减少主要原因系华泰联合长期股权投资中深圳市巨田投资有限责任公司于2011年1月26日在深圳联合产权交易所转让给深圳市中正现代实业有限公司；应收款项中云南证券破产清算，确认无法收回欠款。

17、 卖出回购金融资产款

(1) 按性质分类：

项 目	期末余额	年初余额
证券	5,845,732,995.00	2,508,774,465.75
合 计	5,845,732,995.00	2,508,774,465.75

(2) 按交易方分类：

交易类别	期末余额	年初余额
银行金融机构	4,361,383,995.00	2,338,774,465.75
非银行金融机构	1,484,349,000.00	170,000,000.00
合 计	5,845,732,995.00	2,508,774,465.75

18、 代理买卖证券款

项 目	期末余额	年初余额
个人客户	42,148,448,715.31	65,319,861,160.25
法人客户	3,370,994,968.65	3,786,843,899.92
合 计	45,519,443,683.96	69,106,705,060.17

19、 代理承销证券款

项 目	期末余额	年初余额
代理承销证券款	37,271,200.00	255,650,000.00

20、 应付职工薪酬

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
工资、奖金、津贴和补贴	842,626,530.63	776,169,335.19	960,811,947.73	657,983,918.09
职工福利费	16,550.90	17,234,727.72	17,234,727.72	16,550.90
社会保险费	3,329,773.79	110,917,341.33	111,654,126.95	2,592,988.17
住房公积金	443,497.42	30,164,815.60	28,910,089.82	1,698,223.20
工会经费	11,474,979.16	7,126,306.38	3,598,249.32	15,003,036.22
职工教育经费	12,882,749.03	2,330,871.06	2,734,446.81	12,479,173.28
合 计	870,774,080.93	943,943,397.28	1,124,943,588.35	689,773,889.86

21、 应交税费

税 种	期末余额	年初余额
营业税	32,119,529.61	68,790,201.21
城建税	2,118,352.05	4,807,670.86
所得税	141,358,694.72	376,261,198.86
客户资金利息税	690,183.83	704,247.79
个人所得税	30,833,580.24	123,206,038.87
代扣代缴限售股个人所得税	543,020,588.98	23,026,430.87
其他	4,922,541.16	8,954,368.47
合 计	755,063,470.59	605,750,156.93

22、 应付利息

项 目	期末余额	年初余额
应付债券利息		
其他	2,407,171.38	561,700.06
合 计	2,407,171.38	561,700.06

23、 预计负债

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
诉讼赔款	447,118.94			447,118.94

24、 其他负债

项 目	期末余额	年初余额
应付款项 A	331,876,321.98	1,896,364,187.51
应付股利 B	19,729,238.75	19,729,238.75
其他流动负债 C	5,563,641,545.81	4,896,394,966.48
合 计	5,915,247,106.54	6,812,488,392.74

A、应付款项

主要项目	期末余额	年初余额
开放式基金申、认购款	8,199,768.90	1,575,362,057.53
证券投资者保护基金	29,815,836.14	59,407,014.21
亚洲证券清算组	15,555,842.10	15,414,654.81
其他	278,304,874.84	246,180,460.96
合 计	331,876,321.98	1,896,364,187.51

B、应付股利

单位名称	期末余额	期初余额	超过 1 年未支付原因
北京北大方正集团公司	2,524,500.00	2,524,500.00	股权已抵债给华泰联合，待股权转让时一并处理
东北输变电设备集团公司	1,751,826.75	1,751,826.75	
广州万宝投资发展公司	2,524,500.00	2,524,500.00	
广州珠江实业集团公司	3,646,500.00	3,646,500.00	
中国长城计算机集团公司	2,524,500.00	2,524,500.00	
华诚投资管理有限责任公司	2,356,200.00	2,356,200.00	对华泰联合的欠款未还
中国原子能工业公司	3,781,140.00	3,781,140.00	受让华诚投资对华泰联合的股权尚有未了结事项
东风汽车公司	620,000.00	620,000.00	法院冻结
其他	72.00	72.00	
合 计	19,729,238.75	19,729,238.75	

C、其他流动负债

主要项目	期末余额	年初余额
代兑付债券款	13,298,556.20	11,398,339.73
期货风险准备金	36,078,776.24	33,863,728.42
预提费用	810,931.60	1,085,553.98
期货公司客户保证金	5,497,861,479.94	4,845,991,023.55
其他	15,591,801.83	4,056,320.80
合 计	5,563,641,545.81	4,896,394,966.48

