

华泰证券股份有限公司

601688

2012 年半年度报告

目 录

一、重要提示	2
二、公司基本情况	2
三、股本变动及股东情况	4
四、董事、监事和高级管理人员情况	6
五、董事会报告	7
六、重要事项	24
七、财务会计报告（未经审计）	47
八、备查文件目录	47

一、重要提示

1、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

3、本报告经公司第二届董事会第十一次会议、第二届监事会第六次会议审议通过。董事会会议应到董事17人，实到董事9人，徐祖坚、潘剑秋、周易、王树华、薛炳海、应文禄六位董事和陈传明、范从来两位独立董事未亲自出席会议，其中：徐祖坚、王树华两位董事书面委托陆建萍董事代为行使表决权，潘剑秋、周易两位董事书面委托吴万善董事长代为行使表决权，薛炳海、应文禄两位董事书面委托蔡标董事代为行使表决权，陈传明、范从来两位独立董事书面委托吴晶妹独立董事代为行使表决权。

4、本公司不存在被控股股东及其关联方非经常性占用资金情况。

5、本公司不存在违反规定决策程序对外提供担保的情况。

6、本公司半年度财务报告未经审计。

二、公司基本情况

（一）公司名称

中文名称：华泰证券股份有限公司

中文简称：华泰证券

英文名称：HUATAI SECURITIES CO., LTD.

英文缩写：HTSC

（二）公司股票简况

股票种类：A股

公司股票上市交易所：上海证券交易所

股票简称：华泰证券

股票代码：601688

(三) 公司地址

公司注册地址：江苏省南京市中山东路90号

公司办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

邮政编码：210002

公司国际互联网网址：<http://www.htsc.com.cn>

电子邮箱：bgs@mail.htsc.com.cn

(四) 公司法定代表人：吴万善

(五) 公司董事会秘书：姜健

联系地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦（邮政编码：
210002）

联系电话：025-83290511、83290788、84457777

传真：025-84579938

电子信箱：jiangjian@mail.htsc.com.cn

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

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

公司半年度报告备置地点：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大
厦2704室

(七) 主要财务数据和指标

主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

项目	2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日	本报告期比上年度期末增减 (%)
总资产	84,667,081,153.18	85,742,370,336.15	-1.25
归属于母公司股东权益	33,554,068,182.86	33,228,628,689.59	0.98
归属于母公司股东的每股净资产	5.99	5.93	1.01
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	1,398,606,277.07	1,532,925,517.71	-8.76
利润总额	1,398,918,198.67	1,530,519,123.45	-8.60
归属于母公司股东的净利润	1,058,027,353.28	1,143,575,101.57	-7.48
扣除非经常性损益后归属于母公司的净利润	1,057,856,659.69	1,145,384,089.46	-7.64
基本每股收益	0.19	0.20	-5.00
扣除非经常性损益后基本每股收益	0.19	0.20	-5.00
稀释每股收益	0.19	0.20	-5.00
加权平均净资产收益率 (%)	3.13	3.42	减少 0.29 个百分点
经营活动产生的现金流量净额	-3,638,302,873.11	-24,435,109,182.86	85.11
每股经营活动产生的现金流量净额	-0.65	-4.36	85.09

非经常性项目

单位：人民币元

非经常性损益项目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月	说明
非流动资产处置损益	-4,580.15	-238,848.96	处理固定资产损益
计入当期损益的政府补助(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)	3,796,400.00		主要系财政补助
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-3,479,898.25	-2,167,545.30	主要系印花税返还收入及一次房补支出
减: 所得税费用影响	77,980.40	-615,885.16	
非经常性损益净额	233,941.20	-1,790,509.10	
其中: 归属于母公司的非经常性损益	170,693.59	-1,808,987.89	
归属于少数股东的非经常性损益	63,247.61	18,478.79	

三、股本变动及股东情况

(一) 公司股份变动情况表:

报告期内,公司股份总数及结构无变动。

(二) 主要股东持股情况介绍

1、报告期末股东总数：122,973 户。

2、截至 2012 年 6 月 30 日，公司前十名股东持股情况：

单位：股

股东名称	股东性质	持股比例 (%)	持股总数	报告期内股份变动数量	持有有限售条件股份数量	质押或冻结的股份数量
江苏省国信资产管理集团有限公司	国有法人	24.4319	1,368,187,495	500,000	1,367,687,495	0
江苏交通控股有限公司	国有法人	8.4968	475,819,370	0	475,819,370	0
江苏汇鸿国际集团有限公司	国有法人	7.8498	439,588,150	0	439,588,150	0
江苏高科技投资集团有限公司	国有法人	7.6089	426,096,799	0	426,096,799	60,000,000
江苏省苏豪控股集团有限公司	国有法人	6.0968	341,418,259	0	341,418,259	0
国华能源投资有限公司	国有法人	4.8901	273,847,584	-62,200,455	0	0
江苏宏图高科技股份有限公司	境内非国有法人	2.6360	147,618,708	0	0	144,919,146
上海星聚投资管理有限公司	境内非国有法人	2.5676	143,786,827	0	143,786,827	143,780,000
江苏苏豪国际集团股份有限公司	国有法人	2.3473	131,447,067	0	131,447,067	0
金城集团有限公司	国有法人	1.9452	108,929,397	0	0	0

注：上表中，江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、江苏省苏豪控股集团有限公司均为江苏省国资委所属独资企业。江苏省苏豪控股集团有限公司是江苏苏豪国际集团股份有限公司的控股股东，持有其国有法人股 24,655.68 万股，占该公司总股本的 69.89%，构成母子公司关系。此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。

3、截至 2012 年 6 月 30 日，公司前十名无限售条件股东持股情况：

单位：股

股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类
国华能源投资有限公司	273,847,584	人民币普通股
江苏宏图高科技股份有限公司	147,618,708	人民币普通股
金城集团有限公司	108,929,397	人民币普通股
海澜集团有限公司	90,000,000	人民币普通股
江苏三房巷集团有限公司	45,356,980	人民币普通股
江苏华西村股份有限公司	37,180,000	人民币普通股
上海浦东发展银行—长信金利趋势股票型证券投资基金	32,174,321	人民币普通股
中国建设银行股份有限公司—华夏盛世精选股票型证券投资基金	24,765,452	人民币普通股
中国建设银行—华夏红利混合型开放式证券投资基金	18,650,969	人民币普通股
贵州赤天化集团有限责任公司	18,557,157	人民币普通股

4、截至 2012 年 6 月 30 日，前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	江苏省国信资产管理集团有限公司	1,367,687,495	2013 年 2 月 26 日	1,367,687,495	自上市之日起锁定 36 个月

2	江苏交通控股有限公司	475,819,370	2014年7月30日	2,327,587	自持股之日起锁定 60 个月
			2013年2月26日	473,491,783	自上市之日起锁定 36 个月
3	江苏汇鸿国际集团有限公司	439,588,150	2013年2月26日	439,588,150	自上市之日起锁定 36 个月
4	江苏高科技投资集团有限公司	426,096,799	2013年2月26日	426,096,799	自上市之日起锁定 36 个月
5	江苏省苏豪控股集团有限公司	341,418,259	2013年2月26日	341,418,259	自上市之日起锁定 36 个月
6	上海星聚投资管理有限公司	143,786,827	2012年12月31日	143,786,827	自持股之日起锁定 36 个月
7	江苏苏豪国际集团股份有限公司	131,447,067	2013年2月26日	131,447,067	自上市之日起锁定 36 个月
8	全国社会保障基金理事 会转持三户	67,088,681	2012年7月30日	4,431,531	自持股之日起锁定 36 个月
			2013年2月26日	62,657,150	自上市之日起锁定 36 个月
9	江苏汇鸿国际集团中 鼎控股股份有限公司	53,568,528	2013年2月26日	53,568,528	自上市之日起锁定 36 个月
10	江苏舜天国际集团有 限公司	51,925,531	2013年2月26日	51,925,531	自上市之日起锁定 36 个月

注：上表中，江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、江苏省苏豪控股集团有限公司均为江苏省国资委所属独资企业。江苏省苏豪控股集团有限公司是江苏苏豪国际集团股份有限公司的控股股东，持有其国有法人股 24,655.68 万股，占该公司总股本的 69.89%，构成母子公司关系；江苏汇鸿国际集团有限公司是江苏汇鸿国际集团中鼎控股股份有限公司的控股股东，持有其国有法人股 20,666.00 万股，占该公司总股本的 74.18%，构成母子公司关系；江苏舜天国际集团有限公司是江苏省国信资产管理集团有限公司的全资子公司。此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。

5、控股股东及实际控制人变化情况

报告期内，公司控股股东及实际控制人未发生变化。

四、董事、监事、高级管理人员情况

（一）董事、监事、高级管理人员持股情况

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

公司董事、监事、高级管理人员没有持有公司股份，报告期内未发生变化。

（二）报告期内董事、监事、高级管理人员变更情况

报告期内，公司于2012年6月14日召开第二届董事会第十次会议，经董事认真审议，以通讯表决方式审议通过了关于聘任李筠为公司合规总监的议案，并形成如下决议：同意聘任李筠为公司合规总监，聘任生效

时间自江苏证监局对李筠任公司合规总监审批认可之日起；公司副总裁、董事会秘书姜健代行合规总监职务自李筠任职生效之日起终止。

五、董事会报告

（一）报告期内公司经营情况

报告期末，公司注册资本为 56 亿元，主营业务范围为：证券经纪业务；证券自营；证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具）；证券投资咨询；证券资产管理；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；中国证监会批准的其他业务。在 2012 年证券公司分类监管评级中，公司被评为 A 类 AA 级。

1、报告期内公司总体经营情况

2012 年上半年，我国内外部经济环境严峻复杂。国际方面，欧债危机不断加剧，欧洲经济增长停滞，欧美经济复苏的曲折性、艰巨性进一步凸显。国内方面，经济下行压力持续加大，实体经济持续疲弱，货币政策开始进入适度放松通道。报告期内，证券行业召开创新发展大会，资本市场改革发展和证券行业创新加速推进。

2012 年上半年，股票市场反复震荡运行，报告期末上证综指收盘于 2,225.43 点，报告期内上涨 1.18%；报告期末深证成指收盘于 9,500.32 点，报告期内上涨 6.52%。根据 WIND 资讯 2012 年上半年股票发行统计数据，报告期内包括首发募集资金、增发募集资金、配股募集资金在内的实际募集资金 2,102.23 亿元，较 2011 年同期下降 36.45%；其中首发实际募集资金 688.00 亿元，较 2011 年同期下降 54.53%。

2012 年上半年，债券市场走出牛市格局，报告期末中证全债指数收于 143.82，报告期内上涨 3.09%。报告期内，企业债务融资工具市场不

断扩容，发行规模增长明显。根据 WIND 资讯 2012 年上半年债券发行统计数据，报告期内企业债发行总额 3,137.90 亿元，较 2011 年同期增长 119.82%。公司债方面，随着监管审批的逐步放宽及市场需求的高涨，公司债发行呈现爆发式增长，报告期内公司债发行总额 1,036.83 亿元，较 2011 年同期增长 92.36%。

2012 年上半年，根据中国证券业协会公布的未经审计的证券公司经营数据，我国证券行业上半年实现营业收入 706.28 亿元，同比下降 5.96%；证券行业合计实现净利润 226.59 亿元，同比下降 13.03%。2012 年上半年，我国证券行业总资产 1.62 万亿元，同比下降 2.99%；净资产 6,715.54 亿元，同比上涨 15.61%；净资本 4,817.87 亿元，同比上涨 10.57%。

2012 年是公司全面推进全业务链体系建设的第一年。2012 年上半年，公司按照年初确定的总体经营思路，积极应对，努力拼搏，以全业务链体系建设为抓手，持续深化业务转型，各项业务都保持了稳定发展的态势。

截至 2012 年 6 月 30 日，按合并口径，公司总资产 846.67 亿元，较年初减少 1.25%；归属于上市公司股东的所有者权益 335.54 亿元，较年初增加 0.98%。2012 年 1—6 月，公司实现营业收入 339,459.31 万元，与上年同期相比基本持平；利润总额 139,891.82 万元，较上年同期减少 8.60%；归属于上市公司股东的净利润 105,802.74 万元，较上年同期减少 7.48%。

2、公司主营业务及其经营情况

分业务	营业收入 (万元)	营业成本 (万元)	营业利润 率(%)	营业收入同 比增减(%)	营业成本同 比增减(%)	营业利润率同比增减
证券经纪业务	174,402.44	95,981.75	44.97	-24.18	-8.37	减少 9.49 个百分点
投资银行业务	33,589.76	26,903.75	19.90	-41.96	8.61	减少 37.29 个百分点
证券投资业务	81,821.92	13,064.40	84.03	734.03	100.88	增加 50.32 个百分点
资产管理业务	3,784.92	2,454.04	35.16	-9.37	20.51	减少 16.08 个百分点

报告期内，公司证券经纪业务营业收入同比减少 24.18%，营业利润率同比减少 9.49 个百分点，同比变动的主要原因：一是证券市场成交金额同比大幅下降；二是市场竞争继续加剧，佣金率持续下滑。报告期内，公司投资银行业务营业收入同比减少 41.96%，营业利润率同比减少 37.29 个百分点，同比变动的主要原因是由于市场发行节奏趋缓、融资规模下降，公司投资银行业务完成的项目数量和承销规模也有所下降。报告期内，公司证券投资业务营业收入同比增加 734.03%，营业利润率同比增加 50.32 个百分点，同比变动的主要原因是由于公司较好地把握了上半年债券市场的投资机会，债券投资收益大幅提升。报告期内，公司资产管理业务营业收入同比减少 9.37%，营业利润率同比减少 16.08 个百分点，同比变动的主要原因是由于市场持续低迷，公司资产管理业务规模有所下降。

（1）证券经纪业务

报告期内，股票市场反复震荡运行，市场交易总量萎缩，行业平均佣金率下降趋势延缓。根据沪、深证券交易所统计数据，两市股基交易量 35.69 万亿元，较上年同期下降 28.71%。证券公司经纪业务盈利能力因交易量下滑等因素受到一定影响。

报告期内，公司证券经纪业务始终围绕“稳固传统常规业务、加速新兴常规业务、突破特色业务”年度发展方针，各项业务全面发展、稳步推进。搭建以客户需求为导向的全业务链体系，全面推进服务转型、管理转型。纵深推进经纪业务整合工作，平稳有序完成业务系统合并。稳步开展营销活动，理财产品销售初现多元化发展。构建分层分级的绩效考核体系，形成过程化分析督导流程。推动营销人员管理模式整合，继续完善营销人员精细化管理。进一步扩大投顾业务试点规模，全面深

入推广统一服务营销。积极开展创新业务，扩大债券质押式报价回购业务试点范围，推动业务稳步发展。

报告期内，公司融资融券业务积极应对业务常规化发展带来的机遇与挑战，全面开展推广工作，业务保持快速增长。截至报告期末，公司融资融券业务余额为 44.08 亿元，较 2011 年年末增长 17.68 亿元，增幅达 66.97%，公司融资融券业务余额占全市场融资融券业务余额的 7.22%，行业排名第五。

报告期内，公司股指期货中间介绍业务持续有序推进、稳步发展。截至报告期末，公司可开展期货中间介绍业务的证券营业部共 80 家，新获期货中间介绍业务资格的证券营业部共 5 家，业务覆盖 23 个省、自治区、直辖市。报告期内，公司股指期货交易手数 85.49 万手，合计客户日均权益 3.60 亿元。

代理交易金额及市场份额数据

2012 年 1—6 月			2011 年 1—6 月		
证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)	证券品种	代理交易金额 (亿元)	市场份额 (%)
股票	18,543.01	5.35	A 股	24,726.96	50.24
			基金	214.82	31.98
基金	344.35	5.10	B 股	86.28	51.05
			权证	391.89	76.72
债券	11,046.28	3.74	债券	61.16	11.47
合计	29,933.64	4.62	合计	25,481.11	49.86

注：（1）2012 年 1-6 月代理交易金额及市场份额数据来源于沪、深交易所；2011 年 1-6 月代理交易金额及市场份额数据来源于证券公司综合监管报表。

（2）因证券经纪业务整合，2012 年 1-6 月代理交易金额及市场份额数据为母公司数据；2011 年 1-6 月代理交易金额及市场份额数据为合并数据。

（2）投资银行业务

报告期内，受证券市场行情因素影响，股票市场发行节奏有所放缓，股票筹资规模显著下降。报告期内，债券发行结构发生较大变化，尽管债券发行总额较 2011 年同期出现下降，但企业债与公司债发行总额同期大幅增长。

报告期内，在股票发行承销业务方面，公司在做好投行专项治理收尾工作及内控专项治理工作基础上，继续按照区域开发和行业开发相结合的战略思路及构建全业务链体系的需要，积极加强项目拓展和项目储备。加强投行业务整合力度，深化业务融合，增强业务及人员规范化管理与培训，确保项目质量。强化投行业务制度建设，加快推进业务平台建设，保障投行业务精细化管理。在债券发行承销业务方面，公司积极利用自身资源优势，拓展金融债、企业债和公司债等债券业务的承销工作，加快债券业务拓展，债券业务进展平稳推进。报告期内，公司合并共完成主承销 IPO 项目 6 个，主承销金额 36.86 亿元；公司合并共完成主承销债券发行项目 3 个，主承销金额 66.3 亿元。此外，公司进一步加强对新老客户的开发力度，努力提供综合金融服务，并购重组市场占有率继续保持行业前列。

合并数据

承销方式	发行类别	承销次数（次）		承销金额（万元）		承销收入（万元）	
		本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
主承销	新股发行	6	118	368,605.38	6,907,793.38	22,911.13	289,733.51
	增发新股	1	25	191,483.02	4,245,784.02	2,800.00	43,854.00
	配股	0	30	0	1,002,136.78	0	19,236.96
	可转债	0	8	0	300,800.00	0	11,172.00
	债券发行	3	132	663,000.00	4,597,546.48	2,290.12	43,646.58
	小计	10	313	1,223,088.40	17,054,060.66	28,001.25	407,643.05
副主承销	新股发行	0	27	0	242,956.30	0	1,059.01
	增发新股	0	3	0	55,903.50	0	169.00
	配股	0	12	0	244,241.00	0	1,811.00
	可转债	0	3	0	13,284.00	0	12.00
	债券发行	10	58	10,000.00	425,575.00	56.00	1,349.72
	小计	10	103	10,000.00	981,959.80	56.00	4,400.73
分销	新股发行	0	161	0	1,876,238.51	0	1,284.42
	增发新股	0	28	0	382,226.97	0	701.00
	配股	0	31	0	136,077.30	0	429.94
	可转债	0	8	0	145,936.00	0	87.54
	债券发行	197	924	4,381,107.00	18,191,469.68	5,201.35	19,397.98

	小计	197	1,152	4,381,107.00	20,731,948.46	5,201.35	21,900.88
--	----	-----	-------	--------------	---------------	----------	-----------

母公司数据

承销方式	发行类别	承销次数 (次)		承销金额 (万元)		承销收入 (万元)	
		本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
主承销	新股发行	0	56	0	3,060,253.52	0	103,183.68
	增发新股	0	6	0	2,868,382.00	0	15,710.00
	配股	0	7	0	375,228.32	0	3,935.27
	可转债	0	2	0	72,000.00	0	2,300.00
	债券发行	0	108	0	2,739,901.48	0	24,231.67
	小计	0	179	0	9,115,765.32	0	149,360.62
副主承销	新股发行	0	21	0	160,055.30	0	948.01
	增发新股	0	1	0	37,975.50	0	5.00
	配股	0	7	0	215,438.00	0	1,220.00
	可转债	0	2	0	10,000.00	0	2.00
	债券发行	0	26	0	216,875.00	0	725.22
	小计	0	57	0	640,343.80	0	2,900.23
分销	新股发行	0	103	0	1,073,221.51	0	684.42
	增发新股	0	16	0	163,906.97	0	62.00
	配股	0	20	0	115,235.30	0	37.94
	可转债	0	3	0	67,500.00	0	36.54
	债券发行	96	617	958,000.00	6,663,962.68	895.00	6,440.73
	小计	96	759	958,000.00	8,083,826.46	895.00	7,261.63

(3) 证券投资业务

报告期内,受经济形势、资金面供求、市场扩容等多方面因素影响,股票市场整体处于震荡整理区间,市场行情和交易量一度活跃后进入较为低迷状态。报告期内,国债、金融债收益率震荡下行,信用产品收益率持续显著回落,货币政策放松以及资金利率下降带动了债券市场收益率的加速下行。

报告期内,公司权益类证券投资业务以追求绝对收益为主要目标,加强趋势研判和价值分析,以挖掘业绩增长确定性高、估值有相对优势的投资品种,波段操作积累绝对收益为主要投资思路进行投资操作。但由于二级市场波动较大且难以准确预测,公司权益类投资在报告期内未取得正收益。在数量化投资和股指期货投资方面,公司在有效控制风险

的前提下，以数量化研究为基础，运用金融工程和计算机技术构建数量化模型筛选投资组合，利用股指期货对冲组合的系统性风险，并根据自营业务现货持仓情况和证券市场变化，积极把握市场机会，分期分批进行股指期货套期保值交易。公司固定收益类证券投资业务不断加强市场投研能力，较好地把握债券市场整体走势，适时加仓，并及时减仓获利了结，报告期内固定收益类证券投资业务收入及营业利润同比大幅上涨，投资收益率达 11.53%。

合并数据

单位：人民币元

项目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
证券投资收益	651,509,308.58	108,904,512.80
其中：出售交易性金融资产收益	454,747,437.71	-225,154,740.62
出售交易性金融负债收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	28,124,013.02	-166,246,627.93
金融资产持有期间收益	214,444,374.54	281,773,617.40
衍生金融工具的投资收益	-45,806,516.69	218,532,263.95
公允价值变动损益	166,709,878.34	-10,800,032.17
其中：交易性金融资产	178,975,378.34	19,000,647.83
交易性金融负债	-	-
衍生金融工具	-12,265,500.00	-29,800,680.00
合 计	818,219,186.92	98,104,480.63

母公司数据

单位：人民币元

项目	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
证券投资收益	452,421,033.64	33,907,263.34
其中：出售交易性金融资产收益	290,192,599.75	-280,506,676.89
出售交易性金融负债收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	14,953,392.36	-166,760,038.33
金融资产持有期间收益	193,081,558.22	262,641,714.61
衍生金融工具的投资收益	-45,806,516.69	218,532,263.95
公允价值变动损益	192,109,584.37	-13,853,044.08
其中：交易性金融资产	204,375,084.37	15,947,635.92
交易性金融负债	-	-

衍生金融工具	-12,265,500.00	-29,800,680.00
合计	644,530,618.01	20,054,219.26

(4) 资产管理业务

报告期内，券商资产管理业务竞争日趋激烈，受证券市场行情低迷等因素影响，集合资产管理业务规模难以扩大，同时传统型理财产品无法满足投资者需求。面对新的形势，券商资产管理业务积极创新，不断寻求突破，陆续推出创新型理财产品以满足投资者的多元化投资需求。截至报告期末，市场上存续的各类券商集合理财计划总计 312 只。

报告期内，公司继续完善投资研究体系，通过提高投资业绩，增加产品吸引力，截至报告期末，公司绝大多数集合资产管理计划取得正收益，其中华泰紫金现金管家和华泰紫金龙-大中华排名处于同类产品前列。扎实推进创新业务，以盘活客户资产为创新重点，强化产品创新工作。截至报告期末，公司完成了华泰紫金定增宝集合资产管理计划、华泰如意月月红套利 1 号集合资产管理计划的申报、获批和推广设立工作，完成了华泰紫金 3 号集合资产管理计划合同变更及展期工作。截至报告期末，公司合计管理集合资产管理计划 15 只，合计管理份额 53.98 亿份，合计管理资产规模 46.70 亿元。

资产管理有关业务数据

项目	2012 年 1—6 月		2011 年 1—6 月	
	受托规模(亿元)	净收入(万元)	受托规模(亿元)	净收入(万元)
集合资产管理业务	46.70	3,551.77	64.27	4,067.93
定向资产管理业务	23.40	233.15	2.60	108.50

3、比较式财务报表中变动幅度超过 30% 以上的项目分析

单位：人民币万元

项目	2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日	增减	主要原因
结算备付金	589,614.13	964,611.42	-38.88%	报告期末客户资金头寸减少
买入返售金融资产	61,076.27	103,310.36	-40.88%	买入返售交易规模减少
可供出售金融资产	579,763.73	233,563.18	148.23%	子公司定向理财产品增加
交易席位费	629.15	965.80	-34.86%	系交易席位费摊销所致

其他资产	599,925.84	390,101.86	53.79%	融出资金规模增大
拆入资金	59,000.00	-	-	银行拆入资金规模增加
应交税费	52,793.28	33,618.17	57.04%	代扣客户限售股个人所得税增加
应付利息	170.10	605.31	-71.90%	报告期短期正回购业务增加
递延所得税负债	9,271.48	4,844.15	91.40%	金融资产浮动盈余增加
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	185,214.95	264,993.54	-30.11%	市场行情不佳导致成交量下滑
投资收益	74,601.74	19,249.37	287.55%	交易性金融资产投资收益增加
公允价值变动收益	16,670.99	-1,080.00	-	金融资产公允价值浮盈增加
汇兑收益	56.29	-484.07	-	汇率变动导致汇兑收益增加
其他业务收入	8,431.38	782.41	977.62%	债券回售再融资收入增加
资产减值损失	-	-58.01	-	本期未发生资产减值迹象
其他业务成本	2,780.30	466.29	496.26%	债券回售再融资支出增加
营业外收入	1,641.23	580.70	182.63%	印花税返还收入增加
营业外支出	1,610.04	821.34	96.03%	一次性房补支出增加
少数股东损益	2,321.52	1,164.92	99.29%	控股子公司净利润增加
其他综合收益	10,761.03	-4,645.33	-	可供出售金融资产公允价值增加

