

东吴证券股份有限公司

601555

2012 年半年度报告

目录

一、重要提示	1
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	7
七、证券公司信息披露.....	24
八、财务会计报告	25
九、备查文件	25

一、重要提示

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、准确性和完整性负个别及连带责任。

本报告经公司第一届董事会第二十八次会议、第一届监事会第七次会议审议通过，董事会会议应到董事 12 名，实到董事 12 名，没有董事、监事、高级管理人员声明对本报告内容的真实性、准确性和完整性无法保证或存在异议。

本公司半年度财务报告未经审计

公司负责人吴永敏先生、主管会计工作的负责人马震亚先生及会计机构负责人（会计主管人员）王菁女士声明：保证本半年度报告中财务报告的真实、完整。

本公司无对外担保情况、不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

二、公司基本情况

(一) 公司名称

公司法定中文名称： 东吴证券股份有限公司

公司中文名称缩写： 东吴证券

公司英文名称： Soochow Securities Co., Ltd.

(二) 公司法定代表人：吴永敏

(三) 联系人及联系方式

董事会秘书：魏纯

证券事务代表：余晓瑛

联系地址：江苏省苏州市工业园区翠园路181号

电 话：0512-62601555

传 真：0512-62938812

电子信箱：dwzqdb@gsjq.com.cn

(四) 公司地址

注册地址：苏州市工业园区翠园路181号

办公地址：苏州市工业园区翠园路181号

邮政编码：215028

公司国际互联网网址：<http://www.dwjq.com.cn/>

电子信箱：dwzqdb@gsjq.com.cn

(五) 信息披露及备置地点

公司选定的信息披露报纸名称：中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报

登载定期报告的中国证监会指定网站的网址：<http://www.sse.com.cn>

公司定期报告备置地点：苏州市工业园区翠园路181号公司董事会办公室

（六）公司股票简况

股票上市交易所：上海证券交易所

股票简称：东吴证券

股票代码：601555

（七）财务指标

1、主要会计数据和财务指标（合并报表）

单位：（人民币）元

项目	2012年6月30日	2011年12月31日	本报告期末比上年 度期末增减(%)
总资产	15,313,265,670.72	15,859,933,014.01	-3.45
归属于上市公司股东的所有者权益	7,385,664,465.31	7,389,743,705.05	-0.06
归属于上市公司股东的每股净资产（元/股）	3.69	3.69	0

项目	2012年1-6月	2011年1-6月	本报告期比上年 同期增减(%)
营业利润	186,983,084.38	294,760,275.96	-36.56
利润总额	189,403,001.47	303,039,713.09	-37.5
归属于上市公司股东的净利润	135,217,353.43	225,095,086.19	-39.93
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	133,531,218.57	218,893,084.99	-39
基本每股收益(元)	0.07	0.15	-53.33
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元)	0.07	0.15	-53.33
稀释每股收益(元)	0.07	0.15	-53.33
加权平均净资产收益率(%)	1.81	5.3	减少3.49个百分点
经营活动产生的现金流量净额	-1,345,323,179.04	-7,034,280,317.73	不适用
每股经营活动产生的现金流量净额（元）	-0.67	-4.69	不适用

2、非经常性损益项目和金额（合并报表）

单位：（人民币）元

非经常性损益项目	2012年1-6月
非流动资产处置损益	-51,159.11
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	2,698,296.00
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-227,219.80
所得税影响额	-604,979.27
少数股东权益影响额	-128,802.96
合计	1,686,134.86

三、股本变动及股东情况

(一) 股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

(二) 股东和实际控制人情况

1、报告期末股东总数：70,231 户。

2、报告期末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	报告期内增减	持有有限售条件股份数量	质押或冻结的股份数量	
苏州国际发展集团有限公司	国有法人	30.22	604,407,433	0	604,407,433		
苏州创业投资集团有限公司	国有法人	5.98	119,589,916	0	119,589,916		
苏州市营财投资集团公司	国有法人	3.23	64,578,554	0	64,578,554		
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	国有法人	3.09	61,832,770	0	61,832,770		
昆山市创业控股有限公司	国有法人	2.99	59,794,958	0	59,794,958		
苏州信托有限公司	国有法人	2.66	53,120,000	0	53,120,000		
全国社会保障基金理事会转持三户	国有法人	2.39	47,700,931	0	47,700,931		
江苏隆力奇集团有限公司	境内非国有法人	2.05	41,000,000	0	41,000,000	质押	41,000,000
苏州市相城区江南化纤集团有限公司	境内非国有法人	1.8	36,000,000	0	36,000,000	质押	36,000,000
吴江市东方国有资产经营有限公司	国有法人	1.79	35,876,975	0	35,876,975		

3、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的数量
华润深国投信托有限公司—福麟 1 号信托计划	19,694,559
中融国际信托有限公司-融金 37 号资金信托合同	12,289,604
中诚信托有限责任公司—中诚·金谷 1 号集合资金信托	12,108,300
兴业银行股份有限公司—万家和谐增长混合型证券投资基金	5,000,000
中融国际信托有限公司—中融增强 14 号	4,500,000
中国农业银行股份有限公司—新华优选成长股票型证券投资基金	4,200,000
国信证券—工行—国信“金理财”内需升级集合资产管理计划	4,149,635

中国银行—华宝兴业动力组合股票型证券投资基金	3,799,899
中国银行—嘉实沪深 300 指数证券投资基金	3,166,024
兴业国际信托有限公司—兴业天津<2008-4 号>	2,766,536

注：上述股份均为人民币普通股。

上述股东关联关系或一致行动的说明：

中融国际信托有限公司旗下有“融金 37 号资金信托合同”、“中融增强 14 号”两个产品合计持有公司 16,789,604 股。

公司未知其他上述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。

4、前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

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	苏州国际发展集团有限公司	604,407,433	2014 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定三十六个月
2	苏州创业投资集团有限公司	119,589,916	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月
3	苏州市营财投资集团公司	64,578,554	2014 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定三十六个月
4	苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	61,832,770	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月
5	昆山市创业控股有限公司	59,794,958	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月
6	苏州信托有限公司	53,120,000	2014 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定三十六个月
7	全国社会保障基金理事会转持三户	31,400,130	2014 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定三十六个月
		16,300,801	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月
8	江苏隆力奇集团有	41,000,000	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日

	限公司				起锁定十二个月
9	苏州市相城区江南化纤集团有限公司	36,000,000	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月
10	吴江市东方国有资产经营有限公司	35,876,975	2012 年 12 月 12 日	0	自上市之日起锁定十二个月

上述股东关联关系或一致行动人的说明：

公司第一大股东苏州国际发展集团有限公司和第三大股东苏州市营财投资集团公司、第六大股东苏州信托有限公司之间为存在控制关系的关联方。苏州国际发展集团有限公司持有苏州市营财投资集团公司 100% 的股权，同时持有苏州信托有限公司 70.01% 的股权，因此，苏州国际发展集团有限公司、苏州信托有限公司和苏州市营财投资集团公司为一致行动人。

公司第四大股东苏州工业园区国有资产控股发展有限公司持有公司第二大股东苏州创业投资集团有限公司 30% 的股权。

5、 本报告期内公司控股股东及实际控制人没有发生变更。

四、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 董事、监事和高级管理人员持股变动

报告期内公司董事、监事、高级管理人员均未持有公司股票，也未被授予过期权和限制性股票。报告期内持股未发生变化。

(二) 新聘或解聘公司董事、监事、高级管理人员的情况

1、报告期内，公司董事、监事未发生变更。

2、高级人员变更情况：

2012 年 3 月 13 日，公司第一届董事会第二十二次（临时）会议形成决议，同意公司董事长吴永敏先生辞去兼任的总裁职务，聘任范力先生为公司总裁，任期至本届董事会届满。

2012 年 5 月 14 日，公司第一届董事会第二十五次（临时）会议形成决议，聘任魏纯女士、孙中心先生为公司副总裁，任期至本届董事会届满。江苏证监局《关于核准孙中心证券

公司经理层高级管理人员任职资格的批复》（苏证监机构字〔2012〕212号），孙中心先生取得证券公司高级管理人员任职资格，其任职已于 2012 年 5 月 17 日生效。

五、董事会报告

（一）报告期内整体经营情况的讨论与分析

1、总体经营情况

2012 年上半年，全球各主要经济体增长明显放缓，工业生产反弹受挫，贸易继续走弱，消费趋向低迷。国内经济增长中枢下移，经历着企业去产能化、房地产去泡沫化、地方融资平台去杠杆化的痛苦考验。在此背景下，中国股市持续调整，交投日渐清淡。根据 WIND 数据，上半年 A 股成交额同比减少 29.2%，IPO 融资额同比减少 54.1%，债券融资额同比减少 61%。

面对极为困难的市场环境，公司以综合金融业务为抓手，齐心协力，积极推动创新转型。综合金融业务是公司根据自身资源优势，抢抓资本市场改革创新的历史性机遇，进一步深化根据地战略，经过慎重研究制定的重大战略举措。上半年，公司按照“缩短服务半径，扩大服务范围”的工作原则，以经纪业务转型为契机，全面推进综合金融业务，取得了突破性进展。6 月 8 日，公司承销的苏州华东镀膜玻璃有限公司 5000 万元中小企业私募债券实现全国首单发行、首单挂牌、首单转让。另外，公司还顺利获得债券质押式报价回购和融资融券业务资格，分别于 5 月下旬和 6 月中旬正式开始交易。

报告期内，公司各项业务平稳运行，总资产 153.13 亿元，归属母公司股东权益 73.86 亿元，实现营业收入 6.58 亿元，实现利润总额 1.89 亿元，归属母公司净利润 1.35 亿元。

2、主营业务及其经营情况

报告期内公司主营业务分业务情况表（合并报表）

单位：（人民币）万元

业务类别	营业收入	营业支出	营业利润率 (%)	营业收入比 上年同期增 减 (%)	营业支出 比上年同 期增减 (%)	营业利润率比上年同 期增减 (%)
------	------	------	--------------	-------------------------	-------------------------	----------------------

证券经纪业务	29835.62	21584.70	27.65	-36.56	-15.43	减少 18.08 个百分点
投资银行业务	4232.21	9535.42	-125.31	-86.50	-56.20	减少 155.88 个百分点
自营投资业务	16795.16	1840.11	89.04	179.59	33.25	增加 12.03 个百分点
资产管理业务	273.27	636.22	-132.82	-30.48	21.09	减少 99.16 个百分点
期货经纪业务	6613.87	4609.76	30.30	46.40	24.59	增加 12.2 个百分点

(1) 证券经纪业务

报告期内,公司累计实现 A 股和基金交易量 3098 亿元,经纪业务共实现收入 2.98 亿元,市占率 0.87%。公司加大营销推广力度,合理布局营销网点,积极拓展新的业务,深化客户服务。代销开放式基金及理财产品 59 只,完成南京分公司的筹建开业及淮安等五家营业部的筹建工作,完成 46 家营业部营销团队建设方案的审批,并落实相关管理制度。同时,积极进行轻型营业部的筹建规划,努力控制业务成本。

上半年,公司融资融券业务通过“两所一司”的联网测试,顺利通过中国证券业协会组织的专业评价,5 月份获得了中国证监会同意公司开展融资融券业务资格的批复。随着 5 月底公司融资融券业务系统的上线以及 6 月初信用账户开户工作的全面展开,标志着历时一年多的业务筹备工作划上了圆满的句号,迎来了融资融券业务正式开展的新时期。截止六月底,公司已有 38 家营业部可开展融资融券业务,总授信额度达 2.8 亿元。

围绕创新工作,公司积极争取债券质押式报价回购业务资格,5 月份正式开展业务试点,业务运行效果良好,至 7 月 10 日,试点范围扩大至所有营业部。

(2) 投行业务

受项目开发周期影响,上半年投行业务收入未得到充分体现。报告期内,顺利完成吴通通讯 IPO 项目发行,截止 6 月 30 日,共有两个 IPO 项目和一个再融资项目过会待发行。目前已报证监会 IPO 项目 10 个、增发项目 1 个,已报发改委债券项目 2 个,项目储备充足。

公司全力备战场外市场业务,上半年,已完成 3 家股改、1 家定向增资,新签项目 6 家,考察了台湾柜台交易市场及做市商制度,积极做好项目和技术储备。

报告期内,投行业务共实现收入 4232.21 万元。

(3) 投资业务

上半年,公司投资业务表现突出。投资坚持绝对收益原则,严格决策管理流程,有效控制系统风险,积极创新盈利模式,加强中长期固定收益类资产的投资管理,取得了显著的超额收益。报告期内,公司共实现投资业务收入 1.68 亿元。

(4) 资产管理业务

报告期内，公司资产管理业务在市场总体下滑的不利环境下，通过降低仓位，配置固定收益类产品等，有效规避投资风险；完成了新产品的推广发行；以创新大会为契机，积极研究和设计创新型产品，并大力推进通道性定向资产管理业务。

(5) 期货经纪业务

公司期货业务保持了平稳发展的势头，期货经纪业务上半年实现营业收入 6613.87 万元，同比增加 46.4%。报告期内，东吴期货实现白银期货顺利上市；积极筹备期货资产管理业务；同时大力推进信息技术建设和网点建设，业务创新步伐也开始提速。

3、比较式会计报表中主要项目变动幅度超过 30% 以上的情况及主要原因

(1) 资产负债表项目

单位：(人民币)元

资 产	2012. 6. 30	2011. 12. 31	增减 (%)	主要原因
交易性金融资产	2,432,809,666.00	1,147,492,741.22	112.01	交易性金融资产规模增加
买入返售金融资产	478,544,706.85	689,522,730.55	-30.60	期末买入返售证券减少
可供出售金融资产	1,878,913,012.22	216,550,831.70	767.65	根据债券收益率变化，母公司提前处置持有至到期债券投资，并将剩余债券重分类至可供出售金融资产；可供出售金融资产中的股票投资大幅增加
持有至到期投资	38,702,107.55	890,680,931.58	-95.65	提前处置持有至到期债权，并将剩余债券重分类至可供出售金融资产
长期股权投资	285,191,538.14	209,122,658.67	36.38	公司下属全资企业东吴创业投资有限公司对外投资增加及按权益法核算的东吴基金管理有限公司投资收益增加
递延所得税资产	15,648,489.67	41,504,693.24	-62.30	公允价值变动导致递延所得税资产减少
负 债	2012. 6. 30	2011. 12. 31	增减 (%)	主要原因
卖出回购金融资产款	964,908,675.41	718,950,000.00	34.21	卖出回购业务规模增加

代理承销证券款	-	5,000,000.00	-100.00	前期收到的代理承销证券款在本期支付
应付职工薪酬	83,398,648.97	153,433,874.43	-45.65	报告期内发放已计提的工资薪酬
应交税费	34,778,360.45	79,462,314.69	-56.23	报告期内已缴纳上期企业所得税
应付利息	827,108.88	2,235,738.33	-63.01	应付存款利息及卖出回购金融资产应付利息减少
递延所得税负债	6,820,770.76	74,996.25	8994.82	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

(2) 利润表项目:

单位: (人民币) 元

损 益	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	增减 (%)	主要原因
手续费及佣金净收入	357,098,467.38	777,509,686.42	-54.07	经纪及承销业务收入减少
其中:代理买卖证券业务净收入	308,666,414.03	460,398,443.18	-32.96	经纪业务收入减少
证券承销业务净收入	25,655,000.00	307,222,549.95	-91.65	承销业务收入减少
其他收入	18,901,893.84	5,368,953.41	252.06	财务顾问收入增加
利息净收入	116,773,796.69	66,226,380.74	76.33	存放金融同业利息收入及债券回购利息收入增加
公允价值变动收益	101,350,191.17	-35,829,098.13	-	交易性金融资产公允价值增加
汇兑收益	32,389.46	-182,061.35	-	汇率变动影响
其他业务收入	273,506.06	8,128,918.89	-96.64	报告期内子公司咨询管理费收入减少
营业税金及附加	26,149,253.65	48,613,749.95	-46.21	应税收入减少
营业外收入	3,034,296.01	8,992,921.74	-66.26	政府补助减少
所得税费用	50,225,613.32	76,402,590.27	-34.26	利润总额减少导致所得税费用减少
少数股东损益	3,960,034.72	1,542,036.63	156.81	子公司利润增加
其他综合收益	20,703,406.83	-3,923,250.51	-	可供出售金融资产变化所致

(3) 现金流量表项目:

单位: (人民币) 元

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	增减 (%)	主要原因
经营活动产生的现金流量净额	-1,345,323,179.04	-7,034,280,317.73	-	报告期内代买卖证券款净流出减少
投资活动产生的现金流量净额	-964,420,508.77	-474,974,083.23	-	报告期内配置可供出售金融资产及子公司对外投资

筹资活动产生的现金流量净额	-162,550,000.00	144,900,000.00	-212.18	增加所致
现金及现金等价物净增加额	-2,472,261,298.35	-7,364,536,462.31	-	上年同期发行次级债报告期内代买卖证券款净流出减少导致的经营活动现金流量净额增加

4、报告期内公司营业收入、营业利润的分部报告情况

(1) 报告期内公司营业收入地区分部情况表（合并口径）

单位：（人民币）元

地区	2012 年 1-6 月		2011 年 1-6 月		营业收入增减百分比 (%)
	营业部数量	营业收入	营业部数量	营业收入	
江苏省内	40	287,421,913.51	36	448,164,559.92	-35.87
江苏省外	25	35,654,988.51	24	49,950,954.84	-28.62
总部及子公司		334,471,821.94		423,826,685.72	-21.08
合计	65	657,548,723.96	60	921,942,200.48	-28.68

(2) 报告期内营业利润地区分部情况（合并口径）

单位：（人民币）元

地区	2012 年 1-6 月		2011 年 1-6 月		营业利润增减百分比 (%)
	营业部数量	营业利润	营业部数量	营业利润	
江苏省内	40	113,927,311.68	36	235,354,486.83	-51.59
江苏省外	25	-21,219,974.74	24	-10,044,914.87	111.25
总部及子公司		94,275,747.44		69,450,704.00	35.74
合计	65	186,983,084.38	60	294,760,275.96	-36.56

注：截止 2012 年 6 月 30 日证券公司所属营业部 53 家，期货公司所属营业部 12 家，合计营业部 65 家。

5、报告期内现金流情况

2012 年 1-6 月现金及现金等价物净减少额为 2,472,261,298.35 元，比上年同期减少 4,892,275,163.96 元，主要原因为：

(1) 经营活动产生现金流量净额为 -1,345,323,179.04 元，较上年同期减少 5,688,957,138.69 元，主要原因代买卖证券款净流出较上年同期减少了 4,509,957,031.44 元所致。

(2) 投资活动产生的现金流量净额为-964,420,508.77 元,较上年同期增加 489,446,425.54 元,主要原因是 2012 年 1-6 月配置可供出售金融资产及子公司对外投资增加所致。

(3) 筹资活动产生的现金流量净额为-162,550,000.00 元,较上年同期减少 -307,450,000.00 元,主要原因是公司上年同期发行次级债所致。

6、合并报表范围的变化情况:

单 位	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
东吴期货有限公司	是	是
东吴创业投资有限公司	是	是
东吴创新资本管理有限责任公司	是	不适用

7、主要参控股公司的经营情况

(1) 东吴创业投资有限公司

东吴创业投资有限公司,注册资本为 6 亿元人民币,为公司全资子公司,成立于 2010 年 1 月,其经营范围包括:创业投资业务;代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务;创业投资咨询业务;为创业企业提供创业管理服务业务;参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。

报告期内,东吴创投面对投资收益下降,项目竞争激烈的不利环境,及时改变投资节奏,积极积累项目资源,审慎研究投资方案。上半年,共完成 3 个项目投资,投资金额约 7000 万元。截至 2012 年 6 月 30 日,公司总资产 59,870.43 万元,净资产 59,893.64 万元,利润总额 14.18 万元,净利润 11.31 万元(未经审计)。

(2) 东吴期货有限公司

东吴期货有限公司,注册资本为 2 亿元人民币,本公司持有 74.5% 的股权,其经营范围包括:商品期货经纪,金融期货经纪,期货投资咨询(涉及行政许可的凭许可证经营)。

报告期内,东吴期货面对成交规模持续下降,行业竞争更加激烈的局面,全力开展工作,各项业务平稳发展。截至 2012 年 6 月 30 日,公司总资产 118,771.93 万元,净资产 23,292.11 万元,利润总额 2,071.46 万元,净利润 1,552.95 万元(未经审计)。

(3) 东吴基金管理有限公司

东吴基金管理有限公司，注册资本为 1 亿元人民币，公司持有 49%的股权，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可得其他业务。

报告期内，东吴基金顺应市场需求，积极开发稳健收益类产品，市场份额稳步提高。截至 2012 年 6 月 30 日，公司总资产 21,117 万元，净资产 18,399 万元，实现营业收入 7,453 万元，利润总额 1,659 万元，净利润 1,245 万元（未经审计）。

(4) 东吴创新资本管理有限公司

东吴创新资本管理有限责任公司，注册资本为 3 亿元人民币，为公司全资子公司，成立于 2012 年 6 月 14 日，经营范围为：项目投资、实业投资、股权投资，投资管理，投资信息咨询。

8、经营中的问题与对策

报告期内，公司经营中存在的问题主要表现在：上半年宏观经济下行，证券市场交易量萎缩，激烈的行业竞争导致经纪业务佣金率下滑成为常态，公司的经纪业务面临着巨大挑战；而投资银行项目单体收入下降，同时受项目周期的影响，业务收入出现显著下降；投资者日趋多元化的投资需求，给公司的业务提出了更高的要求；公司上市后，资本规模上了一个新台阶，但目前整体盈利水平与资本规模不相适应，公司盈利能力有待提高。当前外围市场仍存在巨大的不确定性，国内宏观经济复杂多变。整个行业的传统业务竞争激烈，而创新业务在自上而下的推动过程中才刚刚起步。公司在稳定传统业务、转型创新方面，仍将面临诸多的不确定性。

针对上述问题，公司主要采取以下对策：公司将继续坚持“稳健经营”的同时，抓住行业“转型创新”的机遇，增强经纪业务销售能力，积极改善公司经纪业务的客户结构，提高业务水平提供满足客户需求的财富管理服务；提高投行业务水平，加大对现有业务资源的开发，通过调整投行的项目结构，来熨平项目周期对收入的影响。围绕综合金融业务，把它作为创新转型的重要抓手，继续对公司业务模块进行梳理和整合，提高公司的整体协同效率和竞争力；同时以发展中小企业私募债和资产管理为重点，做大中小企业私募债的市场规模，注重资产管理业务转型；合理配置各类资产，做大公司资产池；努力做大子公司，增强分公司的盈利能力。通过以上措施，在稳定传统业务同时抓住行业转型创新的机会，丰富公司的