25、 股本

项 目	年初余额	本期增减 (+, -)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
一、有限售条件的股份							
1、国有法人股	4,210,438,234	-	-	-	-529,629,593	-529,629,593	3,680,808,641
2、社会法人股	605,000,491	-	-	-	-457,334,353	-457,334,353	147,666,138
小 计	4,815,438,725	-	-	-	-986,963,946	-986,963,946	3,828,474,779
二、无限售条件的股份							
1、人民币普通股	784,561,275	-	-	-	986,963,946	986,963,946	1,771,525,221
小 计	784,561,275	-	-	-	986,963,946	986,963,946	1,771,525,221
合 计	5,600,000,000	-	-	-	-	-	5,600,000,000

26、 资本公积

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
股本溢价	17,218,175,402.90	-		17,218,175,402.90
其他资本公积	197,004,303.21	-40,131,359.06		156,872,944.15
合 计	17,415,179,706.11	-40,131,359.06		17,375,048,347.05

27、 未分配利润

项 目	期末余额
调整前上年年末未分配利润	7,197,662,924.77
调整年初未分配利润合计数（调增+，调减-）	
调整后年初未分配利润	7,197,662,924.77
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,143,575,101.57
减：提取法定盈余公积	
提取一般风险准备	
提取交易风险准备金	
应付普通股股利	840,000,000.00
转作股本的普通股股利	
未分配利润	7,501,238,026.34

28、 手续费及佣金净收入

(1) 按业务类别列示

项 目	本期金额	上期金额
手续费及佣金收入	3,367,116,018.51	3,898,022,940.95
——证券经纪业务	2,580,046,799.64	3,003,997,204.48
——证券承销业务	533,457,956.07	660,444,190.81
——证券保荐业务	37,600,000.00	55,060,000.00
——财务顾问业务	33,036,200.00	25,135,000.00
——受托客户资产管理业务[注]	42,092,993.83	53,515,778.58
——期货经纪业务收入	100,149,251.10	99,870,767.08
——融资融券代买卖证券业务	40,732,817.87	
手续费及佣金支出	717,180,614.34	716,688,082.09
——证券经纪业务手续费支出	658,270,674.63	663,271,786.91
——证券承销业务支出	24,989,836.60	29,200,288.01
——证券保荐业务支出	109,108.00	346,225.86
——财务顾问业务支出	308,731.91	797,538.00
——受托资产管理业务支出	328,684.19	350,565.87
——期货经纪业务支出	24,779,145.42	22,721,677.44
——融资融券代买卖证券支出	8,394,433.59	
手续费及佣金净收入	2,649,935,404.17	3,181,334,858.86

[注]受托客户资产管理手续费及佣金收入

项 目	本期金额	上期金额
定向资产管理业务	1,085,019.67	435,128.07
专项资产管理业务		
集合资产管理业务	41,007,974.16	53,080,650.51
合 计	42,092,993.83	53,515,778.58

29、 利息净收入

项 目	本期金额	上期金额
利息收入	759,952,902.74	670,281,055.98
-存放同业	685,165,647.12	668,481,660.92
-买入返售利息收入	8,642,482.59	1,450,700.54
-融资利息收入	65,660,639.33	-
-融券利息收入	475,318.25	-
-其他	8,815.45	348,694.52
利息支出	199,726,093.68	226,891,482.44
-客户资金	136,526,055.87	127,187,933.98
-债券利息	-	68,647,183.76
-卖出回购金融资产	63,200,037.81	24,697,526.07
-其他	-	6,358,838.63
利息净收入	560,226,809.06	443,389,573.54

30、 投资净收益

项 目	本期金额	上期金额
联营企业和合营企业的投资收益	76,022,497.62	126,055,869.15
出售交易性金融资产的投资收益	-225,154,740.62	-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	-166,246,627.93	-85,273,097.76
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	272,273,719.34	92,308,403.25
可供出售金融资产持有期间取得的收益	9,385,398.06	-
持有至到期投资持有期间取得的收益	114,500.00	-
衍生金融工具的投资收益	218,532,263.95	-2,896.34
其 他	7,566,700.00	-
合 计	192,493,710.42	67,901,656.98

31、 公允价值变动净收益

项 目	本期金额	上期金额
交易性金融资产公允价值变动收益	19,000,647.83	-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	-29,800,680.00	4,008,240.00
合 计	-10,800,032.17	-110,862,731.90

32、 营业税金及附加

项 目	本期金额	上期金额
营业税	159,318,130.47	163,922,385.21
城建税	11,097,401.51	9,057,303.37

项 目	本期金额	上期金额
教育费附加	6,989,475.79	5,648,551.33
其他	1,138,957.16	1,336,215.50
合 计	178,543,964.93	179,964,455.41