4、公司营业收入、营业利润的分部报告

(1) 公司营业收入地区分部情况

地区	2012年1-6月		2011年1-6月		增减百分比
	营业部数量 (家)	营业收入 (元)	营业部数量 (家)	营业收入 (元)	
江苏省	81	479,802,918.32	68	747,540,819.92	-35.82%
湖北	28	93,649,175.67	28	132,248,630.79	-29.19%
广东	34	139,403,425.54	31	219,592,436.07	-36.52%
上海	15	83,032,120.26	15	120,706,096.40	-31.21%
北京	8	44,671,416.88	8	78,084,692.18	-42.79%
四川	9	49,240,332.56	9	70,816,534.26	-30.47%
辽宁	8	24,827,396.26	8	41,601,937.84	-40.32%
黑龙江	6	15,401,080.14	6	26,083,897.00	-40.96%
山东	8	18,533,257.71	7	29,723,964.06	-37.65%
天津	6	24,248,654.30	5	37,016,748.26	-34.49%
浙江	8	22,858,067.54	7	31,912,929.55	-28.37%
河南	4	18,478,394.95	4	29,533,339.19	-37.43%
湖南	5	20,580,286.66	5	34,389,966.36	-40.16%
江西	3	10,418,037.04	3	15,508,116.29	-32.82%
广西	3	15,326,312.39	3	19,612,403.01	-21.85%
福建	4	13,764,476.53	3	18,147,622.74	-24.15%
吉林	2	9,147,838.86	2	16,687,094.03	-45.18%
河北	2	8,556,726.19	2	11,424,493.65	-25.10%
陕西	2	8,868,840.88	2	14,149,062.79	-37.32%
安徽	3	6,641,838.39	3	9,267,881.04	-28.33%
海南	2	6,037,797.94	2	9,748,934.79	-38.07%
宁夏	1	5,271,745.20	1	9,258,960.37	-43.06%

重庆	2	4,940,724.05	1	6,886,782.12	-28.26%
内蒙古	1	5,365,612.08	1	6,724,125.78	-20.20%
甘肃	1	1,140,983.77	1	797,624.28	43.05%
山西	1	724,173.15	1	1,189,826.55	-39.14%
贵州	2	1,761,545.72	2	1,450,476.50	21.45%
云南	2	6,383,024.99	2	1,575,614.55	305.11%
新疆	1	19,498.37	-	-	-
营业部小计	252	1,139,095,702.34	230	1,741,681,010.37	-34.60%
香港地区	1	29,855,833.01	1	27,133,338.51	10.03%
公司本部	-	2,225,641,526.01	-	1,626,024,955.74	36.88%
合计	253	3,394,593,061.36	231	3,394,839,304.62	-0.01%

注：上表所列营业部数量为合并报表范围内公司及子公司的营业部数量。

(2) 公司营业利润地区分部情况

地区	2012年1-6月		2011年1-6月		增减百分比
	营业部数量 (家)	营业利润 (元)	营业部数量 (家)	营业利润 (元)	
江苏省	81	169,177,890.38	68	426,754,413.43	-60.36%
湖北	28	24,844,699.69	28	66,581,653.28	-62.69%
广东	34	19,262,389.06	31	94,693,683.60	-79.66%
上海	15	-2,669,896.75	15	38,848,786.17	-106.87%
北京	8	-9,713,601.86	8	33,408,614.12	-129.08%
四川	9	19,717,319.16	9	40,698,296.37	-51.55%
辽宁	8	-5,653,701.86	8	13,513,741.76	-141.84%
黑龙江	6	-533,058.87	6	10,481,601.04	-105.09%
山东	8	1,597,625.57	7	14,589,691.05	-89.05%
天津	6	-246,217.33	5	15,601,652.33	-101.58%
浙江	8	65,887.82	7	8,422,421.97	-99.22%
河南	4	3,635,192.74	4	9,717,954.03	-62.59%
湖南	5	5,548,389.63	5	15,063,737.51	-63.17%
江西	3	2,271,716.42	3	6,876,133.36	-66.96%
广西	3	4,656,072.36	3	10,101,932.36	-53.91%
福建	4	748,947.64	3	6,288,145.16	-88.09%
吉林	2	-316,644.79	2	6,357,369.96	-104.98%
河北	2	2,584,056.80	2	5,397,508.81	-52.13%
陕西	2	2,263,670.25	2	7,052,330.86	-67.90%
安徽	3	-1,925,063.54	3	2,198,476.00	-187.56%
海南	2	1,124,912.41	2	3,672,319.06	-69.37%
宁夏	1	1,383,123.13	1	4,748,367.26	-70.87%
重庆	2	663,806.03	1	3,495,043.65	-81.01%
内蒙古	1	2,092,883.49	1	3,809,356.25	-45.06%
甘肃	1	-1,208,576.38	1	-1,422,531.72	-
山西	1	-1,420,732.85	1	-662,595.67	-
贵州	2	-898,682.98	2	-1,320,552.64	-
云南	2	143,424.64	2	-2,275,930.13	-
新疆	1	-1,204,466.21	-	-	-

营业部小计	252	235,991,363.80	230	842,691,619.23	-72.00%
香港地区	1	5,379,928.62	1	9,849,978.43	-45.38%
公司本部	-	1,157,234,984.65	-	680,383,920.05	70.09%
合计	253	1,398,606,277.07	231	1,532,925,517.71	-8.76%

注：上表所列营业部数量为合并报表范围内公司及子公司的营业部数量。

5、主要控股公司及参股公司经营情况及业绩分析

(1) 华泰联合证券有限责任公司，注册资本人民币 100,000 万元，报告期末，华泰证券持有 98.186%的股权，其中 0.186%的股权尚未办理过户手续。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰联合证券有限责任公司总资产 493,825.70 万元，净资产 451,545.27 万元。2012 年 1—6 月，华泰联合证券有限责任公司营业收入 60,959.42 万元，利润总额 16,683.29 万元，净利润 12,365.13 万元（未经审计）。

主营业务：证券承销与保荐业务（国债、非金融企业债务融资工具承销业务除外）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；中国证监会批准的其他业务。

(2) 华泰长城期货有限公司，注册资本人民币 60,000 万元，报告期末，华泰证券持有 60%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰长城期货有限公司总资产 623,472.75 万元，净资产 82,107.64 万元。2012 年 1—6 月，华泰长城期货有限公司营业收入 21,964.38 万元，利润总额 7,335.36 万元，净利润 5,244.27 万元（未经审计）。

主营业务：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询。

(3) 华泰金融控股（香港）有限公司，实收资本港币 50,000 万元，报告期末，华泰证券持有 100%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰金融控股（香港）有限公司总资产人民币 80,899.21 万元，净资产人民币 41,635.13 万元。2012 年 1—6 月，华泰金融控股（香港）有限公司营业收入人民币 2,985.58 万元，利润总额人民币 537.99 万元，净利润人民

币 537.99 万元（未经审计）。

主营业务：环球股票交易；期货交易；股票融资；投资咨询；资产管理业务。

（4）华泰紫金投资有限责任公司，注册资本人民币 50,000 万元，报告期末，华泰证券持有 100%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰紫金投资有限责任公司总资产 54,052.27 万元，净资产 53,614.85 万元。2012 年 1—6 月，华泰紫金投资有限责任公司营业收入 2,034.12 万元，利润总额 1,623.04 万元，净利润 1,292.86 万元（未经审计）。

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

（5）华泰金控投资咨询（深圳）有限公司，实收资本港币 1,000 万元，为华泰金融控股（香港）有限公司的全资子公司。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰证券间接持有其 100%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰金控投资咨询（深圳）有限公司总资产人民币 399.39 万元，净资产人民币 395.77 万元。2012 年 1—6 月，华泰金控投资咨询（深圳）有限公司营业收入人民币 92.77 万元，利润总额人民币-139.05 万元，净利润人民币-139.05 万元（未经审计）。

主营业务：项目投资信息咨询，企业管理咨询，经济信息咨询，市场营销策划。

（6）南方基金管理有限公司，注册资本人民币 15,000 万元，报告期末，华泰证券持有 45%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，南方基金管理有限公司总资产 287,063.87 万元，净资产 199,156.09 万元。2012 年

1—6 月，南方基金管理有限公司营业收入 82,848.76 万元，利润总额 25,946.16 万元，净利润 19,428.83 万元（未经审计）。

主营业务：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

（7）华泰柏瑞基金管理有限公司，注册资本人民币 20,000 万元，报告期末，华泰证券持有 49%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，华泰柏瑞基金管理有限公司总资产 45,646.90 万元，净资产 41,063.84 万元。2012 年 1—6 月，华泰柏瑞基金管理有限公司营业收入 11,433.84 万元，利润总额 2,595.82 万元，净利润 1,960.38 万元（未经审计）。

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

（8）江苏银行股份有限公司，注册资本人民币 910,000 万元，报告期末，华泰证券持有 7.03%的股权。截至 2012 年 6 月 30 日，江苏银行股份有限公司总资产 62,687,604.92 万元，净资产 3,157,755.23 万元。2012 年 1—6 月，江苏银行股份有限公司营业收入 986,654.74 万元，利润总额 492,816.31 万元，净利润 365,744.63 万元（未经审计）。

主营业务：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券、承销短期融资券；买卖政府债券、金融债券、企业债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务、代客理财、代理销售基金、代理销售贵金属、代理收付和保管集合资金信托计划；提供保险箱业务；办理委托存贷款业务；从事银行卡业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；结售汇、代理远期结售汇；国际结算；自营及代客外汇买卖；同业外汇拆借；买卖或代理买卖股票

以外的外币有价证券；资信调查、咨询、见证业务；网上银行；经银行业监督管理机构和有关部门批准的其他业务。

6、公司经营中存在的问题及应对措施

报告期内，公司经营中存在的问题主要表现为：市场持续低迷导致传统业务收入下滑，创新业务收入贡献度尚待提升；面对新的市场环境和竞争环境，创新发展的意识需要强化，传统业务转型亟待升级和深化。

针对上述问题，公司主要采取了以下措施：

抓住行业创新发展的契机，着力发展创新业务，努力做大创新业务规模，提升业务创新能力，积极布局新型创新业务品种，开辟新的业务空间，增加新的利润增长点，并促进传统业务与创新业务的协同发展。在公司整合的基础上，加强业务协作，发挥整体资源优势，着力提升整体竞争实力。努力发展多元化业务品种，积极提升理财服务能力。大力发展股权融资业务，积极发展债券承销业务，做大做强并购业务，实现投行业务多元化发展。

7、公司下半年业务发展规划

根据证券公司创新发展研讨会精神，结合公司“十二五”发展战略和打造全业务链的战略部署，2012年下半年，公司将立足财富管理，推进证券经纪业务全面转型；着力提升业务能力，构建“大投行”运作模式；加强创新投资品种和技术的运用，提升投资与交易业务获取绝对收益的能力；紧紧围绕客户需求，打造华泰资产管理业务特色；跟踪政策动向，探索开展场外市场业务；发挥香港子公司桥头堡作用，推动跨境业务发展。

8、公司现金分红政策的制定及执行情况

公司在《章程》第一百七十五条中明确了公司的利润分配政策：“根

据公司盈利状况和生产经营发展需要，结合对投资者的合理投资回报等情况，在累计可分配利润范围内制定当年的利润分配方案，利润分配政策应保持连续性和稳定性。公司可以采取现金、股票以及现金与股票相结合的方式分配股利；公司可以进行中期现金分红；最近三年以现金方式累计分配的利润不少于最近三年实现的年均可分配利润的百分之三十。公司经营活动现金流量连续两年为负时可以不进行当年度的利润分配；公司当年盈利，董事会未提出现金利润分配预案的，应当在董事会决议公告和定期报告中详细说明未分红的原因以及未用于分红的资金留存公司的用途，独立董事应当对此发表独立意见；公司还应在定期报告中披露现金分红政策的执行情况。存在股东违规占用公司资金情况的，公司应当扣减该股东所分配的现金红利，以偿还其占用的资金。”

公司 2008 年—2010 年利润分配情况如下：

2008 年度：公司实现归属于母公司股东的净利润为 1,253,126,412.46 元，经公司 2008 年第四次临时股东大会审议批准，以 2008 年 9 月 30 日总股本 4,500,000,000 股为基数，向公司全体股东每股分配 0.223 元现金红利，共计分配现金红利 1,003,500,000 元（含税）。现金分红金额占当年归属于母公司股东净利润的比例为 80.08%。

2009 年度：公司实现归属于母公司股东的净利润为 3,795,291,501.09 元，经公司 2009 年度股东大会审议批准，未进行现金分红。

2010 年度：公司实现归属于上市公司股东的净利润为 3,425,046,334.64 元，经公司 2010 年度股东大会审议批准，以 2010 年 12 月 31 日总股本 5,600,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 1.5 元（含税），共计分配现金红利 840,000,000 元。现金

分红金额占当年归属于上市公司股东净利润的比例为 24.53%。

公司现金分红政策的制定及执行情况符合公司章程的规定，符合公司股东大会决议要求，分红标准和比例明确和清晰，公司利润分配方案的决策程序和机制完备，独立董事尽职履责并发挥了应有的作用，中小股东具有充分表达意见和诉求的机会，充分维护了中小股东的合法权益。

为进一步规范公司利润分配政策尤其是现金分红政策，推动公司建立科学、持续、稳定的分红机制，保护中小投资者合法权益，根据中国证监会《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》（证监发[2012]37号）及江苏证监局《关于进一步落实上市公司现金分红有关要求的通知》（苏证监公司字[2012]276号）有关规定和要求，结合公司实际情况，公司拟对《章程》第一百七十五条关于公司利润分配政策的相关条款作进一步细化、完善。公司《章程》本次修订草案已经 2012 年 8 月 17 日召开的公司第二届董事会第十一次会议审议通过，并将提交定于 2012 年 9 月 5 日召开的公司 2012 年第一次临时股东大会审议。

（二）报告期内投资情况

1、报告期内募集资金使用情况

截至 2012 年 6 月 30 日，公司首发募集资金本金已全部使用完毕，累计使用募集资金 155.994 亿元（含募集资金利息 3,817.45 万元）。报告期内，本公司未使用募集资金。

单位：人民币万元

募集资金总额				1,556,122.55		报告期内投入募集资金总额				0		
变更用途的募集资金总额				—		已累计投入募集资金总额				1,559,940（注）		
变更用途的募集资金总额比例				—								
承诺投资项目和超募资金投向	是否已变更项目	募集资金承诺投资总额	调整后投资总额	截至期末承诺投入金额(1)	报告期内投入金额	截至期末累计投入金额(2)	截至期末累计投入金额与承诺投入金额的差额(3)=(2)-(1)	截至期末投入进度(%) (4)=(2)/(1)	项目达到预定可使用状态日期	报告期内实现的效益	是否达到预计效益	项目可行性是否发生重大变化

承诺投资项目												
补充子公司资本金	否	—	—	—	—	69,440	—	—	—	—	—	否
增加公司主要业务的营运资金	否	—	—	—	—	1,459,600	—	—	—	—	—	否
增加创新业务资金	否	—	—	—	—	30,900	—	—	—	—	—	否
承诺投资项目小计	—	—	—	—	—	1,559,940	—	—	—	—	—	—
未达到计划进度或预计收益的情况和原因（分具体项目）	—											
项目可行性发生重大变化的情况说明	—											
超募资金的金额、用途及使用进展情况	—											
募集资金投资项目实施地点变更情况	—											
募集资金投资项目实施方式调整情况	—											
募集资金投资项目先期投入及置换情况	—											
用闲置募集资金暂时补充流动资金情况	—											
项目实施出现募集资金结余的金额及原因	—											
尚未使用的募集资金用途及去向	—											
募集资金使用及披露中存在的问题或其他情况	—											

注：累计投入募集资金总额超出原募集资金总额 3,817.45 万元均为募集资金专户产生的利息收入。

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

截至 2012 年 6 月 30 日，公司募集资金专用银行账户结余资金余额为 8,127.76 万元，均为募集资金利息，具体存放情况如下：

开户银行	银行账号	账户类别	存储余额（万元）
工商银行南京新街口支行	4301010019100858288	募集资金专户	2,877.97

交通银行南京新街口支行	320006607018170039723	募集资金专户	1,811.40
招商银行南京城西支行	125903648510603	募集资金专户	1,851.53
中国银行江苏省分行营业部	800187023808026001	募集资金专户	1,586.86
合 计			8,127.76

本公司不存在变更募集资金投入项目的情况。报告期内，本公司能严格执行《募集资金管理制度》、《三方监管协议》以及相关证券监管法规，规范募集资金管理，未发生违反相关规定及协议的情况。

2、报告期内非募集资金投资项目情况

无。

六、重要事项

（一）公司治理的情况

报告期内，公司严格依照《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》、《上市公司治理准则》等相关法律法规及《公司章程》的规定，稳健经营、规范运作，按照建立现代企业制度的目标，健全和完善公司法人治理结构，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，使各层次在各自的职责、权限范围内，各司其职，各负其责，确保了公司的规范运作。

报告期内，公司根据相关规定制订或修订了《合规管理制度》、《总裁工作细则》和《年报审计工作规则》，并获得公司董事会审议批准。同时，公司制订了《华泰证券股份有限公司实施内部控制规范工作方案》，并经公司董事会审议通过，以贯彻落实有关文件要求，做好实施内部控制规范有关工作。通过以上制度的建立并不断完善，公司治理结构不断规范，公司治理水平不断提高。公司股东大会、董事会、监事会的召开程序、表决程序合法有效，信息披露真实、准确、完整、及时、公平，

投资者关系管理工作规范、专业。

（二）报告期实施的利润分配方案执行情况

公司 2011 年度股东大会审议通过公司 2011 年度利润分配方案：本次利润分配以 2011 年末总股本 5,600,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 1.5 元（含税），共计分配现金红利 840,000,000 元，剩余未分配利润全部结转以后年度分配。

公司于 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》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）上发布了利润分配实施公告，股权登记日为 2012 年 6 月 20 日，除息日为 2012 年 6 月 21 日，现金红利发放日为 2012 年 6 月 28 日。

公司 2011 年度的现金分红已于 2012 年 6 月 28 日执行完毕。

（三）2012 年半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案
2012 年半年度，公司未拟定利润分配预案、公积金转增股本预案等。

（四）重大诉讼仲裁事项

1、公司报告期内发生的重大诉讼仲裁事项

2012 年 5 月，本公司上海国宾路证券营业部客户谢吉华以返还财产为由起诉徐季松及该证券营业部，要求徐季松返还其 150 万元人民币并支付同期银行利息，并要求该证券营业部承担连带责任。经查，徐季松曾为该证券营业部经纪人，涉嫌以虚构理财产品诈骗受害人谢吉华等客户财产并携款潜逃，目前该起事件已经上海市公安局杨浦分局立案侦查，该民事案件正在审理过程中。

2、公司以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼仲裁事项

2010 年 6 月，世纪证券有限责任公司以于 1995 年与本公司建立期货交易委托代理关系、向本公司交付了交易保证金为由，向南京市中级

人民法院起诉，要求本公司返还所欠其期货交易保证金余额计人民币 5,021,800 元及相关利息共计 5,157,099 元。该纠纷一审本公司胜诉，对方向江苏省高级人民法院提起上诉。原告方于 2012 年 3 月 16 日向法院申请撤回上诉，法院于 2012 年 3 月 19 日裁定准许对方撤诉，该案结案。

3、报告期内，公司控股子公司华泰联合证券有限责任公司涉及的重大诉讼仲裁事项

报告期内，公司控股子公司华泰联合证券未新发生重大诉讼仲裁事项。

4、公司控股子公司华泰联合证券以前期间发生但持续到报告期的重大诉讼仲裁事项（已全额计提了坏账准备）如下：

（1）已决诉讼执行情况

① 子公司华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案

华泰联合证券原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用华泰联合证券资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出（2001）深中法经一初第 315 号民事判决书和（2002）深中法经一初第 430 号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还华泰联合证券 7,345 万元及其利息和 9,940 万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。对于另一案，华泰联合证券于 2008 年 6 月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向华泰联合证券支付欠款总额人民币 23,775.36 万元、利息人民币 2,187.72 万元，合计标的人民币约 2.6 亿元。该案于 2009 年 12 月由北京市高级人民法院判决四通集团公司扣减

债务 8,486.5867 万元，最终需偿还本金 17,553.3893 万元及相应利息，该案目前正在执行中。

② 子公司华泰联合证券与广州珠江实业集团有限公司债权债务纠纷案

广州珠江实业集团有限公司拖欠华泰联合证券 1,500 万元款项，华泰联合证券于 2008 年 12 月向广州市越秀区人民法院起诉，请求法院判令其偿还所欠华泰联合证券款项。法院立案后，主持双方达成和解，并出具民事调解书确认对方对华泰联合证券的全部债务。该案目前正在执行中。

③ 子公司华泰联合证券与北京华资银团集团债权债务纠纷案

因北京华资银团集团一直未按协议履行对华泰联合证券的还款义务，华泰联合证券于 2011 年 1 月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计 3,457.89 万元，2011 年 2 月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合证券欠款 2,430 万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011 年 6 月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判，该案目前正在执行中。

(2) 未决诉讼情况

① 子公司华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限公司债权债务纠纷案

因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用华泰联合证券营业部资金共 3,720 余万元，以及因它与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从华泰联合证券三家营业部及华泰联合证券本部扣划现金共 1,738 万元，中国华诚集团财务有限责任公司拒不履行偿债义务，华泰联合证券于 2003 年 12 月向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求华诚投资管理有限

公司和华诚集团财务有限责任公司承担连带清偿责任。立案后，由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、审理、执行对华诚投资管理有限公司及所属公司的诉讼案件，该案一直处于中止审理阶段。2009 年 5 月，法院裁定华诚投资管理有限公司进入破产清算程序，华泰联合证券已于 2009 年 8 月向破产清算组申报债权本息 12,598 万元，但由于债权未经法院判决，债权待确认。2010 年 3 月，深圳中级人民法院恢复审理，一审判决结果支持华泰联合证券全部诉讼请求，要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司连带支付华泰联合证券 5,458.4 万元，并承担诉讼费 28.2 万元，华泰联合证券已就上述债权和诉讼费向华诚投资管理有限公司破产清算组申报破产债权，2011 年 8 月 31 日，华诚投资第三次债权人会议召开并通过了第一次债权分配方案，华泰联合证券根据上述分配方案获得 276.44 万股华纺股份股票。

② 子公司华泰联合证券与中国长城计算机集团公司债权债务纠纷案

因中国长城计算机集团公司不履行与华泰联合证券之间的合同义务，2008 年 11 月，华泰联合证券向深圳市罗湖区法院起诉，请求法院处置变卖其所持华泰联合证券的 900 万股股权（经 2005 年缩股后变更为 270 万股），将所得款项用于抵偿其对华泰联合证券的所欠债务。2009 年 2 月，该案进行了第一次开庭审理，并由法院追加长城财务公司作为第三人。该案已于 2009 年 7 月开庭审理完毕，2009 年 8 月，法院裁定中止审理。中止审理期间，双方至今一直就相关事宜进行协商。

（五）破产重整相关事项

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

序号	证券品种	证券代码	证券简称	初始投资金额 (元)	持有数量	期末账面价值 (元)	占期末证 券总投资 比例	报告期损益 (元)
1	可转债	113001	中行转债	107,935,357.50	1,099,250	107,554,577.30	5.01%	-498,031.95
2	可转债	113002	工行转债	101,117,609.53	906,880	99,620,495.94	4.64%	19,800,208.08
3	股票	601318	中国平安	52,432,231.26	1,204,832	55,109,015.68	2.57%	2,897,352.02
4	可转债	113003	重工转债	51,436,000.00	494,050	51,593,641.50	2.40%	157,641.50
5	可转债	110015	石化转债	45,694,725.36	441,420	44,213,995.60	2.06%	-2,156,110.03
6	股票	600516	方大炭素	40,630,693.01	3,874,143	33,085,181.22	1.54%	-7,318,240.68
7	股票	600489	中金黄金	36,957,181.13	1,601,911	34,473,124.72	1.60%	-2,226,185.97
8	股票	600498	烽火通信	35,958,745.09	1,292,675	34,268,814.25	1.60%	-1,689,930.84
9	股票	000858	五粮液	35,364,086.36	1,070,565	35,071,709.40	1.63%	103,128.63
10	股票	600773	西藏城投	33,627,035.27	2,302,996	29,109,869.44	1.36%	-4,517,165.83
期末持有的其他证券投资				1,692,074,193.86	-	1,624,228,544.99	75.59%	-19,759,937.59
报告期已出售证券投资损益				-	-	-	-	-108,610,204.27
合计				2,233,227,858.37	-	2,148,328,970.04	100%	-123,817,476.93

2、持有其他上市公司股权情况

序号	证券代码	证券简称	初始投资金额 (元)	占该公 司股权 比例	期末账面 值 (元)	报告期损益 (元)	报告期所有者 权益变动(元)	会计核算 科目	股份 来源
1	002024	苏宁电器	353,298,271.00	0.41%	241,410,747.00	-13,807,479.05	25,103,200.25	可供 出售 金融 资产	购买
2	002206	海利得	120,111,385.00	2.16%	64,705,165.00	244,028.51	-17,606,219.44		非公开增发
3	002299	圣农发展	75,797,182.00	0.56%	73,118,095.00	504,013.25	-2,679,086.57		购买
4	600660	福耀玻璃	58,666,233.00	0.26%	40,054,275.00	33,645.60	-1,022,067.89		购买
5	000423	东阿阿胶	49,979,280.00	0.16%	41,757,757.00	-3,285,862.92	-1,272,585.91		购买
6	600087	ST长油	46,916,667.00	0.44%	24,600,000.00	-31,871,632.61	30,683,333.35		非公开增发
7	600827	友谊股份	44,849,562.00	0.15%	29,376,741.00	0.00	-155,844.78		购买
8	600276	恒瑞医药	38,948,194.00	0.11%	37,897,200.00	-7,554,555.40	12,368,117.66		购买
9	000858	五粮液	36,952,835.00	0.03%	36,050,676.00	-4,466,955.38	-337,212.03		购买
10	600585	海螺水泥	36,796,619.00	0.04%	33,212,020.00	-3,805,855.17	-3,432,421.76		购买
其他			752,824,082.17		709,746,498.23	111,800,875.39	91,726,176.23		
合计			1,615,140,310.17		1,331,929,174.23	47,790,222.22	133,375,389.11		

3、持有非上市金融企业股权情况

持有对象名称	初始投资成本 (元)	持股 比例	期末账面 值 (元)	报告期损益 (元)	报告期所有 者权益变动 (元)	会计核算 科目	股份 来源
华泰联合证券有限责任公司	1,206,780,736.83	98.186%	1,206,780,736.83	121,413,241.24	—	长期股权投资	出资购入
华泰长城期货有限公司	366,598,085.65	60%	366,598,085.65	31,465,640.45	—	长期股权投资	出资购入
南方基金管理有限公司	860,715,656.67	45%	860,715,656.67	87,429,755.95	6,779,591.12	长期股权投资	出资购入
华泰柏瑞基金管理有限公司	204,346,499.43	49%	204,346,499.43	9,605,880.42	1,589,456.40	长期股权投资	出资购入
江苏银行股份有限公司	1,300,000,000.00	7.03%	1,300,000,000.00	—	—	长期股权投资	出资购入
合计	3,938,440,978.58		3,938,440,978.58	249,914,518.06	8,369,047.52		