盈利模式，培养新的利润增长点，努力提高资本回报率。

（二）报告期内投资情况

1、截止 2012 年 6 月 30 日公司在建证券大厦正在履行的合同总额为 6.05 亿元，已支付工程建造款 2.54 亿元、土地使用权的款项 1.02 亿元。

2、报告期内公司的全资子公司东吴创业投资有限公司完成了 3 个股权投资项目，被投资的公司情况如下：

单位：（人民币）元

被投资公司名称	主要经营活动	本期投资金额	截止 2012 年 6 月 30 日占被投资公司权益的比例
四川华体灯业有限公司	生产、销售灯具、照明器具、通用电子产品、锥形钢制灯杆、钢制电杆	24,969,500.00	11.31%
厦门优传供应链有限公司	国际货物运输代理、国内货物运输代理、红酒进出口代理	30,000,000.00	10.39%
北京农信通科技有限公司	许可经营项目：第二类增值电信业务中的信息服务业务（不含固定网电话信息服务和互联网信息服务） 一般经营项目：技术开发、技术推广、技术转让、技术咨询、技术服务；销售计算机、软件及辅助设备、电子产品、机械设备、通讯设备。（未取得行政许可的项目除外）	15,000,000.00	13.04%
合计		69,969,500.00	

（三）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 2011 年募集的资金 318,028.76 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
扩大自营业务规模	150,000.00	2012.1-2012.3
补充子公司东吴创业投资有限责任公司资本金	30,000.00	2012.3
设立子公司东吴创新资本管理有限责任公司	30,000.00	2012.4
开展融资融券业务	68,028.76	2012.4-2012.6
开展其他创新业务	40,000.00	2012.5
合计	318,028.76	

截至报告期末，公司累计使用募集资金 318,028.76 万元，公司募集资金存储专户结余资金余额 1,152.91 万元。

公司募集资金承诺投资总额 314,984.88 万元，截至期末累计投入金额超出承诺投入总额 3,043.88 万元，投入进度 100.97%，原因是募集资金为专户管理使用，其超出使用部分为专户存储产生的利息收入。

报告期内，公司严格按照国家法律法规和证券监管部门的要求，遵循《东吴证券股份有限公司募集资金管理办法》、公司与有关各方签署的《募集资金专户存储三方监管协议》的规定，合法、合规、合理使用募集资金，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。

本公司在《招股说明书》中承诺的募资资金使用方向为用于增加公司资本金，扩展相关业务，未对募集资金到位后产生的效益进行预计。募集资金到位后，公司净资产进一步增加，为与净资产规模挂钩的业务发展拓展了空间。公司按照招股书承诺及公司实际情况，扩大了自营业务规模，拓展了融资融券业务及其他创新业务，并且补充了子公司资本金。募集资金增强了公司的资本实力并且推进各项业务的发展。

（四）报告期内现金分红政策的制定及执行情况

公司在《章程》中明确了利润分配政策、分配方式，并明确规定“公司每年以现金方式分配的利润不少于当年实现的可供分配利润的 30%。”并规定相关议案须经公司董事会审议后提交公司股东大会批准。2012 年上半年，公司根据决策程序，综合考虑投资者利益和公司长远发展，编制了 2011 年度利润分配方案。在经过公司董事会审议通过后，提请股东大会审议。公司独立董事对此发表明确意见，公司中小股东通过参加年度股东大会的方式对利润分配方案充分表达意见和诉求。

公司历来重视对股东的分红回报并兼顾公司的可持续发展，根据证监会《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》要求，公司将进一步完善利润分配的决策程序和机制，为独立董事尽职履责和中小股东充分表达诉求提供制度保障，充分维护中小股东的利益。公司已着手对公司章程的相关条款进行修订，切实落实现金分红的各项工作。

六、重要事项

（一）公司治理情况

1、公司治理

报告期内，公司严格遵循《公司法》、《证券法》、《证券公司治理准则（试行）》、《上市公司治理准则》、《上海证券交易所股票上市规则》等法律法规和规范性文件的有关规定，不断加强和完善公司治理。报告期内，公司按照上市公司的相关要求，修订了《公司章程》，制定了《东吴证券年报信息披露重大差错责任追究制度》，进一步健全了公司治理规章制度。同时，公司不断完善法人治理结构，规范公司运作，强化了公司在治理层面上的有效控制。公司各个治理层面各司其职、相互制衡，确保了公司规范运作，有效的保护了股东权益。

报告期内，公司凭借规范的公司治理、稳健的管理运作和积极回报社会的责任感，被苏州市政府评选为“服务企业上市先进单位”，获评21世纪经济报道“2011年度最佳投资者教育证券公司”；公司领导班子被江苏省委组织部、江苏省国资委党委评为“江苏省国有企业“四好”领导班子。

2、内部控制规范实施进展情况

为贯彻实施中国证监会、财政部等五部委联合颁布的《企业内部控制基本规范》及其配套指引，根据《关于做好江苏上市公司实施内部控制规范有关工作的通知》（苏证监公司字[2012]101号）要求，公司制定了《东吴证券股份有限公司内部控制规范实施工作方案》（以下简称“方案”），并经一届二十三次（临时）董事会审议通过。根据《方案》的时间进度安排，先后开展了内控规范建设动员、内控制度培训、内控咨询机构选聘、风险清单编制等工作。

（二）报告期实施的利润分配方案执行情况

公司2011年年度股东大会审议通过了《公司2011年度利润分配方案》，以20亿股为基数，向全体股东每10股派发现金红利0.8元（含税），扣税后每10股派发现金红利0.72元，共计派发股利160,000,000元（含税）。公司于2012年6月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站刊登了公司2011年年度利润分配实施公告，股权登记日2012年6月20日，除息日2012年6月21日，现金红利发放日2012年6月28日。公司2011年年度利润分配方案已实施完毕。

(三) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

公司 2012 年半年度未拟定利润分配预案、公积金转增股本预案。

(四) 重大诉讼仲裁事项

本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项，无以前期间发生、持续到报告期的重大诉讼、仲裁事项。

(五) 本报告期公司无破产重整相关事项。

(六) 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

单位：（人民币）元

序号	证券品种	证券代码	证券简称	初始投资金额	持有数量	期末账面价值	占期末证券总投资比例	报告期损益
1	股票	300215	电科院	113,295,675.52	5,842,882.00	100,789,714.50	23.64%	11,472,875.50
2	股票	000568	泸州老窖	95,103,023.91	2,200,075.00	93,085,173.25	21.83%	14,985,527.45
3	股票	600256	广汇能源	59,255,540.54	3,882,044.00	52,291,132.68	12.27%	-6,987,269.09
4	股票	600527	江南高纤	44,352,491.32	10,228,000.00	39,889,200.00	9.36%	-3,942,306.01
5	股票	600657	信达地产	22,807,723.68	4,957,046.00	21,959,713.78	5.15%	-550,587.14
6	股票	300333	兆日科技	16,100,000.00	700,000.00	18,697,000.00	4.39%	2,597,000.00
7	股票	300334	津膜科技	17,619,000.00	1,050,000.00	17,619,000.00	4.13%	0
8	可转债	113002	工行转债	13,326,642.10	120,000.00	13,134,000.00	3.08%	-236,148.00
9	股票	002677	浙江美大	11,520,000.00	1,200,000.00	11,292,000.00	2.65%	1,735,942.47
10	股票	600063	皖维高新	10,754,962.30	3,776,000.00	10,535,040.00	2.47%	579,270.83
			期末持有的其他证券投资	56,295,704.59	4,776,242.00	47,050,507.65	11.03%	41,598,590.32
			报告期已出售证券投资损益					-17,924,628.58
			合计	460,430,763.96	38,732,289.00	426,342,481.86	100.00%	43,328,267.75

注：(1) 本表要求按期末账面价值占公司期末证券投资总额的比例排序，填列公司期末所持前十只证券情况；

(2) 本表所述证券投资是指股票、权证、可转换债券等投资。其中，股票投资指在交易性金融资产中核算的部分；

(3) 其他证券投资指：除前十只证券以外的其他证券投资；

(4) 报告期损益，包括报告期公司因持有该证券取得的投资收益及公允价值变动损益。

2、 持有其他上市公司股权情况

单位：（人民币）元

证券代码	证券简称	最初投资成本	占该公司股权比例	期末账面价值	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
600016	民生银行	79,480,242.32	0.04%	75,526,113.00	3,782,610.00	-3,954,129.32	可供出售金融资产	购买
601398	工商银行	59,631,129.16	0.00%	54,623,621.75	0	-5,007,507.41	可供出售金融资产	购买
601939	建设银行	58,605,019.47	0.00%	52,096,266.60	1250011.75	-6,508,752.87	可供出售金融资产	购买
600000	浦发银行	53,873,852.49	0.03%	48,780,000.00	1800000	-5,093,852.49	可供出售金融资产	购买
600015	华夏银行	54,959,996.47	0.07%	47,350,445.09	0	-7,609,551.38	可供出售金融资产	购买
600063	皖维高新	42,937,500.00	1.00%	41,850,000.00	5165801.39	15,112,500.00	可供出售金融资产	参与定向增发
600048	保利地产	19,456,371.91	0.03%	24,435,772.20	339131.97	4,979,400.29	可供出售金融资产	购买
000562	宏源证券	19,107,727.86	0.07%	22,517,506.38	0	3,409,778.52	可供出售金融资产	购买
601601	中国太保	19,758,982.99	0.01%	21,818,665.62	344298.15	2,059,682.63	可供出售金融资产	购买
002664	信质电机	17,600,000.00	0.82%	21,230,000.00	0	3,630,000.00	可供出售金融资产	新股申购
其他		325,449,486.23		321,288,267.37	-2,613,187.50	13,522,523.58	可供出售金融资产	购买
合计		750,860,308.90	/	731,516,658.01	10,068,665.76	14,540,091.55	/	/

注：(1) 本表填列公司在长期股权投资、可供出售金融资产中核算的持有其他上市公司股权情况；

(2) 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。

3、持有非上市金融企业股权情况

单位：（人民币）元

所持对象名称	最初投资成本（元）	持有数量（股）	占该公司股权比例	期末账面价值（元）	报告期损益（元）	报告期所有者权益变动（元）	会计核算科目	股份来源
东吴基金管理有限公司	49,000,000.00	—	49%	90,153,086.55	6,100,528.18	0	长期股权投资	出资认购
江苏银行股份有限公司	5,225,180.00	—	0.08%	5,225,180.00	602,285.44	0	长期股权投资	出资认购

合计	54,225,180.00	/	95,378,266.55	6,702,813.62	/	/
----	---------------	---	---------------	--------------	---	---

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。

(七) 本报告期公司无收购及出售资产、吸收合并事项。

(八) 重大关联交易

本报告期公司无重大关联交易事项。

(九) 重大合同及其履行情况

1、本报告期公司无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

2、本报告期公司无担保事项。

3、本报告期公司无委托理财事项。

4、本报告期公司无其他重大合同。

(十) 承诺事项履行情况

1、公司 5%以上股东对所持股份自愿锁定的承诺

苏州国际发展集团有限公司承诺在公司股份上市后 36 个月内，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。

苏州创业投资集团有限公司承诺在公司股份上市后 12 个月内，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。

2、公司控股股东对避免同业竞争的承诺

苏州国际发展集团有限公司出具了《有关消除或避免同业竞争的承诺函》，承诺苏州国际发展集团有限公司及其附属公司、参股公司：将不会在中国境内单独或与他人，以任何形式（包括但不限于投资、并购、联营、合资、合作、合伙、承包或租赁经营、购买上市公司股票或参股）直接或间接从事或参与或协助从事或参与任何与前述本公司开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务或活动。目前及将来不会利用在发行人的控股股东地位，损害

发行人及其他发行人股东的利益。

在报告期内或者持续到报告期内，上述承诺都得到履行。

（十一）聘任会计师事务所情况

江苏公证天业会计师事务所有限公司为公司2011年度审计机构，审计费用为75万元。至2011年，该事务所已连续12年为公司提供审计服务，服务年限已满。2012年5月15日，公司2011年年度股东大会审议通过了《关于外聘审计机构的议案》，聘请天衡会计师事务所有限公司为公司2012年度审计机构，对公司财务状况和内部控制进行审计，聘期一年，审计费用80万。

（十二）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。

（十三）其他重大事项的说明

1、业务资格事项

2012年4月26日，根据中国证监会《关于东吴证券股份有限公司从事债券质押式报价回购业务试点方案》的无异议函，同意公司开展债券质押式报价回购业务试点。

2012年5月4日，根据中国证监会《关于核准东吴证券股份有限公司融资融券业务资格的批复》（证监许可〔2012〕604号），核准公司变更业务范围，增加融资融券业务。公司已完成章程变更及工商登记，并取得了新的营业执照及经营业务许可证。

2012年6月1日，根据中证协《关于反馈证券公司中小企业私募债券承销业务试点实施方案专业评价结果的函》，公司获得中小企业私募债券承销业务试点资格。

2、东吴创业投资有限公司增资事项

2012年1月18日，公司第一届董事会第二十一（临时）会议通过了《关于对直投子公司增资的议案》，同意公司对全资直投子公司东吴创业投资有限公司增资人民币三亿元。东吴创业投资有限公司已于2012年3月28日完成增资相关事宜及工商变更登记，注册资本增加至人民币六亿元。

3、设立东吴创新资本管理有限责任公司事项

2012 年 3 月 29 日，公司第一届董事会第二十三次（临时）会议通过了《关于设立另类投资子公司的议案》，同意公司设立全资子公司，注册资本为 3 亿元人民币。2012 年 6 月 14 日，该全资子公司的工商登记手续已办理完毕，并领取了营业执照。子公司名称：东吴创新资本管理有限责任公司；注册资本：3 亿元；经营范围：项目投资、实业投资、股权投资，投资管理，投资信息咨询服务。

4、设立南京分公司事项

2011 年 7 月 13 日，根据中国证监会《关于核准东吴证券股份有限公司在江苏设立 1 家分公司的批复》（证监许可[2011]1083 号），公司获准设立东吴证券股份有限公司南京分公司，管理江苏（苏州除外）的证券营业部。2012 年 1 月，南京分公司取得了营业执照及经营业务许可证，正式营业。

5、证券营业部新设、迁址事项

2011 年 12 月 30 日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司在徐州等地设立 5 家证券营业部的批复》（苏证监机构字[2011]682 号），公司获准在江苏省南京市栖霞区、江苏省徐州市铜山区、江苏省淮安市清浦区、江苏省姜堰市、云南省瑞丽市各设立 1 家证券营业部，证券营业部的营业范围为证券经纪业务。截至本报告期末，上述五家营业部已正常营业。

2012 年 2 月 13 日，根据云南证监局文件《云南证监局关于同意东吴证券股份有限公司昆明春城路证券营业部搬迁开业的通知》（云证监〔2012〕44 号），核准公司昆明拓东路营业部同城迁址并更名为“东吴证券股份有限公司昆明春城路证券营业部”。截至报告期末，该营业部已在新址正常营业。

（十四）信息披露索引

报告期内，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
东吴证券关于南京分公司获准开业的公告	中国证券报 B003、上海证券报 B47、证券日报 E2、证券时报 D17	2012-1-6	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于新设 5 家证券营业部获批的公告	中国证券报 B010、上海证券报 31、证券日报 C1、	2012-1-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn

证券时报 B5			
东吴证券关于 2011 年 12 月财务数据、2011 年度业绩预告和净资产变化的公告	中国证券报 B015、上海证券报 B20、证券日报 E1、证券时报 A12	2012-1-12	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度业绩快报	中国证券报 B032、上海证券报 B37、证券日报 A3、证券时报 D13	2012-1-17	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十一次（临时）会议决议公告	中国证券报 B085、上海证券报 B4、证券日报 E7、证券时报 D24	2012-1-19	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券公司章程		2012-2-1	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2012 年 1 月财务数据简报		2012-2-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2012 年 2 月财务数据简报		2012-3-6	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于首次公开发行网下配售股票上市流通的提示性公告	中国证券报 B006、上海证券报 B34、证券日报 C3、证券时报 A4	2012-3-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十二次（临时）会议决议公告	中国证券报 A22、上海证券报 B19、证券日报 E2、证券时报 D13	2012-3-14	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十三次（临时）会议决议公告	中国证券报 B295、上海证券报 B31、证券日报 E61、证券时报 D24	2012-3-30	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券内部控制规范实施工作方案		2012-3-30	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券年报信息披露重大差错责任追究制度		2012-3-30	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2012 年 3 月财务数据简报		2012-4-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券股票交易异常波动公告	中国证券报 A16、上海证券报 176、证券日报 E8、证券时报 C8	2012-4-23	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券年报摘要	中国证券报 B056、上海证券报 B20、证券日报 E27、证券时报 D125	2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券年报		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届监事会第六次会议决议公告	中国证券报 B056、上海证券报 B21、证券日报 E27、证券时报 D125	2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn

东吴证券第一季度季报	中国证券报 B056 、上海 证券报 B20、证券日报 E27、证券时报 D126	2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度募集资金存放与使用情况的专项报告		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券控股股东及其他关联方占用资金情况的专项说明		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于召开 2011 年年度股东大会的通知		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度独立董事述职报告		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度社会责任报告		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券内部控制鉴证报告		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度内部控制评价报告		2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十四次会议决议公告	中国证券报 B056 、上海 证券报 B21、证券日报 E28、证券时报 D126	2012-4-24	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于获得债券质押式报价回购业务试点资格的公告	中国证券报 A20 、上海 证券报 22、证券日报 B4、 证券时报 C12	2012-5-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2012 年 4 月财务数据简报		2012-5-8	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年度股东大会会议材料		2012-5-8	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于融资融券业务资格获批的公告	中国证券报 B002 、上海 证券报 B21、证券日报 E1、证券时报 D21	2012-5-10	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年年度股东大会决议公告	中国证券报 B017 、上海 证券报 B34、证券日报 E5、证券时报 D20	2012-5-16	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十五次（临时）会议决议公告	中国证券报 B017 、上海 证券报 B34、证券日报 E5、证券时报 D20	2012-5-16	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2011 年年度股东大会的法律意见书		2012-5-16	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券第一届董事会第二十六次（临时）会议决议公告	中国证券报 B006 、上海 证券报 B40、证券日报 E2、证券时报 D21	2012-5-29	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券 2012 年 5 月财务数据简报		2012-6-7	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn

东吴证券 2011 年度利润分配实施公告	中国证券报 A37 、上海 证券报 B17、证券日报 B4、证券时报 D17	2012-6-15	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn
东吴证券关于全资子公司“东吴创新 资本管理有限责任公司”成立的公告	中国证券报 B024 、上海 证券报 B22、证券日报 D4、证券时报 D9	2012-6-19	上海证券交易所网站 http://www.sse.com.cn

七、证券公司信息披露

(一) 公司重大行政许可事项的相关情况

时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
2012-2-13	云南证监局关于同意东吴证券股份有限公司昆明春城 路证券营业部搬迁开业的通知	云证监（2012）44 号
2012-3-12	关于段万强证券公司分支机构负责人任职资格的批复	海南证监许可（2012）2 号
2012-3-29	关于范力任职东吴证券总裁的无异议函	苏证监函[2012]117 号
2012-4-12	关于李友林证券公司分支机构负责人任职资格的批复	苏证监机构字（2012）142 号
2012-4-12	关于张峰证券公司分支机构负责人任职资格的批复	苏证监机构字（2012）143 号
2012-4-12	关于俞民良证券公司分支机构负责人任职资格的批复	苏证监机构字（2012）144 号
2012-4-26	关于东吴证券股份有限公司从事债券质押式报价回购 业务试点方案的无异议函	机构部部函（2012）206 号
2012-5-4	关于核准东吴证券股份有限公司融资融券业务资格的 批复	证监许可（2012）604 号
2012-5-13	关于东吴证券苏州竹辉路等三家证券营业部开展中间 介绍业务验收意见的函	苏证监函[2012]173 号
2012-5-17	关于卞爱亮证券公司分支机构负责人任职资格的批复	苏证监机构字（2012）211 号
2012-5-17	关于核准孙中心证券公司 经理层高级管理人员任职资格的批复	苏证监机构字（2012）212 号
2012-5-28	云南证监局关于庾晓辉证券公司分支机构负责人任职 资格的批复	云证监机构字（2012）14 号
2012-6-1	关于反馈证券公司中小企业私募债券承销业务试点实 施方案专业评价结果的函	中证协函（2012）373 号

(二) 监管部门对公司的分类结果

公司 2012 年分类评价结果为 B 类 BBB 级

八、财务会计报告

- (一) 财务报表（附后）
- (二) 财务报表附注（附后）

九、备查文件

- (一) 载有法定代表人签名的半年度报告文本；
- (二) 载有法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文；
- (三) 公司章程；
- (四) 其他有关资料。

东吴证券股份有限公司

董事长：吴永敏

合并资产负债表 (未经审计)

2012年6月30日

编制单位: 东吴证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

资 产	附注	2012.06.30	2011.12.31	负债和所有者权益	附注	2012.06.30	2011.12.31
资产:				负债:			
货币资金	5.01	8,103,064,158.31	10,432,381,715.26	短期借款			
其中: 客户资金存款		5,529,431,048.48	5,966,320,103.51	其中: 质押借款			
结算备付金	5.02	608,187,892.18	751,131,633.58	拆入资金			
其中: 客户备付金		516,407,262.59	703,280,610.99	交易性金融负债			
拆出资金				衍生金融负债			
交易性金融资产	5.03	2,432,809,666.00	1,147,492,741.22	卖出回购金融资产款	5.16	964,908,675.41	718,950,000.00
衍生金融资产	5.04			代理买卖证券款	5.17	6,681,241,854.10	7,369,446,030.72
买入返售金融资产	5.05	478,544,706.85	689,522,730.55	代理承销证券款	5.18	-	5,000,000.00
应收利息	5.06	53,282,061.32	60,941,129.50	应付职工薪酬	5.19	83,398,648.97	153,433,874.43
存出保证金	5.07	676,937,380.20	785,720,064.78	应交税费	5.20	34,778,360.45	79,462,314.69
可供出售金融资产	5.08	1,878,913,012.22	216,550,831.70	应付利息	5.21	827,108.88	2,235,738.33
持有至到期投资	5.09	38,702,107.55	890,680,931.58	预计负债			
长期股权投资	5.10	285,191,538.14	209,122,658.67	长期借款			
投资性房地产				应付债券			
固定资产	5.11	473,072,386.39	378,429,033.50	递延所得税负债	5.13	6,820,770.76	74,996.25
无形资产	5.12	115,314,373.75	117,596,818.83	其他负债	5.22	96,230,907.17	83,601,509.59
其中: 交易席位费		273,179.71	639,376.47	负债合计		7,868,206,325.74	8,412,204,464.01
递延所得税资产	5.13	15,648,489.67	41,504,693.24	所有者权益 (或股东权益)			
其他资产	5.14	153,597,898.14	138,858,031.60	实收资本 (或股本)	5.23	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
				资本公积	5.24	4,260,837,352.76	4,240,133,945.93
				减: 库存股			
				盈余公积	5.25	103,449,266.62	103,449,266.62
				一般风险准备	5.26	234,446,692.74	234,446,692.74
				交易风险准备	5.27	218,282,739.32	218,282,739.32
				未分配利润	5.28	568,648,413.87	593,431,060.44
				外币报表折算差额			
				归属于母公司股东权益合计		7,385,664,465.31	7,389,743,705.05
				少数股东权益	5.29	59,394,879.67	57,984,844.95
				所有者权益合计		7,445,059,344.98	7,447,728,550.00
资产总计		15,313,265,670.72	15,859,933,014.01	负债和所有者权益合计		15,313,265,670.72	15,859,933,014.01