33、 业务及管理费

公司发生的主要业务及管理费如下：

类 别	本期金额	上期金额
职工工资	780,764,524.61	725,808,758.63
劳务费	16,384,415.25	92,369,511.04
咨询费	38,868,711.72	22,156,171.90
投资者保护基金	34,631,295.86	59,792,660.26
劳动保险金	99,845,023.76	87,150,760.44
房屋租赁费	100,399,642.08	84,955,468.28
邮电通讯费	57,642,321.30	50,077,104.81
业务招待费	74,317,247.31	61,183,741.94
差旅费	35,255,728.81	33,865,865.51
固定资产折旧费	99,556,849.09	81,369,253.30
其他	341,621,290.07	328,408,456.19
合 计	1,679,287,049.86	1,627,137,752.30

34、 资产减值损失

项 目	本期金额	上期金额
坏账准备	-580,107.75	-
长期投资减值准备	-	-
合 计	-580,107.75	-

35、 营业外收入

项 目	本期金额	上期金额
印花税及个人所得税返还收入	2,283,283.43	128,750.36
固定资产处置净收入	127,579.38	422,447.66
其 他	3,396,133.28	4,281,324.49
合 计	5,806,996.09	4,832,522.51

36、 营业外支出

项 目	本期金额	上期金额
处理固定资产净损失	366,428.34	109,450.54
捐赠支出	4,490,930.00	2,664,810.00
一次性房补	1,865,575.99	1,279,320.22
其 他	1,490,456.02	2,218,817.46
合 计	8,213,390.35	6,272,398.22

37、 所得税费用

项 目	本期金额	上期金额
当期所得税	274,450,086.10	370,804,404.84
递延所得税	100,844,687.71	-35,040,097.86
合 计	375,294,773.81	335,764,306.98

38、 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

项 目	本期金额	上期金额
归属于公司普通股股东的当期净利润	1,143,575,101.57	1,420,347,648.47
公司发行在外普通股的加权平均数	5,600,000,000.00	5,338,479,575.00
每股收益	0.20	0.27

计算过程如下：

项 目	注释	本期金额	上期金额
归属于公司普通股股东的净利润	P	1,143,575,101.57	1,420,347,648.47
报告期月份数	M0	6	6
期初股份总数	S0	5,600,000,000.00	4,815,438,725.00
报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	S1	-	-
报告期因发行新股或债转股等增加股份数	Si	-	784,561,275.00
增加股份下一月份起至报告期期末的月份数	Mi	-	4
报告期因回购等减少股份数	Sj	-	-
减少股份下一月份起至报告期期末的月份数	Mj	-	-
报告期缩股数	Sk	-	-
发行在外的普通股加权平均数	S	5,600,000,000.00	5,338,479,575.00

基本每股收益=P÷S

$S=S0+S1+Si \times Mi \div M0-Sj \times Mj \div M0-Sk$

公司报告期不存在稀释性潜在普通股，因此稀释每股收益与基本每股收益一致。

39、 其他综合收益

项目	本期金额	上期金额
1、可供出售金融资产产生的利得（损失）金额	-95,471,872.52	-204,918,290.32
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	-15,128,638.82	-46,777,368.24
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小 计	-80,343,233.70	-158,140,922.08
2、按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额	39,549,634.59	-54,845,719.57
减：按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额产生的所得税影响		
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小 计	39,549,634.59	-54,845,719.57

项目	本期金额	上期金额
3、现金流量套期工具产生的利得（或损失）金额		
减：现金流量套期工具产生的所得税影响		
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
转为被套期项目初始确认金额的调整额		
小 计		
4、外币财务报表折算差额	-5,659,711.75	-327,278.43
减：处置境外经营当期转入损益的净额		
小 计	-5,659,711.75	-327,278.43
5、其他		
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响		
前期其他计入其他综合收益当期转入损益的净额		
合 计	-46,453,310.86	-213,313,920.08

40、 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期金额	上期金额
期货公司保证金	-	807,968,529.52
承销证券收到的现金净额	-	14,571,466.00
其他业务收入	8,000,955.06	6,857,272.70
营业外收入	3,422,742.66	4,246,030.35
收到的往来款项	284,759,971.75	52,993,583.53
合 计	296,183,669.47	886,636,882.10

41、 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期金额	上期金额
直接支付的费用	563,783,460.35	597,331,986.49
支付的开放式基金	1,567,162,288.63	1,276,197,634.21
支付投资者保护基金	50,910,202.61	58,836,407.22
支付的证券承销款净额	218,378,800.00	1,000,000,000.00
支付的融出资金	1,281,123,738.26	-
其他业务支出	12,776,418.81	305,642.66
营业外支出	5,744,831.36	3,651,282.79
支付的往来款	117,024,859.51	139,583,821.92
存出保证金本期净支付	42,833,398.40	15,146,184.26
其他	-	15,514,289.14
合 计	3,859,737,997.93	3,106,567,248.69