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) 报告期内公司收购及出售资产、吸收合并事项

本报告期公司无收购及出售资产、吸收合并事项。

(八) 报告期内公司重大关联交易事项

1、与日常经营相关的关联交易

单位：人民币万元

关联方	交易内容	定价原则	向关联方销售产品和提供劳务		向关联方采购产品和接受劳务	
			交易金额	占同类交易金额的比例	交易金额	占同类交易金额的比例
江苏银行股份有限公司	存款利息收入	市场原则	18.29	0.12%	-	-
南方基金管理有限公司	席位分仓佣金收入	市场原则	319.06	12.91%	-	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	席位分仓佣金收入	市场原则	486.90	19.70%	-	-
合计			824.25	-	-	-

2、关联债权债务往来

单位：人民币万元

关联方	向关联方提供资金		关联方向公司提供资金	
	发生额	余额	发生额	余额
南方基金管理有限公司	319.06	0		
华泰柏瑞基金管理有限公司	486.90	0		
合计	805.96	0		

3、其他重大关联交易

无。

(九) 重大合同及履行情况

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

(1) 托管情况

本报告期公司无托管事项。

(2) 承包情况

本报告期公司无承包事项。

(3) 租赁情况

本报告期公司无租赁事项。

2、担保情况

本报告期公司无重大担保事项。

3、委托理财情况

本报告期公司无委托理财事项。

4、其他重大合同

(1) 2012 年 5 月 2 日, 本公司与华泰联合证券有限责任公司签订《华泰联合证券有限责任公司定向资产管理合同》。报告期内, 该合同正常履行。截至报告期末, 华泰联合证券有限责任公司已委托本公司进行资产管理, 委托证券资产市值 20 亿元。

(2) 2010 年 7 月 30 日, 本公司与中国江苏国际经济技术合作公司签订《华泰证券广场施工总承包合同》。报告期内, 该合同正常履行。截至报告期末, 已完成华泰证券广场工程地下室土建施工、部分上部结构土建施工。报告期内, 本公司已按约支付总承包合同价款 94,178,824.87 元。截至报告期末, 本公司已按约累计支付总承包合同价款 297,607,487.27 元。

(3) 2012 年 6 月 29 日, 公司与上海保利广场资产管理有限公司签订了购买上海保利广场 14,975 平方米的《不动产买卖协议》, 协议总价款人民币 9.83 亿元, 期内公司已支付协议定金人民币 1.96 亿元。

(十) 承诺事项履行情况

1、公司或持股 5%以上股东在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

(1) 公司承诺事项

无。

(2) 持股 5%以上股东承诺事项及履行情况

截至 2012 年 6 月 30 日, 公司持股 5%以上的股东共有五家, 分别为江苏省国信资产管理集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏汇鸿

国际集团有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、江苏省苏豪控股集团有限公司，五家股东均承诺在锁定期限内“不转让或者委托他人管理其本次发行前所持有的公司股份，也不由公司回购该部分股份”。其中：

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

② 江苏省苏豪控股集团有限公司，因受实际控制人控制并在公司上市申报前三年内无增持行为，承诺：锁定期限为自公司股票在证券交易所上市之日起 36 个月内。

报告期内，上述股东均履行了承诺，未减持公司股票。

此外，截止或延续到报告期内，公司持股 5%以上的股东并无其它具体承诺事项。

2、截至半年报披露日，是否存在尚未完全履行的业绩承诺
不适用。

3、截至半年报披露日，是否存在尚未完全履行的注入资产、资产整合承诺
不适用。

（十一）审计事项

本次半年度财务报告未经审计。

（十二）公司、董事、监事及高级管理人员、持股 5%以上的股东、

实际控制人受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内，公司及其董事、监事、高级管理人员、持股 5%以上的股东、实际控制人不存在受有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、通报批评、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责等情形。

(十三) 报告期内其他重大事项

1、报告期内证券营业部及分公司新设、迁址等变化情况

证券营业部新设	证券营业部迁址	分公司新设	分公司迁址
10	9	4	1

(1) 报告期内证券营业部新设情况

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	华泰证券股份有限公司南京高淳宝塔路证券营业部	南京市高淳县淳溪镇宝塔路 136 号	苏证监机构字 [2011]650 号	2011 年 12 月 14 日	2012 年 2 月 14 日
2	华泰证券股份有限公司溧水珍珠南路证券营业部	溧水县永阳镇珍珠南路 4 号	苏证监机构字 [2011]650 号	2011 年 12 月 14 日	2012 年 2 月 14 日
3	华泰证券股份有限公司沭阳北京北路证券营业部	沭阳县沭城镇北京北路 17 号(建设银行一楼)	苏证监机构字 [2011]650 号	2011 年 12 月 14 日	2012 年 2 月 14 日
4	华泰证券股份有限公司涟水常青西路证券营业部	涟水县常青路南侧福利大楼	苏证监机构字 [2011]650 号	2011 年 12 月 14 日	2012 年 2 月 14 日
5	华泰证券股份有限公司徐州睢宁中山南路证券营业部	睢宁县睢城镇中山南路 10 号睢宁电信局三楼	苏证监机构字 [2011]650 号	2011 年 12 月 14 日	2012 年 2 月 14 日
6	华泰证券股份有限公司镇江丹徒谷阳大道证券营业部	镇江市丹徒新城谷阳大道 260 号	苏证监机构字 [2012]121 号	2012 年 3 月 22 日	2012 年 5 月 30 日
7	华泰证券股份有限公司镇江句容华阳东路证券营业部	句容市华阳镇华阳东路延伸段华阳名府综合楼	苏证监机构字 [2012]121 号	2012 年 3 月 22 日	2012 年 5 月 30 日
8	华泰证券股份有限公司泰州高港金港南路证券营业部	泰州市高港区都市佳园一期 6 幢 02 室	苏证监机构字 [2012]121 号	2012 年 3 月 22 日	2012 年 5 月 30 日
9	华泰证券股份有限公司泰州兴化长安中路证券营业部	兴化市锦绣园朝东营业房由南向北第 13、14 间	苏证监机构字 [2012]121 号	2012 年 3 月 22 日	2012 年 5 月 30 日
10	华泰证券股份有	淮安市淮阴区北京东	苏证监机构字	2012 年 3 月 22 日	2012 年 5 月 30 日

	限公司淮安淮阴 北京东路证券营 业部	路 17 号	[2012]121 号		
--	--------------------------	--------	-------------	--	--

①经江苏证监局 2011 年 12 月 14 日“苏证监机构字[2011]650 号”文批准，华泰证券股份有限公司在江苏省高淳县、溧水县、沭阳县、涟水县、睢宁县等地各设立 1 家证券营业部，证券经营许可证已经获得，证券营业部已开业。

②经江苏证监局 2012 年 3 月 22 日“苏证监机构字[2012]121 号”文批准，华泰证券股份有限公司在江苏省泰州市高港区、镇江市丹徒区、淮安市淮阴区、兴化市、句容市等地各设立 1 家证券营业部，证券经营许可证已经获得，证券营业部已开业。

(2) 报告期内证券营业部迁址情况

序号	营业部	地址	批复文号	批复日期	变更许可证日期
1	华泰证券股份有限公司常熟金沙江路证券营业部	江苏省常熟市金沙江路 18 号	苏证监机构字[2012]54 号	2012 年 2 月 6 日	2012 年 3 月 15 日
2	华泰证券股份有限公司东台望海西路证券营业部	江苏省东台市望海西路 4 号	苏证监机构字[2012]85 号	2012 年 2 月 28 日	2012 年 4 月 26 日
3	华泰证券股份有限公司上海牡丹江路证券营业部	上海市宝山区牡丹江路 1508 号航运大厦五楼	沪证监机构字[2012]85 号	2012 年 3 月 8 日	期后办理
4	华泰证券股份有限公司成都人民南路证券营业部	四川省成都市武侯区人民南路四段 45 号新希望大厦 7 楼 702、703 室	川证监机构[2012]21 号	2012 年 4 月 16 日	期后办理
5	华泰证券股份有限公司南昌新建文化大道证券营业部	江西省南昌市新建县长堽镇文化大道 1298 号红谷峰尚 10 栋 6 楼	赣证监发[2012]69 号	2012 年 4 月 26 日	期后办理
6	华泰证券股份有限公司牡丹江新华路证券营业部	黑龙江省牡丹江市爱民区新华路 21 号	黑证监函[2012]87 号	2012 年 5 月 11 日	2012 年 5 月 30 日
7	华泰证券股份有限公司上海黄河路证券营业部	上海市黄河路 333 号四层	沪证监机构字[2012]266 号	2012 年 6 月 20 日	期后办理
8	华泰证券股份有限公司成都双流县正东中街证券营业部	四川省成都市双流县华阳镇正东中街 242 号	川证监机构[2012]47 号	2012 年 6 月 26 日	期后办理
9	华泰证券股份有限公司西安文艺北路证券营业部	陕西省西安市文艺北路 11 号陕西省戏曲研究院西部文化广场一层、六层	陕证监函字[2012]137 号	2012 年 6 月 28 日	期后办理

①经江苏证监局 2012 年 2 月 6 日“苏证监机构字[2012]54 号”文

批准，华泰证券股份有限公司常熟枫林路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司常熟金沙江路证券营业部”，地址为江苏省常熟市金沙江路 18 号，2012 年 3 月 15 日变更证券经营许可证。

②经江苏证监局 2012 年 2 月 28 日“苏证监机构字[2012]85 号”文批准，华泰证券股份有限公司东台望海西路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址为江苏省东台市望海西路 4 号，2012 年 4 月 26 日变更证券经营许可证。

③经上海证监局 2012 年 3 月 8 日“沪证监机构字[2012]85 号”文批准，华泰证券股份有限公司上海牡丹江路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址为上海市宝山区牡丹江路 1508 号航运大厦五楼，证券经营许可证变更期后办理。

④经四川证监局 2012 年 4 月 16 日“川证监机构 [2012]21 号”文批准，华泰证券股份有限公司成都南一环路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司成都人民南路证券营业部”，地址为四川省成都市武侯区人民南路四段 45 号新希望大厦 7 楼 702、703 室，证券经营许可证变更期后办理。

⑤经江西证监局 2012 年 4 月 26 日“赣证监发[2012]69 号”文批准，华泰证券股份有限公司南昌新建解放路证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司南昌新建文化大道证券营业部”，地址为江西省南昌市新建县长堽镇文化大道 1298 号红谷峰尚 10 栋 6 楼，证券经营许可证变更期后办理。

⑥经黑龙江证监局 2012 年 5 月 11 日“黑证监函[2012]87 号”文批准，华泰证券股份有限公司牡丹江桦林证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司牡丹江新华路证券营业部”，地址为黑龙江省牡丹江

市爱民区新华路 21 号，2012 年 5 月 30 日变更证券经营许可证。

⑦经上海证监局 2012 年 6 月 20 日“沪证监机构字[2012]266 号”文批准，华泰证券股份有限公司上海黄河路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址为上海市黄河路 333 号四层，证券经营许可证变更期后办理。

⑧经四川证监局 2012 年 6 月 26 日“川证监机构 [2012]47 号”文批准，华泰证券股份有限公司成都双流丁字街证券营业部同城迁址开业，更名为“华泰证券股份有限公司成都双流县正东中街证券营业部”，地址为四川省成都市双流县华阳镇正东中街 242 号，证券经营许可证变更期后办理。

⑨经陕西证监局 2012 年 6 月 28 日“陕证监函字[2012]137 号”文批准，华泰证券股份有限公司西安文艺北路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址为陕西省西安市文艺北路 11 号陕西省戏曲研究院西部文化广场一层、六层，证券经营许可证变更期后办理。

(3) 报告期内分公司新设情况

序号	分公司	地址	批复文号	批复日期	获得许可证日期
1	深圳分公司	广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦 18A	苏证监机构字[2011]594 号	2011 年 11 月 14 日	2012 年 3 月 19 日
2	湖北分公司	湖北省武汉市武昌区武珞路 558 号附 4 号	苏证监机构字[2011]594 号	2011 年 11 月 14 日	2012 年 3 月 19 日
3	四川分公司	四川省成都市青羊区清江西路 51 号中大君悦金沙写字楼 1 幢 16 楼 2 号	苏证监机构字[2011]594 号	2011 年 11 月 14 日	2012 年 5 月 14 日
4	广东分公司	广东省广州市天河路 230、232 号万菱国际中心 39 层	苏证监机构字[2011]594 号	2011 年 11 月 14 日	2012 年 5 月 14 日

经江苏证监局 2011 年 11 月 14 日“苏证监机构字[2011]594 号”文批准，华泰证券股份有限公司在深圳、湖北、四川、广东各设立一家分公司，证券经营许可证已经获得，目前已开业。

(4) 报告期内分公司迁址情况

序号	分公司	地址	批复文号	批复日期	变更许可证日期
1	北京分公司	北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 18 层	京证机构发[2012]38 号	2012 年 3 月 28 日	期后办理

经北京证监局 2012 年 3 月 28 日“京证机构发[2012]38 号”文批准，华泰证券股份有限公司北京分公司同城迁址开业，分公司名称不变，地址为北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 18 层，证券经营许可证变更期后办理。

2、报告期内获准设立华泰紫金定增宝集合资产管理计划事项

根据中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司设立华泰紫金定增宝集合资产管理计划的批复》(证监许可[2012]89 号)，本公司获准设立华泰紫金定增宝集合资产管理计划。报告期内，本公司在该批复之日起 6 个月内启动推广工作。本公司依法合规地推广该集合计划，开展投资管理和后续服务活动(详见 2012 年 2 月 4 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn)。2012 年 4 月 25 日，该集合资产管理计划公告成立，募集资金规模 3.19 亿元。

3、报告期内，本公司完成了华泰如意月月红套利 1 号集合资产管理计划的首发推广工作，募集资金规模 2.52 亿元。本公司依法合规地推广该集合计划，开展投资管理和后续服务活动。2012 年 6 月 4 日，该集合资产管理计划公告成立。

4、报告期内华泰紫金策略优选集合计划终止事项

2012 年 1 月 30 日至 2012 年 2 月 24 日，华泰紫金策略优选集合计划资产净值连续 20 个工作日低于 1 亿元人民币。按照有关合同规定，该计划于 2012 年 2 月 24 日终止。报告期内，本公司完成了华泰紫金策略

优选集合计划的终止及清算工作。

5、报告期内更换保荐代表人事项

2010 年 2 月 9 日,本公司首次公开发行人 78,456.1275 万股 A 股股票,海通证券股份有限公司担任本次股票发行的保荐机构。报告期内,原指定的保荐代表人王新先生因工作变动,不再负责本公司持续督导期的保荐工作。为保证持续督导工作的有序进行,海通证券股份有限公司委派保荐代表人严胜先生接替担任本公司持续督导保荐代表人,继续履行保荐职责和义务。本次保荐代表人更换后,本公司持续督导保荐代表人为周威先生和严胜先生,持续督导期至 2012 年 12 月 31 日止(详见 2012 年 2 月 10 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn)。

6、报告期内增资华泰金融控股(香港)有限公司事项

根据中国证监会《关于同意华泰证券股份有限公司对华泰金融控股(香港)有限公司进行增资的复函》(机构部部函[2010]551号)和公司 2009 年度第一次临时股东大会审议通过的《关于华泰证券股份有限公司首次公开发行人民币普通股(A股)股票募集资金投资项目的议案》,公司决定对全资子公司华泰金融控股(香港)有限公司增资 10 亿港元,并分阶段实施。报告期内,公司出资 2 亿港元将其注册资本由 3 亿港元增至 5 亿港元,该增资事项已获香港特别行政区公司注册处核准,并已报香港证监会备案(详见 2012 年 2 月 24 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn)。

7、报告期内符合向保险机构投资者提供交易单元条件的事项

报告期内,本公司收到中国保险监督管理委员会保险资金运用监管部《关于证券公司向保险机构投资者提供交易单元审核意见书》(资金部

函[2012]2号), 经评估, 本公司基本符合向保险机构投资者提供交易单元的条件。本公司将严格遵守有关法律法规, 履行承诺的各项职责, 严格规范办理保险机构投资者交易单元相关事宜。

8、报告期内国华能源投资有限公司减持公司股权事项

国华能源投资有限公司为本公司发起人股东单位, 本公司上市后持有本公司 365,048,543 股股份, 占本公司注册资本的 6.5187%。2011 年 2 月 28 日起, 其股份可在上海证券交易所上市流通。截至 2012 年 3 月 9 日, 国华能源已累计出售本公司 60,427,881 股股份, 占本公司注册资本的 1.0791%; 截至 2012 年 5 月 17 日, 国华能源已累计出售本公司 85,410,959 股股份, 占本公司注册资本的 1.5252%。(详见 2012 年 3 月 13 日与 2012 年 5 月 19 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn)。截至报告期末, 国华能源持有本公司 273,847,584 股可上市流通股份, 占本公司注册资本的 4.8901%。

9、报告期内华泰紫金 3 号集合资产管理计划管理合同重要条款变更及延长存续期事项

报告期内, 根据中国证监会《关于核准华泰紫金 3 号集合资产管理计划变更集合资产管理合同重要条款及延长存续期的批复》(证监许可[2012]321号), 本公司获准变更华泰紫金 3 号集合资产管理计划管理合同重要条款, 并将存续期间变更为: 本集合计划无固定存续期, 但当本集合计划出现应当终止的情形时, 本集合计划将终止并进行清算。本公司继续担任华泰紫金 3 号集合资产管理计划的管理人(详见 2012 年 3 月 20 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn)。

10、报告期内华泰紫金投资有限责任公司获准设立华泰紫金（江苏）股权投资基金事项

报告期内，根据中国证监会机构监管部《关于华泰紫金投资有限责任公司设立华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）的无异议函》（机构部部函[2012]152号），本公司直投子公司华泰紫金投资有限责任公司获准设立华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）（暂定名，以工商部门核准的名称为准）及其管理机构华泰瑞通投资管理有限公司（暂定名，以工商部门核准的名称为准）。本公司及华泰紫金投资有限责任公司将严格遵守法律法规以及《证券公司直接投资业务试点指引》等有关规定，严格按照有关方案设立和运作基金（详见2012年4月6日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站www.sse.com.cn）。

11、经公司股东大会审议批准，并报请证券监管部门同意，公司决定对上海金融发展投资基金投资人民币10亿元，其中：公司首期出资3亿元，报告期内出资2亿元，截止报告期末公司累计实缴出资5亿元。

12、公司内部控制规范工作进展情况

为贯彻落实《企业内部控制基本规范》及其配套指引相关要求，推进公司内部控制规范体系建设，根据有关工作要求，公司自2012年1月1日起，全面部署实施《企业内部控制规范》及其配套指引。

公司制定了《华泰证券股份有限公司实施内部控制规范工作方案》，并经第二届董事会第八次会议审议通过后于2012年3月31日在上海证券交易所网站公开披露。公司成立以董事长、总裁为组长，公司各高管为组员的领导小组，全面领导公司内部控制规范体系建设实施工作，以保障公司内部控制规范工作顺利实施。同时，公司成立以合规总监为组

长，各相关部门负责人、华泰紫金投资有限责任公司负责人和华泰联合证券有限责任公司各部门负责人为组员的工作小组，负责该项工作的组织实施。公司各部门及各相关子公司明确至少一名有一定工作经验和协调能力的业务骨干作为工作联络人，具体负责各自业务和管理条线的内部控制规范相关工作。

公司内部控制规范体系建设实施工作的主要牵头部门为合规与风险管理部，主要负责组织、协调相关工作的开展，并具体负责内部控制应用指引的实施工作；计划财务部牵头组织开展与财务报表项目及财务科目密切相关的内部控制规范指引工作以及内部控制审计工作；稽查部牵头组织开展内部控制评价实施工作。

公司详细部署内控规范体系建设相关工作，制定内部控制规范体系建设工作实施方案，并聘请毕马威企业咨询（中国）有限公司为公司内部控制规范体系建设咨询服务机构。

报告期内，公司内控规范建设工作已正式启动。截至报告期末，公司已确定了内部控制规范体系建设方案细则并梳理了涉及的各业务流程，毕马威已对公司内部控制规范工作联络人及相关人员开展了内部控制规范体系、实施方法、工作文档等方面的培训并完成了部门初步访谈。

2012 年下半年，公司将根据内部控制规范体系建设实施方案及细则，有计划、有步骤地完成包括流程识别评估、内控识别和穿行测试、内控缺陷整改、内控自评和内控审计等相关工作，并同步完成合规管理有效性评估工作，编制风险控制矩阵、内控手册、内控自评手册及合规管理有效性评估报告等。

（十四）重大期后事项

1、报告期后控股子公司华泰联合证券有限责任公司主要负责人变更

事项

报告期末，本公司控股子公司华泰联合证券有限责任公司召开董事会审议同意盛希泰辞去华泰联合证券董事长职务、马俊生辞去华泰联合证券总裁职务，并选举吴晓东为华泰联合证券董事长，聘任刘晓丹为华泰联合证券总裁，生效日期自深圳证监局对吴晓东、刘晓丹任职审批认可之日起（详见 2012 年 7 月 3 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn）。

2、报告期后获准开展现金管理产品试点并设立华泰紫金天天发集合资产管理计划事项

根据中国证监会《关于同意华泰证券股份有限公司开展现金管理产品试点并核准设立华泰紫金天天发集合资产管理计划的批复》（证监许可[2012]868 号），本公司获准开展现金管理产品试点并设立华泰紫金天天发集合资产管理计划。报告期后，本公司将在该批复之日起 6 个月内启动推广工作，在计划说明书设定的 60 个工作日内完成计划的推广、设立活动。本公司将依法合规地推广该集合计划，开展投资管理和后续服务活动（详见 2012 年 7 月 6 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn）。

3、报告期后获准新设 5 家证券营业部并撤销海口龙华路证券营业部事项

报告期后，本公司根据江苏证监局《关于核准华泰证券股份有限公司在江苏常州等地设立 5 家证券营业部的批复》（苏证监机构字[2012]296 号）和《关于核准华泰证券股份有限公司撤销海口龙华路证券营业部的批复》（苏证监机构字[2012]257 号）批复核准，在江苏省常州市戚墅堰区、湖北省武汉市洪山区、湖北省襄阳市樊城区、海南省三

亚市、青海省西宁市城西区各设立 1 家证券营业部，同时，撤销海口龙华路证券营业部（详见 2012 年 7 月 10 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn）。

4、报告期后本公司收到发行短期融资券无异议函事项

报告期后，本公司收到中国证监会机构监管部《关于华泰证券股份有限公司申请发行短期融资券的监管意见函》（机构部部函[2012]387号）。根据该函，中国证监会机构监管部对本公司申请发行短期融资券无异议。本公司将严格按照有关规定，认真做好短期融资券的发行、交易、信息披露及募集资金使用等工作（详见 2012 年 7 月 18 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn）。

5、报告期后本公司有限售条件流通股上市流通事项

经中国证监会证监许可[2010]138 号文核准，本公司在上海证券交易所向社会首次公开发行人民币普通股（A 股）784,561,275 股，并于 2010 年 2 月 26 日在上海证券交易所上市交易。根据发行前股东所持股份的流通限制和股东对所持股份自愿锁定的承诺，本公司 313,111,138 股有限售条件流通股份于 2012 年 7 月 30 日起在上海证券交易所上市流通（详见 2012 年 7 月 24 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站 www.sse.com.cn）。

（十五）信息披露索引

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

事项	刊载的报刊名称及版面	刊载日期	刊载的互联网网站及检索路径
华泰证券 2011 年 12 月份经营情况主要财		2012-01-13	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)

务信息			
华泰证券股份有限公司 2011 年度业绩快报	中国证券报 B009、上海证券报 B22、证券日报 C4、证券时报 A5	2012-1-13	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于获准设立华泰紫金定增宝集合资产管理计划的公告	中国证券报 B005、上海证券报 25、证券日报 A4、证券时报 B8	2012-2-4	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 1 月份经营情况主要财务信息		2012-02-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于更换保荐代表人的公告	中国证券报 B005、上海证券报 B22、证券日报 A4、证券时报 D21	2012-2-10	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于增资华泰金融控股(香港)有限公司的公告	中国证券报 A21、上海证券报 B16、证券日报 D4、证券时报 D17	2012-2-24	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 2 月份经营情况主要财务信息		2012-03-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于国华能源投资有限公司减持公司股权的公告	中国证券报 B005、上海证券报 B25、证券日报 E2、证券时报 D32	2012-3-13	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于获准变更华泰紫金 3 号集合资产管理计划管理合同重要条款及延长存续期的公告	中国证券报 B004、上海证券报 B40、证券日报 E34、证券时报 D56	2012-3-20	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于新设 5 家证券营业部获批的公告	中国证券报 B004、上海证券报 B41、证券日报 E28、证券时报 D29	2012-3-29	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券实施内部控制规范工作方案		2012-03-31	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司第二届董事会第八次会议决议公告	中国证券报 B004、上海证券报 49、证券日报 C12、证券时报 B29	2012-3-31	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于华泰紫金投资有限责任公司获准设立华泰紫金(江苏)股权投资基金的公告	中国证券报 B016、上海证券报 B40、证券日报 E4、证券时报 D60	2012-4-6	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 3 月份经营情况主要财务信息		2012-04-12	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券募集资金存放与实际使用情况鉴证报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)

华泰证券内部控制鉴证报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券第一季度季报		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券年报		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券年报审计工作规则		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券总裁工作细则		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年度社会责任报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券合规管理制度		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券控股股东及其他关联方资金占用情况的专项说明		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年度独立董事工作报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券董事会关于公司 2011 年度内部控制的自我评价报告		2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司 2011 年年度报告摘要	中国证券报 B138\B139 上海证券报 17\18、证券日报 C1\C2、证券时报 B77\B78	2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司 2012 年第一季度报告正文	中国证券报 B138、上海证券报 17、证券日报 C2、证券时报 B77\B78	2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于召开 2011 年度股东大会的通知	中国证券报 B139、上海证券报 18、证券日报 C3、证券时报 B78	2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司第二届监事会第五次会议决议公告	中国证券报 B139、上海证券报 18、证券日报 C3、证券时报 B78	2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司第二届董事会第九次会议决议公告	中国证券报 B138、上海证券报 18、证券日报 C3、证券时报 B77	2012-4-21	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于公司 2011 年度股东大会增加临时提案的公告	中国证券报 B004、上海证券报 72、证券日报 C22、证券时报 B4	2012-4-28	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年度股东大会会议资料		2012-4-28	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 4 月份经营情况主要财务信息		2012-05-09	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司	中国证券报 B004、上海证券	2012-5-12	上海证券交易所网站