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人: 吴永敏

主管会计工作负责人: 马耀亚

会计机构负责人: 王菁

母公司资产负债表 (未经审计)

2012年6月30日

编制单位: 东吴证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

资 产	附注	2012.06.30	2011.12.31	负债和所有者权益	附注	2012.06.30	2011.12.31
资产:				负债:			
货币资金		6,814,690,939.01	9,773,354,539.86	短期借款			
其中: 客户资金存款		5,103,137,765.76	5,646,789,062.60	其中: 质押借款			
结算备付金		645,479,771.36	758,156,746.63	拆入资金			
其中: 客户备付金		553,699,141.77	710,305,724.04	交易性金融负债			
拆出资金				衍生金融负债			
交易性金融资产		2,407,717,631.89	1,135,446,487.79	卖出回购金融资产款		964,908,675.41	718,950,000.00
衍生金融资产				代理买卖证券款		5,795,775,901.28	6,509,305,124.89
买入返售金融资产		478,544,706.85	689,522,730.55	代理承销证券款		-	5,000,000.00
应收利息		50,702,326.25	59,635,822.39	应付职工薪酬		77,878,399.19	144,432,466.89
存出保证金		154,234,454.52	210,059,785.91	应交税费		34,077,359.18	73,696,287.49
可供出售金融资产		1,878,913,012.22	216,550,831.70	应付利息		827,108.88	2,235,738.33
持有至到期投资		-	851,802,976.63	预计负债			
长期股权投资	12.01	1,151,828,266.55	545,727,738.37	长期借款			
投资性房地产				应付债券			
固定资产		466,972,896.31	371,300,578.86	递延所得税负债		6,812,964.88	74,996.25
无形资产		113,792,096.86	115,825,774.77	其他负债		74,832,400.08	68,960,579.08
其中: 交易席位费		273,179.71	639,376.47	负债合计		6,955,112,808.90	7,522,655,192.93
递延所得税资产		14,221,690.28	38,964,709.89	所有者权益 (或股东权益)			
其他资产	12.02	139,725,524.38	126,278,075.86	实收资本 (或股本)		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
				资本公积		4,260,351,448.20	4,239,648,041.37
				减: 库存股			
				盈余公积		103,449,266.62	103,449,266.62
				一般风险准备		234,446,692.74	234,446,692.74
				交易风险准备		218,282,739.32	218,282,739.32
				未分配利润		545,180,360.70	574,144,866.23
				外币报表折算差额			
				所有者权益合计		7,361,710,507.58	7,369,971,606.28
资产总计		14,316,823,316.48	14,892,626,799.21	负债和所有者权益合计		14,316,823,316.48	14,892,626,799.21

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人: 吴永敏

主管会计工作负责人: 马霞亚

会计机构负责人: 王菁

合并利润表（未经审计）

2012年1-6月

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注	本期数	上年同期数
一、营业收入		657,548,723.96	921,942,200.48
手续费及佣金净收入	5.30	357,098,467.38	777,509,686.42
其中：代理买卖证券业务净收入		308,666,414.03	460,398,443.18
其中：经纪业务席位净收入		2,350,382.80	11,173,315.26
代理销售金融产品净收入		1,426,490.66	1,508,274.93
证券承销业务净收入		25,655,000.00	307,222,549.95
受托客户资产管理业务净收入		2,448,668.85	3,011,464.95
其他		18,901,893.84	5,368,953.41
利息净收入	5.31	116,773,796.69	66,226,380.74
投资收益（损失以“-”号填列）	5.32	82,020,373.20	106,088,373.91
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		6,099,379.47	5,996,753.05
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5.33	101,350,191.17	-35,829,098.13
汇兑收益（损失以“-”号填列）		32,389.46	-182,061.35
其他业务收入	5.34	273,506.06	8,128,918.89
二、营业支出		470,565,639.58	627,181,924.52
营业税金及附加	5.35	26,149,253.65	48,613,749.95
业务及管理费	5.36	444,416,385.93	578,568,174.57
资产减值损失		-	-
其他业务成本		-	-
三、营业利润（损失以“-”号填列）		186,983,084.38	294,760,275.96
加：营业外收入	5.37	3,034,296.01	8,992,921.74
减：营业外支出	5.38	614,378.92	713,484.61
四、利润总额（损失以“-”号填列）		189,403,001.47	303,039,713.09
减：所得税费用	5.39	50,225,613.32	76,402,590.27
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		139,177,388.15	226,637,122.82
归属于母公司所有者的净利润		135,217,353.43	225,095,086.19
少数股东损益		3,960,034.72	1,542,036.63
六、每股收益			
基本每股收益		0.07	0.15
稀释每股收益		0.07	0.15
七、其他综合收益	5.40	20,703,406.83	-3,923,250.51
八、综合收益总额		159,880,794.98	222,713,872.31
归属于母公司所有者的综合收益总额		155,920,760.26	221,171,835.68
归属于少数股东的综合收益总额		3,960,034.72	1,542,036.63

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人：吴永敏

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

母 公 司 利 润 表 (未经审计)

2012年1-6月

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注	本期数	上年同期数
一、营业收入		592,737,773.70	883,700,273.92
手续费及佣金净收入		302,046,557.06	741,414,989.83
其中：代理买卖证券业务净收入		256,114,503.71	424,303,746.59
其中：经纪业务席位净收入		2,350,382.80	11,173,315.26
代理销售金融产品净收入		1,426,490.66	1,508,274.93
证券承销业务净收入		25,655,000.00	307,222,549.95
受托客户资产管理业务净收入		2,448,668.85	3,011,464.95
其他		16,401,893.84	5,368,953.41
利息净收入		101,998,230.44	56,531,132.74
投资收益（损失以“-”号填列）	12.03	90,067,680.19	120,313,979.95
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		6,100,528.18	5,997,987.82
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12.04	98,319,410.49	-34,506,686.14
汇兑收益（损失以“-”号填列）		32,389.46	-182,061.35
其他业务收入		273,506.06	128,918.89
二、营业支出		418,120,376.28	586,376,115.69
营业税金及附加		23,012,704.92	46,052,215.13
业务及管理费		395,107,671.36	540,323,900.56
资产减值损失		-	-
其他业务成本		-	-
三、营业利润（损失以“-”号填列）		174,617,397.42	297,324,158.23
加：营业外收入		2,009,225.00	8,940,964.92
减：营业外支出		579,296.46	701,117.89
四、利润总额（损失以“-”号填列）		176,047,325.96	305,564,005.26
减：所得税费用		45,011,831.49	73,133,541.34
五、净利润（净亏损以“-”填列）		131,035,494.47	232,430,463.92
归属于母公司所有者的净利润			
少数股东损益			
六、每股收益			
基本每股收益			
稀释每股收益			
七、其他综合收益		20,703,406.83	-3,923,250.51
八、综合收益总额		151,738,901.30	228,507,213.41
归属于母公司所有者的综合收益总额		151,738,901.30	228,507,213.41
归属于少数股东的综合收益总额			

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人：吴永敏

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

合并现金流量表 (未经审计)

2012年1-6月

编制单位: 东吴证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

项 目	附注	2012年1-6月	2011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		596,773,233.93	976,635,881.08
收到的税费返还			
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		456,936,699.11	4,939,726.03
代理买卖业务的现金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	5.41 (1)	162,269,660.26	17,071,840.63
现金流入小计		1,215,979,593.30	998,647,447.74
处置交易性金融资产净减少额		1,126,859,608.36	1,908,859,667.71
支付利息、手续费及佣金的现金		117,048,174.73	137,198,068.17
代理买卖业务的现金净减少额		770,996,097.39	5,280,953,128.83
回购业务资金净减少额			-
支付给职工及为职工支付的现金		287,906,370.12	240,277,770.70
支付的各项税费		73,700,555.29	165,063,898.33
支付其他与经营活动有关的现金	5.41 (2)	184,791,966.45	300,575,231.73
现金流出小计		2,561,302,772.34	8,032,927,765.47
经营活动产生的现金流量净额		-1,345,323,179.04	-7,034,280,317.73
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资所收到的现金		268,028,476.86	33,721,825.36
取得投资收益所收到的现金		44,786,487.54	100,091,620.86
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		139,752.48	5,406.60
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			
现金流入小计		312,954,716.88	133,818,852.82
投资支付的现金		1,151,802,565.50	550,332,987.79
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		125,572,660.15	58,459,948.26
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
现金流出小计		1,277,375,225.65	608,792,936.05
投资活动产生的现金流量净额		-964,420,508.77	-474,974,083.23
三、筹资活动产生的现金流量:			
吸收投资收到的现金			
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			300,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
现金流入小计		-	300,000,000.00
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		162,550,000.00	155,100,000.00
其中: 子公司支付给少数股东的股利、利润		2,550,000.00	5,100,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金			
现金流出小计		162,550,000.00	155,100,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		-162,550,000.00	144,900,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		32,389.46	-182,061.35
五、现金及现金等价物净增加额		-2,472,261,298.35	-7,364,536,462.31
加: 期初现金及现金等价物		11,183,513,348.84	16,933,078,426.21
六、期末现金及现金等价物	5.41 (4)	8,711,252,050.49	9,568,541,963.90

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人: 吴永敏

主管会计工作负责人: 马震亚

会计机构负责人: 王菁

母公司现金流量表 (未经审计)

2012年1-6月

编制单位: 东吴证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

项 目	附注	2012年1-6月	2011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		528,617,828.92	931,264,928.85
收到的税费返还			
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		456,936,699.11	4,939,726.03
代理买卖业务的现金净增加额			
收到其他与经营活动有关的现金	12.05(1)	58,105,662.45	9,069,883.81
现金流入小计		1,043,660,190.48	945,274,538.69
处置交易性金融资产净减少额		1,126,844,608.36	1,898,887,667.71
支付利息、手续费及佣金的现金		117,048,174.73	137,198,068.17
代理买卖业务的现金净减少额		748,319,944.38	5,304,219,036.81
回购业务资金净减少额			
支付给职工及为职工支付的现金		264,407,334.58	223,158,917.23
支付的各项税费		61,285,107.88	157,794,113.78
支付其他与经营活动有关的现金	12.05(2)	163,182,256.62	240,058,769.12
现金流出小计		2,481,087,426.55	7,961,316,572.82
经营活动产生的现金流量净额		-1,437,427,236.07	-7,016,042,034.13
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资所收到的现金		268,028,476.86	33,721,825.36
取得投资收益所收到的现金		51,088,728.92	114,315,992.13
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		117,752.48	-
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			
现金流入小计		319,234,958.26	148,037,817.49
投资支付的现金		1,670,089,148.60	511,832,987.79
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		123,091,539.17	57,414,083.55
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
现金流出小计		1,793,180,687.77	569,247,071.34
投资活动产生的现金流量净额		-1,473,945,729.51	-421,209,253.85
三、筹资活动产生的现金流量:			
吸收投资收到的现金			
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			300,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
现金流入小计		-	300,000,000.00
偿还债务支付的现金			
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		160,000,000.00	150,000,000.00
其中: 子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金			
现金流出小计		160,000,000.00	150,000,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		-160,000,000.00	150,000,000.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		32,389.46	-182,061.35
五、现金及现金等价物净增加额		-3,071,340,576.12	-7,287,433,349.33
加: 期初现金及现金等价物		10,531,511,286.49	16,093,491,065.54
六、期末现金及现金等价物	12.05(4)	7,460,170,710.37	8,806,057,716.21

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人: 吴永敏

主管会计工作负责人: 马震亚

会计机构负责人: 王菁

合并股东权益变动表(未经审计)

编制单位: 东吴证券股份有限公司

2012年1-6月

金额单位: 人民币元

项 目	本 年 金 额								少数股东权益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益									
	实收资本	资本公积	减: 库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润			
一、上年年末余额	2,000,000,000.00	4,240,133,945.93	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	593,431,060.44	57,984,844.95	7,447,728,550.00	
加: 会计政策变更									-	
前期差错更正									-	
二、本年初余额	2,000,000,000.00	4,240,133,945.93	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	593,431,060.44	57,984,844.95	7,447,728,550.00	
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	20,703,406.83	-	-	-	-	-24,782,646.57	1,410,034.72	-2,669,205.02	
(一) 净利润							135,217,353.43	3,960,034.72	139,177,388.15	
(二) 其他综合收益	-	20,703,406.83	-	-	-	-	-	-	20,703,406.83	
1. 可供出售金融资产公允价值变动净额		20,703,406.83							20,703,406.83	
2. 权益法下被投资单位其他所有者权益变动的影响									-	
3. 与计入所有者权益项目相关的所得税影响									-	
4. 其他									-	
上述(一)和(二)小计	-	20,703,406.83	-	-	-	-	135,217,353.43	3,960,034.72	159,880,794.98	
(三) 所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
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									-	
(四) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-160,000,000.00	-2,550,000.00	-162,550,000.00	
1. 提取盈余公积									-	
2. 提取一般风险准备									-	
3. 对所有者的分配							-160,000,000.00	-2,550,000.00	-162,550,000.00	
4. 提取交易风险准备									-	
(五) 所有者权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
1. 资本公积转增资本									-	
2. 盈余公积转增资本									-	
3. 盈余公积弥补亏损									-	
4. 一般风险准备弥补亏损									-	
5. 其他									-	
四、本年年末余额	2,000,000,000.00	4,260,837,352.76	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	568,648,413.87	59,394,879.67	7,445,059,344.98	

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人: 吴永敏

主管会计工作负责人: 马震亚

会计机构负责人: 王菁

合并股东权益变动表（续）

编制单位：东吴证券股份有限公司

2011年1-6月

金额单位：人民币元

项 目	上年金额							少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本	资本公积	减：库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润		
一、上年年末余额	1,500,000,000.00	1,618,544,014.91	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	582,011,220.31	58,910,704.30	4,245,550,018.57
加：会计政策变更									-
前期差错更正									-
二、本年初余额	1,500,000,000.00	1,618,544,014.91	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	582,011,220.31	58,910,704.30	4,245,550,018.57
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-3,923,250.51	-	-	-	-	75,095,086.19	-3,557,963.37	67,613,872.31
（一）净利润							225,095,086.19	1,542,036.63	226,637,122.82
（二）其他综合收益	-	-3,923,250.51	-	-	-	-	-	-	-3,923,250.51
1. 可供出售金融资产公允价值变动净额		-3,923,250.51							-3,923,250.51
2. 权益法下被投资单位其他所有者权益变动的影响									-
3. 与计入所有者权益项目相关的所得税影响									-
4. 其他									-
上述（一）和（二）小计	-	-3,923,250.51	-	-	-	-	225,095,086.19	1,542,036.63	222,713,872.31
（三）所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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									-
（四）利润分配	-	-	-	-	-	-	-150,000,000.00	-5,100,000.00	-155,100,000.00
1. 提取盈余公积							-	-	-
2. 提取一般风险准备							-	-	-
3. 对所有者的分配							-150,000,000.00	-5,100,000.00	-155,100,000.00
4. 提取交易风险准备							-	-	-
（五）所有者权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增资本									-
2. 盈余公积转增资本									-
3. 盈余公积弥补亏损									-
4. 一般风险准备弥补亏损									-
5. 其他									-
四、本年年末余额	1,500,000,000.00	1,614,620,764.40	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	657,106,306.50	55,352,740.93	4,313,163,890.88

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人：吴永敏

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

母公司股东权益变动表(未经审计)

编制单位：东吴证券股份有限公司

2012年1-6月

金额单位：人民币元

项 目	本 年 金 额							
	实收资本	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	2,000,000,000.00	4,239,648,041.37	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	574,144,866.23	7,369,971,606.28
加：会计政策变更								-
前期差错更正								-
二、本年年初余额	2,000,000,000.00	4,239,648,041.37	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	574,144,866.23	7,369,971,606.28
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	20,703,406.83	-	-	-	-	-28,964,505.53	-8,261,098.70
（一）净利润							131,035,494.47	131,035,494.47
（二）其他综合收益	-	20,703,406.83	-	-			-	20,703,406.83
1. 可供出售金融资产公允价值变动净额		20,703,406.83						20,703,406.83
2. 权益法下被投资单位其他所有者权益变动的影响								-
3. 与计入所有者权益项目相关的所得税影响								-
4. 其他								-
上述（一）和（二）小计	-	20,703,406.83	-	-			131,035,494.47	151,738,901.30
（三）所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-
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								
（四）利润分配	-	-	-	-	-	-	-160,000,000.00	-160,000,000.00
1. 提取盈余公积							-	-
2. 提取一般风险准备						-	-	-
3. 对所有者的分配							-160,000,000.00	-160,000,000.00
4. 提取交易风险准备						-	-	-
（五）所有者权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增资本								-
2. 盈余公积转增资本								-
3. 盈余公积弥补亏损								-
4. 一般风险准备弥补亏损								-
5. 其他								-
四、本年年末余额	2,000,000,000.00	4,260,351,448.20	-	103,449,266.62	234,446,692.74	218,282,739.32	545,180,360.70	7,361,710,507.58

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人：吴永敏

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

母公司股东权益变动表（续）

编制单位：东吴证券股份有限公司

2011年1-6月

金额单位：人民币元

项 目	上年金额							
	实收资本	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	1,500,000,000.00	1,618,058,110.35	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	560,590,753.79	4,164,732,943.19
加：会计政策变更								-
前期差错更正								-
二、本年初余额	1,500,000,000.00	1,618,058,110.35	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	560,590,753.79	4,164,732,943.19
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-3,923,250.51	-	-	-	-	82,430,463.92	78,507,213.41
（一）净利润							232,430,463.92	232,430,463.92
（二）其他综合收益	-	-3,923,250.51	-	-			-	-3,923,250.51
1. 可供出售金融资产公允价值变动净额		-3,923,250.51						-3,923,250.51
2. 权益法下被投资单位其他所有者权益变动的影响								-
3. 与计入所有者权益项目相关的所得税影响								-
4. 其他								-
上述（一）和（二）小计	-	-3,923,250.51	-	-			232,430,463.92	228,507,213.41
（三）所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-
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								
（四）利润分配	-	-	-	-	-	-	-150,000,000.00	-150,000,000.00
1. 提取盈余公积							-	-
2. 提取一般风险准备						-	-	-
3. 对所有者的分配							-150,000,000.00	-150,000,000.00
4. 提取交易风险准备						-	-	-
（五）所有者权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增资本								-
2. 盈余公积转增资本								-
3. 盈余公积弥补亏损								-
4. 一般风险准备弥补亏损								-
5. 其他								-
四、本年年末余额	1,500,000,000.00	1,614,134,859.84	-	80,084,393.41	211,081,819.53	194,917,866.11	643,021,217.71	4,243,240,156.60

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

法定代表人：吴永敏

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

东吴证券股份有限公司

财务报表附注

附注 1、公司概况

东吴证券股份有限公司（原名苏州证券公司、苏州证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司，以下简称“本公司”或“公司”）成立于 1993 年 4 月 10 日，1998 年 1 月 9 日经中国人民银行江苏省分行苏银复（1998）30 号批复同意增资改制，注册资本增至 10,400 万元，公司名称变更登记为苏州证券有限责任公司，2001 年 12 月 19 日经中国证监会证监机构字（2001）308 号“关于苏州证券有限责任公司增资扩股并更名的批复”，注册资本由 10,400 万增至 100,000 万元人民币，公司更名为东吴证券有限责任公司。

2008 年 6 月 23 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]831 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更注册资本的批复”，增加注册资本人民币 50,000 万元，变更后的注册资本为人民币 150,000 万元。

2009 年 12 月 8 日经公司 2009 年度第二次临时股东会决议并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]310 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复”批准，本公司整体变更为东吴证券股份有限公司，申请变更股份公司的注册资本为人民币 150,000 万元，由全体股东以截止 2009 年 9 月 30 日经审计后的公司净资产折股。

2011 年 1 月 25 日经公司 2011 年第一次临时股东大会决议并经中国证券监督管理委员会“证监许可[2011]1887 号”文核准，公司首次公开发行 50,000 万股新股。公司股票于 2011 年 12 月 12 日起在上海证券交易所上市交易，注册资本变更为人民币 200,000.00 万元。

公司住所：苏州工业园区翠园路 181 号。

企业法人营业执照注册号：320500000004432，经营证券业务许可证编号：Z23232000。

经营范围：许可经营项目：证券经纪；证券投资咨询；与证券投资交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务。

本公司现设有经纪业务事业部、投资银行总部、投资总部、资产管理总部、固定收益总部、场外市场总部、融资融券部、资本运营中心、机构销售交易部、财富管理中心、董事会办公室、党委办公室、总裁办公室、行政事务部、人力资源部、财务部、风险合规总部、稽核审计部、研究所、信息技术总部、客户服务中心等 21 个职能部门以及九家分公司，五十三家营业部。

公司所属分公司为：苏州分公司、上海分公司、北京分公司、常熟分公司、吴江分公司、昆山分公司、太仓分公司、张家港分公司、南京分公司。

公司所属证券营业部为：

序号	证券营业部名称	注册地址	营运资金 (万元)
1	苏州狮山路证券营业部	江苏省苏州市新区狮山路 25 号	500
2	苏州西北街证券营业部	江苏省苏州市西北街 180 号	500