42、 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

项 目	本期金额	上期金额
1、将净利润调节为经营活动的现金流量		
净利润	1,155,224,349.64	1,442,520,757.85
加：计提的资产减值准备	-580,107.75	-
固定资产折旧	101,063,847.48	84,736,490.15
无形资产摊销	13,686,066.99	11,073,568.69
长期待摊费用摊销	42,281,224.86	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）	-16,760.97	-147,646.93
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	255,609.93	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	10,800,032.17	110,862,731.90
财务费用（收益以“-”号填列）	4,910,398.73	-
投资损失（收益以“-”号填列）	-403,915,858.38	-126,558,439.12
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-3,262,528.80	166,134,016.53
递延所得税负债的增加（减少以“-”号填列）	15,329,371.03	-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）	-3,931,406,971.18	-5,839,091,183.75
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-21,439,408,180.08	-8,927,979,288.44
其他	-69,676.53	-59,938.79
经营活动产生的现金流量净额	-24,435,109,182.86	-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	54,619,768,021.97	76,784,766,184.68
减：现金的年初余额	59,464,527,062.88	70,743,834,531.23
加：现金等价物的期末余额	4,546,980,345.36	7,902,629,172.07
减：现金等价物的年初余额	25,128,360,266.58	14,413,843,187.41
现金及现金等价物净增加额	-25,426,138,962.13	-470,282,361.89

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	本期金额	上期金额
一、现金	54,619,768,021.97	76,784,766,184.68
其中：库存现金	2,098,643.62	2,409,236.57
可随时用于支付的银行存款	54,603,051,718.17	76,660,553,798.45
可随时用于支付的其他货币资金	14,617,660.18	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	4,546,980,345.36	7,902,629,172.07

项 目	本期金额	上期金额
其中：三个月内到期的债券投资	-	-
三、现金及现金等价物余额	59,166,748,367.33	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、本公司的实际控制人情况

本公司的实际控制人为江苏省人民政府国有资产监督管理委员会。

2、本公司的子公司情况

(1) 子公司情况

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	98.00%	98.00%
华泰长城	100022258	广州	吴建党	金融	60,000	子公司	60.00%	60.00%
华泰（香港）公司	37387817-0 00-11-07-7	香港	张海波	金融	26,485	子公司	100.00%	100.00%
华泰紫金公司	67982047-7	南京	张海波	股权投资	50,000	子公司	100.00%	100.00%
华泰金控公司	56279815-7	深圳	宋洋洲	咨询	843	子公司的子 公司	100.00%	100.00%

(2) 子公司注册资本及其变化：

单位：人民币元

关联方名称	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
华泰联合证券	1,000,000,000.00			1,000,000,000.00
华泰长城	600,000,000.00			600,000,000.00
华泰（香港）公司	264,845,000.00			264,845,000.00
华泰紫金公司	500,000,000.00			500,000,000.00
华泰金控投资咨询（深圳）有限公司	1,277,010.00	7,152,750.78		8,429,760.78

3、本公司的合营及联营企业情况

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
南方基金管理有限公司	279533137	深圳	吴万善	基金管理	15,000	45%	45%
华泰柏瑞基金管理有限公司	71785177-7	上海	齐亮	基金管理	20,000	49%	49%

4、本公司的其他关联方情况

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 24.423%， 第一大股东	73572480-0
江苏交通控股有限公司	持有本公司股份 8.497%	13476706-3
江苏汇鸿国际集团有限公司	持有本公司股份 7.850%	13479189-9
江苏高科技投资集团有限公司	持有本公司股份 7.609%	13475957-3
国华能源投资有限公司	持有本公司股份 6.519%	71092159-2

关联方名称	与本公司关系	组织机构代码
江苏省丝绸集团有限公司	持有本公司股份 6.097%	13477712-2
江苏银行股份有限公司	公司持有其股份 7.03%	79654459-8
吴万善	公司董事长	-
潘剑秋	公司党委书记、董事	-
周易	公司总裁、董事	-
张海波	公司副总裁	-
齐亮	公司副总裁	-
孙含林	公司副总裁	-
吴祖芳	公司副总裁	-
张涛	公司副总裁	-
姜健	公司副总裁、董事会秘书	-
吴晓东	公司合规总监	-
舒本娥	公司计划财务部总经理	-

5、关联方交易

(1) 收取席位租金、交易佣金

单位：人民币万元

关联方名称	本期金额	上期金额
南方基金管理有限公司	524.27	631.28
华泰柏瑞基金管理有限公司	190.26	581.30
合计	714.53	1,212.58
占公司全部同类交易的金额比例	8.09%	22.84%

(2) 代买卖证券款余额

单位：人民币万元

关联方名称	期末余额	年初余额
南方基金管理有限公司	218.82	3.95
华泰柏瑞基金管理有限公司	42.24	150.36

(3) 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
南方基金管理有限公司	深成 ETF	1,030.00	1,241.70
	南方金砖	500.00	499.98
华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰柏瑞量化	300.00	299.99

