

公司代码：601688

公司简称：华泰证券

华泰证券股份有限公司

2015年半年度报告

重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

二、未出席董事情况

未出席董事职务	未出席董事姓名	未出席董事的原因说明	被委托人姓名
独立董事	白维	因公务原因	刘红忠
独立董事	张捷	因公务原因	沈坤荣

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人吴万善、主管会计工作负责人吴万善及会计机构负责人（会计主管人员）舒本娥声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司董事会在审议半年度报告时，未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。

六、前瞻性陈述的风险声明

本半年度报告涉及的未来计划、发展战略等前瞻性陈述不构成公司对投资者的实质承诺，请投资者注意投资风险。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、 是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

目录

第一节	释义.....	4
第二节	公司简介.....	4
第三节	会计数据和财务指标摘要.....	7
第四节	董事会报告.....	12
第五节	重要事项.....	45
第六节	股份变动及股东情况.....	63
第七节	优先股相关情况.....	67
第八节	董事、监事、高级管理人员.....	67
第九节	财务报告.....	69
第十节	备查文件目录.....	202
第十一节	证券公司信息披露.....	202

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
社保基金会	指	全国社会保障基金理事会
江苏省国资委	指	江苏省人民政府国有资产监督管理委员会
江苏国信	指	江苏省国信资产管理集团有限公司
华泰证券、本公司、公司	指	华泰证券股份有限公司
华泰联合证券	指	华泰证券控股子公司华泰联合证券有限责任公司
华泰期货	指	华泰证券控股子公司华泰期货有限公司
华泰紫金投资	指	华泰证券全资子公司华泰紫金投资有限责任公司
华泰资管公司	指	华泰证券全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司
华泰金控（香港）	指	华泰证券全资子公司华泰金融控股（香港）有限公司
江苏股权交易中心	指	华泰证券控股子公司江苏股权交易中心有限责任公司
南方基金	指	南方基金管理有限公司
华泰柏瑞	指	华泰柏瑞基金管理有限公司
标准守则	指	《香港上市规则》附录十《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
报告期	指	2015年1-6月

2015年半年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，这些差异是由于四舍五入造成的。

第二节 公司简介

一、公司信息

公司的中文名称	华泰证券股份有限公司
公司的中文简称	华泰证券
公司的外文名称	HUATAI SECURITIES CO.,LTD.
公司的外文名称缩写	HTSC
公司的法定代表人	吴万善
公司总经理	周易
公司授权代表	吴万善、姜健

注册资本和净资本

	本报告期末	上年度末
注册资本	7,162,768,800	5,600,000,000
净资本	52,136,620,483.14	19,727,808,969.73

公司的各单项业务资格情况

公司经营范围。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、金融债（含政策性金融债））；证券投资咨询；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；证券投资基金代销；证券投资基金托管；黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务；股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务。

报告期内，公司新增单项业务资格有：

1、2015年1月16日，公司收到上交所《关于华泰证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》（上证函〔2015〕73号），获准成为上交所股票期权交易参与人，并开通股票期权经纪、自营业务交易权限。

2、2015年1月29日，公司收到中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司股票期权做市业务资格的批复》（证监许可〔2015〕162号）。根据该批复，公司股票期权做市业务资格已获核准。

3、2015年1月30日，公司收到上交所《关于华泰证券股份有限公司开展上证50ETF期权做市业务的通知》（上证函〔2015〕213号），同意我公司于2015年2月9日起成为上证50ETF期权合约品种的主做市商。

4、2015年4月21日，公司收到中国证券投资基金业协会《私募基金业务外包服务机构备案证明》（备案编号A00004），成为首批通过私募基金外包服务备案的机构之一，可以为私募基金提供估值核算业务外包服务和份额登记业务外包服务。

5、2015年6月1日，公司收到中国证券登记结算公司《关于华泰证券单向视频开户创新方案的无异议函》（中国结算办字〔2015〕460号），对我公司申报的网上开户创新方案中关于增加单向视频方式验证投资者身份的创新事项无异议，同意公司进行试点。

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	姜健	赵远宽
联系地址	江苏省南京市江东中路228号	江苏省南京市江东中路228号
电话	(025)83387793、83387780、83387688	(025) 83387788
传真	(025) 83387784	(025) 83387784
电子信箱	jiangjian@htsc.com	zhaoyuankuan@htsc.com

	联席公司秘书	
姓名	姜健	邝燕萍
联系地址	江苏省南京市江东中路228号	香港湾仔皇后大道东28号金钟汇中心18楼

三、基本情况变更简介

公司注册地址	南京市中山东路90号
--------	------------

公司注册地址的邮政编码	210002
公司办公地址	江苏省南京市江东中路228号
公司办公地址的邮政编码	210019
香港营业地址	香港皇后大道中99号中环中心42楼4201室
公司网址	http://www.htsc.com.cn
电子信箱	boardoffice@htsc.com
公司总机	025-83389999
客服热线	95597 或 4008895597
报告期内变更情况查询索引	2015年1月29日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（ www.sse.com.cn ）上披露

注：报告期后，公司注册地址变更为江苏省南京市江东中路228号。

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn
登载半年度报告的香港联交所指定网站的网址	http://www.hkexnews.hk
公司半年度报告备置地点	江苏省南京市江东中路228号
报告期内变更情况查询索引	2015年1月29日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（ www.sse.com.cn ）上披露

五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A股	上交所	华泰证券	601688	无
H股	香港联交所	HTSC	06886	无

六、报告期内注册变更情况

注册登记日期	2015年5月12日
注册登记地点	南京市中山东路90号
企业法人营业执照注册号	320000000000192
税务登记号码	苏国税320005134754246；苏地税320006704041011
组织机构代码	70404101-1
报告期内注册变更情况查询索引	2015年2月4日、7月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（ www.sse.com.cn ）上披露
变更范围	经营范围增加“股票期权做市业务”登记

七、其他有关资料

（一）法律顾问：

中国香港法律顾问：高伟绅律师事务所（香港中环康乐广场1号怡和大厦27楼）

(二) 会计事务所

境内会计师事务所：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

国际会计师事务所：毕马威会计师事务所

办公地址：香港中环遮打道10号太子大厦8楼

(三) 股份登记处

A 股股份登记处：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166 号中国保险大厦36 楼

H 股股份登记处：香港中央证券登记有限公司

办公地址：香港湾仔皇后大道东183 号合和中心17M 楼

第三节 会计数据和财务指标摘要

一、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期（调整后）	上年同期(调整前)	本报告期比 上年同期增 减(%)
营业收入	14,644,251,806.44	4,369,255,869.68	4,319,731,665.21	235.17
归属于母公司 股东的净利润	6,674,821,930.46	1,517,633,030.48	1,478,917,478.24	339.82
归属于母公司 股东的扣除非 经常性损益的 净利润	6,653,312,958.35	1,502,507,976.41	1,463,792,424.17	342.81
经营活动产生 的现金流量净 额	139,225,841,847.80	7,859,700,296.14	7,664,129,988.97	1,671.39
其他综合收益	1,684,553,023.59	-11,865,157.61	9,254,278.47	不适用
	本报告期末	上年度末		本报告期末 比上年度末 增减(%)
资产总额	580,161,265,136.93	272,226,035,504.69		113.12
负债总额	502,410,640,203.16	230,281,627,782.69		118.17
归属于母公司 股东的权益	77,053,766,772.37	41,298,556,412.04		86.58
所有者权益总 额	77,750,624,933.77	41,944,407,722.00		85.37

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1—6月)	上年同期（调 整后）	上年同期(调 整前)	本报告期比上 年同期增减 (%)
基本每股收益（元 / 股）	1.1450	0.2710	0.2641	322.51

稀释每股收益（元 / 股）	1.1450	0.2710	0.2641	322.51
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元 / 股）	1.1413	0.2683	0.2614	325.38
加权平均净资产收益率（%）	15.33	4.11	4.06	增加11.22个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	15.28	4.07	4.02	增加11.21个百分点

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	52,136,620,483.14	19,727,808,969.73
净资产	71,341,330,469.47	37,085,784,571.20
净资本/各项风险准备之和(%)	1,033.13	463.56
净资本/净资产(%)	73.08	53.20
净资本/负债(%)	27.92	19.67
净资产/负债(%)	38.21	36.98
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	39.87	69.18
自营固定收益类证券/净资本(%)	35.47	81.46

二、 境内外会计准则下会计数据差异

√适用 □不适用

(一) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

□适用 √不适用

(二) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

□适用 √不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明：

本公司按照中国企业会计准则编制的合并财务报表及按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的2015年1-6月及2014年1-6月的净利润、2015年6月30日及2014年12月31日的净资产无差异。

三、 非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-1,495,280.53	
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，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	3,241,023.71	
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	5,512,041.46	
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	21,751,059.04	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
少数股东权益影响额	-247,660.65	
所得税影响额	-7,252,210.92	
合计	21,508,972.11	

四、其他

(一) 采用公允价值计量的项目

单位：人民币元

项目名称	期初余额	期末余额	当期变动	对当期利润的影响金额
以公允价值变动计入当期损益的金融资产	55,999,957,916.75	84,897,192,284.66	28,897,234,367.91	5,825,890,877.08
以公允价值变动计入当期损益的金融负债	9,244,846.63	15,588,540,564.48	15,579,295,717.85	246,149,771.17
可供出售金融资产	9,276,148,087.87	11,345,555,335.04	2,069,407,247.17	392,116,221.72
持有到期投资	5,000,000.00	5,000,000.00	-	113,671.49
衍生金融工具	-709,928,484.26	-1,524,668,055.49	-814,739,571.23	-3,130,561,691.47
合计	64,580,422,366.99	110,311,620,128.69	45,731,197,761.70	3,333,708,749.99

(二) 归属于母公司的股东权益变动情况。

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	主要变动原因
实收资本 (或股本)	5,600,000,000.00	1,562,768,800.00		7,162,768,800.00	发行H股
资本公积	17,221,260,799.97	28,634,704,003.75		45,855,964,803.72	H股发行溢价
其他综合收益	1,853,643,771.39	1,682,915,626.12		3,536,559,397.51	可供出售金融资产浮动收益增加所致
盈余公积	1,692,853,808.08			1,692,853,808.08	-
一般风险准备	4,611,609,649.74			4,611,609,649.74	-
未分配利润	10,319,188,382.86	6,674,821,930.46	280,000,000.00	14,194,010,313.32	净利润增加及利润分配所致
归属于母公司所有者权益(或股东权益)	41,298,556,412.04	38,555,210,360.33	280,000,000.00	77,053,766,772.37	-

(三) 按《证券公司年度报告内容与格式准则(2013年修订)》(中国证监会公告[2013]41号), 公司合并财务报表和母公司财务报表主要项目会计数据。

合并数据

资产负债表项目	期末余额	期初余额	变动幅度
货币资金	283,661,411,384.97	89,864,943,930.42	215.65%
结算备付金	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39	126.77%
融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25	77.42%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	84,897,192,284.66	55,999,957,916.75	51.60%
衍生金融资产	317,807,279.02	20,814,658.67	1426.84%
买入返售金融资产	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64	19.28%
应收款项	1,677,815,454.50	362,653,212.62	362.65%
应收利息	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17	65.41%
存出保证金	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77	48.04%
固定资产	2,603,579,520.34	1,258,361,600.29	106.90%
在建工程	1,086,170,068.11	2,045,324,758.06	-46.89%
其他资产	703,514,440.27	305,542,089.10	130.25%
拆入资金	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00	126.67%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	15,588,540,564.48	9,244,846.63	168518.70%

衍生金融负债	1,842,475,334.51	730,743,142.93	152.14%
代理买卖证券款	175,620,904,470.86	60,398,770,689.39	190.77%
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63	200.30%
应付职工薪酬	3,759,075,265.64	1,740,596,909.95	115.96%
应交税费	2,998,377,479.63	1,429,904,303.41	109.69%
应付利息	1,821,595,255.57	1,025,326,598.95	77.66%
长期借款	367,095,074.05	138,657,783.84	164.75%
应付债券	70,928,065,527.29	21,345,324,135.31	232.29%
长期应付职工薪酬	298,041,770.93	705,434,340.93	-57.75%
递延所得税负债	1,037,375,485.71	601,173,542.16	72.56%
其他负债	103,885,187,866.83	52,103,789,780.47	99.38%
实收资本（或股本）	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00	27.91%
资本公积	45,855,964,803.72	17,221,260,799.97	166.28%
其他综合收益	3,536,559,397.51	1,853,643,771.39	90.79%
未分配利润	14,194,010,313.32	10,319,188,382.86	37.55%

母公司数据

资产负债表项目	期末余额	期初余额	变动幅度
货币资金	213,330,456,974.57	61,641,473,590.59	246.08%
结算备付金	42,437,118,408.10	18,647,422,972.23	127.58%
融出资金	114,531,926,402.23	64,497,968,083.50	77.57%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	42,457,765,512.02	26,883,329,108.83	57.93%
衍生金融资产	313,086,462.96	17,329,494.06	1706.67%
买入返售金融资产	11,884,878,512.55	8,070,324,226.64	47.27%
应收款项	209,556,281.82	132,231,897.76	58.48%
应收利息	1,783,421,134.74	1,062,828,633.66	67.80%
存出保证金	2,332,662,145.47	1,267,518,877.70	84.03%
长期股权投资	7,521,370,963.15	5,650,280,401.15	33.12%
固定资产	2,547,525,931.61	1,199,361,919.07	112.41%
在建工程	1,086,170,068.11	2,045,324,758.06	-46.89%
其他资产	480,036,131.23	117,303,030.92	309.23%
应付短期融资款	24,369,823,509.44	24,787,070,000.00	-1.68%
拆入资金	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00	126.67%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	15,551,618,360.00	-	
衍生金融负债	1,836,687,432.60	729,314,190.09	151.84%

卖出回购金融资产款	58,507,552,349.79	44,478,760,889.99	31.54%
代理买卖证券款	163,013,106,415.13	53,348,884,179.56	205.56%
代理承销证券款	2,925,000.00	41,400,000.00	-92.93%
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	9,683,616,751.81	204.83%
应付职工薪酬	3,205,316,186.37	1,254,867,820.58	155.43%
应交税费	2,798,082,598.61	1,308,393,964.17	113.86%
应付利息	1,804,359,532.41	1,002,313,577.35	80.02%
长期借款	367,095,074.05	138,657,783.84	164.75%
应付债券	68,484,287,178.09	18,974,610,078.75	260.93%
长期应付职工薪酬	171,928,200.00	405,375,400.00	-57.59%
递延所得税负债	1,026,276,461.70	598,220,322.95	71.55%
其他负债	1,883,936,604.69	915,112,764.24	105.87%
实收资本（或股本）	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00	27.91%
资本公积	45,577,448,327.12	17,125,162,430.36	166.14%
其他综合收益	2,997,823,674.20	1,742,457,852.81	72.05%
未分配利润	10,312,819,429.42	7,327,694,049.30	40.74%

第四节 董事会报告

一、董事会关于公司报告期内经营情况的讨论与分析

(一)报告期内公司外部环境及行业发展变化情况

2015年上半年，国内外经济形势依然严峻复杂。国际方面，世界经济处于深度调整之中，主要经济体致力于结构性调整，新兴经济体总体增速放缓，世界经济总体呈现复苏乏力状况。国内方面，中国经济总体状况平稳，结构调整步伐加快，经济运行保持在合理区间，主要经济指标趋稳向好，但宏观经济仍面临较大下行压力。

2015年上半年，股票市场整体处于强势，总体呈现量价大幅度上升态势，沪深两市指数持续攀升，成交量异常活跃，同时，A股IPO进程明显提速。报告期末，上证综指收盘于4,277.22点，报告期内大幅上涨32.23%；报告期末，深证成指收盘于14,337.96点，报告期内大幅上涨30.17%。根据WIND资讯2015年上半年股票市场发行与交易统计数据，2015年上半年沪深A股市场累计股票成交金额1,383,945.43亿元，日均股票成交金额11,629.79亿元，均较2014年同期大幅上涨543.39%；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6,624.80亿元，较2014年同期大幅上涨105.99%，其中，首发募集资金增长明显，实际募集资金较2014年同期大幅上涨440.97%，再融资市场持续活跃，增发募集资金与配股募集资金合计较2014年同期大幅上涨77.32%。

2015年上半年，债券市场整体经历震荡行情，在货币政策宽松不断加码、地方债发行速度加快、宏观经济数据边际企稳等综合因素作用下，资金利率整体呈现下行格局，债券市场长端收益率呈震荡趋势，短端收益率大幅下行，长短端利差走扩。报告期末，中证全债指数收于163.34，报告期内上涨3.17%。报告期内，债券市场发行规模继续稳步增加，市场化负债产品进一步丰富。根据WIND资讯2015年上半年债券发行

规模统计数据,报告期内债券发行总额88,477.81亿元,较2014年同期大幅上涨57.47%,其中,地方政府债发行规模8,682.65亿元,同比大幅上涨534.70%;同业存单发行规模16,681.00亿元,同比大幅上涨1,118.75%;金融债发行规模25,895.37亿元,同比大幅上涨45.79%;企业债发行规模同比回落;公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券发行规模同比稳步增长。

2015年上半年,在本轮牛市波澜壮阔的行情中,我国证券行业传统业务转型加速的同时创新业务规模化发展持续推进,各主营业务实现全面增收,净利润呈现几何级数增长,业务的快速扩张也使我国证券行业的规模体量出现质的提升。根据中国证券业协会公布的未经审计的2015年上半年度证券公司经营数据,我国证券行业上半年实现营业收入3,305.08亿元,同比大幅上涨255.27%;代理买卖证券业务净收入1,584.35亿元,同比大幅上涨393.52%;证券承销与保荐业务净收入160.51亿元,同比上涨46.62%;财务顾问业务净收入43.54亿元,同比上涨97.01%;投资咨询业务净收入19.25亿元,同比大幅上涨134.76%;受托客户资产管理业务净收入122.14亿元,同比大幅上涨159.71%;证券投资收益(含公允价值变动)920.63亿元,同比大幅上涨241.11%;利息净收入366.40亿元,同比大幅上涨124.32%。2015年上半年,证券行业合计实现净利润1,531.96亿元,同比大幅上涨373.57%;总资产8.27万亿元,同比大幅上涨237.55%;净资产1.30万亿元,同比上涨60.49%;净资本1.14万亿元,同比大幅上涨100%。

(二)主营业务分析

1、财务报表相关科目变动分析表

单位:元 币种:人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例(%)
营业收入	14,644,251,806.44	4,369,255,869.68	235.17
营业成本	5,833,875,333.50	2,355,027,453.74	147.72
经营活动产生的现金流量净额	139,225,841,847.80	7,859,700,296.14	1,671.39
投资活动产生的现金流量净额	1,538,183,023.72	3,341,613,485.98	-53.97
筹资活动产生的现金流量净额	76,004,432,158.12	2,353,447,484.58	3,129.49
现金及现金等价物净增加额	217,103,062,385.34	13,561,316,478.91	1,500.90

2、收入分析

单位:万元 币种:人民币

业务类别	营业收入	占总收入比例(%)	上年同期数	同期占总收入比例(%)	增减
经纪及财富管理	1,032,503.18	70.51	270,693.91	61.95	增加8.56个百分点
投资银行业务	72,271.38	4.94	51,072.71	11.69	减少6.75个百分点
资产管理业务	88,381.96	6.04	48,849.62	11.18	减少5.14个百分点
投资及交易业务	263,159.42	17.97	71,491.41	16.36	增加1.61个百分点

海外业务及其他	8,145.96	0.56	-4,239.45	-0.97	增加1.53个百分点
---------	----------	------	-----------	-------	------------

报告期内，按合并口径，公司实现营业收入1,464,425.18万元，与上年同期相比，营业收入增长1,027,499.59万元，增幅为235.17%。主要业务类别中，经纪与财富管理业务、投资及交易业务、资产管理业务和投资银行业务同比增长的金额依次为76.18亿元、19.17亿元、3.95亿元和2.12亿元。

从收入结构看，公司把握市场机遇，大力发展互联网金融，拓展资本中介业务，股基交易量和融资融券余额均居市场前列，经纪及财富管理业务收入占比提升了8.56个百分点；积极改变投资策略，挖掘金融创新业务，努力去方向化，投资及交易业务收入占比提升了1.61个百分点；由于其他业务收入的提升，导致投资银行业务及资产管理业务收入占比有所下降。

3、成本分析

单位：万元 币种：人民币

业务类别	成本构成项目	本期数	本期占成本比例(%)	上年同期数	上年同期占成本比例(%)	增减
经纪及财富管理	业务及管理费、营业税金及附加	335,094.17	57.44	110,254.24	46.82	增加10.62个百分点
投资银行业务		43,801.32	7.51	42,880.33	18.21	减少10.70个百分点
资产管理业务		18,659.24	3.20	5,758.35	2.45	增加0.75个百分点
投资及交易业务		69,025.96	11.83	6,742.86	2.86	增加8.97个百分点
海外业务及其他		116,843.56	20.03	69,921.69	29.69	减少9.66个百分点

报告期内，按合并口径，公司实现营业成本583,387.53万元，与上年同期相比，营业成本增长347,884.79万元，增幅为147.72%。从各项主营业务成本占公司总成本的比例情况看，投资银行业务、海外业务及其他分别下降了10.70个百分点和9.66个百分点，资产管理业务略增0.75个百分点；经纪与财富管理业务、投资及交易业务成本占比分别增长了10.62个百分点和8.97个百分点，这两块业务成本占比上升的主要原因是报告期内业务规模快速增长，营业收入增长引起的投保基金、营业税金及附加及绩效费用等均较上年同期有所增长。

4、费用总体情况对比

单位：万元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	增减金额	增减比例(%)
业务及管理费用	487,835.57	209,168.96	278,666.61	133.23

报告期内，公司业务及管理费用较上年同期上升133.23%，主要原因是公司围绕转型和创新发展的需要，在队伍建设、高端人才引进、信息技术、互联网证券等方面进行战略性、前瞻性的投入，同时收入大幅增长导致绩效费用相应增长。

5、研发支出

单位：万元 币种：人民币

本期费用化研发支出	2,248.80
本期资本化研发支出	3,120.02
研发支出合计	5,368.82
研发支出总额占净资产比例(%)	0.07

研发支出总额占营业收入比例 (%)	0.37
-------------------	------

为支持并推动业务创新，公司始终坚持研发先行，为长效提升经营效益和管理效率，公司通过自行开发、合作开发、委托开发等方式合计进行研发及硬件投入5,368.82万元。

6、现金流分析及公司现金流转情况

报告期内，公司现金流量如下表：

单位：万元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	增减金额	增减比例 (%)
经营活动产生的现金流量净额	13,922,584.18	785,970.03	13,136,614.15	1,671.39
投资活动产生的现金流量净额	153,818.30	334,161.35	-180,343.05	-53.97
筹资活动产生的现金流量净额	7,600,443.22	235,344.75	7,365,098.47	3,129.49

报告期内，公司经营活动产生的现金流量净额为13,922,584.18万元，其中经营活动现金流入21,511,320.23万元，经营活动现金流出7,588,736.05万元；投资活动产生的现金流量净额为153,818.30万元，其中投资活动现金流入222,299.59万元，投资活动现金流出68,481.28万元；筹资活动产生的现金流量净额为7,600,443.22万元，其中筹资活动现金流入10,854,442.42万元，筹资活动现金流出3,253,999.21万元。

本期与上年同期相比变动率30%以上主要现金流量项目及变动原因如下：

单位：亿元 币种：人民币

项 目	本期数	上年同期数	同比变动 (%)	变动原因
收取利息、手续费及佣金的现金	177.24	45.71	287.75	业务规模增加、收入增加
代理买卖证券收到的现金净额	1,349.11	49.40	2,630.99	客户资金流入，收入增加
收到其他与经营活动有关的现金	501.08	75.63	562.54	经营现金流入增加
融出资金净增加额	500.41	15.22	3,187.84	融出资金规模增加
购入以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净支付的现金	95.46	41.48	130.14	证券投资规模增加
支付利息、手续费及佣金的现金	47.46	7.77	510.81	负债规模提高、对外支付利息增加
支付给职工以及为职工支付的现金	24.57	12.71	93.31	员工队伍建设支出增加
支付的各项税费	16.54	9.09	81.96	营业收入增加、税费增加
支付其他与经营活动有关的现金	74.42	9.57	677.64	经营现金流出增加

收回投资所收到的现金	13.53	36.31	-62.74	收回投资减少
吸收投资收到的现金	306.24	-		H股发行及其他少数股东投资
发行债券收到的现金	776.92	243.00	219.72	发行债券规模增加
偿还债务支付的现金	285.43	203.00	40.61	偿还到期债务
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	39.75	16.19	145.52	年度分红及偿付利息增加

报告期内,公司经营活动产生现金流量净额与本期净利润存在重大差异,主要与公司所处行业的现金流变动特点相关,公司的客户资金、自营投资、债券融资以及同业拆借等业务涉及的现金流量巨大,且变动频繁,经营活动的现金流变动与年度净利润关联度不高。

7、其他

(1) 公司利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

报告期内,公司营业收入、营业利润、净利润均较上年同期有较大幅度的提升。主要原因是市场股票基金交易量、资本中介业务规模均较上年同期大幅增加,同时,股指的大幅上涨促使投资及交易业务、资产管理业务收益同比大幅上涨。报告期内,两市股基交易量292.92万亿元,较上年同期的45.35万亿元增长545.91%。公司股基交易量市场份额8.32%,较上年同期的6.91%增长20.41%,母公司融资融券业务余额1,145.11亿元,较上年同期的211.97亿元增长440.22%,均远超行业平均水平。公司营业收入、营业利润、净利润等项目的同比变动情况及主要影响因素如下表。

单位:亿元 币种:人民币

项目	本期数	上年同期数	同比变动(%)	主要影响因素
营业收入	146.44	43.69	235.18	股基交易量上升、资本中介业务快速发展、投资收益大幅增长
营业支出	58.34	23.55	147.73	税费及业务管理费增加
营业利润	88.10	20.14	337.44	营业收入增加
利润总额	88.34	20.35	334.10	营业收入增加
净利润	67.19	15.33	338.29	营业收入增加
其中:归属母公司净利润	66.75	15.18	339.72	营业收入增加
资产	5,801.61	2,722.26	113.12	货币资金、金融资产和融出资金增加
负债	5,024.11	2,302.82	118.17	为满足业务发展有息负债增加及客户资金流入
其中:代理买卖证券款(含信用)	2,051.39	702.28	192.10	客户资金流入
股东权益合计	777.51	419.44	85.37	经营利润增加及H股发行

(2) 公司前期各类融资、重大资产重组事项实施进度分析说明

2014年2月18日，公司召开了第三届董事会第三次会议，审议通过了《关于公司发行短期融资券的议案》。2014年3月7日，公司召开了2014年第一次临时股东大会，审议通过了该项议案。2014年4月15日，中国人民银行以“银发[2014]112号”《关于华泰证券股份有限公司发行短期融资券的通知》核定本公司待偿还短期融资券的最高余额为121亿元，并在有效期一年内，本公司可自主发行短期融资券。报告期内，公司完成了四期共110亿元人民币短期融资券的发行工作。

2014年11月25日，公司召开了第三届董事会第十三次会议，审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》。2014年12月11日，公司召开了2014年第四次临时股东大会，审议通过了该项议案。2015年1月23日，公司完成2015年第一期次级债券发行工作，发行规模为人民币60亿元；2015年4月20日，公司完成2015年第二期次级债券发行工作，发行规模为人民币120亿元；2015年6月26日，公司完成2015年第三期次级债券发行工作，发行规模为人民币180亿元。

2015年3月6日，公司召开了第三届董事会第十六次会议，审议通过了《关于公司公开发行公司债券的议案》。2015年3月30日，公司召开了2014年年度股东大会，审议通过了该项议案。2015年6月19日，中国证监会以“证监许可[2015]1326号”《关于核准华泰证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》核准公司向合格投资者公开发行面值总额不超过66亿元的公司债券。报告期后，公司于2015年7月1日完成2015年公司债券（第一期）发行工作，发行规模为66亿元，发行品种为3年期，票面利率为4.20%。

2014年11月25日，公司召开了第三届董事会第十三次会议，审议通过了《关于公司发行H股股票并在香港上市的议案》等议案。2014年12月11日，公司召开了2014年第四次临时股东大会，审议通过了该等议案。2015年4月21日，中国证监会以“证监许可[2015]685号”《关于核准华泰证券股份有限公司发行境外上市外资股的批复》核准公司发行不超过1,610,000,000股境外上市外资股。2015年5月7日，香港联合交易所有限公司上市委员会举行上市聆讯，审议本公司发行不超过1,610,000,000股境外上市外资股并在香港联交所主板上市的申请。2015年6月1日，本公司1,540,000,000股境外上市外资股（H股）在香港联交所主板挂牌上市并开始交易，包括首次公开发行的1,400,000,000股H股以及本公司相关国有股东因国有股减持而划转至社保基金会并转换为H股的140,000,000股H股。2015年6月24日，因部分行使超额配售权，本公司179,045,680股H股在香港联交所主板挂牌上市并开始交易，包括部分行使超额配售权额外发行的162,768,800股H股以及本公司相关国有股东因国有股减持而划转至社保基金会并转换为H股的16,276,880股H股。

报告期内，公司不存在重大资产重组事项。

(3) 发展战略和经营计划进展说明

报告期内，面对证券行业发展的历史性机遇，公司践行全业务链战略，积极把握市场机会，加大力度推进战略实施、传统业务转型和创新业务规模化发展，顺利完成了年初制定的经营目标，各项业务发展亮点纷呈，经营业绩呈现大幅提升的良好势头。公司证券经纪业务进一步细化客户分类分级服务体系，持续加强产品创新与业务协同，大力拓展金融产品销售业务，不断提升客户价值转化能力，加快推进财富管理业务转型发展步伐。融资融券业务不断丰富拓展资券筹集渠道，有效实施逆周期调节机制，做好风险控制工作，融资融券余额呈快速增长态势。投资银行业务抓住行业转型机遇，

重点布局新兴行业，充分发挥并购业务品牌效应，持续推动IPO、再融资、债券、资本介入等业务均衡发展，不断提升对客户一揽子服务能力。权益类投资业务稳步加大非方向性投资项目占比，固定收益类投资业务加大推进“IRS+现券”组合套利交易力度，同时，积极开展量化对冲投资业务、大力推进场外衍生品业务创新，投资及交易业务收益率大幅提升。资产管理业务不断优化业务机制与投研体系，持续健全风险管理能力，积极打造全方位的产品创设能力，不断提升主动投资管理能力，资产管理业务规模稳步增长。同时，公司持有华泰联合证券股权比例进一步提升；原华泰长城期货完成工商变更登记手续，更名为华泰期货有限公司；华泰紫金投资完成进一步增资备案手续；华泰金控（香港）注册成立HTSC LIMITED、Lead Talent Enterprises Limited等11家子公司；华泰创新投资有限公司完成向全资子公司华泰瑞新（上海）投资有限公司缴纳出资款事项。

截至2015年6月30日，按合并口径，公司总资产5,801.61亿元，较年初增长113.12%；归属于上市公司股东的所有者权益770.54亿元，较年初增长86.58%。2015年1—6月，公司实现营业收入146.44亿元，较上年同期增长235.18%；利润总额88.34亿元，较上年同期增长334.10%；归属于上市公司股东的净利润66.75亿元，较上年同期增长339.72%。

(4) 破产重整，兼并或分立，重大的资产处置、收购、置换、剥离，重组其他公司情况等

报告期内，公司不存在破产重整，兼并或分立情况；不存在重大的资产处置、收购、置换、剥离情况；不存在重组其他公司情况等。

(三) 行业、产品或地区经营情况分析

1、主营业务分行业、分产品情况

报告期内，公司主营业务中，除海外业务及其他毛利率为负值外，其他主营业务均取得了超过30%的毛利率。公司主营业务分行业、分产品情况如下表：

单位:万元 币种:人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率(%)	营业收入比上年增减(%)	营业成本比上年增减(%)	毛利率比上年增减(%)
经纪及财富管理	1,032,503.18	335,094.17	67.55	281.43	203.93	增加8.28个百分点
投资银行业务	72,271.38	43,801.32	39.39	41.51	2.15	增加23.35个百分点
资产管理业务	88,381.96	18,659.24	78.89	80.93	224.04	减少9.32个百分点
投资及交易业务	263,159.42	69,025.96	73.77	268.1	923.69	减少16.80个百分点
海外业务及其他	8,145.96	116,843.56	-1,334.37	292.15	67.11	不适用

合计	1,464,461.90	583,424.25	60.16	234.45	147.68	增加 13.96个 百分点
----	--------------	------------	-------	--------	--------	---------------------

主营业务分行业和分产品情况的说明

公司主营业务主要分为经纪及财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务、投资及交易业务、海外业务。经纪及财富管理业务主要包括证券与期货经纪、金融产品销售、机构销售与研究、资本中介业务等。投资银行业务主要包括股票承销、债券承销、财务顾问、场外业务等。资产管理业务主要包括证券公司资产管理、私募股权基金管理及基金公司资产管理业务等。投资及交易业务主要包括权益证券投资和交易、固定收益投资和交易、OTC金融产品与交易业务等。海外业务主要包括投资银行、销售及交易、资产管理业务等。

(1) 经纪及财富管理业务

① 证券与期货经纪业务方面

报告期内，股票市场呈现牛市行情，市场交易持续火爆，成交量异常活跃，股票成交金额几倍级增长，根据WIND资讯金融终端统计数据，两市股基交易量292.92万亿元，较上年同期增长545.91%。报告期内，随着互联网证券的持续推广以及“一人多户”政策的放开等因素影响，市场开户数快速提升，行业平均佣金率进一步加速下滑，券商经纪业务竞争更趋激烈，市场化进程显著提速。

报告期内，公司证券经纪业务以利润为中心，坚持创新发展与合规风控，抓住业务重点和业务主线，继续推动代理交易类、投资类、融资类、顾问类四大类业务发展，不断提升经营效率，提高精细化管理水平，以客户需求为导向，加快推动证券经纪业务向财富管理业务转型。建立多层次的客户分析评价系统，持续优化紫金理财服务体系，不断丰富服务内容、完善服务渠道、优化推送方式，积极打造分层级的客户服务体系，满足客户多元化理财服务需求。调整销售及营销策略，主动降低基础通道服务佣金率水平，通过线上网络和标准化产品及服务与营业网点集约化运营等策略，进一步扩大市场份额及客户基础，切实实现客户结构、业务结构与收入结构的优化调整。

报告期内，公司大力推进互联网证券业务创新，持续完善优化移动互联网平台业务功能及用户体验，逐步从“客户服务”向“用户服务”突破。报告期内，移动终端“涨乐财富通”下载量536.7万次，日均活跃客户数94.2万人次；自“涨乐财富通”上线以来，累计下载量达765.7万次。报告期内，“涨乐财富通”移动终端客户开户数165.8万人次，占公司全部开户数的89.1%；公司59.5%的交易客户通过“涨乐财富通”进行交易。

代理交易金额及市场份额数据

2015年1—6月			2014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	198,974.04	7.18	股票	27,823.39	6.45
基金	44,684.90	28.62	基金	3,494.19	15.82
债券	41,529.58	3.11	债券	30,542.55	4.03
合计	285,188.52	6.68	合计	61,860.13	5.10

注：代理交易金额及市场份额数据来源于WIND资讯金融终端。

根据WIND资讯2015年上半年券商交易量统计数据，报告期内公司股票交易量19.90万亿元，基金交易量4.47万亿元，股票基金交易量合计24.37万亿元，市场份额为8.32%，排名位居行业第一。

在期货经纪业务领域，公司通过控股子公司华泰期货开展期货经纪业务，截至报告期末，共有31家期货营业部，遍及国内18个省份。报告期内，华泰期货实现代理成交量9,581万手，成交金额242,983亿元，市场份额分别为2.83%和3.44%，同比分别增长8.43%和2.08%。报告期内，公司期货IB业务继续延续增长势头，IB业务权益和IB业务收入均大幅提升，期货IB业务日均权益17.5亿元，截至报告期末，公司获准从事期货IB业务的证券营业部及区域总部共173家。

②金融产品销售方面

根据中国证监会2012年11月颁布的《证券公司代销金融产品管理规定》等有关法律法规，公司依法代销基金管理公司、信托公司及商业银行等第三方金融机构所提供的多种金融产品。报告期内，公司充分发挥客户资源优势和网点布局优势，通过公司广泛的证券营业部网络和互联网平台代理理财产品，进一步提升公司代理销售金融产品业务能力。报告期内，公司代理销售金融产品的销售总金额及代理销售总收入等情况如下表所示：

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期数		上年同期数	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	19,152,573,983.45	181,178,479.11	5,337,405,709.42	19,004,280.41
证券公司理财产品	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17	389,680,824,098.25	433,315.19
信托	2,183,010,000.00	1,731,048.27	1,383,520,000.00	1,006,367.12
合计	2,101,680,984,171.40	184,242,656.55	396,401,749,807.67	20,443,962.72

③机构销售与研究业务方面

报告期内，公司向机构客户推广和销售各种证券交易服务和金融产品，包括股票、债券和基金。公司机构客户主要包括公募基金管理公司、私募基金管理公司、QFII、全国社保基金、保险公司、信托公司、资产管理公司、人民币合格境外机构投资者（RQFII）、财务公司及商业银行等。公司大力发展主经纪商业务，包括基金托管服务、清算、估值、融资、融券、产品销售及其他增值服务等。报告期内，公司于2015年4月21日通过中国证券投资基金业协会私募基金业务外包服务机构备案，成为首批通过备案的机构之一。截至报告期末，公司基金托管业务上线运行产品121只，业务规模103.15亿元，私募基金外包服务业务上线运行产品96只，业务规模67.15亿元。