序号	证券营业部名称	注册地址	营运资金 (万元)
3	苏州石路证券营业部	江苏省苏州市石路爱河桥 28 号	500
4	苏州工业园区现代大道证券营业部	江苏省苏州工业园区现代大道 158 号邻里中心 新城大厦三层	500
5	苏州竹辉路证券营业部	江苏省苏州市竹辉路 398 号	500
6	苏州干将东路证券营业部	江苏省苏州市干将东路 599 号东凌大厦 5-6 层	500
7	苏州胥江路证券营业部	江苏省苏州市胥江路 487 号	500
8	苏州吴中区木渎镇证券营业部	江苏省苏州市吴中区木渎镇金山路 158 号	500
9	苏州相城采莲路证券营业部	江苏省苏州市相城区元和镇采莲路开元银座 1015 号	500
10	苏州滨河路证券营业部	江苏省苏州市新区滨河路 1768-1770 号	500
11	太仓上海东路证券营业部	江苏省太仓市上海东路 6 号	500
12	太仓人民南路证券营业部	江苏省太仓市城厢镇人民南路 160—4 号	500
13	太仓沙溪镇白云中路证券营业部	江苏省太仓市沙溪镇白云中路 3 号	500
14	张家港杨舍证券营业部	江苏省张家港市杨舍镇新风桥东堍	500
15	张家港锦丰镇证券营业部	江苏省张家港市锦丰镇锦都花苑 15 幢三楼	500
16	张家港金港镇证券营业部	江苏省张家港市金港镇长江中路 160 号	500
17	昆山前进中路证券营业部	江苏省昆山市前进中路 269 号	500
18	昆山环城北路证券营业部	江苏省昆山市环城北路 135 号	500
19	常熟阜湖路证券营业部	江苏省常熟市虞山镇阜湖路 9 号	500
20	常熟白雪路证券营业部	江苏省常熟市虞山镇白雪路 30 号四楼	500
21	吴江中山北路证券营业部	江苏省吴江市松陵镇中山北路 172 号	500
22	吴江盛泽镇西环路证券营业部	江苏省吴江市盛泽镇西环路金源大厦一至三层	500
23	无锡锡沪路证券营业部	江苏省无锡市锡山区东亭街道锡沪路 168 号 1、 2 楼	500
24	常州关河中路证券营业部	江苏省常州市关河中路 38 号	500
25	泰州海陵南路证券营业部	江苏省泰州市海陵南路 360-6、7 号	500
26	南京中山南路证券营业部	江苏省南京市中山南路 501 号通服大厦	500
27	盐城大庆中路证券营业部	江苏省盐城市大庆中路 156 号鼎盛时代广场 2 号楼 117、204-209 门市	500
28	杭州文晖路证券营业部	杭州市文晖路 348 号金鹰大厦	700
29	嘉善县嘉善大道证券营业部	浙江省嘉善县罗星街道嘉善大道 53 号 301 室	500
30	北京安德里北街证券营业部	北京市东城区安德里北街 21 号	1000
31	上海西藏南路证券营业部	上海市西藏南路 1208 号 1、4、5 层	500
32	东莞鸿福路证券营业部	广东省东莞市鸿福路 102 号汇成大厦 7 楼	700
33	福州湖滨路证券营业部	福建省福州市鼓楼区湖滨路 66 号中福西湖花园 1#楼 B 区 4 层 B 店面	700

序号	证券营业部名称	注册地址	营运资金 (万元)
34	沈阳滂江街证券营业部	辽宁省沈阳市大东区滂江街 123 号	500
35	昆明春城路证券营业部	昆明市春城路 60 号新摩尔商务中心 A 座 2 楼	500
36	深圳宝安大道证券营业部	深圳市宝安中心区 N4 区新安街道裕安西路与 宝安大道交汇处南侧宝鸿林大厦 1-3 楼之 2 楼	500
37	三亚凤凰路证券营业部	海南省三亚市凤凰路汇丰国际公寓 2 号楼商铺	500
38	济南纬十二路证券营业部	山东省济南市槐荫区纬十二路 330 号	500
39	北京大兴兴华大街证券营业部	北京市大兴区黄村镇兴华大街三段 53 号一层	500
40	重庆洋河一村证券营业部	重庆市江北区洋河一村 78 号 2 楼 2 号	500
41	大连中山路证券营业部	大连市沙河口区中山路星岛园 13、14 号	500
42	长沙人民中路证券营业部	湖南省长沙市人民中路 568 号融圣国际 8、9 号 栋裙楼第 4 层	500
43	仪征真州西路证券营业部	江苏省仪征市真州西路 72 号	500
44	海口金贸西路证券营业部	海南省海口市金贸西路 18 号华贸大厦 A 座三层 302 号	500
45	镇江黄山北路证券营业部	江苏省镇江市润州区黄山北路 C 座	500
46	合肥黄山路证券营业部	安徽省合肥市蜀山区黄山路 468 号易居时代公 寓 1 幢 701-718 室	500
47	上海奉贤环城东路证券营业部	上海市奉贤区环城东路 846 弄 842—844 号	500
48	南宁朝阳路证券营业部	南宁市兴宁区朝阳路 38 号新朝阳商业广场 16 层第 B1601-1618 号	500
49	南京迈化路证券营业部	南京市栖霞区迈皋桥街道长营村 15 号	500
50	徐州北京北路证券营业部	江苏省徐州市铜山新区北京路东、同昌路南	500
51	淮安淮海南路证券营业部	江苏省淮安市淮海南路 178 号	500
52	姜堰人民中路证券营业部	江苏省姜堰市姜堰镇人民中路 82-58 号	500
53	瑞丽人民路证券营业部	云南省瑞丽市人民路 12 号（工商银行瑞丽支行 3 楼）	500

截至 2012 年 6 月 30 日公司（包括纳入合并范围内子公司）在职员工 2,042 人，其中高级管理人员 9 人。

附注 2、公司主要会计政策、会计估计和前期差错

2.01 财务报表的编制基础

(1) 财务报表的编制方法

本公司财务报表以下属各营业部、总部各业务部门等个别会计报表及其他资料为基础汇总编制；汇总时，本公司内部之间重大交易及其余额已相互抵销。

(2) 财务报表的编制基础

本公司以持续经营为基础，按照 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则——基本准则》及其相应具体准则、《企业会计准则——应用指南》的规定进行确认和计量，在此基础上编制财务报表。

2.02 遵循企业会计准则的声明

本公司声明：本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等有关信息。

2.03 会计期间

本公司的会计期间分为年度和中期，会计年度为自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日，中期包括月度、季度和半年度。

2.04 记账本位币

本公司采用人民币为记账本位币。

2.05 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

同一控制下的企业合并：合并方支付的合并对价和合并方取得的净资产均按账面价值计量。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及所发行股份面值总额的差额，调整资本公积；资本公积不足以冲减的，调整留存收益。合并发生的各项直接相关费用，包括为进行合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益，但为企业合并发行权益性证券或债券等发生的手续费、佣金等计入股东权益或负债的初始计量金额。

非同一控制下的企业合并：购买方的合并成本和购买方在合并中取得的可辨认净资产按公允价值计量。合并成本大于合并中取得的被购买方于购买日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。合并发生的各项直接相关费用，包括为进行合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益，但为企业合并发行权益性证券或债券等发生的手续费、佣金等计入股东权益或负债的初始计量金额。

2.06 合并财务报表的编制方法

合并财务报表是指反映本公司和子公司形成的企业集团整体财务状况、经营成果和现金流量的财务报表。

合并财务报表的合并范围以控制为基础，包括本公司及全部子公司截至 2012 年 6 月 30 日止财务报表。子公司是指被本公司控制的企业和主体。

编制合并财务报表时，子公司采用与本公司一致的会计期间和会计政策。本公司内部各公司之间的所有关联交易产生的损益和未实现损益及往来于合并时全额抵消。

纳入合并范围的子公司的所有者权益中不属于本公司的部分作为少数股东权益在合并财务报表中单独列示。

对于通过非同一控制下的企业合并取得的子公司，被购买方经营成果和现金流量自本公司取得控制权之日起纳入合并财务报表。在编制合并财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整。

对于通过同一控制下企业合并取得的子公司，被合并方的经营成果和现金流量自合并当期期初纳入合并财务报表。编制比较合并财务报表时，对前期财务报表的相关项目进行调整，视同合并后形成的报告主体自最终控制方开始实施控制时一直存在。

2.07 现金及现金等价物

现金等价物是指持有期限短（一般是指从购买日起三个月内到期）、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。公司本期在编制现金流量表时，将现金、银行存款、结算备付金确认为现金及现金等价物。

2.08 外币业务核算方法

按经营业务涉及不同的币种采用分账制核算，期末以人民币编制会计报表。资产负债表日将记账本位币外的其他币种折算为记账本位币，其中：货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，非货币性项目以交易日即期汇率折算，产生的汇兑差异计入当期损益。

2.09 金融工具的核算方法

（1）金融资产的分类

金融资产在初始确认时，按照公司取得金融资产的目的，将持有的金融资产划分为下列四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，包括交易性金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；持有至到期投资；应收款项；可供出售金融资产。

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括公司为了近期内出售或回购而持有的金融资产；或是初始确认时被公司管理层直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。这类资产在初始计量时按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或已到付息但尚未领取的债券利息，单独确认为应收项目。

②持有至到期投资

持有至到期投资，是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且公司有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。持有至到期投资采用实际利率法，按摊余成本计量。如公司将尚未到期的某项持有至到期投

资在本会计年度内出售或重分类为可供出售金融资产，相对于该类投资在出售或重分类前的总额较大时对该类投资的剩余部分也重分类为可供出售金融资产，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。但是，下列情况除外：

a、出售日或重分类日距离该项投资到期日或赎回日较近（如到期前三个月内），市场利率变化对该项投资的公允价值没有显著影响。

B、根据合同约定的定期偿付或提前还款方式收回该投资几乎所有初始本金后，将剩余部分予以出售或重分类。

C、出售或重分类是由于本公司无法控制、预期不会重复发生且难以合理预计的独立事项所引起。

2012 年利率市场出现较大幅度变化，债券市场出现明显上涨行情，为了锁定收益，同时为规避今后的信用风险，公司改变持有意图，提前出售了持有至到期投资中的部分债券。

③应收款项

是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

④可供出售金融资产

可供出售金融资产，是指初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，或未划分为应收款项、持有至到期投资、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的其他金融资产。

（2）金融资产的计量

A、初始计量：

初始确认的金融资产，按照公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产，相关交易费用计入初始确认金额。

B、后续计量：

a、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，公允价值变动形成的利得或损失，计入当期损益；持有期间实现的利息或现金股利计入投资收益；处置该金融资产时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应当确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。

b、可供出售金融资产公允价值变动形成的利得或损失，除减值损失和外币货币性金融资产形成的汇兑差额外，计入资本公积；可供出售金融资产持有期间实现的利息或现金股利计入当期损益；处置该金融资产时，应将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时将原直接计入资本公积的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

c、持有至到期投资在持有期间应当按摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益；处置该项金融资产时，应将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益。

d、应收款项按摊余成本计量，占用期间按实际利率法确认收益。

e、在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，应当按照成本计量。

（3）金融资产公允价值的确定

A、公允价值确定的基本原则：

a、对存在活跃市场的投资品种，如报表日有成交价，应当以当日收盘价作为公允价值。如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应当以最近交易日收盘价作为公允价值；如报表日无成交价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应当在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值；

b、对不存在活跃市场的投资品种，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值；

c、有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，公司应根据具体情况与监管部门或中介机构进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

B、具体投资品种的估值方法：

a、交易所上市交易品种的估值。

交易所上市股票和权证以收盘价估值，上市债券以收盘净价估值，期货合约以结算价格估值。交易所大宗方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

b、交易所发行未上市品种的估值。

(a) 首次发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(b) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；

(c) 有明确锁定期的股票，按如下原则确定公允价值：

如果估值日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 为估值日该有明确锁定期的股票的价值；

C 为该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（不含估值日当天）。

C、交易所停止交易等非流通品种的估值。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

D、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 金融资产减值

公司在资产负债表日对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，判定是否发生减值：

①可供出售金融资产：

可供出售金融资产发生减值时，即使该金融资产没有终止确认，原直接计入所有者权益的因公允价值下降形成的累计损失，应当予以转出，计入当期损益。该转出的累计损失，为可供出售金融资产的初始取得成本扣除已收回本金和已摊销金额、当前公允价值和原已计入损益的减值损失后的余额。

对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失确认后发生的事项有关的，原确认的减值损失应当予以转回，计入当期损益。

可供出售权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回。但是，在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，或与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产发生的减值损失，不得转回。

②以摊余成本计量的金融资产：

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，应当将该金融资产的账面价值减记至预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。

对以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关（如债务人的信用评级已提高等），原确认的减值损失应当予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

③以成本计量的金融资产：

在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，或与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产发生减值时，应当将该权益工具投资或衍生金融资产的账面价值，与按照类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额，确认为减值损失，计入当期损益。

（5）金融负债分类

金融负债在初始确认时划分为下列两类：

①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；

②其他金融负债。

（6）金融负债的计量

①初始计量：

公司初始确认金融负债，应当按照公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关交易费用应当直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用应当计入初始确认金额。

②后续计量：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，以公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的收益或损失计入当期损益。

其他金融负债，以实际利率法计算的摊余成本进行后续计量。在其终止确认、发生减值或摊销时产生的

利得或损失，应当计入当期损益。

2.10 应收款项

公司对于单项金额重大（余额超过 100 万元确认为重大）的应收款项，单独进行减值测试。有客观证据表明其发生了减值的，公司根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，计提坏账准备。短期应收款项的预计未来现金流量与其现值相差很小的，在确定相关减值损失时，可不对其预计未来现金流量进行折现。

对于单项金额非重大的应收款项可以单独进行减值测试，确定减值损失，计提坏账准备；也可以与经单独测试后未减值的应收款项一起按类似信用风险特征划分为若干组合，再按这些应收款项组合在资产负债表日余额的一定比例计提确定减值损失，计提坏账准备。根据应收款项组合余额的一定比例计算确定的坏账准备，应当反映各项目实际发生的减值损失，即各项组合的账面价值超过其未来现金流量现值的金额。

公司一般性应收款项坏账损失的核算方法：坏账损失采用备抵法核算，根据债务单位的财务状况、现金流量等情况，每年年度终了时对应收款项按账龄分析法结合个别认定计提坏账准备，坏账准备的计提比例列示如下：

账 龄	计提比例
三年以上	70%

2.11 客户交易结算资金的核算

(1) 公司接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等证券而收到的款项，全额存入公司指定的银行账户，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

(2) 公司接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等证券时，如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额加上代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用之和减少客户交易结算资金；如卖出证券成交总额大于买入证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额减去代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用后的余额增加客户交易结算资金。

2.12 承销证券业务的核算

(1) 公司承销证券时，在证券发行日根据承销合同确认的证券发行总额，按承销价款，在备查簿中记录承销证券的情况。

(2) 承销证券结束，将承销证券款交付委托单位并确认承销手续费。

(3) 承销期结束，如有未售出证券、采用余额包销方式承销证券的，按合同规定由公司认购，应按承销价款转为交易性金融资产或可供出售金融资产等科目。

2.13 融资融券业务的核算

融资融券业务，是指证券公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。企业发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

融资业务，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。应收债权在“其他资产”中融出资金中核算。

融券业务，融出的证券，按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定，不终止确认该证券，并确认相应利息收入；融出的证券在“可供出售金融资产”项目中核算。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

2.14 长期股权投资核算方法

长期股权投资包括本公司对子公司的股权投资、本公司对合营企业和联营企业的股权投资以及本公司对被投资单位不具有控制、共同控制或重大影响，并且在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的长期股权投资。

(1) 初始投资成本的确认

A) 同一控制下的企业合并，合并方以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，应当在合并日按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。

B) 非同一控制下的企业合并，购买方在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值作为长期股权投资的初始投资成本。

C) 其他除企业合并而形成的长期股权投资，其初始投资成本包括实际支付的购买价款以及与取得长期股权投资直接相关的费用、税金及其他必要支出。

(2) 后续计量

公司能够对被投资单位实施控制的长期股权投资，以及公司对被投资单位不具有共同控制或重大影响，并且在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的长期股权投资，采用成本法核算；公司对被投资单位具有共同控制或重大影响的长期股权投资，采用权益法核算。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告派发的现金股利或利润确认为当期投资收益。

(3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

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。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。

(4) 长期投资减值准备计提方法

公司在资产负债表日检查发现长期股权投资存在减值迹象时，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，按其可收回金额低于账面价值的差额，计提长期投资减值准备。

对于在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的长期股权投资，其账面价值低于按照类似金融资产当时的市场收益率对未来现金流量折现确定的现值的数额，确认为减值损失，计入当期损益。

对可供出售金融资产以外的长期股权投资，减值准备一经计提，在资产存续期内不予转回，可供出售金融资产减值损失，可以通过权益转回。

2.15 固定资产的核算方法

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在取得时，按取得时的成本入账。与购买或建造固定资产有关的一切直接或间接成本，在所购建资产达到预定可使用状态前所发生的，全部资本化为固定资产的成本。固定资产折旧采用直线法平均计算，并按固定资产的原值扣除残值和其预计使用年限制定折旧率。符合资本化条件的固定资产装修费用，在两次装修期间与固定资产尚可使用年限两者中较短的期间内，采用年限平均法单独计提折旧。

主要固定资产类别的折旧年限和年折旧率如下：

固定资产类别	净残值率（%）	使用期限（年）	年折旧率（%）
房屋建筑物	3~5%	30~35	2.71~3.23
机器设备	3~5%	5	19~19.4
运输设备	3~5%	5~10	9.5~19.4
电子设备	3~5%	5	19~19.4
其他设备	3~5%	5	19~19.4

固定资产的减值测试方法、减值准备计提方法：

公司在资产负债表日对固定资产进行检查，如发现存在减值迹象，则对其进行减值测试，计算可收回金额，按照可收回金额低于账面价值的金额，计提固定资产减值准备。

固定资产减值准备按单项资产计提，难以对单项资产的可收回金额进行估计的，按该资产所属的资产组为基础计提。减值准备一经计提，在资产存续期内不予转回。

2.16 在建工程的核算方法

以立项项目分类核算工程发生的实际成本。

当所建工程项目达到预定可使用状态时，转入固定资产核算；尚未办理竣工决算的，按估计价值转帐，待办理竣工决算手续后再作调整。

在建工程减值准备的确认标准和计提方法：本公司于每年年度终了，对在建工程进行全面检查，当存在减值迹象时，估计其可收回金额，按该项工程可收回金额低于其账面价值的差额计提减值准备。减值准备一经计提，在资产存续期内不予转回。

2.17 无形资产的核算办法

无形资产是指本公司拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产。

无形资产按照成本进行初始计量。

使用寿命有限的无形资产，自其可供使用时起在使用寿命内采用年限平均法摊销，计入当期损益；每年年度终了，对其使用寿命及摊销方法进行复核，若与以前估计不同的，改变摊销期限和摊销方法。使用寿命不确定的无形资产不摊销；在每个会计期间对其使用寿命进行复核，如果有证据表明其使用寿命是有限的，估计其使用寿命并按上述方法进行摊销。

本公司对商标等受益年限不确定的无形资产，每年末均需进行减值测试，估计其可收回金额，按其可收回金额低于账面价值的差额计提无形资产减值准备。对其他无形资产，年末进行检查，当存在减值迹象时估计其可收回金额，按其可收回金额低于账面价值的差额计提无形资产减值准备。减值准备一经计提，在资产存续期内不予转回。

2.18 商誉的核算办法

对于非同一控制下的企业合并投资成本大于被投资单位可辨认净资产公允价值的份额确认为商誉，并按规定进行减值测试。

2.19 长期待摊费用的核算方法

长期待摊费用指已经支出但受益期限在 1 年以上(不含 1 年)的各项费用，以实际发生额入账，按受益期限平均摊销，其中：

预付经营租入固定资产的租金，按租赁合同规定的期限平均摊销。

经营租赁方式租入的固定资产改良支出，按剩余租赁期与租赁资产尚可使用年限两者中较短的期限平均摊销。

2.20 预计负债

如果与或有事项相关的义务同时符合以下条件，本公司将其确认为预计负债：

- (1)该义务是本公司承担的现时义务；
- (2)该义务的履行很可能导致经济利益流出本公司；
- (3)该义务的金额能够可靠地计量。

如果清偿已确认预计负债所需支出全部或部分预期由第三方或其他方补偿，则补偿金额只能在基本确定能收到时，作为资产单独确认。确认的补偿金额不超过所确认负债的账面价值。

2.21 应付职工薪酬的核算方法

职工薪酬是指企业为获得职工提供的服务而给予各种形式的报酬以及其他相关支出。职工薪酬包括：

- (1) 职工工资、奖金、津贴和补贴；
- (2) 职工福利费；
- (3) 医疗保险费、养老保险费、失业保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费；
- (4) 住房公积金；
- (5) 工会经费和职工教育经费；
- (6) 非货币性福利；
- (7) 因解除与职工的劳动关系给予的补偿；
- (8) 其他与获得职工提供的服务相关的支出。

在职工为本公司提供服务的会计期间，将应付的职工薪酬确认为负债，计入当期损益。

为职工缴纳的医疗保险费、养老保险费、失业保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公

积金，在职工为本公司提供服务的会计期间，根据当地政府有关规定按工资总额的一定比例计算。

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，同时满足下列条件的，确认因解除与职工的劳动关系给予补偿而产生的预计负债，同时计入当期损益：

- (1) 企业已经制定正式的解除劳动关系计划或提出自愿裁减建议，并即将实施。
- (2) 企业不能单方面撤回解除劳动关系计划或裁减建议。

2.22 营业收入的确认原则

(1) 手续费及佣金收入

代理客户买卖证券业务：在与客户办理买卖证券款清算时确认收入。其中，出租交易单元租金收入、代销金融产品佣金收入按双方确认的金额，在收到价款或取得收取价款的凭证时确认收入。

代兑付证券业务，于代兑付证券业务完成且收到价款或取得收取价款的凭证时确认收入。

证券承销业务：按证券发行方式分别确认。A、全额包销方式，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认为发行收入；B、余额包销、代销方式，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

保荐业务：按照提供劳务收入确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认。

投行咨询服务业务：按照提供劳务收入确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认。

受托客户资产管理业务：在资产负债表日按合同约定的方法确认收入。

期货经纪业务：按照与客户签订的期货合同中有关手续费收取标准向客户收取的相关手续费，在扣除上缴给交易所的手续费后，公司按其净额确认手续费收入。

(2) 投资收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，公允价值变动形成的利得或损失，计入当期损益；持有期间实现的利息或现金股利计入投资收益；处置该金融资产时取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时调整公允价值变动收益。