司 2011 年度股东大会决议公告	报 16、证券日报 B4、证券时报 B1		(www.sse.com.cn)
华泰证券 2011 年度股东大会的法律意见书		2012-5-12	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于国华能源投资有限公司减持公司股权的公告	中国证券报 B016、上海证券报 22、证券日报 C14、证券时报 B20	2012-05-19	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 5 月份经营情况主要财务信息		2012-06-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司第二届董事会第十次会议决议公告	中国证券报 B008、上海证券报 B11、证券日报 E2、证券时报 D13	2012-6-15	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司 2011 年度利润分配实施公告	中国证券报 B008、上海证券报 B11、证券日报 E2、证券时报 D13	2012-6-15	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于控股子公司华泰联合证券有限责任公司主要负责人变更的公告	中国证券报 A05、上海证券报 B17、证券日报 E2、证券时报 D20	2012-7-3	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于获准开展现金管理产品试点并设立华泰紫金天天发集合资产管理计划的公告	中国证券报 B005、上海证券报 B24、证券日报 C4、证券时报 D20	2012-7-6	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券股份有限公司关于获准新设 5 家证券营业部并撤销海口龙华路证券营业部的公告	中国证券报 B009、上海证券报 B32、证券日报 E3、证券时报 D29	2012-07-10	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 6 月份经营情况主要财务信息		2012-07-10	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券关于收到发行短期融资券无异议函的公告	中国证券报 A05、上海证券报 A25、证券日报 E5、证券时报 D17	2012-07-18	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券有限售条件流通股上市流通提示性公告	中国证券报 B008、上海证券报 A24、证券日报 E3、证券时报 D16	2012-07-24	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)
华泰证券 2012 年 7 月份经营情况主要财务信息		2012-08-08	上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn)

七、财务会计报告

- (一) 会计报表（附后）
- (二) 会计报表附注（附后）

八、备查文件目录

本公司在办公地点备置下列备查文件供股东及投资者查询：

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

华泰证券股份有限公司

董事长：吴万善

二〇一二年八月十七日

合并资产负债表（未经审计）

2012 年 6 月 30 日

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

资产	附注	2012年6月30日	2011年12月31日	负债和股东权益	附注	2012年6月30日	2011年12月31日
货币资金	五(一)	40,455,170,892.90	41,545,584,204.66	短期借款		-	-
其中：客户资金存款		30,853,327,749.03	31,214,169,129.16	其中：质押借款		-	-
结算备付金	五(二)	5,896,141,334.41	9,646,114,230.16	拆入资金	五(十八)	590,000,000.00	-
其中：客户备付金		4,931,238,853.32	7,911,940,686.54	交易性金融负债		-	-
拆出资金		-	-	衍生金融负债		-	-
交易性金融资产	五(三)	17,751,153,442.13	19,411,404,791.06	卖出回购金融资产款	五(十九)	10,640,287,935.91	9,045,556,468.53
衍生金融资产	五(四)	-	-	代理买卖证券款	五(二十)	33,414,009,288.51	36,057,227,571.67
买入返售金融资产	五(五)	610,762,736.08	1,033,103,612.47	代理承销证券款		-	-
应收利息	五(六)	70,781,125.79	65,736,055.67	应付职工薪酬	五(二十一)	646,221,969.02	555,535,415.10
存出保证金	五(七)	3,081,447,731.64	2,943,572,195.99	应交税费	五(二十二)	527,932,768.53	336,181,734.33
可供出售金融资产	五(八)	5,797,637,282.84	2,335,631,760.16	应付利息	五(二十三)	1,701,038.52	6,053,075.75
持有至到期投资	五(九)	5,000,000.00	5,000,000.00	预计负债		447,118.94	447,118.94
长期股权投资	五(十)	3,181,675,234.67	2,962,709,049.34	长期借款		-	-
投资性房地产	五(十一)	107,618,611.11	109,729,763.90	应付债券		-	-
固定资产	五(十二)	1,073,136,564.72	1,112,689,249.03	递延所得税负债	五(十五)	92,714,838.04	48,441,486.95
无形资产	五(十三)	365,242,928.89	366,200,731.92	其他负债	五(二十四)	4,789,537,749.08	6,077,551,861.77
其中：交易席位费		6291,520.61	9,658,031.99	负债合计		50,702,852,706.55	52,126,994,733.04
商誉	五(十四)	51,341,567.30	51,341,567.30	股东权益			
递延所得税资产	五(十五)	220,713,290.77	252,534,476.58	股本	五(二十五)	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
其他资产	五(十六)	5,999,258,409.93	3,901,018,647.91	资本公积	五(二十六)	16,934,846,089.54	16,829,341,650.45
				减：库存股		-	-
				盈余公积	五(二十七)	961,235,087.10	961,235,087.10
				一般风险准备	五(二十八)	1,112,131,338.22	1,112,131,338.22
				交易风险准备	五(二十八)	1,022,247,650.47	1,022,247,650.47
				未分配利润	五(二十九)	7,942,387,783.48	7,724,360,430.20
				外币报表折算差额		-18,779,765.95	-20,687,466.85
				归属于母公司股东权益合计		33,554,068,182.86	33,228,628,689.59
				少数股东权益		410,160,263.77	386,746,913.52
				股东权益合计		33,964,228,446.63	33,615,375,603.11
资产总计		84,667,081,153.18	85,742,370,336.15	负债和股东权益总计		84,667,081,153.18	85,742,370,336.15

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

公司资产负债表（未经审计）

2012 年 06 月 30 日

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

资产	附注	2012年6月30日	2011年12月31日	负债和股东权益	附注	2012年6月30日	2011年12月31日
货币资金		34,308,288,918.57	35,581,828,863.58	短期借款		-	-
其中：客户资金存款		28,143,233,792.71	28,827,509,988.55	其中：质押借款		-	-
结算备付金		6,589,602,310.39	9,584,387,907.63	拆入资金		590,000,000.00	-
其中：客户备付金		4,930,411,154.08	7,911,940,686.54	交易性金融负债		-	-
拆出资金		-	-	衍生金融负债		-	-
交易性金融资产		17,664,754,309.58	16,832,627,176.73	卖出回购金融资产款		10,640,287,935.91	7,172,617,266.34
衍生金融资产		-	-	代理买卖证券款		33,026,081,789.80	35,703,290,675.14
买入返售金融资产		610,762,736.08	50,600,000.00	代理承销证券款		-	-
应收利息		59,147,125.79	53,187,197.65	应付职工薪酬		296,113,238.76	209,439,564.54
存出保证金		280,187,554.07	325,837,095.07	应交税费		482,756,347.87	282,517,902.80
可供出售金融资产		3,721,267,524.08	2,251,863,382.08	应付利息		1,701,038.52	5,024,717.56
持有至到期投资		5,000,000.00	5,000,000.00	预计负债		447,118.94	447,118.94
长期股权投资	十一（一）	5,377,442,978.58	4,995,976,793.25	长期借款		-	-
投资性房地产		100,116,795.20	102,056,526.75	应付债券		-	-
固定资产		980,758,510.44	1,016,436,224.24	递延所得税负债		81,895,908.35	33,868,512.27
无形资产		361,421,949.55	363,191,608.14	其他负债		304,709,529.02	1,318,664,954.08
其中：交易席位费		5,910,491.61	9,277,002.99	负债合计		45,423,992,907.17	44,725,870,711.67
商誉		-	-	股东权益			
递延所得税资产		104,069,782.93	135,891,152.83	股本		5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
其他资产	十一（二）	5,384,990,280.28	3,400,659,345.43	资本公积		16,655,528,640.69	16,551,695,483.47
				减：库存股		-	-
				盈余公积		961,235,087.10	961,235,087.10
				一般风险准备		1,112,131,338.22	1,112,131,338.22
				交易风险准备		1,022,247,650.47	1,022,247,650.47
				未分配利润		4,772,675,151.89	4,726,363,002.45
				外币报表折算差额		-	-
				归属于母公司股东权益合计		30,123,817,868.37	29,973,672,561.71
				少数股东权益		-	-
				股东权益合计		30,123,817,868.37	29,973,672,561.71
资产总计		75,547,810,775.54	74,699,543,273.38	负债和股东权益总计		75,547,810,775.54	74,699,543,273.38

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

合并利润表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
一、营业收入		3,394,593,061.36	3,394,839,304.62
手续费及佣金净收入	五(三十)	1,852,149,540.12	2,649,935,404.17
其中：代理买卖证券业务净收入		1,478,442,722.62	2,029,484,614.97
证券承销业务净收入		335,857,645.45	578,686,479.56
受托客户资产管理业务净收入		37,849,172.05	41,764,309.64
利息净收入	五(三十一)	544,839,539.45	560,226,809.06
投资收益（损失以“-”号填列）	五(三十二)	746,017,426.39	192,493,710.42
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		91,597,137.81	76,022,497.62
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	五(三十三)	166,709,878.34	-10,800,032.17
汇兑收益（损失以“-”号填列）		562,854.26	-4,840,722.20
其他业务收入	五(三十七)	84,313,822.80	7,824,135.34
二、营业支出		1,995,986,784.29	1,861,913,786.91
营业税金及附加	五(三十四)	157,878,384.18	178,543,964.93
业务及管理费	五(三十五)	1,810,305,436.26	1,679,287,049.86
资产减值损失	五(三十六)	-	-580,107.75
其他业务成本	五(三十七)	27,802,963.85	4,662,879.87
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,398,606,277.07	1,532,925,517.71
加：营业外收入	五(三十八)	16,412,278.42	5,806,996.09
减：营业外支出	五(三十九)	16,100,356.82	8,213,390.35
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,398,918,198.67	1,530,519,123.45
减：所得税费用	五(四十)	317,675,662.69	375,294,773.81
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,081,242,535.98	1,155,224,349.64
归属于母公司所有者的净利润		1,058,027,353.28	1,143,575,101.57
少数股东损益		23,215,182.70	11,649,248.07
六、每股收益：			
（一）基本每股收益	五(四十一)	0.19	0.20
（二）稀释每股收益		0.19	0.20
七、其他综合收益	五(四十二)	107,610,307.54	-46,453,310.86
八、综合收益总额		1,188,852,843.52	1,108,771,038.78
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,165,439,493.27	1,097,465,867.76
归属于少数股东的综合收益总额		23,413,350.25	11,305,171.02

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

公司利润表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2012 年 1-6 月	2011 年 1-6 月
一、营业收入		2,520,765,919.98	2,208,295,600.42
手续费及佣金净收入	十一(三)	1,341,845,368.84	1,735,540,456.36
其中：代理买卖证券业务净收入		1,295,181,196.79	1,334,705,868.10
证券承销业务净收入		8,815,000.00	359,247,098.34
受托客户资产管理业务净收入		37,849,172.05	41,587,489.92
利息净收入		415,547,312.85	374,340,607.15
投资收益（损失以“-”号填列）	十一(四)	546,034,171.45	109,929,760.96
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		91,597,137.81	76,022,497.62
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		192,109,584.37	-13,853,044.08
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
其他业务收入		25,229,482.47	2,337,820.03
二、营业支出		1,380,812,284.29	1,066,416,484.45
营业税金及附加		113,290,029.08	118,977,100.84
业务及管理费		1,252,082,523.66	945,657,533.06
资产减值损失		-	-
其他业务成本		15,439,731.55	1,781,850.55
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,139,953,635.69	1,141,879,115.97
加：营业外收入		12,650,932.88	3,989,734.62
减：营业外支出		16,054,049.77	7,813,998.98
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,136,550,518.80	1,138,054,851.61
减：所得税费用		250,238,369.36	265,508,088.40
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		886,312,149.44	872,546,763.21
六、每股收益：			
（一）基本每股收益		-	-
（二）稀释每股收益		-	-
七、其他综合收益		103,833,157.22	-6,452,246.64
八、综合收益总额		990,145,306.66	866,094,516.57

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

合并现金流量表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本期金额	上期金额
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		3,150,030,578.58	4,109,418,486.41
拆入资金净增加额		590,000,000.00	-
回购业务资金净增加额		2,017,072,343.77	2,463,896,013.78
代理买卖证券款净增加额		-	-
收到的税费返还		9,263,679.51	2,283,283.43
收到的其他与经营活动有关的现金	五(四十三)	472,823,974.93	296,183,669.47
经营活动现金流入小计		6,239,190,576.79	6,871,781,453.09
处置交易性金融资产净减少额		879,008,993.20	1,360,763,722.54
支付利息、手续费及佣金的现金		761,911,097.24	928,471,484.67
回购业务支付的现金净额		-	-
代理买卖证券款净减少额		2,643,218,283.17	23,587,261,376.21
支付给职工以及为职工支付的现金		968,229,342.18	1,205,991,459.65
支付的各项税费		487,102,795.68	884,658,753.06
支付的其他与经营活动有关的现金	五(四十三)	4,138,022,938.43	3,339,743,839.82
经营活动现金流出小计		9,877,493,449.90	31,306,890,635.95
经营活动产生的现金流量净额		-3,638,302,873.11	-24,435,109,182.86
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		19,412,344.66	-
取得投资收益收到的现金		3,132,413.80	293,380,171.80
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	-
收到其他与投资活动有关的现金		-	6,077,795.10
投资活动现金流入小计		22,544,758.46	299,457,966.90
投资支付的现金		200,000,000.00	309,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		186,565,884.85	142,042,882.38
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		-	-
支付的其他与投资活动有关的现金		-	27,809.56
投资活动现金流出小计		386,565,884.85	451,070,691.94
投资活动产生的现金流量净额		-364,021,126.39	-151,612,725.04
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		-	-
收到其他与筹资活动有关的现金		-	-
筹资活动现金流入小计		-	-
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		840,000,000.00	828,919,927.51
其中：子公司支付给少数股东的股利		-	-
支付其他与筹资活动有关的现金		756,895.95	-
筹资活动现金流出小计		840,756,895.95	828,919,927.51
筹资活动产生的现金流量净额		-840,756,895.95	-828,919,927.51
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		2,694,687.94	-10,497,126.72
五、现金及现金等价物净增加额		-4,840,386,207.51	-25,426,138,962.13
加：期初现金及现金等价物余额		51,191,698,434.82	84,592,887,329.46
六、期末现金及现金等价物余额	五(四十四)	46,351,312,227.31	59,166,748,367.33

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

公司现金流量表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本期金额	上期金额
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		2,423,777,038.18	2,698,384,463.81
拆入资金净增加额		590,000,000.00	-
回购业务资金净增加额		2,907,507,933.49	2,010,874,534.25
代理买卖证券款净增加额		-	-
收到的税费返还		9,263,679.51	2,283,283.43
收到的其他与经营活动有关的现金		91,521,844.94	134,120,213.97
经营活动现金流入小计		6,022,070,496.12	4,845,662,495.46
处置交易性金融资产净减少额		1,531,758,784.02	591,082,380.12
支付利息、手续费及佣金的现金		674,911,067.72	608,949,298.37
回购业务支付的现金净额		-	-
代理买卖证券款净减少额		2,677,208,885.34	18,658,538,839.65
支付给职工以及为职工支付的现金		610,209,637.47	679,765,902.33
支付的各项税费		364,415,115.87	624,344,979.05
支付的其他与经营活动有关的现金		3,122,958,336.19	2,595,227,293.76
经营活动现金流出小计		8,981,461,826.61	23,757,908,693.28
经营活动产生的现金流量净额	十一(五)	-2,959,391,330.49	-18,912,246,197.82
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		-	-
取得投资收益收到的现金		2,016,000.00	270,125,146.47
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	-
收到其他与投资活动有关的现金		69,463,740.40	320,663.48
投资活动现金流入小计		71,479,740.40	270,445,809.95
投资支付的现金		362,500,000.00	309,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		177,157,056.21	98,743,543.55
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		-	-
支付的其他与投资活动有关的现金		-	-
投资活动现金流出小计		539,657,056.21	407,743,543.55
投资活动产生的现金流量净额		-468,177,315.81	-137,297,733.60
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		-	-
收到其他与筹资活动有关的现金		-	-
筹资活动现金流入小计		-	-
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		840,000,000.00	828,919,927.51
其中：子公司支付给少数股东的股利		-	-
支付其他与筹资活动有关的现金		756,895.95	-
筹资活动现金流出小计		840,756,895.95	828,919,927.51
筹资活动产生的现金流量净额		-840,756,895.95	-828,919,927.51
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
		-	-
五、现金及现金等价物净增加额			
加：期初现金及现金等价物余额		45,166,216,771.21	61,581,180,630.32
六、期末现金及现金等价物余额			
		40,897,891,228.96	41,702,716,771.39

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

合并股东权益变动表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

项目	本期金额									少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益										
	股本	资本公积	减: 库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润	外币折算差额			
一、上年年末余额	5,600,000,000.00	16,829,341,650.45	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	7,724,360,430.20	-20,687,466.85	386,746,913.52	33,615,375,603.11	
加: 同一控制下企业合并产生的追溯调整	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
二、本年初余额	5,600,000,000.00	16,829,341,650.45	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	7,724,360,430.20	-20,687,466.85	386,746,913.52	33,615,375,603.11	
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	-	105,504,439.09	-	-	-	-	218,027,353.28	1,907,700.90	23,413,350.25	348,852,843.52	
(一) 净利润	-	-	-	-	-	-	1,058,027,353.28	-	23,215,182.70	1,081,242,535.98	
(二) 其他综合收益	-	105,504,439.09	-	-	-	-	-	1,907,700.90	198,167.55	107,610,307.54	
上述 (一) 和 (二) 小计	-	105,504,439.09	-	-	-	-	1,058,027,353.28	1,907,700.90	23,413,350.25	1,188,852,843.52	
(三) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
1. 股东投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
(四) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-	-	-840,000,000.00	
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3. 提取交易风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-	-	-840,000,000.00	
5. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
(五) 股东权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4. 一般风险准备弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
5. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
五、本期期末余额	5,600,000,000.00	16,934,846,089.54	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	7,942,387,783.48	-18,779,765.95	410,160,263.77	33,964,228,446.63	

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

合并股东权益变动表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

项目	上期金额									少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益										
	股本	资本公积	减: 库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润	外币折算差额			
一、上年年末余额	5,600,000,000.00	17,415,179,706.11	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,197,662,924.77	-8,922,614.14		357,985,284.89	33,239,788,099.97
加: 同一控制下企业合并产生的追溯调整	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年初余额	5,600,000,000.00	17,415,179,706.11	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,197,662,924.77	-8,922,614.14		357,985,284.89	33,239,788,099.97
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-40,131,359.06	-	-	-	-	303,575,101.57	-5,659,711.75		11,305,171.02	269,089,201.78
(一) 净利润	-	-	-	-	-	-	1,143,575,101.57	-		11,649,248.07	1,155,224,349.64
(二) 其他综合收益	-	-40,449,522.06	-	-	-	-	-	-5,659,711.75		-344,077.05	-46,453,310.86
上述(一)和(二)小计	-	-40,449,522.06	-	-	-	-	1,143,575,101.57	-5,659,711.75		11,305,171.02	1,108,771,038.78
(三) 股东投入和减少资本	-	318,163.00	-	-	-	-	-	-		-	318,163.00
1. 股东投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
2. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
3. 其他	-	318,163.00	-	-	-	-	-	-		-	318,163.00
(四) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-		-	-840,000,000.00
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
3. 提取交易风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
4. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-		-	-840,000,000.00
5. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
(五) 股东权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
4. 一般风险准备弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
四、本期末余额	5,600,000,000.00	17,375,048,347.05	-	821,991,327.95	972,887,579.07	883,003,891.32	7,501,238,026.34	-14,582,325.89		369,290,455.91	33,508,877,301.75

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

公司股东权益变动表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位:华泰证券股份有限公司

金额单位: 人民币元

项目	本期金额							
	股本	资本公积	减: 库存股	盈余公积	一般风险准备	交易风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、上年年末余额	5,600,000,000.00	16,551,695,483.47	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	4,726,363,002.45	29,973,672,561.71
加: 会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
其它	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年初余额	5,600,000,000.00	16,551,695,483.47	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	4,726,363,002.45	29,973,672,561.71
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	103,833,157.22	-	-	-	-	46,312,149.44	150,145,306.66
(一) 净利润	-	-	-	-	-	-	886,312,149.44	886,312,149.44
(二) 其他综合收益	-	103,833,157.22	-	-	-	-	-	103,833,157.22
上述(一)和(二)小计	-	103,833,157.22	-	-	-	-	886,312,149.44	990,145,306.66
(三) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
(四) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-840,000,000.00
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 提取交易风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-840,000,000.00	-840,000,000.00
5. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 股东权益内部结转	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 一般风险准备弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
五、本期期末余额	5,600,000,000.00	16,655,528,640.69	-	961,235,087.10	1,112,131,338.22	1,022,247,650.47	4,772,675,151.89	30,123,817,868.37

法定代表人: 吴万善

主管会计工作负责人: 吴万善

会计机构负责人: 舒本娥

公司股东权益变动表（未经审计）

2012 年度 1-6 月

编制单位：华泰证券股份有限公司

金额单位：人民币元

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

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

华泰证券股份有限公司 2012 年度 1-6 月财务报表附注

编制单位：华泰证券股份有限公司

单位：人民币元

一、公司基本情况

华泰证券股份有限公司（以下简称“本公司”）的前身为江苏省证券公司，经中国人民银行总行批准，于 1991 年 4 月 9 日设立，领取注册号为 13475424-6 号企业法人营业执照，注册资本为人民币 1,000 万元。

1997 年 6 月，本公司 1996 年度股东会通过实施增资扩股方案，并经中国人民银行总行银复[1997]501 号文批准，公司注册资本增至人民币 40,400 万元，同时更名为江苏证券有限责任公司，并于 1998 年 4 月 21 日变更工商注册登记。

1998 年 5 月，本公司 1997 年度股东会通过实施增资扩股方案，注册资本增至人民币 82,800 万元，并于 1999 年 1 月 18 日变更工商注册登记，领取注册登记号为 3200001100365 企业法人营业执照。

1999 年 3 月，本公司经股东会通过并经中国证券监督管理委员会证监机构字[1999]152 号文批准，公司的注册资本变更为 85,032 万元，同时更名为华泰证券有限责任公司，于 1999 年 12 月 21 日变更工商注册登记。

2001 年 4 月，本公司经股东会通过预备实施增资扩股方案，2002 年 4 月经中国证监会核准，公司注册资本由人民币 85,032 万元增至 220,000 万元，于 2002 年 5 月 24 日变更工商注册登记。

2007 年 12 月，经中国证券监督管理委员会证监机构字[2007]311 号文批准，本公司整体变更为股份有限公司，注册资本变更为 450,000 万元，于 2007 年 12 月 7 日变更工商注册登记，领取注册登记号为 320000000000192 企业法人营业执照，经营期限五十年。公司注册地为江苏省南京市，公司法定代表人为吴万善。

2009 年 7 月，本公司经股东大会通过并经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]715 号文批准，注册资本由人民币 450,000 万元增至 481,543.8725 万元，并且吸收合并信泰证券有限责任公司。本公司于 2009 年 7 月 31 日完成注册资本及经营范围工商注册登记变更手续。

经中国证券监督管理委员会证监发行字[2010]138 号《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》批准，本公司于 2010 年 2 月 9 日，采取“网下向配售对象询价配售和网上向社会公众投资者定价发行相结合”的方式，公开发行人民币普通股（A 股）78,456.1275 万股，并于 2010 年 2 月 26 日在上海证券交易所挂牌交易。公司注册资本变更为人民币 560,000 万元，并于 2010 年 2 月 23 日领取了变更后的企业法人营业执照。

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

根据公司 2010 年度股东大会决议和中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司变更业务范围的批复》（证监许可[2011]1353 号），2011 年 9 月 5 日，经江苏省工商行政管理局核准，本公司经营范围变更为：证券经纪业务，证券自营，证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具），证券投

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

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

本公司的权力机构是股东大会，实行董事会领导下的总裁负责制，董事会下设合规与风险管理委员会、审计委员会、发展战略委员会、提名委员会、薪酬与考核委员会。公司根据总体发展规划和业务发展的具体情况，下设董事会办公室、合规与风险管理部、经纪业务总部、固定收益部、证券投资部、金融创新部、资产管理总部、销售交易部、财富管理部、融资融券部、研究所、理财服务中心、运营中心、信息技术部、计划财务部、人力资源部、稽查部、办公室、党群工作部、企划部、督导室、综合事务部等部门。

截至 2012 年 6 月 30 日止，本公司拥有华泰联合证券有限责任公司、华泰长城期货有限公司、华泰金融控股（香港）有限公司、华泰紫金投资有限责任公司、华泰金控投资咨询（深圳）有限公司五家子公司；下属 223 家证券营业部，子公司华泰长城期货有限公司下属 29 家期货营业部；公司拥有南方基金管理有限公司和华泰柏瑞基金管理有限公司两家联营企业。

截至 2012 年 6 月 30 日止，本公司共有员工 8,188 人，其中高级管理人员 9 人。

二、重要会计政策、会计估计和前期差错

（一）财务报表的编制基础

本公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照《企业会计准则—基本准则》和其他各项具体会计准则、应用指南及准则解释的规定进行确认和计量，在此基础上编制财务报表。编制符合企业会计准则要求的财务报表需要使用估计和假设，这些估计和假设会影响到财务报告日的资产、负债和或有负债的披露，以及报告期间的收入和费用。

（二）遵循企业会计准则的声明

本公司编制的财务报表符合《企业会计准则》的要求，真实、完整地反映了本公司 2012 年 6 月 30 日的财务状况、2012 年度 1-6 月的经营成果和现金流量等有关信息。

（三）会计年度

本公司会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

（四）记账本位币

本公司以人民币为记账本位币。

（五）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

1、同一控制下的企业合并

对于同一控制下的企业合并，合并方在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在被合并方的账面价值计量。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

2、非同一控制下企业合并

对于非同一控制下的企业合并，合并成本为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。

通过多次交换交易分步实现的非同一控制下企业合并，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

(1) 在个别财务报表中，以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为该项投资的初始投资成本；购买日之前持有的被购买方的股权涉及其他综合收益的，在处置该项投资时将与其相关的其他综合收益（例如，可供出售金融资产公允价值变动计入资本公积的部分，下同）转入当期投资收益。

(2) 在合并财务报表中，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及其他综合收益的，与其相关的其他综合收益转为购买日所属当期投资收益。

购买方为进行企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

购买方对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。购买方对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，经复核后合并成本仍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。

（六）合并财务报表的编制方法

本公司将拥有实际控制权的子公司和特殊目的主体纳入合并财务报表范围。

本公司合并财务报表按照《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》及相关规定的要求编制，合并时合并范围内的所有重大内部交易和往来业已抵销。子公司的股东权益中不属于母公司所拥有的部分作为少数股东权益在合并财务报表中股东权益项下单独列示。