报告期内，随着经济结构与经济发展方式转型升级及资本市场改革创新等政策措施的持续推进，券商研究业务面临新的机遇与挑战。报告期内，公司加大引进研究业务领军人物及业内有影响力的重点行业首席研究员的力度，持续推进研究团队建设，研究服务数量与质量显著提高，研究实力和市场影响力不断提升，业务收入大幅增长，公募基金分仓交易量及分仓市场占有率稳步提升。同时，公司不断完善研究业务服务体系，加强客户服务与拓展力度，持续优化内部组织架构，强化中后台服务支持，研究服务效率大幅提高。截至报告期末，公司公募基金分仓交易量4,395.97亿元，公募基金分仓交易量市场份额为5%，较2014年度增长59.24%。

④资本中介业务方面

资本中介业务方面主要包括向客户提供融资融券、股票质押式回购及约定购回业

务等。报告期内，受益于股票市场行情的上涨与成交量的大幅增加及客户进行杠杆交易意愿的提升，加之转融通标的证券范围的再次扩大等因素的驱动，市场融资融券业务呈现加速增长态势，市场融资融券余额大幅增长，截至报告期末，市场融资融券业务余额20,493.86亿元。报告期内，公司把握住市场行情持续上涨的良好机遇，不断提升业务规模，适时进行总量和结构调整，做好风险控制工作，有效保障公司债权安全。报告期末，母公司融资融券业务余额1,145.11亿元，市场份额为5.59%，维持担保比率为296.45%。报告期内，公司约定购回业务运行情况良好，但受股票质押式回购业务的替代性等因素影响，业务规模呈下降趋势，截至报告期末，业务待购回余额0.57亿元，履约保障比例为349.57%。报告期内，公司积极推广股票质押式回购业务，业务规模呈持续增长态势，截至报告期末，业务待购回余额合计348.9亿元，履约保障比率为439.34%。

(2) 投资银行业务

①股票承销、债券承销与财务顾问业务方面

报告期内，国内实体经济继续低位徘徊，宏观经济处于调结构、转方式的关键阶段。受证券监管政策趋于市场化等因素影响，券商承销规模整体呈稳定增长态势，股票市场加速改革，IPO发行、再融资速度显著提升；债券配套制度持续完善，交易机制不断优化，市场规模持续增长；随着并购重组政策的修订发布，并购重组市场化机制不断完善，并购重组市场表现活跃。

报告期内，公司加大行业开发转型力度，不断优化“专业化分工+体系化协同”模式，进一步完善组织体系、业务模式、管理机制、运作流程，形成集新兴行业、综合业务、优势业务及客户服务于一体的全方位业务条线，业绩实现持续增长。进一步优化投资银行业务布局，IPO及再融资继续保持市场地位，股权融资稳中有升，固定收益业务创新持续推进，固定收益业务业绩同比稳步增长，并购重组业务继续领先，市场影响力不断加大。积极布局资本中介等创新业务，加大资本介入力度，创新业务增长明显，业务品种和覆盖范围明显扩大，有效拓展了业务新增长点，增加了客户粘性。

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	8	134	754,290.02	8,103,200.33	33,977.12	353,633.80
	增发新股	13	64	821,585.67	8,148,587.86	6,853.33	86,185.52
	配股	0	30	0	1,002,136.78	0	19,236.96
	可转债	0	10	0	487,530.00	0	14,520.00
	债券发行	19	229	3,026,460.00	18,705,065.10	3,406.71	110,664.30
	小计	40	467	4,602,335.69	36,446,520.07	44,237.16	584,240.58
副主承销	新股发行	0	27	0	242,956.30	0	1,059.01
	增发新股	1	4	0	55,903.50	300	469
	配股	0	12	0	244,241.00	0	1,811.00
	可转债	0	3	0	13,284.00	0	12
	债券发行	3	85	0	691,575.00	2	1634.62
	小计	4	131	0	1,247,959.80	302	4,985.63
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

配股	0	31	0	136,077.30	0	429.94
可转债	0	9	0	164,536.00	0	217.74
债券发行	226	1,961	1,846,000.00	31,855,569.68	3,673.93	35,477.37
小计	226	2,190	1,846,000.00	34,414,648.46	3,673.93	38,110.47

报告期内，并购重组、财务顾问业务情况（合并数据）

	收入（万元）	家数	
	本期	本期	历年累计
并购重组、财务顾问业务	13,976.16	29	760

股票承销业务主要包括首次公开发行及定向增发、公开配售与配股及可转债发行等后续再融资。债券承销业务主要包括企业债券、公司债券、中小企业私募债券、非金融企业债务融资工具、其他各种金融债券及资产证券化等债权承销。报告期内，公司合并主承销40次，合并主承销金额460.23亿元，合并主承销收入4.42亿元；合并股权主承销21次，合并股权主承销金额1,575,875.69万元，合并股权主承销收入40,830.45万元；合并债权主承销19次，合并债权主承销金额3,026,460.00万元，合并债权主承销收入3,406.71万元。在并购重组业务方面，报告期内，公司并购重组与财务顾问业务收入13,976.16万元，公司主导完成的上市公司并购重组项目数在国内券商中继续排名第一。

②场外业务方面

报告期内，新三板业务增长迅猛，新三板挂牌企业数量增加，随着做市转让、市场分层、竞价交易、投资者适当性管理、转板制度等市场基础制度的愈发完善以及做市业务主体的扩大，市场流动性将不断改善，市场效率将进一步提升，新三板市场蕴藏巨大潜力。公司抓住市场机遇，积极推动项目承揽工作，不断提高项目储备水平，各项业务全面推进。报告期内共完成推荐挂牌项目9家、获同意挂牌函项目7家、在审项目14家，并完成4家挂牌企业的5次股票发行业务。截至报告期末，公司控股子公司江苏股权交易中心共有挂牌企业194家，累计发展会员单位141家，积极拓展私募债券备案发行、股权融资与股权质押贷款等业务，截至报告期末，累计私募债券备案金额148.05亿元，实际发行53.96亿元。随着互联网销售渠道的持续拓展、各类收益权产品的创设与开展、股权交易制度的变更完善以及传统股权业务的发展，江苏股权交易中心业务收入将进一步提升。

（3）资产管理业务

①证券公司资产管理业务方面

报告期内，在监管限制逐步放松的大背景下，资产管理行业准入门槛逐步降低，资管业务外延大幅扩展，混业竞争趋势愈加明显，行业市场化竞争更趋激烈。未来，随着券商资产管理业务产品创新力度的持续提升，券商资管业务种类和产品种类进一步丰富，将有助于满足投资者的多层次需求。截至报告期末，券商资管行业合计管理资产规模达10.25万亿元，创历史新高。

在证券公司资产管理业务领域，华泰资管公司抢抓行业发展重要机遇，以全业务链理念为指导，依托母公司高覆盖的经纪业务渠道及领先的投行资源，确立了打造全方位、综合性资产管理机构的目标。积极布局对接外部资源的机构投融资业务，以机构客户为服务对象，建立覆盖面广、有快速反应机制和产品能力的服务团队，提供综合的、能提升资本市场价值的增值服务。积极布局对接集团内部的平台业务，整合集团内外部资源，丰富完善资产管理业务形态和业务手段，及时满足各类业务需求，夯实并提升全业务链体系功能。积极布局投资研究业务，全力打造科学的、系统的、可

持续的投研平台，不断提高主动投资管理能力，持续提升资产管理业务核心竞争力。

截至报告期末，华泰资管公司合计管理集合资产管理计划44只，合计管理资产规模1,080.11亿元；合计管理定向资产管理计划372只，合计管理资产规模4,221.22亿元；合计管理专项资产管理计划3只，合计管理资产规模40.60亿元。根据中国证券投资基金业协会公布的证券期货经营机构资产管理业务统计数据，截至报告期末，华泰资管公司主动管理业务规模1,394亿元，行业排名第五，资产管理业务总规模行业排名第三。

报告期内，资产管理业务规模和收入情况如下表所示：

项目	2015 年度 1—6 月		2014 年度 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	1,080.11	46,327.54	263.53	24,349.50
定向资产管理业务	4,221.22	10,547.99	2,508.87	6,154.97
专项资产管理业务	40.60	250.00	0.54	13.71

②私募股权基金管理业务方面

报告期内，公司通过全资子公司华泰紫金投资开展直接投资，包括私募股权基金的投资与管理。报告期内，在股权投资机构及券商直投业务监管理念明确、并购市场持续火热、险资获准投资创投基金、注册制推进可期等因素影响下，私募股权投资市场新业务机遇逐渐涌现，市场面临更多机遇与挑战。截至报告期末，华泰紫金投资合计实施投资项目2个，均为股权投资类项目，合计投资金额4,000万元；华泰紫金投资控股子公司华泰瑞通投资管理有限公司发起设立华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）合计实施投资项目12个，合计投资金额46,592.94万元，其中股权投资类项目11个、投资金额46,092.94万元，债权投资类项目1个、投资金额500万元；华泰紫金投资下属子公司华泰瑞联基金管理有限公司发起设立的北京华泰瑞联并购基金中心（有限合伙）合计实施投资项目8个，合计投资金额97,389.10万元，其中股权投资类项目7个、投资金额87,170.30万元，债权投资类项目1个、投资金额10,218.80万元；华泰紫金投资控股子公司深圳市华泰瑞麟基金投资管理合伙企业（有限合伙）发起设立的深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）合计实施投资项目3个，均为股权投资类项目，合计投资金额17,088.33万元；华泰紫金投资控股子公司江苏省新兴产业投资管理有限公司作为基金管理人的江苏新兴产业投资基金（有限合伙）合计实施投资项目1个，为股权投资类项目，合计投资金额39,687.93万元；同时，华泰紫金投资控股子公司北京华泰同信投资基金管理有限公司于报告期内发起设立北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限公司）。

③基金公司资产管理业务方面

报告期内，公司主要通过参股公司南方基金与华泰柏瑞开展基金公司资产管理业务。在南方基金资产管理业务领域，截至报告期末，南方基金公募业务管理基金数合计73只，公募业务基金总规模合计人民币2,303.86亿元，较2014年同期1,954.30亿元增长17.89%；非公募业务账户资产净值合计人民币1,205.36亿元，较2014年同期808.21亿元增长49.14%。报告期内，南方基金获《中国证券报》“金牛基金奖”、《证券时报》“2014年度中国基金业明星基金奖”、《上海证券报》“第十二届中国‘金基金’奖”。在华泰柏瑞资产管理业务领域，截至报告期末，华泰柏瑞公募业务管理基金数合计32只，公募业务基金总规模合计人民币766.62亿元，较2014年同期405.79亿元增长88.92%；非公募业务账户资产净值合计人民币14.13亿元，较2014年同期

12.05亿元增长17.26%。报告期内，华泰柏瑞获《中国证券报》“2014年度金牛基金公司”、《上海证券报》“金基金·TOP公司大奖”。

④其他主要业务方面

在期货资产管理业务领域，控股子公司华泰期货于2012年11月19日获得期货资产管理业务资格。报告期内，华泰期货积极开展传统资产管理业务的同时持续推进业务创新，截至报告期末，期货资产管理业务产品共78只，委托资产管理规模达40.12亿元，期货端权益达8.39亿元。

（4）投资及交易业务

①权益证券投资 and 交易业务方面

报告期内，在货币政策宽松不断加码、杠杆资金推动及改革预期推进等因素影响下，股票市场延续上涨趋势，沪深两市指数持续攀升，沪深300指数实现26.58%的涨幅。报告期内，公司以“在控制风险的前提下获得合理回报”为投资目标，注重强调安全边际，通过加大非方向性投资项目的占比，积极采用对冲、量化、套利、高频等积极管理风险的方式，获取低风险稳定收益，公司权益类证券投资业务投资收益率大幅跑赢沪深300指数的涨幅。同时，场内量化对冲投资业务继续以量化分析和系统支撑为核心，在保持alpha对冲投资策略等传统优势业务发展的同时积极把握市场期现基差套利机会，取得了良好的投资业绩。

②固定收益投资和交易业务方面

报告期内，受国内宏观经济基本面走弱、货币政策宽松、流动性充裕等因素影响，尽管国内债券市场行情有波折，但整体呈现牛市行情，债券收益率整体呈下行态势，短端收益率表现好于长端收益率。报告期内，中债综合全价指数和中证全债指数分别上涨1.21%和3.17%。报告期内，公司积极开展并推动传统业务转型，并以FICC业务发展战略为指引，全面布局创新业务。积极调整现券投资策略，充分利用一二级市场机遇，加强波段操作并调整持仓券种，规避信用风险，同时，加大IRS对冲力度，有效锁定资金成本，降低市场风险，以实现收益的稳定性。报告期内，公司固定收益投资和交易业务依靠深度研究、精准的市场预判、及时的策略调整实现了较好的收益。

③OTC金融产品与交易业务方面

报告期内，公司大力强化柜台市场交易平台建设，丰富完善业务流程和制度，有序推出资管计划、收益凭证、收益互换、结构化产品、限制性股票融资、资产支持证券等业务种类，全力推进私募产品、场外金融衍生品及创新融资等发展。目前，公司的柜台市场取得了投资类、代理交易类、创设类、推荐类、展示类等全部业务权限。报告期内，公司合计发行67只收益凭证，共融资人民币240.31亿元，截至报告期末的存量规模为172.75亿元。报告期内，公司累计发行35笔权益类收益互换交易业务，累计发行规模90.46亿元，截至报告期末的业务存量为29笔，存量规模为80.85亿元。

④其他主要业务方面

报告期内，公司通过全资子公司华泰创新投资有限公司积极开展另类投资业务。报告期内，新增投资项目3个，目前存续项目6个，投资品种包括债券结构化产品、商品期现套利、量化对冲产品、非标产品代持等，上半年实现投资收益及浮盈8,423.91万元。公司积极开展全国中小企业股份转让系统做市业务，截至报告期末，公司合计为17家挂牌公司提供做市报价服务，做市总市值为23,754.14万元。

合并数据

单位：元 币种：人民币

项目	2015年1—6月	2014年1—6月
----	-----------	-----------

证券投资收益	2,982,236,406.53	618,827,913.61
其中：出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的收益	5,244,097,020.98	-200,044,118.25
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	241,159,781.34	-104,331,319.27
金融资产持有期间收益	851,651,924.35	606,442,604.40
衍生金融工具的投资收益	-3,354,672,320.14	316,760,746.73
公允价值变动损益	351,472,443.46	463,575,415.79
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-118,787,956.38	481,861,123.95
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	246,149,771.17	-
衍生金融工具	224,110,628.67	-18,285,708.16
合计	3,333,708,849.99	1,082,403,329.40

母公司数据

单位：元 币种：人民币

项目	2015年1—6月	2014年1—6月
证券投资收益	2,667,091,751.71	645,396,500.85
其中：出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的收益	5,154,202,213.81	-150,601,108.74
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的收益	-	-
出售可供出售金融资产投资收益	179,479,539.90	-108,431,319.27
金融资产持有期间收益	691,597,946.58	587,668,182.13
衍生金融工具的投资收益	-3,358,187,948.58	316,760,746.73
公允价值变动损益	92,831,718.50	395,834,304.47
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-363,551,365.73	418,317,093.99
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	250,156,640.00	-
衍生金融工具	206,226,444.23	-22,482,789.52
合计	2,759,923,470.21	1,041,230,805.32

(5) 海外业务

2006年11月，为开拓境外业务，公司在香港正式注册成立全资子公司华泰金融控股（香港）有限公司，并于2007年正式营业。华泰金控（香港）致力于不断升级和扩展海外业务平台，截至报告期末，拥有香港证监会核发的第1类（证券交易）、第2类（期货合约交易）、第4类（就证券提供意见）、第6类（就机构融资提供意见）及第

9类（提供资产管理）牌照，搭建了较完整的综合性业务条线。目前，华泰金控（香港）业务主要包括投资银行业务（股票承销、债券承销、私募配售、财务顾问、并购、结构融资及投资）、销售及交易业务（为股票、固定收益产品、信用、期货合约及结构产品等各类证券及期货产品提供交易及做市服务；为客户设计满足其需求的金融产品及市场进入方案；为代理业务项下的证券提供融资服务）和资产管理业务。

报告期内，华泰金控（香港）代理股票交易量194.41亿港元、代理期货合约交易量5.46万张；参与股票配售项目3个、债券发行项目7个、财务顾问项目6个、合计承销规模44.06亿港元；合计资产管理规模34.19亿港元。同时，华泰金控（香港）还注册成立HTSC LIMITED、Lead Talent Enterprises Limited等11家子公司。

（6）业务创新情况与对公司经营业绩和未来发展的影响，以及如何进行风险控制

①主要业务创新情况与对公司经营业绩和未来发展的影响

信用类业务方面。报告期内，公司积极开展行权融资和限制性股票融资业务，以满足上市公司股权激励方案中被激励对象行权买入上市股票与申购限制性股票的融资需求。截至报告期末，行权融资业务待偿还融资金额224.7万元，限制性股票融资业务待偿还融资金额3.64亿元。两项业务的开展是对公司现有产品线和业务范围的补充，在创造利息收入的同时，有利于改善客户结构和业务经营模式，增强公司盈利能力，进一步提升公司品牌影响力。

期权经纪与场内期权业务方面。报告期内，经上交所《关于华泰证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》批准，公司成为上交所股票期权交易参与人，并开通股票期权经纪业务与自营业务交易权限。报告期内，公司股票期权经纪业务平稳有序开展，保持良好发展态势，总成交量37.77万张，市场份额占比7.48%，期权经纪业务的开展有利于进一步拓展券商业务范围，进一步拓宽券商收入渠道。同时，经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司股票期权做市业务资格的批复》及上交所《关于华泰证券股份有限公司开展上证50ETF期权做市业务的通知》批准，公司于2015年2月9日成为上证50ETF期权合约品种主做市商，场内期权业务的开展丰富了量化投资策略，并提供了多样化的投资和风险管理工具。

场外衍生品业务方面。报告期内，场外衍生品业务延续去年以来的快速发展势头，公司积极把握收益凭证业务的发展机遇，继续推动权益类收益互换业务规模的迅速增长，同时，继续推进业务平台建设，建立健全场外衍生品业务后台管理系统。场外衍生品业务作为投资业务的稳定器，可以为投资业务提供更广阔的创新空间，有利于促进资本市场产品多样化，满足客户多元需求，进一步扩大券商收入来源。

柜台市场业务方面。2014年10月14日，经中国证券业协会许可，公司获准开展柜台市场试点业务。报告期内，公司柜台市场业务积极探索尝试产品常态化发行机制，持续拓宽产品销售范围和方式，不断满足投资者多样化的产品配置需求及综合金融需求。柜台市场业务的发展有助于券商基础功能的再造及整合，有效释放券商业务空间，扩大券商客户资源，丰富券商业务服务方式。

基金托管外包业务方面。2014年9月29日，经中国证监会核准，公司获准开展证券投资基金托管业务，同时，公司于2015年4月21日通过中国证券投资基金业协会的私募基金业务外包服务机构备案。报告期内，公司根据有关规定和核准文件要求，积极开展基金托管外包业务。基金托管外包业务的开展，有利于券商整合各类金融产品，满足客户全方位业务需求，提供综合化金融服务。

②业务创新的风险控制

报告期内，公司持续促进业务创新活动，推动公司新业务、新产品、服务及管理

模式创新，提高公司创新能力。在经营创新业务中，公司坚持“市场有需求，法律无障碍，风险可控制，效率有保障”的基本原则，针对创新业务风险特点，在组织体系、决策授权、制度流程等方面进一步完善了风险控制措施，防范创新业务风险认识不全面、业务设计不合理以及控制机制不完善的风险，确保了各项创新业务在风险可测可控可承受的前提下持续稳健开展。

在信用类创新业务方面，报告期内公司推出“限制性股票融资”、“上市公司股权激励行权融资”等创新业务品种。在原有信用业务风险管理基础上，公司结合具体创新业务的特点进一步完善覆盖客户征信授信、信用账户管理、担保物管理、逐日盯市及强制平仓管理、贷后跟踪管理、客户回访、客户投诉受理及处理等业务各环节的制度体系。为有效防范和控制业务风险，公司风险管理部门制定完善了信用风险管理体系，业务部门设置专岗实时监控各类风险指标，交易时间结束后及时评估风险并报告，以完善的风险管理体系、执行流程来确保业务风险水平满足公司要求。

在场内期权业务方面，公司将期权业务严格纳入以净资本为核心的期权业务风险控制指标体系中，健全与净资本相适应的业务规模调整机制。公司权益类证券投资业务委员会在董事会授权范围内，决定股票期权业务的总体投资规模上限。业务开展过程，在业务一线风控的基础上，风险管理部对期权业务运作中的风险状况进行全过程的监控和评估，制定风险限额、设立风险对冲机制、进行逐日盯市，包括但不限于：期权业务资金规模情况、风险敞口及希腊字母情况、投资项目盈亏率情况、保证金占用情况等。其中，保证金占用情况包括日间实时保证金比例及日终维持保证金比例，设置预警机制，以确保业务风险可控。

在期权经纪业务方面，公司建立了规范的制度、流程和岗位设置等，通过信息系统进行全方位的风险监控，增加了客户履约担保率、平仓担保率、投资者越级交易、限购额度、持仓限额、行权交收资金缺口、行权交收证券缺口等风险监控指标；公司通过短信、电话、邮件等方式及时对风险客户进行预警、追保和强平提示；对期权经纪业务的公司整体开展状况、客户适当性要求、客户风险状况、客户异常交易等进行日常监控并制定了应对措施。

在权益类收益互换等场外衍生品业务方面，公司从交易对手评估、标的证券选择、交易额度设置、风险对冲管理、逐日盯市、风险处置等各个环节出发，制定了覆盖各业务流程节点的风险控制措施和制度体系。在具体业务开展过程中，具体业务部门一线业务人员负责日常盯市监控职责，风险管理部门进行二级监控，并在原有风险管理措施基础上细化对信用风险、市场风险和流动性风险的评估，确保业务过程中的风险水平符合各项限额指标的要求。

在柜台市场业务方面，报告期内，公司建设完成柜台交易监控模块，完成相关交易监控指标的开发及阈值设置，包括账户监控、客户适当性管理、异常交易、诚信交易、做市业务、特殊业务监控、隔离墙管理以及产品和客户信息查询等。

在基金托管外包方面，报告期内，公司进一步修订完善基金托管和外包相关业务管理制度，优化业务流程，明确各相关部门业务审核职责；同时，为满足私募基金管理人基金净值披露及投资者份额查询的需要，作为增值服务手段，公司开发了公司网站托管产品信息披露、外包产品净值披露及持有人份额查询功能，公司可根据基金业务外包服务协议约定，接受私募基金管理人委托，代为披露外包基金产品的净值信息，代为提供外包基金产品的持有人份额查询服务。

2、主营业务分地区情况

(1) 公司营业收入地区分部情况

单位：万元 币种：人民币

地区	2015年1-6月		2014年1-6月		营业收入增 减百分比(%)
	营业部数 量(家)	营业收入 (万元)	营业部数 量(家)	营业收入 (万元)	
江苏	98	233,227.60	91	56,974.17	309.36
湖北	30	44,082.48	30	10,195.65	332.37
广东	34	67,267.11	34	14,847.60	353.05
上海	16	56,735.24	15	14,242.78	298.34
北京	8	30,677.16	8	7,286.68	321.00
四川	8	20,092.67	9	5,859.44	242.91
辽宁	8	13,602.62	8	2,774.35	390.30
黑龙江	6	8,133.63	6	2,098.26	287.64
山东	8	9,151.17	8	2,191.47	317.58
天津	5	12,010.42	6	2,920.42	311.26
浙江	10	13,099.31	8	3,018.84	333.92
河南	4	7,543.79	4	1,732.91	335.32
湖南	4	12,781.01	5	2,713.75	370.97
江西	2	6,194.67	3	1,289.67	380.33
广西	3	3,913.20	3	1,187.21	229.61
福建	4	6,472.16	4	1,676.13	286.14
吉林	3	2,308.32	2	965.29	139.13
河北	2	2,954.81	2	744.19	297.05
陕西	2	5,218.46	2	1,125.46	363.67
安徽	5	4,737.87	3	755.80	526.87
海南	2	2,925.38	2	616.47	374.54
宁夏	1	1,972.14	1	485.44	306.26
重庆	3	2,902.75	3	88.25	3,189.24
内蒙古	3	2,043.50	1	468.72	335.97
甘肃	1	608.55	1	130.50	366.32
山西	1	620.23	1	99.96	520.48
贵州	2	384.87	2	111.71	244.55
云南	1	1,327.56	2	289.39	358.74
新疆	1	316.43	1	56.58	459.26
青海	1	134.82	1	3.10	4,249.03
营业部小计	276	573,439.91	266	136,950.19	318.72
香港地区	-	28,571.96	-	4,178.39	583.80
总部及子公司	-	862,413.31	-	295,797.01	191.56
合计	276	1,464,425.18	266	436,925.59	235.17

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

单位：万元 币种：人民币

地区	2015年1-6月		2014年1-6月		营业利润 增减百分比 (%)
	营业部数量 (家)	营业利润 (万元)	营业部数量 (家)	营业利润 (万元)	
江苏	98	179,152.26	91	29,135.00	514.90
湖北	30	30,978.50	30	3,827.80	709.30
广东	34	38,529.99	34	2,339.75	1,546.76
上海	16	32,508.36	15	3,019.02	976.79
北京	8	15,332.95	8	410.24	3,637.56
四川	8	12,363.29	9	2,411.25	412.73
辽宁	8	9,421.39	8	866.49	987.31
黑龙江	6	5,878.39	6	925.05	535.47
山东	8	6,442.03	8	819.47	686.12
天津	5	7,647.52	6	797.59	858.83
浙江	10	8,742.39	8	448.05	1,851.21
河南	4	4,806.02	4	562.53	754.36
湖南	4	8,971.13	5	985.26	810.53
江西	2	4,644.48	3	637.85	628.15
广西	3	2,441.39	3	305.28	699.72
福建	4	3,833.03	4	420.00	812.63
吉林	3	1,464.59	2	233.63	526.88
河北	2	2,066.41	2	258.96	697.96
陕西	2	3,789.69	2	542.81	598.16
安徽	5	2,798.96	3	34.28	8,064.99
海南	2	2,170.81	2	201.83	975.56
宁夏	1	1,453.28	1	152.58	852.47
重庆	3	2,004.68	3	212.02	845.51
内蒙古	3	1,303.01	1	238.19	447.05
甘肃	1	98.05	1	-57.30	-271.12
山西	1	350.04	1	-97.66	-458.43
贵州	2	152.48	2	-95.10	-260.33
云南	1	533.03	2	-91.99	-679.44
新疆	1	121.64	1	-62.52	-294.56
青海	1	63.34	1	-49.32	-228.43
营业部小计	276	390,063.10	266	49,331.04	690.71
香港地区	-	15,558.00	-	-1,233.66	-1,361.13
总部及子公司	-	475,416.54	-	153,325.46	210.07
合计	276	881,037.65	267	201,422.84	337.41

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。

(四) 资产、负债情况分析

1、 资产负债情况分析表

单位：亿元 币种：人民币

项目名称	本期		上期		本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
	期末金额	占总资产比 (%)	期末金额	占总资产比 (%)		
货币资金（含结算备付金）	3,249.73	56.01	1,080.82	39.70	200.67	合并资管产品
融出资金	1,146.78	19.77	646.37	23.74	77.42	融资融券业务规模增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	848.97	14.63	560.00	20.57	51.60	期末持有的交易性金融资产增加
买入返售金融资产	247.03	4.26	207.10	7.61	19.28	约定购回及股票质押业务增加
存出保证金	66.36	1.14	44.83	1.65	48.03	应收客户资金增加
可供出售金融资产	113.46	1.96	92.76	3.41	22.32	合并资管产品
长期股权投资	21.73	0.37	18.74	0.69	15.96	投资股权增加
应付短期融资款	243.70	4.20	247.87	9.11	-1.68	短期融资规模增加
拆入资金	34.00	0.59	15.00	0.55	126.67	拆入资金增加
卖出回购金融资产款	629.55	10.85	496.68	18.25	26.75	期末未到期卖出回购金融资产款增加
代理买卖证券款（含信用）	2,051.39	35.36	702.28	25.80	192.10	客户交易资金增加
应付债券	709.28	12.23	213.45	7.84	232.29	发行债券规模增加
其他负债	1,038.85	17.91	521.04	19.14	99.38	其他经营性负债增加
资产合计	5,801.61	100.00	2,722.26	100.00	113.12	

截至报告期末，公司资产较年初大幅增加3,079.35亿元、增幅高达113.12%，增加的来源主要有六个：公司发行H股增加净资产301.97亿元、经营利润增加66.75亿元（扣减分配28亿元利润后净增加38.75亿元）、合并资管产品因素增加486.04亿元、卖出回购增加132.87亿元、代理买卖客户资金增加1349.11亿元、净增加发行债券326.83亿元，增加的资金主要体现在货币资金、融出资金和交易性金融资产等项目上。

从资产结构看，截至报告期末，货币资金3,249.73亿元，占比56.01%；融出资金1,146.78亿元，占比19.77%；交易性金融资产、买入返售金融资产、存出保证金、可供出售金融资产合计为1,274.68亿元，占比21.97%。从资产分布结构可以看出，公司资产主要为流动性和安全性均较高的投资品种。负债项目以应付短期融资款、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付债券为主，负债总额为5,024亿元。对比流动资产金额和负债总额，公司没有负债偿还压力，资产状况、资产结构良好，持续经营的稳定性及安全性较高。

受益于公司净资产大幅增加，截至报告期末，扣除资管产品影响因素和客户资金因素后，公司合并报表资产负债率为71.32%，较年初的71.40%下降0.08%，权益乘数为3.49倍，较年初的3.50倍下降了0.01倍。

2、报告期内公司盈利能力情况分析

报告期内，公司营业收入、营业利润、净利润均较上年同期有较大幅度的提升。主要原因为：市场环境明显好转，交易量上升、融资融券余额快速增长、IPO持续进行等利好因素推动行业整体经营情况显著优于上年同期；公司通过大力推进全业务链战略，加快了业务创新和业务拓展的步伐，公司经纪与财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务和投资及交易业务均取得了良好的业绩，其中，公司股基交易量市场份额增长20.41%，母公司融资融券业务余额增长440.22%，均远超行业平均水平。随着公司H股成功发行上市、业务转型持续深化、全业务链逐步打通、内部管理不断强化等战略地逐步深入推进，在行业创新力度不断加大的大背景下，公司各项业务的市场竞争力将进一步加强，公司的盈利能力的持续性和稳定性将得到进一步的巩固和提升。

3、比较式会计报表中变动幅度超过30%以上项目的情况

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	期末余额	期初余额	增减(%)	变动原因说明
货币资金	283,661,411,384.97	89,864,943,930.42	215.65	客户资金增加及公司发行H股所致
结算备付金	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39	126.77	客户备付金增加所致
融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25	77.42	融资业务规模大幅度增长所致
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	84,897,192,284.66	55,999,957,916.75	51.60	期末持有的股票增加及合并结构化主体所致
衍生金融资产	317,807,279.02	20,814,658.67	1,426.84	权益互换浮动盈亏增加
应收款项	1,677,815,454.50	362,653,212.62	362.65	合并结构化主体所致
应收利息	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17	65.41	融资融券应计利息增加所致
存出保证金	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77	48.04	子公司期货保证金增加
固定资产	2,603,579,520.34	1,258,361,600.29	106.90	启用新建的办公大楼由在建工程转为固定资产
在建工程	1,086,170,068.11	2,045,324,758.06	-46.89	启用新建的办公大楼由在建工程转为固定资产
其他资产	703,514,440.27	305,542,089.10	130.25	收关联方红利及合并资管产品
拆入资金	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00	126.67	银行短期拆入资金增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	15,588,540,564.48	9,244,846.63	168,518.70	本期新增黄金租赁业务所致
衍生金融负债	1,842,475,334.51	730,743,142.93	152.14	权益互换浮动盈亏增加
代理买卖证券款	175,620,904,470.86	60,398,770,689.39	190.77	客户资金流入所致
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63	200.30	融资融券业务规模大幅度增长

应付职工薪酬	3,759,075,265.64	1,740,596,909.95	115.96	计提的职工薪酬增加
应交税费	2,998,377,479.63	1,429,904,303.41	109.69	本期应税收入增加。
应付利息	1,821,595,255.57	1,025,326,598.95	77.66	本期短融及次级债规模增加所致
长期借款	367,095,074.05	138,657,783.84	164.75	本期工程借款增加
应付债券	70,928,065,527.29	21,345,324,135.31	232.29	发行次级债所致
长期应付职工薪酬	298,041,770.93	705,434,340.93	-57.75	长期职工薪酬中一年内需支付的部分转入应付职工薪酬
递延所得税负债	1,037,375,485.71	601,173,542.16	72.56	应纳税暂时性差异增加。
其他负债	103,885,187,866.83	52,103,789,780.47	99.38	合并结构化主体所致
实收资本(或股本)	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00	27.91	发行H股所致
资本公积	45,855,964,803.72	17,221,260,799.97	166.28	H股发行溢价
其他综合收益	3,536,559,397.51	1,853,643,771.39	90.79	可供出售金融资产的浮动收益增加所致
未分配利润	14,194,010,313.32	10,319,188,382.86	37.55	本期净利润增加及现金分红所致
利润表科目	本期数	上年同期数	增减(%)	变动原因说明
手续费及佣金净收入	7,969,997,167.12	2,144,080,896.46	271.72	经纪业务、投行业务手续费及资产管理业务收入均有所增加
利息净收入	2,769,331,690.69	986,092,925.76	180.84	本期融资融券利息收入增加
投资收益	3,179,740,350.49	744,192,339.02	327.27	本期证券投资业务收入增加
汇兑收益	331,388,162.11	1,253,092.00	26,345.64	H股募集资金结售汇所致
其他业务收入	42,321,992.57	30,061,200.65	40.79	子公司咨询服务费收入
营业税金及附加	921,431,417.06	238,957,477.60	285.60	本期应税收入增加。
业务及管理费	4,878,355,706.15	2,091,689,643.22	133.23	本期在队伍建设、高端人才引进、信息技术、客户营销与服务方面支出增加
资产减值损失	-2,361,942.69	-344,967.96	584.68	前期计提减值准备转回
其他业务成本	36,450,152.98	24,725,300.88	47.42	子公司备用信用证成本
所得税费用	2,115,301,390.96	501,843,439.84	321.51	本期利润总额增加
其他综合收益的税后净额	1,684,553,023.59	-11,865,157.61	不适用	可供出售金融资产的浮动收益增加

4、报表合并范围变更的说明

(1) 新设子公司导致的合并范围变动

截至2015年6月30日，公司报表合并范围包括了报告期内新设立的子公司。本公司认为本公司对新设立的子公司具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。新设立子公司的详情如下：

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册资本	持股比例(%) (或类似权益比例)		取得方式
						直接	间接	
深圳前海瑞联一号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联二号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联三号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联四号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联六号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
上海京瑞投资中心（有限合伙）	上海	上海	投资管理	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
北京瑞联京深投资中心（有限合伙）	北京	北京	投资管理	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	北京	北京	股权投资	人民币	1,000,000,000.00	-	45.00	设立
深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	220,010,000.00	-	25.00	设立
华泰瑞新（上海）投资有限公司	上海	上海	投资管理	人民币	100,000,000.00	-	100.00	设立
HTSC LIMITED	香港	香港	控股投资	港币	1.00	-	100.00	设立
Principle Solution Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Lucid Elegant Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Reward Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Reward Investment Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Return Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Return Holdings Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Festive Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principal Investment I limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Lead Talent Enterprises Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principle Investment Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
北京华泰同信投资基金管理有限公司	北京	北京	投资管理	人民币	3,000,000.00	-	51.00	设立
北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）	北京	北京	投资管理	人民币	30,000,000.00	-	52.00	设立

(2) 其他

本集团根据准则33号（2014），对于本集团同时作为管理人或投资顾问及投资者，且综合评估本集团因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本集团面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并（主要是资产管理计划）。

5、公司融资渠道和融资能力等情况分析

(1) 公司的主要融资渠道

公司目前的短期融资渠道主要包括：债券回购、同业拆借、转融通、黄金租赁、发行短期融资券、发行短期次级债、发行短期公司债、发行收益凭证以及两融收益权融资等，中长期融资渠道主要包括项目贷款、发行公司债、发行长期次级债以及股权再融资等。

(2) 公司的负债结构

报告期末，公司的负债结构及变化情况如下表：

单位：元 币种：人民币

负债项目	期末数	负债结构 (%)	期初数	比期初变动 (%)
应付短期融资款	24,369,823,509.44	4.85	24,787,070,000.00	-1.68
拆入资金	3,400,000,000.00	0.68	1,500,000,000.00	126.67
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	15,588,540,564.48	3.10	9,244,846.63	168,518.70
衍生金融负债	1,842,475,334.51	0.37	730,743,142.93	152.14
卖出回购金融资产款	62,955,007,481.35	12.53	49,668,228,233.78	26.75
代理买卖证券款	175,620,904,470.86	34.96	60,398,770,689.39	190.77
代理承销证券款	40,510,963.43	0.01	41,400,000.00	-2.15
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	5.88	9,829,634,190.63	200.30
应付职工薪酬	3,759,075,265.64	0.75	1,740,596,909.95	115.96
应交税费	2,998,377,479.63	0.60	1,429,904,303.41	109.69
应付款项	3,949,424,654.39	0.79	4,194,205,380.59	-5.84
应付利息	1,821,595,255.57	0.36	1,025,326,598.95	77.66
应付股利	13,096,640.00	0.00	15,452,840.00	-15.25
预计负债	-		-	
长期借款	367,095,074.05	0.07	138,657,783.84	164.75
应付债券	70,928,065,527.29	14.12	21,345,324,135.31	232.29
长期应付职工薪酬	298,041,770.93	0.06	705,434,340.93	-57.75
递延所得税负债	1,037,375,485.71	0.21	601,173,542.16	72.56
递延收益	17,671,063.72	0.00	16,671,063.72	6.00
其他负债	103,885,187,866.83	20.68	52,103,789,780.47	99.38
负债合计	502,410,640,203.16	100.00	230,281,627,782.69	118.17