可供出售金融资产公允价值变动形成的利得或损失，除减值损失和外币货币性金融资产形成的汇兑差额外，计入资本公积；可供出售金融资产持有期间实现的利息或现金股利计入当期损益；处置该金融资产时，取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时将原直接计入资本公积的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

持有至到期投资在持有期间按摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益；处置该项金融资产时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分配的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确定投资收益。

(3) 利息收入、金融企业往来收入

以利息款项已收到或合同签订并执行取得利息收款凭据时确认收入的实现。

买入返售金融资产，在证券到期返售时，按返售价格与买入成本的差额确认为收入。

(4) 其他业务收入：以合同签订并执行到期时、劳务已提供、资产已转让并收到价款或取得收取价款的凭证时确认收入。

2.23 政府补助

政府补助，是指本公司从政府无偿取得货币性资产或非货币性资产，但不包括政府作为本公司所有者投入的资本，分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。

与资产相关的政府补助，是指企业取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助。与收益相关的政府补助，是指除与资产相关的政府补助之外的政府补助。

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。

与收益相关的政府补助，分别下列情况处理：用于补偿企业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；用于补偿公司已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

2.24 所得税的会计处理方法

本公司所得税的会计处理方法采用资产负债表债务法。

所得税费用包括当期所得税费用和递延所得税费用，当期所得税费用按应纳税所得额和适用税率计算，递延所得税费用根据财务报表中资产和负债账面金额与其用于计算应纳税所得的相应计税基础之间的差额产生的暂时性差异计算，但不包括直接计入所有者权益的交易或事项及企业合并的所得税的影响：

(1) 所有应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债均予确认，除非应纳税暂时性差异是由商誉或是在某一既不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）、也不影响会计利润的交易中（该交易不是企业合并）的其他资产和负债的初始确认下产生的。

(2) 可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。可抵扣暂时性差异是在某一既不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损），也不影响会计利润的交易中（该交易不是企业合并）的其他资产和负债的初始确认下产生时不确认递延所得税资产。

(3) 资产负债表日，对于递延所得税资产和递延所得税负债，根据税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。适用税率发生变化的，对已确认的递延所得税资产和递延所得税负债进行重新计量，除直接在所有者权益中确认的交易或者事项产生的递延所得税资产和递延所得税负债以外，将其影响数计入变化当期的所得税费用。

2.25 现金股利分配会计处理

现金股利于股东大会决议通过时从未分配利润中提取。

2.26 一般风险准备和交易风险准备

根据 2007 年 12 月 18 日发布的《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320 号）的规定，本公司依据《金融企业财务规则》的要求，按照税后利润的 10%提取一般风险准备金。

根据《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320 号）的规定，本公司依据《证券法》要求，按税后利润的 10%提取交易风险准备金，用于弥补证券交易损失。

2.27 分部信息

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本公司内满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）公司管理层能够定期评价该组成部分的经营业绩，以决定向其分配资源、评价业绩；（3）能够取得该部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相同或相类似的经济特征，并且满足一定条件，本公司将其合并为一个经营分部。

2.28 实施会计政策中采用的重大会计估计及判断

本公司执行会计政策过程中，管理层根据历史经验和对未来事项的合理预期，对所采用的重要会计估计和关键假设进行持续的评价。很可能导致下一会计年度资产和负债的账面价值出现重大调整。导致出现重大调整风险的重要会计估计和关键假设如下。

（1）商誉减值准备的会计估计

本公司每年对商誉进行减值测试。包含商誉的资产组和资产组组合的可收回金额为其预计未来现金流量的现值，其计算需要采用会计估计。

如果管理层对资产组和资产组组合未来现金流量计算中采用的毛利率进行修订，修订后的毛利率低于目前采用的毛利率，本公司需要对商誉增加计提减值准备。

如果管理层对应用于现金流量折现的税前折现率进行修订，修订后的折现率高于目前采用的折现率，本公司需要对商誉增加计提减值准备。

如果实际毛利率或税前折现率高于或低于管理层的估计，本公司不能转回原已计提的商誉减值损失。

（2）所得税

在正常的经营活动中，涉及的很多交易和事项的最终税务处理都存在不确定性，本公司根据相关税收法规谨慎判断交易对应的所得税影响并相应计提所得税。递延所得税资产只有在未来有足够纳税所得并可用于抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重大判断。如果这些税务事项的最终认定结果与最初入账的金额存在差异，该差异将对作出上述最终认定期间的所得税费用和递延所得税的金额产生影响。

附注 3、税项

3.01 营业税

按应纳税营业额缴纳营业税，营业税税率为 5%。营业税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳营业税。根据财政部、国家税务总局财税[2006]172 号《关于证券投资基金有关营业税问题的通知》，准许证券公司上缴的证券投资基金从其营业税计税营业额中扣除。

3.02 城建税

按应交营业税额的 7%计征。城建税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳城建税。

3.03 教育费附加

按应交营业税额的 5%计征。

3.04 企业所得税

企业所得税税率为 25%。

附注 4、控股子公司、合营及联营公司

4.01 公司控股子公司情况

(1) 通过非同一控制下的企业合并取得的子公司

公司名称	业务性质	注册资本	主营业务	企业类型	法人代表
东吴期货有限公司	期货经纪业务	20,000 万	商品期货经纪业务；金融期货业务（涉及行政许可的凭许可证经营）	有限责任公司	任少华

公司名称	实际投资额	持股比例	表决权比例	是否合并	2012年6月30日少数股东权益	组织机构代码
东吴期货有限公司	15,645 万	74.50%	74.50%	是	59,394,879.67	13211380-8

2007年7月26日，经中国证券监督管理委员会“证监期货字[2007]106号”文件批准，东吴期货原股东上海强生传媒创业投资有限公司、上海汇浦产业投资有限公司分别将其所持公司90%、10%的股权转让给东吴证券有限责任公司、苏州市营财投资集团公司和苏州工业园区华都物资贸易有限公司。变更注册资本后，股东变更为东吴证券有限责任公司、苏州市营财投资集团公司和苏州工业园区华都物资贸易有限公司。同时东吴期货增加注册资本人民币2,000万元，由新股东东吴证券有限责任公司、苏州市营财投资集团公司和苏州工业园区华都物资贸易有限公司于批准之日后缴付；

根据公司股东会决议和修改后的章程规定，并于2007年11月27日经中国证券监督管理委员会“证监期货字[2007]314号”文件批准，同意公司增加注册资本人民币5,000万元，增资后，东吴期货注册资本为10,000万元。

2010年5月4日经中国证券监督管理委员会“证监许可[2010]557号”文件批准，同意公司增加注册资本人民币10,000万元，增资后，公司注册资本为20,000万元。

收购时取得的净资产与商誉的确认情况如下：

合并成本——支付的现金	22,150,000.00
减：取得的可辨认净资产公允价值按股权比例可享用的份额	14,157,912.36
商誉	7,992,087.64

(2) 通过设立或投资方式取得的子公司

公司名称	业务性质	注册资本	主营业务	企业类型	法人代表
东吴创业投资有限公司	投资	60,000 万元	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。	有限责任公司	衡敏
东吴创新资本管理有限责任公司	投资及投资管理	30,000 万元	项目投资、实业投资、股权投资，投资管理，投资信息咨询业务。	有限责任公司	任少华

公司名称	实际投资额	持股比例	表决权比例	是否合并	组织机构代码
东吴创业投资有限公司	60,000 万元	100%	100%	是	69936998-6
东吴创新资本管理有限责任公司	30,000 万元	100%	100%	是	59856874-0

东吴创业投资有限公司(原名:东吴投资有限公司)成立于2010年1月7日,原注册资本为300,000,000.00元,系由东吴证券股份有限公司出资组建的法人独资有限责任公司。2012年3月增加注册资本300,000,000.00元,截止2012年6月30日东吴创业投资有限公司的注册资本为600,000,000.00元。企业法人登记注册号:320594000151900。公司住所:苏州工业园区星澄路9号B-H幢。

东吴创新资本管理有限责任公司成立于2012年6月14日,注册资本为300,000,000.00元,系由东吴证券股份有限公司出资组建的法人独资有限责任公司。企业法人登记注册号:320583000535875。公司住所:花桥经济开发区商银路538号国际金融大厦。

4.02 公司联营企业情况

直接持有:

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	实际投资额	持股比例	是否合并
东吴基金管理有限公司	上海浦东源深路279号	基金管理业务、发起设立基金和经中国证监会批准的其他业务	10,000 万	4,900 万	49.00%	否

间接持有:

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	实际投资额	持股比例	是否合并
许昌市绿野农业科技有 限公司	许昌市魏都 民营科技园 区管委会办 公楼	农产品的种植及 销售（不含粮油 销售）	1,590 万	656.88 万	35.00%	否

注：许昌市绿野农业科技有限公司为本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资的联营企业。

4.03 合并报表范围的变化情况

单 位	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
东吴期货有限公司	是	是
东吴创业投资有限公司	是	是
东吴创新资本管理有限责任公司	是	不适用

附注 5、合并财务报表主要项目注释 (下列项目如无特殊说明, 金额均以人民币元为货币单位)

5.01 货币资金

(1) 项目

	2012-6-30	2011-12-31
库存现金	198,091.30	168,954.07
银行存款	8,102,174,920.13	10,431,937,312.67
其中: 经纪业务客户	5,529,431,048.48	5,966,320,103.51
公司自有	2,572,743,871.65	4,465,617,209.16
其他货币资金	691,146.88	275,448.52
其中: 新股申购款	-	-
合 计	8,103,064,158.31	10,432,381,715.26

(2) 按币种分类

	2012-6-30		
	原 币	汇 率	折人民币
库存现金			198,091.30
其中: 人民币	198,091.30	1.00	198,091.30
银行存款			8,102,174,920.13
其中: 经纪业务客户			5,529,431,048.48
--信用资金			8,571,907.22
其中: 人民币	8,571,907.22	1.00	8,571,907.22
--非信用资金			5,520,859,141.26
其中: 人民币	5,456,715,473.92	1.00	5,456,715,473.92
美元	9,114,398.42	6.3249	57,647,658.58
港币	7,968,607.41	0.8152	6,496,008.76
公司自有			2,572,743,871.65
--信用资金			1,505,183.88
其中: 人民币	1,505,183.88	1.00	1,505,183.88
--非信用资金			2,571,238,687.77
其中: 人民币	2,562,518,488.16	1.00	2,562,518,488.16
美元	1,325,132.24	6.3249	8,381,328.91
港币	415,690.26	0.8152	338,870.70
其他货币资金			691,146.88
其中: 人民币	691,146.88	1.00	691,146.88
合 计			8,103,064,158.31

	2011-12-31		
	原 币	汇 率	折人民币
库存现金			168,954.07
其中：人民币	168,954.07	1.00	168,954.07
银行存款			10,431,937,312.67
其中：经纪业务客户			5,966,320,103.51
--信用资金			-
其中：人民币	-	1.00	-
--非信用资金			5,966,320,103.51
其中：人民币	5,898,600,903.67	1.00	5,898,600,903.67
美元	9,088,289.71	6.3009	57,264,404.65
港币	12,896,009.85	0.8107	10,454,795.19
公司自有			4,465,617,209.16
--信用资金			-
其中：人民币	-	1.00	-
--非信用资金			4,465,617,209.16
其中：人民币	4,457,919,086.94	1.00	4,457,919,086.94
美元	1,195,454.69	6.3009	7,532,440.46
港币	204,368.77	0.8107	165,681.76
其他货币资金			275,448.52
其中：人民币	275,448.52	1.00	275,448.52
合 计			10,432,381,715.26

期末银行存款中不存在抵押或冻结等对使用有限制或有潜在回收风险的款项。

5.02 结算备付金

	2012-6-30		2011-12-31	
	原 币	折人民币	原 币	折人民币
客户备付金		516,407,262.59		703,280,610.99
--信用资金		5,303,670.00		-
其中：人民币	5,303,670.00	5,303,670.00	-	-
--非信用资金		511,103,592.59		703,280,610.99
其中：人民币	478,635,102.65	478,635,102.65	676,527,944.71	676,527,944.71
美元	3,896,976.38	24,647,985.91	3,589,623.27	22,617,857.26
港币	9,593,356.27	7,820,504.03	5,100,294.83	4,134,809.02
公司备付金		91,780,629.59		47,851,022.59

--信用资金		-		-
其中：人民币	-	-	-	-
--非信用资金		91,780,629.59		47,851,022.59
其中：人民币	91,780,629.59	91,780,629.59	47,851,022.59	47,851,022.59
合 计		608,187,892.18		751,131,633.58

5.03 交易性金融资产

项 目	2012-6-30		2011-12-31		公允价值 变动本期 增减数
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值	
权益工具	446,923,576.46	413,030,303.86	478,253,855.54	376,382,907.21	67,977,675.73
债券	1,890,933,938.16	1,918,105,999.88	664,415,899.76	662,672,942.33	28,915,019.15
基金	94,444,602.29	91,612,551.64	68,649,068.00	62,666,891.68	3,150,125.67
其他	10,000,000.00	10,060,810.62	50,000,000.00	45,770,000.00	4,290,810.62
合 计	2,442,302,116.91	2,432,809,666.00	1,261,318,823.30	1,147,492,741.22	104,333,631.17

2012年6月30日交易性金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物，期末公允价值为564,749,917.89元，质押到期日为2012年6月20日至2012年7月11日。

交易性金融资产中股票市值是根据资产负债表基准日证券交易所公布的收盘价确定，银行间市场债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债估值价格计算，开放式基金采用基金公司公布的净值计算。

上述交易性金融资产中无持有本公司5%（含5%）以上表决权股份的股东作为发起人的金融资产。

5.04 衍生金融资产

衍生金融资产期末余额为0，其项目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)之间的抵消后的净额为0，为便于报表使用人理解，在附注中按下列格式，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	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
沪深300指数	IF1207	-39	28,870,920.00	951,120.00
合 计			28,870,920.00	951,120.00
减：可抵消股指期货暂收暂付款				951,120.00
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。

5.05 买入返售金融资产

按品种划分：

项 目	2012-6-30	2011-12-31
证券	478,544,706.85	689,522,730.55
减：坏账准备	-	-
买入返售金融资产账面价值	478,544,706.85	689,522,730.55

按交易对手划分：

项 目	2012-6-30	2011-12-31
银行	-	81,159,081.97
其他非银行金融机构	51,144,706.85	383,363,648.58
上海证券交易所	427,400,000.00	225,000,000.00
合 计	478,544,706.85	689,522,730.55

5.06 应收利息

项 目	2012-6-30	2011-12-31
应收存款利息	24,347,659.70	12,349,923.25
应收债券利息	28,754,865.40	47,801,441.27
应收买入返售金融资产利息	119,698.44	789,764.98
应收融资融券业务利息	59,837.78	-
合 计	53,282,061.32	60,941,129.50

5.07 存出保证金

项 目	2012-6-30	2011-12-31
证券业务交易保证金	149,903,816.52	162,058,585.91
期货业务交易保证金	289,626,633.80	442,733,608.05
期货业务履约保证金	227,406,929.88	170,927,870.82
期货业务结算担保金	10,000,000.00	10,000,000.00
融资融券业务信用交易担保金	-	-
合 计	676,937,380.20	785,720,064.78

5.08 可供出售金融资产

项 目	2012-6-30		2011-12-31		公允价值变动 本期增减数
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值	
债券	1,001,184,112.06	1,022,514,015.20	-	-	21,329,903.14
基金	100,000,000.00	92,255,097.87	-	-	-7,744,902.13

券商理财计划	45,995,061.96	30,603,413.66	45,995,061.96	31,272,725.34	-669,311.68
权益工具	752,735,374.82	733,540,485.49	219,161,848.80	185,278,106.36	14,688,853.11
其中：融出证券	1,875,065.92	2,023,827.48	-	-	148,761.56
合 计	1,899,914,548.84	1,878,913,012.22	265,156,910.76	216,550,831.70	27,604,542.44

本期将持有至到期投资重分类为可供出售金融资产的，本期重分类的金额为 1,001,210,643.58 元，该金额占重分类前持有至到期投资总额的比例为 90.88 %。

项 目	重分类前的公允价值	重分类后的公允价值
债券	1,001,210,643.58	1,022,514,015.20
合 计	1,001,210,643.58	1,022,514,015.20

2012 年 6 月 30 日可供出售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物，期末公允价值为 757,000,215.53 元，质押到期日为 2012 年 6 月 20 日至 2012 年 7 月 9 日。

可供出售金融资产的公允价值是以资产负债表基准日交易所公布的收盘价为基础，采用估值技术进行估值。券商理财计划的期末净值按照理财产品管理人网站公布的单位净值计算。

上述可供出售金融资产中无持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东作为发起人的金融资产。

5.09 持有至到期投资

项 目	2012-6-30	2011-12-31
债券	38,702,107.55	890,680,931.58
其他	-	-
合计	38,702,107.55	890,680,931.58
减：持有至到期投资减值准备	-	-
持有至到期投资账面价值	38,702,107.55	890,680,931.58

由于 2012 年以来利率市场出现较大幅度变化，本期公司提前处置债券 100,422,497.33 元，并将公司剩余的持有至到期资产重分类至可供出售金融资产。本期内出售但尚未到期的持有至到期投资情况如下：

项 目	金额	占该项投资出售前金额的比例（%）
11 文登债	100,422,497.33	9.12%
合 计	100,422,497.33	9.12%

期末持有至到期投资为子公司东吴期货有限公司持有，无被用作卖出回购等业务的质押物。

5.10 长期股权投资

2012 年 1-6 月增减变动：

项 目	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
按权益法核算的长期股权投资	90,611,478.67	6,100,528.18	1,148.71	96,710,858.14

按成本法核算的长期股权投资	118,511,180.00	69,969,500.00	-	188,480,680.00
合 计	<u>209,122,658.67</u>	<u>76,070,028.18</u>	<u>1,148.71</u>	<u>285,191,538.14</u>
长期投资减值准备	-	-	-	-
长期股权投资净值	<u>209,122,658.67</u>	<u>76,070,028.18</u>	<u>1,148.71</u>	<u>285,191,538.14</u>

(1) 按权益法核算的长期股权投资

2012年1-6月增减变动:

项 目	股权比例	表决权比例	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
东吴基金管理有限公司			84,052,558.37	6,100,528.18	-	90,153,086.55
——投资成本	49%	49%	49,000,000.00	-	-	49,000,000.00
——损益调整			35,052,558.37	6,100,528.18	-	41,153,086.55
许昌市绿野农业科技有限公司			6,558,920.30	-	1,148.71	6,557,771.59
——投资成本	35%	35%	6,568,800.00	-	-	6,568,800.00
——损益调整			-9,879.70	-	1,148.71	-11,028.41
合 计			<u>90,611,478.67</u>	<u>6,100,528.18</u>	<u>1,148.71</u>	<u>96,710,858.14</u>

许昌市绿野农业科技有限公司系由本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资。

按权益法核算的长期股权投资 2012年6月30日资产负债及2012年度1-6月损益情况如下:

被投资单位名称	东吴基金管理有限公司	许昌市绿野农业科技有限公司
期末资产总额	211,168,589.47	15,841,766.38
期末负债总额	27,182,698.55	-22,004.00
期末净资产总额	183,985,890.92	15,863,770.38
本期营业收入总额	74,530,508.15	-
本期净利润	12,450,057.51	-3,282.04

(2) 按成本法核算的长期股权投资

2012年1-6月增减变动:

项 目	股权比例	表决权比例	初始投资金额	2011-12-31	本期增减变动	2012-6-30
1、江苏银行	0.08%	0.08%	5,225,180.00	5,225,180.00	-	5,225,180.00
2、期货会员资格投资			1,400,000.00	1,400,000.00	-	1,400,000.00
——上海期货交易所资格投资			500,000.00	500,000.00	-	500,000.00
——郑州商品交易所资格投资			400,000.00	400,000.00	-	400,000.00
——大连商品交易所资格投资			500,000.00	500,000.00	-	500,000.00
3、四川伊顿农业科技开发有限公司	15.50%	15.50%	13,950,000.00	13,950,000.00	-	13,950,000.00
4、重庆东吴创业投资有限公司	15.00%	15.00%	16,500,000.00	16,500,000.00	-	16,500,000.00
5、重庆乌江实业(集团)股份有限公司	0.85%	0.85%	20,000,000.00	20,000,000.00	-	20,000,000.00

6、成都支付通新信息技术有限公司	9.97%	9.97%	3,500,000.00	3,500,000.00	-	3,500,000.00
7、上海东吴创业投资有限公司	15.00%	15.00%	15,000,000.00	15,000,000.00	-	15,000,000.00
8、四川华体灯业有限公司	11.31%	11.31%	37,905,500.00	12,936,000.00	24,969,500.00	37,905,500.00
9、厦门优传供应链有限公司	10.39%	10.39%	40,000,000.00	10,000,000.00	30,000,000.00	40,000,000.00
10、昌图国美肉联有限责任公司	8.00%	8.00%	20,000,000.00	20,000,000.00	-	20,000,000.00
11、北京农信通科技有限公司	13.04%	13.04%	15,000,000.00	-	15,000,000.00	15,000,000.00
合 计				118,511,180.00	69,969,500.00	188,480,680.00

注：3~11 项系由本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资。

报告期内被投资单位经营正常，近期内不会出现可收回金额低于账面价值的情况，不需计提长期投资减值准备。

(3) 本期现金红利

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
江苏银行股份有限公司	602,285.44	-
重庆乌江实业(集团)股份有限公司	1,000,000.00	-
四川华体灯业有限公司	86,948.00	-
合 计	1,689,233.44	-

5.11 固定资产

项 目	2012-6-30			2011-12-31		
	账面余额	减值准备	账面净值	账面余额	减值准备	账面净值
固定资产	222,663,567.68	-	222,663,567.68	235,728,708.07	-	235,728,708.07
在建工程	250,408,818.71	-	250,408,818.71	142,700,325.43	-	142,700,325.43
合 计	473,072,386.39	-	473,072,386.39	378,429,033.50	-	378,429,033.50

1、 固定资产增减变动

2012 年 1-6 月增减变动：

一、原 值	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
房屋建筑物	143,439,004.32	-	-	143,439,004.32
机器设备	21,444,779.64	1,456,041.00	149,720.00	22,751,100.64
运输工具	27,124,303.20	438,000.00	707,207.00	26,855,096.20
电子设备	177,638,570.42	5,039,985.50	114,300.00	182,564,255.92
其 他	6,428,986.17	122,171.50	401,870.00	6,149,287.67
合 计	376,075,643.75	7,056,198.00	1,373,097.00	381,758,744.75