关联方名称	年初余额		
	基金名称	持有份额（万份）	持有成本
南方基金管理有限公司	深成 ETF	1,000.00	1,224.99
	南方金砖	1,499.95	1,499.90
华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰柏瑞量化	300.00	299.99

(4) 与江苏银行股份有限公司发生的经常性关联交易

单位：人民币万元

项 目	本期金额	上期金额
存款利息	353.24	33.23

(5) 董事、监事及高管购买公司管理的理财产品的期末市值

单位：人民币万元

职 务	期末市值	期初市值
董事	111.26	114.59
其中：独立董事	-	-
监事	323.46	314.55
高管人员	1,067.34	1,102.38
合 计	1,502.06	1,531.51

(6) 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	年初余额
江苏省国信资产管理集团有限公司	应付房租款	320.09	320.09
南方基金管理有限公司	应收席位佣金	-	705.82
华泰柏瑞基金管理有限公司	应收席位佣金	-	175.43
江苏银行股份有限公司	存款	8,260.11	55,133.69

(7) 房屋租赁

单位：人民币万元

关联方名称	本期金额	上期金额
江苏省国信资产管理集团有限公司	98.28	127.80
合 计	98.28	127.80

主要系公司营业部租赁国信集团房屋，租赁价格按照第三方市场价格确定。

七、或有事项

截至报告日止，公司未决诉讼情况如下：

1、报告期内公司发生的重大诉讼、仲裁事项

2011 年 5 月，本公司收到上海市浦东新区人民法院开庭通知，上海钰霖投资咨询有限公司起诉我公司下属上海陆家嘴东路证券营业部，要求营业部支付服务费 4056149 元。经查，该纠纷起因于上海钰霖投资咨询有限公司不具备从事证券服务的资质，本公司营业部根据相关法律法规及监管机关的规定，终止了与其签订的服务协议，上海钰霖投资咨询有限公司遂诉诸法院。该纠纷尚在审理过程中。

2、公司以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项

2010 年 6 月，世纪证券有限责任公司以于 1995 年与本公司建立期货交易委托代理关系、向本公司交付了交易保证金为由，向南京市中级人民法院起诉，要求本公司返还所欠其期货交易保证金余额计人民币 5021800 元及相关利息共计 5157099 元。该纠纷尚在审理过程中。

3、控股子公司华泰联合证券有限责任公司报告期内发生的重大诉讼、仲裁事项

因北京华资银团集团一直未按协议履行对公司的还款义务，公司子公司华泰联合证券于 2011 年 1 月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计 3457.89 万元，2011 年 2 月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付欠款 2430 万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011 年 6 月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判，该案目前正在执行中。

4、控股子公司华泰联合证券有限责任公司以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项

(1) 与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案

华泰联合证券公司原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用公司资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出(2001)深中法经一初第315号民事判决书和(2002)深中法经一初第430号民事调解书。根据上述判决书和调解书,四通集团应分别偿还公司7,345万元及其利息和9,940万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效,两案正在执行中。对于另一案,公司于2008年6月向北京市高级人民法院提起诉讼,请求法院判令四通集团公司向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。该案于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,该案目前正在执行中。

(2) 与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限公司债权债务纠纷案

因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用公司营业部资金共3,720余万元,以及因它与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从公司三家营业部及华泰联合证券公司本部扣划现金共1,738万元,中国华诚集团财务有限责任公司拒不履行偿债义务,华泰联合证券公司于2003年12月向深圳市中级人民法院提起诉讼,要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司承担连带清偿责任。立案后,由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、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,该案一直处于中止审理阶段。2009年5月,法院裁定华诚投资管理有限公司进入破产清算程序,华泰联合证券公司已于2009年8月向破产清算组申报债权本息12598万元,但由于债权未经法院判决,债权待确认。2010年3月深圳中级人民法院恢复审理,一审判决结果支持公司全部诉讼请求,要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司连带支付公司5458.4万元,并承担诉讼费28.2万元,公司已就上述债权和诉讼费向华诚投资管理有限公司破产清算组申报破产债权。

(3) 与中国长城计算机集团公司债权债务纠纷案

中国长城计算机集团公司不履行与公司之间的合同义务,2008年11月,华泰联合证券公司向深圳市罗湖区法院起诉,请求法院处置变卖其所持公司的900万股股权(经2005年缩股后变更为270万股),将所得款项用于抵偿其对公司的所欠债务。2009年2月该案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。该案已于2009年7月开庭审理完毕,2009年8月,法院裁定中止审理。中止审理期间,双方至今就一直就相关事宜进行协商。