剔除代理买卖证券款和代理承销证券款后，公司的负债总额为2,972.31亿元，比期初1,600.12亿元增加1,372.19亿元，增长比例为85.76%，增长的主要原因有：（1）纳入合并报表的公司担任管理人的资产管理计划规模大幅增加；（2）公司充分利用多种融资渠道进行债务融资，报告期内，公司运用了黄金租赁、次级债、公司债和收益凭证等多种融资工具进行债务融资，使得主动负债规模较上年度大幅增加；（3）卖出回购也较上年度大幅增加。

(3) 公司流动性管理政策和措施

公司按照集中管理、分层防控的管理模式，遵循全面性、审慎性、预见性的总体原则进行流动性风险管理，依托全面风险管理架构建立流动性风险管理组织体系，建立健全与公司战略相适应的流动性风险管理体系，贯彻实施偏好为“安全”的流动性风险管理政策，即公司确保不发生对持续经营造成重大影响的流动性风险，全力保障公司各项业务稳健、安全、有序运行。

为确保流动性安全，公司采取的主要措施包括：一是不断完善资金计划体系，强化资金头寸管理和现金流量监控，确保日间流动性安全；二是加强资产负债期限匹配管理，建立优质流动资产储备，提高融资的多元化和稳定程度；三是搭建流动性管理平台，逐步实现通过信息系统对流动性风险实施有效的识别、计量、监测和控制，确保流动性风险可测、可控、可承受；四是分析压力情景下公司的现金流量和资金缺口，评估公司的流动性风险的承受能力，并依据压力测试结果，制定必要的流动性风险应急处置方案。

(4) 公司融资能力及融资策略分析

公司经营规范，信誉良好，资本实力、盈利能力和偿债能力较强，与各大商业银行保持良好的合作关系，因此公司融资能力较强，可以通过监管许可的融资方式，筹集经营所需资金。报告期内，公司主要采取的融资方式包括发行H股、两融收益权融资、次级债、黄金租赁、公司债、短期融资券、收益凭证、同业拆借、债券回购、转融通、项目贷款等。未来，公司将结合业务发展情况采取其他监管许可的融资方式，这些融资方式的融资成本主要受资金市场利率的变动影响，公司将加强对市场利率跟踪和分析，选择恰当的融资方式和时机，在确保公司业务需求的前提下，力求降低融资成本。

(5) 汇率和利率变动对公司财务状况影响

就公司而言，为兼顾流动性和收益性，持有一定金额的银行存款和固定收益产品，利率变动将对公司持有现金所获利息收入、所持有债券投资的市场价格及投资收益等带来直接影响；同时，公司的股票投资也受到利率变动的间接影响；此外，在本报告期内，公司H股在香港联交所顺利挂牌交易，募集资金总额为港币387.48亿元，为了避免汇率的波动风险，公司对募集的港币资金与中国银行和工商银行签订了外汇远期协议；同时，因公司有境外注册的子公司，以外币投入资本金，公司持有外币资金和资产，汇率的变动将对公司财务状况产生一定影响。

(6) 公司或有事项及其对公司财务状况的影响

报告期末，公司或有事项主要包括未决诉讼仲裁形成的或有负债、为其他单位提供债务担保形成的或有负债等，上述事项对公司财务状况的影响较小。

(五) 核心竞争力分析

公司是中国证监会首批批准的综合类证券公司，也是中国证券业协会较早评审通过的创新试点证券公司。多年来，公司始终秉承“高效、诚信、稳健、创新”的核心价值观，坚持“以客户服务为中心、以客户需求为导向、以客户满意为目的”的经营理念，逐步塑造了公司的核心竞争力，在市场上形成了较高的知名度和影响力。报告期内，公司持续推动业务转型与创新发展，不断巩固公司核心竞争力。

报告期内，公司完成上市后的首次股权融资，公司H股在香港联交所挂牌上市并交易，同时，公司完成66亿元公司债券、三期共360亿元次级债券以及四期共110亿元短期融资券的发行，净资本和净资产规模大幅提升，资本结构进一步改善。公司资本实力迈上了一个新台阶，为公司实施业务转型、加快业务创新提供了坚实的资本保障。

报告期内，公司经营范围增加股票期权做市业务资格，并获准成为上交所股票期权交易参与人。公司业务资格不断增多，业务体系和业务结构不断完善，综合金融服务能力不断提升，同时，公司逐步形成集证券、基金、期货和海外业务等为一体的综合金融控股集团，具有强大的规模效应和交叉销售潜力，将有助于发挥公司整体业务优势。

报告期内，公司创新业务增长迅猛，传统业务呈上升趋势，创新业务与传统业务协同效应显现。截至报告期末，公司经纪业务股票基金交易量市场份额位居行业第一，并购重组业务项目数位居行业首位。公司在巩固传统业务优势的同时，稳步推进创新业务，收入结构不断优化，创新业务收入占比持续提升，为公司下一阶段发展夯实了基础。

截至报告期末，公司共有分公司29家、证券营业部245家，公司网点众多，布局全国，覆盖30个省市自治区的逾800万客户群体，形成了较为完善的业务网络体系。公司主动探索实践互联网金融模式，研究制定互联网证券业务发展规划，积极布局互联网证券业务，不断拓展客户基础，积极推进业务互联网化的同时推动公司业务转型升级。

报告期内，公司进一步加强公司治理、合规管理、风险管理体系、内部控制体系、信息技术、人才队伍等中后台建设，以巩固提升公司核心竞争力。报告期内，公司完成A+H股布局，香港成功上市是公司业务发展的一个重要里程碑，有助于公司更好借力资本市场，发展国际化金融平台，向国际化战略迈出实质性一步。报告期内，公司未发生因设备或技术升级换代、特许经营权丧失等导致公司核心竞争力受到严重影响的情况。公司将认真分析研究经济环境变化、市场变化、业务变化等带来的机遇和挑战，在泛混业经营背景下，努力提升公司综合竞争实力。

(六)投资状况分析

1、对外股权投资总体分析

截至报告期末，公司累计对外股权投资总额为21.73亿元，较期初的18.74亿元增加2.99亿元，增加幅度为15.93%。

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初投资	本年增减变动	期末投资	持股比例(%)	主要业务
南方基金管理有限公司	1,359,324,049.23	54,988,499.20	1,414,312,548.43	45.00	基金管理
华泰柏瑞基金管理有限公司	243,389,084.64	54,203,404.80	297,592,489.44	49.00	基金管理
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	256,523,312.65	189,501,523.51	446,024,836.16	48.25	股权投资
江苏小微企业融资产品交易中心有限责任公司	15,251,156.95	-	15,251,156.95	49.00	金融服务
合计	1,874,487,603.47	298,693,427.51	2,173,181,030.98	/	/

(1) 证券投资情况

√适用 □不适用

序号	证券品种	证券代码	证券简称	最初投资金额(元)	持有数量(股)	期末账面价值(元)	占期末证券总投资比例(%)	报告期损益(元)

1	股票	601318	中国平安	1,304,931,350.46	16,008,092.00	1,311,703,058.48	6.21	-246,094,365.69
2	股票	600016	民生银行	1,309,065,177.26	128,001,504.00	1,272,334,949.76	6.03	-123,829,882.29
3	股票	600000	浦发银行	645,586,536.67	37,939,349.00	643,451,359.04	3.05	-16,319,864.10
4	股票	002471	中超电缆	191,340,000.00	18,000,000.00	485,820,000.00	2.30	288,000,000.00
5	股票	600030	中信证券	479,089,201.68	15,885,678.00	427,483,594.98	2.02	-190,887,069.45
6	股票	601009	南京银行	284,509,925.06	18,181,180.00	414,530,904.00	1.96	126,820,071.03
7	股票	000858	五粮液	337,667,417.52	12,953,166.00	410,615,362.20	1.94	71,383,896.56
8	股票	600518	康美药业	412,253,632.74	22,000,396.00	390,067,021.08	1.85	-20,800,707.80
9	股票	601166	兴业银行	354,484,377.82	20,174,841.00	348,016,007.25	1.65	-53,390,537.67
10	股票	600519	贵州茅台	312,286,294.43	1,256,923.00	323,846,210.95	1.53	7,868,714.52
期末持有的其他证券投资				14,460,268,538.68	/	15,083,938,178.17	71.46	8,233,500.46
报告期已出售证券投资损益				/	/	/	/	4,905,656,118.41
合计				20,091,482,452.32	/	21,111,806,645.91	100%	4,756,639,873.98

证券投资情况的说明

- 1、本表按期末账面价值占公司期末证券投资总额的比例排序，填列公司期末所持前十只证券情况。
- 2、本表所述证券投资是指股票、权证、可转换债券等投资。其中，股票投资填列公司在交易性金融资产中核算的部分。
- 3、其他证券投资指：除前十只证券以外的其他证券投资。
- 4、报告期损益，包括报告期公司因持有该证券取得的投资收益及公允价值变动损益。

(2) 持有其他上市公司股权情况

√适用 □不适用

单位：元

证券代码	证券简称	最初投资成本	期初持股比例(%)	期末持股比例(%)	期末账面值	报告期损益	报告期所有者权益变动	会计核算科目	股份来源
002581	万昌科技	105,573,468.01	4.8308	4.8308	897,668,000.00	0.00	665,108,000.00	可供出售金融资产	购买
000008	神州高铁	189,384,297.88	2.4703	3.8762	836,492,979.44	0.00	550,817,981.56	可供出售金融资产	购买
002517	泰亚股份	63,412,680.00	-	2.2624	169,920,000.00	0.00	106,507,320.00	可供出售金融资产	购买
002707	众信旅游	39,999,960.16	-	0.7048	138,656,065.92	98,087.20	98,656,105.76	可供出售金融资产	购买
000601	韶能股份	44,472,226.75	-	0.4651	46,986,555.00	28,432,420.72	2,514,328.25	可供出售金融资产	购买
600282	南钢股份	42,950,045.24	-	0.1806	44,030,000.00	-1,364,064.84	1,079,954.76	可供出售金融资产	购买
002701	奥瑞金	28,168,647.54	-	0.1294	33,058,100.00	11,737,094.43	4,889,452.46	可供出售金融资产	购买
000826	桑德环境	24,136,754.04	0.0047	0.0782	25,737,518.67	-8,720,902.59	1,649,497.16	可供出售金融资产	购买
601328	交通银行	15,350,141.60	0.0027	0.0027	16,480,000.00	940,264.13	882,302.63	可供出售金融资产	购买

600030	中信证券	15,454,884.70	-	0.0050	16,146,000.00	-437,007.16	691,115.30	可供出售金融资产	购买
	其他	152,615,751.57	/	/	182,454,202.61	142,311,806.39	21,175,216.76	可供出售金融资产	购买
合计		721,518,857.49	/	/	2,407,629,421.64	172,997,698.28	1,453,971,274.64	/	/

持有其他上市公司股权情况的说明

- 1、本表填列公司在可供出售金融资产中核算的持有其他上市公司股权情况。
- 2、报告期损益指：该项投资对公司本报告期合并净利润的影响。

(3) 持有非上市金融企业股权情况

√适用 □不适用

所持对象名称	最初投资金额（元）	期初持股比例（%）	期末持股比例（%）	期末账面价值（元）	报告期损益（元）	报告期所有者权益变动（元）	会计核算科目	股份来源
华泰联合证券	1,224,096,481.63	98.58	99.10	1,235,995,139.63	274,772,291.27	-15,209,837.65	长期股权投资	出资购入
华泰期货	491,998,085.65	60.00	60.00	491,998,085.65	51,454,227.11	2,182,308.79	长期股权投资	出资购入
南方基金	253,800,000.00	45.00	45.00	1,414,312,548.43	155,569,517.24	34,418,981.96	长期股权投资	出资购入
华泰柏瑞	101,200,000.00	49.00	49.00	297,592,489.44	45,432,903.21	8,770,501.59	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	6.16	6.16	4,282,922,777.00	51,200,000.00	816,851,385.00	可供出售金融资产	出资购入
华泰金控（香港）	827,472,700.00	100.00	100.00	827,472,700.00	155,579,994.45	3,217,193.59	长期股权投资	出资成立
华泰紫金投资	600,000,000.00	100.00	100.00	2,350,000,000.00	8,237,250.93	441,159,783.61	长期股权投资	出资成立
金浦产业投资基金管理有限公司	12,000,000.00	10.00	10.00	12,000,000.00	3,000,000.00	-	可供出售金融资产	出资购入
华泰资管公司	300,000,000.00	100.00	100.00	300,000,000.00	347,483,058.42	1,565,499.85	长期股权投资	出资成立
合计	5,110,567,267.28	/	/	11,212,293,740.15	1,092,729,242.63	1,292,955,816.74	/	/

持有非金融企业股权情况的说明

- 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。

(4) 买卖其他上市公司股份的情况

股份名称	期初股份数量（股）	报告期买入股份数量（股）	使用的资金数量（元）	报告期卖出股份数量（股）	卖出股份收到的资金数额（元）	期末股份数量（股）	产生的投资收益（元）
AVIC Joy Holdings HK Ltd	0.00	300,000,000.00	47,316,600.00	101,000,000.00	47,366,754.87	199,000,000.00	31,436,832.87
民生银行	35,218,281.00	200,912,028.00	2,069,426,341.36	108,128,805.00	1,104,569,465.61	128,001,504.00	28,949,855.06
农业银行	16,533,614.00	138,554,108.00	512,277,622.69	121,658,538.00	460,305,980.60	33,429,184.00	7,551,583.12
交通银行	12,448,548.00	97,561,851.00	692,745,325.24	81,815,823.00	592,758,769.66	28,194,576.00	26,320,115.59

光大银行	12,509,247.00	94,388,829.00	482,116,800.46	79,804,571.00	417,983,527.77	27,093,505.00	17,890,912.99
------	---------------	---------------	----------------	---------------	----------------	---------------	---------------

报告期内卖出申购取得的新股产生的投资收益总额100,500,882.32元。

买卖其他上市公司股份的情况的说明：

上表数据为公司买卖上市公司股票前五名情况。

2、委托理财和委托贷款情况

报告期内，公司不存在委托理财和委托贷款情况。

3、募集资金使用情况

(1) 募集资金总体使用情况

①A股募集资金总体使用情况

经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复》（证监许可[2010]138号）核准，本公司于2010年2月9日向社会公众公开发行人民币普通股股票784,561,275股，每股面值1.00元，每股发行价格20.00元，共募集资金人民币15,691,225,500.00元。扣除承销费和保荐费130,000,000.00元后的募集资金为人民币15,561,225,500.00元，上述募集资金于2010年2月12日全部到位，并经江苏天衡会计师事务所有限公司以“天衡验字（2010）009号”验资报告验证。截至2012年12月31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156.810亿元（含募集资金利息11,980.82万元），公司募集资金专用账户已全部办理销户结息手续。

②H股募集资金总体使用情况

经中国证监会核准，本公司于2015年完成H股股票发行，H股募集资金已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具毕马威华振验字第1501031号验资报告。

根据毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）出具的《验资报告》，公司2015年首次公开发行H股共募集资金净额折合人民币30,015,054,696.76元（扣除相关发行费用）。

截至2015年6月30日，公司累计使用募集资金折合人民币13,331,187,815.20元，其中，人民币9,079,682,345.52元用于融资融券、股票质押等资本中介业务；人民币3,001,505,469.68元用于套利等程序化投资交易业务；人民币1,250,000,000.00元用于增资华泰紫金投资。尚未使用的募集资金折合人民币16,683,866,881.56元。

本公司H股募集资金计划投向与招股说明书披露的内容一致，目前没有发生变更。报告期后，公司将根据发展战略，市场状况及H股募集资金使用计划，陆续将H股募集资金投入使用。

√适用□不适用

单位:万元 币种:人民币

募集年份	募集方式	募集资金总额	本报告期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金用途及去向
2015年	首次发行（H股）	3,001,505.47	1,333,118.78	1,333,118.78	1,668,386.69	用于拓展融资融券等资本中介业务/用于向华泰紫金投资和华泰资管公司增资/用于

						拓展海外业务/用于营运资金和其他一般企业用途
2010年	首次发行（A股）	1,556,122.55	--	1,568,103.37	--	--
合计	/	4,557,628.02	1,333,118.78	2,901,222.15	1,668,386.69	/
募集资金总体使用情况说明			--			

注：A股募集资金总体使用情况中，累计投入募集资金总额超出原募集资金总额11,980.82万元为募集资金专户产生的利息收入。

(2) 募集资金承诺项目情况

√适用 □不适用

单位:万元 币种:人民币

承诺项目名称	是否变更项目	募集资金拟投入金额	募集资金报告期投入金额	募集资金累计实际投入金额	是否符合计划进度	项目进度
用于拓展融资融券等资本中介业务	否	1,800,903.27	907,968.23	907,968.23	是	50.42%
用于拓展投资和交易业务	否	300,150.55	300,150.55	300,150.55	是	100%
用于向华泰紫金投资和华泰资管公司增资	否	300,150.55	125,000.00	125,000.00	是	41.65%
用于拓展海外业务	否	300,150.55	--	--		--
用于营运资金和其他一般企业用途	否	300,150.55	--	--		--
合计	/	3,001,505.47	1,333,118.78	1,333,118.78	/	/
募集资金承诺项目使用情况说明			--			

(3) 募集资金变更项目情况

□适用 √不适用

4、主要子公司、参股公司分析

(1) 华泰联合证券有限责任公司，注册资本人民币99,748.00万元，华泰证券持有其99.10%的股权(持有的股权比例于2015年7月22日由99.10%变更为99.72%)。截至2015年6月30日，华泰联合证券总资产619,115.32万元，净资产543,106.53万元；2015年上半年实现营业收入78,817.34万元，利润总额36,478.48万元，净利润27,809.00万元。

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、金融债券承销业务除外）；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它业务。

(2) 华泰期货有限公司，注册资本人民币80,900.00万元，华泰证券持有其60.00%的股权。截至2015年6月30日，华泰期货总资产1,549,119.03万元，净资产115,719.10万元；2015年上半年实现营业收入139,180.42万元，利润总额11,167.52万元，净利润8,575.70万元。

主营业务：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。

(3) 华泰金融控股(香港)有限公司, 实收资本港币100,000.00万元, 华泰证券持有其100.00%的股权。截至2015年6月30日, 华泰金控(香港)总资产人民币475,182.25万元, 净资产人民币90,828.90万元; 2015年上半年实现营业收入人民币28,571.96万元, 利润总额人民币15,558.00万元, 净利润人民币15,558.00万元。

主营业务: 投资银行业务(股票承销、债券承销、私募配售、财务顾问、并购、结构融资及投资)、销售及交易业务(为股票、固定收益产品、信用、期货合约及结构产品等各类证券及期货产品提供交易及做市服务;为客户设计满足其需求的金融产品)及市场进入方案;为代理业务项下的证券提供融资服务)和资产管理业务。

(4) 华泰紫金投资有限责任公司, 注册资本人民币235,000.00万元, 华泰证券持有其100.00%的股权。截至2015年6月30日, 华泰紫金投资总资产580,274.92万元, 净资产309,213.64万元; 2015年上半年实现营业收入3,993.64万元, 利润总额1,626.32万元, 净利润1,244.49万元。

主营业务: 股权投资(自有资金或客户资金), 债权投资, 投资于与股权投资、债权投资相关的其他投资基金;股权投资、债权投资的投资顾问、投资管理, 财务顾问服务。

(5) 江苏股权交易中心有限责任公司, 注册资本人民币20,000.00万元, 华泰证券持有其52.00%的股权。截至2015年6月30日, 江苏股权交易中心总资产22,057.89万元, 净资产20,723.16万元; 2015年上半年实现营业收入1,267.02万元, 利润总额529.62万元, 净利润400.39万元。

主营业务: 为非上市公司股权、债券、资产和相关金融及其衍生品的批准募集挂牌、登记、托管、交易、融资、结算、过户、分红、质押等提供场所、设施和服务, 组织和监督交易市场活动, 发布市场信息, 代理本交易市场内挂牌产品买卖服务, 为市场参与方提供咨询服务。

(6) 华泰创新投资有限公司, 注册资本人民币50,000.00万元, 华泰证券持有其100.00%的股权。截至2015年6月30日, 华泰创新投资有限公司总资产62,149.15万元, 净资产57,046.15万元; 2015年上半年实现营业收入5,536.34万元, 利润总额2,464.05万元, 净利润1,591.62万元。

主营业务: 项目投资;投资管理;资产管理;投资咨询;企业管理咨询;财务咨询;酒店管理;货物进出口;技术进出口;销售有色金属、贵金属及其制品、金属材料、金属矿石、非金属矿石、建筑材料、燃料油、化工产品、橡胶制品、煤炭、玻璃、沥青、农畜产品、饲料、食用油、珠宝首饰、工艺品;收购黄金制品;收购白银制品。

(7) 华泰证券(上海)资产管理有限公司, 注册资本人民币30,000.00万元, 华泰证券持有其100.00%的股权。截至2015年6月30日, 华泰资管公司总资产78,270.09万元, 净资产64,911.41万元; 2015年上半年实现营业收入57,692.60万元, 利润总额46,331.07万元, 净利润34,748.31万元。

主营业务: 证券资产管理业务(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)。

(8) 南方基金管理有限公司, 注册资本人民币30,000.00万元, 华泰证券持有45.00%的股权。截至2015年6月30日, 南方基金总资产500,573.61万元, 净资产334,102.32万元; 2015年上半年实现营业收入144,079.97万元, 利润总额53,942.09万元, 净利润39,466.53万元。

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。

(9) 华泰柏瑞基金管理有限公司, 注册资本人民币20,000.00万元, 华泰证券持有其49.00%的股权。截至2015年6月30日, 华泰柏瑞总资产72,028.59万元, 净资产

60,733.16万元；2015年上半年实现营业收入28,516.95万元，利润总额12,138.45万元，净利润9,272.02万元。

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（涉及许可证经营的凭许可证经营）。

5、非募集资金项目情况

☐适用 ☒不适用

报告期内，公司不存在项目投资总额超过公司上年度末经审计净资产10%的非募集资金投资项目。

6、可能面对的风险及风险防范措施

针对公司自身特点，遵循关联性原则和重要性原则，可能对公司未来发展战略和经营目标以及业务经营活动产生不利影响的重大风险因素主要有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、信息技术风险等。具体分析如下：

（1）市场风险

报告期内，公司面对的市场风险主要有两方面，一是由于市场因素变化导致公司日常经营潜在亏损的风险，主要体现在市场交易量、经纪业务市场占有率、佣金率、资产管理业务规模等因素的变动对公司盈利状况的影响；二是由于市场价格如股价、利率、汇率等变化导致公司资产、自营头寸或资产管理产品、组合潜在亏损的风险，主要体现在证券公司自营业务和资产管理业务等投资相关业务中。

报告期内，公司采取了多项措施以防范市场风险。权益类证券投资方面，公司进一步加强对宏观经济的研究，稳健参与市场投资，合理配置资产规模，灵活控制投资品种比重，积极使用风险对冲工具，分散投资以降低风险；固定收益类证券投资方面，公司积极跟踪国家货币政策动向，密切关注市场利率走势，严格控制债券投资久期和杠杆率；数量化投资方面，积极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。

（2）信用风险

报告期内，公司面临的信用风险主要包括四类：一是在债券交易业务中，发债企业违约或交易对手违约造成的风险；二是在融资融券、约定购回、股票质押等信用业务中，客户违约致使借出资券及利息遭受损失的风险；三是在信用类创新业务中，融资方违约导致自有资金或客户资金遭受损失的风险；四是除债券投资外的固定收益类金融资产及衍生金融资产的违约风险，即交易对手方出现违约，导致资产遭受损失的风险。

对于债券交易中的信用风险，报告期内公司重点加强对发债主体和债券的研究，完善信用风险评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质；对交易对手信用状况进行评估，研究完善交易对手池，防范交易对手违约风险。融资融券、约定购回、股票质押式报价回购业务方面，公司重点加强客户适当性管理，通过征信评级全面了解客户资信水平和风险承受能力，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；进一步加强对融出资券履约保障比例的监控，发现异常时及时与客户沟通反馈，避免客户违约给公司造成损失。信用类创新业务方面，业务人员加强前期尽职调查，提交全面的项目可行性分析报告、尽职调查报告，经公司评审通过后，项目才可实施。公司除现金以外的货币资金主要存放于信用良好的金融机构，预期不会因为对方违约而给公司造成损失；公司开展的衍生品交易的交易对手均为国内信用良好的金融机构，并受到授信额度的限制。

（3）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，导致自营投资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，或资产管理产品由于流动资金不足无法应付客户大规模赎回的风险。

自营业务方面，报告期内公司密切关注市场变化，动态调整资产配置，合理控制各品种证券的投资规模，避免投资过于集中，确保投资组合的流动性。资产管理业务方面，公司加强对客户赎回资金的分析，通过保留部分现金类资产比例、大额赎回预警等措施，合理安排各资产管理计划的流动性。公司自有资金方面，公司重点做好自有资金的合理安排和负债管理，保障公司日常的稳健运行。

（4）操作风险

公司面临的操作风险主要包括由不完善或有问题的内部程序、人员、系统及外部事件所造成财务或其他损失的风险，可能造成的损失类别主要包括资产损失、对外赔偿、账面减值、监管罚没、法律成本等。

报告期内，公司通过多种措施防范或降低操作风险。一是风险管理部门全程参与创新类业务及传统业务的操作风险评估及制度流程制定，针对操作风险点制定相应的控制措施并通过系统或流程予以固化；二是将操作风险及控制自我评估与内控自评有效结合，加大对操作风险点的识别评估维度和深度；三是操作风险管理系统上线运行，通过系统可实现风险与控制自我评估及缺陷整改跟踪、操作风险损失事件上报与收集、关键风险指标填报及监控等工作。

（5）合规风险

合规风险是指因证券公司的业务活动或工作人员的行为违反法律、法规或规则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、自律处分、遭受财产损失或声誉损失的风险。

报告期内，公司根据管理需要进一步调整完善合规管理组织架构及制度体系，完成23家分公司的合规风控集中工作，有效提升业务一线合规风险管控能力；加大合规检查力度，日常检查与专项检查相结合，做到合规检查既有覆盖又有重点，并根据检查结果有针对性地提出改进建议及整改方案，督促相关业务部门及分支机构及时落实完善；构建多层次、多样化合规培训体系，提升合规培训频次，拓宽合规培训覆盖范围，力求将监管要求及合规理念渗透到各级从业人员的思想中，促使各项业务在合规前提下稳健发展；加大合规考核问责力度，对违法违规行为进行严格问责，进一步提升合规风控工作的权威性和有效性，为合规管理制度的有效实施提供重要保障。公司继续严格执行合规咨询、合规审查、合规监督等各项合规管理机制，并按照有效管理利益冲突、防范洗钱风险的原则，高度重视信息隔离墙和反洗钱工作，促进各项业务规范有序发展。

（6）信息技术风险

公司的各项业务以及中后台管理均高度依赖于信息技术系统的支持，信息系统已成为支撑公司各项业务运转的关键设施。信息技术风险主要指证券公司信息系统发生各类技术故障或数据泄漏，导致信息系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面不能保障交易与业务管理稳定、高效、安全地进行，从而给证券公司带来一定的损失。

报告期内，公司不断加大信息技术的投入，逐步建立面向业务条线的专业化信息技术服务管理体系，进一步提高了信息系统建设与安全管理水平，确保公司各运营管理支撑信息系统的安全性、可靠性和稳定性，有效防范了信息技术风险。

二、利润分配或资本公积金转增预案

(一) 报告期实施的利润分配方案的执行或调整情况

公司《章程》第二百五十五条明确了公司利润分配政策、公司利润分配方案的决策程序和公司利润分配政策调整的决策程序等。公司利润分配政策为：“公司重视对投资者的合理投资回报，执行持续、稳定的利润分配政策；公司利润分配不得超过累计可分配利润的范围，不得损害公司持续经营能力；公司可以采用现金、股票以及现金与股票相结合的方式分配股利，除公司在未来十二个月内计划进行重大投资或重大现金支出等可能导致公司不符合净资本监管要求的特殊情况外，公司在当年盈利且累计未分配利润为正的情况下，采取现金方式分配股利，公司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30%，经公司董事会提议，股东大会批准，也可以进行中期现金分红；公司根据年度盈利情况及现金流状况，在保证最低现金分红比例和公司股本规模合理的前提下，可以采取股票方式分配股利。”

报告期内，公司不存在资本公积金转增股本方案的执行或调整情况。报告期内，公司实施的利润分配方案的执行情况如下：

2014年度利润分配方案的执行情况：公司实现归属于上市公司股东的净利润为4,486,276,132.08元，经公司2014年年度股东大会审议批准，以2014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5.00元（含税），共计分配现金红利2,800,000,000.00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62.41%。

公司利润分配政策特别是现金分红政策的制定及执行情况符合证券行业有关规定，符合公司《章程》的规定，符合公司股东大会决议要求，分红标准和分红比例明确和清晰，相关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。公司利润分配政策调整或变更的条件和程序合规、透明。

(二) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
每10股送红股数（股）	--
每10股派息数(元)（含税）	--
每10股转增数（股）	--
利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明	
公司董事会在审议半年度报告时，未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。	

三、 其他披露事项

(一) 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及说明

☐适用 ☒不适用

(二) 董事会、监事会对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

☐适用 ☒不适用

(三)其他披露事项

2014年度，公司根据财政部新颁布/修订的《企业会计准则第2号——长期股权投资》等八项企业会计准则变更了相关会计政策，报告期内，公司对比较财务报表进行了追溯重述。采用变更后的会计政策编制的2014年1-6月合并利润表的各项目增减情况如下：

会计科目	本集团		
	调整前	调整数	调整后
手续费及佣金收入	2,357,671,496.16	-213,590,599.70	2,144,080,896.46
利息净收入	658,657,926.99	327,434,998.77	986,092,925.76
投资收益	873,620,638.20	-129,428,299.18	744,192,339.02
公允价值变动损益	399,729,072.71	63,846,343.08	463,575,415.79
其他业务收入	28,409,189.29	1,652,011.36	30,061,200.65
业务及管理费	2,092,763,697.83	-1,074,054.61	2,091,689,643.22
其他业务成本	24,172,765.78	552,535.10	24,725,300.88
所得税费用	490,933,935.06	10,909,504.78	501,843,439.84
其他综合收益	9,254,278.47	-21,119,436.08	-11,865,157.61

报告期内，公司无其他应披露而未披露的事项。

第五节 重要事项

一、重大诉讼、仲裁和媒体普遍质疑的事项

√适用 □不适用

(一)诉讼、仲裁或媒体质疑事项已在临时公告披露且无后续进展的

事项概述及类型	查询索引
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公司支付欠款总额人民币23775.36万元人民币、利息人民币2187.72万元，合计标的人民币约2.6亿元。2015年上半年，未发生新的资产与现金收回。截至2015年6月30日，应收四通集团账面金额15442.8万元，已全部计提减值准备。	可在2011至2014年年报中查询。
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3457.89万元，2011年2月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合证券欠款2430万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011年6月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判，该案目前正	可在2011至2014年年报中查询。

在执行中。	
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，华泰联合证券于2009年8月向破产清算组申报债权本息12598万元，但由于债权未经法院判决，债权待确认。2010年3月深圳中级人民法院恢复审理，一审判决结果支持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5458.4万元，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，2012年12月21日，华泰联合证券收到了北京市第二中级人民法院民事裁定书，裁定终结华诚投资管理有限公司破产程序，华诚投资管理有限公司破产程序期间华泰联合证券共获得276.44万股华纺股份股票及182.3979万元。2012年7月法院裁定华诚集团财务有限责任公司进入破产清算程序，2013年6月，破产清算管理人发出《关于审查申报债权的函》让华泰联合证券确认债权，2014年3月21日，北京市第二中级人民法院召开华诚财务债权人会议，破产管理人以“由于华泰联合证券有限责任公司否认华诚投资公司的股东身份，因此对贵公司享有的华诚财务公司的债权不予确认。”因此，华泰联合证券向北京市第二中级人民法院提起确认债权诉讼，北京市第二中级人民法院于2014年11月18日做出（2014）二中民初字第6794号判决，确认了华泰联合证券对华诚集团财务有限责任公司享有债权金额39387194.72元，后续对方未上诉，判决已生效，等待破产分配中。原工商登记在华诚集团财务有限责任公司名下的华泰联合证券252万股无效出资，经履行减资程序，并经中国证券监督管理委员会深圳监管局核准同意，已经办理完毕工商变更登记手续。华诚集团财务有限责任公司对此有异议，以股权转让纠纷为由起诉至北京市第二中级人民法院，此案正在审理过程中。	可在2011至2014年年报中查询。

(二)临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

报告期内:									
起诉 (申 请)方	应诉 (被申 请)方	承担 连带 责任 方	诉讼 仲裁 类型	诉讼 (仲 裁)基 本情 况	诉讼(仲裁)涉 及金额	诉讼 (仲 裁)是 否形 成预	诉讼 (仲 裁)进 展情 况	诉讼 (仲 裁)审 理结 果及	诉讼 (仲 裁)判 决执 行情

						计负 债及 金额		影响	况
华泰 期货	张晓 东		债权 债务 纠纷	见表 下概 述	22,639,786.41	否	执行 阶段	见表 下概 述	见表 下概 述
华泰 联合 证券	中国 原子 能工 业有 限公 司		合同 纠纷	见表 下概 述	9,500,000.00	否	起诉		

1、华泰期货公司客户张晓东期货账户于2013年4月16日发生重大穿仓事件，穿仓金额为人民币22,639,786.41元。由于张晓东未能偿还华泰期货代其垫付的穿仓损失款，华泰期货于2013年12月27日向上海市第一中级人民法院对张晓东提起民事诉讼，要求张晓东赔偿华泰期货代其垫付的穿仓损失并承担全部的诉讼费用。上海市第一中级人民法院于2014年5月29日开庭审理，并于6月25日下达判决书【(2014)沪一中民六(商)初字第1号】，依法判决被告张晓东应于本判决生效之日起十日内偿还原告华泰期货人民币22,639,786.41元，并支持了华泰期货要求张晓东负担案件受理费的请求。华泰期货于2014年11月11日向上海市第一中级人民法院申请强制执行客户张晓东穿仓欠款，目前该案正在执行过程中。关于该案件申请财产执行的情况，华泰期货于2015年6月底收到河南省三门峡市中级人民法院执行裁定书：因被执行人暂无履行债务能力，本案未能有效执结，法院终结本次执行程序。华泰期货如发现被执行人有可供执行的财产，可随时向法院申请恢复执行。根据相关财务制度规定，此笔客户穿仓已于2103年度计入“应收风险损失款”处理。华泰期货根据期货行业财务管理相关规定计提期货风险准备，此笔客户穿仓不需要再计提坏账准备。

2、中国原子能工业有限公司名下现有华泰联合证券200万股权，诉讼标的额为950万元。2014年12月23日，北京市西城区人民法院依法受理华泰联合证券诉中国原子能工业有限公司合同纠纷一案，目前此案正在审理过程中。

(三) 临时公告未披露或有后续进展的媒体普遍质疑事项

报告期内，公司无临时公告未披露或有后续进展的媒体普遍质疑事项。

(四) 公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

1、报告期内，公司于2015年4月3日收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令限期改正措施的决定》（[2015]38号），主要内容为：“经查，你公司在开展融资融券业务过程中，存在向在你公司及与你公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年的客户融资融券、向缺乏风险承担能力的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条、第十四条的规定和《证券公司监督管理条例》第二十九条、第三十条的规定，反映出你公司内部控制不完善，根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，对你公司采取责令限期改正的措施。你公司应当进一步梳理相关业务流程，强化有关人员合规守法意识，并在决定书作出之日起

1个月内完成整改”。

2、报告期内，公司于2015年4月24日收到安徽证监局《关于对华泰证券股份有限公司合肥长江东大街证券营业部采取出具警示函措施的决定》（[2015]1号），主要内容为：“经查，我局发现你部为1名在你公司从事证券交易时间不足半年的客户开立融资融券账户，并与该客户签订《保证书》，承诺提供他人信用账户供其使用（未实际使用）。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条、《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的相关规定，表明你营业部内部控制不完善。依据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你营业部采取出具警示函的监督管理措施。你营业部应严格按照有关法律法规要求，加强业务开展中的合规管理和内部控制，对客户账户的管理情况和融资类业务开展情况全面自查，规范经营行为，保证客户账户安全。”

二、破产重整相关事项

☐适用 ☒不适用

三、资产交易、企业合并事项

☐适用 ☒不适用

四、公司股权激励情况及其影响

☐适用 ☒不适用

五、重大关联交易

☒适用 ☐不适用

（一）与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

（1）佣金收入

关联方	关联交易内容	2015年1-6月	2014年1-6月
		金额（元）	金额（元）
南方基金	基金分仓及尾随佣金和销售服务费	24,077,646.66	7,113,959.58
华泰柏瑞基金	基金分仓及尾随佣金和销售服务费	30,402,845.86	2,725,634.05
江苏国信	证券代理买卖交易佣金	1,831,539.02	21,502.38
江苏交通控股有限公司	证券代理买卖交易佣金	18,179.70	-
江苏苏豪控股集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	120,044.12	226,133.04
江苏高科技投资集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	32,392.03	4,768.38
南方基金	证券代理买卖交易		