子公司与本公司采用的会计政策或会计期间不一致的，在编制合并财务报表时，按照本公司的会计政策或会计期间对子公司财务报表进行必要的调整。

对于非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其个别财务报表进行调整；对于同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，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是一体化存续下来的，对合并资产负债表的期初数进行调整，同时对比较报表的相关项目进行调整。

（七）现金及现金等价物的确定标准

本公司在编制现金流量表时所确定的现金，是指本公司的库存现金以及可以随时用于支付的存款；现金等价物，是指本公司持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

（八）外币业务和外币报表折算

1、外币业务

本公司对发生的外币业务，采用交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。资产负债

表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，由此产生的汇兑损益，除属于与符合资本化条件资产有关的借款产生的汇兑损益，予以资本化计入相关资产成本外，其余计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。

2、外币财务报表折算

本公司对合并范围内境外经营实体的财务报表（含采用不同于本公司记账本位币的境内子公司、合营企业、联营企业、分支机构等），折算为人民币财务报表进行编报。

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，股东权益项目除未分配利润项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用平均汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在编制合并财务报表时，在合并资产负债表中所有者权益项目下单独作为一外币报表折算差额项目单独列示。外币现金流量采用现金流量发生时的即期汇率折算汇率变动对现金的影响额，在现金流量表中单独列示。

处置境外经营时，与该境外经营有关的外币报表折算差额，按比例转入处置当期损益。

（九）金融工具

1、金融工具的分类、确认依据和计量方法

本公司的金融资产包括：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项（相关说明见附注二之（十））、可供出售金融资产和持有至到期投资。金融资产的分类取决于本公司及其子公司对金融资产的持有意图和持有能力。

本公司的金融负债包括：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

包括交易性金融资产和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，本公司采用近期出售的投资策略而买入的股票、基金、债券等确认为交易性金融资产。这类金融资产按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期但尚未领取的债券利息，单独确认为应收项目。本公司在持有该等金融资产期间取得的利息或现金股利，确认为投资收益。资产负债表日，本公司将该等金融资产的公允价值变动计入当期损益。处置该等金融资产时，该等金融资产公允价值与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。本公司售出的交易性金融资产，以移动加权平均法结转成本。

（2）持有至到期投资

指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本公司有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产，该非衍生金融资产有活跃的市场，可以取得其市场价格。本公司对持有至到期投资，按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。支付的价款中包含的已到付息期但尚未领取的债券利息的，单独确认为应收项目。持有至到期投资在持有期间按照摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益。实际利率在取得持有至到期投资时确定，在随后期间保持不变。实际利率与票面利率差别很小的，按票面利率计算利息收入，计入投资收益。处置持有至到期投资时，将所取得价款与该投资账面价值之间的差额确认为投资收益。

如本公司因持有意图或能力发生改变，使某项投资不再适合作为持有至到期投资，则将其重分类为可供出售金融资产，并以公允价值进行后续计量。重分类日，该投资的账面价值与公允价值之间的差额计入

所有者权益，在该可供出售金融资产发生减值或终止确认时转出，计入当期损益。

（3）可供出售金融资产

指初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，即本公司没有划分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、贷款和应收款项的金融资产。

本公司可供出售金融资产按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。支付的价款中包含已到付息期但尚未领取的债券利息或已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。本公司可供出售金融资产持有期间取得的利息或现金股利，确认为投资收益。资产负债表日，可供出售资产按公允价值计量，其公允价值变动计入“资本公积—其他资本公积”。

处置可供出售金融资产时，将取得的价款和该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益，同时，将原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

（4）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

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

（5）其他金融负债

本公司的其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。主要包括企业发行的债券等。其他金融负债按其公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。采用摊余成本进行后续计量。

2、金融资产转移的确认依据和计量方法

本公司的金融资产转移，包括下列两种情形：

（1）将收取金融资产现金流量的权利转移给另一方；

（2）将金融资产转移给另一方，但保留收取金融资产现金流量的权利，并承担将收取的现金流量支付给最终收款方的义务，同时满足下列条件：

A. 从该金融资产收到对等的现金流量时，才有义务将其支付给最终收款方。企业发生短期垫付款，但有权全额收回该垫付款并按照市场上同期银行贷款利率计收利息的，视同满足本条件。

B. 根据合同约定，不能出售该金融资产或作为担保物，但可以将其作为对最终收款方支付现金流量的保证。

C. 有义务将收取的现金流量及时支付给最终收款方。企业无权将该现金流量进行再投资，但按照合同约定在相邻两次支付间隔期内将所收到的现金流量进行现金或现金等价物投资的除外。企业按照合同约定进行再投资的，应当将投资收益按照合同约定支付给最终收款方。

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

既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：

(1) 放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产。

(2) 未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

3、金融负债终止确认条件

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

4、金融工具的公允价值确定方法

存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值，活跃市场的报价包括易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融资产的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。对于没有报价且其公允价值不能可靠计量的金融资产投资，按成本计量。

(1) 公允价值的估值原则

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

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

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

4) 银行间市场和场外交易债券类金融资产：包括国债、企业债、短期融资券、特种金融债和中央银行票据等，按估值计算。

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

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

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

5、金融资产减值测试方法、减值准备计提方法

资产负债表日，本公司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。

对于持有至到期投资，有客观证据表明其发生了减值的，根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额计算确认减值损失；计提后如有证据表明其价值已恢复，原确认的减值损失可予以转回，记入当期损益，但该转回的账面价值不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。

对于可供出售金融资产，如果其公允价值出现持续大幅度下降，且预期该下降为非暂时性的，则根据其初始投资成本扣除已收回本金和已摊销金额及当期公允价值后的差额计算确认减值损失；在计提减值损失时将原直接计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入“资产减值损失”。

（十） 应收款项

本公司应收款项（包括应收账款和其他应收款等）按合同或协议价款作为初始入账金额。

1、 坏账的确认标准

- (1) 凡因债务人破产，依照法律清偿程序清偿后仍无法收回；
- (2) 因债务人死亡，既无遗产可供清偿，又无义务承担人，确实无法收回；
- (3) 因债务人逾期未能履行偿债义务，并且有明显特征表明无法收回。

2、 坏账损失的核算方法

采用备抵法核算。

3、 坏账准备的计提方法和计提比例

(1) 在资产负债表日，本公司对单项金额重大的应收款项单独进行减值测试，如有客观证据表明其发生了减值的，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；对单项测试未减值的应收款项，汇同对单项金额非重大的应收款项，按类似的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算确定减值损失，计提坏账准备。

(2) 按组合计提坏账准备的应收款项

类别	账龄			
	1 年以内	1-2 年	2-3 年	3 年以上
账龄分析法		3%		50%-100%
余额百分比法*		3%		

*押金及备用金采用余额百分比计提坏账准备。

(3) 单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收款项

对于单项金额虽不重大，如有迹象表明某项应收款项的可收回性与该账龄段其他应收款项存在明显差别，导致该项应收款项如果按照既定比例计提坏账准备，无法真实反映其可收回金额的，采用个别认定法计提坏账准备。

对确实无法收回的应收款项，经批准后作为坏账损失，并冲销提取的坏账准备。

本公司收回应收款项时，将取得的价款和应收款项账面价值之间的差额计入当期损益。

(十一) 交易结算资金核算办法

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

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

3、 本公司于每季度末按规定向客户统一结息时，增加客户交易结算资金。

(十二) 长期股权投资

本公司的长期股权投资包括对子公司的投资、对合营企业、联营企业的投资和对被投资企业不具有控制、共同控制或重大影响，且在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益性投资（其他长期股权投资）。

1、 投资成本的确定

本公司对子公司的投资按照初始投资成本计价，控股合并形成的长期股权投资的初始计量参见本附注二之（五）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法。追加或收回投资调整长期股权投资的成本。

本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，以及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，均按照初始投资成本计价。

2、 后续计量及损益确认方法

本公司对子公司的投资的后续计量采用成本法核算，编制合并财务报表时按照权益法进行调整。除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外，按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认投资收益。

本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，后续计量采用权益法核算。长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，不调整长期股权投资的初始投资成本；长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。取得长期股权投资后，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额，确认投资损益并调整长期股权投资的账面价值。本公司按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。

本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，后续计量采用成本法核算。

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经营决策需要分享控制权的投资方一致同意时存在。投资企业与其他方对被投资单位实施共同控制的，被投资单位为其合营企业；重大影响，是指对一个企业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。投资企业能够对被投资单位施加重大影响

的，被投资单位为其联营企业。

4、减值测试方法及减值准备计提方法

资产负债表日，若因市价持续下跌或被投资单位经营状况恶化等原因使长期股权投资存在减值迹象时，根据单项长期股权投资的公允价值减去处置费用后的净额与长期股权投资预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定长期股权投资的可收回金额。长期股权投资的可收回金额低于账面价值时，将资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。长期股权投资减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

(十三) 投资性房地产

本公司的投资性房地产包括已出租的房屋建筑物等。

本公司的投资性房地产按其成本作为入账价值，外购投资性房地产的成本包括购买价款、相关税费和可直接归属于该资产的其他支出；自行建造投资性房地产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。

本公司对投资性房地产采用成本模式进行后续计量，按其预计使用寿命及净残值率对房屋建筑物计提折旧。投资性房地产的预计使用寿命、净残值率及年折旧（摊销）率列示如下：

类别	预计使用寿命（年）	预计净残值率	年折旧（摊销）率
房屋建筑物	35 年	3%	2.77%

投资性房地产的用途改变为自用时，自改变之日起，本公司将该投资性房地产转换为固定资产或无形资产。自用房地产的用途改变为赚取租金或资本增值时，自改变之日起，本公司将固定资产或无形资产转换为投资性房地产。发生转换时，以转换前的账面价值作为转换后的入账价值。

资产负债表日，若单项投资性房地产的可收回金额低于账面价值时，将资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。投资性房地产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

当投资性房地产被处置，或者永久退出使用且预计不能从其处置中取得经济利益时，终止确认该项投资性房地产。投资性房地产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的金额计入当期损益。

(十四) 固定资产

1、固定资产确认条件

固定资产指同时满足与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业和该固定资产的成本能够可靠地计量条件的，为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

本公司固定资产按取得时的实际成本入账。

2、各类固定资产的折旧方法

除已提足折旧仍继续使用的固定资产和单独计价入账的土地之外，本公司对所有固定资产计提折旧。折旧方法采用年限平均法。

本公司根据固定资产的性质和使用情况，确定固定资产的使用寿命和预计净残值。并在年度终了，对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整。

本公司的固定资产类别、折旧年限、残值率和年折旧率如下：

固定资产类别	预计使用寿命	预计净残值率	年折旧率
房屋及建筑物	30-35 年	3%	2.77%-3.23%
电子设备	5 年	3%	19.40%
运输设备	5-8 年	3%	12.13%-19.40%
办公设备	5 年	3%	19.40%
其他设备	5 年	3%	19.40%

3、固定资产的减值测试方法、减值准备计提方法

资产负债表日，固定资产按照账面价值与可收回金额孰低计价。若单项固定资产的可收回金额低于账面价值，将资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。固定资产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

4、其他说明

本公司固定资产按成本进行初始计量。其中，外购的固定资产的成本包括买价、增值税、进口关税等相关税费，以及为使固定资产达到预定可使用状态前所发生的可直接归属于该资产的其他支出。自行建造固定资产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。投资者投入的固定资产，按投资合同或协议约定的价值作为入账价值，但合同或协议约定价值不公允的按公允价值入账。

当固定资产被处置、或者预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的金额计入当期损益。

（十五） 在建工程

本公司自行建造的在建工程按实际成本计价，实际成本由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。本公司的在建工程只包括房屋建筑物。

已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的固定资产，按照估计价值确定其成本，并计提折旧；待办理竣工决算后，再按实际成本调整原来的暂估价值，但不调整原已计提的折旧额。

资产负债表日，本公司对在建工程按照账面价值与可收回金额孰低计量，按单项工程可收回金额低于账面价值的差额，计提在建工程减值准备，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。在建工程减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

（十六） 借款费用

借款费用，包括借款利息、折价或者溢价的摊销、辅助费用以及因外币借款而发生的汇兑差额等。

本公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时根据其发生额确认为费用，计入当期损益。

（十七） 无形资产

本公司无形资产是指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。包括交易席位费、软件和土地使用权等。

无形资产按照成本进行初始计量。购入的无形资产，按实际支付的价款和相关支出作为实际成本。

投资者投入的无形资产，按投资合同或协议约定的价值确定实际成本，但合同或协议约定价值不公允的，按公允价值确定实际成本。

本公司在取得无形资产时分析判断其使用寿命，划分为使用寿命有限和使用寿命不确定的无形资产。使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内采用直线法摊销；使用寿命不确定的无形资产不予摊销。

本公司购入的交易席位费按取得时的实际成本计价，并按直线法在 10 年内进行摊销。

本公司在每个会计期间对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。于每年年度终了，对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。

资产负债表日，无形资产按照账面价值与可收回金额孰低计价。无形资产存在减值迹象的，公司估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，按差额计提资产减值准备，具体核算办法与上述固定资产减值核算办法一致。无形资产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

公司无形资产具体项目及摊销年限如下：

类别	使用寿命	摊销方法
交易席位费	10 年	直线法
软件系统等	2-3 年	直线法
土地使用权	50 年	直线法

（十八） 商誉

商誉为非同一控制下企业合并成本超过应享有的被投资单位或被购买方可辨认净资产于取得日或购买日的公允价值份额的差额。

与子公司有关的商誉在合并财务报表上单独列示，与联营企业和合营企业有关的商誉，包含在长期股权投资的账面价值中。

本公司对商誉不摊销，在财务报表中单独列示的商誉至少在每年年终进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值依据相关的资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中受益的情况分摊至受益的资产组或资产组组合。难以分摊至相关的资产组的，将其分摊至相关的资产组组合。在将商誉的账面价值分摊至相关的资产组或者资产组组合时，按照各资产组或者资产组组合的公允价值占相关资产组或者资产组组合公允价值总额的比例进行分摊。公允价值难以可靠计量的，按照各资产组或者资产组组合的账面价值占相关资产组或者资产组组合账面价值总额的比例进行分摊。

在对包含商誉的相关资产组或者资产组组合进行减值测试时，如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，先对不包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，计算可收回金额，并与相关账面价值相比较，确认相应的减值损失。再对包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，比较这些相关资产组或者资产组组合的账面价值（包括所分摊的商誉的账面价值部分）与其可收回金额，如相关资产组或者资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认商誉的减值损失。

商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。

（十九） 长期待摊费用

本公司长期待摊费用是指已经支出，但受益期限在一年以上（不含一年）的各项费用，包括：租入固定资产改良支出、其他，其摊销方法如下：

类别	摊销方法	摊销年限	备注
租入固定资产改良支出	直线法	自费用发生当月起在受益期	
其他	直线法	内平均摊销	

（二十） 抵债资产

抵债资产是指债务重组取得的债务人用以抵债的非现金资产，该项资产尚未转为公司自用。抵债资产取得时按其公允价值入账，并将重组债权的账面价值与该抵债资产公允价值之间的差额，计入当期损益。

公司在资产负债表日判断抵债资产是否存在可能发生减值的迹象，对存在减值迹象的抵债资产，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，将抵债资产的账面价值减记至收回金额，减记的金额确认为抵债资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的抵债资产减值准备。

抵债资产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

（二十一） 预计负债

本公司发生与或有事项相关的义务并同时符合以下条件时，在资产负债表中确认为预计负债：（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企业；（3）该义务的金额能够可靠地计量。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，并综合考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。货币时间价值影响重大的，通过对相关未来现金流出进行折现后确定最佳估计数。本公司于资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，并对账面价值进行调整以反映当前最佳估计数。

（二十二） 盈余公积计提

根据公司法的相关规定，本公司按照当年实现净利润（减弥补亏损）的 10% 计提法定盈余公积。

（二十三） 一般风险准备、交易风险准备

根据证券法的相关规定，本公司按照当年实现净利润（减弥补亏损）的 10% 分别计提一般风险准备、交易风险准备。一般风险准备累计达到注册资本的 50% 时不再提取。

（二十四） 收入

1、 收入确认方法

各项手续费及佣金收入同时满足下列条件的，才能予以确认：

- （1）提供的相关服务完成；
- （2）收入的金额能够可靠地计量；
- （3）相关的经济利益很可能流入企业

本公司收入主要分为：手续费及佣金收入、利息收入和其他业务收入。

2、 手续费及佣金收入

（1）代买卖证券手续费收入，在与客户办理买卖证券款项清算日确认收入，手续费收取的依据和标准为根据成交金额及代买卖的证券品种按相应的费率收取。

(2) 代兑付债券手续费收入，在代兑付债券业务提供的相关服务完成并与委托方结算时确认收入；

(3) 证券承销、保荐业务收入，采用代销方式和余额承购包销方式代理发行证券收取的手续费收入。它的确认主要以证券承销项目结束，根据承销协议、实际证券承销数量和收取比例等收取承销手续费后确认；

(4) 财务顾问费收入，在该项业务按照合同提供的相关咨询服务完成时确认收入；

(5) 投资咨询服务等业务收入，以劳务已提供、视提供劳务交易的结果是否能够可靠估计，合理确认；

(6) 受托客户资产管理业务收入，定向资产管理业务于委托资产管理合同到期与委托单位结算收益或损失时，按合同约定计算确认收入；集合资产管理业务每月按受托资产规模和合同约定的费率计算确认收入。

3、利息收入

(1) 利息收入，以利息款项已收到或取得利息收款凭据时确认收入的实现；

(2) 买入返售金融资产利息收入，按照合同约定利率和回购金额按权责发生制原则确认；

(3) 融资融券业务利息收入，根据客户实际使用资金、实际卖出证券市值及使用时间，按每笔融券交易计算并确认相应的融券利息收入。

4、投资收益

本公司持有交易性金融资产、可供出售金融资产期间取得的红利、股息或现金股利确认当期收益；处置可供出售金融资产时所取得价款与该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益；处置交易性金融资产其公允价值与初始入帐金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。

采用成本法核算长期股权投资的，按被投资单位宣告发放的现金股利或利润中属于本公司的部分确认收益；采用权益法核算长期股权投资的，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认投资收益。

5、公允价值变动损益

对以公允价值计量且其变动进入当期损益的金融资产或金融负债等在资产负债表日因公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债等时，将原计入该金融资产、金融负债的公允价值变动从公允价值变动损益转入投资收益。

6、其他业务收入

反映公司从事除证券经营业务以外的其他业务实现的收入。包括出租固定资产、出租无形资产或债务重组等实现的收入以及投资性房地产取得的租金收入，该等收入于劳务已提供、资产已转让时确认。

(二十五) 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，但不包括政府作为企业所有者投入的资本。

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量；政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能可靠取得的，按照名义金额（人民币 1 元）计量。

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

已确认的政府补助需要返还的，存在相关递延收益的，冲减相关递延收益账面余额，超出部分计入当期损益；不存在相关递延收益的，直接计入当期损益。

（二十六） 递延所得税资产和递延所得税负债

对于可抵扣暂时性差异确认递延所得税资产，以未来期间很可能取得的用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

对于应纳税暂时性差异，除特殊情况外，确认递延所得税负债。

不确认递延所得税资产或递延所得税负债的特殊情况包括：商誉的初始确认；除企业合并以外的发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的其他交易或事项。

（二十七） 经营租赁

如果租赁条款在实质上将与租赁资产所有权有关的全部风险和报酬转移给承租人，该租赁为融资租赁，其他租赁则为经营租赁。本公司的租赁为经营性租赁。

本公司作为承租人，经营租赁中的租金，在租赁期内各个期间按照直线法计入相关资产成本或当期损益；发生的初始直接费用，计入当期损益。

（二十八） 所得税费

本公司的所得税采用资产负债表债务法核算。资产、负债的账面价值与其计税基础存在差异的，按照规定确认所产生的递延所得税资产和递延所得税负债。

在资产负债表日，对于当期和以前期间形成的当期所得税负债（或资产），按照税法规定计算的预期应交纳（或返还）的所得税金额计量；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。

递延所得税资产的确认以本公司很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、可抵扣亏损和税款抵减的应纳税所得额为限。在无法明确估计可抵扣暂时性差异预期转回期间可能取得的应纳税所得额时，不确认与可抵扣暂时性差异相关的递延所得税资产。对子公司、联营企业及合营企业投资相关的应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债，予以确认，但同时满足能够控制应纳税暂时性差异转回的时间且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回的，不予确认；对子公司、联营企业及合营企业投资相关的可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产，该可抵扣暂时性差异同时满足在可预见的未来很可能转回即在可预见的将来有处置该项投资的明确计划，且预计在处置该项投资时，除了有足够的应纳税所得以外，还有足够的投资收益用以抵扣可抵扣暂时性差异时，予以确认。

资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核。除企业合并、直接在所有者权益中确认的交易或者事项产生的所得税外，本公司将当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益。

（二十九） 利润分配

由本公司股东大会根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》及公司章程确定，其税后利润除国家另有规定外，按照下列顺序分配：

- 1、 弥补以前年度亏损；
- 2、 提取法定盈余公积金，按照税后利润的 10%提取；
- 3、 提取一般风险准备金，按照税后利润的 10%提取；
- 4、 提取交易风险准备金，按照税后利润的 10%提取；
- 5、 提取任意盈余公积金；
- 6、 分配利润。

（三十） 套期会计

套期保值分为公允价值套期、现金流量套期和境外经营净投资套期。

本公司的套期保值是以套期保值为目的参与股指期货交易的，对符合套期保值会计运用条件的，公司采用套期会计方法进行处理。

（三十一） 融资融券业务

融资融券业务，是指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。融资融券业务分为融资业务和融券业务两类。

1、 融资业务

按融出资金金额确认债权，根据客户实际使用资金及使用时间，按每笔融资交易计算并确认相应的融资利息收入。

2、 融券业务

对融出的证券不做金融资产转移处理，根据客户实际卖出证券市值及使用时间，按每笔融券交易计算并确认相应的融券利息收入。

（三十二） 买入返售与卖出回购证券业务

1、 买入返售证券业务

对于买入返售证券业务，本公司在买入证券时，按实际支付的金额确认为买入返售金融资产。资产负债表日，按照合同约定利率计算确定的买入返售金融资产的利息收入确认为当期收入。

2、 卖出回购证券业务

对于卖出回购证券业务，本公司在卖出证券时，按实际支付的金额确认为卖出回购金融资产款。资产负债表日，按照合同约定利率计算确定的卖出回购金融资产款的利息支出确认为当期成本。

（三十三） 代理承销证券业务

- 1、 本公司代理承销证券，根据与发行人确定的发售方式，按以下规定核算：

通过证券交易所上网发行的，在证券上网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。承销期结束，将承销证券款项交付委托单位并收取承销手续费，计入手续费及佣金收入。承销期结束有未售出证券，采用余额承购包销方式承销证券的，按承销价款，转为交易性金融资产或可供出售金融资产；

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

2、 待转承销费用

本公司将在发行项目立项之前的相关费用计入当期损益科目。在项目立项之后，本公司将可单独辨认的发行费用记入待转承销费用科目，待项目成功发行后，结转损益。所有已确认不能成功发行的项目费用作为发行沉没成本记入当期损益。

（三十四） 代理兑付债券业务

代理兑付债券业务是公司接受证券发行人的委托对其发行的债券到期进行债券兑付的业务。代兑付债券的手续费收入于代兑付债券业务提供的相关服务完成时确认。

（三十五） 资产管理业务

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

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

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

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

（三十六） 主要会计政策、会计估计变更

本报告期主要会计政策、会计估计未发生变更。

（三十七） 前期会计差错更正

本报告期未发生前期会计差错更正。

三、 税项

（一） 流转税及附加税

税目	纳税（费）基础	税（费）率	备注
营业税	应税营业收入	5%	
城建税	营业税额	7%、5%	东莞 5%
教育费附加	营业税额	3%、4%	江苏、东莞 4%

（二） 企业所得税

公司名称	税率	备注
本公司	25%	
华泰联合证券有限责任公司	25%	

公司名称	税率	备注
华泰长城期货有限公司	25%	
华泰紫金投资有限责任公司	25%	
华泰金融控股（香港）有限公司	16.5%	最高税率 16.5%
华泰金控投资咨询（深圳）有限公司	25%	

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

（三） 房产税

（1）房产税按照房产原值的 70% 为纳税基础，税率为 1.2%。

（2）以租金收入为纳税基准，税率为 12%。

（3）物业税，换取物业使用权的成本，税率为 15%

（四） 个人所得税

员工个人所得税由本公司代扣代缴。

四、企业合并及合并财务报表

（一） 子公司情况

1、 通过投资设立或投资等方式取得的子公司

子公司名称	子公司类型	注册地	业务性质	注册资本	法人代表	主要经营范围
华泰紫金投资有限责任公司	全资	南京市	股权投资	RMB500,000,000.00	张海波	股权投资、投资于依法公开发行的国债、公司债、货币基金、央行票据等证券
华泰金融控股（香港）有限公司	全资	香港	证券业	HKD500,000,000.00	张海波	受香港证券及期货事务监察委员会规管的各类证券业务
华泰金控投资咨询（深圳）有限公司	控股	深圳市	信息咨询 管理咨询	HKD10,000,000.00	宋羊洲	项目投资信息咨询、企业管理咨询、经济信息咨询、市场营销策划

子公司名称	持股比例 (%)		表决权比例 (%)	期末实际出资额	实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	是否合并
	直接	间接				
华泰紫金投资有限责任公司	100	—	100	RMB500,000,000.00	—	是
华泰金融控股（香港）有限公司	100	—	100	HKD500,000,000.00	—	是
华泰金控投资咨询（深圳）有限公司	—	100	100	HKD10,000,000.00	—	是

子公司名称	企业类型	组织机构代码	少数股东权益	少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	备注
华泰紫金投资有限责任公司	有限公司	67982047-7	—	—	—
华泰金融控股（香港）有限公司	有限公司	37387817-000-11-07-7	—	—	—
华泰金控投资咨询（深圳）有限公司	有限公司	56279815-7	—	—	—

2、 非同一控制下的企业合并取得的子公司

子公司名称	子公司类型	注册地	业务性质	注册资本	法人代表	经营范围
华泰联合证券有限责任公司	控股	深圳市	证券金融	1,000,000,000.00	盛希泰	证券承销与保荐业务；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；
华泰长城期货有限公司	控股	广州市	期货经纪	600,000,000.00	吴建党	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询

子公司名称	持股比例%	表决权比例%	期末实际出资额	实质上构成对子公司净投资的其他项目余额	是否合并
华泰联合证券有限责任公司	98.186	98.186	1,206,780,736.83	—	是
华泰长城期货有限公司	60	60	366,598,085.65	—	是