(4) 与北京北大方正集团公司债权债务纠纷案

北京北大方正集团公司不履行与公司之间的合同义务,华泰联合证券公司于2008年11月向深圳市罗湖区法院起诉,请求法院处置变卖其所持公司的900万股股权(经2005年缩股后变更为270万股),将所得款项用于抵偿其对公司的所欠债务。法院立案后,主持双方达成和解,并出具民事调解书确认对方对公司的全部债务。该案目前正在执行中。

(5) 与广州珠江实业集团有限公司债权债务纠纷案

广州珠江实业集团有限公司拖欠公司1500万元欠款,华泰联合证券公司于2008年12月向广州市越秀区人民法院起诉,请求法院判令其偿还公司所欠款项。法院立案后,主持双方达成和解,并出具民事调解书确认对方对公司的全部债务。该案目前正在执行中。上述5起纠纷案均为2004年以前发生的历史遗留事项,华泰联合证券公司已于以前年度全额计提了坏账准备。

(6) 与北京东阳影视实力文化传播有限公司资产管理纠纷案

2010年11月,华泰联合证券公司原定向资产管理业务客户北京东阳实力影视文化传播有限公司起诉公司,要求公司赔偿其资产管理账户亏损、返还业绩报酬并支付律师费成本,共计600.2万元。该案已由中国国际经济贸易仲裁委员会受理,并与2011年5月开庭完毕,待裁决中。鉴于目前无法确定该案判决结果,可能承担的义务也无法可靠计量,因此未在会计上做“预计负债”处理。

八、承诺事项

截止2011年6月30日,本公司无需要披露的重大承诺事项。

九、资产负债表日后非调整事项

截止报告日，本公司无需披露的资产负债表日后非调整事项。

十、其他重要事项

1、以公允价值计量的资产和负债：

项 目	年初余额	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	期末余额
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）	13,916,093,453.66	19,000,647.83			17,829,297,813.42
2.衍生金融资产		-29,800,680.00			-
3.可供出售金融资产	5,190,756,894.78		63,055,574.05		2,360,648,383.41
金融资产小计	19,106,850,348.44	-10,800,032.17	63,055,574.05	-	20,189,946,196.83
投资性房地产					
上述合计	19,106,850,348.44	-10,800,032.17	63,055,574.05	-	20,189,946,196.83
金融负债					96,685,483.06

2、外币金融资产和外币金融负债

项 目	年初余额	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	期末余额
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）	-	-	-	-	-
2.衍生金融资产	-	-	-	-	-
3.贷款和应收款	284,004,356.22	-	-	-	362,795,745.98
4.可供出售金融资产	-	-	-	-	-
5.持有至到期投资	-	-	-	-	-
金融资产小计	284,004,356.22	-	-	-	362,795,745.98
金融负债	-	-	-	-	-

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	期末余额		年初余额	
	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	3,947,930,713.14	6,138,722.66	3,638,930,713.14	6,138,722.66
按权益法核算的长期股权投资	1,064,238,033.18		1,083,665,900.97	
合 计	5,012,168,746.32	6,138,722.66	4,722,596,614.11	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	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
江苏银行股份有限公司	7.03%	1,300,000,000.00			1,300,000,000.00
华泰长城期货有限公司	60%	366,598,085.65			366,598,085.65
华泰金融控股（香港）有限公司	100%	264,845,000.00			264,845,000.00
华泰联合证券有限责任公司	98.00%	1,198,691,904.83			1,198,691,904.83
华泰紫金投资有限责任公司	100%	500,000,000.00			500,000,000.00
其他法人股投资		8,795,722.66	309,000,000.00		317,795,722.66
合 计		3,638,930,713.14	309,000,000.00	-	3,947,930,713.14

(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	年初余额	本期权益增减额	本期红利	本期转让	期末余额
南方基金管理有限公司	45.00%	892,711,991.61	107,776,639.31	135,000,000.00		865,488,630.92
华泰柏瑞基金管理有限公司	49.00%	190,953,909.36	7,795,492.90			198,749,402.26
合 计		1,083,665,900.97	115,572,132.21	135,000,000.00	-	1,064,238,033.18

(4) 长期股权投资减值准备

被投资单位名称	期末余额	本期增加	本期减少	年初余额	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	期末余额	年初余额
应收股利	135,000,000.00	
应收款项 [A]	77,822,529.84	105,078,866.29
在建工程	258,246,800.01	209,470,195.60
融出资金	2,145,630,787.88	864,507,049.62
其他流动资产	6,796,872.88	7,803,917.19
长期待摊费用	140,263,448.62	152,681,637.27
合 计	2,763,760,439.23	1,339,541,665.97

[A] 应收款项

(1) 分类情况

类 别	期末余额			年初余额		
	金额	比例	金额	比例	金额	比例
合同期内	56,703,448.39	55.59%	170,110.35	84,794,858.11	65.60%	254,384.57
超过合同期	45,273,605.97	44.38%	23,984,414.17	44,438,532.70	34.38%	23,900,139.95
无合同期	35,000.00	0.03%	35,000.00	35,000.00	0.03%	35,000.00
合 计	102,012,054.36	100.00%	24,189,524.52	129,268,390.81	100.00%	24,189,524.52