	佣金	4,000.00	18,783.92
华泰柏瑞	证券代理买卖交易佣金		288.18

(2) 关联租赁情况

单位：元

出租方名称	承租方名称	租赁资产种类	2015年1-6月 本期确认租赁费	2014年1-6月 确认租赁费
江苏国信	华泰证券徐州青年路证券营业部	房屋建筑物	-	1,137,713.52

单位：元

承租方名称	出租方名称	租赁资产种类	2015年1-6月 确认租赁收入	2014年1-6月 确认租赁收入
南方基金	华泰证券	房屋建筑物	552,194.28	552,194.28
华泰柏瑞	华泰证券	设备租赁	50,000.00	-

(3) 与关联方相关取得的投资收益

单位：元

关联方	关联交易内容	2015年1-6月	2014年1-6月
南方基金	南方现金B红利	2,357,728.60	1,482,859.45
	南方薪金宝红利	53,029.06	-
	南方现金通货币A红利	-	197,203.36
	理财金H红利	1,030,294.64	-
	南方利鑫混合红利	1,000.00	
华泰柏瑞	股利分红	-	19,600,000.00
	柏瑞货币B红利	3,777,108.68	-
	华泰柏瑞量化红利	1,000.00	
江苏金苏证投资发展有限公司	权益互换投资收益	-	-123,410.60

(4) 本公司认购关联方管理的基金情况

关联方	认购基金名称	2015年6月				
		年初持有份额 (万份)	本期新增份 额(万份)	本期减少 份额(万 份)	期末持有 份额(万 份)	期末余额 (万元)
南方基金	深成ETF	99.00		66.00	33.00	49.20
	中国梦	999.9		999.90	-	-
	中证500ETF	2,817.95		2,800.00	17.95	36.92
	南方恒指EF	500		500.00	-	-
	南方现金B	110,000.00		107,990.15	2,009.85	2,009.85
	南方薪金宝	3,061.81		3,061.81	-	-
	南方利鑫混合		17,946.06		17,946.06	18,125.52
	理财金H		52.87		52.87	5,286.82

	南方多利增强A		885.10		885.10	995.21
华泰柏瑞	华泰柏瑞增利	3,000.13		3,000.13		
	华泰柏瑞沪深300ETF	26,947.58		25,274.42	1,673.16	7,502.45
	华泰柏瑞上证红利ETF	154.52		126.00	28.52	101.13
	华泰柏瑞量化		2,155.10		2,155.10	4,202.45
	华泰柏瑞货币B	25,594.98		9,621.01	15,973.97	15,973.97

2、临时公告未披露事项

关联方	关联关系	关联交易内容	2015年1-6月	2014年1-6月
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	联营公司	收取基金管理费	20,000,000.00	20,000,000.00
		长期股权投资	193,000,000.00	
		集合资管计划	301,643,360.00	

(二)关联债权债务往来

1、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

(1) 应收关联方款项

单位：元

项目名称	关联方	2015年6月末余额		2015年年初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
基金分仓佣金	华泰柏瑞	22,452,894.93	112,264.47	5,218,983.99	15,656.95
基金分仓佣金	南方基金	14,771,566.57	73,857.83	8,957,462.22	26,872.39
基金产品分红	华泰柏瑞	412,329.65	-		
基金公司分红	南方基金	135,000,000.00	-		

(2) 应付关联方款项

单位：元

项目名称	关联方	2015年6月末余额	2015年年初余额
其他应付款项	江苏国信	3,211,190.78	3,211,190.78
代理买卖证券款	江苏国信	171,268.61	171,046.15
代理买卖证券款	江苏交通控股有限公司	674,453.13	3,093.74
代理买卖证券款	南方基金	20,938.22	11,332.59
代理买卖证券款	华泰柏瑞	725.81	3,204.81
代理买卖证券款	江苏高科技投资集团有限公司	2,641.69	-
代理买卖证券款	江苏苏豪控股集团有限公司	24,000,100.15	100.00

2、临时公告未披露的事项

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	关联	向关联方提供资金	关联方向上市公司
-----	----	----------	----------

	关系				提供资金		
		期初 余额	发生额	期末 余额	期初 余额	发生额	期末 余额
华泰紫金（江苏）股权投资 基金（有限合伙）	联营 公司					303,743,444.31	303,743,444.31
合计						303,743,444.31	303,743,444.31
报告期内公司向控股股东及其子 公司提供资金的发生额（元）							0
公司向控股股东及其子公司提供 资金的余额（元）							0
关联债权债务形成原因		合并结构化主体形成的其他金融负债					

六、重大合同及其履行情况

1 托管、承包、租赁事项

☐适用 ☒不适用

2 担保情况

☐适用 ☒不适用

3 其他重大合同或交易

合同名 称	合同双 方名称	签订 日期	合同标的所涉及资产					交易价 格	执行情况
			账 面 价 值	评 估 价 值	评 估 机 构 名 称	评 估 基 准 日	定 价 原 则		
华泰证 券广场 施工总 承包合 同	华泰证 券股份 有限公司与中国江苏 国际经 济技术 合作公 司	2010 年7 月30 日						113285. 18万元	2010年7月，公司与中国江苏国际经济技术合作公司签订了《华泰证券广场施工总承包合同》。报告期内该合同正常履行，报告期内，公司已按约支付总承包及其分包合同价款5169.296403万元。截止报告期末，公司已按约累计支付总承包合同价款68102.01031万元。
华泰证 券广场 智能化 施工合 同	华泰证 券股份 有限公司与上海浩德 科技股 份有限	2012 年3 月6 日						19889.9 7万元	2012年3月，公司与上海浩德科技股份有限公司签订了《华泰证券广场智能化施工合同》。报告期内该合同正常履行，公司已按约支付智能化施工合同价款6227.923696万元。截止报

	公司								告期末,公司已按约累计支付智能化施工合同价款16131.02739万元。
华泰证券广场室内装饰装修二标段工程施工合同	华泰证券股份有限公司与浙江亚厦装饰股份有限公司	2013年5月21日						11758.45万元	2013年5月21日,公司与浙江亚厦装饰股份有限公司签订了《华泰证券广场室内装饰装修二标段工程施工合同》。报告期内该合同正常履行,公司已按约支付内装饰装修二标段工程施工合同价款2074.076886万元。截止报告期末,公司已按约累计支付内装饰装修二标段工程施工合同价款3984.56813万元。
华泰证券广场室内装饰装修一标段工程施工合同	华泰证券股份有限公司与中国建筑集团有限公司	2013年5月21日						7877.18万元	2013年5月21日,与中国建筑集团有限公司签订了《华泰证券广场室内装饰装修一标段工程施工合同》。报告期内该合同正常履行,公司已按约支付内装饰装修一标段工程施工合同价款1603.151354万元。截止报告期末,公司已按约累计支付内装饰装修一标段工程施工合同价款2342.696703万元。
华泰证券广场工程内装三标段施工合同	华泰证券股份有限公司与深圳市深装总装饰工程工业有限公司	2013年10月						13158.63043万元	2013年10月,公司与深圳市深装总装饰工程工业有限公司签订了《华泰证券广场工程内装三标段施工合同》。报告期内该合同正常履行,公司已按约支付内装三标段施工合同2550.905148万元。截止报告期末,公司已按约累计支付内装三标段施工合同价款7399.02004万元。
招行融资业务债权收益权转让及回购合同	华泰证券与招商银行股份有限公司	2014年2月24日						100000万元	2014年2月公司与招商银行股份有限公司签订了融资业务债权收益权转让及回购合同,报告期内履行完毕。
兴业财富资产管理有限公司与华泰证券关	华泰证券与兴业财富资产管理有限公司	2014年8月15日						1050000万元	2014年8月公司与兴业财富资产管理有限公司签订了融资业务债权收益权转让及远期受让合同,在报告期内有800000万元履行完毕,剩余250000万元正常履行。

于金融资产 债权收益 权转让及 远期受让 合同									
招商银行 股份有限 公司与华 泰证券关 于融资业 务债权收 益权转让 及回购合 同	招商银 行股份 有限公 司与华 泰证券	2014 年8 月15 日						410000 万元	2014年8月公司与招商银行 股份有限公司签订了融资 业务债权收益权转让及远 期受让合同，在报告期内履 行完毕。
博时资 本管理 有限公 司与华 泰证券 关于融 资业务 债权收 益权转 让及远 期受让 合同	华泰证 券与博 时资本 管理有 限公司	2014 年9 月19 日						500000 万元	2014年9月公司与博时资本 管理有限公司签订了融资 业务债权收益权转让及远 期受让合同，在报告期内分 期完成受让，正常履行。

七、承诺事项履行情况

√适用 □不适用

(一) 上市公司、持股5%以上的股东、控股股东及实际控制人在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行
其他承诺	解决同业竞争	江苏国信	江苏国信及附属公司或者附属企业在今后的任何时间不会以任何方式（包括但不限于自营、合资或联营）参与或进行与华泰证券主营业务存在竞争的业务活动（锦泰期货有限公司除外）。凡江苏国信及附属公司或者附属企业有任何商	承诺出具日：2014年6月27日；到期日：长期	否	是

			业机会可从事、参与或入股任何可能会与华泰证券生产经营构成竞争的业务，江苏国信会将上述商业机会让予华泰证券（锦泰期货有限公司除外）。			
--	--	--	---	--	--	--

八、聘任、解聘会计师事务所情况

√适用 □不适用

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

经公司2014年度股东大会审议批准，公司继续聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为公司及控股子公司2015年度会计报表和内部控制审计服务机构，审计服务费不超过200万元。

九、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、持有5%以上股份的股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况

√适用 □不适用

（一）报告期内公司被中国证监会及其派出机构处罚及整改情况

1、报告期内，公司于2015年4月3日收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令限期改正措施的决定》（[2015]38号），主要内容为：“经查，你公司在开展融资融券业务过程中，存在向在你公司及与你公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年的客户融资融券、向缺乏风险承担能力的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条、第十四条的规定和《证券公司监督管理条例》第二十九条、第三十条的规定，反映出你公司内部控制不完善，根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，对你公司采取责令限期改正的措施。你公司应当进一步梳理相关业务流程，强化有关人员合规守法意识，并在决定书作出之日起1个月内完成整改”。

针对监管部门的决定，公司采取了相应的整改措施，具体为：

（1）组织完成了对全公司开户满半年但交易不满半年客户的情况梳理，存量客户采取了清零信用额度、限制其开新仓的措施落实限期改正，新增客户加强前端控制，全面实行“系统前端判断加人工复核”的双重控制机制，保障申请融资融券的客户符合从事证券交易的时间连续计算满半年的条件。

（2）自2015年1月19日起公司已将融资融券业务开户资产门槛统一提高到了50万元，并通过系统前端控制确保新开户客户资产符合条件；对证监会下发要求进行开户资金门槛调整前已开立信用账户并交易的客户重点加强风险评估，切实做好风险提示和客户服务。

（3）公司于2015年1月23日根据监管要求全面暂停了融资融券网上开户业务，相关营销推广及对外宣传活动也同步下线。后续公司严格按照相关法律、法规，规范审慎开展融资融券相关业务，同时加强对融资融券相关业务规范的学习，认真研究，组织培训，严格落实，对于有理解不清晰的政策法规，及时向主管部门作了请示。

相关公告于2015年4月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露。

2、报告期内，公司于2015年4月24日收到安徽证监局《关于对华泰证券股份有限公司合肥长江东大街证券营业部采取出具警示函措施的决定》（[2015]1号），主要内

容为：“经查，我局发现你部为1名在你公司从事证券交易时间不足半年的客户开立融资融券账户，并与该客户签订《保证书》，承诺提供他人信用账户供其使用（未实际使用）。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条、《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的相关规定，表明你营业部内部控制不完善。依据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你营业部采取出具警示函的监督管理措施。你营业部应严格按照有关法律法规要求，加强业务开展中的合规管理和内部控制，对客户账户的管理情况和融资类业务开展情况全面自查，规范经营行为，保证客户账户安全。”

公司收到函件后立即组织相关营业部进行了整改。营业部成立了专项整改小组，开展对营业部所有两融客户档案的合规自查，同时梳理优化营业部印章管理流程，加强营业部日常管理，强化员工合规意识，杜绝类似风险事件的再次发生。

（二）本年度公司董事、监事、高级管理人员、持有5%以上股份的股东未受中国证监会的稽查、行政处罚、通报批评及证券交易所的公开谴责。

（三）报告期内，未发生公司董事、监事、高级管理人员、持股5%以上的股东违反相关规定买卖公司股票的情形，也未发生其他涉嫌违规买卖公司股票且公司已披露将收回涉嫌违规所得收益的情形。

十、可转换公司债券情况

☐适用 ☒不适用

十一、公司治理情况

公司长期以来致力于公司治理结构和制度建设的不断完善。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》、《香港联合交易所有限公司证券上市规则》附录十四《企业管治守则》及《企业管治报告》等相关法律法规以及公司《章程》的规定，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、合规风控制度和内控管理体系，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，确保了公司的稳健经营和规范运作。

报告期内，公司经营和管理规范有序，能够严格按照法律法规和规范性文件等有关规定，制定并不断完善各项规章制度，以规范公司运作。报告期内，鉴于公司拟发行境外上市外资股（H股）并在香港联合交易所有限公司主板挂牌上市，为满足相关监管要求，公司进一步修订完善了《关联交易决策制度》、《对外担保决策制度》、《董事会专门委员会工作细则》、《总裁工作细则》、《董事会秘书工作细则》、《信息披露管理办法》、《投资者关系管理制度》、《董事、监事及高级管理人员所持本公司股份管理制度》、《内幕信息知情人登记管理及保密制度》、《会计制度》、《合规管理制度》等，同时修订完善了公司《章程》，并获得公司股东大会或董事会审批批准。报告期内，公司召开股东大会1次，董事会8次，监事会2次，董事会专门委员会会议共8次，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。报告期内，公司不断加强投资者关系管理及信息披露工作，公司投资者关系管理工作规范、专业，信息披露真实、准确、完整、及时、公平，公司透明度持续提高。

通过以上制度的建立与不断完善并有效执行，公司治理结构不断规范，公司治理水平不断提高，公司治理的实际情况与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。同时，公司严格遵守《企业管治守则》及《企业管治报告》中的所有守则条

文，达到了《企业管治守则》中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

十二、审计委员会及审计事项

公司董事会设有审计委员会，符合中国证监会、上交所的有关规定及《香港联合交易所有限公司证券上市规则》的规定。

2015年4月30日，公司董事会收到独立董事王全洲先生的书面辞职报告，因个人原因，王全洲先生辞去公司第三届董事会独立董事职务和董事会审计委员会委员及主任委员（召集人）职务。同时，公司新任独立董事李志明先生已于报告期内取得江苏证监局核准的证券公司独立董事任职资格，经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，李志明先生担任公司第三届董事会审计委员会主任委员（召集人）。

截至报告期末，公司审计委员会共3人，独立董事占1/2以上，成员包括李志明、浦宝英、刘红忠，其中李志明为审计委员会主任委员（召集人）。审计委员会主要负责本公司内、外部审计的沟通、监督及核查等工作，并向董事会提供专业意见。

报告期内，公司董事会审计委员会共召开四次会议，具体情况如下：（1）第三届董事会审计委员会2015年第一次会议于2015年1月27日以通讯方式召开，审议通过了《关于公司2014年度审计计划的议案》。（2）第三届董事会审计委员会2015年第二次会议于2015年2月17日以视频会议方式召开，审阅公司2014年度审计报告初稿，听取毕马威华振会计师事务所对公司2014年度审计等情况汇报，并与事务所相关人员进行讨论与沟通。（3）第三届董事会审计委员会2015年第三次会议于2015年3月5日在南京召开，审议通过了《关于公司2014年度财务报表的议案》、《关于预计公司2015年日常关联交易的预案》、《关于公司2014年度内部控制评价报告的议案》、《关于公司董事会审计委员会2014年年度履职情况的报告》、《关于公司续聘会计师事务所的预案》、《关于修订公司<会计制度>的预案》、《公司2015年内部审计工作计划》，并听取公司2014年度内部审计工作情况的报告。（4）第三届董事会审计委员会2015年第四次会议于2015年4月21日以通讯方式召开，审议通过了《关于公司2015年第一季度财务报表的议案》。

本次半年度财务报告未经审计。公司董事会审计委员会已审阅公司截至2015年6月30日止6个月的未经审计的半年度财务报表及半年度报告，未对公司所采纳的会计政策及常规提出异议。

十三、报告期内，本公司已采纳《标准守则》作为所有董事及监事进行本公司证券交易的行为守则。2015年3月6日，公司第三届董事会第十六次会议审议通过了公司《董事、监事及高级管理人员所持本公司股份管理制度》（以下简称《管理制度》），以加强对公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动的管理。《管理制度》与《标准守则》中的强制性规定相比更加严格。经查询，公司所有董事、监事及高级管理人员均已确认其于报告期内严格遵守了《管理制度》及《标准守则》的相关规定。

十四、其他重大事项的说明

（一）董事会对会计政策、会计估计或核算方法变更的原因和影响的分析说明

☐适用 ☒不适用

（二）董事会对重要前期差错更正的原因及影响的分析说明

☐适用 ☒不适用

(三)其他

1、报告期内证券营业部及分公司新设、迁址、撤销等变化情况

(1) 报告期内，公司无分公司新设情况。

(2) 报告期内，公司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	华泰证券江阴华士镇环东路证券营业部	江阴市华士镇环东路680号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日
2	华泰证券江阴临港新城申浦路证券营业部	江阴市申港街道申浦路108号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日
3	华泰证券江阴周庄镇西大街证券营业部	江阴市周庄镇西大街174号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日
4	华泰证券江阴青阳镇迎秀路证券营业部	江阴市青阳镇迎秀路111号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日
5	华泰证券江阴长泾镇虹桥北路证券营业部	江阴市长泾镇虹桥北路10号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日
6	华泰证券铜陵淮河大道证券营业部	安徽省铜陵市淮河大道铜陵商城汇金大厦十六层1602、1603号	苏证监机构字[2014]369号	2014年8月13日	2015年2月11日

根据江苏证监局《关于核准华泰证券股份有限公司在上海等地设立11家证券营业部的批复》（苏证监机构字[2014]369号），核准我公司在上海市、深圳市、安徽省铜陵市、安徽省滁州市、黑龙江大庆市、吉林省吉林市各设立1家营业部，在江苏省江阴市设立5家营业部。目前全部11家营业部已获得经营证券业务许可证，并已投入运营，其中安徽省铜陵市1家及江苏省江阴市5家营业部于今年2月11日获的经营证券业务许可证。

(3) 报告期内，公司证券营业部迁址情况：

序号	营业部	地址	批复文号	获得许可证日期
1	济南千佛山路证券营业部	济南市历下区千佛山路7号2号楼2层	已报备	2015年1月20日
2	汕头珠江路证券营业部	广东省汕头市龙湖区珠江路南侧兴源大厦A幢1001号09、11、13房	已报备	2015年1月16日
3	广州番禺东环路证券营业部	广州市番禺区市桥街东环路449-451号205、206、210、211	已报备	2015年3月9日
4	南京六合彤	江苏省南京市六合区雄州街道	已报备	2015年3月20日

	华街证券营业部	彤华街9号18幢18-4号		
5	扬州江都龙城路证券营业部	江苏省扬州市江都区仙女镇引江居委会龙城苑6幢22号	已报备	2015年3月20日

注：

1、经山东证监局同意，华泰证券济南山大南路证券营业部同城迁址开业，营业部名称变更为“华泰证券股份有限公司济南千佛山路证券营业部”，地址变更为济南市历下区千佛山路7号2号楼2层。

2、经广东证监局同意，华泰证券汕头长平东路证券营业部同城迁址开业，营业部名称变更为“华泰证券股份有限公司汕头珠江路证券营业部”，地址变更为广东省汕头市龙湖区珠江路南侧兴源大厦A幢1001号09、11、13房。

3、经广东证监局同意，华泰证券广州番禺繁华路同城迁址开业，营业部名称变更为“华泰证券股份有限公司广州番禺东环路证券营业部”，地址变更为广州市番禺区市桥街东环路449-451号205、206、210、211。

4、经江苏证监局同意，华泰证券南京六合板门口证券营业部同城迁址开业，营业部名称变更为“华泰证券股份有限公司南京六合彤华街证券营业部”，地址变更为江苏省南京市六合区雄州街道彤华街9号18幢18-4号。

5、经江苏证监局同意，华泰证券扬州江都东方红东路证券营业部同城迁址开业，营业部名称变更为“华泰证券股份有限公司扬州江都龙城路证券营业部”，地址变更为江苏省扬州市江都区仙女镇引江居委会龙城苑6幢22号。

(4) 分公司及证券营业部撤销情况：

序号	营业部	批复文号	批复日期	核查函日期	核查意见函
1	天津东马路证券营业部	津证监许可字[2014]53号	2014年8月27日	2015年2月3日	津证监机构字[2015]6号

注：上述营业部已经撤销完毕。

2、华泰紫金投资及下属公司工商变更、公司设立及投资

(1) 2015年6月，华泰证券决定将华泰紫金投资注册资本从11亿元人民币增加到60亿元人民币，并根据业务实际需要逐步到位。2015年6月已首批到位12.5亿元，相关工商变更手续正在办理中。

(2) 北京华泰同信投资基金管理有限公司、北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）及北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）

北京华泰同信投资基金管理有限公司成立于2014年12月29日，注册资本300万元，华泰紫金投资认缴出资153万元，占比51%。北京华泰同信投资基金管理有限公司于2015年1月15日发起设立北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙），总认缴出资额3,000万元，其中，华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资1,530万元，认缴出资占比51%。北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）于2015年6月1日发起设立北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙），其中北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）作为普通合伙人认缴出资1,000万元，华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资4.4亿元人民币，认缴出资占比44%。

3、华泰联合证券股权转让及注册资本变更

(1) 华诚投资管理有限公司无效出资处理事宜

2014年5月30日，因名义股东华诚投资公司无效出资，华泰联合证券召开了2014年第一次临时股东会，批准了《华泰联合证券有限责任公司关于通过减资处理华诚投资无效出资的议案》。2014年11月14日，深圳证监局核准华泰联合证券变更注册资本（深证局许可字【2014】174号），同意华泰联合证券注册资本拟由100,000万元变更为99,748万元。2015年5月18日完成工商变更，华泰联合证券注册资本由原来的100,000万元变成99,748万元，股东家数由原来的6家变成5家，各家股权比例相应变化。

(2) 长城计算机集团公司股权转让事宜

2014年7月14日，长城计算机集团公司所持的华泰联合证券270万元股权（占注册

资金总额0.27%) 在深圳联合产权交易所网络拍卖平台被华泰证券竞拍获得。2015年5月28日, 本次股权转让完成工商变更, 华泰联合证券股东家数由原来的5家变成4家, 华泰证券的出资额变为98,846万, 占比99.10%。

(3) 厦门建昌房地产开发有限公司股权转让事宜

2014年12月25日, 厦门建昌房地产开发有限公司给华泰联合证券发函, 拟向华泰证券转让其所持华泰联合证券的621万元股权(占出资总额0.62%)。2015年1月19日, 华泰联合证券2015年第一次临时股东会议审议通过了相关议案。2015年1月30日, 签订完成相关股权转让协议。2015年7月22日, 完成工商变更。至此, 华泰联合证券股东变成3家, 其中华泰证券持有99.72%的股权。

4、报告期内, 华泰金控(香港)公司注册成立了HTSC LIMITED、Principle Solution Group Limited、Lucid Elegant Limited、Pioneer Reward Limited、Pioneer Reward Investment Limited、Pioneer Return Limited、Pioneer Return Holdings Limited、Pioneer Festive Limited、Huatai Principal Investment I limited、Lead Talent Enterprises Limited、Huatai Principal Investment Group Limited等11家子公司。

5、报告期内, 华泰创新投资有限公司向上海自贸区全资子公司华泰瑞新(上海)投资有限公司缴纳注册资本7,000万元, 并以子公司为主体开展大宗商品相关业务。

6、公司债及次级债相关信息

(1) 公司债相关信息

债券简称	本金(单位: 元)	票面利率(%)	起息日	到期日
13华泰01	4,000,000,000.00	4.68	2013年6月5日	2018年6月5日
13华泰02	6,000,000,000.00	5.10	2013年6月5日	2023年6月5日
15华泰债01	6,600,000,000.00	4.20	2015年6月29日	2018年6月29日
合计	10,000,000,000.00			

报告期内, 公司对2013年发行的华泰证券2013年公司债券支付了自2014年6月5日至2015年6月4日期间的利息, 债券简称及代码是13华泰01(122261)、13华泰02(122262), 本次付息总金额为49,320万元(含税)。《华泰证券股份有限公司2013年公司债券2015年付息公告》于2015年5月28日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站(www.sse.com.cn)上披露。

《华泰证券股份有限公司关于2013年公司债券跟踪评级结果的公告》于2015年4月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站(www.sse.com.cn)上披露。

报告期内, 公司发行了一期期限3年金额66亿元的公司债。《华泰证券2015年公司债(第一期)发行结果》已于2015年7月2日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站(www.sse.com.cn)上披露。

本报告期不存在涉及和可能涉及影响债券按期偿付的重大诉讼事项。

本报告期未发生可能导致债券信用评级发生重大变化, 对债券按期偿付产生任何影响的事件, 也不存在相关的市场传言。

(2) 次级债存续情况

债券简称	本金(单位: 元)	票面利率(%)	起息日	到期日
14华泰02	3,000,000,000.00	6.15	2014.4.21	2016.4.21
14华泰03	2,000,000,000.00	5.70	2014.9.29	2017.9.29
14华泰04	4,000,000,000.00	5.90	2014.9.29	2018.9.29
14华泰05	4,000,000,000.00	5.10	2014.11.21	2015.11.21

15华泰01	6,000,000,000.00	5.90	2015.1.23	2017.1.23
15华泰02	7,000,000,000.00	5.60	2015.4.21	2017.4.21
15华泰03	5,000,000,000.00	5.80	2015.4.21	2020.4.21
15华泰04	18,000,000,000.00	5.50	2015.6.26	2017.6.26
合计	49,000,000,000.00			

报告期内，公司共计发行360亿元次级债，其中期限2年的长期次级债为310亿元，期限5年的长期次级债为50亿元。上述募集资金已全部用于补充公司营运资金，主要投向为扩大融资融券、股票约定购回以及股票质押式回购业务规模，上述投向符合募集说明书的要求。

报告期内，公司对2014年4月21日非公开发行的第一期次级债14华泰01（123380）进行了本息兑付，兑付金额为3,178,500,000.00元（含税）；对非公开发行的第一期次级债14华泰02（123381）支付了自2014年4月21日至2015年4月20日的利息，本期付息金额为184,500,000.00元（含税）。《华泰证券股份有限公司非公开发行2014年第一期次级债券2015年兑付、兑息公告》于2015年4月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露。

报告期内，不存在涉及和可能涉及公司次级债券本息偿付的重大投资和关联交易等事项。

报告期内，公司不存在其他对公司债券持有人有重大影响的信息。

7、短期融资券相关信息

债券简称	本金（单位：元）	票面利率（%）	起息日	到期日
14华泰证券CP011	3,000,000,000.00	4.34	2014.10.17	2015.1.14
14华泰证券CP012	3,000,000,000.00	4.15	2014.11.18	2015.2.11
14华泰证券CP013	2,500,000,000.00	5.20	2014.12.12	2015.3.12
15华泰证券CP001	3,000,000,000.00	4.77	2015.1.16	2015.4.16
15华泰证券CP002	3,000,000,000.00	4.90	2015.2.10	2015.5.8
15华泰证券CP003	2,000,000,000.00	4.99	2015.3.11	2015.6.9
15华泰证券CP004	3,000,000,000.00	4.80	2015.4.10	2015.7.9
合计	19,500,000,000.00			

报告期内，公司共发行了4期总计110亿元的短期融资券，兑付了6期共计165亿元的短期融资券。

8、报告期内，公司已在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露的其他重大事项如下：

序号	事项	刊载日期
1	华泰证券关于江苏汇鸿国际集团有限公司减持公司股权的提示性公告	2015-01-13
2	华泰证券关于公司2015年度第一期短期融资券发行结果的公告	2015-01-17
3	华泰证券关于周勇董事任职的公告	2015-01-23
4	华泰证券第三届董事会第十五次会议决议公告（申请开展股权期权经纪业务、申请开展普通期权自营交易业务、申请开展专业化期权交易业务、扩大公司融资融券业务总规模等）	2015-01-24
5	华泰证券2014年年度业绩预增公告	2015-01-24
6	华泰证券关于获准成为上海证券交易所股票期权交易参与人的	2015-01-24

	公告	
7	华泰证券关于2015年第一期次级债券发行结果的公告	2015-01-24
8	华泰证券关于公司总部迁址的公告	2015-01-29
9	华泰证券关于股票期权做市业务资格获批的公告	2015-02-04
10	华泰证券关于华泰紫金投资有限责任公司增加注册资本的公告	2015-02-06
11	华泰证券关于公司2015年度第二期短期融资券发行结果的公告	2015-02-11
12	华泰证券关于公司董事王会娟提出辞职的公告	2015-02-17
13	华泰证券董事会审计委员会2014年度履职情况报告	2015-03-09
14	华泰证券第三届董事会第十六次会议决议公告（2014年度利润分配、续聘会计师事务所、为公司董事、监事和高级管理人员投保责任险、为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保、公司经营范围增加股票期权做市业务和修订公司章程、公司公开发行人公司债券、补选公司第三届董事会成员、调整公司第三届董事会发展战略委员会成员、修订公司《关联交易决策制度》、修订公司《对外担保决策制度》、修订公司《董事会专门委员会工作细则》、修订公司《总裁工作细则》、修订公司《董事会秘书工作细则》、修订公司《信息披露管理办法》、修订公司《投资者关系管理制度》、修订公司《董事、监事及高级管理人员所持本公司股份管理制度》、修订公司《内幕信息知情人登记管理及保密制度》、修订公司《会计制度》、修订公司《合规管理制度》相关条款等）	2015-03-09
15	华泰证券第三届监事会第八次会议决议公告（修订公司《会计制度》等）	2015-03-09
16	华泰证券关于预计2015年度日常关联交易的公告	2015-03-09
17	华泰证券关于公司2015年度第三期短期融资券发行结果的公告	2015-03-12
18	华泰证券关于向香港联交所递交境外上市外资股（H股）上市申请并刊发申请版本资料集的公告	2015-03-17
19	华泰证券第三届董事会第十七次会议决议公告（提高公司股票质押式回购交易业务规模）	2015-03-31
20	华泰证券2014年年度股东大会决议公告	2015-03-31
21	华泰证券关于中国证监会对公司融资融券业务检查情况的公告	2015-04-07
22	华泰证券关于2013年公司债券跟踪评级结果的公告	2015-04-07
23	华泰证券关于公司2015年度第四期短期融资券发行结果的公告	2015-04-11
24	华泰证券非公开发行2014年第一期次级债券2015年兑付、兑息公告	2015-04-14
25	华泰证券简式权益变动报告书（国华能源投资有限公司）	2015-04-15
26	华泰证券关于股东权益变动的提示性公告	2015-04-15
27	华泰证券关于2015年第二期次级债券发行结果的公告	2015-04-22
28	华泰证券关于控股子公司华泰长城期货有限公司更名的公告	2015-04-22
29	华泰证券第三届董事会第十八次会议决议公告（扩大外汇业务范围等）	2015-04-23
30	华泰证券2014年度利润分配实施公告	2015-04-24

31	华泰证券关于发行境外上市外资股获得中国证监会批复的公告	2015-04-25
32	华泰证券关于李志明独立董事任职等事项的公告	2015-05-01
33	华泰证券第三届董事会第十九次会议决议公告（调整公司第三届董事会审计委员会和发展战略委员会成员）	2015-05-07
34	华泰证券关于香港联合交易所有限公司审议本公司境外发行上市外资股的公告	2015-05-09
35	华泰证券关于刊发H股发行聆讯后资料集的公告	2015-05-11
36	华泰证券第三届董事会第二十次会议决议公告（确定H股全球发售（香港公开发售及国际发售）及在香港联交所上市）	2015-05-13
37	华泰证券关于刊发H股发行更新聆讯后资料集的公告	2015-05-18
38	华泰证券关于刊发H股招股说明书、H股发行价格区间及H股香港公开发售等事宜的公告	2015-05-19
39	华泰证券关于境外上市外资股（H股）公开发行价格的公告	2015-05-25
40	华泰证券2013年公司债券2015年付息公告	2015-05-28
41	华泰证券关于境外上市外资股（H股）配发结果的公告	2015-05-29
42	华泰证券第三届董事会第二十一次会议决议公告（申请开展上市公司定向增发融资业务、制订公司《2015年内部控制持续优化工作方案》）	2015-05-30
43	华泰证券关于持股5%以上股东股份变动的公告	2015-06-01
44	华泰证券关于境外上市外资股（H股）挂牌并上市交易的公告	2015-06-01
45	华泰证券关于发行境外上市外资股（H股）国有股减持的公告	2015-06-01
46	华泰证券关于单向视频开户创新方案取得无异议函的公告	2015-06-09
47	华泰证券关于公司净资本变动情况的公告	2015-06-09
48	华泰证券关于北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）设立的公告	2015-06-13
49	华泰证券第三届董事会第二十二次会议决议公告（扩大公司融资融券业务规模、扩大公司股票质押式回购交易业务规模、对华泰紫金投资有限责任公司进行增资）	2015-06-16
50	华泰证券关于部分行使超额配售权、稳定价格行动及稳定价格期结束的公告	2015-06-20
51	华泰证券关于部分行使超额配售权后进行国有股减持及股份变动的公告	2015-06-24
52	华泰证券公开发行2015年公司债券（第一期）发行公告	2015-06-25
53	华泰证券关于获得中国证监会核准公开发行公司债券批复的公告	2015-06-25
54	华泰证券关于2015年第三期次级债券发行结果的公告	2015-06-27
55	华泰证券2015年公司债券（第一期）票面利率公告	2015-06-29

9、报告期后，在公司股价出现大幅波动下，为了积极参与维护资本市场的稳定，本公司执行董事、职工监事、高级管理人员及部分员工自愿筹集资金约2.3亿元人民币，通过合格境内机构投资者（QDII）集合理财计划渠道，在符合有关法律法规的前提下，购入本公司的H股股份，共计购入1,625万股公司H股股份，平均成本为每股17.6港元。详见2015年7月16日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》

以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露的公告内容。

第六节 股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例 (%)	发行新股	送股	公积金 转股	其他	小计	数量	比例 (%)
一、有限售 条件股份	0	0						0	0
1、国家持 股									
2、国有法 人持股									
3、其他内 资持股									
其中：境内 非国有法 人持股									
境内自然 人持股									
4、外资持 股									
其中：境外 法人持股									
境外自然 人持股									
二、无限 售条件流 通股份	5,600,000,000	100	1,562,768,800				1,562,768,800	7,162,768,800	100
1、人	5,600,000,000	100				-156,276,880	-156,276,880	5,443,723,120	76

人民币普通股									
2、境内上市的外资股									
3、境外上市的外资股	0	0	1,562,768,800			156,276,880	1,719,045,680	1,719,045,680	24
4、其他									
三、股份总数	5,600,000,000	100	1,562,768,800			0	1,562,768,800	7,162,768,800	100

2、股份变动情况说明

根据中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司发行境外上市外资股的批复》(证监许可[2015] 685号), 并经香港联交所批准, 本公司发行的1,400,000,000股境外上市外资股(H股)于2015年6月1日在香港联交所主板挂牌并开始上市交易, 联席全球协调人部分行使超额配售权并要求本公司额外发行162,768,800股H股于2015年6月24日在香港联交所主板上市交易。

根据国务院《减持国有股筹集社会保障资金管理暂行办法》(国发[2001]22号)的有关规定, 本公司国有股东中包括江苏国信等21家国有股东须进行国有股减持, 即按本次发行(含部分行使超额配售权而额外发行)的H股数量的10%, 将其合计持有的156,276,880股本公司内资股(A股)划转由社保基金会以H股的形式持有。

截至报告期末, 公司总股本为7,162,768,800股, 其中: A股5,443,723,120股, 占总股本的76%; H股1,719,045,680股, 占总股本的24%。

(二) 限售股份变动情况

☐适用 ☒不适用

二、 股东情况

(一) 股东总数:

截止报告期末股东总数(户)	227,409
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0
截止报告期末A股股东总数(户)	215,873
截止报告期末H股登记股东总数(户)	11,536