子公司名称	企业类型	组织机构代码	少数股东权益	少数股东权益中用于冲减少数股东损益的金额	备注
华泰联合证券有限责任公司	有限公司	27943491-3	81,729,693.54	—	—
华泰长城期货有限公司	有限公司	100022258	328,430,570.23	—	—

（二）合并范围发生变更的说明

本年度本公司合并报表范围未发生变更的情况。

（三）境外经营实体主要报表项目的折算汇率

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

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

五、合并财务报表主要项目注释

（一）货币资金

项目	币种	期末余额			年初余额		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
现金	人民币	1,740,856.16		1,740,856.16	1,231,143.51		1,231,143.51
	美元	24,969.01	6.3249	157,926.49	25,064.01	6.3009	157,925.83
	港币	59,762.44	0.8152	48,718.34	17,026.27	0.8107	13,803.20
小计				1,947,500.99			1,402,872.54
银行存款							
公司自有:							
	人民币	9,262,383,876.28		9,262,383,876.28	9,890,910,357.07		9,890,910,357.07
	美元	22,816,445.68	6.3249	144,311,737.28	22,505,405.15	6.3009	141,804,307.36
	港币	212,833,018.42	0.8152	173,501,476.62	115,474,594.6	0.8107	93,615,253.82
自有信用资金存款	人民币	17,186,475.35		17,186,475.35	170,213,420.81		170,213,420.81
小计				9,597,383,565.53			10,296,543,339.06

客户存款:							
	人民币	29,408,035,555.13		29,408,035,555.13	30,043,692,188.7		30,043,692,188.74
	美元	60,324,304.41	6.3249	381,545,192.96	22,505,405.15	6.3009	395,662,673.62
	港币	463,348,056.36	0.8152	377,721,335.54	463,836,762.60	0.8107	376,032,463.46
客户信用资金存款	人民币	686,025,665.40		686,025,665.40	398,781,803.28		398,781,803.28
小计				30,853,327,749.03			31,214,169,129.10
其他货币资金	人民币	2,512,077.35		2,512,077.35	33,468,863.96		33,468,863.96
合计				40,455,170,892.90			41,545,584,204.66

(二) 结算备付金

项目	币种	期末余额			年初余额		
		原币	汇率	人民币	原币	汇率	人民币
公司备付金							
	人民币	609,613,980.92		609,613,980.92	1,318,424,705.96		1,318,424,705.96
小计:		609,613,980.92		609,613,980.92	1,318,424,705.96		1,318,424,705.96
客户备付金							
	人民币	4,738,986,620.35		4,738,986,620.35	7,793,511,069.43		7,793,511,069.43
	美元	21,719,706.55	6.3249	137,374,971.96	15,697,697.13	6.3009	98,909,619.83
	港币	67,317,542.95	0.8152	54,877,261.01	24,077,953.92	0.8107	19,519,997.28
小计:				4,931,238,853.32			7,911,940,686.54
信用备付金	人民币	355,288,500.17		355,288,500.17	415,748,837.66		415,748,837.66
合计				5,896,141,334.41			9,646,114,230.16

期末结算备付金余额比年初余额减少 38.88%，系期末在交易所存放的客户资金头寸减少所致。

(三) 交易性金融资产

项目	期末余额		年初余额	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
企业债券	14,610,941,124.50	14,991,019,393.74	17,170,639,042.46	17,331,500,472.53
权益工具	1,905,454,938.87	1,822,516,818.09	1,422,661,411.78	1,389,230,653.10
基金	641,277,937.75	641,224,080.30	289,326,950.27	275,415,835.43
国债	291,936,792.96	296,393,150.00	406,210,116.84	415,257,830.00
合计	17,449,610,794.08	17,751,153,442.13	19,288,837,521.35	19,411,404,791.06

其中作为本公司回购交易质押品的债券金额为 10,396,560,388.62 元。

(四) 衍生金融资产

衍生金融资产期末余额为 0，其中股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间抵销后的净额为 0。

期末股指期货投资情况

品种	代码	名称	持仓量(买卖)	合约市值	公允价值变动
沪深 300 指数	IF1207	IF1207	-1637	1,211,838,360.00	5,688,060.00
沪深 300 指数	IF1208	IF1208	-15	11,124,900.00	-117,300.00
沪深 300 指数	IF1209	IF1209	-533	396,967,740.00	12,232,800.00
沪深 300 指数	IF1212	IF1212	-250	188,145,000.00	4,661,640.00
合计					22,465,200.00
减: 可抵消股指期货暂收暂付款					22,465,200.00
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。

(五) 买入返售金融资产

(1) 按证券品种

项目	期末余额	年初余额
证券	610,762,736.08	1,033,103,612.47

(2) 按交易对手

项目	期末余额	年初余额
银行金融机构	100,000,000.00	251,315,912.30
非银行金融机构	510,762,736.08	781,787,700.17
合计	610,762,736.08	1,033,103,612.47

(3) 按交易品种

项目	期末余额		年初余额	
	账面金额	约定到期金额	账面金额	约定到期金额
OR006	100,000,000.00	100,067,397.26	—	—
OR015	370,762,736.08	371,544,892.43	—	—
OR007	140,000,000.00	140,147,671.23	532,826,200.66	533,323,245.84
OR014	—	—	187,856,753.12	188,246,862.62
OR021	—	—	200,220,658.69	200,715,912.30
RC007	—	—	112,200,000.00	112,297,499.18
合计	610,762,736.08	611,759,960.92	1,033,103,612.47	1,034,583,519.94

(4) 期末买入返售金融资产余额比年初减少 40.88%, 主要是买入返售证券减少。

(六) 应收利息

项目	年初账面余额	本期增加额	本期减少额	期末账面余额	未收回原因
应收银行利息	27,174,252.53	242,169,183.90	257,709,436.43	11,634,000.00	尚未结息
融资融券业务利息	37,590,400.50	58,758,803.67	37,590,400.50	58,758,803.67	尚未到期
买入返售金融资产利息	971,402.64	388,322.12	971,402.64	388,322.12	尚未结息
合计	65,736,055.67	301,316,309.69	296,316,309.69	70,781,125.79	

期末应收利息账龄都为 1 年以内, 不存在收回的风险。

(七) 存出保证金

(1) 按项目列示

项目	期末余额	年初余额
交易保证金	66,100,968.90	329,741,817.59
履约保证金	2,000,000.00	2,000,000.00
期货公司保证金	3,013,346,762.74	2,611,830,378.40
合计	3,081,447,731.64	2,943,572,195.99

(2) 按交易场所列示

项目	期末余额	年初余额
交易保证金:		
上海证券交易所	31,306,171.07	28,903,714.07
深圳证券交易所	23,096,300.00	20,996,300.00
香港联合交易所有限公司	948,634.83	944,542.52
其他	10,749,863.00	278,897,261.00
小计	66,100,968.90	329,741,817.6
履约保证金:		
深圳证券交易所	2,000,000.00	2,000,000.00
其他	—	—
小计	2,000,000.00	2,000,000.00
期货公司保证金:		
上海期货交易所	803,411,211.51	699,234,009.00
大连商品交易所	451,125,040.82	250,235,379.7
郑州商品交易所	530,512,985.96	592,838,713.84
中国金融期货交易所	1,228,297,524.45	1,069,522,275.91
小计	3,013,346,762.74	2,611,830,378.40
合计	3,081,447,731.64	2,943,572,195.99

(八) 可供出售金融资产

项目	期末余额		年初余额	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
可供出售债券	1,336,245,780.26	1,341,276,559.84	173,758,748.57	163,083,099.92
可供出售权益工具*	2,535,347,428.64	2,195,565,989.55	2,365,368,942.59	1,929,271,732.93
其中: 基金	782,471,217.73	722,932,646.13	197,248,679.67	174,183,097.94
其他	2,277,712,951.19	2,260,794,733.45	274,301,530.53	243,276,927.31
合计	6,149,306,160.09	5,797,637,282.84	2,813,429,221.69	2,335,631,760.16

(1) 其中作为本公司回购交易质押品的债券金额为 1,341,276,559.84 元。

(2) 截止 2012 年 6 月末, 可供出售金融资产余额其中融出证券 143,239,911.24 元。

持有的前十名融出证券明细如下:

证券名称	证券代码	期末市值
中国平安	601318	11,965,584.00
贵州茅台	600519	10,767,011.30

中信证券	600030	7,703,529.57
中国太保	601601	5,853,568.16
光大银行	601818	4,118,000.00
洋河股份	002304	4,083,323.40
中国人寿	601628	3,980,963.70
海通证券	600837	3,391,243.02
宏源证券	000562	3,355,635.20
包钢稀土	600111	2,951,608.00
合计		58,170,466.35

(3) 可供出售金融资产限售明细:

证券名称	数量	期末账面价值	限售期限
日出东方	207,900	4,010,391.00	2012年8月21日
东江环保	500,000	29,500,000.00	2012年7月26日
汉盛基金	5,000,000	5,025,000.00	封闭式基金发起人持有的份额, 2014年5月17日到期
汉兴基金	5,000,000	4,065,000.00	封闭式基金发起人持有的份额, 2014年12月30日到期
鸿阳基金	3,000,000	1,638,000.00	封闭式基金发起人持有的份额, 2016年12月9日到期
合计		44,238,391.00	

(4) 其他系持有的理财产品

期末可供出售金融资产比年初增加了 148.23%，主要是本期理财产品大幅增加。

(九) 持有至到期投资

项 目	期末余额	年初余额
企业债券	5,000,000.00	5,000,000.00
持有至到期投资合计	5,000,000.00	5,000,000.00
减: 持有至到期投资减值准备	—	—
持有至到期投资账面价值	5,000,000.00	5,000,000.00

本报告期内无出售尚未到期的持有至到期投资情况。

(十) 长期股权投资

对联营企业投资

本公司主要联营企业相关信息列示如下:

被投资单位名称	本企业持股比例 (%)	企业在被投资单位表决权比 (%)	期末资产总额	期末负债总额	期末净资产总额	本期营业收入总额	本期净利润
南方基金管理有限公司	45	45	2,870,638,682.57	879,077,738.53	1,991,560,944.04	828,487,637.11	194,288,346.56
华泰柏瑞基金管理有限公司	49	49	456,469,025.77	45,830,613.75	410,638,412.02	114,338,433.97	19,603,837.59

(1) 分类情况

项 目	期末余额		年初余额	
	金额	减值准备	金额	减值准备

按成本法核算的长期股权投资	2,124,385,079.23	7,772,000.66	1,924,385,079.23	7,772,000.66
按权益法核算的长期股权投资	1,065,062,156.10	—	1,046,095,970.77	—
	3,189,447,235.33	7,772,000.66	2,970,481,050.00	7,772,000.66

(2) 按成本法核算的长期股权投资主要单位列示如下:

被投资单位名称	持股比例%	表决权比例%	投资成本	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
江苏银行股份有限公司	7.03	7.03	1,300,000,000.00	1,300,000,000.00	—	—	1,300,000,000.00
苏州世名科技开发有限公司	10.00	10.00	20,000,000.00	20,000,000.00	—	—	20,000,000.00
苏州浩波科技股份有限公司	6.79	6.79	18,200,000.00	18,200,000.00	—	—	18,200,000.00
江苏中恒宠物用品股份有限公司	11.11	11.11	23,200,000.00	23,200,000.00	—	—	23,200,000.00
江苏天容集团股份有限公司	5.93	5.93	44,450,000.00	44,450,000.00	—	—	44,450,000.00
上海金融发展投资基金			500,000,000.00	300,000,000.00	200,000,000.00	—	500,000,000.00
南京德邦金属装备工程有限公司	6.59	6.59	20,590,000.00	20,590,000.00	—	—	20,590,000.00
江苏鹏鹞环境工程承包有限公司	6.95	6.95	145,950,000.00	145,950,000.00	—	—	145,950,000.00
其他法人股投资			51,995,079.23	51,995,079.23	—	—	51,995,079.23
合计			2,124,385,079.23	1,924,385,079.23	200,000,000.00	—	2,124,385,079.23

(3) 按权益法核算的长期股权投资

被投资单位名称	持股比例	表决权比例	投资成本	年初余额
南方基金管理有限公司	45.00%	45.00%	857,250,015.50	852,450,016.99
华泰柏瑞基金管理有限公司	49.00%	49.00%	165,256,241.16	193,645,953.78
合计			1,022,506,256.66	1,046,095,970.77

(续上表)

被投资单位名称	本期增加	本期减少	期末余额	本期现金红利
南方基金管理有限公司	89,265,639.68	81,000,000.00	860,715,656.67	81,000,000.00
华泰柏瑞基金管理有限公司	10,700,545.65	—	204,346,499.43	—
合计	99,966,185.33	81,000,000.00	1,065,062,156.10	81,000,000.00

(4) 长期股权投资减值准备

被投资单位名称	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额	计提原因
其他法人股投资	7,772,000.66	—	—	7,772,000.66	净资产为负
合计	7,772,000.66	—	—	7,772,000.66	

(十一) 投资性房地产

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原值				
房屋建筑物	150,423,372.71	—	—	150,423,372.71
累计折旧				
房屋建筑物	38,773,059.47	2,111,152.79	—	40,884,212.26
减值准备				

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
房屋建筑物	1,920,549.34	—	—	1,920,549.34
账面价值				
房屋建筑物	109,729,763.90			107,618,611.11

(十二) 固定资产

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原值				
房屋及建筑物	799,041,527.50	34,081,846.91	—	833,123,374.41
电子设备	861,373,164.79	9,138,801.18	8,746,394.77	861,765,571.20
运输设备	148,618,421.37	2,488,458.00	920,165.42	150,186,713.95
办公设备	61,597,015.91	20,755,509.18	1,229,223.25	81,123,301.84
其他设备	15,111,138.17	541,053.23	5,146,974.49	10,505,216.91
合计	1,885,741,267.74	67,005,668.50	16,042,757.93	1,936,704,178.31
累计折旧				
房屋及建筑物	192,243,828.30	11,373,989.32	—	203,617,817.62
电子设备	476,940,079.19	66,435,548.27	8,921,261.23	534,454,366.23
运输设备	60,630,082.14	7,741,530.81	932,143.66	67,439,469.29
办公设备	35,412,254.66	16,957,308.17	1,250,718.40	51,118,844.43
其他设备	7,825,774.42	1,122,540.04	2,011,198.44	6,937,116.02
合计	773,052,018.71	103,630,916.61	13,115,321.73	863,567,613.59
减值准备				
房屋及建筑物	—	—	—	—
电子设备	—	—	—	—
运输设备	—	—	—	—
办公设备	—	—	—	—
其他设备	—	—	—	—
合计	—	—	—	—
账面价值				
房屋及建筑物	606,797,699.20			629,505,556.79
电子设备	384,433,085.60			327,311,204.97
运输设备	87,988,339.23			82,747,244.66
办公设备	26,184,761.25			30,004,457.41
其他设备	7,285,363.75			3,568,100.89
合计	1,112,689,249.03			1,073,136,564.72

(十三) 无形资产

(1)分类列示

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
-----	------	------	------	------

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
原值				
土地使用权	359,161,122.60	—	—	359,161,122.6
交易席位费	125,565,678.11	—	—	125,565,678.1
软件支出等	66,901,008.30	13,699,558.40	—	80,600,566.7
小计	551,627,809.01	13,699,558.40	—	565,327,367.41
累计摊销				
土地使用权	28,343,599.19	3,588,440.76	—	31,932,039.95
交易席位费	115,907,646.12	3,366,511.38	—	119,274,157.50
软件支出等	41,175,831.78	7,702,409.29	—	48,878,241.07
小计	185,427,077.09	14,657,361.43	—	200,084,438.52
减值准备				
土地使用权	—	—	—	—
交易席位费	—	—	—	—
软件支出等	—	—	—	—
小计	—	—	—	—
账面价值				
土地使用权	330,817,523.41	—	—	327,229,082.65
交易席位费	9,658,031.99	—	—	6,291,520.61
软件支出等	25,725,176.52	—	—	31,722,325.63
合计	366,200,731.92	—	—	365,242,928.89

(2) 交易席位费

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、原价				
1.上海证券交易所	82,507,452.82	—	—	82,507,452.82
A 股	75,477,156.76	—	—	75,477,156.76
B 股	7,030,296.06	—	—	7,030,296.06
2.深圳证券交易所	41,927,196.29	—	—	41,927,196.29
A 股	41,077,196.29	—	—	41,077,196.29
B 股	850,000.00	—	—	850,000.00
3.其他交易所	1,131,029.00	—	—	1,131,029.00
小计	125,565,678.11	—	—	125,565,678.11
二、累计摊销额				
1.上海证券交易所	75,882,673.17	2,193,693.88	—	78,076,367.05
A 股	69,269,506.29	1,930,749.85	—	71,200,256.14
B 股	6,613,166.88	262,944.03	—	6,876,110.91
2.深圳证券交易所	39,274,972.95	791,788.50	—	40,066,761.45
A 股	38,484,972.95	791,788.50	—	39,276,761.45
B 股	790,000.00	—	—	790,000.00

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
3.其他交易所	750,000.00	381,029.00	—	1,131,029.00
小计	115,907,646.12	3,366,511.38	—	119,274,157.50
三、账面价值				
1.上海证券交易所	6,624,779.65	—	—	4,431,085.77
A 股	6,207,650.47	—	—	4,276,900.62
B 股	417,129.18	—	—	154,185.15
2.深圳证券交易所	2,652,223.34	—	—	1,860,434.84
A 股	2,592,223.34	—	—	1,800,434.84
B 股	60,000.00	—	—	60,000.00
3.其他交易所	381,029.00	—	—	—
合计	9,658,031.99	—	—	6,291,520.61

(十四) 商誉

被投资单位名称	形成来源	初始金额	年初账面余额	本期增加额	本期减少额	期末账面余额	期末减值准备
华泰联合证券有限责任公司	非同一控制下企业合并产生	51,089,439.80	51,089,439.80	—	—	51,089,439.80	—
华泰长城期货有限公司	非同一控制下企业合并产生	252,127.50	252,127.50	—	—	252,127.50	—
		51,341,567.30	51,341,567.30	—	—	51,341,567.30	—

商誉组成明细如下：

项 目	华泰联合	华泰长城	合 计
原始投资金额	702,563,500.00	29,580,000.00	732,143,500.00
购入时按净资产享有权益	651,474,060.20	29,326,040.43	680,800,100.63
购入时溢价	51,089,439.80	253,959.57	51,343,399.37
减：已摊销额	—	1,832.07	1,832.07
净值	51,089,439.80	252,127.50	51,341,567.30

公司对于非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值按照预计未来现金流量现值进行计算，其可收回金额均高于账面价值，未发生减值，无需计提商誉的减值准备。

(十五) 递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 递延所得税资产

项目	期末余额		年初余额	
	暂时性差异	递延所得税资产	暂时性差异	递延所得税资产
应收账款账面价值小于计税基础形成	453,988,240.52	113,497,060.13	453,988,240.52	113,497,060.13
长期股权投资账面价值小于计税基础形成	7,772,000.66	1,943,000.16	7,772,000.66	1,943,000.16
投资性房地产账面价值小于计税基础形成	1,920,549.34	480,137.34	1,920,549.34	480,137.34
抵债资产账面价值小于计税基础形成	26,112,930.76	6,528,232.69	26,112,930.76	6,528,232.69
可供出售金融资产公允价值变动	386,979,960.01	96,744,990.00	514,265,439.61	128,566,359.90
以后年度可弥补亏损	201,225.94	33,202.28	200,110.24	33,018.19

项目	期末余额		年初余额	
	暂时性差异	递延所得税资产	暂时性差异	递延所得税资产
其他	5,946,672.68	1,486,668.17	5,946,672.68	1,486,668.17
合计	882,921,579.91	220,713,290.77	1,010,205,943.81	252,534,476.58

(2) 递延所得税负债

项目	期末余额		年初余额	
	暂时性差异	递延所得税负债	暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产公允价值变动	324,031,553.04	81,007,888.26	122,567,269.73	30,641,817.43
可供出售金融资产公允价值变动	24,362,599.13	6,090,649.78	36,467,978.08	9,116,994.52
衍生金融工具	22,465,200.00	5,616,300.00	34,730,700.00	8,682,675.00
合计	370,859,352.17	92,714,838.04	193,765,947.81	48,441,486.95

(十六) 其他资产

项目	期末余额	年初余额
应收股利 (1)	81,000,000.00	—
应收款项 (2)	523,859,968.52	590,915,821.99
在建工程 (3)	472,005,764.62	373,272,187.69
其他流动资产 (4)	4,631,840,306.20	2,602,360,686.11
长期待摊费用 (5)	259,239,439.84	303,157,021.37
其他非流动资产	31,312,930.75	31,312,930.75
其中：抵债资产	29,912,930.75	29,912,930.75
合计	5,999,258,409.93	3,901,018,647.91

期末其他资产比年初增加了 53.79%，主要是融出资金大幅增加。

其他资产明细项目列示如下：

- (1) 应收股利系应收本期南方基金分配股利。
- (2) 应收款项

1) 应收款项按类别列示如下：

类别	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例%	金额	比例%	
单项计提坏账准备的应收款项	461,075,936.04	47.16	437,768,144.48	96.47	23,307,791.56
按账龄分析法计提坏账准备的应收款项	500,277,976.66	51.17	15,960,487.49	3.52	484,317,489.17
按余额百分比法计提坏账准备的应收款项*	16,283,538.41	1.67	48,850.62	0.01	16,234,687.79
合计	977,637,451.11	100.00	453,777,482.59	100.00	523,859,968.52
类别	年初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例%	金额	比例%	

单项计提坏账准备的应收款项	461,075,936.04	44.14	437,768,144.48	96.47	23,307,791.56
按账龄分析法计提坏账准备的应收款项	567,333,830.13	54.31	15,960,487.49	3.52	551,373,342.64
按余额百分比法计提坏账准备的应收款项*	16,283,538.41	1.55	48,850.62	0.01	16,234,687.79
合计	1,044,693,304.58	100.00	453,777,482.59	100.00	590,915,821.99

*押金及备用金采用余额百分比计提坏账准备。

按账龄分析法计提坏账准备的应收款项：

类别	期末余额			年初余额		
	账面余额		坏账准备	账面余额		坏账准备
	金额	比例(%)		金额	比例(%)	
1年以内	437,741,688.85	87.50	360,224.53	504,797,542.32	88.98	360,224.53
1至2年	26,547,799.00	5.31	79,643.40	26,547,799.00	4.68	79,643.40
2至3年	5,937,039.72	1.19	18,055.64	5,937,039.72	1.05	18,055.64
3年以上	30,051,449.09	6.01	15,502,563.92	30,051,449.09	5.30	15,502,563.92
合计	500,277,976.66	100.00	15,960,487.49	567,333,830.13	100.00	15,960,487.49

2) 期末应收款项前 5 名单位情况列示如下：

单位名称或内容	与本公司关系	金额	账龄	款项性质
四通集团公司	非关联方	223,130,292.63	5年以上	用原受托管理营业部资金及账外融资等
上海保利广场资产管理有限公司	非关联方	196,688,024.00	1年以内	定金
华夏基金管理有限公司	非关联方	52,797,819.75	1-4年	用交易席位的佣金
华诚投资管理有限公司	非关联方	47,278,666.10	5年以上	用原受托管理营业部资金等
天津南大科技有限公司	非关联方	30,869,930.42	5年以上	垫款项

截止 2012 年 06 月 30 日，应收款项中金额较大的前 5 名单位欠款人民币 550,764,732.90 元，占应收款项期末余额的 56.34%。

截至 2012 年 06 月 30 日止，应收款项余额中无持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位欠款。

3) 应收款项单项计提坏账准备情况列示如下：

应收款项内容	期末账面金额	计提比例%	坏账准备	理由
占用原受托管理营业部资金等	352,905,707.95	96.82	341,690,854.75	收回可能性极小
代垫款项	59,022,872.28	100.00	59,022,872.28	
扣押金及往来款等	31,506,855.81	99.04	31,205,787.45	款项收回有风险
基金公司租用交易席位的佣金	17,640,500.00	33.15	5,848,630.00	款项回收慢
合计	461,075,936.04	94.94	437,768,144.48	

(3) 在建工程

1) 分类情况

项 目	期末余额	年初余额
-----	------	------

	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
华泰证券广场	463,135,191.36	—	463,135,191.36	365,423,508.39	—	365,423,508.39
其他工程	8,870,573.26	—	8,870,573.26	7,848,679.30	—	7,848,679.30
合计	472,005,764.62	—	472,005,764.62	373,272,187.69	—	373,272,187.69

2) 在建工程本期变动情况

项 目	预算数 (亿元)	资金来源	年初余额		本期增加额	
			金额	其中: 利息资本化	金额	其中: 利息资本化
华泰证券广场	16.38	自筹	365,423,508.39	—	97,893,325.57	—
其他工程	—	自筹	7,848,679.30	—	1,021,893.96	—
合计			373,272,187.69	—	98,915,219.53	—

(续上表)

项 目	本期减少额		期末金额		工程投入占 预算比	工程进度
	金额	其中: 本期转 固定资产	金额	其中: 利息资 本化金额		
华泰证券广场	181,642.60	—	463,135,191.36	—	28.27%	28.27%
其他工程		—	8,870,573.26	—	—	—
合计	181,642.60	—	472,005,764.62	—	—	—

3) 期末在建工程不存在减值迹象, 不需计提在建工程减值准备。

(4) 其他流动资产

项 目	期末余额	年初余额
融出资金	4,570,667,222.47	2,566,571,197.60
待摊费用	9,512,841.45	11,048,153.19
待转承销费用	39,039,966.79	15,557,985.82
其他	12,620,275.49	9,183,349.50
合计	4,631,840,306.20	2,602,360,686.11

融出资金

1) 客户融资买入证券市值前十名情况

项目	2012 年 06 月 30 日市值
包钢稀土	243,859,524.82
民生银行	135,522,671.80
兴业银行	131,599,962.56
中信证券	121,063,298.88
五 粮 液	97,163,965.08
中国平安	92,736,935.20
中铁二局	81,552,092.44
白云山 A	74,117,048.04
海螺水泥	58,241,295.84
中恒集团	49,527,165.92

项目	2012 年 06 月 30 日市值
合计	1,085,383,960.58

2) 融资融券担保物情况

项 目	2012 年 06 月 30 日市值
资金	666,109,503.01
证券	12,236,372,877.43
合计	12,902,482,380.44

(5) 长期待摊费用

项 目	年初余额	本期增加	本期摊销额	期末余额
房屋装修费	288,648,379.98	3,232,034.76	46,936,386.93	244,944,027.81
其他	14,508,641.39	434,759.01	647,988.37	14,295,412.03
合计	303,157,021.37	3,666,793.77	47,584,375.30	259,239,439.84