(2) 逾期应收款项明细列示

类 别	期末余额	年初余额
逾期买入返售证券		
其他逾期应收款	45,308,605.97	44,473,532.70
合 计	45,308,605.97	44,473,532.70

(3) 逾期应收款项账龄分析

账龄	期末余额		年初余额	
	金额	比例	金额	比例
1 年以内	-	-		
1-2 年	5,420,312.71	11.96%	6,216,689.72	13.98%
2-3 年	3,123,000.64	6.90%	887,892.53	2.00%
3 年以上	36,765,292.62	81.14%	37,368,950.45	84.03%
合 计	45,308,605.97	100.00%	44,473,532.70	100.00%

(4) 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
证券投资者保护基金	22,844,693.20	待弥补客户资金缺口
南京五星高能股份有限公司	5,580,000.00	往来款
中国太平洋保险（集团）股份有限公司	2,949,673.22	预付买房款
中保大厦有限公司物业管理分公司	1,302,311.13	租房押金
江苏省产权交易所	1,150,000.00	保证金
徐州市中级人民法院	1,121,000.00	往来款
合 计	34,947,677.55	

3、手续费及佣金净收入

项 目	本期金额	上期金额
手续费及佣金收入	2,196,391,548.83	2,374,917,959.52
——证券经纪业务	1,750,731,806.85	2,037,480,277.41
——证券承销业务	341,675,750.00	251,679,178.95
——证券保荐业务	12,000,000.00	25,560,000.00
——财务顾问业务	9,335,000.00	6,635,000.00
——受托客户资产管理业务	41,916,174.11	53,563,503.16
——融资融券代买卖证券业务	40,732,817.87	
手续费及佣金支出	460,851,092.47	465,292,246.69
——证券经纪业务手续费支出	448,364,323.03	458,483,090.14
——证券承销业务支出	3,345,811.75	5,314,826.82
——证券保荐业务支出	109,108.00	346,225.86
——财务顾问业务支出	308,731.91	797,538.00
——受托资产管理业务支出	328,684.19	350,565.87
——融资融券代买卖证券支出	8,394,433.59	-
手续费及佣金净收入	1,735,540,456.36	1,909,625,712.83

4、投资净收益

项 目	本期金额	上期金额
联营企业和合营企业的投资收益	76,022,497.62	126,055,869.15
从子公司取得的股利		
出售交易性金融资产的投资收益	-280,506,676.89	-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	-166,760,038.33	-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	253,141,816.55	92,308,403.25
可供出售金融资产持有期间取得的收益	9,385,398.06	
持有至到期投资持有期间取得的收益	114,500.00	
衍生金融工具的投资收益	218,532,263.95	
其 他		-2,896.34
合 计	109,929,760.96	-17,379,009.64

5、公允价值变动净收益

项 目	本期金额	上期金额
交易性金融资产公允价值变动收益	15,947,635.92	-176,173,341.41
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	-29,800,680.00	4,008,240.00
合 计	-13,853,044.08	-172,165,101.41

6、现金流量表补充资料

项 目	本期金额	上期金额
1、将净利润调节为经营活动的现金流量		
净利润	872,546,763.21	900,102,982.19
加：计提的资产减值准备	-	-
固定资产折旧	73,776,799.07	61,999,667.95
无形资产摊销	7,094,463.13	7,517,346.42
长期待摊费用摊销	26,033,159.15	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）	-79,709.38	-
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	243,509.93	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	13,853,044.08	172,165,101.41
财务费用（收益以“-”号填列）		-
投资损失（收益以“-”号填列）	-346,147,644.09	-126,055,869.15
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-3,262,528.80	166,134,016.53
递延所得税负债的增加（减少以“-”号填列）	15,329,371.03	-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）	-1,482,280,562.23	-5,525,720,111.44
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-18,089,352,862.92	-3,356,914,713.96
其他		-
经营活动产生的现金流量净额	-18,912,246,197.82	-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		-

项 目	本期金额	上期金额
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	37,820,424,106.98	53,983,172,510.73
减：现金的年初余额	41,196,494,791.95	45,044,299,706.56
加：现金等价物的期末余额	3,882,292,664.41	9,686,601,029.30
减：现金等价物的年初余额	20,384,685,838.37	13,652,691,591.21
现金及现金等价物净增加额	-19,878,463,858.93	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	本期金额	上期金额
非流动资产处置损益	-238,848.96	312,997.12
其他营业外收支净额	-2,167,545.30	-1,752,872.83
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
扣除所得税前非经常性损益合计	-2,406,394.26	-1,439,875.71
减：所得税影响金额	-615,885.16	-338,487.34
少数股东权益影响额	18,478.79	-53,718.80
扣除企业所得税及少数股东权益后的非经常性损益	-1,808,987.89	-1,047,669.57