(二) 截止报告期末前十名股东、前十名流通股东(或无限售条件股东)持股情况表

单位:股

前十名股东持股情况						
股东名称	报告期内增减	期末持股数	比例	持	质押或冻结情况	股东

(全称)		量	(%)	有 有 限 售 条 件 股 份 数 量	股 份 状 态	数 量	性 质
香港中央结算(代理人)有限公司	1,715,002,280	1,715,002,280	23.94	0	无		境外法人
江苏省国信资产管理集团有限公司	-86,759,006	1,250,928,425	17.46	0	无		国有法人
江苏交通控股有限公司	7,799,348	399,138,718	5.57	0	无		国有法人
江苏高科技投资集团有限公司	-17,971,994	342,028,006	4.78	0	无		国有法人
江苏省苏豪控股集团有限公司	-24,087,387	268,097,477	3.74	0	无		国有法人
江苏汇鸿国际集团有限公司	-26,864,286	246,847,296	3.45	0	无		国有法人
江苏宏图高科技股份有限公司	-5,780,000	137,403,149	1.92	0	未知	136,169,146	境内非国有法人
中国工商银行股份有限公司-申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金	38,441,259	103,063,930	1.44	0	无		其他
江苏苏豪国际集团股份有限公司	-9,337,683	97,582,317	1.36	0	无		国有法人
金城集团有限公司	-4,426,090	85,353,007	1.19	0	无		国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件 流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
香港中央结算(代理人)有限公司	1,715,002,280	境外上市外资股	1,715,002,280				
江苏省国信资产管理集团有限公司	1,250,928,425	人民币普通股	1,250,928,425				
江苏交通控股有限公司	399,138,718	人民币普通股	399,138,718				
江苏高科技投资集团有限公司	342,028,006	人民币普通股	342,028,006				
江苏省苏豪控股集团有限公司	268,097,477	人民币普通股	268,097,477				
江苏汇鸿国际集团有限公司	246,847,296	人民币普通股	246,847,296				
江苏宏图高科技股份有限公司	137,403,149	人民币普通股	137,403,149				
中国工商银行股份有限公司-申万菱信申银万国证券行业指数分级证券投资基金	103,063,930	人民币普通股	103,063,930				
江苏苏豪国际集团股份有限公司	97,582,317	人民币普通股	97,582,317				
金城集团有限公司	85,353,007	人民币普通股	85,353,007				
上述股东关联关系或一致行动的说明	江苏国信、江苏交通控股有限公司、江苏高科技投资集团有限公司、江苏汇鸿国际集团有限公司、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25,253.42万股，占该公司总股本的71.58%，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。						
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	无						

注：1、本公司境外上市外资股（H股）股东中，非登记股东的股份由香港中央结算（代理人）有限公司代为持有。

2、人民币普通股（A股）股东性质为股东在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记的账户性质。

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前10名股东

☐适用 ☒不适用

三、 控股股东或实际控制人变更情况

☐适用 ☒不适用

四、 主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

截至2015年6月30日，据本公司董事合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事或最高行政人员）于股份及相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第XV部第2及第3分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第336条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓。

序号	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目（股）	占本公司已发行股份总数的比例（%）	占本公司已发行A股/H股总数的比例（%）	好仓（注2）/淡仓（注3）/可供借出的股份
1	江苏省国信资产管理集团有限公司	A股	实益拥有人(注1)	1,250,928,425	17.46	22.98	好仓
2	江苏交通控股有限公司	A股	实益拥有人(注1)	399,138,718	5.57	7.33	好仓
3	江苏高科技投资集团有限公司	A股	实益拥有人(注1)	342,028,006	4.78	6.28	好仓
4	江苏省苏豪控股集团有限公司	A股	实益拥有人(注1)	268,097,477	3.74	4.92	好仓
		A股	受控法团权益（注4）	97,582,317	1.36	1.79	好仓
5	全国社会保障基金理事会	H股	实益拥有人(注1)	142,346,200	1.99	8.28	好仓

注1：按香港联交所网站（www.hkex.com.hk）及中国证券登记结算有限公司(www.chinaclear.cn/)所提供的信息，截至2015年6月30日，江苏国信持有1250,928,425股A股股份，江苏交通控股有限公司持有399,138,718股A股股份，江苏高科技投资集团有限公司持有342,028,006股A股股份，江苏省苏豪控股集团有限公司持有268,097,477股A股股份，全国社会保障基金理事会持有142,346,200股H股股份。根据《证券及期货条例》第336条，倘若若干条件达成，则本公司股东须呈交披露权益表格。倘股东于本公司的持股量变更，除非若干条件已达成，否则股东毋须知会本公司及香港联交所，故主要股东于本公司之最新持股量可能与呈交予联交所的持股量不同；

注2：如股东对股份本身持有权益，包括透过持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而持有权益，并因而具有如下的权利与责任，该股东便属于持有[好仓]：(i) 其有权购入相关股份；(ii) 其有责任购入相关股份；(iii) 如相关股份价格上升，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格上升，其有权避免或减低损失；及

注3：如股东根据证券借贷协议借入股份，或如股东因持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而具有以下的权利与责任，该股东便属于持有[淡仓]：(i) 其有权要求另一个人购入相关股份；(ii) 其有责任交付相关股份；(iii) 如相关股份价格下降，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格下降，其有权避免或减低损失。

注4：江苏省苏豪控股集团有限公司持有江苏苏豪国际集团股份有限公司71.58%股权，因此被视为于江苏苏豪国际集团股份有限公司拥有的97,582,317股股份中拥有权益。

除上述披露外，于2015年6月30日，本公司并不知悉任何其他人士（本公司董事、监事及最高行政人员除外）于本公司股份及相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第336条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

五、董事、监事及最高行政人员于本公司及相联法团的股份、相关股份或债券之权益及淡仓

截至2015年6月30日，就本公司所获得的资料及据董事所知，本公司董事、监事及最高行政人员在本公司或其相关法团（定义见《证券及期货条例》第XV部分）的股份、相关股份或债权证中概无拥有任何根据《证券及期货条例》第XV部及第7及8分部须通知本公司及联交所的权益及淡仓（包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓），或根据《证券及期货条例》第352条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《证券交易的标准守则》的规定需要通知本公司和联交所之权益或淡仓。

六、购回、出售或赎回本公司及附属公司的上市证券

报告期内，本公司及附属公司未购回、出售或赎回本公司及附属公司的任何上市证券。

第七节 优先股相关情况

☐适用 ☒不适用

第八节 董事、监事、高级管理人员

一、持股变动情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

☐适用 ☒不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

☐适用 ☒不适用

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

☒适用 ☐不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
王会娟	董事	离任	因工作需要而离任董事会董事职务以及董事会发展战略委员会委员职务
王全洲	独立董事	离任	因个人原因而提请辞去公司第三届董事会独立董事职务和董事会审计委员会委员及主任委员（召集人）职务
薛炳海	董事	离任	因单位工作安排而离任董事会董事职务以及董事会合规与风险管理委员会委员职务
周勇	董事	聘任	
李志明	独立董事	聘任	

三、其他说明

（一）董事、监事及有关雇员之证券交易

本公司已采纳《标准守则》所订标准作为本公司董事、监事及相关雇员进行证券交易的行为准则。本公司经查询全体董事及监事后，已确认他们于本公司2015年1月1日起至6月30日期间一直遵守上述《标准守则》的要求。报告期内，公司现任及离任董事、监事、高级管理人员没有持有本公司股份、股票期权，也未被授予限制性股票。

（二）董事、监事相关信息的重大变更

1、经江苏省国资委研究，并经中共江苏省委组织部同意，董事王树华先生自2015年3月25日起任江苏国信副总经理。

2、董事浦宝英女士自2015年3月25日起任江苏国信总会计师。

3、董事蔡标先生自2015年3月起任江苏汇鸿国际集团土产进出口股份有限公司董事。

（三）董事、监事服务合同的说明

根据香港上市规则第19A.54及19A.55条，本公司已与各董事及监事就（其中包括）遵守相关法律及法规和遵从公司章程及仲裁条文订立合约。除上述披露者外，本公司并无及并不建议与本公司任何董事或监事以其各自作为董事／监事的身份订立任何服务合约（于一年内届满或可由雇主于一年内终止而毋须支付赔偿（不包括法定赔偿）的合约除外）。

（四）员工及薪酬政策

1、集团共有员工6,496人，其中母公司5,140人，子公司1,356人。根据适用的中国法律法规，本公司与每位雇员签订劳动合同，建立劳动关系。劳动合同包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同的变更及解除等条款。

2、公司培训工作围绕业务创新、入职教育、管理素质等方面，采取集中培训和外派培训相结合、现场培训与网络培训相结合的方式推进，年度培训计划有序实施。上半年完成11场集中培训，26场外派培训。现场参训人员约470人，通过远程视频或网络形式参训的人员超过500人。下半年计划举办集中培训12场，包括新员工培训、内部讲师培训、出境培训、财富管理系列培训等，继续为公司创新发展提供人才培养方面的支持。

3、公司重视人才的培养和激励，薪酬定位上坚持市场对标，根据员工绩效与能力差异，给付具有市场竞争力的薪酬。致力于建立以市场薪酬水平、公司薪酬定位和员工能力为定薪依据，以公司业绩、部门业绩及员工贡献为分配导向的薪酬激励机制。本公司员工薪酬由基本薪酬、绩效奖金和福利计划三部分组成。

4、本公司根据相关法律法规，为员工足额缴纳各项社会保险费（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险及生育保险）和住房公积金。法定福利之外，本公司还为员工提供了丰富、全面的自主激励性福利，如意外险、医疗险、大病险、健康体检等等。

第九节 财务报告

一、 审计报告

☐适用 ☒不适用

二、 财务报表

合并资产负债表

2015年6月30日

编制单位：华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
资产：			
货币资金	七、1	283,661,411,384.97	89,864,943,930.42
其中：客户存款		168,889,069,250.49	53,863,316,563.78
结算备付金	七、2	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39
其中：客户备付金		39,338,795,331.37	17,672,993,684.50
拆出资金			
融出资金	七、3	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	七、4	84,897,192,284.66	55,999,957,916.75
衍生金融资产	七、5	317,807,279.02	20,814,658.67
买入返售金融资产	七、6	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64
应收款项	七、7	1,677,815,454.50	362,653,212.62
应收利息	七、8	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17
存出保证金	七、9	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77
应收股利			
划分为持有待售的资产			
可供出售金融资产	七、10	11,345,555,335.04	9,276,148,087.87
持有至到期投资	七、11	5,000,000.00	5,000,000.00
长期应收款			
长期股权投资	七、12	2,173,181,030.98	1,874,487,603.47
投资性房地产	七、13	734,565,524.71	673,981,494.13
固定资产	七、14	2,603,579,520.34	1,258,361,600.29
在建工程	七、15	1,086,170,068.11	2,045,324,758.06
无形资产	七、16	394,741,140.67	401,210,959.03
开发支出			
商誉	七、17	51,341,567.30	51,341,567.30
长期待摊费用	七、18	90,801,677.77	108,853,631.32
递延所得税资产	七、19	191,757,540.71	178,877,991.44
其他资产	七、20	703,514,440.27	305,542,089.10
资产总计		580,161,265,136.93	272,226,035,504.69
负债：			
短期借款			
应付短期融资款	七、22	24,369,823,509.44	24,787,070,000.00
拆入资金	七、23	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	七、24	15,588,540,564.48	9,244,846.63
衍生金融负债	七、5	1,842,475,334.51	730,743,142.93

卖出回购金融资产款	七、25	62,955,007,481.35	49,668,228,233.78
代理买卖证券款	七、26	175,620,904,470.86	60,398,770,689.39
代理承销证券款	七、27	40,510,963.43	41,400,000.00
信用交易代理买卖证券款	七、28	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63
应付职工薪酬	七、29	3,759,075,265.64	1,740,596,909.95
应交税费	七、30	2,998,377,479.63	1,429,904,303.41
应付款项	七、31	3,949,424,654.39	4,194,205,380.59
应付利息	七、32	1,821,595,255.57	1,025,326,598.95
应付股利	七、33	13,096,640.00	15,452,840.00
划分为持有待售的负债			
预计负债			
长期借款	七、35	367,095,074.05	138,657,783.84
应付债券	七、36	70,928,065,527.29	21,345,324,135.31
长期应付款			
长期应付职工薪酬	七、37	298,041,770.93	705,434,340.93
专项应付款			
递延所得税负债	七、19	1,037,375,485.71	601,173,542.16
递延收益	七、38	17,671,063.72	16,671,063.72
其他负债	七、39	103,885,187,866.83	52,103,789,780.47
负债合计		502,410,640,203.16	230,281,627,782.69
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	七、40	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00
其他权益工具			
资本公积	七、41	45,855,964,803.72	17,221,260,799.97
减：库存股			
其他综合收益	七、42	3,536,559,397.51	1,853,643,771.39
专项储备			
盈余公积	七、43	1,692,853,808.08	1,692,853,808.08
一般风险准备	七、44	4,611,609,649.74	4,611,609,649.74
未分配利润	七、45	14,194,010,313.32	10,319,188,382.86
外币报表折算差额			
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		77,053,766,772.37	41,298,556,412.04
少数股东权益		696,858,161.40	645,851,309.96
所有者权益（或股东权益）合计		77,750,624,933.77	41,944,407,722.00
负债和所有者权益（或股东权益）总计		580,161,265,136.93	272,226,035,504.69

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

母公司资产负债表

2015年6月30日

编制单位:华泰证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
资产:			
货币资金		213,330,456,974.57	61,641,473,590.59
其中: 客户存款		158,789,100,159.88	49,261,467,510.54
结算备付金		42,437,118,408.10	18,647,422,972.23
其中: 客户备付金		39,338,795,331.37	17,672,993,684.50
拆出资金			
融出资金		114,531,926,402.23	64,497,968,083.50
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		42,457,765,512.02	26,883,329,108.83
衍生金融资产		313,086,462.96	17,329,494.06
买入返售金融资产		11,884,878,512.55	8,070,324,226.64
应收款项	十九、1	209,556,281.82	132,231,897.76
应收利息		1,783,421,134.74	1,062,828,633.66
存出保证金		2,332,662,145.47	1,267,518,877.70
应收股利			
划分为持有待售的资产			
一年内到期的非流动资产			
可供出售金融资产		8,550,754,900.40	8,125,748,594.03
持有至到期投资		5,000,000.00	5,000,000.00
长期应收款			
长期股权投资	十九、2	7,521,370,963.15	5,650,280,401.15
投资性房地产		649,901,098.58	587,924,115.17
固定资产		2,547,525,931.61	1,199,361,919.07
在建工程		1,086,170,068.11	2,045,324,758.06
无形资产		386,638,907.15	392,437,249.36
开发支出			
商誉			
长期待摊费用		81,097,411.82	98,797,338.77
递延所得税资产			
其他资产		480,036,131.23	117,303,030.92
资产总计		450,589,367,246.51	200,442,604,291.50
负债:			
短期借款			
应付短期融资款		24,369,823,509.44	24,787,070,000.00
拆入资金		3,400,000,000.00	1,500,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		15,551,618,360.00	-

衍生金融负债		1,836,687,432.60	729,314,190.09
卖出回购金融资产款		58,507,552,349.79	44,478,760,889.99
代理买卖证券款		163,013,106,415.13	53,348,884,179.56
代理承销证券款		2,925,000.00	41,400,000.00
信用交易代理买卖证券款		29,518,371,795.33	9,683,616,751.81
应付职工薪酬		3,205,316,186.37	1,254,867,820.58
应交税费		2,798,082,598.61	1,308,393,964.17
应付款项		3,293,276,793.11	4,176,828,711.25
应付利息		1,804,359,532.41	1,002,313,577.35
应付股利			
划分为持有待售的负债			
预计负债			
长期借款		367,095,074.05	138,657,783.84
应付债券		68,484,287,178.09	18,974,610,078.75
长期应付款			
长期应付职工薪酬		171,928,200.00	405,375,400.00
专项应付款			
递延所得税负债		1,026,276,461.70	598,220,322.95
递延收益		13,393,285.72	13,393,285.72
其他负债		1,883,936,604.69	915,112,764.24
负债合计		379,248,036,777.04	163,356,819,720.30
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		7,162,768,800.00	5,600,000,000.00
其他权益工具			
资本公积		45,577,448,327.12	17,125,162,430.36
减：库存股			
其他综合收益		2,997,823,674.20	1,742,457,852.81
专项储备			
盈余公积		1,692,853,808.08	1,692,853,808.08
一般风险准备		3,597,616,430.65	3,597,616,430.65
未分配利润		10,312,819,429.42	7,327,694,049.30
外币报表折算差额			
所有者权益（或股东权益）合计		71,341,330,469.47	37,085,784,571.20
负债和所有者权益（或股东权益）总计		450,589,367,246.51	200,442,604,291.50

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
2015年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		14,644,251,806.44	4,369,255,869.68
手续费及佣金净收入	七、46	7,969,997,167.12	2,144,080,896.46
其中：经纪业务手续费净收入		7,128,400,815.29	1,560,175,292.88
投资银行业务手续费净收入		612,749,245.08	437,828,713.82
资产管理业务手续费净收入		130,418,528.77	90,826,135.27
利息净收入	七、47	2,769,331,690.69	986,092,925.76
投资收益（损失以“-”号填列）	七、48	3,179,740,350.49	744,192,339.02
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		197,503,943.96	119,445,225.40
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	七、49	351,472,443.46	463,575,415.79
汇兑收益（损失以“-”号填列）		331,388,162.11	1,253,092.00
其他业务收入	七、50	42,321,992.57	30,061,200.65
二、营业支出		5,833,875,333.50	2,355,027,453.74
营业税金及附加	七、51	921,431,417.06	238,957,477.60
业务及管理费	七、52	4,878,355,706.15	2,091,689,643.22
资产减值损失	七、53	-2,361,942.69	-344,967.96
其他业务成本	七、54	36,450,152.98	24,725,300.88
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		8,810,376,472.94	2,014,228,415.94
加：营业外收入	七、55	31,747,969.45	28,473,625.68
减：营业外支出	七、56	8,251,167.23	7,801,567.78
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,833,873,275.16	2,034,900,473.84
减：所得税费用	七、57	2,115,301,390.96	501,843,439.84
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,718,571,884.20	1,533,057,034.00
其中：归属于母公司所有者（或股东）的净利润		6,674,821,930.46	1,517,633,030.48
少数股东损益		43,749,953.74	15,424,003.52
六、其他综合收益的税后净额	七、42	1,684,553,023.59	-11,865,157.61
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		1,682,915,626.12	-11,806,140.54
（一）以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2.权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益		1,682,915,626.12	-11,806,140.54

1.权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		43,189,483.55	-166,346.65
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		1,636,508,948.98	-16,941,914.10
3.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4.现金流量套期损益的有效部分			
5.外币财务报表折算差额		3,217,193.59	5,302,120.21
6.其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		1,637,397.47	-59,017.07
七、综合收益总额		8,403,124,907.79	1,521,191,876.39
归属于母公司所有者的综合收益总额		8,357,737,556.58	1,505,826,889.94
归属于少数股东的综合收益总额		45,387,351.21	15,364,986.45
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)	七、58	1.1450	0.2710
（二）稀释每股收益(元/股)	七、58	1.1450	0.2710

法定代表人：吴万善 主管会计工作负责人：吴万善 会计机构负责人：舒本娥

母公司利润表

2015年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		12,521,404,436.66	3,508,844,781.08
手续费及佣金净收入	十九、3	7,072,541,093.84	1,816,540,934.95
其中: 经纪业务手续费净收入		6,981,607,700.07	1,474,002,074.85
投资银行业务手续费净收入		29,458,856.12	16,555,974.01
资产管理业务手续费净收入		4,796,292.60	300,732,131.60
利息净收入		2,125,201,118.39	499,626,888.69
投资收益(损失以“—”号填列)	十九、4	2,868,094,172.16	776,766,706.09
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		201,002,420.45	116,572,205.24
公允价值变动收益(损失以“—”号填列)		92,831,718.50	395,834,304.47
汇兑收益(损失以“—”号填列)		339,077,225.28	840.56
其他业务收入		23,659,108.49	20,075,106.32
二、营业支出		4,895,765,199.26	1,743,364,406.40
营业税金及附加		836,541,057.53	202,331,873.75
业务及管理费		4,046,623,592.25	1,517,317,791.93
资产减值损失		2,444,770.03	-344,967.96
其他业务成本		10,155,779.45	24,059,708.68
三、营业利润(亏损以“—”号填列)		7,625,639,237.40	1,765,480,374.68
加: 营业外收入		29,346,829.84	20,477,602.56
减: 营业外支出		8,225,363.69	7,743,246.03
四、利润总额(亏损总额以“—”号填列)		7,646,760,703.55	1,778,214,731.21
减: 所得税费用		1,861,635,323.43	415,410,631.49
五、净利润(净亏损以“—”号填列)		5,785,125,380.12	1,362,804,099.72
六、其他综合收益的税后净额		1,255,365,821.39	11,460,732.94
(一) 以后不能重分类进损益的其他综合收益			
1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动			
2.权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额			
(二) 以后将重分类进损益的其他综合收益		1,255,365,821.39	11,460,732.94
1.权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		43,189,483.55	-166,346.65
2.可供出售金融资产公允价值变		1,212,176,337.84	11,627,079.59

动损益			
3.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4.现金流量套期损益的有效部分			
5.外币财务报表折算差额			
6.其他			
七、综合收益总额		7,040,491,201.51	1,374,264,832.66
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
（二）稀释每股收益(元/股)			

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

2015年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、经营活动产生的现金流量：			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加			
收取利息、手续费及佣金的现金		17,723,572,951.20	4,571,166,627.64
拆入资金净增加额		1,900,000,000.00	3,195,000,000.00
回购业务资金净增加额		10,471,210,830.72	-
融出资金净减少额			
代理买卖证券收到的现金净额		134,910,871,386.17	4,940,049,173.96
收到其他与经营活动有关的现金	七、59(1)	50,107,547,151.98	7,562,694,454.36
经营活动现金流入小计		215,113,202,320.07	20,268,910,255.96
融出资金净增加额		50,041,252,017.05	1,521,974,751.13
购入以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净支付的现金		9,546,088,861.01	4,148,425,284.82
回购业务资金净减少额		-	2,824,428,058.35
代理买卖证券支付的现金净额		-	-
支付利息、手续费及佣金的现金		4,746,084,709.33	777,466,945.46
支付给职工以及为职工支付的现金		2,457,033,662.71	1,271,255,779.69
支付的各项税费		1,654,159,104.26	908,612,853.42
支付其他与经营活动有关的现金		7,442,742,117.91	957,046,286.95
经营活动现金流出小计		75,887,360,472.27	12,409,209,959.82
经营活动产生的现金流量净额	七、59(5)	139,225,841,847.80	7,859,700,296.14
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,353,128,074.80	3,630,504,500.71
取得投资收益收到的现金		151,070,111.87	77,561,122.45
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	七、59(3)	718,797,672.28	44,443.99
投资活动现金流入小计		2,222,995,858.95	3,708,110,067.15

投资支付的现金		306,600,000.00	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		378,212,835.23	335,309,460.37
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			30,735,744.80
支付其他与投资活动有关的现金		-	451,376.00
投资活动现金流出小计		684,812,835.23	366,496,581.17
投资活动产生的现金流量净额		1,538,183,023.72	3,341,613,485.98
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		30,624,270,946.94	-
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			-
取得借款收到的现金		228,437,290.21	
发行债券收到的现金		77,691,716,000.00	24,300,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		108,544,424,237.15	24,300,000,000.00
偿还债务支付的现金		28,543,063,000.00	20,300,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		3,975,311,442.31	1,619,159,642.35
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	七、59(4)	21,617,636.72	27,392,873.07
筹资活动现金流出小计		32,539,992,079.03	21,946,552,515.42
筹资活动产生的现金流量净额		76,004,432,158.12	2,353,447,484.58
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		334,605,355.70	6,555,212.21
五、现金及现金等价物净增加额	七、60(1)	217,103,062,385.34	13,561,316,478.91
加：期初现金及现金等价物余额		102,590,278,912.60	43,403,084,862.96
六、期末现金及现金等价物余额	七、60(2)	319,693,341,297.94	56,964,401,341.87

法定代表人：吴万善 主管会计工作负责人：吴万善 会计机构负责人：舒本娥

母公司现金流量表

2015年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、经营活动产生的现金流量:			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加		3,190,295,743.69	-
收取利息、手续费及佣金的现金		15,112,821,611.78	3,565,176,689.44
拆入资金净增加额		1,900,000,000.00	3,195,000,000.00
回购业务资金净增加额		13,515,315,749.23	661,840,248.72
融出资金净减少额			
代理买卖证券收到的现金净额		129,183,672,558.87	4,839,811,375.47
收到其他与经营活动有关的现金		332,073,991.66	739,335,910.89
经营活动现金流入小计		163,234,179,655.23	13,001,164,224.52
融出资金净增加额		50,033,958,318.73	1,608,366,462.55
购入以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净支付的现金			1,527,549,829.62
回购业务资金净减少额			
代理买卖证券支付的现金净额			
支付利息、手续费及佣金的现金		4,596,524,234.87	710,888,660.33
支付给职工以及为职工支付的现金		1,747,315,326.06	882,736,975.99
支付的各项税费		1,390,791,795.96	795,298,521.21
支付其他与经营活动有关的现金		2,360,209,794.19	660,625,151.92
经营活动现金流出小计		60,128,799,469.81	6,185,465,601.62
经营活动产生的现金流量净额		103,105,380,185.42	6,815,698,622.90
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资收到的现金		1,370,691,713.36	1,040,617,879.13
取得投资收益收到的现金		122,374,835.47	32,688,317.30
收到其他与投资活动有关的现金		786,525.06	-
投资活动现金流入小计		1,493,853,073.89	1,073,306,196.43

投资支付的现金			
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		368,762,963.22	348,120,764.71
取得子公司及其他营业单位支付的现金		1,750,000,000.00	116,035,744.80
支付其他与投资活动有关的现金		-	451,376.00
投资活动现金流出小计		2,118,762,963.22	464,607,885.51
投资活动产生的现金流量净额		-624,909,889.33	608,698,310.92
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		30,587,689,604.94	
取得借款收到的现金		228,437,290.21	-
发行债券收到的现金		77,630,580,000.00	26,300,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		108,446,706,895.15	26,300,000,000.00
偿还债务支付的现金		28,543,063,000.00	22,300,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		3,934,785,581.55	1,609,186,167.48
支付其他与筹资活动有关的现金		8,648,439.78	27,392,873.07
筹资活动现金流出小计		32,486,497,021.33	23,936,579,040.55
筹资活动产生的现金流量净额		75,960,209,873.82	2,363,420,959.45
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		339,077,225.28	840.56
五、现金及现金等价物净增加额		178,779,757,395.19	9,787,818,733.83
加：期初现金及现金等价物余额		81,038,846,562.82	29,381,774,912.08
六、期末现金及现金等价物余额		259,818,603,958.01	39,169,593,645.91

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

合并所有者权益变动表
2015年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	本期							
	归属于母公司所有者权益						少数股东权益	所有者权益合计
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年期末余额	5,600,000,000.00	17,221,260,799.97	1,853,643,771.39	1,692,853,808.08	4,611,609,649.74	10,319,188,382.86	645,851,309.96	41,944,407,722.00
加：会计政策变更								
前期差错更正								
同一控制下企业合并								
其他								
二、本年期初余额	5,600,000,000.00	17,221,260,799.97	1,853,643,771.39	1,692,853,808.08	4,611,609,649.74	10,319,188,382.86	645,851,309.96	41,944,407,722.00
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,562,768,800.00	28,634,704,003.75	1,682,915,626.12	-	-	3,874,821,930.46	51,006,851.44	35,806,217,211.77
（一）综合收益总额			1,682,915,626.12	-	-	6,674,821,930.46	45,387,351.21	8,403,124,907.79
（二）所有者投入和减少资本	1,562,768,800.00	28,634,704,003.75					5,619,500.23	30,203,092,303.98
1. 股东投入的普通股	1,562,768,800.00	28,634,704,003.75	-	-	-	-	-13,578,635.12	30,183,894,168.63
2. 其他权益工具持有者投入资本	-		-	-	-	-		
3. 股份支付计								

入所有者权益 的金额								
4. 其他							19,198,135.35	19,198,135.35
(三) 利润分 配						-2,800,000,000.00		-2,800,000,000.00
1. 提取盈余公 积								
2. 提取一般风 险准备								
3. 对所有 者(或股 东)的分 配						-2,800,000,000.00		-2,800,000,000.00
4. 其他								
(四) 所有 者权益内 部结转								
1. 资本公积转 增资本(或 股本)								
2. 盈余公积转 增资本(或 股本)								
3. 盈余公积弥 补亏损								
4. 其他								
(五) 专项储 备								
1. 本期提取								
2. 本期使用								
(六) 其他								
四、本期期末 余额	7,162,768,800.00	45,855,964,803.72	3,536,559,397.51	1,692,853,808.08	4,611,609,649.74	14,194,010,313.32	696,858,161.40	77,750,624,933.77

项目	上期							
	归属于母公司所有者权益						少数股东权益	所有者权益合计
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年期末余额	5,600,000,000.00	17,218,019,723.17	378,908,957.77	1,302,766,945.49	3,741,574,120.66	7,933,034,642.45	626,672,621.53	36,800,977,011.07
加：会计政策变更								
前期差错更正								
同一控制下企业合并								
其他								
二、本年期初余额	5,600,000,000.00	17,218,019,723.17	378,908,957.77	1,302,766,945.49	3,741,574,120.66	7,933,034,642.45	626,672,621.53	36,800,977,011.07
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）		2,632,221.67	-11,806,140.54			677,633,030.48	-19,195,654.9	649,263,456.71
（一）综合收益总额			-11,806,140.54	-	-	1,517,633,030.48	15,364,986.45	1,521,191,876.39
（二）所有者投入和减少资本		2,632,221.67					-24,587,166.48	-21,954,944.81
1．股东投入的普通股		2,632,221.67					-18,667,966.48	-16,035,744.81
2．其他权益工具持有者投入资本								
3．股份支付计入所有者权益的金额								
4．其他							-5,919,200.00	-5,919,200.00
（三）利润						-840,000,000.00	-9,973,474.87	-849,973,474.87

分配								
1. 提取盈余公积								
2. 提取一般风险准备								
3. 对所有者（或股东）的分配						-840,000,000.00	-9,973,474.87	-849,973,474.87
4. 其他								
（四）所有者权益内部结转								
1. 资本公积转增资本（或股本）								
2. 盈余公积转增资本（或股本）								
3. 盈余公积弥补亏损								
4. 其他								
（五）专项储备								
1. 本期提取								
2. 本期使用								
（六）其他								
四、本期期末余额	5,600,000,000.00	17,220,651,944.84	367,102,817.23	1,302,766,945.49	3,741,574,120.66	8,610,667,672.93	607,476,966.63	37,450,240,467.78

法定代表人：吴万善

主管会计工作负责人：吴万善

会计机构负责人：舒本娥

母公司所有者权益变动表

2015年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	本期						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	5,600,000,000.00	17,125,162,430.36	1,742,457,852.81	1,692,853,808.08	3,597,616,430.65	7,327,694,049.30	37,085,784,571.20
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年期初余额	5,600,000,000.00	17,125,162,430.36	1,742,457,852.81	1,692,853,808.08	3,597,616,430.65	7,327,694,049.30	37,085,784,571.20
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,562,768,800.00	28,452,285,896.76	1,255,365,821.39			2,985,125,380.12	34,255,545,898.27
（一）综合收益总额			1,255,365,821.39			5,785,125,380.12	7,040,491,201.51
（二）所有者投入和减少资本	1,562,768,800.00	28,452,285,896.76					30,015,054,696.76
1．股东投入的普通股	1,562,768,800.00	28,452,285,896.76					30,015,054,696.76
2．其他权益工具持有者投入资本							
3．股份支付计入所有者权益的金额							
4．其他							
（三）利润分配						-2,800,000,000.00	-2,800,000,000.00
1．提取盈余公积							
2．对所有者（或股东）的分配						-2,800,000,000.00	-2,800,000,000.00
3．其他							
（四）所有者权益内部结转							
1．资本公积转增资本（或股本）							
2．盈余公积转增资本（或股本）							
3．盈余公积弥补亏损							

4. 其他							
（五）专项储备							
1. 本期提取							
2. 本期使用							
（六）其他							
四、本期期末余额	7,162,768,800.00	45,577,448,327.12	2,997,823,674.20	1,692,853,808.08	3,597,616,430.65	10,312,819,429.42	71,341,330,469.47

项目	上期						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	5,600,000,000.00	17,123,273,575.23	247,277,888.36	1,302,766,945.49	2,817,442,705.47	5,437,086,011.15	32,527,847,125.70
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年期初余额	5,600,000,000.00	17,123,273,575.23	247,277,888.36	1,302,766,945.49	2,817,442,705.47	5,437,086,011.15	32,527,847,125.70
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）			11,460,732.94			522,804,099.72	534,264,832.66
（一）综合收益总额			11,460,732.94	-	-	1,362,804,099.72	1,374,264,832.66
（二）所有者投入和减少资本							
1. 股东投入的普通股							
2. 其他权益工具持有者投入资本							
3. 股份支付计入所有者权益的金额							
4. 其他							
（三）利润分配						-840,000,000.00	-840,000,000.00
1. 提取盈余公积							
2. 对所有者（或股东）的分配						-840,000,000.00	-840,000,000.00
3. 其他							
（四）所有者权益内部结转							
1. 资本公积转增资本							

(或股本)							
2. 盈余公积转增资本 (或股本)							
3. 盈余公积弥补亏损							
4. 其他							
(五) 专项储备							
1. 本期提取							
2. 本期使用							
(六) 其他							
四、本期期末余额	5,600,000,000.00	17,123,273,575.23	258,738,621.30	1,302,766,945.49	2,817,442,705.47	5,959,890,110.87	33,062,111,958.36

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

三、 公司基本情况

1. 公司概况

华泰证券股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)原为江苏省证券公司,系经中国人民银行总行批准,于1991年4月9日在江苏省工商行政管理局登记注册,总部设在江苏省南京市。

于1999年12月经中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)“证监机构字[1999]152号”文批准,公司更名为“华泰证券有限责任公司”。于2007年11月29日经证监会《关于华泰证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》(证监机构字[2007]311号)批准,公司改制为股份有限公司。

经中国证券监督管理委员会2010年2月1日印发的《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复》(证监发行字[2010]138号)批准,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)784,561,275股,并于2010年2月26日在上海证券交易所挂牌交易证券简称为“华泰证券”,证券代码为“601688”,每股面值1元。

根据中国证券监督管理委员会2015年4月21日签发的《关于核准华泰证券股份有限公司发行境外上市外资股的批复》(证监许可[2015]685号),经香港联合交易所有限公司批准,2015年6月1日,已公开发售的H股1,400,000,000股于香港联交所主板挂牌并开始上市交易,H股股票简称为“HTSC”,H股股票代码为“6886”,2015年6月19日,因部分行使H股超额配股权超额发行162,768,800股,该股份于2015年6月24日在香港联交所主板交易。截至2015年6月24日止,累计发售H股股票1,562,768,800股。

截至2015年6月30日,本公司累计发行股本总额为7,162,768,800.00元,本公司注册资本为人民币7,162,768,800.00元。本公司于2015年7月14日更换了注册号320000000000192的《企业法人营业执照》。

本公司及子公司(以下简称“本集团”)经营范围:证券经纪业务,证券自营,证券资产管理业务,证券承销业务,证券投资咨询,为期货公司提供中间介绍业务,融资融券业务,代销金融产品业务,证券投资基金代销,证券投资基金托管,黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务,股票期权做市业务、直接投资业务,创新投资业务,期货经纪业务以及中国证监会批准的其他业务。

截至2015年6月30日,本公司经批准设立分公司29家,证券营业部245家,本公司下设子公司情况参见附注七、1。

截至2015年6月30日,本公司拥有员工5,140人,其中高级管理人员10人。

2. 合并财务报表范围

合并财务报表范围变动详见附注八。

四、 财务报表的编制基础

1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

2. 持续经营

本公司自本报告期末至少12个月内具备持续经营能力，无影响持续经营能力的重大事项。

五、 重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

本公司金融资产及金融负债的确认和计量、融出资金和融出证券、转融通业务核算方法、买入返售和卖出回购金融资产款的确认和计量以及收入的确认和计量是按照本集团相关业务特点制定的，具体政策参见相关附注。

1. 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本公司2015年06月30日的合并财务状况和财务状况、2015年半年度的合并经营成果和经营成果及合并现金流量和现金流量。

此外，本公司的财务报表同时符合证监会2014年修订的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第15号——财务报告的一般规定》有关财务报表及其附注的披露要求。

2. 会计期间

本公司会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

3. 营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

5. 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

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。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，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。为进行企业合并发生的直接相关费用，于发生时计入当期损益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

(2) 非同一控制下的企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下的企业合并。本集团作为购买方，为取得被购买方控制权而付出的资产（包括购买日之前所持有的被购买方的股权）、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买

日的公允价值之和，减去合并中取得的被购买方可辨认净资产于购买日公允价值份额的差额，如为正数则确认为商誉（参见附注五、17）；如为负数则计入当期损益。本集团将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。本集团为进行企业合并发生的其他各项直接费用计入当期损益。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。本集团在购买日按公允价值确认所取得的被购买方符合确认条件的各项可辨认资产、负债及或有负债。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。

通过多次交易分步实现非同一控制企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，本集团会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的以后可重分类进损益的其他综合收益及权益法核算下的其他所有者权益变动（参见附注五、11(2)(b)）于购买日转入当期投资收益。

6. 合并财务报表的编制方法

(1) 总体原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定，包括本公司及本公司控制的子公司。控制，是指本集团拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本集团是否拥有对被投资方的权力时，本集团仅考虑与被投资方相关的实质性权利（包括本集团自身所享有的及其他方所享有的实质性权利）。子公司的财务状况、经营成果和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。

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

当子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，合并时已按照本公司的会计期间或会计政策对子公司财务报表进行必要的调整。合并时所有集团内部交易及余额，包括未实现内部交易损益均已抵销。集团内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

(2) 合并取得子公司

对于通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，视同被合并子公司在本公司最终控制方对其开始实施控制时纳入本公司合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。本公司在编制合并财务报表时，自本公司最终控制方对被合并子公司开始实施控制时起将被合并子公司的各项资产、负债在最终控制方财务报表中的账面价值并入本公司合并资产负债表，被合并子公司的经营成果纳入本公司合并利润表。

对于通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以购买日确定的被购买子公司各项可辨认资产、负债的公允价值为基础自购买日起将被购买子公司纳入本公司合并范围。