(十七) 资产减值准备

项 目	年初余额	本期计提	本期减少		期末余额
			转回	转出	
坏账准备	453,777,482.59	—	—	—	453,777,482.59
长期股权投资减值准备	7,772,000.66	—	—	—	7,772,000.66
投资性房地产减值准备	1,920,549.34	—	—	—	1,920,549.34
抵债资产减值准备	26,112,930.76	—	—	—	26,112,930.76
合计	489,582,963.35	—	—	—	489,582,963.35

(十八) 拆入资金

项 目	期末余额	年初余额
拆入资金	590,000,000.00	—

(十九) 卖出回购金融资产款

(1) 按性质分类

项 目	期末余额	年初余额
证券	10,640,287,935.91	9,045,556,468.53
合计	10,640,287,935.91	9,045,556,468.53

其中质押式报价回购 1,059,992,000.00 元。

(2) 按交易方分类

交易类别	期末余额	年初余额
银行金融机构	6,334,772,064.00	4,815,543,519.13
非银行金融机构	4,305,515,871.91	4,230,012,949.40
合计	10,640,287,935.91	9,045,556,468.53

(3) 按交易品种分类

项目	期末余额	年初余额

	账面金额	约定到期金额	账面金额	约定到期金额
GC001	1,883,000,000.00	1,883,578,781.80	1,700,000,000.00	1,700,373,401.90
GC007	129,000,000.00	129,083,516.93	768,000,000.00	768,225,578.12
GC014	35,000,000.00	35,050,900.31	—	—
GC028	6,992,000.00	7,012,468.38	—	—
GC091	1,000,000.00	107,786.58	—	—
RC001	507,000,000.00	507,155,690.22	310,378,000.00	310,377,526.60
R003	680,000,000.00	680,205,750.68	—	—
R004	254,800,000.00	254,911,693.15	—	—
R005	40,000,000.00	40,023,232.88	—	—
R006	2,200,000,000.00	2,201,474,849.31	—	—
R007	821,800,000.00	822,459,465.21	680,000,000.00	680,619,969.88
R014	350,000,000.00	350,624,438.36	3,599,200,000.00	3,604,902,907.18
OR003	1,058,147,657.97	1,058,481,474.49	—	—
OR007	719,647,982.89	720,287,811.55	327,539,202.19	327,847,532.02
OR014	1,375,017,799.58	1,374,439,455.96	653,039,266.34	654,526,183.17
OR021	477,218,385.88	478,162,889.48	—	—
OR030	101,664,109.59	101,954,783.56	—	—
GC002	—	—	307,400,000.00	307,567,172.09
R021	—	—	700,000,000.00	701,878,356.16
合计	10,640,287,935.91	10,645,014,988.85	9,045,556,468.53	9,056,318,627.12

本期拆入资金增加系短期从银行拆入。

(二十) 代理买卖证券款

(1) 按客户结构列示

项 目	期末余额	年初余额
个人客户	31,224,727,689.38	33,900,629,674.54
法人客户	2,189,281,599.13	2,156,597,897.13
合计	33,414,009,288.51	36,057,227,571.67

(2) 按币种列示

币种	期末余额			年初余额		
	原币	折算汇率	折人民币	原币	折算汇率	折人民币
人民币	32,310,080,588.48		32,310,080,588.48	35,007,856,043.33		35,007,856,043.33
港币	739,968,685.79	0.8152	603,222,472.66	699,324,146.89	0.8107	566,942,085.81
美元	79,164,291.51	6.3249	500,706,227.37	76,565,164.12	6.3009	482,429,442.53
			33,414,009,288.51			36,057,227,571.67

(3) 按业务类别

项 目	期末余额	年初余额
经纪业务代理买卖证券款	32,747,899,785.50	35,647,603,166.32
融资融券业务信用交易代理买卖证券款	666,109,503.01	409,624,405.35
合计	33,414,009,288.51	36,057,227,571.67

(二十一) 应付职工薪酬

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
工资、奖金、津贴和补贴	542,700,122.40	923,244,306.03	839,210,634.81	626,733,793.62
职工福利费	—	19,974,487.80	19,974,487.80	—
社会保险费	1,932,690.08	82,597,770.19	82,085,384.19	2,445,076.08
住房公积金	555,968.64	29,286,716.47	28,585,545.15	1,257,139.96
工会经费	4,430,454.24	6,966,196.36	1,347,678.50	10,048,972.10
职工教育经费	5,904,379.36	3,359,296.36	3,605,467.36	5,658,208.36
其他	11,800.38	473,553.94	406,575.42	78,778.90
合计	555,535,415.10	1,065,902,327.15	975,215,773.23	646,221,969.02

(二十二) 应交税费

税 种	期末余额	年初余额
营业税	32,072,882.10	52,401,610.95
城建税	2,134,903.77	3,556,503.15
所得税	138,590,062.76	161,836,701.74
个人所得税	349,032,662.27	111,168,744.61
其中：代扣代缴客户限售股个人所得税	313,651,687.02	83,488,531.91
其他	6,102,257.63	7,218,173.88
合计	527,932,768.53	336,181,734.33

期末应交税费比年初增加了 57.04%，主要是代扣的客户限售股个人所得税增加。

(二十三) 应付利息

项 目	期末余额	年初余额
卖出回购金融资产利息	1,076,693.04	6,053,075.23
其他	624,345.48	0.52
合计	1,701,038.52	6,053,075.75

期末应付利息比年初减少 71.90%，主要系本期短期正回购业务较多应付利息较少。

(二十四) 其他负债

项 目	期末余额	年初余额
应付款项	337,767,900.63	1,350,098,009.19
应付股利	19,729,238.75	19,729,238.75
其他流动负债	4,432,040,609.70	4,707,724,613.83
合计	4,789,537,749.08	6,077,551,861.77

其他负债明细项目列示如下：

(1) 应付款项

1) 分类列示

主要项目	期末余额	年初余额
开放式基金申、认购款	14,338,265.26	1,053,839,993.56
证券投资者保护基金	38,419,374.76	24,432,541.68

主要项目	期末余额	年初余额
亚洲清算组	15,414,654.81	15,414,654.81
其他	269,595,605.80	256,410,819.14
合计	337,767,900.63	1,350,098,009.19

2) 截至 2012 年 06 月 30 日止, 应付持有公司 5%(含 5%)以上表决权股份的股东单位的款项:

单位名称	与本公司关系	款项性质	金额	占应付账款总额的比例%
江苏省国信资产管理集团有限公司	第一大股东	往来款	3,200,912.98	0.95

3) 应付款项中金额较大的几单位明细列示如下:

单位名称	欠款金额	款项性质
中国证券投资者保护基金有限公司	33,115,159.93	投资者保护基金
(亚)清算中心	15,414,654.81	收购亚洲证券清算款
江苏省财政厅	6,145,828.00	往来款
辽宁大成房产有限公司	4,300,000.00	业务往来款
江苏省国信资产管理集团有限公司	3,200,912.98	往来款

截止 2012 年 06 月 30 日, 应付款项前五名合计人民币 62,176,555.72 元, 占应付款项期末余额的 18.41%。

(2) 应付股利

单位名称	期末余额	年初余额	未支付原因
北京北大方正集团公司	2,524,500.00	2,524,500.00	股权已抵债给华泰联合, 待股权转让时一并处理。
东北输变电设备集团公司	1,751,862.75	1,751,862.75	
广州万宝投资发展公司	2,524,500.00	2,524,500.00	
广州珠江实业集团公司	3,646,500.00	3,646,500.00	
中国长城计算机集团公司	2,524,500.00	2,524,500.00	
华诚投资管理有限责任公司	2,356,200.00	2,356,200.00	对华泰联合的欠款未还。
中国原子能工业公司	3,781,140.00	3,781,140.00	受让华诚投资对华泰联合的股权尚有未了结事项。
东风汽车公司	620,000.00	620,000.00	法院冻结。
其他	36.00	36.00	
合计	19,729,238.75	19,729,238.75	

(3) 其他流动负债

主要项目	期末余额	年初余额
代兑付债券款	11,048,900.82	12,827,742.60
期货风险准备金	52,116,609.40	43,827,453.97
期货公司客户保证金	4,367,910,002.27	4,650,336,720.06
其他	965,097.21	732,697.20
合计	4,432,040,609.70	4,707,724,613.83

(二十五) 股本

项 目	年初余额	本期增减(+, -)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
一、有限售条件的股份							
1、国有法人股	3,680,808,641	—	—	—	—	—	3,680,808,641
2、社会法人股	147,666,138	—	—	—	—	—	147,666,138
小 计	3,828,474,779	—	—	—	—	—	3,828,474,779
二、无限售条件的股份							
1、人民币普通股	1,771,525,221	—	—	—	—	—	1,771,525,221
小 计	1,771,525,221	—	—	—	—	—	1,771,525,221
合计	5,600,000,000	—	—	—	—	—	5,600,000,000

(二十六) 资本公积

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
股本溢价	17,218,175,402.90	—	—	17,218,175,402.90
其他资本公积				
可供出售金融资产公允价值变动净额	-477,322,095.18	125,930,416.7	—	-351,391,678.45
与直接计入所有者权益项目相关的所得税	118,564,313.78	—	28,795,025.16	89,769,288.62
被投资单位除净损益外所有者权益其他变动*	-29,602,128.32	8,369,047.52	—	-21,233,080.80
其他	-473,842.73	—	—	-473,842.73
其他资本公积小计	-388,833,752.45	134,299,464.25	28,795,025.16	-283,329,313.36
合计	16,829,341,650.45	134,299,464.25	28,795,025.16	16,934,846,089.54

*主要系按权益法核算的联营公司资本公积变动按本公司持股比例计算，计入资本公积的金额。

(二十七) 盈余公积

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	961,235,087.10	—	—	961,235,087.10

(二十八) 一般风险准备、交易风险准备

项 目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备	1,112,131,338.22	—	—	1,112,131,338.22
交易风险准备	1,022,247,650.47	—	—	1,022,247,650.47

(二十九) 未分配利润

项 目	期末余额
上年期末未分配利润	7,724,360,430.20

项 目	期末余额
加：会计政策变更	—
本年年初未分配利润	7,724,360,430.20
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,058,027,353.28
减：提取法定盈余公积	—
提取一般风险准备	—
提取交易风险准备金	—
应付普通股股利*	840,000,000.00
转作股本的普通股股利	—
未分配利润	7,942,387,783.48

*本公司 2011 年度利润分配方案已经于 2012 年 5 月 11 日召开的公司 2011 年度股东大会审议通过，本次利润分配以 2011 年期末总股本 5,600,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 1.5 元（含税），共计分配现金红利 840,000,000 元，剩余未分配利润全部结转以后年度分配。

（三十） 手续费及佣金净收入

（1） 按业务类别列示

项 目	本期金额	上期金额
手续费及佣金收入：		
证券经纪业务收入	1,740,746,905.76	2,620,779,617.51
证券承销业务收入	305,178,662.92	533,457,956.07
证券保荐业务收入	26,100,000.00	37,600,000.00
财务顾问业务收入	57,280,000.00	33,036,200.00
受托客户资产管理业务收入	38,103,657.87	42,092,993.83
投资咨询业务收入	39,805,447.49	—
期货经纪收入	147,593,284.30	75,370,105.68
小计	2,354,807,958.34	3,342,336,873.09
手续费及佣金支出：		
证券经纪业务手续费支出	448,314,288.82	666,665,108.22
证券承销业务支出	52,701,017.47	24,989,836.60
证券保荐业务支出	—	109,108.00
财务顾问业务支出	—	308,731.91
受托资产管理业务支出	254,485.82	328,684.19
投资咨询业务支出	1,388,626.11	—
小计	502,658,418.22	692,401,468.92
手续费及佣金净收入	1,852,149,540.12	2,649,935,404.17

（2） 受托客户资产管理手续费及佣金收入

项 目	本期金额	上期金额
定向资产管理业务	2,331,486.32	908,199.95
专项资产管理业务	—	—

项 目	本期金额	上期金额
集合资产管理业务	35,772,171.55	41,184,793.88
合计	38,103,657.87	42,092,993.83

(3) 受托客户资产管理手续费及佣金支出

项 目	本期金额	上期金额
定向资产管理业务	—	950.00
专项资产管理业务	—	—
集合资产管理业务	254,485.82	327,734.19
合计	254,485.82	328,684.19

本期手续费及佣金净收入较上年下降 30.11%，主要原因系 2012 年证券市场行情不好，成交量大幅下降，使证券经纪业务收入减少所致。

(三十一) 利息净收入

项 目	本期金额	上期金额
利息收入：		
存放金融机构利息收入	621,887,732.03	685,165,647.12
融资融券利息收入	175,588,884.00	66,135,957.58
买入返售金融资产利息收入	2,968,022.34	8,642,482.59
其他	52,438.83	8,815.45
小计	800,497,077.20	759,952,902.74
利息支出：		
客户保证金利息支出	97,327,381.58	136,526,055.87
资金拆借支出	1,678,000.00	—
证券回购利息支出	156,652,156.17	63,200,037.81
其他	—	—
小计	255,657,537.75	199,726,093.68
利息净收入	544,839,539.45	560,226,809.06

(三十二) 投资收益

项 目	本期金额	上期金额
联营企业和合营企业的投资收益	91,597,137.81	76,022,497.62
出售交易性金融资产的投资收益	454,747,437.71	-225,154,740.62
交易性金融负债形成的投资收益	—	—
出售可供出售金融资产的投资收益	28,124,013.02	-166,246,627.93
出售持有至到期金融资产的投资收益	—	—
金融资产持有期间的收益	214,444,374.54	281,773,617.40
衍生金融工具的投资收益	-45,806,516.69	218,532,263.95
股权转让收益	—	—
成本法核算的投资收益	2,910,980.00	7,566,700.00
	746,017,426.39	192,493,710.42

本期投资收益较上年度上升 287.55%，主要系本期出售交易性金融资产收益比上年同期大幅度上升所致。

(三十三) 公允价值变动收益

项 目	本期金额	上期金额
交易性金融资产公允价值变动收益	178,975,378.34	19,000,647.83
交易性金融负债公允价值变动收益	—	—
衍生金融工具公允价值变动收益	-12,265,500.00	-29,800,680.00
	166,709,878.34	-10,800,032.17

(三十四) 营业税金及附加

项 目	本期金额	上期金额
营业税	140,409,943.79	159,318,130.47
城建税	9,717,158.00	11,097,401.51
教育费附加	6,633,286.19	6,989,475.79
其他	1,117,996.20	1,138,957.16
	157,878,384.18	178,543,964.93

(三十五) 业务及管理费

报告期内公司发生的主要业务及管理费如下：

类 别	本期金额	上期金额
工资及薪金	923,244,306.03	780,764,524.61
固定资产折旧费	103,747,925.92	99,556,849.09
房屋租赁费	108,865,690.32	100,399,642.08
业务招待费	70,397,861.78	74,317,247.31
劳动保险金	53,254,153.14	99,845,023.76
邮电通讯费	65,538,995.66	57,642,321.30
咨询费	37,537,267.36	38,868,711.72
差旅费	33,912,102.88	35,255,728.81
投资者保护基金	34,221,065.64	34,631,295.86
劳务费	38,308,547.60	16,384,415.25
合计	1,469,027,916.33	1,337,665,759.79

主要业务管理费金额合计为 1,469,027,916.33 元，占费用总额的比例为 81.15%。

(三十六) 资产减值损失

项 目	本期金额	上期金额
坏账准备	—	-580,107.75
合计	—	-580,107.75

(三十七) 其他业务收入/成本

(1) 其他业务收入

项 目	本期金额	上期金额
融资服务收入	68,159,798.40	—
其他	16,154,024.40	7,824,135.34
合计	84,313,822.80	7,824,135.34

其他业务收入比上年上升 977.61%，主要是本期融资服务收入大幅增加。

(2) 其他业务支出

项 目	本期金额	上期金额
融资服务支出	19,823,440.00	—
其他	7,979,523.85	4,662,879.87
合计	27,802,963.85	4,662,879.87

其他业务支出比上年上升 496.26%，主要是本期融资服务支出大幅增加

(三十八) 营业外收入

项 目	本期金额	上期金额	计入当期非经常损益的金额
非流动资产处置利得合计	291,437.31	127,579.38	291,437.31
其中：固定资产处理利得	291,437.31	127,579.38	291,437.31
印花税及个人所得税返还收入	8,773,679.51	2,283,283.43	8,773,679.51
政府补助	3,796,400.00	—	3,796,400.00
其他	3,550,761.60	3,396,133.28	3,550,761.60
合计	16,412,278.42	5,806,996.09	16,412,278.42

本期营业外收入较上年度增加 182.63%，主要是印花税返还收入增加。

(三十九) 营业外支出

项 目	本期金额	上期金额	计入当期非经常损益的金额
非流动资产处置损失合计	296,017.46	366,428.34	296,017.46
其中：固定资产处理损失	296,017.46	366,428.34	296,017.46
捐赠支出	2,598,000.00	4,490,930.00	2,598,000.00
一次性房补	8,913,774.45	1,865,575.99	8,913,774.45
其他	4,292,564.91	1,490,456.02	4,292,564.91
合计	16,100,356.82	8,213,390.35	16,100,356.82

本期营业外支出较上期增加 90.03%，主要是一次性房补支出增加。

(四十) 所得税费用

项 目	本期金额	上期金额
当期所得税	275,998,193.10	274,450,086.10
递延所得税	41,677,469.59	100,844,687.71
合 计	317,675,662.69	375,294,773.81

(四十一) 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

1、计算结果

报告期利润	本期数		上期数	
	基本每股	稀释每股	基本每股	稀释每股

	收益	收益	收益	收益
归属于公司普通股股东的净利润（I）	0.1889	0.1889	0.2042	0.2042
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利（II）	0.1889	0.1889	0.2045	0.2045

2、计算过程如下

项 目	序号	本期发生额	上期发生额
归属于本公司普通股股东的净利润	1	1,058,027,353.28	1,143,575,101.57
扣除所得税影响后归属于母公司普通股股东净利润的非经常性损益	2	170,693.59	-1,808,987.89
扣除非经常性损益后的归属于本公司普通股股东的净利润	3=1-2	1,057,856,659.69	1,145,384,089.46
年初股份总数	4	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加的股份数	5	—	—
报告期因发行新股或债转股等增加的股份数	6	—	—
发行新股或债转股等增加股份下一月份起至报告期期末的月份数	7	—	—
报告期因回购等减少的股份数	8	—	—
减少股份下一月份起至报告期期末的月份数	9	—	—
报告期缩股数	10	—	—
报告期月份数	11	6	6
发行在外的普通股加权平均数（I）	12=4+5+6×7÷11-8×9÷11-10	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
因同一控制下企业合并而调整的发行在外的普通股加权平均数（II）	13	5,600,000,000.00	5,600,000,000.00
基本每股收益（I）	14=1÷12	0.1889	0.2042
基本每股收益（II）	15=3÷13	0.1889	0.2045
已确认为费用的稀释性潜在普通股利息	16	—	—
所得税率	17	—	—
转换费用	18	—	—
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	19	—	—
稀释每股收益（I）	20=[1+(16-18)×(1-17)]÷(12+19)	0.1889	0.2042
稀释每股收益（II）	21=[3+(16-8)×(1-17)]÷(13+19)	0.1889	0.2045

（1）基本每股收益

基本每股收益=P0÷S

$$S = S_0 + S_1 + S_i \times M_i \div M_0 - S_j \times M_j \div M_0 - S_k$$

其中：P0 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普通股股东的净利润；S 为发行在外的普通股加权平均数；S0 为期初股份总数；S1 为报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数；Si 为报告期因发行新股或债转股等增加股份数；Sj 为报告期因回购等减少股份数；Sk 为报告期缩股数；M0 报告期月份数；Mi 为增加股份次月起至报告期期末的累计月数；Mj 为减少股份次月起至报告期期末的累

计月数。

(2) 稀释每股收益

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。

(3) 本公司不存在报告期内不具有稀释性但以后期间很可能具有稀释性的潜在普通股。

(四十二) 其他综合收益

项 目	本期金额	上期金额
可供出售金融资产公允价值变动净额	126,128,584.28	-95,471,872.52
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	—	—
与计入其他综合收益项目相关的所得税影响	-28,795,025.16	15,128,638.82
权益法下被投资单位其他股东权益变动的的影响	8,369,047.52	39,549,634.59
外币报表折算差额	1,907,700.90	-5,659,711.75
合 计	107,610,307.54	-46,453,310.86

(四十三) 现金流量表附注

1、收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期金额	上期金额
期货公司保证金净收入	265,993,344.99	—
存出保证金净收回	46,709,001.00	—
收到的往来款项	94,302,746.40	284,759,971.75
其他	65,818,882.54	11,423,697.72
合 计	472,823,974.93	296,183,669.47

2、支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期金额	上期金额
直接支付的费用	450,577,755.26	563,783,460.35
支付投资者保护基金	29,698,974.40	50,910,202.61
支付的证券承销款净额	—	218,378,800.00
支付的融出资金	1,703,091,817.12	1,281,123,738.26
支付的往来款	1,897,831,611.10	1,164,192,990.03
存出保证金本期净支付	—	42,833,398.40
其他	56,822,780.55	18,521,250.17
合计	4,138,022,938.43	3,339,743,839.82

(四十四) 现金流量表补充资料

1、采用间接法将净利润调节为经营活动现金流量

项目	本期金额	上期金额
1、将净利润调节为经营活动的现金流量		
净利润	1,081,242,535.98	1,155,224,349.64
加：计提的资产减值准备	—	-580,107.75
固定资产折旧	103,747,925.92	101,063,847.48
无形资产摊销	14,657,361.43	13,686,066.99
长期待摊费用摊销	47,584,375.30	42,281,224.86
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	4,580.15	-16,760.97
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	—	255,609.93
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-166,709,878.34	10,800,032.17
财务费用（收益以“-”号填列）	—	4,910,398.73
投资损失（收益以“-”号填列）	-107,900,172.27	-403,915,858.38
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	74,130,251.11	-3,262,528.80
递延所得税负债的增加（减少以“-”号填列）	-12,521,448.50	15,329,371.03
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-3,578,303,192.53	-3,931,406,971.18
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-1,094,235,211.36	-21,439,408,180.08
其他	—	-69,676.53
经营活动产生的现金流量净额	-3,638,302,873.11	-24,435,109,182.86
2、不涉及现金收支的投资和筹资活动	—	—
债务转为资本	—	—
一年内到期的可转换公司债券	—	—
融资租入固定资产	—	—
3、现金及现金等价物净增加情况	—	—
现金的期末余额	46,351,312,227.31	59,166,748,367.33
减：现金的年初余额	51,191,698,434.82	84,592,887,329.46
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	-4,840,386,207.51	-25,426,138,962.13

2、现金和现金等价物

项 目	本期金额	上期金额
一、现金	46,351,312,227.31	59,166,748,367.33
其中：库存现金	1,946,876.20	2,098,643.62
可随时用于支付的银行存款	40,450,711,939.35	54,603,051,718.17
可随时用于支付的其他货币资金	2,512,077.35	14,617,660.18
可用于支付的存放中央银行款项	—	—
存放同业款项	—	—
拆放同业款项	—	—

项 目	本期金额	上期金额
结算备付金	5,896,141,334.41	4,546,980,345.36
二、现金等价物	—	—
其中：三个月内到期的债券投资	—	—
三、现金及现金等价物余额	46,351,312,227.31	59,166,748,367.33
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物	—	—

六、关联方关系及其交易

（一）关联方关系

1、本公司的实际控制人情况

本公司的实际控制人为江苏省人民政府国有资产监督管理委员会。

2、本公司的子公司情况

子公司情况详见本附注四、企业合并及合并财务报表之（一）。

3、本公司的联营企业情况

被投资单位名称	组织机 构代码	注册地	法人 代表	业务 性质	注册 资本	本公司 持股比例	本公司在被投资单位 表决权比例
南方基金管理有限公司	279533137	深圳	吴万善	基金管理	15,000	45%	45%
华泰柏瑞基金管理有限公司	71785177-7	上海	齐亮	基金管理	20,000	49%	49%

（续上表）

单位：人民币万元

被投资单位名称	期末资产总额	期末负债总额	期末净资产总额	本期营业收入总额	本期净利润
南方基金管理有限公司	287,063.87	87,907.78	199,156.09	82,848.76	19,428.83
华泰柏瑞基金管理有限公司	45,646.90	4,583.06	41,063.84	11,433.84	1,960.38

4、本公司的其他关联方情况

关联方名称	与本公司关系	组织机构代码
江苏省国信资产管理集团有限公司	持有本公司股份 24.432%，第一大股东	73572480-0
江苏交通控股有限公司	持有本公司股份 8.497%	13476706-3
江苏汇鸿国际集团有限公司	持有本公司股份 7.850%	13479189-9
江苏高科技投资集团有限公司	持有本公司股份 7.609%	13475957-3
江苏省苏豪控股集团有限公司	持有本公司股份 6.097%	13477712-2
江苏银行股份有限公司	公司持有其股份 7.03%	79654459-8
吴万善	公司董事长	—

关联方名称	与本公司关系	组织机构代码
潘剑秋	董事	—
周易	公司总裁、董事	—
张海波	公司副总裁	—
齐亮	公司副总裁	—
孙含林	公司副总裁	—
吴祖芳	公司副总裁	—
张涛	公司副总裁	—
姜健	公司副总裁、董事会秘书	—
舒本娥	公司财务总监、计划财务部总经理	—
李筠	公司合规总监、合规与风险管理部总经理	—

(二) 关联方交易

1、收取席位租金、交易佣金

关联方	关联交易内容	本期发生		上期发生	
		金额(万元)	占同类交易额的比率%	金额(万元)	占同类交易额的比率%
南方基金管理有限公司	基金分仓及交易手续费收入	319.06	12.91	524.27	5.94
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金分仓及交易手续费收入	486.90	19.70	190.26	2.15

2、持有关联方发行的基金

关联方名称	基金名称	期末余额		年初余额	
		持有份额(万份)	持有成本	持有份额(万份)	持有成本
南方基金管理有限公司	深成ETF	1,221.20	13,459,161.24	1,221.20	13,459,161.24
	南方金砖	500.00	4,999,849.99	500.00	4,999,849.99
	南方中国LOF	141.39	1,413,765.26	200.06	2,000,416.40
	南方380联接	200.06	2,000,349.96	200.06	2,000,349.96
	南方380ETF	500.00	5,000,000.00	500.22	5,000,000.00
华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰柏瑞量化	—	—	300.00	2,999,939.99
	上证300ETF	18,997.10	509,758,286.60	—	—
	华泰柏瑞增利	3,000.13	30,000,000.00	—	—