二、累计折旧	2011-12-31	本期新增	本期计提金额	本期减少金额	2012-6-30
房屋建筑物	23,532,663.75	-	2,298,675.18	-	25,831,338.93
机器设备	12,051,598.17	-	2,032,175.18	146,109.88	13,937,663.47
运输工具	7,033,108.62	-	1,319,006.20	566,804.88	7,785,309.94
电子设备	95,556,927.36	-	13,337,916.65	73,732.97	108,821,111.04
其他	2,172,637.78	-	569,048.78	21,932.87	2,719,753.69
合计	140,346,935.68	-	19,556,821.99	808,580.60	159,095,177.07

三、固定资产账面净额	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
房屋建筑物	119,906,340.57			117,607,665.39
机器设备	9,393,181.47			8,813,437.17
运输工具	20,091,194.58			19,069,786.26
电子设备	82,081,643.06			73,743,144.88
其他	4,256,348.39			3,429,533.98
合计	235,728,708.07			222,663,567.68

四、减值准备	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
房屋建筑物	-	-	-	-
机器设备	-	-	-	-
运输工具	-	-	-	-
电子设备	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

五、固定资产账面价值

合计	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
房屋建筑物	119,906,340.57			117,607,665.39
机器设备	9,393,181.47			8,813,437.17
运输工具	20,091,194.58			19,069,786.26
电子设备	82,081,643.06			73,743,144.88
其他	4,256,348.39			3,429,533.98
合计	235,728,708.07			222,663,567.68

①报告期内固定资产中无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提固定资产减值准备。

②期末固定资产无抵押情况。

③本期减少固定资产主要原因为清理报废设备。

④期末增加固定资产中无借款费用资本化。

2、在建工程

①2012年1-6月增减变动：

项 目	2011-12-31	本期增加	转入固定资产	其他减少	2012-6-30
东吴证券大厦工程	142,700,325.43	107,708,493.28	-	-	250,408,818.71
合 计	142,700,325.43	107,708,493.28	-	-	250,408,818.71
减：减值准备	-	-	-	-	-
在建工程账面价值	142,700,325.43	107,708,493.28	-	-	250,408,818.71

在建工程2012年1-6月增加主要系公司在建办公大楼工程款增加所致。

②上述工程为东吴证券大厦工程，预算为6.05亿元，截止2012年6月30日工程及土地投入占预算的比例为60%，工程进度为80%；工程资金来源均为自筹，截止2012年6月30日公司在建工程中无利息资本化。

③报告期内在建工程中无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提减值准备。

5.12 无形资产

(1) 2012年1-6月增减变动

资产类别	2011-12-31	本期增加	本期摊销或计提	其它减少	2012-6-30
一、原价					
土地使用权	104,376,805.70	-	-	-	104,376,805.70
交易软件	36,171,692.16	2,886,584.00	-	-	39,058,276.16
卫星建站费	415,600.00	-	-	-	415,600.00
交易席位费	14,465,005.38	-	-	-	14,465,005.38
合 计	155,429,103.24	2,886,584.00		-	158,315,687.24
二、累计摊销					
土地使用权	8,312,095.69	-	1,304,710.08	-	9,616,805.77
交易软件	15,298,959.45	-	3,488,122.22	-	18,787,081.67
卫星建站费	395,600.36	-	10,000.02	-	405,600.38
交易席位费	13,825,628.91	-	366,196.76	-	14,191,825.67
合 计	37,832,284.41	-	5,169,029.08	-	43,001,313.49
三、无形资产净值					
土地使用权	96,064,710.01	-	1,304,710.08	-	94,759,999.93
交易软件	20,872,732.71	2,886,584.00	3,488,122.22	-	20,271,194.49
卫星建站费	19,999.64	-	10,000.02	-	9,999.62

交易席位费	639,376.47	-	366,196.76	-	273,179.71
合 计	117,596,818.83	2,886,584.00	5,169,029.08	-	115,314,373.75
四、减值准备					
土地使用权	-	-	-	-	-
交易软件	-	-	-	-	-
卫星建站费	-	-	-	-	-
交易席位费	-	-	-	-	-
合 计	-	-	-	-	-
无形资产净额					
土地使用权	96,064,710.01	-	1,304,710.08	-	94,759,999.93
交易软件	20,872,732.71	2,886,584.00	3,488,122.22	-	20,271,194.49
卫星建站费	19,999.64	-	10,000.02	-	9,999.62
交易席位费	639,376.47	-	366,196.76	-	273,179.71
合 计	117,596,818.83	2,886,584.00	5,169,029.08	-	115,314,373.75

(2)交易席位费

2012年1-6月增减变动

资产类别	2011-12-31	本期增加	本期摊销或计提	本期减少	2012-6-30
一、原值:	14,465,005.38	-	-	-	14,465,005.38
1、上海证交所	8,489,005.02	-	-	-	8,489,005.02
其中：A股	6,782,407.45	-	-	-	6,782,407.45
B股	1,706,597.57	-	-	-	1,706,597.57
2、深交所	5,976,000.36	-	-	-	5,976,000.36
其中：A股	4,986,000.36	-	-	-	4,986,000.36
B股	990,000.00	-	-	-	990,000.00
二、累计摊销	13,825,628.91	-	366,196.76	-	14,191,825.67
1、上海证交所	8,054,260.47	-	161,564.84	-	8,215,825.31
其中：A股	6,347,662.90	-	161,564.84	-	6,509,227.74
B股	1,706,597.57	-	-	-	1,706,597.57
2、深交所	5,771,368.44	-	204,631.92	-	5,976,000.36
其中：A股	4,781,368.44	-	204,631.92	-	4,986,000.36
B股	990,000.00	-	-	-	990,000.00
三、账面价值	639,376.47	-	366,196.76	-	273,179.71

1、上海证交所	434,744.55	-	161,564.84	-	273,179.71
其中：A 股	434,744.55	-	161,564.84	-	273,179.71
B 股	-	-	-	-	-
2、深交所	204,631.92	-	204,631.92	-	-
其中：A 股	204,631.92	-	204,631.92	-	-
B 股	-	-	-	-	-

5.13 递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 已确认的递延所得税资产/递延所得税负债

递延所得税资产：

	2012-6-30	2011-12-31
期货风险准备	33,924.43	35,274.43
金融资产公允价值变动损益	14,221,690.28	39,699,396.53
子公司可抵扣亏损	75,428.36	104,155.28
应付职工薪酬	1,317,446.60	1,665,867.00
合 计	15,648,489.67	41,504,693.24

递延所得税负债：

	2012-6-30	2011-12-31
交易性金融资产公允价值变动	6,820,770.76	74,996.25
合 计	6,820,770.76	74,996.25

(2) 应纳税差异和可抵扣差异项目明细

可抵扣差异项目：	2012-6-30	2011-12-31
期货风险准备	135,697.72	141,097.72
金融资产公允价值变动损益	56,886,761.17	158,797,586.14
子公司可抵扣亏损	301,713.44	416,621.12
应付职工薪酬	5,269,786.40	6,663,468.00
合 计	62,593,958.73	166,018,772.98

应纳税暂时性差异项目：	2012-6-30	2011-12-31
交易性金融资产公允价值变动	27,283,083.05	299,985.00
合 计	27,283,083.05	299,985.00

子公司可抵扣亏损系本年度公司投资的全资子公司东吴创业投资有限公司经营亏损，按税法规定可用未来 5 年该公司利润弥补。

5.14 其他资产

项 目	2012-6-30	2011-12-31
应收款项	32,655,757.23	42,139,264.71
待摊费用	11,176,978.25	11,114,223.44
长期待摊费用	62,256,181.93	65,862,456.01
商 誉	19,742,087.44	19,742,087.44
融出资金	27,766,893.29	-
合 计	153,597,898.14	138,858,031.60

(1) 应收款项

①应收款项按性质分类

项 目	2012年6月30日			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例(%)	金 额	比例(%)
单项金额重大的应收款项	14,291,413.92	43.76	-	-
其他不重大应收款项	18,364,343.31	56.24	-	-
合 计	32,655,757.23	100.00	-	-

项 目	2011年12月31日			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例(%)	金 额	比例(%)
单项金额重大的应收款项	31,991,661.75	75.92	-	-
其他不重大应收款项	10,147,602.96	24.08	-	-
合 计	42,139,264.71	100.00	-	-

②应收款项账龄情况:

账 龄	2012-6-30	2011-12-31
1年以内	27,895,104.28	38,698,189.71
1~2年	4,760,652.95	3,441,075.00
2~3年	-	-
3年以上	-	-
合 计	32,655,757.23	42,139,264.71
坏账准备	-	-
应收款项净额	32,655,757.23	42,139,264.71

③期末单项金额重大或虽不重大但单独进行减值测试的应收款项坏账准备计提:

往来单位名称	金额	账龄	坏账金额	款项性质
沈阳远大铝业工程有限公司上海分公司	4,000,000.00	1年以内	-	幕墙及穹顶工程预付款
江苏省电力公司苏州供电公司	3,358,640.76	1-2年	-	预付东吴大厦工程款及电费
苏州通源电器有限公司	2,260,665.60	1年以内	-	低压柜设备预付款

苏州工业园区商业旅游发展有限公司	1,725,426.00	1 年以内	-	房租押金
北京恒奥房地产开发有限公司	1,214,205.00	1-2 年	-	装修预付款
合计	12,558,937.36			

④期末应收款项中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

（2）待摊费用

项 目	2012-6-30	2011-12-31
房 租	7,005,573.22	10,976,572.80
彭博咨询费	31,641.60	137,650.64
其他	4,139,763.43	-
合 计	11,176,978.25	11,114,223.44

（3）长期待摊费用

2012 年 1-6 月增减变动：

项 目	取得方式	原始金额	2011-12-31	本期增加	本期摊销	2012-6-30	剩余摊销年限(月)
装修费	购入	109,554,770.28	45,019,948.10	8,073,763.38	8,620,992.76	44,472,718.72	1-60 月
网络工程	购入	17,234,238.84	9,363,373.59	51,085.44	1,361,533.87	8,052,925.16	1-60 月
办公家具	购入	10,544,522.85	5,226,643.20	8,096.05	840,922.52	4,393,816.73	3-54 月
水电增容	购入	5,847,533.97	3,089,722.15	-	604,481.13	2,485,241.02	4-54 月
消防工程	购入	7,038,796.07	3,162,768.97	162,110.00	473,398.67	2,851,480.30	1-58 月
合 计		65,862,456.01	8,295,054.87	8,295,054.87	11,901,328.95	62,256,181.93	

（4）商誉

项目	2012-6-30	2011-12-31
重组商誉	11,749,999.80	11,749,999.80
收购子公司商誉	7,992,087.64	7,992,087.64
合 计	19,742,087.44	19,742,087.44
减：减值准备	-	-
商誉净额	19,742,087.44	19,742,087.44

上述重组商誉系受让营业部形成的商誉，于 2006 年 12 月 31 日停止摊销，以后定期减值测试。

报告期内商誉无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提减值准备。

（5）融出资金

①融资资金

	2012-6-30	2011-12-31
融出资金	27,766,893.29	-
合 计	27,766,893.29	-

②融资融券担保物情况

担保物类别	2012-6-30	2011-12-31
资金	8,571,907.22	-
证券	193,603,907.01	-
合 计	202,175,814.23	-

5.15 资产减值准备

2012 年 1-6 月增减变动:

项 目	2011-12-31	本期计提额	本期减少额		2012-6-30
			转回	转销	
坏账准备	-	-	-	-	-
可供出售金融资产	14,722,336.62	-	-	-	14,722,336.62
合 计	14,722,336.62	-	-	-	14,722,336.62

5.16 卖出回购金融资产款

(1) 按交易品种分类:

项 目	2012-6-30	2011-12-31
证券	964,908,675.41	718,950,000.00
合 计	964,908,675.41	718,950,000.00

(2) 按交易对手分类:

项 目	2012-6-30	2011-12-31
银 行	388,397,675.41	251,600,000.00
其他非银行金融机构	422,900,000.00	337,350,000.00
上海交易所	153,611,000.00	130,000,000.00
合 计	964,908,675.41	718,950,000.00

5.17 代买卖证券款

(1) 按客户分类

	2012-6-30		2011-12-31	
	开户数	金 额	开户数	金 额
个人客户	621,384	6,247,026,827.54	611,320	6,521,118,638.54
机构客户	3,144	434,215,026.56	2,958	848,327,392.18
合 计		6,681,241,854.10		7,369,446,030.72

(2) 按币种分类:

	2012-6-30		2011-12-31	
	原 币	折人民币	原 币	折人民币
人民币		6,582,106,773.82		7,272,462,221.60
美 元	13,281,374.80	84,003,367.48	12,947,912.98	81,583,504.89
港 币	18,561,963.68	15,131,712.80	18,996,304.68	15,400,304.23
合 计		6,681,241,854.10		7,369,446,030.72

期末代买卖证券款中，其中客户信用交易代理买卖证券款余额为 8,571,907.22 元。

上述代买卖证券款中持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位存入的款项请见附注 7。

5.18 代理承销证券款

项 目	2012-6-30	2011-12-31
企业债券	-	5,000,000.00
合 计	-	5,000,000.00

5.19 应付职工薪酬

项 目	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
一、职工工资及奖金	150,716,278.80	154,262,281.57	223,811,287.87	81,167,272.50
二、职工福利费	-	11,550,398.97	11,550,398.97	-
三、社会保险费	527,562.01	25,573,280.54	25,517,826.41	583,016.14
其中：医疗保险费	116,679.62	7,220,443.10	7,211,205.36	125,917.36
基本养老保险	363,203.51	15,622,416.90	15,583,475.76	402,144.65
失业保险费	30,659.89	1,472,845.47	1,471,300.38	32,204.98
工伤保险费	6,748.67	679,537.24	675,540.64	10,745.27
生育保险费	10,270.32	578,037.83	576,304.27	12,003.88
四、住房公积金	29,091.00	7,572,455.02	7,593,312.02	8,234.00
五、辞退福利	-	346,455.00	346,455.00	-
六、工会经费	2,160,942.62	2,689,168.88	3,209,985.17	1,640,126.33
七、职工教育经费	-	84,966.31	84,966.31	-
八、其他	-	-	-	-
合 计	153,433,874.43	202,079,006.29	272,114,231.75	83,398,648.97

5.20 应交税费

项 目	2012-6-30	2011-12-31
营业税	5,988,701.62	3,257,816.75

城建税	418,366.75	227,316.61
教育费附加	305,872.41	162,231.33
企业所得税	2,740,424.08	37,130,154.63
股民利息税	3,493,971.70	90,651.15
个人所得税	21,592,079.13	36,981,240.66
其他税费	238,944.76	1,612,903.56
合 计	34,778,360.45	79,462,314.69

5.21 应付利息

项 目	2012-6-30	2011-12-31
存款利息	827,108.88	1,286,375.97
卖出回购金融资产应付利息	-	949,362.36
合 计	827,108.88	2,235,738.33

5.22 其他负债

项 目	2012-6-30	2011-12-31
预提费用	25,673,376.50	17,340,944.56
期货风险准备金	15,323,872.49	12,621,176.98
应付款项	54,800,746.88	53,083,756.88
应付期货投资者保障基金	413,819.20	536,539.07
代理兑付证券款	19,092.10	19,092.10
合 计	96,230,907.17	83,601,509.59

(1) 预提费用

项 目	2012-6-30	2011-12-31
投资者保护基金	8,779,316.60	4,419,407.01
三方存管费	2,195,786.50	10,140,469.20
业务拓展费	1,745,105.81	1,714,636.39
席位年费	2,493,143.20	-
房租	1,064,966.81	-
数据线路费	3,802,911.54	-
其 他	5,592,146.04	1,066,431.96
合 计	25,673,376.50	17,340,944.56

(2) 期货风险准备金按期货手续费收入的 5%计提。

(3) 应付款项

2012-6-30		2011-12-31	
金 额	比 例	金 额	比 例

应付款项	54,800,746.88	100.00%	53,083,756.88	100.00%
其中：逾期应付款项	-	-	-	-
合 计	54,800,746.88	100.00%	53,083,756.88	100.00%

2012年6月30日主要应付款项：

内 容	金 额	账 龄	款项性质
员工风险金	28,965,187.27	1年以内	员工风险金
南通二建集团有限公司	4,805,366.72	1年以内	工程款
南通二建集团有限公司	500,000.00	1~2年	工程款
上海三菱电梯有限公司	2,567,220.00	1年以内	电梯款
经纪人风险金	1,217,521.15	1年以内	经纪人风险金
沈阳远大铝业工程有限公司	1,098,332.00	1年以内	幕墙款

报告期内应付款项中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

(4) 应付期货投资者保障基金

项 目	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
应付期货投资者保障基金	536,539.07	1,447,831.02	1,570,550.89	413,819.20
合 计	536,539.07	1,447,831.02	1,570,550.89	413,819.20

应付期货投资者保障基金按代理交易额的千万分之七计提。

5.23 股本

	期初数	本次变动增减 (+/-)			期末数
		发行新股	其他	小计	
一、有限售条件股份					
1、国有法人股	1,155,250,000.00	-	-	-	1,155,250,000.00
2、社会法人股	569,750,000.00	-	-225,000,000.00	-225,000,000.00	344,750,000.00
小 计	1,725,000,000.00	-	-225,000,000.00	-225,000,000.00	1,500,000,000.00
二、无限售条件的股份					
1、人民币普通股	275,000,000.00	-	225,000,000.00	225,000,000.00	500,000,000.00
小 计	275,000,000.00	-	225,000,000.00	225,000,000.00	500,000,000.00
合 计	2,000,000,000.00	-	-	-	2,000,000,000.00

上述股本已经江苏公证天业会计师事务所验证，并于 2011 年 12 月出具苏公 W[2011]B120 号验资报告。

5.24 资本公积

项 目	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
捐赠公积	-	-	-	-

股本溢价	4,265,060,848.19	-	-	4,265,060,848.19
可供出售金融资产公允价值变动	-25,412,806.82	20,703,406.83		-4,709,399.99
其他资本公积	485,904.56	-	-	485,904.56
合 计	4,240,133,945.93	20,703,406.83	-	4,260,837,352.76

资本公积 2012 年 1-6 月增加 20,703,406.83 元，系公司按可供出售金融资产期末公允价值调整所致。

5.25 盈余公积

项 目	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
法定盈余公积	103,449,266.62	-	-	103,449,266.62
任意盈余公积	-	-	-	-
合 计	103,449,266.62	-	-	103,449,266.62

5.26 一般风险准备

项 目	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
一般风险准备	234,446,692.74	-	-	234,446,692.74
合 计	234,446,692.74	-	-	234,446,692.74

5.27 交易风险准备

项 目	2011-12-31	本期增加金额	本期减少金额	2012-6-30
交易风险准备	218,282,739.32	-	-	218,282,739.32
合 计	218,282,739.32	-	-	218,282,739.32

5.28 未分配利润

项 目	2012-6-30	2011-12-31
期初未分配利润	593,431,060.44	582,011,220.31
加：归属于母公司所有者的净利润	135,217,353.43	231,514,459.76
减：法定盈余公积	-	23,364,873.21
一般风险准备	-	23,364,873.21
交易风险准备	-	23,364,873.21
普通股股利	160,000,000.00	150,000,000.00
净资产折股	-	-
期末未分配利润	568,648,413.87	593,431,060.44

2012 年 5 月 15 日经公司 2011 年年度股东大会会议决议通过 2011 年度利润分配方案，以审计后的净利润为基准，按 10%的比例计提法定盈余公积、按 10%的比例计提交易风险准备、按 10%的比例计提一般风险准备、按每 10 股派送 0.80 元现金红利（含税）。

5.29 少数股东权益

项 目	2012-6-30	2011-12-31
上年期末余额	57,984,844.95	58,910,704.30
加：会计政策变更	-	-
本年期初余额	57,984,844.95	58,910,704.30
所有者投入资本	-	-
本年净利润	3,960,034.72	4,174,140.65
利润分配	2,550,000.00	5,100,000.00
期末余额	59,394,879.67	57,984,844.95

5.30 手续费及佣金净收入

(1) 项目明细

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
手续费及佣金收入	440,905,932.16	880,594,323.09
——代理买卖证券业务收入	390,436,651.74	559,099,649.33
其中：经纪业务席位收入	2,350,382.80	11,173,315.26
期货经纪业务收入	52,551,910.32	36,094,696.59
融资融券业务收入	164,887.01	-
——代理销售金融产品收入	1,426,490.66	1,508,274.93
——证券承销业务佣金收入	22,655,000.00	234,419,549.95
——保荐业务收入	3,000,000.00	75,350,000.00
——财务顾问业务收入	19,167,113.84	6,321,190.24
——投资咨询服务收入	226,104.00	-
——受托客户资产管理业务收入	2,823,234.18	3,388,075.47
——其他手续费及佣金收入	1,171,337.74	507,583.17
手续费及佣金支出	83,807,464.78	103,084,636.67
——代理买卖证券业务支出	81,770,237.71	98,701,206.15
其中：经手费、规费、结算费等	59,234,861.04	83,470,385.37
其中：融资融券业务支出	24,738.23	-
第三方存管费	5,270,853.93	9,857,630.97
证券经纪人报酬支出	17,264,522.74	5,373,189.81
期货经纪业务支出	-	-
——证券承销业务支出	-	2,547,000.00
——保荐业务支出	-	-
——财务顾问业务支出	-	-
——投资咨询业务支出	-	-
——受托客户资产管理业务支出	374,565.33	376,610.52
——代销手续费及其他支出	1,662,661.74	1,459,820.00
手续费及佣金净收入	357,098,467.38	777,509,686.42

(2) 按区域划分的手续费及佣金净收入

	2012年1-6月	
	机构数量	金 额
江苏省内	40	248,827,045.02
江苏省外	25	59,120,931.74
总部及子公司		49,150,490.62
合 计	65	357,098,467.38

截止 2012 年 6 月 30 日证券公司所属营业部 53 家，期货公司所属营业部 12 家。

(3) 代理买卖证券业务净收入

①代理买卖证券业务净收入按类别列示

	2012年1-6月	2011年1-6月
证券经纪业务净收入	256,114,503.71	424,303,746.59
期货经纪业务净收入	52,551,910.32	36,094,696.59
合 计	308,666,414.03	460,398,443.18

②证券经纪业务净收入按区域划分

	2012年1-6月	
	机构数量	金 额
江苏省内	33	230,452,426.72
江苏省外	20	25,662,076.99
合 计	53	256,114,503.71