(3) 处置子公司

本集团丧失对原有子公司控制权时，终止确认与该子公司相关的资产、负债、少数股东权益以及权益中的其他相关项目。对于处置后的剩余股权投资，本集团按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量，由此产生的任何收益或损失，计入丧失控制权当期的投资收益。

通过多次交易分步处置对子公司长期股权投资直至丧失控制权的，按下述原则判断是否为一揽子：

- 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；
- 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；
- 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；
- 一项交易单独考虑时是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

如果各项交易不属于一揽子交易的，则在丧失对子公司控制权以前的各项交易，按照不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资的会计政策进行处理(参见附注五、6(4))。

如果各项交易属于一揽子交易的，本公司将各项交易作为一项处置原有子公司并丧失控制权的交易进行处理，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司自购买日开始持续计算的净资产账面价值的份额之间的差额，在合并财务报表中计入其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

(4) 少数股东权益变动

本公司因购买少数股权新取得的长期股权投资成本与按照新增持股比例计算应享有子公司的可辨认净资产份额之间的差额，以及在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司净资产的差额，均调整合并资产负债表中的资本公积(股本溢价)，资本公积(股本溢价)不足冲减的，调整留存收益。

7. 现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、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。

8. 外币业务和外币报表折算

本集团收到投资者以外币投入资本时按当日即期汇率折合为人民币，其他外币交易在初始确认时按交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折合为人民币。

即期汇率是中国人民银行公布的人民币外汇牌价。即期汇率的近似汇率是按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的当期平均汇率。

于资产负债表日，外币货币性项目采用该日的即期汇率折算，除与购建符合资本化条件资产有关的专门借款本金和利息的汇兑差额(参见附注五、15)外，其他汇兑差额计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，由此产生的汇兑差额，属于可供出售金融资产的外币非货币性项目的差额，计入其他综合收益；其他差额计入当期损益。

对境外经营的财务报表进行折算时，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，采用交易发生日的即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在资产负债表中股东权益项目下的其他综合收益中列示。处置境外经营时，相关的外币财务报表折算差额自股东权益转入处置当期损益。

9. 金融工具

(1) 金融资产及金融负债的确认和计量

金融资产和金融负债在本集团成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

本集团在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、贷款及应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本集团持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。但是被指定且为有效套期工具的衍生工具、属于财务担保合同的衍生工具、与在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生工具除外。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。初始确认后，应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 持有至到期投资

本集团将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。

初始确认后，持有至到期投资以实际利率法按摊余成本计量。

- 可供出售金融资产

本集团将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。

对公允价值不能可靠计量的可供出售权益工具投资，初始确认后按成本计量；其他可供出售金融资产，初始确认后以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失，除减值损失和外币货币性金融资产形成的汇兑差额计入当期损益外，其他利得或损失计入其他综合收益，在可供出售金融资产终止确认时转出，计入当期损益。可供出售权益工具投资的现金股利，在被投资单位宣告发放股利时计入当期损益（参见附注五、24(3)）。按实际利率法计算的可供出售金融资产的利息，计入当期损益（参见附注五、24(3)）。

- 其他金融负债

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。

其他金融负债包括财务担保合同负债。财务担保合同指本集团作为保证人与债权人约定，当债务人不履行债务时，本集团按照约定履行债务或者承担责任的合同。财务担保合同负债以初始确认金额扣除累计摊销额后的余额与按照或有事项原则（参见附注五、23）确定的预计负债金额两者之间较高者进行后续计量。

除上述以外的其他金融负债，初始确认后采用实际利率法按摊余成本计量。

(2) 金融资产及金融负债的列报

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集团具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是当前可执行的；
- 本集团计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(3) 金融资产和金融负债的终止确认

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本集团终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移而收到的对价，与原直接计入股东权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本集团终止确认该金融负债或其一部分。

(4) 金融资产的减值

本集团在资产负债表日对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备。

金融资产发生减值的客观证据，包括但不限于：

- (a) 发行方或债务人发生严重财务困难；
- (b) 债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金发生违约或逾期等；
- (c) 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- (d) 因发行方发生重大财务困难，该金融资产无法在活跃市场继续交易；
- (e) 权益工具发行方经营所处的技术、市场、经济或法律环境等发生重大不利变化，使权益工具投资人可能无法收回投资成本；
- (f) 权益工具投资的公允价值发生严重下跌（即公允价值下跌超过50%）或非暂时性下跌（即公允价值下跌持续一年）等。

有关应收款项减值的方法，参见附注五、10，其他金融资产的减值方法如下：

- 持有至到期投资

持有至到期投资按下述原则运用个别方式和组合方式评估减值损失。

运用个别方式评估时，当持有至到期投资的预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本集团将该持有至到期投资的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。

当运用组合方式评估持有至到期投资的减值损失时，减值损失金额是根据具有类似信用风险特征的持有至到期投资（包括以个别方式评估未发生减值的持有至到期投资）的以往损失经验，并根据反映当前经济状况的可观察数据进行调整确定的。

持有至到期投资确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本集团将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后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。

- 可供出售金融资产

可供出售金融资产运用个别方式和组合方式评估减值损失。可供出售金融资产发生减值时，即使该金融资产没有终止确认，本集团将原直接计入股东权益的因公允价值下降形成的累计损失从股东权益转出，计入当期损益。

对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的，本集团将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。可供出售权益工具投资发生的减值损失，不通过损益转回。在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，不得转回。

(5) 权益工具

本公司发行权益工具收到的对价扣除交易费用后，计入股东权益。回购本公司权益工具支付的对价和交易费用，减少股东权益。

10. 应收款项

应收款项按下述原则运用个别方式和组合方式评估减值损失。

运用个别方式评估时，当应收款项的预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本集团将该应收款项的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。

当运用组合方式评估应收款项的减值损失时，减值损失金额是根据具有类似信用风险特征的应收款项（包括以个别方式评估未发生减值的应收款项）的以往损失经验，并根据反映当前经济状况的可观察数据进行调整确定的。

在应收款项确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本集团将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后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。

(1). 单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项

单项金额重大的判断依据或金额标准	金额人民币500万以上。
单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法	当应收款项的预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本集团对该部分差额确认减值损失，计提应收款项坏账准备。

(2). 单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项：

单项计提坏账准备的理由	1、如与对方存在争议或涉及诉讼、仲裁的应收款项2、已有明显迹象表明债务人很可能无法履行还款义务的应收款项。
坏账准备的计提方法	当应收款项的预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本集团对该部分差额确认减值损失，计提应收款项坏账准备。

(3). 按信用风险特征组合计提坏账准备的应收款项：

对于上述（1）和（2）中单项测试未发生减值的应收款项，本集团也会将其包括在具有类似信用风险特征的应收款项组合中再进行减值测试。

按信用风险特征组合计提坏账准备的计提方法（账龄分析法、余额百分比法、其他方法）

账龄分析法组合	账龄分析法
---------	-------

组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的

☒适用 ☐不适用

账龄	应收账款计提比例(%)	其他应收款计提比例(%)
1年以内（含1年）	0.5	0.5
其中：1年以内分项，可添加行		
1—2年	5	5
2—3年	10	10
3年以上	50	50
3—4年		
4—5年		
5年以上		

组合中，采用余额百分比法计提坏账准备的

☐适用 ☒不适用

组合中，采用其他方法计提坏账准备的

☐适用 ☒不适用

11. 长期股权投资

(1) 长期股权投资投资成本确定

(a) 通过企业合并形成的长期股权投资

- 对于同一控制下的企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照合并日取得的被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付对价账面价值之间的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。通过非一揽子的多次交易分步实现的同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按上述原则确认的长期股权投资的初始投资成本与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。

- 对于非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照购买日取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值，作为该投资的初始投资成本。通过非一揽子的多次交易分步实现的非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，其初始投资成本为本公司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。

(b) 其他方式取得的长期股权投资

- 对于通过企业合并以外的其他方式取得的长期股权投资，在初始确认时，对于以支付现金取得的长期股权投资，本集团按照实际支付的购买价款作为初始投资成本；对于发行权益性证券取得的长期股权投资，本集团按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

(2) 长期股权投资后续计量及损益确认方法

(a) 对子公司的投资

在本公司个别财务报表中，本公司采用成本法对子公司的长期股权投资进行后续计量，对被投资单位宣告分派的现金股利或利润由本公司享有的部分确认为当期投资

收益，但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除外。

对子公司的投资按照成本减去减值准备后在资产负债表内列示。

在本集团合并财务报表中，对子公司的长期股权投资按附注五、6进行处理。

(b) 对合营企业和联营企业的投资

合营企业指本集团与其他合营方共同控制（参见附注五、11(3)）且仅对其净资产享有权利的一项安排。

联营企业指本集团能够对其施加重大影响（参见附注五、11(3)）的企业。

后续计量时，对合营企业和联营企业的长期股权投资采用权益法核算，除非投资符合持有待售条件。

本集团在采用权益法核算时的具体会计处理包括：

- 对于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，以前者作为长期股权投资的成本；对于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，以后者作为长期股权投资的成本，长期股权投资的成本与初始投资成本的差额计入当期损益。

- 取得对合营企业和联营企业投资后，本集团按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；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。对合营企业或联营企业除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动（以下简称“其他所有者权益变动”，本集团按照应享有或应分担的份额计入股东权益，并同时调整长期股权投资的账面价值。

在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益、其他综合收益及所有者权益的其他变动的份额时，本集团以取得投资时被投资单位可辨认净资产公允价值为基础，按照本集团的会计政策或会计期间进行必要调整后确认投资收益和其他综合收益等。本集团与联营企业及合营企业之间内部交易产生的未实现损益按照应享有的比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵销。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

- 本集团对合营企业或联营企业发生的净亏损，除本集团负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对合营企业或联营企业净投资的长期权益减记至零为限。合营企业或联营企业以后实现净利润的，本集团在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

本集团对合营企业和联营企业投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见附注五、19。

(3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的判断标准

共同控制指按照合同约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动（即对安排的回报产生重大影响的活动）必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。

本集团在判断对被投资单位是否存在共同控制时，通常考虑下述事项：

- 是否任何一个参与方均不能单独控制被投资单位的相关活动；
- 涉及被投资单位相关活动的决策是否需要分享控制权参与方一致同意。

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

12. 投资性房地产

(1). 如果采用成本计量模式的：

折旧或摊销方法

本集团将持有的为赚取租金或资本增值，或两者兼有的房地产划分为投资性房地产。本集团采用成本模式计量投资性房地产，即以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。本集团将投资性房地产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非投资性房地产符合持有待售的条件。减值测试方法及减值准备计提方法参见附注三、19。

各类投资性房地产的使用寿命、残值率和年折旧率分别为：

项目	使用寿命（年）	残值率（%）	年折旧率（%）
房屋及建筑物	30 - 35年	3%	2.77% - 3.23%

13. 固定资产

(1). 确认条件

固定资产指本集团为经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度价值超过人民币5000元的有形资产。

外购固定资产的初始成本包括购买价款、相关税费以及使该资产达到预定可使用状态前所发生的可归属于该项资产的支出。自行建造固定资产按附注五、14确定初始成本。

对于构成固定资产的各组成部分，如果各自具有不同使用寿命或者以不同方式为本集团提供经济利益，适用不同折旧率或折旧方法的，本集团分别将各组成部分确认为单项固定资产。

对于固定资产的后续支出，包括与更换固定资产某组成部分相关的支出，在符合固定资产确认条件时计入固定资产成本，同时将被替换部分的账面价值扣除；与固定资产日常维护相关的支出在发生时计入当期损益。

固定资产以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。

(2). 折旧方法

本集团将固定资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在其使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非固定资产符合持有待售的条件。

各类固定资产的使用寿命、残值率和年折旧率分别为：

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率（%）	年折旧率（%）
房屋及建筑物		30 - 35年	3%	2.77% - 3.23%
运输工具		5 - 8年	3%	12.13% - 19.40%
电子设备		5年	3%	19.40%
办公设备及其他设备		5年	3%	19.40%

(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

参见附注五、19

(4) 固定资产处置

固定资产满足下述条件之一时，本集团会予以终止确认。

- 固定资产处于处置状态；
- 该固定资产预期通过使用或处置不能产生经济利益。

报废或处置固定资产项目所产生的损益为处置所得款项净额与项目账面金额之间的差额，并于报废或处置日在损益中确认。

14. 在建工程

自行建造的固定资产的成本包括工程用物资、直接人工、符合资本化条件的借款费用和使该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出。

自行建造的固定资产于达到预定可使用状态时转入固定资产，此前列于在建工程，且不计提折旧。

在建工程以成本减减值准备（参见附注七、19）在资产负债表内列示。

15. 借款费用

本集团发生的可直接归属于符合资本化条件的资产的购建的借款费用，予以资本化并计入相关资产的成本。

除上述借款费用外，其他借款费用均于发生当期确认为财务费用。

在资本化期间内，本集团按照下列方法确定每一会计期间的利息资本化金额（包括折价或溢价的摊销）：

- 对于为购建符合资本化条件的资产而借入的专门借款，本集团以专门借款按实际利率计算的当期利息费用，减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额确定专门借款应予资本化的利息金额。

- 对于为购建符合资本化条件的资产而占用的一般借款，本集团根据累计资产支出超过专门借款部分的资产支出的加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。资本化率是根据一般借款加权平均的实际利率计算确定。

本集团确定借款的实际利率时，是将借款在预期存续期间或适用的更短期间内的未来现金流量，折现为该借款初始确认时确定的金额所使用的利率。

在资本化期间内，外币专门借款本金及其利息的汇兑差额，予以资本化，计入符合资本化条件的资产的成本。而除外币专门借款之外的其他外币借款本金及其利息所产生的汇兑差额作为财务费用，计入当期损益。

资本化期间是指本集团从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间，借款费用暂停资本化的期间不包括在内。当资本支出和借款费用已经发生及为使资产达到预定可使用状态所必要的购建活动已经开始时，借款费用开始资本化。当购建符合资本化条件的资产达到预定可使用状态时，借款费用停止资本化。对于符合资本化条件的资产在购建过程中发生非正常中断、且中断时间连续超过3个月的，本集团暂停借款费用的资本化。

16. 无形资产

计价方法、使用寿命、减值测试

无形资产以成本减累计摊销（仅限于使用寿命有限的无形资产）及减值准备（参见附注五、19）后在资产负债表内列示。对于使用寿命有限的无形资产，本集团将无形资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后按直线法在预计使用寿命期内摊销，除非该无形资产符合持有待售的条件。

各项无形资产的摊销年限为：

项目	摊销年限（年）
土地使用权	50年
交易席位费	10年
软件	2 - 3年

本集团将无法预见未来经济利益期限的无形资产视为使用寿命不确定的无形资产，并对这类无形资产不予摊销。截至资产负债表日，本集团没有使用寿命不确定的无形资产。

17. 商誉

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是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。

本集团对商誉不摊销，以成本减累计减值准备（参见附注五、19）在资产负债表内列示。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。

18. 长期待摊费用

长期待摊费用包括经营租入固定资产改良及其他已经发生但应由本期和以后各期负担的、分摊期限在一年以上的各项费用，按预计收益期间分期平均摊销，并以实际支出减去累计摊销后的净额列示。

19. 除金融资产外的其他资产减值

本集团在资产负债表日根据内部及外部信息以确定下列资产是否存在减值的迹象，包括：

- 固定资产
- 在建工程
- 无形资产
- 长期待摊费用
- 采用成本模式计量的投资性房地产
- 长期股权投资
- 商誉等

本集团对存在减值迹象的资产进行减值测试，估计资产的可收回金额。此外，无论是否存在减值迹象，本集团于每年年度终了对商誉估计其可收回金额。本集团依据相关资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中的受益情况分摊商誉账面价值，并在此基础上进行商誉减值测试。

可收回金额是指资产(或资产组、资产组组合，下同)的公允价值(参见附注五、21)减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者。

资产组是可以认定的最小资产组合，其产生的现金流入基本上独立于其他资产或者资产组。资产组由创造现金流入相关的资产组成。在认定资产组时，主要考虑该资产组能否独立产生现金流入，同时考虑管理层对生产经营活动的管理方式以及对资产使用或者处置的决策方式等。

资产预计未来现金流量的现值，按照资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量，选择恰当的税前折现率对其进行折现后的金额加以确定。

可收回金额的估计结果表明，资产的可收回金额低于其账面价值的，资产的账面价值会减记至可收回金额，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。与资产组或者资产组组合相关的减值损失，先抵减分摊至该资产组或者资产组组合中商誉的账面价值，再根据资产组或者资产组组合中除商誉之外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值，但抵减后的各资产的账面价值不得低于该资产的公允价值减去处置费用后的净额(如可确定的)、该资产预计未来现金流量的现值(如可确定的)和零三者之中最高者。

资产减值损失一经确认，在以后会计期间不会转回。

20. 买入返售和卖出回购金融资产款

买入返售金融资产，是指本集团按返售协议先买入再按固定价格返售金融资产所融出的资金。卖出回购金融资产款，是指本集团按回购协议先卖出再按固定价格回购金融资产所融入的资金。

买入返售和卖出回购金融资产款按业务发生时实际支付或收到的款项入账并在资产负债表中反映。买入返售的已购入标的资产不予以确认，在表外记录；卖出回购的标的资产在资产负债表中不终止确认。

买入返售和卖出回购业务的买卖差价在相关交易期间以实际利率法摊销，分别确认为利息收入和利息支出。

21. 公允价值的计量

除特别声明外，本集团按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本集团估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

22. 职工薪酬

(1)、短期薪酬的会计处理方法

本集团在职工提供服务的会计期间，将实际发生的职工工资、奖金、按规定的基准和比例为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费和住房公积金，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2)、离职后福利的会计处理方法

本集团所参与的设定提存计划是按照中国有关法规要求，本集团职工参加的由政府机构设立管理的社会保障体系中的基本养老保险。基本养老保险的缴费金额按国家

规定的基准和比例计算。本集团在职工提供服务的会计期间，将应缴存的金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(3)、辞退福利的会计处理方法

本集团在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，在下列两者孰早日，确认辞退福利产生的负债，同时计入当期损益：

- 本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；
- 本集团有详细、正式的涉及支付辞退福利的重组计划；并且，该重组计划已开始实施，或已向受其影响的各方通告了该计划的主要内容，从而使各方形成了对本集团将实施重组的合理预期时。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

本集团的其他长期职工福利为报告期末12个月内不需支付的递延发放奖金，本公司根据职工提供服务而获取的未来报告期间预计获得的福利金额，将其予以折现后的现值确认为负债，并计入当前损益或相关资产成本。

23. 预计负债

如果与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且该义务的履行很可能会导致经济利益流出本集团，以及有关金额能够可靠地计量，则本集团会确认预计负债。

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。对于货币时间价值影响重大的，预计负债以预计未来现金流量折现后的金额确定。在确定最佳估计数时，本集团综合考虑了与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- 或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定；
- 或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

本集团在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，并按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

24. 收入

收入是本集团在日常活动中形成的、会导致股东权益增加且与股东投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集团、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

(1) 手续费及佣金收入

手续费及佣金收入的金额按照本集团在日常经营活动中提供劳务时，已收或应收合同或协议价款的公允价值确定。

与交易相关的经济利益能够流入本集团，相关的收入能够可靠计量且满足下列各项经营活动的特定收入确认标准时，确认相关的手续费及佣金收入：

(a) 经纪业务收入

代理买卖证券业务手续费收入及期货经纪业务手续费收入在交易日确认为收入。

(b) 投资银行业务收入

证券承销业务、保荐业务及财务顾问服务按照提供劳务收入的确认条件，在提供

劳务交易的结果能够可靠估计时确认为收入。

(c) 资产管理业务收入

受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入，在符合相关收入确认条件时，按合同规定的条件和比例计算应由公司享有的收益，确认为收入。

(2) 利息收入

利息收入和利息支出是按借出和借入货币资金的时间和实际利率计算确定的。其中：

(a) 融资融券利息收入

融资融券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和实际利率，按每笔融资或融券交易计算并确认相应的融资融券利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

(b) 存放金融同业利息收入

存放金融同业利息收入以按资金使用时间和实际利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

(c) 买入返售金融资产收入

买入返售金融资产的收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法确认。直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

(3) 投资收益

本集团持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产及其他投资在持有期间取得的利息、红利、股息或现金股利确认当期收益。

金融资产转移满足终止确认条件的，应当将下列两项金额的差额计入投资收益：

- 终止确认部分的账面价值；
- 终止确认部分的对价，与原直接计入股东权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

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。

25. 政府补助

政府补助是本集团从政府无偿取得的货币性资产或非货币性资产，但不包括政府以投资者身份向本集团投入的资本。政府拨入的投资补助等专项拨款中，国家相关文件规定作为资本公积处理的，也属于资本性投入的性质，不属于政府补助。

政府补助在能够满足政府补助所附条件，并能够收到时，予以确认。

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。

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助作为与资产相关的政府补助。

与资产相关的政府补助，本集团将其确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内平均分配，计入当期损益。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

本集团取得的与资产相关之外的其他政府补助作为与收益相关的政府补助。

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

26. 递延所得税资产/递延所得税负债

除因企业合并和直接计入股东权益（包括其他综合收益）的交易或者事项产生的所得税外，本集团将当期所得税和递延所得税计入当期损益。

当期所得税是按本年度应税所得额，根据税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上以往年度应付所得税的调整。

资产负债表日，如果本集团拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

递延所得税资产与递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

如果不属于企业合并交易且交易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），则该项交易中产生的暂时性差异不会产生递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生相关的递延所得税。

资产负债表日，本集团根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

资产负债表日，本集团对递延所得税资产的账面价值进行复核。如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，减记的金额予以转回。

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

- 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；
- 递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债。

27. 租赁

经营租赁的会计处理方法

经营租赁租入资产的租金费用在租赁期内按直线法确认为相关资产成本或费用。

28. 融资融券业务

融资融券业务，是指本集团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。本集团发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

本集团融资融券业务所融出的资金确认为应收债权，作为融出资金列示并确认相应利息收入；为融券业务购入的金融资产在融出前按照附注五、9 (1)的相关规定进行列示，融出后在资产负债表中不终止确认，继续按照附注五、9 (1)的相关规定进行会计处理，同时将相应利息收入计入当期损益。

29. 转融通业务核算方法

本集团通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由本集团享有或承担，不将其计入资产负债表。本集团根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

30. 股利分配

资产负债表日后，经审议批准的利润分配方案中拟分配的股利或利润，不确认为资产负债表日的负债，在附注中单独披露。

31. 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成本集团的关联方。本集团及本公司的关联方包括但不限于：

- (a) 本公司的母公司；
- (b) 本公司的子公司；
- (c) 与本公司受同一母公司控制的其他企业；
- (d) 对本集团实施共同控制或重大影响的投资方；
- (e) 与本集团同受一方控制、共同控制的企业或个人；
- (f) 本集团的合营企业，包括合营企业的子公司；
- (g) 本集团的联营企业，包括联营企业的子公司；
- (h) 本集团的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员；
- (i) 本集团的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员；
- (j) 本公司母公司的关键管理人员；
- (k) 与本公司母公司关键管理人员关系密切的家庭成员；及
- (l) 本集团的主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制的其他企业。

除上述按照企业会计准则的有关要求被确定为本集团或本公司的关联方以外，根据证监会颁布的《上市公司信息披露管理办法》的要求，以下企业或个人（包括但不限于）也属于本集团或本公司的关联方：

- (m) 持有本公司5% 以上股份的企业或者一致行动人；
- (n) 直接或者间接持有本公司5% 以上股份的个人及与其关系密切的家庭成员，上市公司监事及与其关系密切的家庭成员；
- (o) 在过去12个月内或者根据相关协议安排在未来12月内，存在上述(a) ， (c) 和 (m) 情形之一的企业；
- (p) 在过去12个月内或者根据相关协议安排在未来12月内，存在(i) ， (j) 和(n) 情

形之一的个人；及(q) 由 (i) , (j) , (n) 和(p) 直接或者间接控制的、或者担任董事、高级管理人员的，除本公司及其控股子公司以外的企业。

32. 风险准备计提

本公司根据《金融企业财务规则》(中华人民共和国财政部令第42号)及其实施指南(财金[2007] 23号) 的规定，以及证监会颁布的《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320号) 的要求，按照当期净利润的10%提取一般风险准备；本公司根据《证券法》和证监机构字[2007]320号的规定，按照当期净利润的10%提取交易风险准备金。提取的一般风险准备和交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算。

33. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。经营分部，是指集团内同时满足下列条件的组成部分：

- 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 本集团管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 本集团能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时在以下方面具有相似性的，可以合并为一个经营分部：

- 劳务的性质；
- 劳务的客户类型；
- 提供劳务的方式；
- 提供劳务受法律、行政法规的影响。

本集团在编制分部报告时，分部间交易收入按实际交易价格为基础计量。编制分部报告所采用的会计政策与编制本集团财务报表所采用的会计政策一致。

34. 主要会计估计及判断

编制财务报表时，本集团管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本集团管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

除附注七、17和附注十一载有关于商誉减值和金融工具公允价值估值涉及的假设和风险因素的数据外，其他主要估计金额的不确定因素如下：

- 可供出售金融资产及持有至到期投资的减值

在确定是否存在客观证据表明可供出售金融资产及持有至到期投资已发生减值时，本集团定期评估上述资产是否出现了公允价值严重或非暂时性低于其成本或账面价值，或者被投资方的财务状况和商业前景(例如行业前景、技术变革以及经营和融资现金流量)表明上述资产已发生减值的客观证据。这要求管理层运用大量判断，而判断会影响因此确认的减值损失的金额。

- 应收款项减值

如附注五、10所述，本集团在资产负债表日审阅按摊余成本计量的应收款项，以评估是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。减值的客观

证据包括显示个别应收款项预计未来现金流量出现大幅下降的可观察数据、显示个别或组合应收款项中债务人财务状况出现重大负面变动的可观察数据等事项。如果有证据表明该应收款项的价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，则将原确认的减值损失或组合予以转回。

- 除金融资产外的其他资产减值

如附注五、19所述，本集团在资产负债表日对除金融资产外的其他资产进行减值评估，以确定资产可收回金额是否下跌至低于其账面价值。如果情况显示长期资产的账面价值可能无法全部收回，有关资产便会视为已减值，并相应确认减值损失。

可收回金额是资产 (或资产组) 的公允价值减去处置费用后的净额与资产 (或资产组) 预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。由于本集团不能可靠获得资产 (或资产组) 的公开市价，且不能可靠估计资产的公允价值。因此，本集团将预计未来现金流量的现值作为可收回金额。在预计未来现金流量现值时，需要对该资产 (或资产组) 生产产品的产量、售价、相关经营成本以及计算现值时使用的折现率等作出重大判断。本集团在估计可收回金额时会采用所有能够获得的相关资料，包括根据合理和可支持的假设所作出有关产量、售价和相关经营成本的预测。

- 投资性房地产、固定资产、无形资产等资产的折旧和摊销

如附注五、12、13和16所述，本集团对投资性房地产、固定资产和无形资产等资产在考虑其残值后，在使用寿命内计提折旧和摊销。本集团定期审阅相关资产的使用寿命，以决定将计入每个报告期的折旧和摊销费用数额。资产使用寿命是本集团根据对同类资产的已往经验并结合预期的技术改变而确定。如果以前的估计发生重大变化，则会在未来期间对折旧和摊销费用进行调整。

- 递延所得税资产

在估计未来期间能够取得足够的应纳税所得额用以利用可抵扣暂时性差异时，本集团以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限，并以预期收回该资产期间的适用所得税税率为基础计算并确认相关递延所得税资产。本集团需要运用判断来估计未来取得应纳税所得额的时间和金额，并根据现行的税收政策及其他相关政策对未来的适用所得税税率进行合理的估计和判断，以决定应确认的递延所得税资产的金额。如果未来期间实际产生的利润的时间和金额或者实际适用所得税税率与管理层的估计存在差异，该差异将对递延所得税资产的金额产生影响。

- 合并范围的确定

在评估本集团作为投资方是否控制了被投资方时需考虑所有事实和情况。判断是否存在控制的原则包括三个要素：(i)拥有对被投资方的权力；(ii)因参与被投资方的相关活动而享有可变回报；且(iii)有能力运用其对被投资方的权力影响其回报的金额。在有情况表明上述三个要素的一个或多个要素发生变动时，本集团会对本集团是否对被投资方依然存在控制进行重新评估。

对于本集团担任资产管理方的资产管理计划，本集团会持续评估因管理该资产管理计划而获得的薪酬水平和面临的可变回报风险程度是否表明本集团为该资产管理计划的主要责任人。如本集团为该资产管理计划的主要责任人，应将上述资产管理计划纳入合并范围。

35. 重要会计政策和会计估计的变更

(1)、重要会计政策变更

☐适用 ☒不适用

(2)、重要会计估计变更

√适用 □不适用

会计估计变更的内容和原因	审批程序	开始适用的时点	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)
见说明	经华泰证券第三届董事会第十六次会议审议通过	2015年1月1日	采用未来适用法,对以前年度无影响

其他说明

1、应收账款和其他应收款坏账准备计提比例变更

账龄	原计提比例 (%)	变更后计提比例 (%)
1年以内	0.3	0.5
1-2年	0.3	5
2-3年	0.3	10
3年以上	50-100	50

2、固定资产认定标准

	原认定标准	变更后认定标准
单位价值	人民币2000元	人民币5000元

六、 税项

主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额,在扣除当期允许抵扣的进项税额后,差额部分为应交增值税	17%
消费税		
营业税	按应税营业收入计征	5%
城市维护建设税	按实际缴纳营业税及应交增值税计征	7%和5%
企业所得税	按应纳税所得额计征	25%
教育费附加	按实际缴纳营业税及应交增值税计征 3%	3%
地方教育费附加	按实际缴纳营业税及应交增值税计征 2%	2%

存在不同企业所得税税率纳税主体的,披露情况说明

√适用 □不适用

纳税主体名称	所得税税率
本公司及本公司的境内子公司	25%
华泰金融控股(香港)有限公司	16.5%

七、合并财务报表项目注释

1、货币资金

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	525,675.08	/	/	542,256.36
人民币	/	/	511,281.30	/	/	416,655.61
美元	86	6.1136	525.77	9,750.00	6.119	59,660.25
港元	17,585.61	0.7886	13,868.01	83,585.37	0.7889	65,940.50
银行存款：	/	/	283,034,297,479.72	/	/	89,863,864,476.74
其中：自有资金	/	/	114,145,228,229.23	/	/	36,000,547,912.96
人民币	/	/	109,220,235,609.72	/	/	33,504,075,873.17
美元	154,273,708.28	6.1136	943,167,742.94	351,530,354.25	6.1190	2,151,014,237.66
港元	5,046,982,628.57	0.7886	3,980,050,500.89	430,431,297.33	0.7889	339,567,250.46
其他			1,774,375.68			5,890,551.67
客户资金	/	/	168,889,069,250.49	/	/	53,863,316,563.78
人民币	/	/	166,525,874,732.36	/	/	52,993,678,955.91
美元	167,081,378.07	6.1136	1,021,468,712.97	93,868,257.21	6.119	574,379,865.87
港元	1,694,098,899.84	0.7886	1,335,966,392.41	369,397,490.24	0.7889	291,417,680.05
其他			5,759,412.75			3,840,061.95
其他货币资金：	/	/	626,588,230.17	/	/	537,197.32
人民币	/	/	496,453,340.42	/	/	537,197.32
美元	21,286,130.88	6.1136	130,134,889.75			
人民币						
合计	/	/	283,661,411,384.97	/	/	89,864,943,930.42

其中，融资融券业务：

☐适用 ☒不适用

货币资金的说明

使用受限制的货币资金

使用受限制的货币资金为纳入合并范围内的华泰紫金天天发集合资产管理计划和华泰紫金1号集合资产管理计划根据合同约定计提的风险准备金。截至2015年6月30日，上述风险准备金为人民币157,666,567.25元(2014年:人民币69,502,847.18元)。

2、结算备付金

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有备付金：	/	/	1,973,017,841.85	/	/	544,254,747.89
人民币	/	/	1,964,490,987.38	/	/	542,208,764.93
港元	10,812,648.32	0.7886	8,526,854.47	2,593,463.00	0.7889	2,045,982.96
人民币						
客户备付金：	/	/	39,338,795,331.37	/	/	17,672,993,684.50
人民币	/	/	28,492,892,795.69	/	/	14,885,928,649.00
美元	15,115,286.74	6.1136	92,408,817.01	33,716,761.46	6.119	206,312,863.37
港元	244,397,545.83	0.7886	192,731,904.64	194,081,154.29	0.7889	153,110,622.62
人民币（客户信用备付金）			10,560,761,814.03			2,427,641,549.51

信用备付金:	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
人民币						
人民币						
合计	/	/	41,311,813,173.22	/	/	18,217,248,432.39

3、融出资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	111,256,872,162.15	61,180,199,541.62
机构	3,421,119,312.15	3,456,539,915.63
合计	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况:

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63
债券	22,872,628.17	69,168,002.51
股票	309,072,606,082.51	154,450,637,084.22
基金	4,038,510,304.24	1,852,965,653.88
合计	342,652,360,810.25	166,202,404,931.24

融出资金的说明

(1)按类别列示

	2015年6月30日	2014年12月31日
融资融券业务融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25
减：减值准备	-	-
融出资金净值	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25

于2015年6月30日，本公司将上述融资融券业务中计人民币59,140,852,043.86元的债权收益权进行了质押式回购(参见附注七、25)。

于2014年12月31日，本公司将上述融资融券业务中计人民币44,931,541,941.58元的债权收益权进行了质押式回购(参见附注七、25)。

(2)按账龄分析

2015年6月30日	
账面余额	坏账准备

	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
1-3个月	106,041,540,962.52	92.47%	-	-
3-6个月	8,504,691,902.21	7.42%	-	-
6个月以上	131,758,609.57	0.11%	-	-
合计	114,677,991,474.30	100.00%	-	-

2014年12月31日

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
1-3个月	60,057,893,325.93	92.91%	-	-
3-6个月	4,561,593,289.96	7.06%	-	-
6个月以上	17,252,841.36	0.03%	-	-
合计	64,636,739,457.25	100.00%	-	-

4、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
	公允价值			初始投资成本		
项目	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	39,557,354,484.34		39,557,354,484.34	39,012,999,286.63		39,012,999,286.63
基金	22,497,528,757.34		22,497,528,757.34	22,453,611,410.57		22,453,611,410.57
股票	20,650,431,815.92		20,650,431,815.92	19,885,733,452.32		19,885,733,452.32
其他	1,130,766,116.01	1,061,111,111.05	2,191,877,227.06	1,124,124,865.71	1,000,000,000.00	2,124,124,865.71
合计	83,836,081,173.61	1,061,111,111.05	84,897,192,284.66	82,476,469,015.23	1,000,000,000.00	83,476,469,015.23
期初余额						
	公允价值			初始投资成本		
项目	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	34,486,847,798.83		34,486,847,798.83	34,284,489,376.81		34,284,489,376.81
基金	12,186,904,749.73		12,186,904,749.73	12,004,688,204.40		12,004,688,204.40
股票	8,360,220,307.03		8,360,220,307.03	7,190,879,869.01		7,190,879,869.01
其他	965,985,061.16		965,985,061.16	964,805,061.16		964,805,061.16
合计	55,999,957,916.75		55,999,957,916.75	54,444,862,511.38		54,444,862,511.38

其他说明

(1) 变现有限制的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

	限制条件	2015年6月30日	2014年12月31日
国债	质押	3,060,885,160.00	-
金融债	质押	679,717,730.00	24,049,513.12
企业债	质押	7,460,278,928.50	8,099,822,039.18
公司债	质押	547,865,299.03	186,744,244.19
中期票据	质押	3,472,751,636.00	1,469,510,366.88
短期融资券	质押	691,071,920.00	1,309,645,862.87
地方债	质押	421,564,540.00	55,112,695.00
政府支持机构债	质押	145,385,164.00	
非公开定向债务融资工具	质押	50,222,950.00	
股票	已融出证券	287,442,576.89	529,303,443.65
基金	已融出证券	37,116,879.30	520,458,560.66
合计		16,854,302,783.71	12,194,646,725.55

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产变动情况说明

截至2015年6月30日，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产较2014年12月31日增加人民币288.97亿元，增长比例为52.97%，主要是本年自营规模增加以及纳入合并范围的结构化主体的投资规模增加所致。

5、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具				22,970,058,300.00	27,101,145.10	-93,122,402.76				14,914,052,444.12	17,329,494.06	-49,159,811.36
- 国债期货				155,288,300.00	-	-				57,933,444.12	-	-
- 利率互换				22,814,770,000.00	27,101,145.10	-93,122,402.76				14,856,119,000.00	17,329,494.06	-49,159,811.36
货币衍生工具				245,688,000.00	959,573.84	-818,069.12						

- 货币互换				245,688,000.00	959,573.84	-818,069.12						
权益衍生工具				20,982,007,452.08	289,178,980.04	-1,222,016,227.13				10,820,955,789.53	3,482,104.61	-681,583,331.57
- 股指期货				11,567,242,740.00						6,768,392,836.55	-	-
- 权益互换				8,657,463,712.08	273,646,674.20	-1,191,944,037.00				3,941,640,000.00	3,407,471.99	-681,564,266.92
- 场内期权				678,351,000.00	15,532,305.84	-29,350,947.47				10,922,952.98	74,632.62	-19,064.65
- 场外期权				78,950,000.00	-	-721,242.66				100,000,000.00	-	-
信用衍生工具（按类别列示）				245,688,000.00	567,580.04	-2,836,555.31						
- 信用违约互换				245,688,000.00	567,580.04	-2,836,555.31						
其他衍生工具（按类别				15,815,190,800.00	-	-523,682,080.19				249,871,145.00	3,060.00	