2、受托资产管理业务

(1) 截止 2011 年 6 月 30 日，公司所管理的受托资产管理计划情况如下： 单位：人民币元

计划名称	成立时间	资产市值	计划份额（份）	计划单位净值
集合资产管理计划				
华泰紫金 1 号[注 1]	2005.12.6	315,974,673.44	289,184,229.11	1.09
华泰紫金 2 号[注 1]	2006.8.7	967,909,155.99	864,252,897.96	1.12
华泰紫金 3 号	2007.3.6	1,057,348,032.18	945,334,300.86	1.12
华泰紫金鼎步步为盈子计划	2008.10.27	255,667,590.14	226,200,608.26	1.13
华泰紫金鼎锦上添花子计划	2009.3.19	190,811,769.66	200,088,302.58	0.95
华泰紫金鼎造福桑梓子计划	2008.10.27	207,555,142.78	199,444,793.32	1.04
华泰紫金优债精选	2009.5.12	539,157,158.68	547,518,626.37	0.98
华泰紫金现金管家	2009.8.25	306,566,235.92	298,359,572.10	1.03
华泰紫金策略优选	2010.2.9	106,574,693.17	104,682,400.80	1.02
华泰紫金智富	2010.7.8	101,164,803.10	88,293,087.49	1.15
华泰紫金周期轮动[注 1]	2010.9.27	1,272,535,077.63	1,495,267,847.69	0.85
华泰紫金新兴产业	2011.6.20	1,009,527,623.81	1,005,833,753.52	1.00
华泰紫金龙-大中华	2011.2.15	96,709,060.93	101,860,728.93	0.95
合 计		6,427,501,017.43		
定向资产管理业务[注 2]		260,378,489.40		

[注 1]公司在其管理的紫金 1 号、紫金 2 号及紫金周期轮动计划成立时分别持有 22,893,412.29 份、

100,000,000.00 份及 70,703,078.03 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定项资产管理业务。

(2) 资产管理计划业务简表

资产项目	期末余额	年初余额	负债项目	期末余额	年初余额
受托管理资金存款	1,956,769,931.64	2,022,072,099.38	受托管理资金	6,427,501,017.43	9,506,062,281.47
客户结算备付金	21,313,482.01	97,233,310.35	应付款项	408,378,753.93	74,621,550.45
应收款项	502,478,649.76	2,598,912,310.24			
受托投资	4,355,317,707.95	4,862,466,111.95			
其中：投资成本	4,470,465,702.59	4,814,792,461.99			
已实现未结算损益	-115,147,994.64	47,673,649.96			
合计	6,835,879,771.36	9,580,683,831.92	合计	6,835,879,771.36	9,580,683,831.92

3、主要会计报表项目的异常情况及原因

单位：人民币万元

资产负债表项目	期末余额	年初余额	增减 (%)	主要原因
结算备付金	454,698.03	2,512,836.03	-81.90%	在登记公司缴存的客户结算资金减少
买入返售金融资产	113,417.27	25,121.02	351.48%	期末买入返售证券增加
应收利息	3,786.04	1,990.91	90.17%	定期存款利息增加
可供出售金融资产	236,064.84	519,075.69	-54.52%	可供出售金融资产中股票投资大幅减少
其他资产	345,424.45	196,554.80	75.74%	融出资金增加以及在建设工程投入增加
交易性金融负债	9,668.55	-	0.00%	系买断式回购业务形成的交易性金融负债
卖出回购金融资产款	584,573.30	250,877.45	133.01%	本期卖出回购金融资产规模增加
代理承销证券款	3,727.12	25,565.00	-85.42%	期末尚未结算的代理承销证券款减少
应付利息	240.72	56.17	328.55%	本期增加应付卖出回购利息
递延所得税负债	3,680.89	6,188.44	-40.52%	公司可供出售金融资产公允价值减少导致应纳税暂时性差异确认的递延所得税负债减少
利润表项目	2011 年 1—6 月	2010 年 1—6 月	增减 (%)	主要原因
投资净收益	19,249.37	6,790.17	183.49%	主要系股指期货收益增加
公允价值变动净收益	-1,080.00	-11,086.27	-90.26%	公司部分交易性金融资产处置导致公允价值转回
营业外支出	821.34	627.24	30.94%	公司本期捐赠支出较前期增加
少数股东损益	1,164.92	2,217.31	-47.46%	子公司净利润减少导致少数股东损益减少
其他综合收益	-4,645.33	-21,331.39	-78.22%	金融资产公允价值增加

华泰证券股份有限公司

2011年8月6日