(4) 财务顾问业务净收入

项目	2012年1-6月	2011年1-6月
财务顾问业务收入		
并购重组财务顾问业务收入--境内上市公司	-	250,000.00
并购重组财务顾问业务收入--其他	-	-
其他财务顾问业务收入	19,167,113.84	6,071,190.24
财务顾问业务收入小计	19,167,113.84	6,321,190.24
财务顾问业务支出		
并购重组财务顾问业务支出--境内上市公司	-	-
并购重组财务顾问业务支出--其他	-	-
其他财务顾问业务支出	-	-
财务顾问业务支出小计	-	-
财务顾问业务净收入	19,167,113.84	6,321,190.24

(5) 受托客户资产管理手续费及佣金净收入

	2012年1-6月	2011年1-6月
受托客户资产管理业务收入		

定向资产管理业务	20,490.72	-
专项资产管理业务	-	-
集合资产管理业务	2,802,743.46	3,388,075.47
小 计	2,823,234.18	3,388,075.47
受托客户资产管理业务支出		
定向资产管理业务	-	-
专项资产管理业务	-	-
集合资产管理业务	374,565.33	376,610.52
小 计	374,565.33	376,610.52
受托客户资产管理业务净收入	2,448,668.85	3,011,464.95

5.31 利息净收入

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
利息收入	148,605,877.19	104,457,694.26
——存放金融同业利息收入	140,527,812.96	104,127,227.52
——资金拆借利息收入	-	-
——债券回购利息收入	7,992,377.93	311,457.08
——融资融券利息收入	85,686.30	-
——其他利息收入	-	19,009.66
利息支出	31,832,080.50	38,231,313.52
——客户存放资金利息支出	15,640,493.18	26,451,428.18
——资金拆借利息支出	46,000.00	-
——债券回购利息支出	16,145,587.32	6,979,766.31
——债券利息支出	-	4,800,000.00
——其他利息支出	-	119.03
利息净收入	116,773,796.69	66,226,380.74

5.32 投资收益

① 投资收益明细情况

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
成本法核算的长期股权投资收益	1,689,233.44	-
权益法核算的长期股权投资收益	6,099,379.47	5,996,753.05
持有交易性金融资产期间取得的投资收益	11,043,491.36	21,374,100.73
持有可供出售金融资产间取得的投资收益	17,043,603.49	36,572,251.84
持有至到期投资持有期间取得的投资收益	34,698,584.43	-
出售交易性金融资产取得的投资收益	19,755,187.05	26,553,687.04
出售可供出售金融资产取得的投资收益	-849,052.57	-
出售持有至到期投资取得的投资收益	50,386.13	-
衍生金融工具投资收益	-7,510,439.60	15,591,581.25

合 计	82,020,373.20	106,088,373.91
②按成本法核算的长期股权投资收益		
项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
江苏银行股份有限公司	602,285.44	-
重庆乌江实业(集团)股份有限公司	1,000,000.00	-
四川华体灯业有限公司	86,948.00	-
合 计	1,689,233.44	-
③按权益法核算的长期股权投资收益:		
项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
东吴基金有限公司	6,100,528.18	5,997,987.82
许昌市绿野农业科技有限公司	-1,148.71	-1,234.77
合 计	6,099,379.47	5,996,753.05

本期不存在重大限制的投资收益汇回事项。

5.33 公允价值变动收益

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
交易性金融资产	104,333,631.17	-35,829,098.13
衍生金融工具	-2,983,440.00	-
合 计	101,350,191.17	-35,829,098.13

5.34 其他业务收入

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
其他业务收入	273,506.06	8,128,918.89
——房屋租赁收入	157,000.00	22,000.00
——其他收入	116,506.06	8,106,918.89
其他业务支出	-	-
——其他支出	-	-
其他业务收入净额	273,506.06	8,128,918.89

5.35 营业税金及附加

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
营业税	23,327,256.11	43,591,102.91
城市维护建设税	1,627,215.01	2,968,949.19
教育费附加	1,171,459.09	2,035,909.87
其他	23,323.44	17,787.98
合 计	26,149,253.65	48,613,749.95

5.36 业务及管理费用

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
业务及管理费	444,416,385.93	578,568,174.57

本公司业务及管理费前 10 名明细如下：

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
职工工资	154,262,281.57	263,342,624.71
租赁费及物业费	33,890,340.77	30,522,268.95
咨询费	30,575,411.76	29,555,758.26
社会保险费	25,573,280.54	17,816,916.55
业务宣传费	24,916,070.69	13,703,682.65
固定资产折旧费	19,556,821.99	17,803,709.36
职工福利与工会经费	14,239,567.85	13,578,758.80
差旅费	12,927,473.50	24,916,352.10
业务营销费	12,062,756.17	22,750,583.77
长期待摊费用摊销	11,901,328.95	10,549,360.84

5.37 营业外收入

项 目	2012年1-6月	其中：计入当期 损益的金额	2011年1-6月
固定资产清理收入	5,517.39	5,517.39	3,515.00
无需支付的应付款清理	-	-	877,449.92
补贴及奖励收入	2,698,296.00	2,698,296.00	8,060,000.00
其他	330,482.62	330,482.62	51,956.82
合 计	3,034,296.01	3,034,296.01	8,992,921.74

补贴及奖励收入明细：

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
企业扶持金	1,500,000.00	8,000,000.00
其他补贴及奖励	1,198,296.00	60,000.00
合 计	2,698,296.00	8,060,000.00

5.38 营业外支出

项 目	2012年1-6月	其中：计入当期非 经常性损益的金额	2011年1-6月
处理固定资产损失	56,676.50	56,676.50	75,448.07
捐赠支出	340,000.00	340,000.00	205,000.00
市场物价及粮食风险基金	7,065.72	7,065.72	-
计提各项基金及其他支出	207,529.14	207,529.14	423,240.29
其他	3,107.56	3,107.56	9,796.25

合 计	614,378.92	614,378.92	713,484.61
-----	------------	------------	------------

5.39 所得税费用			
项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	
当期所得税费用	25,617,033.77	84,811,524.68	
递延所得税费用	24,608,579.55	-8,408,934.41	
合 计	50,225,613.32	76,402,590.27	

5.40 其他综合收益

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
1.可供出售金融资产产生的利得（损失）金额	-6,279,199.99	-1,436,186.12
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	-1,569,800.00	-359,046.54
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	-25,412,806.82	2,846,110.93
小 计	20,703,406.83	-3,923,250.51
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	-	-
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	-	-
其他	-	-
合 计	20,703,406.83	-3,923,250.51

5.41 现金流量项目分析

（1）收到其他与经营活动有关的现金

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
补贴及奖励	2,698,296.00	8,060,000.00
管理顾问费	2,500,000.00	8,000,000.00
存出保证金增加额	156,783,884.58	-
其他	287,479.68	1,011,840.63
合 计	162,269,660.26	17,071,840.63

（2）支付其他与经营活动有关的现金

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
存出保证金	-	53,956,617.96
投资者保护基金	9,792,722.13	19,008,089.21
物业及租赁费	33,890,343.77	30,522,268.95
公杂费	10,061,724.96	17,006,901.01
会议费	6,065,268.29	8,210,053.66

咨询费	30,575,411.76	29,555,758.26
差旅费	12,927,473.50	24,916,352.10
业务营销费	14,165,009.05	22,750,583.77
业务宣传费	24,916,070.69	13,703,682.65
其他	42,397,942.30	80,944,924.16
合 计	184,791,966.45	300,575,231.73

(3) 现金流量表补充资料

1、将净利润调节为经营活动现金流量

项 目	2012年 1-6月	2011年 1-6月
净利润	139,177,388.15	226,637,122.82
资产减值准备及风险准备	2,702,695.51	-
固定资产折旧	19,556,821.99	17,803,709.36
无形资产摊销	5,169,029.08	4,262,383.45
长期待摊费用摊销	11,901,328.95	10,644,638.74
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益)	51,093.92	5,763.27
固定资产报废损失	-	-
公允价值变动损失	-101,289,380.55	35,829,098.13
财务费用(减:收益)	-32,389.46	182,061.35
投资损失(减:收益)	-48,234,058.57	-106,088,373.91
递延所得税资产减少(减:增加)	25,856,203.57	-8,463,568.04
递延所得税负债增加(减:减少)	6,745,774.51	-1,253,116.55
交易性金融资产减少	-1,163,676,703.67	-1,907,537,255.72
经营性应收项目的减少(减:增加)	358,196,825.82	-427,859,829.00
经营性应付项目的增加(减:减少)	-601,447,808.29	-4,878,442,951.63
合 计	-1,345,323,179.04	-7,034,280,317.73

2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动

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	8,711,252,050.49	9,568,541,963.90
减: 现金的年初余额	11,183,513,348.84	16,933,078,426.21
加: 现金等价物的期末余额	-	-
减: 现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	-2,472,261,298.35	-7,364,536,462.31

(4) 现金及现金等价物

项 目	2012年 1-6月	2011年 1-6月
一、现金	8,711,252,050.49	9,568,541,963.90

其中：库存现金	198,091.30	315,030.45
可随时用于支付的银行存款	8,102,174,920.13	9,082,238,428.60
可随时用于支付的结算备付金	608,187,892.18	485,988,504.85
其他货币资金	691,146.88	-
二、现金等价物	-	-
三、期末现金及现金等价物余额	8,711,252,050.49	9,568,541,963.90

2012年1-6月现金及现金等价物净减少额为2,472,261,298.35元，比上年同期减少4,892,275,163.96元，主要原因为：

(1) 经营活动产生现金流量净额为-1,345,323,179.04元，较上年同期减少5,688,957,138.69元，主要原因代买卖证券款净流出较上年同期减少了4,509,957,031.44元所致。

(2) 投资活动产生的现金流量净额为-964,420,508.77元，较上年同期增加489,446,425.54元，主要原因是2012年1-6月配置可供出售金融资产及子公司对外投资增加所致。

(3) 筹资活动产生的现金流量净额为-162,550,000.00元，较上年同期减少-307,450,000.00元，主要原因是公司上年同期发行次级债所致。

5.42 受托资产管理

公司受托资产管理业务独立建账、独立核算，相关资产、负债、净资产、收入和费用等，均按照新企业会计准则的规定进行确认、计量和报告。不在本公司财务报表内列示。

报告期内受托资产管理业务的资产负债情况如下：

2012年1-6月

资产项目	2012年6月30日	2011年12月31日	负债项目	2012年6月30日	2011年12月31日
受托管理银行存款	-	-	受托管理资金	893,287,110.18	496,453,254.49
客户结算备付金	-	-	应付款项	1,519,979.73	20,266,402.32
存出与托管客户资金	25,004,078.88	5,501,021.86			
应收帐款	127,053,855.96	74,433,334.42			
受托投资	742,749,155.07	436,785,300.53			
其中：投资成本	600,931,368.67	291,045,032.84			
已实现未结算损益	141,817,786.40	145,740,267.69			
合 计	894,807,089.91	516,719,656.81	合 计	894,807,089.91	516,719,656.81

附注 6、分部报告

2012 年 1-6 月经营分部信息

	证券经纪业务	投资银行业务	自营投资业务	受托资产管理	期货经纪业务	公司总部及其他	合并抵销	合 计
营业收入	298,356,167.28	42,322,113.84	167,951,597.76	2,732,664.78	66,138,673.93	87,497,506.37	-7,450,000.00	657,548,723.96
其中：手续费及佣金净收入	257,275,774.37	42,322,113.84	-	2,448,668.85	52,551,910.32	2,500,000.00	-	357,098,467.38
投资收益	-	-	75,914,866.57	-	-1,683,106.28	15,238,612.91	-7,450,000.00	82,020,373.20
其他收入（含公允价 值变动）	41,080,392.91	-	92,036,731.19	283,995.93	15,269,869.89	69,758,893.46	-	218,429,883.38
营业支出	215,846,978.14	95,354,240.13	18,401,103.21	6,362,183.79	46,097,550.64	88,503,583.67	-	470,565,639.58
利润/（亏损）	82,730,757.34	-53,032,204.29	149,560,494.55	-3,629,519.01	20,714,602.84	508,870.04	-7,450,000.00	189,403,001.47
资产总额	5,966,335,281.14	5,530,049.41	2,600,109,125.95	39,982,946.66	1,187,719,269.71	6,603,669,500.50	-1,090,080,502.65	15,313,265,670.72
负债总额	5,850,668,180.48	18,145,096.29	979,267,188.98	1,523,901.88	954,798,172.95	105,426,375.45	-41,622,590.29	7,868,206,325.74
折旧费用	14,168,561.48	321,132.56	161,377.04	84,199.66	1,315,238.44	3,506,312.81	-	19,556,821.99

2011年1-6月经营分部信息

	证券经纪业务	投资银行业务	自营投资业务	受托资产管理	期货经纪业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
营业收入	470,309,463.68	313,543,740.19	60,070,000.00	3,930,870.86	45,175,890.02	45,481,542.83	-16,569,307.10	921,942,200.48
其中：手续费及佣金净收入	424,303,746.59	313,543,740.19		3,011,464.95	37,764,003.69	556,038.10	-1,669,307.10	777,509,686.42
投资收益			99,415,992.13		675,628.73	20,896,753.05	-14,900,000.00	106,088,373.91
其他收入（含公允价值变动）	46,005,717.09	-	-39,345,992.13	919,405.91	6,736,257.60	24,028,751.68	-	38,344,140.15
营业支出	255,234,217.73	217,694,341.90	13,809,718.81	5,253,883.08	37,000,175.39	99,858,894.70	-1,669,307.10	627,181,924.52
利润/（亏损）	219,544,880.20	96,726,065.21	46,259,588.19	-1,323,012.22	8,215,331.07	-51,483,139.35	-14,900,000.00	303,039,713.09
资产总额	8,578,058,738.34	3,777,893.78	4,063,759,425.07	41,793,559.09	1,367,986,173.14	1,317,251,262.78	-	15,372,627,052.20
负债总额	8,450,331,938.28	118,105,545.24	734,801,698.46	879,593.38	1,150,785,271.22	604,559,114.74	-	11,059,463,161.32
折旧费用	13,036,604.73	198,626.84	79,314.30	83,547.06	1,256,740.45	3,148,875.98	-	17,803,709.36

附注 7、关联方关系及其交易

7.01 关联方关系

(1) 第一大股东持股情况如下 (单位: 人民币万股):

关联方名称	关联 方关 系	2012 年 6 月 30 日			2011 年 12 月 31 日		
		持股数	持股比例	表决权比例	持股数	持股比 例	表决权比 例
苏州国际发展集团有限公司	股东	60,440.7433	30.22%	30.22%	60,440.7433	30.22%	30.22%

本公司第一大股东概况

关联方名称	注册地	主营业务	与公司关系	经济 性质	法定 代表人	存在控制关 系的期间
苏州国际发展集团有限公司	中国苏州	授权范围的国有资 产经营管理,国内商 业、物资供销业(国 家规定的专营、专项 审批商品除外),提 供各类咨询服务。	控股股东	有限 责任	黄建林	2006 年起

报告期本公司的第一大股东注册资本及其变化

企业名称	2011 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2012 年 6 月 30 日
苏州国际发展集团有限公司	100,000 万元	-	-	100,000 万元

受本公司第一大股东控制的其他股东所持股份或权益及其变化

企业名称	2012 年 6 月 30 日			2011 年 12 月 31 日		
	金额	持股比例	表决权比例	金额	持股比例	表决权比例
苏州市营财投资集团公司	6,457.8554 万股	3.23%	3.23%	6,457.8554 万股	3.23%	3.23%
苏州信托有限公司	5,312.0000 万股	2.66%	2.66%	5,312.0000 万股	2.66%	2.66%

苏州国际发展集团有限公司及其控制的其他股东合计持有公司 36.11% 股份。

(2) 持有本公司 5% 以上 (含 5%) 股份的其他股东

企业名称	2012 年 6 月 30 日			2011 年 12 月 31 日		
	金额	持股比例	表决权比例	金额	持股比例	表决权比例
苏州创业投资集团有限公司	11,958.9916 万股	5.98%	5.98%	11,958.9916 万股	5.98%	5.98%

持有本公司 5% 以上 (含 5%) 股份股东的一致行动人所持股份或权益及其变化

企业名称	2012 年 6 月 30 日			2011 年 12 月 31 日		
	金额	持股比例	表决权比例	金额	持股比例	表决权比例
苏州工业园区国有资产控股 发展有限公司	6,183.2770 万股	3.09%	3.09%	6,183.2770 万股	3.09%	3.09%
苏州工业园区经济发展有限 公司	717.5395 万股	0.36%	0.36%	717.5395 万股	0.36%	0.36%

(3) 本公司联营企业

直接持有:

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	实际投资额	持股比例	表决权比例	是否合并
东吴基金管理 有限公司	上海浦东源深 路 279 号	基金管理业务、发起设立基金和 经中国证监会批准的其他业务	10,000 万	4,900 万	49.00%	49.00%	否

间接持有:

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	实际投资额	持股比例	表决权比例	是否合并
许昌市绿野农 业科技有限公 司	许昌市魏都民 营科技园区管 委会办公楼	农产品的种植及销售(不含粮油 销售)	1,590 万	656.88 万	35.00%	35.00%	否

注: 许昌市绿野农业科技有限公司为本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资的联营企业。

(4) 其他关联企业

企业名称	与本公司关系	注册号
苏州国发创业投资控股有限公司	受第一大股东控制	320200000059879
苏州国发高新创业投资管理有限公司	受第一大股东间接控制	320512000091268
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	受第一大股东间接控制	320506000147812
昆山市创业控股有限公司	股东	320583000008825

7.02 与关联方的交易事项

(1) 手续费及佣金收入

①本公司股东

企业名称	2012 年 1-6 月		2011 年 1-6 月	
	金额	比例	金额	比例
苏州国际发展集团有限公司	5,000.00	0.00	-	-
苏州信托有限公司	92,023.22	0.00	-	-
合 计	97,023.22	0.00	-	-

②第一大股东直接、间接控制的企业

企业名称	2012 年 1-6 月		2011 年 1-6 月	
	金额	比例	金额	比例
苏州国发创业投资控股有限公司	-	0.00	1,291.05	0.00
合 计	-	0.00	1,291.05	0.00

(2) 利息支出

①本公司股东

企业名称	2012 年 1-6 月		2011 年 1-6 月	
	金额	比例	金额	比例

苏州国际发展集团有限公司	-	-	0.02	0.00
苏州市营财投资集团公司	216.96	0.00	11.84	0.00
苏州信托有限公司	51,419.04	0.00	-	-
合 计	51,636.00	0.00	11.86	0.00

② 第一大股东直接、间接控制的企业

企业名称	2012年1-6月		2011年1-6月	
	金额	比例	金额	比例
苏州国发创业投资控股有限公司	17,131.87	0.00	15,982.75	0.00
苏州国发高新创业投资管理有限公司	165.96	0.00	-	-
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	87.16	0.00	-	-
合 计	17,384.99	0.00	15,982.75	0.00

(3) 支付房屋租赁费

企业名称	2012年1-6月	2011年1-6月
苏州国际发展集团有限公司	545,000.00	540,000.00
昆山市创业控股有限公司	1,460,000.04	1,386,669.36
合计	2,005,000.04	1,926,669.36

(4) 期末持有由东吴证券股份有限公司作为管理人募集设立的集合资产管理计划情况如下:

企业名称	项 目	数量(份)	期末净值
苏州国际发展集团有限公司	东吴财富1号集合资产管理计划	1,194,144.00	746,817.66
苏州国际发展集团有限公司	东吴财富3号集合资产管理计划	995,585.00	1,001,658.07
苏州市营财投资集团公司	东吴财富1号集合资产管理计划	1,990,260.00	1,244,708.60
合 计			2,993,184.33

(5) 公司向东吴基金管理有限公司出租交易席位收取佣金:

基金项目	2012年1-6月	2011年1-6月
东吴价值成长双动力股票型证券投资基金	304,412.43	2,456,791.41
东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金	410,536.07	735,099.14
东吴行业轮动股票型证券投资基金	193,090.03	613,543.95
东吴优信稳健债券型证券投资基金	969.88	54,372.30
东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金	-	588,592.73
东吴新经济股票型证券投资基金	78,401.35	100,680.43
东吴新创业股票型证券投资基金	7,904.61	40,106.84
东吴新产业精选股票型证券投资基金	384,183.02	-
东吴增利债券型证券投资基金	142.19	-
东吴中证新兴产业指数证券投资基金	307,857.76	751,009.41
东吴深证100指数增强型证券投资基金	191,386.70	-

(6) 截止2012年6月30日公司持有东吴基金管理有限公司旗下证券投资基金情况:

基金项目	数量（份）	初始成本	公允价值
东吴增利债券型基金	19,999,000	19,999,000	21,158,942.00

(7) 公司为东吴基金管理有限公司代理销售金融产品收取佣金：

	2012年1-6月	2011年1-6月
代理销售金融产品收取佣金	78,879.44	965,038.79

(8) 截止 2012 年 6 月 30 日公司董事、监事、高级管理人员购买公司集合理财产品合计 220.18 万元。

(9) 本公司与关联方的交易主要参考市场价格确定。

附注 8、或有事项

截止 2012 年 6 月 30 日，本公司下属控股子公司——东吴期货有限公司未决诉讼情况如下：

东吴期货厦门营业部客户刘振会与东吴期货侵权纠纷一案，客户刘振会请求赔偿交易亏损及退还手续费合计 380,146.87 元，2010 年 10 月 19 日在厦门市中级人民法院开庭审理，2010 年 12 月 10 日，厦门市中级人民法院做出一审判决，驳回刘振会诉讼请求。刘振会 2011 年 1 月 6 日提出上诉。福建省高级人民法院 4 月 6 日开庭审理了本案，并于 5 月 30 日以事实不清为理由裁定撤销厦门市中级人民法院判决，发回该院重审。福建省厦门市中级人民法院已于 8 月 16 日开庭审理，并于 10 月 26 日作出判决：东吴期货赔偿原告亏损 24,302.06 元，并由公司承担案件受理费 448 元。刘振会不服判决，向福建省厦门市中级人民法院递交上诉状，上诉于福建省高级人民法院。2012 年 2 月 10 日，福建省高级人民法院开庭审理此案，目前还未收到法院判决书。

东吴期货大连客户徐健军与公司合同纠纷一案，由大连仲裁委员会受理，客户 2010 年 3 月申请仲裁要求返还 100 万元保证金，另索赔 30 万元，实际亏损 66.65 万元，公司已返还客户 33.35 万元保证金。大连仲裁委员会于 2012 年 2 月 17 日开庭审理了本案，未做判决。目前还未收到大连仲裁委有关下一步审理进程的信息。