- 商品期货			13,415,800.00	-	-260,940.19			249,871,145.00	3,060.00	
- 远期合约			15,801,775,000.00	-	-523,421,140.00					
合计			60,258,632,552.08	317,807,279.02	-1,842,475,334.51			25,984,879,378.65	20,814,658.67	-730,743,142.93

衍生金融工具的说明：

(i) 本集团进行的国债期货交易为每日无负债结算。于2015年6月30日，本集团持有的用于非套期的未到期国债期货合约的公允价值为浮盈人民币213,016.43元 (2014年12月31日:浮亏人民币 90,155.88元)，与本集团因参与该国债期货交易所确认的相关金融资产或负债相互抵销。

(ii) 2015年本集团进行的在上海清算所集中清算的利率互换交易为每日无负债结算。于2015年6月30日，本集团持有在上海清算所集中清算用于非套期的未到期利率互换合约的公允价值为浮亏人民币39,824,541.85元 (2014年12月31日: 浮盈人民币 54,144,141.03元)，与本集团因参与该利率互换交易所确认的相关金融负债相互抵销。

(iii)本集团进行的股指期货交易为每日无负债结算。于2015年6月30日，本集团持有的用于非套期的未到期股指期货合约的公允价值为浮盈人民币865,553,186.95元 (2014年12月31日: 浮亏人民币230,155,289.19元)，与本集团因参与该股指期货交易所确认的相关金融资产或负债相互抵销。

(iv)本集团通过期货子公司和华泰创新进行的商品期货交易为每日无负债结算。于2015年6月30日，本集团持有通过期货子公司进行交易用于非套期的未到期商品期货合约的公允价值为浮盈人民币1,485,050.00元 (2014年12月31日: 浮亏人民币 4,598,835.00元)，与本集团因参与该商品期货交易所确认的相关金融资产相互抵销。

6、买入返售金融资产

√适用 □不适用

(1) 按金融资产种类

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	19,895,299,197.92	15,111,424,226.64
债券	4,170,729,175.34	5,035,830,693.46
其他	637,087,890.50	562,771,101.54
减：减值准备		
买入返售金融资产账面价值	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64

(2) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	6,601,817,019.20	5,776,242,073.13
一个月至三个月内	3,014,815,634.04	858,369,398.59
三个月至一年内	11,884,526,110.52	11,675,294,549.92
一年以上	3,201,957,500.00	2,400,120,000.00
合计	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64

买入返售金融资产的说明：

(3) 按业务类别列示

	2015年6月30日	2014年12月31日
约定购回式证券	56,621,700.00	593,043,178.59
股票质押式回购	19,843,331,065.22	14,518,381,048.05
债券质押式回购	4,067,100,000.00	2,889,578,174.73
债券买断式回购	101,628,575.34	-
其他	634,434,923.20	2,709,023,620.27
减：减值准备	-	-
合计	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64

(4) 按交易场所类别列示

	2015年6月30日	2014年12月31日
证券交易所	20,017,652,765.22	15,723,898,271.64
银行间同业市场	4,051,028,575.34	4,389,356,308.46
其他	634,434,923.20	596,771,441.54
减：减值准备	-	-
合计	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64

(5) 担保物信息

于2015年6月30日，本集团买入返售金融资产的担保物公允价值为人民币84,498,812,893.55元（2014年：人民币50,877,452,661.31元）。

7、应收款项

(1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

应收清算款	961,486,137.72	2,641,557.66
应收经纪、交易商及结算所	256,122,377.14	244,161,910.02
应收手续费及佣金	215,081,070.28	103,487,138.88
应收实物销售款	165,838,926.19	-
其他	80,506,418.96	12,760,495.42
合计	1,679,034,930.29	363,051,101.98
减：减值准备	1,219,475.79	397,889.36
应收款项账面价值	1,677,815,454.50	362,653,212.62

(2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	1,676,324,930.29	99.86	1,211,345.79	0.06	360,341,101.98	99.26	389,759.36	0.11
1-2年	2,590,000.00	0.14	7,770.00	0.3	2,590,000.00	0.71	7,770.00	0.3
2-3年	120,000.00	0	360	0.3	120,000.00	0.03	360	0.3
3年以上								
合计	1,679,034,930.29	100	1,219,475.79	0.06	363,051,101.98	100	397,889.36	0.11

(3) 按评估方式列示

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提减值准备								
组合计提减值准备	1,679,034,930.29	100	1,219,475.79	0.06	363,051,101.98	100	397,889.36	0.11
合计	1,679,034,930.29	100	1,219,475.79	0.06	363,051,101.98	100	397,889.36	0.11

(4) 单项计提坏账准备的应收款项

本集团并无单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项。

(5) 本年计提、收回或转回的坏账准备情况：

2015年6月30日 2014年12月31日

年初余额	397,889.36	55,215.32
本年计提	821,586.43	342,674.04
本年收回或转回	-	-
本年核销	-	-

年末余额 1,219,475.79 397,889.36

8、应收利息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
债券投资	1,146,821,312.78	810,917,648.72
存放金融同业	372,279,571.60	201,753,767.14
资金拆借		
融资融券	892,991,621.27	372,840,366.92
买入返售	422,895,142.11	280,713,504.59
其他	62,504,292.65	85,451,821.80
合计	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17

9、存出保证金

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
交易保证金	519,529,825.00	227,002,325.49
信用保证金	753,144,975.23	361,406,671.62
履约保证金		
期货保证金	5,363,743,235.96	3,894,435,986.66
合计	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77

存出保证金的说明：

其中：外币保证金

	2015年6月30日			2014年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
交易保证金：						
美元	70,000.00	6.1136	427,952.00	70,000.00	6.1190	428,330.00
港币	7,000,000.00	0.7886	5,520,200.00	6,900,000.00	0.7889	5,443,410.00
合计			5,948,152.00			5,871,740.00

	2015年6月30日			2014年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
期货保证金：						
韩元	-	-	-	4,835,542.85	0.00566	27,369.17
合计			-			27,369.17

10、可供出售金融资产

√适用 □不适用

(1) 可供出售金融资产情况

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末				期初			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
债券	504,170,588.70	7,274,798.75	-	511,445,387.45	386,803,846.18	4,537,453.82	-	391,341,300.00
基金	464,336,707.39	6,938,718.24	-	471,275,425.63	341,080,178.61	1,350,316.25	-	342,430,494.86
股票	721,518,857.49	1,687,801,300.92	1,690,736.77	2,407,629,421.64	375,537,851.93	233,830,026.28	1,690,736.77	607,677,141.44
证券公司理财产品	125,811,016.14	21,561,103.55	-	147,372,119.69	212,785,355.42	-5,529,725.32	-	207,255,630.10
银行理财产品	105,000,000.00	663,173.14	-	105,663,173.14	275,000,000.00	-	-	275,000,000.00
信托计划	50,000,000.00	26,875,427.61	-	76,875,427.61	1,375,000,000.00	16,786,693.48	-	1,391,786,693.48
其他股权投资	2,871,943,222.86	3,908,839,777.00	5,716,470.66	6,775,066,529.20	2,238,010,130.86	2,385,675,596.95	5,716,470.66	4,617,969,257.15
其他	839,499,388.89	10,728,461.79	-	850,227,850.68	1,428,051,149.67	14,636,421.17	-	1,442,687,570.84
合计	5,682,279,781.47	5,670,682,761.00	7,407,207.43	11,345,555,335.04	6,632,268,512.67	2,651,286,782.63	7,407,207.43	9,276,148,087.87

(2) 截至报告期末可供出售金融资产的成本（摊余成本）、公允价值、累计计入其他综合收益的公允价值变动金额，以及已计提减值金额

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

可供出售金融资产分类	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/债务工具的摊余成本	4,367,108,803.88	1,315,170,977.59	5,682,279,781.47
公允价值	10,019,953,144.59	1,325,602,190.45	11,345,555,335.04
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	5,660,251,548.14	10,431,212.86	5,670,682,761.00
已计提减值金额	7,407,207.43	-	7,407,207.43

(3) 报告期内可供出售金融资产减值的变动情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

可供出售金融资产分类	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
期初已计提减值金额	7,407,207.43		7,407,207.43
本年计提			
其中：从其他综合收益转入			

本年减少			
其中：期后公允价值回升转回	/		
期末已计提减值金额	7,407,207.43		7,407,207.43

(4) 可供出售金融资产中的长期债权投资

债券项目	债券种类	面值	初始投资成本	年利率	到期日	期末余额
10郴州债	企业债	122,310,000.00	124,872,724.61	7.10%	2017年1月21日	125,979,300.00
10吴江债	企业债	114,000,000.00	112,621,121.57	6.40%	2018年12月23日	113,886,000.00
合计		236,310,000.00	237,493,846.18			239,865,300.00

(5) 变现受限制的可供出售金融资产

	限制条件	2015年6月30日	2014年12月31日
企业债	质押	115,750,300.00	116,052,000.00
证券公司	以管理人身份认购的		
理财产品	发行的集合资产管理计划	923,882,555.39	122,440,524.23
股票	已融出证券	8,620,875.25	7,865,357.43
股票	存在限售期限(注)	682,937,795.36	-
基金	存在限售期限(注)	4,206,000.00	2,760,000.00
合计		1,735,397,526.00	249,117,881.66

注：存在限售期限的可供出售金融资产

	限制条件	2015年6月30日	2014年12月31日
神舟高铁	限售	544,281,729.44	-
众信旅游	限售	138,656,065.92	-
基金鸿阳	限售	4,206,000.00	2,760,000.00
合计		687,143,795.36	2,760,000.00

11、持有至到期投资

√适用 □不适用

持有至到期投资情况

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额	期末公允价值
债券	5,000,000.00	5,000,000.00	
其中（按类别列示）：			
企业债	5,000,000.00	5,000,000.00	
其他			

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	

12、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
一、联营企业											
南方基金	1,359,324,049.23			155,569,517.24	34,418,981.96		-135,000,000.00			1,414,312,548.43	
华泰柏瑞	243,389,084.64			45,432,903.21	8,770,501.59					297,592,489.44	
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	256,523,312.65	193,000,000.00		-3,498,476.49	-					446,024,836.16	
江苏小微企业融资产品交易中心有限责任公司	15,251,156.95									15,251,156.95	
小计	1,874,487,603.47	193,000,000.00	-	197,503,943.96	43,189,483.55		-135,000,000.00			2,173,181,030.98	
合计	1,874,487,603.47	193,000,000.00	-	197,503,943.96	43,189,483.55		-135,000,000.00			2,173,181,030.98	

13、投资性房地产

√适用 □不适用

投资性房地产计量模式

(1). 采用成本计量模式的投资性房地产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1.期初余额	774,907,422.94			774,907,422.94
2.本期增加金额	139,826,349.35			139,826,349.35
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\在建工程转入	139,826,349.35			139,826,349.35
(3) 企业合并增加				
3.本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4.期末余额	914,733,772.29			914,733,772.29

二、累计折旧和累计摊销				
1.期初余额	-96,378,911.10			-96,378,911.10
2.本期增加金额	-79,242,318.77			-79,242,318.77
(1) 计提或摊销	-11,370,577.75			-11,370,577.75
固定资产转入	-67,871,741.02			-67,871,741.02
3.本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4.期末余额	-175,621,229.87			-175,621,229.87
三、减值准备				
1.期初余额	4,547,017.71			4,547,017.71
2.本期增加金额				
(1) 计提				
3、本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4.期末余额	4,547,017.71			4,547,017.71
四、账面价值				
1.期末账面价值	734,565,524.71			734,565,524.71
2.期初账面价值	673,981,494.13			673,981,494.13

(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况:

√适用 □不适用

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
深圳市福田区彩田路2014-9号福源大厦裙楼1层	2,916,833.64	注1
上海市浦东新区乳山路229号1-3层	53,165,063.70	注2
天津市河西区大沽南路387号	4,605,867.28	注3
哈尔滨道里区西十六道街15号3-7层	9,475,482.42	注4
哈尔滨南岗区马端头道街110号车库1号楼7-8车库	117,531.72	注4
海口市龙昆北路38号华银大厦11层	2,461,916.41	注5
北京西城区月坛北街2号A座14层2-5	31,027,253.76	注6
济南市历下区趵突泉北路1号117、118	32,710,087.30	注7
大连保税区黄海西四路201号国商大厦5层1-13号、19号	14,450,065.47	注7

合计	150,930,101.70
----	----------------

其他说明

注1：该房产系由本公司深圳彩田路营业部1996年购买的只具有使用权的商业用房，使用期限50年，因历史原因尚未办妥房屋所有权证。

注2：该房产为经营性用房，因历史原因，目前仍未能办理相关权属分割手续。

注3：该房产系本公司2000年以前购买，因历史原因房屋所有权证户名仍为本公司前身江苏证券，无法办妥更名手续。

注4：该房产原为中国人民银行的资产，因历史原因转至本公司哈尔滨西十六道街营业部，无土地使用权证。

注5：该房产系于2005年因抵债抵偿入账本公司子公司华泰联合证券有限责任公司，因历史原因尚未办妥土地使用权证。

注6：该房产系本公司子公司华泰联合证券有限责任公司于2008年以前购买自用，因历史原因尚未办妥土地使用权证。

注7：2012年、2013年四通集团公司分别以此二处房产抵偿对本公司子公司华泰联合证券有限责任公司所负债务，因历史原因尚未办妥土地使用权证。

14、固定资产

(1). 固定资产情况

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	运输工具	电子设备	办公设备及其他设备	合计
一、账面原值：					
1.期初余额	1,310,880,862.36	148,607,487.19	580,585,619.61	87,297,526.08	2,127,371,495.24
2.本期增加金额	1,443,611,665.57	4,075,613.24	47,495,378.90	1,777,815.91	1,496,960,473.62
(1) 购置	240,776.57	4,075,613.24	47,495,378.90	1,777,815.91	53,589,584.62
(2) 在建工程转入	1,443,370,889.00				1,443,370,889.00
(3) 企业合并增加					
3.本期减少金额	139,826,349.35	671,924.58	61,226,808.46	2,854,393.24	204,579,475.63
(1) 处置或报废		671,924.58	61,226,808.46	2,854,393.24	64,753,126.28
(2) 转出至投资性房地产	139,826,349.35				139,826,349.35
4.期末余额	2,614,666,178.58	152,011,175.85	566,854,190.05	86,220,948.75	3,419,752,493.23
二、累计折旧					
1.期初余额	266,738,190.81	95,864,276.77	443,606,226.92	62,801,200.45	869,009,894.95
2.本期增加金额	27,629,956.72	7,524,344.85	36,525,354.35	5,815,336.51	77,494,992.43
(1) 计提	27,629,956.72	7,524,344.85	36,525,354.35	5,815,336.51	77,494,992.43

3.本期减少金额	67,871,741.02	651,766.84	59,280,685.98	2,527,720.65	130,331,914.49
(1) 处置或报废		651,766.84	59,280,685.98	2,527,720.65	62,460,173.47
(2) 转出至投资性房地产	67,871,741.02				67,871,741.02
4.期末余额	226,496,406.51	102,736,854.78	420,850,895.29	66,088,816.31	816,172,972.89
三、减值准备					
1.期初余额					
2.本期增加金额					
(1) 计提					
3.本期减少金额					
(1) 处置或报废					
4.期末余额					
四、账面价值					
1.期末账面价值	2,388,169,772.07	49,274,321.07	146,003,294.76	20,132,132.44	2,603,579,520.34
2.期初账面价值	1,044,142,671.55	52,743,210.42	136,979,392.69	24,496,325.63	1,258,361,600.29

于2015年6月30日，本集团及本公司管理层认为无需对固定资产计提减值准备(2014年：无)。

(2). 暂时闲置的固定资产情况

☐适用 ☒不适用

(3). 通过融资租赁租入的固定资产情况

☐适用 ☒不适用

(4). 通过经营租赁租出的固定资产

☐适用 ☒不适用

(5). 未办妥产权证书的固定资产情况

☒适用 ☐不适用

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
深圳市福田区彩田路2014-9号福源大厦裙楼1-2层	6,450,734.49	注1
江苏省南通市环城西路18号银都大厦2-3层	1,928,465.22	注2
深圳市保税区桂花路西段21号红树福苑5栋A座1105-1108房、4栋A座2109房	1,492,514.40	注3

深圳市宝深路南松坪村三期经济适用房西区2栋2J、2K号	439,299.14	注3
连云港市新浦区登泰新村H号楼2单元201、202室；3单元201室	631,718.70	注4
辽宁营口市站前区渤海大街东16-甲1号	6,097,078.42	注5
哈尔滨道里区西十六道街15号办公楼1-2层、8层	4,621,889.18	注6
郑州市金水区农业路16号1号楼1-2层101号、3层305号	20,325,062.57	注7
四川省成都市锦江区点将台横街51号2栋1层9号、3栋6单元2-7楼	1,050,574.87	注8
成都市武侯区燃灯寺北街184号1栋4单元4层7、8号	333,288.62	注8
广东省深圳市福田区福田中路统建商住楼丙幢8D	202,162.12	注9
合计	43,572,787.73	

其他说明：

注1：该房屋系本公司深圳彩田路营业部1996年购买的只具有使用权的商业用房，因历史原因尚未办妥房屋所有权证。

注2：该房屋系本公司南通环城西路营业部于2006年以前购买并使用，因历史原因尚未办妥房屋所有权证。

注3：福利房无房屋所有权证。

注4：该房屋系本公司连云港通灌南路证券营业部所有，因历史原因尚未办妥土地使用权证。

注5：该房屋因项目未整体竣工无法单独办理土地使用权证，开发商已就协助办理土地使用权证事项出具承诺函。

注6：该房屋原为中国人民银行国有资产，后转至哈尔滨西十六道街营业部，因历史原因尚未办妥土地使用权证。

注7：该房屋系郑州农业街营业部因2007年合并信泰证券所接收，土地使用权证为大厦整体所有。

注8：该房物实际所有人与房屋所有权证户名不符，正办理更名手续。

注9：该房屋系因2009年合并本公司子公司华泰联合证券有限责任公司所接收，因股东变更等历史原因，房屋实际所有人与房屋所有权证户名不符。

15、在建工程

√适用 □不适用

(1). 在建工程情况

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	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	1,058,720,263.04		1,058,720,263.04	2,019,887,424.19		2,019,887,424.19
其他工程	27,449,805.07		27,449,805.07	25,437,333.87		25,437,333.87
合计	1,086,170,068.11		1,086,170,068.11	2,045,324,758.06		2,045,324,758.06

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	预算数	期初余额	本期增加金额	本期转入固定资产金额	本期其他减少金额	期末余额	工程累计投入占预算比例(%)	工程进度	利息资本化累计金额	其中：本期利息资本化金额	本期利息资本化率(%)	资金来源
华泰证券广场	2,707,580,000.00	2,019,887,424.19	482,203,727.85	-1,443,370,889.00		1,058,720,263.04	92.41	92.41	10,002,760.12	8,467,560.88	6.00	金融机构贷款
其他工程		25,437,333.87	2,948,862.04		-936,390.84	27,449,805.07						
合计	2,707,580,000.00	2,045,324,758.06	485,152,589.89	-1,443,370,889.00	-936,390.84	1,086,170,068.11	/	/	10,002,760.12	8,467,560.88	/	/

(3). 本期计提在建工程减值准备情况：

□适用 √不适用

16、无形资产

(1). 无形资产情况

单位：元 币种：人民币

项目	土地使用权	交易席位费	软件	合计
一、账面原值				
1.期初余额	359,161,122.60	125,565,772.11	258,117,313.61	742,844,208.32
2.本期增加金额			30,967,144.57	30,967,144.57
(1)购置			30,967,144.57	30,967,144.57
(2)内部研发				
(3)企业合并				

增加				
3.本期减少金额			203,304.20	203,304.20
(1)处置			203,304.20	203,304.20
4.期末余额	359,161,122.60	125,565,772.11	288,881,153.98	773,608,048.69
二、累计摊销				
1.期初余额	49,339,951.49	123,526,747.18	168,766,550.62	341,633,249.29
2.本期增加金额	3,598,607.60	410,246.63	33,428,108.70	37,436,962.93
(1) 计提	3,598,607.60	410,246.63	33,428,108.70	37,436,962.93
3.本期减少金额			203,304.20	203,304.20
(1)处置			203,304.20	203,304.20
4.期末余额	52,938,559.09	123,936,993.81	201,991,355.12	378,866,908.02
三、减值准备				
1.期初余额				
2.本期增加金额				
(1) 计提				
3.本期减少金额				
(1)处置				
4.期末余额				
四、账面价值				
1.期末账面价值	306,222,563.51	1,628,778.30	86,889,798.86	394,741,140.67
2.期初账面价值	309,821,171.11	2,039,024.93	89,350,762.99	401,210,959.03

(2). 未办妥产权证书的土地使用权情况:

☐适用 ☒不适用

其他说明:

于2015年6月30日, 本集团及本公司管理层认为无需对无形资产计提减值准备(2014年: 无)。

17、商誉

☒适用 ☐不适用

(1). 商誉账面原值

单位: 元 币种: 人民币

被投资单位名称或	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
----------	------	------	------	------

形成商誉的事项		企业合并形成的		处置		
华泰联合证券有限责任公司	51,089,439.80					51,089,439.80
华泰期货有限公司	252,127.50					252,127.50
合计	51,341,567.30					51,341,567.30

(2). 商誉减值准备

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加		本期减少		期末余额
		计提		处置		
投行业务	51,089,439.80					51,089,439.80
期货经纪业务	252,127.50					252,127.50
合计	51,341,567.30					51,341,567.30

说明商誉减值测试过程、参数及商誉减值损失的确认方法

(a) 本集团于2006年支付人民币702,563,500.00元合并成本收购了华泰联合证券有限责任公司70%的权益。合并成本超过按比例获得的华泰联合证券有限责任公司可辨认资产、负债公允价值的差额人民币51,089,439.80元，确认为与华泰联合证券有限责任公司相关的商誉。

(b) 本集团于2006年支付人民币29,580,000.00元合并成本收购了长城伟业期货经纪公司（现更名为“华泰期货有限公司”）60%的权益。合并成本超过按比例获得的长城伟业期货经纪公司可辨认资产、负债公允价值的差额人民币252,127.50元，确认为与长城伟业期货经纪公司相关的商誉。

其他说明

各资产组的可收回金额根据预计未来现金流量现值的方法确定。本集团根据管理层批准的最近未来5年财务预算和相应的折现率预计资产组的未来现金流量现值。超过5年财务预算之后年份的现金流量均保持稳定。对可回收金额的预计结果并没有导致确认减值损失。

18、长期待摊费用

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加金额	本期摊销金额	其他减少金额	期末余额
固定资产改良支出	102,451,274.31	8,925,771.21	26,738,900.00		84,638,145.52
其他	6,402,357.01	98,999.81	337,824.57		6,163,532.25
合计	108,853,631.32	9,024,771.02	27,076,724.57		90,801,677.77

19、递延所得税资产/递延所得税负债

(1). 未经抵销的递延所得税资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	410,918,887.49	102,729,721.87	417,761,158.81	104,440,289.70
内部交易未实现利润				
可抵扣亏损				
衍生金融工具的估值	697,540,268.11	174,385,067.03	888,086,001.67	222,021,500.42
尚未支付的职工薪酬	1,076,970,911.45	269,242,727.86	802,718,572.81	200,679,643.20
应付利息	1,126,504,243.41	281,626,060.86	740,295,810.51	185,073,952.63
其他			3,647,529.96	911,882.49
合计	3,311,934,310.46	827,983,577.62	2,852,509,073.76	713,127,268.44

(2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
非同一控制企业合并资产评估增值				
可供出售金融资产公允价值变动	4,012,724,441.30	1,003,181,110.32	2,421,306,504.40	605,326,626.10
交易性金融工具的估值	1,466,599,149.08	366,649,787.27	1,537,387,402.36	384,346,850.59
衍生金融工具的估值	1,485,100.00	371,275.00	-	-
应收利息	1,213,597,400.09	303,399,350.03	582,997,369.88	145,749,342.47
合计	6,694,406,090.47	1,673,601,522.62	4,541,691,276.64	1,135,422,819.16

(3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债：

□适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	-636,226,036.91	191,757,540.71	-534,249,277.00	178,877,991.44
递延所得税负债	636,226,036.91	-1,037,375,485.71	534,249,277.00	-601,173,542.16

(4). 未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异		
可抵扣亏损		24,655,180.15
合计		24,655,180.15

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

年份	期末金额	期初金额	备注
2015年			
2016年			
2017年			
2018年			
2019年及以后年度		24,655,180.15	
合计		24,655,180.15	/

20、其他资产

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	343,089,876.64	152,104,874.73
抵债资产	29,912,930.75	29,912,930.75
代理兑付债券		
待摊费用	29,130,420.73	32,464,388.98
预付投资款	110,055,000.00	-
应收股利	135,000,000.00	-
其他	56,326,212.15	91,059,894.64
合计	703,514,440.27	305,542,089.10

其他资产的说明：

其他应收款按类别分析如下

	2015年6月30日	2014年12月31日
其他应收款余额	714,016,803.70	530,765,146.82
减：坏账准备	(370,926,927.06)	(378,660,272.09)
其他应收款净值	343,089,876.64	152,104,874.73

21、资产减值准备变动表

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
----	------	------	------	------

			转回	转销	
买入返售金融资产减值准备					
坏账准备					
可供出售金融资产减值准备	7,407,207.43	-	-	-	7,407,207.43
投资性房地产减值准备	4,547,017.71	-	-	-	4,547,017.71
应收款项坏账准备	397,889.36	821,586.43	-	-	1,219,475.79
其他应收款坏账准备	378,660,272.09	1,623,183.60	4,876,200.00	4,480,328.63	370,926,927.06
抵债资产减值准备	26,112,930.76	-	-	-	26,112,930.76
其他资产减值准备	635,841.46	705,328.74	635,841.46		705,328.74
合计	417,761,158.81	3,150,098.77	5,512,041.46	4,480,328.63	410,918,887.49

22、应付短期融资款

项目	发行日期	到期日期	票面利率	年初账面余额	本年增加	本年减少	年末账面余额
短期融资券(注1)							
14华泰CP11	2014/10/15	2015/01/14	4.34%	3,000,000,000.00	-	(3,000,000,000.00)	-
14华泰CP12	2014/11/17	2015/02/11	4.15%	3,000,000,000.00	-	(3,000,000,000.00)	-
14华泰CP13	2014/12/11	2015/03/12	5.20%	2,500,000,000.00	-	(2,500,000,000.00)	-
15华泰CP01	2015/01/16	2015/04/16	4.77%	-	3,000,000,000.00	(3,000,000,000.00)	-
15华泰CP02	2015/02/10	2015/05/08	4.90%	-	3,000,000,000.00	(3,000,000,000.00)	-
15华泰CP03	2015/03/10	2015/06/09	4.99%	-	2,000,000,000.00	(2,000,000,000.00)	-
15华泰CP04	2015/04/09	2015/07/09	4.80%	-	3,000,000,000.00	-	3,000,000,000.00
短期融资券小计				8,500,000,000.00	11,000,000,000.00	(16,500,000,000.00)	3,000,000,000.00
短期公司债(注2)							
14华泰D1	2014/12/17	2015/08/18	6.00%	7,000,000,000.00	-	-	7,000,000,000.00
短期公司债小计				7,000,000,000.00	-	-	7,000,000,000.00
短期次级债(注3)							
14华泰01	2014/04/17	2015/04/21	5.95%	3,000,000,000.00	-	(3,000,000,000.00)	-
14华泰05	2014/11/19	2015/11/21	5.10%	4,000,000,000.00	-	-	4,000,000,000.00
14华泰02	2014/04/18	2016/04/21	6.15%	-	2,995,236,509.44	-	2,995,236,509.44
短期次级债小计				7,000,000,000.00	2,995,236,509.44	(3,000,000,000.00)	6,995,236,509.44
收益凭证(注4)			3.0%-6.2%	2,287,070,000.00	14,130,580,000.00	(9,043,063,000.00)	7,374,587,000.00
合计				24,787,070,000.00	28,125,816,509.44	(28,543,063,000.00)	24,369,823,509.44

注1：2014年中国人民银行以“银发[2014]112号”《关于华泰证券股份有限公司发行短期融资券的通知》核定本公司待偿还短期融资券的最高余额为人民币121亿元，有效期为一年。在有效期内，本公司可自主发行短期融资券。

注2：根据中国证监会《关于证券公司试点发行短期公司债券有关事宜的通知》(证券基金机构监管部函[2014]1526号)，本公司获准试点发行短期公司债券。本公司于2014年发行了一期短期公司债券，期限为一年以内，年利率为6%。

注3：2014年1月10日，中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司发行次级债券的

批复》核准本公司非公开发行面值不超过人民币160亿元的次级债券。2014年第四次临时股东大会审议通过的《关于公司发行次级债券的议案》，批准非公开发行面值不超过人民币500亿元的次级债券。1年期以上的次级债详见应付债券(附注七、36)，应付短期融资款中的次级债为1年期的短期次级债。

注4: 截至2015年6月30日六个月，本公司共发行56期收益凭证，按固定年利率3.0%-6.2%或与若干股指挂钩计算的浮息计息，将于一年内偿还。期末未到期产品的收益率为3.0%至6.2%。以浮息计算的收益凭证包含非密切关联的嵌入式衍生工具，理由是其回报与若干股指挂钩。对于嵌入式衍生工具而言，这些工具自脱离其各自合约后披露于附注七.5。期限一年以上的收益凭证披露于附注七.36。

23、拆入资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
银行拆入款项	1,900,000,000.00	
转融通融入款项	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00
合计	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00

拆入资金的说明：

(1) 银行拆入资金剩余期限和利率分析

2015年6月30日			2014年		
剩余期限	余额	利率	剩余期限	余额	利率
2天	500,000,000.00	3.61%	-	-	-
3天	800,000,000.00	3.60%	-	-	-
6天	300,000,000.00	2.95%	-	-	-
6天	300,000,000.00	3.60%	-	-	-
合计	1,900,000,000.00		合计	-	

(2) 转融通融入资金剩余期限和利率分析

2015年6月30日			2014年		
剩余期限	余额	利率	剩余期限	余额	利率
63天	500,000,000.00	6.3%	61天	500,000,000.00	5.8%
87天	750,000,000.00	6.3%	85天	750,000,000.00	5.8%
104天	250,000,000.00	6.3%	100天	250,000,000.00	5.8%
合计	1,500,000,000.00		合计	1,500,000,000.00	

24、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			期初公允价值		
	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
债券						
基金						
股票	27,674,075.61		27,674,075.61	9,244,846.63		9,244,846.63
黄金租赁	15,551,618,360.00		15,551,618,360.00			
其他		9,248,128.87	9,248,128.87			
合计	15,579,292,435.61	9,248,128.87	15,588,540,564.48	9,244,846.63		9,244,846.63

25、 卖出回购金融资产款

√适用 □不适用

(1) 按金融资产种类

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	49,715,100,000.00	40,116,100,000.00
债券	13,239,907,481.35	9,542,128,233.78
其他		10,000,000.00
合计	62,955,007,481.35	49,668,228,233.78

(2) 报价回购融入资金按剩余期限分类

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	500,000.00	0.80%	500,000.00	0.80%
一个月至三个月内				
三个月至一年内				
一年以上				
合计	500,000.00		500,000.00	

卖出回购金融资产款的说明：

(3) 按业务类别

	附注	2015年6月30日	2014年
债券质押式报价回购		500,000.00	500,000.00
信用业务债权收益权	(i)	49,715,100,000.00	40,116,100,000.00
其他		13,239,407,481.35	9,551,628,233.78
合计		62,955,007,481.35	49,668,228,233.78

(i) 截至2015年6月30日，质押的信用业务债权收益权所对应的债权金额为人民币

59,140,852,043.86元(2014年:44,931,541,941.58元)。

(4) 担保物信息

截至2015年6月30日, 卖出回购金融资产款的担保物公允价值为人民币73,652,795,702.76元(2014年:人民币56,536,601,734.42元)。

26、 代理买卖证券款

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	128,065,204,749.14	49,502,315,890.62
机构	47,555,699,721.72	10,896,454,798.77
合计	175,620,904,470.86	60,398,770,689.39

27、 代理承销证券款

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	32,249,996.32	
债券	8,260,967.11	41,400,000.00
其中: 国债		
金融债券		
企业债券	8,260,967.11	41,400,000.00
其他有价证券		
合计	40,510,963.43	41,400,000.00

28、 信用交易代理买卖证券款

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	29,306,496,266.53	9,407,507,240.13
机构	211,875,528.80	422,126,950.50
合计	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63

29、 应付职工薪酬

(1). 应付职工薪酬列示:

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,567,879,014.74	3,394,594,470.27	1,834,992,601.21	3,127,480,883.80
二、离职后福利-设定	3,980,890.21	66,609,270.25	69,282,948.62	1,307,211.84

提存计划				
三、辞退福利				
四、一年内到期的其他福利	168,737,005.00	630,287,170.00	168,737,005.00	630,287,170.00
合计	1,740,596,909.95	4,091,490,910.52	2,073,012,554.83	3,759,075,265.64

(2). 短期薪酬列示:

√适用 □不适用

单位: 元 币种:人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,556,645,064.12	3,276,714,348.69	1,721,163,821.83	3,112,195,590.98
二、职工福利费	11,550.90	29,216,319.50	29,105,669.86	122,200.54
三、社会保险费	11,259.56	36,555,804.78	36,547,168.41	19,895.93
其中: 医疗保险费	-	32,972,834.76	32,972,834.76	-
工伤保险费	8,743.52	1,577,509.23	1,574,414.11	11,838.64
生育保险费	2,516.04	2,005,460.79	1,999,919.54	8,057.29
四、住房公积金	-	40,137,638.65	39,670,250.81	467,387.84
五、工会经费和职工教育经费	11,211,140.16	11,970,358.65	8,505,690.30	14,675,808.51
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	1,567,879,014.74	3,394,594,470.27	1,834,992,601.21	3,127,480,883.80

2015年1-6月, 本公司向关键管理人员支付的薪酬总额为人民币1,389.36万元。

(3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	3,980,890.21	62,512,918.35	65,186,596.72	1,307,211.84
2、失业保险费	-	4,096,351.90	4,096,351.90	-
3、企业年金缴费				
合计	3,980,890.21	66,609,270.25	69,282,948.62	1,307,211.84

30、 应交税费

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税		
消费税		
营业税	249,240,858.44	122,259,832.84
企业所得税	1,579,550,771.46	358,644,988.75
个人所得税	1,130,888,826.22	923,365,523.11
城市维护建设税	16,828,652.02	8,715,356.51

教育费附加	10,971,662.87	5,635,558.80
房产税	8,031,763.74	6,315,615.55
其他	2,864,944.88	4,967,427.85
合计	2,998,377,479.63	1,429,904,303.41

31、 应付款项

√适用 □不适用

应付款项列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款	72,313,601.12	36,639,147.88
开放式基金申购款		2,409,017,622.69
应付赎回款	495,236,911.26	
应付收益互换业务款项	3,228,181,090.82	1,742,481,847.51
应付实物销售款	127,683,389.35	-
其他	26,009,661.84	6,066,762.51
合计	3,949,424,654.39	4,194,205,380.59

32、 应付利息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项 目	期末账面余额	期初账面余额
客户资金	19,238,723.31	7,039,251.84
拆入资金	27,103,750.00	24,770,833.33
其中：转融通融入资金	26,293,750.00	24,770,833.33
次级债券	719,632,990.90	362,250,000.01
应付债券	55,870,008.13	307,640,730.53
卖出回购	446,902,294.88	177,186,715.93
应付短期融资款	339,477,502.44	73,957,791.51
利率互换	67,047,377.01	72,218,345.97
黄金租赁	144,298,497.03	-
其他	2,024,111.87	262,929.83
合计	1,821,595,255.57	1,025,326,598.95

33、 应付股利

2015年6月30日

2014年

应付股利

13,096,640.00

15,452,840.00

34、预计负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	期末余额	形成原因
对外提供担保			
未决诉讼	0	0	
产品质量保证			
重组义务			
待执行的亏损合同			
其他			
合计	0	0	/

35、长期借款

√适用 □不适用

长期借款分类

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款		
抵押借款	367,095,074.05	138,657,783.84
保证借款		
信用借款		
合计	367,095,074.05	138,657,783.84

长期借款分类的说明：

长期借款明细

贷款单位	借款 起始日	借款 终止日	币种	利率	2015年6月30日	2014年
中国工商银行 股份有限公司	2014年 9月12日	2016年 3月11日	人民币	6.00%	367,095,074.05	138,657,783.84
合计					367,095,074.05	138,657,783.84

36、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	发行日期	债券期限	发行金额	票面利率	期末余额	期初余额
13华泰 01(1)	人民币 4,000,000,000.00	2013年6 月5日	5 年	人民币 4,000,000,000.00	4.68%	3,994,830,468.60	3,994,117,225.50
13华泰 02(1)	人民币 6,000,000,000.00	2013年6 月5日	10 年	人民币 6,000,000,000.00	5.10%	5,989,456,709.49	5,988,197,698.79