3、关联方利息收入

关联方	关联交易内容	本期发生		上期发生	
		金额(万元)	占同类交易额的比率%	金额(万元)	占同类交易额的比率%
江苏银行股份有限公司	存款利息收入	18.29	0.12	353.24	2.95

4、关联方持有的资产管理计划

关联方名称	资产管理业务品种	产品名称	期末持有份额	期末持有成本	年初持有份额	年初持有成本
华泰联合证券有限责任公司	集合资产管理业务	华泰紫金龙-大中华	35,129,563.87	30,000,000.00	—	—
	定向资产管理业务	—	—	20,000,000,000.00	—	—

5、董事、监事及高管购买本公司管理的理财产品的期末市值

名称	本期金额	上期金额
周易	2,527,912.10	3,357,790.53
潘剑秋	986,761.97	1,112,630.29
张海波	129,276.22	190,482.46
孙含林	1,480,581.75	1,888,259.97
吴祖芳	2,411,669.05	3,207,936.51
姜健	698,254.98	1,008,869.36
舒本娥	655,893.01	811,826.37
陈良训	1,224,420.47	1,770,479.78
强莹	672,507.80	1,255,946.75
赵茂富	—	208,186.83
合计	10,787,277.35	14,812,408.85

(三) 关联方往来款项余额

1、代买卖证券款余额

关联方名称	期末余额	年初余额
南方基金管理有限公司	13,728.45	10,922.27
华泰柏瑞基金管理有限公司	588,121.77	426,766.25
江苏省国信资产管理集团有限公司	4,316,978.78	1,099,966.35
江苏交通控股有限公司	15,062,791.96	6,638,782.32

2、关联方往来款项余额

关联方名称	科目名称	期末账面余额		年初账面余额	
		金额	坏账准备	金额	坏账准备
南方基金管理有限公司	应收款项	—	—	3,597,740.93	10,793.22
华泰柏瑞基金管理有限公司	应收款项	—	—	641,114.89	1,923.34
江苏省国信资产管理集团有限公司	应付款项	3,200,900.00	—	3,200,900.00	—
江苏银行股份有限公司	银行存款	6,940,162.73	—	106,757,570.68	—

七、或有事项

截止报告期末，本公司未决诉讼情况如下：

(1) 子公司华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限公司债权债务纠纷案

因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用华泰联合营业部资金共3,720余万元,以及因他与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从华泰联合三家营业部及华泰联合本部扣划现金共1,738万元,中国华诚集团财务有限责任公司拒不履行偿债义务,华泰联合于2003年12月向深圳市中级人民法院提起诉讼,要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司承担连带清偿责任。立案后,由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、审理、执行对华诚投资管理有限公司及所属公司的诉讼案件,该案一直处于中止审理阶段。2009年5月,法院裁定华诚投资管理有限公司进入破产清算程序,华泰联合已于2009年8月向破产清算组申报债权本息12,598万元,但由于债权未经法院判决,债权待确认。2010年3月,深圳中级人民法院恢复审理,一审判决结果支持华泰联合全部诉讼请求,要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司连带支付华泰联合5,458.4万元,并承担诉讼费28.2万元,华泰联合已就上述债权和诉讼费向华诚投资管理有限公司破产清算组申报破产债权,2011年8月31日,华诚投资第三次债权人会议召开并通过了第一次债权分配方案,华泰联合根据上述分配方案获得276.44万股华纺股份股票。

(2) 子公司华泰联合证券与中国长城计算机集团公司债权债务纠纷案

2008年11月18日,子公司华泰联合证券以中国长城计算机集团公司不履行与公司的合同义务,拖欠公司款项为由,向深圳市罗湖区人民法院起诉,请求法院处置变卖其所持有公司的900万股股权(经2005年缩股后变更为270万股),将所得款项用于抵偿其对公司的所欠债务。法院于2009年2月进行了第一次开庭审理,并由法院追加长城财务公司作为第三人。该案已于2009年7月开庭审理完毕,2009年8月,法院裁定中止审理。中止审理期间,双方至今就一直就相关事宜进行协商。

截止2012年6月末子公司华泰联合证券已对中国长城计算机集团公司的欠款1,000.00万元全额计提了坏账准备。

八、承诺事项

其他使用受限资产情况

其他使用受限资产为交易性金融资产和可供出售金融资产,详见附注五(三)及附注五(八)(1)。

除上述承诺事项外,截止2012年6月30日,本公司无其他应需要披露未披露的重大承诺事项。

九、资产负债表日后非调整事项

截止报告日,本公司无需披露的资产负债表日后非调整事项。

十、其他事项

1、融资融券业务

核算科目	核算项目	期末余额
可供出售金融资产	融出证券	143,239,911.24
其他资产	融出资金	4,570,667,222.47

融出证券详见附注五(八)(1)

融出资金详见附注五（十六）（4）

2、已决诉讼的执行情况

（1）子公司华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案

华泰联合原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用华泰联合资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出（2001）深中法经一初第315号民事判决书和（2002）深中法经一初第430号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还华泰联合7,345万元及其利息和9,940万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。本纠纷另一案，华泰联合于2008年6月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向华泰联合支付欠款总额人民币23,775.36万元、利息人民币2,187.72万元，合计标的人民币约2.6亿元。该案于2009年12月由北京市高级人民法院判决四通集团公司扣减债务8,486.5867万元，最终需偿还本金17,553.3893万元及相应利息，该案目前正在执行中。

截止2012年6月末华泰联合证券已对四通集团公司的欠款全额计提了坏账准备。

（2）子公司华泰联合证券与广州珠江实业集团有限公司债权债务纠纷案

广州珠江实业集团有限公司拖欠华泰联合1,500万元欠款，华泰联合于2008年12月向广州市越秀区人民法院起诉，请求法院判令其偿还所欠华泰联合款项。法院立案后，主持双方达成和解，并出具民事调解书确认对方对华泰联合的全部债务。该案目前正在执行中。

截至2012年6月30日止，华泰联合证券已对广州珠江实业集团有限公司的欠款全额计提了坏账准备。

（3）子公司华泰联合证券与北京华资银团集团债权债务纠纷案

因北京华资银团集团一直未按协议履行对华泰联合的还款义务，华泰联合于2011年1月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计3,457.89万元，2011年2月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合2,430万元及银行同期存款利息，北京华资银团集团不服该判决，提起上诉，2011年6月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判，该案目前正在执行中。

上述本金2,430万元挂账在应收四通集团公司名下，截至2012年6月30日止，华泰联合公司已对四通集团公司的欠款全额计提了坏账准备。

3、以公允价值计量的资产和负债：

项目	年初余额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末余额
金融资产					
1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	19,411,404,791.06	178,975,378.34	—	—	17,751,153,442.13
2.衍生金融资产	—	-12,265,500.00	—	—	—
3.可供出售金融资产	2,335,631,760.16	—	-351,391,678.45	—	5,797,637,282.84
金融资产小计	21,747,036,551.22	166,709,878.34	-351,391,678.45	—	23,548,790,724.97
投资性房地产	—	—	—	—	—
上述合计	21,747,036,551.22	166,709,878.34	-351,391,678.45	—	23,548,790,724.97
金融负债	—	—	—	—	—

注：本表不存在必然的勾稽关系

4、外币金融资产和外币金融负债

项目	年初余额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末余额
----	------	------------	---------------	---------	------

项目	年初余额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末余额
金融资产					
1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(不含衍生金融资产)	—	—	—	—	—
2.衍生金融资产	—	—	—	—	—
3.贷款和应收款	383,945,294.19	—	—	—	173,839,071.35
4.可供出售金融资产	—	—	—	—	—
5.持有至到期投资	—	—	—	—	—
金融资产小计	383,945,294.19	—	—	—	173,839,071.35
金融负债	—	—	—	—	—

注:本表不存在必然的勾稽关系

十一、母公司财务报表主要项目注释

(一)长期股权投资

1、分类情况

项目	期末余额		年初余额	
	账面金额	减值准备	账面金额	减值准备
按成本法核算的长期股权投资	4,318,519,545.14	6,138,722.66	3,956,019,545.14	6,138,722.66
按权益法核算的长期股权投资	1,065,062,156.10	—	1,046,095,970.77	—
合计	5,383,581,701.24	6,138,722.66	5,002,115,515.91	6,138,722.66

2、按成本法核算的长期股权投资主要单位列示

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例	年初余额	本期增加	本期 减少	期末余额
江苏银行股份有限公司	7.03%	1,300,000,000.00	—	—	1,300,000,000.00
华泰长城期货有限公司	60%	366,598,085.65	—	—	366,598,085.65
华泰金融控股(香港)有限公司	100%	264,845,000.00	162,500,000.00	—	427,345,000.00
华泰联合证券有限责任公司	98.186%	1,206,780,736.83	—	—	1,206,780,736.83
华泰紫金投资有限责任公司	100%	500,000,000.00	—	—	500,000,000.00
上海金融发展投资基金		300,000,000.00	200,000,000.00	—	500,000,000.00
金浦产业投资基金管理有限公司	7.5%	9,000,000.00	—	—	9,000,000.00
其他法人股投资		8,795,722.66	—	—	8,795,722.66
合计		3,956,019,545.14	362,500,000.00	—	4,318,519,545.14

3、按权益法核算的长期股权投资

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例%	年初余额	本期权益增减额	本期红利	本期 转让	期末余额
南方基金管理有限公司	45	852,450,016.99	89,265,639.68	81,000,000.00	—	860,715,656.67
华泰柏瑞基金管理有限公司	49	193,645,953.78	10,700,545.65	—	—	204,346,499.43

被投资单位名称	占被投资单位 注册资本比例%	年初余额	本期权益增减额	本期红利	本期 转让	期末余额
合计		1,046,095,970.77	99,966,185.33	81,000,000.00	—	1,065,062,156.10

4、长期股权投资减值准备

被投资单位名称	期末余额	本期增加	本期减少	年初余额	计提原因
盐城商业大厦股份有限公司	2,455,530.00	—	—	2,455,530.00	对方净资产为负数
天津农药股份有限公司	2,295,000.00	—	—	2,295,000.00	对方净资产为负数
天津津泰橡胶股份有限公司	687,600.00	—	—	687,600.00	对方净资产为负数
其他投资	700,592.66	—	—	700,592.66	信泰并入、南京新百公司
合计	6,138,722.66	—	—	6,138,722.66	

(二)其他资产

项 目	期末余额	年初余额
应收款项	318,793,298.47	173,512,971.27
在建工程	510,918,814.47	373,272,187.69
其他流动资产	6,708,135.41	7,756,069.70
长期待摊费用	197,907,017.21	279,546,919.17
应收股利	81,000,000.00	—
融出资金	4,269,663,014.72	2,566,571,197.60
合计	5,384,990,280.28	3,400,659,345.43

1、应收款项

(1) 按类别列示如下：

类别	期末余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例%	金额	比例%	
单项计提坏账准备的应收款项	8,290,541.81	2.42	8,290,541.81	100	—
按账龄分析法计提坏账准备的应收账款	333,663,205.73	97.58	14,869,907.26	4.46	318,793,298.47
合计	341,953,747.54	100.00	23,160,449.07	6.77	318,793,298.47
类别	年初余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例%	金额	比例%	
单项提坏账准备的应收款项	8,290,541.81	4.32	8,290,541.81	100.00	—
按账龄分析法计提坏账准备的应收账款	188,382,878.53	95.78	14,869,907.26	7.89	173,512,971.27
合计	196,673,420.34	100	23,160,449.07	11.78	173,512,971.27

组合中，按账龄分析法计提坏账准备的应收款项：

类别	期末余额		年初余额	
	账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备

	金额	比例(%)		金额	比例(%)	
1 年以内	297,949,458.77	89.30%	455,675.18	152,669,131.57	81.04	455,675.18
1 至 2 年	3,989,656.61	1.19%	11,968.97	3,989,656.61	2.12	11,968.97
2 至 3 年	2,937,187.26	0.88%	8,811.56	2,937,187.26	1.56	8,811.56
3 年以上	28,786,903.09	8.63%	14,393,451.55	28,786,903.09	15.28	14,393,451.55
合计	333,663,205.73	100.00%	14,869,907.26	188,382,878.53	100.00	14,869,907.26

(2) 期末单项金额重大并单项计提坏账准备或单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收账款

应收账款内容	期末账面金额	坏账准备金额	计提比例%	理由
收购信泰时并入的其他款项	8,290,541.81	8,290,541.8	100.00	收回的可能性极小

(3) 期末应收款项前 5 名单位情况列示如下:

单位名称或内容	与本公司关系	金额	账龄	占应收账款总额的比例 (%)
上海保利广场资产管理有限公司	非关联方	196,688,024.00	1 年	57.52
证券投资者保护基金	非关联方	25,975,670.19	5 年	7.60
南京五星高能股份有限公司	非关联方	5,580,000.00	5 年	1.63
江苏阳光集团有限公司	非关联方	5,318,826.75	1 年	1.56
江苏国盾科技实业有限公司	非关联方	1,611,600.00	1 年	0.47
合计		235,174,120.94		68.78

(4) 截至 2012 年 6 月 30 日止, 应收款项余额中无持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东单位欠款。

(5) 应收关联方账款情况

单位名称	与本公司关系	期末金额	占应收账款总额的比例 (%)
华泰联合证券有限责任公司	子公司	3,311,092.90	0.97
华泰长城期货有限公司	子公司	3,247,747.06	0.95
华泰紫金投资有限责任公司	全资子公司	302,536.41	0.09
华泰金融控股(香港)有限公司	全资子公司	690,166.45	0.20
合计		7,551,542.82	2.21

(三) 手续费及佣金净收入

项目	本期金额	上期金额
手续费及佣金收入		
— 证券经纪业务	1,712,216,246.71	1,791,464,624.72
— 证券承销业务	8,950,000.00	341,675,750.00
— 证券保荐业务	—	12,000,000.00
— 财务顾问业务	—	9,335,000.00
— 受托客户资产管理业务	38,103,657.87	41,916,174.11

项目	本期金额	上期金额
—投资咨询业务收入	14,192,021.58	—
合计	1,773,461,926.16	2,196,391,548.83
手续费及佣金支出		
—证券经纪业务手续费支出	431,227,071.50	456,758,756.62
—证券承销业务支出	135,000.00	3,345,811.75
—证券保荐业务支出	—	109,108.00
—财务顾问业务支出	—	308,731.91
—受托资产管理业务支出	254,485.82	328,684.19
—投资咨询业务支出	—	—
合计	431,616,557.32	460,851,092.47
手续费及佣金净收入	1,341,845,368.84	1,735,540,456.36

(四)投资净收益

项目	本期金额	上期金额
联营企业和合营企业的投资收益	91,597,137.81	76,022,497.62
出售交易性金融资产的投资收益	290,192,599.75	-280,506,676.89
交易性金融负债形成的投资收益	—	—
出售可供出售金融资产的投资收益	14,953,392.36	-166,760,038.33
出售持有至到期金融资产的投资收益	—	—
金融资产持有期间的取得的收益	193,081,558.22	262,641,714.61
衍生金融工具的投资收益	-45,806,516.69	218,532,263.95
成本法核算的投资收益	2,016,000.00	—
合计	546,034,171.45	109,929,760.96

(五)现金流量表补充资料

项目	本期金额	上期金额
1、将净利润调节为经营活动的现金流量		
净利润	886,312,149.44	872,546,763.21
加：计提的资产减值准备	—	—
固定资产折旧	96,508,865.39	73,776,799.07
无形资产摊销	13,835,694.26	7,094,463.13
长期待摊费用摊销	42,517,167.65	26,033,159.15
处置固定资产、无形资产和其他长期资产损失（收益以“-”号填列）	57,254.04	-79,709.38
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	—	243,509.93
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-192,109,584.37	13,853,044.08
财务费用（收益以“-”号填列）	—	—
投资损失（收益以“-”号填列）	-93,613,137.81	-346,147,644.09
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	74,130,251.11	-3,262,528.80

项 目	本期金额	上期金额
递延所得税负债的增加（减少以“-”号填列）	-11,793,748.25	15,329,371.03
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-4,425,331,041.37	-1,482,280,562.23
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	650,094,799.42	-18,089,352,862.92
其他	—	—
经营活动产生的现金流量净额	-2,959,391,330.49	-18,912,246,197.82
2、不涉及现金收支的投资和筹资活动		
债务转为资本	—	—
一年内到期的可转换公司债券	—	—
融资租入固定资产	—	—
3、现金及现金等价物净增加情况	—	—
现金的期末余额	40,897,891,228.96	41,702,716,771.39
减：现金的年初余额	45,166,216,771.21	61,581,180,630.32
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	-4,268,325,542.25	-19,878,463,858.93

十二、公司经营活动面临的风险及采取的对策和措施

公司经营活动面临的风险因素可分为市场风险、信用风险、操作风险、合规风险、流动性风险等。

1、市场风险

市场风险主要是因证券市场价格、利率、汇率等的变动，导致公司持有资产遭遇未预期损失的风险。2012 年上半年，国内货币政策趋于逐渐宽松，在经历了两次降息、两次降准后，物价保持稳定，国内经济增速平稳回落，但受到经济结构调整、行业兴衰等因素影响，上市公司盈利能力与发展前景仍存在诸多不确定性。世界经济增长仍然低迷，欧债危机对世界经济的潜在威胁仍在增加，未来欧元区主权债务危机导致的信用危机、金融危机，可能对欧洲经济以至世界经济产生较大冲击，也增大了我国出口的不确定性。这些不确定性因素可能会对公司持有的金融产品造成冲击，导致金融产品价格下跌，影响公司经营业绩。

报告期内，公司采取了多项措施防范市场风险，一是加强对宏观经济的研究，实地调研上市公司，稳健参与市场投资；二是合理配置股票、债券等自营资产，灵活控制投资品种比重，分散投资降低风险，重点投资低风险、收益稳定型的品种；三是合理控制资产管理业务仓位，谨慎操作，尽可能降低客户承担的风险；四是加强对创新业务的研究，灵活使用数量化模型与金融衍生品，对冲系统性市场风险；五是加强对各业务的实时监控，构建模型进行量化评估与分析，采取合理措施有效控制市场风险。

2、信用风险

信用风险主要包括三类，一是债券交易业务中，发债企业违约或交易对手违约造成的风险；二是委托方或交易对手不能或不愿履行合约承诺而使公司及客户资产遭受损失的风险；三是在融资融券业务中，客户失信致使公司融出资券及其息费遭受损失的风险。

报告期内，公司加强对发债主体和所发债券的研究，完善信用风险评级体系，对重点持仓债券进

行调研。投资债券时优先选择高信用等级的债券，严控所投债券的品质。加强对交易对手信用状况的评估，选择信用等级良好、实力雄厚的交易对手，降低交易对手信用风险。融资融券业务方面，公司通过征信评级全面了解客户的基本情况、资信水平、投资经验和风险承受能力等，综合确定客户信用评级及授信额度，并通过业务合同及风险揭示书，明确违约处置措施。加强对融出证券情况的实时监控，发现问题及时与客户沟通反馈，有效防范了融资融券业务的信用风险。

3、操作风险

操作风险是指由于不完善或有问题的内部操作程序、人员、系统或外部事件而导致的风险。

报告期内，公司规章制度较为健全，流程不断优化，覆盖了公司各个业务领域以及经营管理的方方面面，同时强化事前控制，制度流程执行力强，信息技术支持力度大，人员培训逐步加强，胜任能力逐步增强，较好控制了操作风险。

4、合规风险

合规风险是指证券公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规或准则而使证券公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。

报告期内，公司严格管理、审慎经营、规范运作：结合经营管理和业务运作实践，制定或修订完善了《合规管理制度（修订）》、《华泰证券股份有限公司合规管理有效性评估办法》及《信息隔离墙管理制度（修订）》及等数项合规管理制度，确保公司合规管理工作顺利开展；不断健全以合规总监为核心的合规管理组织架构体系，强化一线合规人员职责，为防范合规风险、减少风险事件构筑坚实防线；强化重点业务和重点环节合规管理，加大对经纪业务、研究咨询、直投、资产管理等业务的合规管理；继续深化信息隔离墙制度建设，逐步落实信息隔离各项措施，控制敏感信息在相互存在利益冲突的业务之间不当流动和使用，防范内幕交易和管理利益冲突。

细化完善合规管理制度，健全合规管理组织，推进合规文化建设，强化重点环节合规管理，并采取有效措施落实信息隔离墙制度和反洗钱工作，有力保障了公司各项业务持续规范发展。

5、流动性风险

公司流动性风险主要包括两个方面：一是资产的流动性风险，是指由于资产不能及时变现或变现成本过高导致损失的风险，主要是由于市场深度的限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能对自营投资以及客户资产造成损失的风险，其主要体现在自营投资业务和资产管理产品投资中。二是负债的流动性风险，是指证券公司缺乏现金不能按时支付债务或正常营业支出的风险或资产管理业务各产品由于流动资金不足无法应付客户大规模赎回的风险。

报告期内，公司合理控制各品种证券的投资规模，避免投资过于集中造成的流动性不足。密切关注市场变化，建立投资组合量化指标分析机制，动态调整资产配置，确保投资组合的流动性。合理安排公司自有资金，预留部分现金以应付各项业务可能出现的流动性问题，保障公司日常的稳健运行。资产管理业务各产品通过保留部分现金类资产比例、大额赎回预警等措施，加强对客户赎回资金的分析，合理安排投资组合的流动性情况。

十三、补充资料

(一) 当期非经常性损益明细表

根据中国证监会《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号—非经常性损益》（“中国证券监督管理委员会公告[2008]43 号”），本公司非经常性损益如下：

项 目	本期发生额	上期发生额
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-4,580.15	-238,848.96
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免	—	—
计入当期损益的政府补助（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）	3,796,400.00	—
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费	—	—
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益	—	—
非货币性资产交换损益	—	—
委托他人投资或管理资产的损益	—	—
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备	—	—
债务重组损益	—	—
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等	—	—
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益	—	—
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益	—	—
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	—	—
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益	—	—
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	—	—
对外委托贷款取得的损益	—	—
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益	—	—
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响	—	—
受托经营取得的托管费收入	—	—
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-3,479,898.25	-2,167,545.30
其他符合非经常性损益定义的损益项目	—	—
非经常性损益合计（影响利润总额）	311,921.60	-2,406,394.26
减：所得税影响数	77,980.40	-615,885.16
非经常性损益净额（影响净利润）	233,941.20	-1,790,509.10
其中：影响少数股东损益	63,247.61	18,478.79
影响归属于母公司普通股股东净利润	170,693.59	-1,808,987.89
扣除非经常性损益后的归属于母公司普通股股东净利润	1,057,856,659.70	1,145,384,089.46

(二) 净资产收益率和每股收益

本公司按照中国证监会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号——净资产收益率和每股

收益的计算及披露（2010 年修订）》（“中国证券监督管理委员会公告[2010]2 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》（“中国证券监督管理委员会公告[2008]43 号”）要求计算的净资产收益率和每股收益如下：

报告期利润	本期数		
	加权平均净资产收益率	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润（I）	3.13%	0.19	0.19
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润（II）	3.13%	0.19	0.19
报告期利润	上期数		
	加权平均净资产收益率	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润（I）	3.42%	0.20	0.20
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润（II）	3.43%	0.20	0.20

（三） 受托资产管理业务

1、截至 2012 年 6 月 30 日止，公司所管理的受托资产管理计划情况如下：

计划名称	成立时间	资产市值	计划份额（份）	计划单位净值
集合资产管理计划				
华泰紫金新兴产业集合资产管理计划	2011 年 06 月 20 日	448,421,272.43	560,068,440.79	0.8007
华泰紫金套金宝集合资产管理计划	2011 年 08 月 09 日	183,840,612.48	181,238,590.84	1.0144
华泰紫金定增宝集合资产管理计划	2012 年 04 月 25 日	320,788,776.14	319,700,690.69	1.0034
华泰如意月月红套利 1 号集合资产管理计划	2012 年 06 月 04 日	253,212,091.31	253,056,504.21	1.0006
华泰紫金 1 号集合资产管理计划	2005 年 12 月 06 日	232,122,941.40	227,411,600.89	1.0207
华泰紫金鼎步步为盈子集合资产管理计划	2008 年 10 月 27 日	173,428,663.43	164,080,218.94	1.0570
华泰紫金优债精选集合资产管理计划	2009 年 05 月 12 日	335,141,472.10	372,419,303.11	0.8999
华泰紫金现金管家集合资产管理计划	2009 年 08 月 25 日	261,945,957.07	246,954,047.90	1.0607
华泰紫金策略避险集合资产管理计划	2011 年 10 月 24 日	202,883,037.76	193,391,572.97	1.0491
华泰紫金 2 号集合资产管理计划	2006 年 08 月 07 日	558,740,528.15	607,715,747.48	0.9194
华泰紫金 3 号集合资产管理计划	2007 年 03 月 06 日	520,915,914.12	661,996,183.73	0.7869
华泰紫金鼎锦上添花子集合资产管理计划	2009 年 03 月 19 日	136,647,906.11	176,140,683.17	0.7758
华泰紫金鼎造福桑梓子集合资产管理计划	2008 年 10 月 27 日	104,160,029.72	147,476,598.41	0.7063
华泰紫金周期轮动集合资产管理计划	2010 年 09 月 27 日	834,466,316.62	1,165,193,567.36	0.7162
华泰紫金龙-大中华集合资产管理计划	2011 年 02 月 15 日	103,479,369.44	121,283,071.24	0.8490

计划名称	成立时间	资产市值	计划份额(份)	计划单位净值
定向资产管理业务**		2,339,919,157.27		

*公司在其管理的紫金 1 号、紫金 2 号、紫金周期轮动计划、紫金套利宝成立时分别持有 22,893,412.29 份、100,000,000.00 份、70,703,078.03 份、5,134,529.61 份、紫金策略避险 35,735,157.07 份，并承诺在管理期间不赎回。

**定向资产管理业务系公司为特定客户提供的定项资产管理业务。

2、资产管理计划业务简表

资产项目	期末余额	年初余额	负债项目	期末余额	年初余额
受托管理资金存款	959,540,101.48	1,155,638,318.84	受托管理资金	7,727,385,376.34	7,135,554,684.19
客户结算备付金	82,397,883.05	57,375,674.95	应付款项	-541,949,338.42	139,227,634.89
应收款项	244,997,611.91	1,282,159,708.11			
受托投资	5,898,500,441.48	4,779,608,617.18			
其中：投资成本	5,879,676,236.86	4,901,932,239.50			
已实现未结算损益	18,824,204.62	-122,323,622.32			
合计	7,185,436,037.92	7,274,782,319.08	合计	7,185,436,037.92	7,274,782,319.08

华泰证券股份有限公司

2012年8月17日