附注 9、承诺事项

存在于 2012 年 6 月 30 日各项承诺事项如下：

9.01 资本性支出承诺事项

截止 2012 年 6 月 30 日公司在建证券大厦正在履行的合同总额为 6.05 亿元，已支付工程建造款 2.54 亿元、土地使用权的款项 1.02 亿元。

9.02 经营租赁承诺事项

根据已签订的不可撤销的经营性租赁合同，本公司未来最低应支付租金汇总如下：

	2012年6月30日
1年以内	38,270,870.56
1-2年	29,283,233.38
2-3年	26,210,126.98
3年以上	29,848,678.99
合 计	123,612,909.91

9.03 对外资产质押承诺

本公司部分债券（其中包含买断式回购的债券）被用作卖出回购等业务的质押物。于各资产负债表日，期末质押余额及到期日如下：

	2012年6月30日	质押到期日
卖出回购证券协议	1,321,750,133.42	
其中：交易性金融资产	564,749,917.89	2012年6月20日至2012年7月11日
可供出售金融资产	757,000,215.53	2012年6月20日至2012年7月9日

	2011年12月31日	质押到期日
卖出回购证券协议	718,950,000.00	2012年1月3日至2012年1月18日

附注 10、风险管理

本公司经营活动面临的主要风险包括：流动性风险、信用风险、市场风险。

10.01 流动性风险

流动性风险是指公司无力为负债的减少和/或资产的增加提供融资而造成损失或破产的风险。

本公司的负债主要系代买卖证券款，目前已实施三方存管，由托管银行负责监控，本公司不得挪用，因此，该负债不构成本公司流动性风险。

本公司资金需求主要是体现为日常运营资金需求、自营股票投资需求、固定资产采购与对外投资、债券投资和债券回购等，由于本公司的流动资产绝大部分为货币资金，因此有能力支付可预见的到期债务或承诺。本公司资金实行统一管理，由财务部负责日常资金的预测与规划工作，自营证券规模由公司董事会确定，规模较大资金筹集与运用需通过预先申请，经营班子集体讨论等程序。本年度公司自有资金较充裕，流动性风险较小。

10.02 信用风险

信用风险是指本公司客户（或交易对手）未能履行合同所规定的义务，或信用质量发生变化影响金融工具价值，从而给本公司带来损失的风险。本公司信用风险主要存在于债券投资违约风险及下属期货公司中。

本公司债券投资主要交易品种为企业和金融债，整体信用较高，违约率低，信用风险不大。

本公司下属东吴期货有限公司经营期货经纪业务，按照相关规定按风险比例收取交易保证金。该公司设置风险管理部门对交易保证金实施实时监控，必要时可要求客户追加保证金或强制平仓等手段控制相关风险。

10.03 市场风险

市场风险是指利率、汇率以及其他市场因素变动而引起金融工具的价值变化，进而对未来收益或者未来现金流量可能造成潜在损失的风险。影响本公司业务的市场风险主要包括市场价格风险、利率风险与汇率风险。

①市场价格风险是指本公司所持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本公司主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券和权证等，所面临的最大的市场风险为公允价值的变动。②外汇风险

从 2005 年 7 月 21 日起，我国开始实行以市场供求为基础、参考一篮子货币进行调节、有管理的浮动汇率制度。新的人民币汇率形成机制更加市场化也更富有弹性，同时也使金融业面临更大的汇率风险。汇率波动的时间差、地区差以及币种和期限结构不匹配等因素均可能产生风险。

本公司面临的汇率风险主要包括交易风险和折算风险。交易风险指在运用外币进行计价收取的交易费时，银行因汇率变动而蒙受损失的可能性。折算风险是指银行将外币转换成记账本位币时，因汇率变动而呈现账面损失的可能性。

本公司持有的外币资产及负债比重较小，现阶段外汇业务规模较小，汇率风险对本公司经营和收益的影响也相对较小。

③利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本公司持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性债券投资与买入返售金融资产。

本公司通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

10.04 金融资产和金融负债的账面价值

本公司货币资金、结算备付金、存出保证金、其它资产大部分于 1 年内到期，账面价值接近于公允价值。

交易性金融资产以公开市场报价确定公允价值，没有公开市场报价的，其公允价值依据公认的估值模型确认。

可供出售金融资产以公开市场报价确定公允价值，没有公开市场报价的，其公允价值依据公认的估值模型确认。

附注 11、以公允价值计量的资产和负债

	本期公允价值变动		计入权益的累计		2012年6月30日
	2011年12月31日	损益	公允价值变动	计提的减值准备	
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）	1,147,492,741.22	104,333,631.17	-	-	2,432,809,666.00
衍生金融资产	-	-2,983,440.00	-	-	-
可供出售金融资产	216,550,831.70	-	20,703,406.83	-	1,878,913,012.22
金融资产小计	1,364,043,572.92	101,350,191.17	20,703,406.83	-	4,311,722,678.22
投资性房地产	-	-	-	-	-
上述合计	1,364,043,572.92	101,350,191.17	20,703,406.83	-	4,311,722,678.22
金融负债	-	-	-	-	-

附注 12、母公司财务报表主要项目注释

12.01 长期股权投资

2012 年 1-6 月增减变动:

项 目	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
对子公司投资	456,450,000.00	600,000,000.00	-	1,056,450,000.00
按权益法核算的联营企业投资	84,052,558.37	6,100,528.18	-	90,153,086.55
按成本法核算的联营企业投资	5,225,180.00	-	-	5,225,180.00
合 计	545,727,738.37	606,100,528.18	-	1,151,828,266.55
长期投资减值准备	-	-	-	-
长期股权投资净值	545,727,738.37	606,100,528.18	-	1,151,828,266.55

(1) 对子公司投资

2012 年 1-6 月增减变动:

项 目	持股比例	表决权比例	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
东吴期货有限公司	74.50%	74.50%	156,450,000.00	-	-	156,450,000.00
东吴创业投资有限公司	100.00%	100.00%	300,000,000.00	300,000,000.00	-	600,000,000.00
东吴创新资本管理有 限公司	100.00%	100.00%	-	300,000,000.00	-	300,000,000.00
合 计			456,450,000.00	600,000,000.00	-	1,056,450,000.00

(2) 按权益法核算的长期股权投资

2012 年 1-6 月增减变动:

项 目	持股比例	表决权比例	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
东吴基金管理有限公司	49.00%	49.00%	84,052,558.37	6,100,528.18	-	90,153,086.55

——投资成本	49,000,000.00	-	-	49,000,000.00
——损益调整	35,052,558.37	6,100,528.18	-	41,153,086.55

(3) 按成本法核算的长期股权投资

2012年1-6月增减变动:

项 目	持股比例	表决权比例	2011-12-31	本期增加	本期减少	2012-6-30
江苏银行	0.08%	0.08%	5,225,180.00	-	-	5,225,180.00
合 计			5,225,180.00	-	-	5,225,180.00

报告期内被投资单位经营正常,近期内不会出现可收回金额低于账面价值的情况,不需计提长期投资减值准备。

(4) 本期现金股利

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
江苏银行股份有限公司	602,285.44	-
东吴期货有限公司	7,450,000.00	14,900,000.00
合 计	8,052,285.44	14,900,000.00

12.02 其他资产

项 目	2012-6-30	2011-12-31
应收款项	31,347,611.36	40,847,455.92
待摊费用	9,888,993.80	9,888,467.19
长期待摊费用	58,972,026.13	63,792,152.95
商誉	11,749,999.80	11,749,999.80
融出资金	27,766,893.29	-
合 计	139,725,524.38	126,278,075.86

(1) 应收款项

①应收款项账龄情况:

账 龄	2012-6-30	2011-12-31
1年以内	26,586,958.41	37,406,380.92
1~2年	4,760,652.95	3,441,075.00
合计	31,347,611.36	40,847,455.92
坏账准备	-	-
应收款项净额	31,347,611.36	40,847,455.92

②期末主要账户:

往来单位名称	金额	账龄	坏账金额	款项性质
沈阳远大铝业工程有限公司上海分公司	4,000,000.00	1年以内	-	幕墙及穹顶工程预付款

江苏省电力公司苏州供电公司	3,358,640.76	1-2 年	-	预付东吴大厦工程款及电费
苏州通源电器有限公司	2,260,665.60	1 年以内	-	低压柜设备预付款
苏州工业园区商业旅游发展有限公司	1,725,426.00	1 年以内	-	房租押金
北京恒奥房地产开发有限公司	1,214,205.00	1-2 年	-	装修预付款
合计	12,558,937.36			

③期末应收款项中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

(2) 待摊费用

项 目	2012-6-30	2011-12-31
房租	5,749,230.37	9,888,467.19
其他	4,139,763.43	-
合 计	9,888,993.80	9,888,467.19

(3) 长期待摊费用

2012 年 1-6 月增减变动情况

项 目	取得方式	原始金额	2011-12-31	本期增加	本期摊销	2012-6-30	剩余摊销年限
装修费	购入	103,004,126.34	43,396,092.33	6,029,353.40	7,896,035.67	41,529,410.06	1-60 月
网络工程	购入	17,234,238.84	9,363,373.59	51,085.44	1,361,533.87	8,052,925.16	1-60 月
办公家具	购入	10,544,522.85	5,226,643.20	8,096.05	840,922.52	4,393,816.73	3-54 月
水电增容	购入	5,269,597.16	2,766,966.09	-	512,774.82	2,254,191.27	4-54 月
消防工程	购入	6,774,857.73	3,039,077.74	162,110.00	459,504.83	2,741,682.91	1-58 月
合 计		142,827,342.92	63,792,152.95	6,250,644.89	11,070,771.71	58,972,026.13	

(4) 商誉

项 目	2012-6-30	2011-12-31
商 誉	11,749,999.80	11,749,999.80

系受让营业部支付的超过该公司可辨认净资产公允价值的金额。

截止 2012 年 6 月 30 日商誉无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提减值准备。

(5) 融出资金

项 目	2012-6-30	2011-12-31
融出资金	27,766,893.29	-

12.03 投资收益

①投资收益明细情况

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
成本法核算的长期股权投资收益	8,052,285.44	14,900,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	6,100,528.18	5,997,987.82

持有交易性金融资产期间取得的投资收益	11,043,491.36	20,688,348.37
持有可供出售金融资产间取得的投资收益	17,043,603.49	-
持有至到期投资持有期间取得的投资收益	33,333,243.87	-
出售交易性金融资产取得的投资收益	22,803,633.89	36,582,375.47
出售可供出售金融资产取得的投资收益	-849,052.57	26,553,687.04
出售持有至到期投资取得的投资收益	50,386.13	-
衍生金融工具投资收益	-7,510,439.60	15,591,581.25
合 计	90,067,680.19	120,313,979.95

②按成本法核算的长期股权投资收益

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
江苏银行股份有限公司	602,285.44	-
东吴期货有限公司	7,450,000.00	14,900,000.00
合 计	8,052,285.44	14,900,000.00

③按权益法核算的长期股权投资收益:

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
东吴基金有限公司	6,100,528.18	5,997,987.82
合 计	6,100,528.18	5,997,987.82

12.04 公允价值变动收益

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
交易性金融资产	101,302,850.49	-32,562,172.41
衍生金融工具	-2,983,440.00	-1,944,513.73
合 计	98,319,410.49	-34,506,686.14

12.05 现金流量项目分析

(1) 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
存出保证金增加额	55,825,331.39	-
补贴及奖励收入	1,998,296.00	8,060,000.00
其他	282,035.06	1,009,883.81
合 计	58,105,662.45	9,069,883.81

(2) 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	2012年1-6月	2011年1-6月
存出保证金减少额	-	14,923,850.34
投资者保护基金	8,784,126.99	17,673,953.29
物业及租赁费	30,267,804.90	27,276,129.12
公杂费	9,940,387.60	17,006,901.01

会议费	4,950,311.75	7,752,867.16
咨询费	26,361,482.12	27,177,117.98
差旅费	10,786,344.35	22,932,730.31
业务营销费	12,062,756.17	22,750,583.77
业务宣传费	23,022,521.69	12,619,707.05
其他	37,006,521.05	69,944,929.09
合 计	163,182,256.62	240,058,769.12

(3) 现金流量表补充资料

1、将净利润调节为经营活动现金流量

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
净利润	131,035,494.47	232,430,463.92
资产减值准备	-	-
固定资产折旧	18,169,402.59	16,500,028.33
无形资产摊销	4,888,839.91	4,262,383.45
长期待摊费用摊销	11,070,771.71	9,926,374.84
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益)	26,259.76	-
固定资产报废损失	-	-
公允价值变动损失	-98,319,410.49	34,506,686.14
财务费用(减:收益)	-32,389.46	182,061.35
投资损失(减:收益)	-56,220,554.94	-120,313,979.95
递延所得税资产减少(减:增加)	24,743,019.61	-8,681,305.19
递延所得税负债增加(减:减少)	6,737,968.63	-1,253,116.55
交易性金融资产减少	-1,160,691,733.61	-1,898,887,667.71
经营性应收项目的减少(减:增加)	255,445,448.41	-385,003,786.62
经营性应付项目的增加(减:减少)	-574,280,352.66	-4,899,710,176.14
合 计	-1,437,427,236.07	-7,016,042,034.13

2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动

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	7,460,170,710.37	8,806,057,716.21
减: 现金的年初余额	10,531,511,286.49	16,093,491,065.54
加: 现金等价物的期末余额	-	-
减: 现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	-3,071,340,576.12	-7,287,433,349.33

(4) 现金及现金等价物

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
-----	--------------	--------------

一、现金	7,460,170,710.37	8,806,057,716.21
其中：库存现金	157,702.19	301,574.55
可随时用于支付的银行存款	6,813,842,089.94	8,299,169,525.16
可随时用于支付的结算备付金	645,479,771.36	506,586,616.50
其他货币资金	691,146.88	-
二、现金等价物	-	-
三、期末现金及现金等价物余额	7,460,170,710.37	8,806,057,716.21

附注 13、资产负债表日后事项的非调整事项

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。

附注 14、其他重要事项

14.01 融资融券业务

1) 融资融券业务规模

截至 2012 年 6 月 30 日，公司融出资金规模为 27,766,893.29 元，融出证券成本为 1,875,065.92 元，融出证券期末公允价值为 2,023,827.48 元，应收客户利息为 59,837.78 元。

2) 融资融券业务的财务报表列报

公司在编制财务报表时，融出证券在可供出售金融资产项目中列示，其核算方法参照可供售金融资产；融出资金在其他资产项目中列示，应收客户利息在应收利息科目列示。

附注 15、补充资料

15.01 扣除非经常性损益后的净利润

根据中国证券监督管理委员会公告[2008]43 号《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益（2008）》，本公司非经常性损益及扣除非经常性损益后的净利润如下：

项 目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
一、净利润	139,177,388.15	226,637,122.82
二、非经常性损益		
非流动性资产处置损益	51,159.11	71,933.07
计入当期损益的政府补助	-2,698,296.00	-8,060,000.00
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	227,219.80	-291,370.20
非经常性损益合计	-2,419,917.09	-8,279,437.13
三、非经常性损益所得税费用的影响金额	604,979.27	2,069,859.28

四、扣除非经常性损益后的净利润	137,362,450.33	220,427,544.97
其中：扣除非经常性净损益后归属于少数股东损益	3,831,231.76	1,534,459.98
扣除非经常性损益后归属于母公司净利润	133,531,218.57	218,893,084.99

公司根据自身正常经营业务的性质和特点将上表列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目列示如下：

项 目	金 额	原 因
交易性金融资产的投资收益	30,798,678.41	公司主营业务损益
可供出售金融资产的投资收益	16,194,550.92	公司主营业务损益
衍生金融工具的投资收益	-7,510,439.60	公司主营业务损益
交易性金融资产公允价值变动损益	104,333,631.17	公司主营业务损益
衍生金融工具公允价值变动损益	-2,983,440.00	公司主营业务损益
合 计	140,832,980.90	

15.02 每股收益及净资产收益率

2012 年 1-6 月	净资产收益率 (%)		每股收益 (人民币元)	
	加权平均		基本每股收益	稀释每股收益
归属于母公司所有者的净利润	1.81		0.07	0.07
扣除非经常性损益后归属于母公司所有者的净利润	1.79		0.07	0.07

2011 年 1-6 月	净资产收益率 (%)		每股收益 (人民币元)	
	加权平均		基本每股收益	稀释每股收益
归属于母公司所有者的净利润	5.30		0.15	0.15
扣除非经常性损益后归属于母公司所有者的净利润	5.15		0.15	0.15

(1) 加权平均净资产收益率计算过程

项目名称	序号	2012年1-6月	2011年1-6月
归属于公司普通股股东的净利润	P0(NP)	135,217,353.43	225,095,086.19
扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益		1,686,134.86	6,202,001.20
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	P0	133,531,218.57	218,893,084.99
归属于公司普通股股东的期初净资产	E0	7,389,743,705.05	4,186,639,314.27
报告期发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	Ei	-	-
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	Mi	-	-
报告期月份数	M0	6.00	6.00
报告期回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	Ej	160,000,000.00	150,000,000.00
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	Mj	-	2.00
因其他交易或事项引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动	Ek	20,703,406.83	-3,923,250.51
发生其他净资产增减变动次月起至报告期期末的累计月数	Mk	3.00	3.00
扣除非经常性损益前加权平均净资产收益率(%) ※1		1.81%	5.30%
扣除非经常性损益后加权平均净资产收益率(%) ※1		1.79%	5.15%

※1 加权平均净资产收益率= $P0/(E0+NP\div 2+Ei\times Mi\div M0-Ej\times Mj\div M0\pm Ek\times Mk\div M0)$

(2) 每股收益的计算过程

项目名称	项目号	2012年1-6月	2011年1-6月
归属于公司普通股股东的净利润	P0(I)	135,217,353.43	225,095,086.19
扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益		1,686,134.86	6,202,001.20
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	P0(II)	133,531,218.57	218,893,084.99
发行在外的普通股加权平均数	S	2,000,000,000.00	1,500,000,000.00
期初股份总数	S0	2,000,000,000.00	1,500,000,000.00
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	-	-
报告期因回购等减少股份数	Sj	-	-
报告期缩股数	Sk	-	-
报告期月份数	M0	6.00	6.00
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	Mi	-	-
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	Mj	-	-
扣除非经常性损益前每股收益※1		0.07	0.15
扣除非经常性损益后每股收益※1		0.07	0.15
已确认为费用的稀释性潜在普通股股利		-	-
所得税税率		25%	25%
转换费用		-	-
可转换公司债券、认股权证、股份期权等转换或行权而增加的股份数		-	-
扣除非经常性损益前稀释每股收益※2		0.07	0.15
扣除非经常性损益后稀释每股收益※2		0.07	0.15

※1 基本每股收益= $P0 \div S$ (其中 $S=S0+S1+Si \times Mi \div M0-Sj \times Mj \div M0-Sk$)

※2 稀释每股收益= $P1 / (S0+S1+Si \times Mi \div M0-Sj \times Mj \div M0-Sk+认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数)$

(其中 P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润，并考虑稀释性潜在普通股对其影响，按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时，考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响，按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益，

直至稀释每股收益达到最小值。)

15.03 主要会计报表项目的异常情况及原因

资产负债表项目

项目	期末余额	期初余额	增减%	主要原因
交易性金融资产	2,432,809,666.00	1,147,492,741.22	112.01%	交易性金融资产规模增加
买入返售金融资产	478,544,706.85	689,522,730.55	-30.60%	期末买入返售证券减少
可供出售金融资产	1,878,913,012.22	216,550,831.70	767.65%	根据债券收益率变化，母公司提前处置持有至到期债券投资，并将剩余债券重分类至可供出售金融资产；可供出售金融资产中的股票投资大幅增加
持有至到期投资	38,702,107.55	890,680,931.58	-95.65%	提前处置持有至到期债权，并将剩余债券重分类至可供出售金融资产
长期股权投资	285,191,538.14	209,122,658.67	36.38%	公司下属全资企业东吴创业投资有限公司对外投资增加及按权益法核算的东吴基金管理有限公司投资收益增加
递延所得税资产	15,648,489.67	41,504,693.24	-62.30%	公允价值变动导致递延所得税资产减少
卖出回购金融资产款	964,908,675.41	718,950,000.00	34.21%	卖出回购业务规模增加
代理承销证券款	-	5,000,000.00	-100.00%	前期收到的代理承销证券款在本期支付
应付职工薪酬	83,398,648.97	153,433,874.43	-45.65%	报告期内发放已计提的工资薪酬
应交税费	34,778,360.45	79,462,314.69	-56.23%	报告期内已缴纳上期企业所得税
应付利息	827,108.88	2,235,738.33	-63.01%	应付存款利息及卖出回购金融资产应付利息减少
递延所得税负债	6,820,770.76	74,996.25	8994.82%	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

项目	2012年1-6月	2011年1-6月	增减%	主要原因
手续费及佣金净收入	357,098,467.38	777,509,686.42	-54.07%	经纪及承销业务收入减少
其中：代理买卖证券业务净收入	308,666,414.03	460,398,443.18	-32.96%	经纪业务收入减少
证券承销业务净收入	25,655,000.00	307,222,549.95	-91.65%	承销业务收入减少
其他收入	18,901,893.84	5,368,953.41	252.06%	财务顾问收入增加
利息净收入	116,773,796.69	66,226,380.74	76.33%	存放金融同业利息收入及债券回购利息收入增加
公允价值变动收益	101,350,191.17	-35,829,098.13	-	交易性金融资产公允价值增加
汇兑收益	32,389.46	-182,061.35	-	汇率变动影响

其他业务收入	273,506.06	8,128,918.89	-96.64%	报告期内子公司咨询管理费收入减少
营业税金及附加	26,149,253.65	48,613,749.95	-46.21%	应税收入减少
营业外收入	3,034,296.01	8,992,921.74	-66.26%	政府补助减少
所得税费用	50,225,613.32	76,402,590.27	-34.26%	利润总额减少导致所得税费用减少
少数股东损益	3,960,034.72	1,542,036.63	156.81%	子公司利润增加
其他综合收益	20,703,406.83	-3,923,250.51	-	可供出售金融资产变化所致

现金流量表项目

项目	2012年1-6月	2011年1-6月	增减%	主要原因
经营活动产生的现金流量净额	-1,345,323,179.04	-7,034,280,317.73	-	报告期内代买卖证券款净流出减少
投资活动产生的现金流量净额	-964,420,508.77	-474,974,083.23	-	报告期内配置可供出售金融资产及子公司对外投资增加所致
筹资活动产生的现金流量净额	-162,550,000.00	144,900,000.00	-212.18%	上年同期发行次级债
现金及现金等价物净增加额	-2,472,261,298.35	-7,364,536,462.31	-	报告期内代买卖证券款净流出减少导致的经营活动现金流量净额增加

十六、财务报表之批准

本财务报告经公司第一届董事会第28次会议于2012年8月8日决议批准。