14华泰02(2)	人民币 3,000,000,000.00	2014年4月18日	2年	人民币 3,000,000,000.00	6.15%	-	2,992,295,154.46
14华泰03(3)	人民币 2,000,000,000.00	2014年9月26日	3年	人民币 2,000,000,000.00	5.70%	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
14华泰04(3)	人民币 4,000,000,000.00	2014年9月26日	4年	人民币 4,000,000,000.00	5.90%	4,000,000,000.00	4,000,000,000.00
15华泰债01(4)	人民币 6,600,000,000.00	2015年6月29日	3年	人民币 6,600,000,000.00	4.20%	6,600,000,000.00	-
15华泰01(5)	人民币 6,000,000,000.00	2015年1月22日	2年	人民币 6,000,000,000.00	5.90%	6,000,000,000.00	-
15华泰02(6)	人民币 7,000,000,000.00	2015年4月20日	2年	人民币 7,000,000,000.00	5.60%	7,000,000,000.00	-
15华泰03(6)	人民币 5,000,000,000.00	2015年4月20日	5年	人民币 5,000,000,000.00	5.80%	5,000,000,000.00	-
15华泰04(7)	人民币 18,000,000,000.00	2015年6月26日	2年	人民币 18,000,000,000.00	5.50%	18,000,000,000.00	-
HUATAI B1910(8)	美元400,000,000.00	2014年10月8日	5年	美元399,656,000.00	3.63%	2,443,778,349.20	2,370,714,056.56
长期限收益凭证(9)					5.2%-5.6%	9,900,000,000.00	-

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

(1)经证监会核准，本公司于2013年6月5日发行了5年期面值总额为人民币40亿元和10年期面值总额为人民币60亿元的债券。该两笔公司债于2013年7月17日在上海证券交易所上市。

(2)经证监会核准，本公司于2014年4月18日发行了2年期面值总额为人民币30亿元的次级债，本期转入应付短期融资款核算。

(3)经证监会核准，本公司于2014年9月26日发行了3年期面值总额为人民币20亿元的次级债和4年期面值总额为人民币40亿元的次级债。

(4)经证监会核准，本公司于2015年6月29日发行了3年期面值总额为人民币66亿元的公司债。

(5)本公司于2015年1月22日发行了2年期面值总额为人民币60亿元的次级债。

(6)本公司于2015年4月20日发行了面值总额为人民币120亿元的次级债,其中2年期品种（附第1年末发行人赎回选择权）发行规模为人民币70亿元，5年期品种（附第3年末发行人赎回选择权）发行规模为人民币50亿元。

(7)本公司于2015年6月26日发行了2年期面值总额为人民币180亿元的次级债。

(8)Huatai International Finance I Limited (本公司间接全资附属公司) 于2014年10月8日发行了5年期面值总额为4亿美元的债券(其中，本集团持有1,000万美元，后于2015年出售)。该笔债券由中国银行股份有限公司进行担保，本公司向中国银行股份有限公司提供了反担保。

(9)本公司于本年度共发行11期期限大于一年的收益凭证，未到期产品的收益率为5.2%至5.6%。

37、长期应付职工薪酬

☐适用 ☐不适用

(1) 长期应付职工薪酬表

☐适用 ☐不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、离职后福利-设定受益计划净负债		
二、辞退福利		
三、其他长期福利	928,328,940.93	874,171,345.93
减：一年内支付的部分	-630,287,170.00	-168,737,005.00
合计	298,041,770.93	705,434,340.93

(2) 设定受益计划变动情况

☐ 适用 ☒ 不适用

38、递延收益

☒ 适用 ☐ 不适用

单位：元 币种人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因
政府补助	16,671,063.72	1,000,000.00		17,671,063.72	补贴购置
合计	16,671,063.72	1,000,000.00		17,671,063.72	/

涉及政府补助的项目：

单位：元 币种：人民币

负债项目	期初余额	本期新增补助金额	本期计入营业外收入金额	其他变动	期末余额	与资产相关/与收益相关
购置办公用房	13,393,285.72				13,393,285.72	资产相关
交易平台建设	3,277,778.00	1,000,000.00			4,277,778.00	资产相关
合计	16,671,063.72	1,000,000.00			17,671,063.72	/

39、其他负债

☒ 适用 ☐ 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	1,784,978,762.20	956,784,071.20
代理兑付债券款	9,921,010.91	10,093,550.32
预提费用		
合并结构化主体形成的其他金融负债	99,164,059,877.24	49,903,536,079.61
应付私募基金其他有限合伙人净资产	2,593,561,299.18	843,786,589.23

期货风险准备金	86,963,929.45	80,168,609.59
其他	245,702,987.85	309,420,880.52
合计	103,885,187,866.83	52,103,789,780.47

其他负债的说明：

(a) 合并结构化主体形成的其他金融负债

合并结构化主体形成的其他金融负债为本集团纳入合并范围内结构化主体产生的应付其他权益持有人持有的权益。纳入合并范围的结构化主体信息详见附注九、4。

(b) 其他应付款

(i) 金额较大的其他应付款分析如下

	金额	款项性质
办公楼工程款	881,350,511.63	华泰证券河西办公楼应付工程款
上市费用	428,247,766.44	上市费用款项
应付经纪人佣金	155,000,000.00	经纪人业务款项
应付证券投资者保护基金款项	81,309,707.40	应付保护基金款项
应付经纪人风险金	55,445,767.15	经纪人业务风险款项
应付亚洲证券清算款	15,414,654.81	应付清算组款项
合计	1,616,768,407.43	

(ii) 账龄超过1年的重要其他应付款的情况如下

项目	年末余额	未偿还原因及资产负债表日后偿还金额
应付亚洲证券清算款	15,414,654.81	清算组已解散
应付江苏省财政厅	6,145,828.00	历史遗留问题
合计	21,560,482.81	

(c) 期货风险准备金

本集团下设子公司华泰期货有限公司根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按商品和金融期货经纪业务手续费收入的5%计提期货风险准备并计入当期损益，动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

40、股本

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减（+、-）	期末余额
--	------	-------------	------

		发行 新股	送股	公积金 转股	其他	小计	
股份总 数	5,600,000,000.00	1,562,768,800.00				1,562,768,800.00	7,162,768,800.00

41、资本公积

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	17,219,527,624.57	28,634,704,003.75	-	45,854,231,628.32
其他资本公积	1,733,175.40	-	-	1,733,175.40
合计	17,221,260,799.97	28,634,704,003.75	-	45,855,964,803.72

42、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上期金额
1. 可供出售金融资产产生的利得（损失）金额	2,056,720,326.18	-12,263,311.44
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	397,854,484.23	-5,666,977.06
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	22,356,892.97	10,345,579.72
小计	1,636,508,948.98	-16,941,914.10
2. 按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额	43,189,483.55	-166,346.65
减：按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额产生的所得税影响	-	-
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	-	-
小计	43,189,483.55	-166,346.65
3. 现金流量套期工具产生的利得（或损失）金额	-	-
减：现金流量套期工具产生的所得税影响	-	-
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	-	-
转为被套期项目初始确认金额的调整额	-	-
小计	-	-
4. 外币财务报表折算差额	3,217,193.59	5,302,120.21
减：处置境外经营当期转入损益的净额	-	-
小计	3,217,193.59	5,302,120.21
5. 其他	-	-
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响	-	-
前期其他计入其他综合收益当期转入损益的净额	-	-

小计	-	-
合计	1,682,915,626.12	-11,806,140.54

43、盈余公积

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	1,692,853,808.08			1,692,853,808.08
任意盈余公积				
储备基金				
企业发展基金				
其他				
合计	1,692,853,808.08			1,692,853,808.08

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

根据《公司法》以及本公司章程的规定，本公司税后净利润在弥补以前年度未弥补亏损后，按10%的比例提取法定盈余公积金。法定盈余公积金累计额为注册资本50%以上的，可不再提取。

44、一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	2,364,467,393.31				2,364,467,393.31
交易风险准备	2,247,142,256.43				2,247,142,256.43
合计	4,611,609,649.74				4,611,609,649.74

一般风险准备的说明

根据《金融企业财务规则》(中华人民共和国财政部令第42号)及其实施指南(财金[2007]23号)的规定，以及证监会颁布的《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320号)的要求，本公司按照当期净利润的10%提取一般风险准备。

根据《证券法》和证监机构字[2007]320号的规定，本公司按照当期净利润的10%提取交易风险准备金。提取的一般风险准备和交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算。

45、未分配利润

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	10,319,188,382.86	7,933,034,642.45

调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	10,319,188,382.86	7,933,034,642.45
加：本期归属于母公司所有者的净利润	6,674,821,930.46	1,517,633,030.48
减：提取法定盈余公积		
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备		
应付普通股股利	2,800,000,000.00	840,000,000.00
转作股本的普通股股利		
期末未分配利润	14,194,010,313.32	8,610,667,672.93

（1）提取各项盈余公积和风险准备

本公司按证券法、公司章程及其他相关规定，提取2014年度以下各项盈余公积和风险准备：

（i）提取法定盈余公积	10%
（ii）提取一般风险准备	10%
（iii）提取交易风险准备	10%

一般风险准备还包括本公司下属子公司根据所属行业或所属地区适用法规提取的一般风险准备和交易风险准备。

（2）本年内分配普通股股利

根据2015年3月30日股东大会的批准，本公司于2015年4月30日向普通股股东派发现金股利，每10股人民币5元（2014年：每10股人民币1.5元），共人民币2,800,000,000.00元（2014年：人民币840,000,000.00元）。

（3）期末未分配利润的说明

截至2015年6月30日，本集团归属于母公司的未分配利润中包含了本公司子公司提取的盈余公积人民币572,320,840.88元（2014年：人民币572,320,840.88元）。

46、手续费及佣金净收入

（1）手续费及佣金净收入情况

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入	11,096,769,889.41	2,647,246,848.05
证券经纪业务	10,094,404,273.73	1,937,688,075.86
其中：代理买卖证券业务	9,577,074,732.97	1,864,792,996.07
交易单元席位租赁	333,086,884.21	52,451,117.07
代销金融产品业务	184,242,656.55	20,443,962.72
期货经纪业务	135,712,416.19	95,827,044.11
投资银行业务	633,929,643.41	465,543,823.14
其中：证券承销业务	423,325,656.70	254,894,110.68
证券保荐业务	70,842,408.71	42,713,362.50

财务顾问业务	139,761,578.00	167,936,349.96
资产管理业务	133,632,893.50	91,801,040.43
基金管理业务	31,473,886.56	30,000,000.00
投资咨询业务	57,518,837.03	26,386,864.51
其他	10,097,938.99	-
手续费及佣金支出	-3,126,772,722.29	-503,165,951.59
证券经纪业务	-3,090,136,791.45	-451,936,413.73
其中：代理买卖证券业务	-3,090,136,791.45	-446,098,058.52
交易单元席位租赁	-	-25,000.00
代销金融产品业务	-	-5,813,355.21
期货经纪业务	-11,579,083.18	-21,403,413.36
投资银行业务	-21,180,398.33	-27,715,109.32
其中：证券承销业务	-20,080,398.33	-27,715,109.32
证券保荐业务	-	-
财务顾问业务	-1,100,000.00	-
资产管理业务	-3,214,364.73	-974,905.16
基金管理业务		
投资咨询业务	-662,084.60	-1,136,110.02
其他		
手续费及佣金净收入	7,969,997,167.12	2,144,080,896.46
其中：财务顾问业务净收入	138,661,578.00	167,936,349.96
——并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	120,350,000.00	105,782,895.96
——并购重组财务顾问业务净收入--其他	3,400,000.00	950,000.00
——其他财务顾问业务净收入	14,911,578.00	61,203,454.00

(2) 代理销售金融产品业务

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	19,152,573,983.45	181,178,479.11	5,337,405,709.42	19,004,280.41
银行理财产品				
证券公司理财产品	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17	389,680,824,098.25	433,315.19
信托	2,183,010,000.00	1,731,048.27	1,383,520,000.00	1,006,367.12
合计	2,101,680,984,171.40	184,242,656.55	396,401,749,807.67	20,443,962.72

(3) 资产管理业务

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
----	----------	----------	----------

			务
期末产品数量	75	426	3
期末客户数量	670,357	148	39
其中：个人客户	669,109	35	12
机构客户	1,248	113	27
期初受托资金	57,218,542,846.29	284,637,768,171.13	3,229,968,007.48
其中：自有资金投入	1,389,785,094.74	10,000,000.00	6,400,000.00
个人客户	51,580,744,742.26	232,098,727.12	23,093,744.68
机构客户	4,248,013,009.29	284,395,669,444.01	3,200,474,262.80
期末受托资金	109,388,403,019.09	421,250,995,482.99	4,224,725,589.38
其中：自有资金投入	2,096,454,953.89	2,381,183,365.98	5,814,310.93
个人客户	95,453,223,623.27	319,079,258.22	24,061,345.58
机构客户	11,838,724,441.93	418,550,732,858.79	4,194,849,932.87
期末主要受托资产初始成本	108,542,772,688.18	425,087,022,219.04	4,048,170,741.56
其中：股票	1,567,259,858.76	1,325,617,624.38	13,818,429.77
国债			
其他债券			
基金	19,895,830,760.33	41,912,254,847.07	5,472,311.79
债券	19,454,919,902.16	15,900,180,684.40	
信托计划	1,324,353,000.00	21,055,243,874.68	
资产收益权		31,435,551,093.36	4,028,480,000.00
银行承兑汇票		235,702,020,579.25	
协议或定期存款	52,878,121,187.11	2,335,582,879.35	
其他	13,422,287,979.82	75,420,570,636.55	400,000.00
当期资产管理业务净收入	21,812,962.51	106,064,470.47	2,541,095.79
当年资产管理业务抵销前净收入	469,240,902.95	108,704,440.63	2,541,095.79
合并抵消影响数	-447,427,940.44	-2,639,970.16	

47、利息净收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	6,452,646,444.65	1,887,752,938.13
存放金融同业利息收入	1,607,264,029.05	650,023,535.73
其中：自有资金存款利息收入	509,113,984.35	349,078,393.25
客户资金存款利息收入	1,098,150,044.70	300,945,142.48
融资融券利息收入	4,042,995,060.53	897,242,079.21
买入返售金融资产利息收入	539,698,070.41	211,422,314.70
其中：约定购回利息收入	17,794,385.91	80,808,491.76
股权质押回购利息收入	504,153,363.96	94,266,526.92

拆出资金利息收入		
其他		
债券投资利息收入	262,689,284.66	129,065,008.49
利息支出	3,683,314,753.96	901,660,012.37
客户资金存款利息支出	221,157,882.57	53,485,842.02
卖出回购金融资产利息支出	1,609,794,082.91	231,991,414.95
其中：报价回购利息支出	2,005.66	1,972.78
短期借款利息支出		
应付短期融资款利息支出	552,488,106.82	238,964,383.93
拆入资金利息支出	116,171,306.36	58,299,929.68
其中：转融通利息支出	61,828,369.08	44,844,540.90
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	293,121,310.24	247,705,345.56
次级债券利息支出	723,324,345.87	70,583,333.33
黄金租赁利息支出	153,384,827.03	
其他	13,872,892.16	629,762.90
利息净收入	2,769,331,690.69	986,092,925.76

利息净收入的说明：

2015年1-6月利息净收入较2014年1-6月增长人民币17.83亿元，增长比例为181%，主要原因为2015年融资融券利息收入、股票质押回购利息收入的大幅增长。

48、投资收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益	-	5,919,200.01
权益法核算的长期股权投资收益	197,503,943.96	119,445,225.40
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	2,982,236,406.53	618,827,913.61
其中：持有期间取得的收益	851,651,924.35	606,442,604.40
—以公允价值计量且其变动计入当期损益金融资产	700,581,812.48	548,481,481.95
—持有至到期投资	113,671.49	113,671.49
—可供出售金融资产	150,956,440.38	57,847,450.96
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	2,130,584,482.18	12,385,309.21
—以公允价值计量且其变动计入当期损益金融资产	5,244,097,020.98	-200,044,118.25
—持有至到期投资		
—可供出售金融资产	241,159,781.34	-104,331,319.27
—衍生金融工具	-3,354,672,320.14	316,760,746.73

其他		
合计	3,179,740,350.49	744,192,339.02

投资收益的说明:

(1) 对联营企业和合营企业的投资收益

	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
南方基金管理 有限公司	155,569,517.24	99,786,637.67	被投资单位净利润变化
华泰柏瑞基金管理 有限公司	45,432,903.21	16,785,567.57	被投资单位净利润变化
华泰紫金(江苏)股权 投资基金(有限合伙)	(3,498,476.49)	2,873,020.16	被投资单位净利润变化
合计	197,503,943.96	119,445,225.40	

(2) 本集团不存在投资收益汇回的重大限制。

49、公允价值变动收益 / （损失）

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
以公允价值计量且其变动计入 当期损益金融资产	-118,787,956.38	481,861,123.95
以公允价值计量且其变动计入 当期损益金融负债	246,149,771.17	
衍生金融工具	224,110,628.67	-18,285,708.16
合计	351,472,443.46	463,575,415.79

50、其他业务收入

	2015年1-6月	2014年1-6月
租赁收入	20,108,132.21	17,907,635.40
咨询收入	18,892,251.37	5,249,726.92
其他	3,321,608.99	6,903,838.33
合计	42,321,992.57	30,061,200.65

51、营业税金及附加

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
消费税			
营业税	823,000,411.74	212,774,403.86	按应税营业收入计征
城市维护建设税	55,688,212.32	14,849,978.60	按实际缴纳营业税及应交增值税计征
教育费附加	39,803,513.38	10,387,953.32	按实际缴纳营业税

			及应交增值税计征 3%
资源税			
其他	2,939,279.62	945,141.82	
合计	921,431,417.06	238,957,477.60	/

52、业务及管理费

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
电子设备运转费		
安全防范费	4,158,776.03	4,562,507.52
物业管理费	20,670,878.33	15,821,945.53
员工成本	4,091,490,910.52	1,496,543,693.95
租赁费	110,675,365.41	104,437,824.05
固定资产折旧	77,494,992.43	84,742,386.81
办公及后勤事务费用	145,531,278.17	129,587,533.94
业务招待费	46,606,714.14	43,956,952.24
长期待摊费用摊销	27,076,724.57	38,370,243.65
差旅费	37,862,466.07	26,952,332.07
无形资产摊销	37,436,962.93	28,071,798.62
咨询费	67,852,101.58	46,661,568.38
证券投资者保护基金	81,328,807.03	24,194,004.83
其他	130,169,728.94	47,786,851.63
合计	4,878,355,706.15	2,091,689,643.22

53、资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
一、坏账损失	-2,431,429.97	-344,967.96
二、存货跌价损失		
三、可供出售金融资产减值损失		
四、持有至到期投资减值损失		
五、长期股权投资减值损失		
六、投资性房地产减值损失		
七、固定资产减值损失		
八、工程物资减值损失		
九、在建工程减值损失		
十、生产性生物资产减值损失		
十一、油气资产减值损失		
十二、无形资产减值损失		

十三、商誉减值损失		
十四、其他	69,487.28	
合计	-2,361,942.69	-344,967.96

54、其他业务成本

	2015年1-6月	2014年1-6月
投资性房地产折旧	11,370,577.75	9,736,524.37
贸易销售成本	12,286,591.18	552,535.10
其他	12,792,984.05	14,436,241.41
合计	36,450,152.98	24,725,300.88

55、营业外收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计	180,777.34	1,328,056.93	180,777.34
其中：固定资产处置利得	180,777.34	1,328,056.93	180,777.34
无形资产处置利得	-	-	-
债务重组利得			
非货币性资产交换利得			
接受捐赠			
政府补助	3,241,023.71	2,231,928.32	3,241,023.71
税收返还	26,925,036.29	23,664,360.50	26,925,036.29
其他	1,401,132.11	1,249,279.93	1,401,132.11
合计	31,747,969.45	28,473,625.68	31,747,969.45

计入当期损益的政府补助

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
财政扶持资金(i)	217,280.71	30,000.00	
租金补贴(ii)	1,305,743.00	-	
新三板挂牌奖励(iii)	600,000.00	-	
发展基金(iv)	1,020,000.00	-	

增资扩股奖励	-	1,000,000.00	
其他	98,000.00	1,201,928.32	
合计	3,241,023.71	2,231,928.32	/

其他说明：

本集团于2014年取得的政府补助详情如下：

- (i) 本公司和本公司子公司华泰联合证券部分分支机构以及本公司子公司华泰紫金投资获得的财政扶持资金。
- (ii) 本公司及本公司子公司华泰联合证券获得的房屋租赁补贴款。
- (iii) 本公司分支机构获得的帮助当地企业新三板挂牌的奖励。
- (iv) 本公司子公司华泰紫金有限公司获得的发展支持补贴。

56、营业外支出

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	1,676,057.87	631,453.15	1,676,057.87
其中：固定资产处置损失	1,676,057.87	631,453.15	1,676,057.87
无形资产处置损失			
债务重组损失			
非货币性资产交换损失			
对外捐赠	1,997,550.00	621,332.00	1,997,550.00
违约和赔偿损失	90.00	290.27	90
其他	4,577,469.36	6,548,492.36	4,577,469.36
合计	8,251,167.23	7,801,567.78	8,251,167.23

57、所得税费用

(1) 所得税费用表

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	2,095,388,166.25	332,124,679.61
递延所得税费用	25,467,910.07	173,630,880.09
汇算清缴差异调整	-5,554,685.36	-3,912,119.86
合计	2,115,301,390.96	501,843,439.84

(2) 会计利润与所得税费用调整过程：

项目	本期发生额
----	-------

利润总额	8,833,873,275.16
按法定/适用税率计算的所得税费用	2,208,468,318.80
子公司适用不同税率的影响	-13,224,299.53
调整以前期间所得税的影响	-5,554,685.36
非应税收入的影响	-50,507,197.16
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	2,113,486.70
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-4,068,104.75
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	
其他	-21,926,127.74
所得税费用	2,115,301,390.96

58、基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

(1) 基本每股收益

基本每股收益以归属于本公司普通股股东的合并净利润除以本公司发行在外普通股的加权平均数计算：

	2015年1-6月	2014年1-6月
归属于本公司普通股股东的 合并净利润	6,674,821,930.46	1,517,633,030.48
本公司发行在外普通股的 加权平均数	5,829,705,043.09	5,600,000,000.00
基本每股收益（元/股）	1.1450	0.2710

(2) 稀释每股收益

本公司不存在稀释性潜在普通股，因此稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

59、现金流量表项目

(1). 收到的其他与经营活动有关的现金：

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
合并结构化主体收到的现金	48,790,291,938.76	4,715,545,961.09
其他业务收入	42,321,992.57	30,061,200.65
营业外收入	31,747,969.45	28,473,625.68
收到的往来款项	1,243,185,251.20	536,505,984.72

使用受限制货币资金的变动		2,252,107,682.22
合计	50,107,547,151.98	7,562,694,454.36

(2). 支付的其他与经营活动有关的现金:

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
使用受限制货币资金的变动	1,715,521,012.31	-
存出保证金本年净支付	2,153,573,052.42	46,079,625.33
支付的其他费用	795,166,388.00	430,917,871.55
支付的往来款项	2,778,481,665.18	480,048,790.07
合计	7,442,742,117.91	957,046,286.95

(3). 收到的其他与投资活动有关的现金

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
应付私募基金份额持有人及有限合伙人净资产净增加额	718,000,000.00	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产所收到的现金	797,672.28	44,443.99
合计	718,797,672.28	44,443.99

(4). 支付的其他与筹资活动有关的现金

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
债券发行费用	1,552,810.00	21,000,000.00
短期融资券发行费用	4,095,629.78	5,202,022.80
股利分红交易所费用	3,000,000.00	1,190,850.27
H股发费用	12,969,196.94	
合计	21,617,636.72	27,392,873.07

60、现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

单位: 元 币种: 人民币

补充资料	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	6,718,571,884.20	1,533,057,034.00
加: 资产减值准备	-2,361,942.69	-344,967.96
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	88,865,570.18	94,478,911.18
无形资产摊销	37,436,962.93	28,071,798.62

长期待摊费用摊销	27,076,724.57	38,370,243.65
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）	1,495,280.53	-696,603.78
固定资产报废损失（收益以“－”号填列）		
公允价值变动损失（收益以“－”号填列）	-351,472,343.46	-463,575,415.79
利息支出	2,114,380,991.03	344,406,949.55
汇兑（收益）/损失	-331,388,162.11	-1,253,092.00
财务费用（收益以“－”号填列）		
投资损失（收益以“－”号填列）	-2,590,006,513.32	-665,198,110.43
递延所得税资产减少（增加以“－”号填列）	-12,879,549.27	314,834,606.39
递延所得税负债增加（减少以“－”号填列）	436,201,943.55	-146,959,572.37
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的增加	-28,897,234,367.91	-4,801,136,584.79
存货的减少（增加以“－”号填列）		
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-5,321,245,599.00	-6,535,336,362.40
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	167,308,400,968.57	18,120,981,462.27
其他		
经营活动产生的现金流量净额	139,225,841,847.80	7,859,700,296.14
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	315,626,241,297.94	56,257,801,341.87
减：现金的期初余额	99,700,700,737.87	43,403,084,862.96
加：现金等价物的期末余额	4,067,100,000.00	706,600,000.00
减：现金等价物的期初余额	2,889,578,174.73	
现金及现金等价物净增加额	217,103,062,385.34	13,561,316,478.91

(2) 现金和现金等价物的构成

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

一、现金	315,626,241,297.94	99,700,700,737.87
其中：库存现金	525,675.08	542,256.36
可随时用于支付的银行存款	273,687,314,291.47	81,482,372,851.80
可随时用于支付的其他货币资金	626,588,230.17	537,197.32
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		
结算备付金	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39
二、现金等价物	4,067,100,000.00	2,889,578,174.73
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	319,693,341,297.94	102,590,278,912.60
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		

八、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

☐适用 ☒不适用

2、同一控制下企业合并

☐适用 ☒不适用

3、反向购买

☐适用 ☒不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

☐适用 ☒不适用

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

☐适用 ☒不适用

5、其他原因的合并范围变动

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：

（1）新设子公司导致的合并范围变动

于2015年6月30日，本集团合并范围包括了于本年新设立的子公司。本公司管理层认为本公司对这些新设立的子公司具有实际控制权，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。新设立子公司的详情如下：

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册资本	持股比例(%) (或类似权益比例)		取得方式
						直接	间接	
深圳前海瑞联一号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联二号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联三号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联四号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
深圳前海瑞联六号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
上海京瑞投资中心（有限合伙）	上海	上海	投资管理	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
北京瑞联京深投资中心（有限合伙）	北京	北京	投资管理	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	北京	北京	股权投资	人民币	1,000,000,000.00	-	45.00	设立
深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资	人民币	220,010,000.00	-	25.00	设立
华泰瑞新（上海）投资有限公司	上海	上海	投资管理	人民币	100,000,000.00	-	100.00	设立
HTSC LIMITED	香港	香港	控股投资	港币	1.00	-	100.00	设立
Principle Solution Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Lucid Elegant Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Reward Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Reward Investment Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Return Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Return Holdings Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Festive Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principal Investment I limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Lead Talent Enterprises Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principle Investment Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
北京华泰同信投资基金管理有限公司	北京	北京	投资管理	人民币	3,000,000.00	-	51.00	设立
北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）	北京	北京	投资管理	人民币	30,000,000.00	-	52.00	设立

（2）其他

本集团根据准则33号（2014），对于本集团同时作为管理人或投资顾问及投资者，且综合评估本集团因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本集团面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并（主要是资产管理计划）。详见附注九、4。

九、 在其他主体中的权益

1、 在子公司中的权益

√适用 □不适用

(1). 企业集团的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
华泰联合证券有限责任公司	深圳	深圳	投资银行	99.10	-	购买
华泰期货有限公司	广州	广州	期货经纪	60	-	购买
华泰紫金投资有限责任公司	南京	南京	股权投资	100	-	设立
华泰金融控股 (香港) 有限公司	香港	香港	证券经纪	100	-	设立
江苏股权交易中心有限责任公司	南京	南京	股权交易服务	52	-	设立
华泰创新投资有限公司	北京	北京	创新投资	100	-	设立
华泰证券 (上海) 资产管理有限公司	上海	上海	资产管理	100	-	设立
华泰瑞通投资管理有限公司	南京	南京	投资管理	-	54	设立
江苏省新兴产业投资管理有限公司	南京	南京	投资管理	-	51	设立
华泰瑞联基金管理有限公司	北京	北京	投资管理	-	42.33	设立
华泰金控投资咨询 (深圳) 有限公司	深圳	深圳	管理咨询	-	100	设立
深圳市华泰君信基金投资管理有限公司	深圳	深圳	投资管理	-	51	设立
华泰长城资本管理有限公司	上海	深圳	基差及仓单交易	-	60	设立
华泰长城国际贸易有限公司	上海	上海	风险管理	-	60	设立
北京华泰瑞联并购基金中心(有限合伙)	北京	北京	股权投资	-	32	设立
深圳市华泰瑞麟基金投资管理合伙企业 (有限合伙)	深圳	深圳	投资管理		52	设立
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业 (有限合伙)	深圳	深圳	股权投资		31	设立

Huatai HK Investment (Cayman) Limited	开曼群岛	开曼群岛	投资管理		100	设立
Huatai HK SPC	开曼群岛	开曼群岛	基金管理		100	设立
Huatai International Finance I Limited(华泰国际财务I有限公司)	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	融资业务		100	设立
Huatai International Finance Limited(华泰国际财务有限公司)	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	融资业务		100	设立
Huatai Capital Finance Limited (华泰资本财务有限公司)	香港	香港	财务业务		100	设立
Huatai Capital Investment Limited (华泰资本投资有限公司)	香港	香港	自营投资		100	设立
深圳前海瑞联一号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		100	设立
深圳前海瑞联二号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		100	设立
深圳前海瑞联三号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		100	设立
深圳前海瑞联四号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		100	设立
深圳前海瑞联六号投资中心（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		100	设立
上海京瑞投资中心（有限合伙）	上海	上海	投资管理		100	设立
北京瑞联京深投资中心（有限合伙）	北京	北京	投资管理		100	设立
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	北京	北京	股权投资		45	设立
深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	股权投资		25	设立
华泰瑞新（上海）投资有限公司	上海	上海	投资管理		100	设立
HTSC LIMITED	香港	香港	控股投资	-	100	设立

Principle Solution Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Lucid Elegant Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Pioneer Reward Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Pioneer Reward Investment Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Pioneer Return Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Pioneer Return Holdings Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Pioneer Festive Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Huatai Principal Investment I limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Lead Talent Enterprises Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
Huatai Principle Investment Group Limited	香港	英属维尔京群岛	控股投资	-	100	设立
北京华泰同信投资基金管理有限公司	北京	北京	投资管理		51	设立
北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）	北京	北京	投资管理		52	设立

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：
无

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位、以及持有半数以上表决权但不控制被投资单位的依据：

截至2015年6月，本公司原子公司华泰瑞联基金管理有限公司引入战略投资者，拉萨合业投资管理有限公司与天罡风华（北京）影视文化有限公司共同出资人民币5100万，其中1024.09万元计入实收资本，4075.91万元计入资本公积。增资完成后，本公司对华泰瑞联基金管理有限公司的持股比例由51%稀释为42.33%。截至2015年06月30日，本公司间接持有华泰瑞联基金管理有限公司42.33%的股权，根据华泰瑞联基金管理有限公司的章程及相关协议，本公司及本管理层持有的表决权及董事会席位占绝对多数。因此，本公司管理层认为本公司对华泰瑞联基金管理有限公司具有实际控制，继续采用长期股权投资成本法对其进行核算。

截至2014年12月31日，本公司间接持有北京华泰瑞联并购基金中心(有限合伙) 32.00%的股权比例。根据北京华泰瑞联并购基金中心(有限合伙) 的合伙协议，该基金

的投资决策委员会成员均为本公司管理层。同时，本公司子公司华泰瑞联基金管理有限公司为该基金的普通合伙人，负责执行并购基金的日常事务。因此，本公司管理层认为本公司对北京华泰瑞联基金并购中心(有限合伙)具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。

截至2014年12月31日，本公司间接持有深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)31.00%的股权比例。根据深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)的合伙协议所规定的表决机制，本公司可以控制该基金的投资决策。同时，本公司子公司深圳市华泰瑞麟基金投资管理合伙企业(有限合伙)为该基金的普通合伙人，负责执行投资基金的日常事务。因此，本公司管理层认为本公司对深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。

截至2015年06月30日，本公司间接持有北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)45%的股权比例。根据北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)的合伙协议，该中心的投资决策委员会成员均为本公司管理层，因此，本公司管理层认为本公司对该投资中心具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。

截至2015年6月30日，本公司间接持有深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)25%的股权比例。根据合伙协议所规定的表决机制，本公司可以控制该基金的投资决策。同时，本公司子公司深圳市华泰瑞麟基金投资管理合伙企业(有限合伙)为该基金的普通合伙人，负责执行投资基金的日常事务。因此，本公司管理层认为本公司对深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。

其他说明：

于2015年，华泰紫金投资有限责任公司注册资本由人民币6亿元增加至人民币23.5亿元。

于2015年，华泰联合证券有限责任公司注册资本由人民币10亿元减少至人民币9.9748亿元。

于2015年，Lau Chi Wai Michael将其持有的Huatai Investment Limited（华泰资本投资有限公司）股份（占50%）以1港元的价格转让给华泰金融控股（香港）有限公司，转让后华泰金融控股（香港）有限公司持股比例增至100%。

(2). 重要的非全资子公司

单位:元 币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
华泰期货有限公司	40.00%	34,302,791.40		462,876,346.66

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额						期初余额					
	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计

华泰期货	10,096,960,586.57	5,394,229,690.77	15,491,190,277.34	-11,492,850,591.59	-2,841,148,719.07	-14,333,999,310.66	5,904,331,384.41	3,204,728,958.06	9,109,060,342.47	-7,031,577,016.79	-1,009,686,518.82	-8,041,263,535.61
------	-------------------	------------------	-------------------	--------------------	-------------------	--------------------	------------------	------------------	------------------	-------------------	-------------------	-------------------

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
华泰期货	1,391,044,049.31	85,756,978.51	89,394,159.82	4,547,760,339.91	202,757,942.70	31,495,007.54	31,495,007.54	28,925,361.77

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

√适用 □不适用

(1). 在子公司所有者权益份额的变化情况的说明：

本公司于2015年从少数股东取得部分对子公司华泰联合证券有限责任公司的投资（占该子公司股份的0.27%）。

(2). 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响：

单位：元 币种：人民币

购买成本/处置对价	
--现金	11,898,658.00
--非现金资产的公允价值	
购买成本/处置对价合计	11,898,658.00
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	14,548,537.63
差额	-2,649,879.63
其中：调整资本公积	2,649,879.63
调整盈余公积	
调整未分配利润	

3、在合营企业或联营企业中的权益

√适用 □不适用

(1). 重要的合营企业或联营企业

单位：元 币种：人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
南方基金管理有限公司	深圳	深圳	基金管理	45	-	权益法
华泰柏瑞	上海	上海	基金管理	49	-	权益法

基金管理 有限公司						
华泰紫金 (江苏) 股权投资基金(有 限合伙)	南京	南京	股权投资	-	48.25	权益法

(2). 重要联营企业的主要财务信息

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额			期初余额/ 上期发生额		
	南方基金	华泰柏瑞	华泰紫金（江苏） 股权投资基金（有 限合伙）	南方基金	华泰柏瑞	华泰紫金（江 苏）股权投资基金 （有限合伙）
流动资产	3,019,840,113.03	346,285,470.75	5,878,776.19	2,733,806,872.15	333,204,234.67	2,727,734.69
非流动资产	1,985,895,964.25	374,000,424.25	888,072,670.00	1,769,760,563.67	351,422,351.33	519,474,440.00
资产合计	5,005,736,077.28	720,285,895.00	893,951,446.19	4,503,567,435.82	684,626,586.00	522,202,174.69
流动负债	-1,012,561,322.27	-93,803,646.23		-920,138,024.35	-173,532,868.80	
非流动负债	-652,151,569.76	-19,150,638.38		-350,358,907.10	-14,381,299.20	-21,000,000.00
负债合计	-1,664,712,892.03	-112,954,284.61		-1,270,496,931.45	-187,914,168.00	-21,000,000.00
少数股东权益	198,106,410.94			212,350,394.96		
归属于母公司股 东权益	3,142,916,774.31	607,331,610.39	893,951,446.19	3,020,720,109.41	496,712,418.00	501,202,174.69
按持股比例计算 的净资产份额	1,414,312,548.44	297,592,489.09	431,331,572.80	1,359,324,049.23	243,389,084.64	241,830,049.29
调整事项			14,693,263.36			14,693,263.36
--商誉						
--内部交易未实 现利润						
--其他			14,693,263.36			14,693,263.36
对联营企业权益 投资的账面价值	1,414,312,548.44	297,592,489.09	446,024,836.16	1,359,324,049.23	243,389,084.64	256,523,312.65
存在公开报价的 联营企业权益投 资的公允价值						
营业收入	1,440,799,650.74	285,169,487.09	13,167,897.01	997,271,417.98	149,306,510.00	26,057,743.28
净利润	394,665,348.48	92,720,210.64	-7,250,728.50	241,007,577.09	35,266,038.24	5,954,445.92
终止经营的净利 润						
其他综合收益	79,400,404.04	17,898,982.83	-	509,082.49	-1,666,673.70	
综合收益总额	474,065,752.52	110,619,193.47	-7,250,728.50	241,516,659.58	33,599,364.54	5,954,445.92
本年度收到的来 自联营企业的股 利				81,000,000	19,600,000	

4、本集团在合并的结构化主体中的权益

本集团纳入合并财务报表范围的结构化主体指本集团作为管理人或投资顾问及投资者的资产管理计划，本集团会评估其所持投资组合及其报酬会否对该资产管理产品业务回报变动产生重大风险，以此表明本集团为主要责任人。

2015年6月30日及2014年12月31日，合并资产管理计划的总资产分别为人民币104,098,129,502.38元以及人民币55,318,894,301.86元，本集团于合并的资产管理计划中所持权益账面价值分别为人民币4,584,737,062.90元及人民币3,746,450,796.94元。

5、本集团在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本集团的合并范围，主要包括基金、资产管理计划、信托计划及银行或其他金融机构发行的理财产品。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

2015年6月30日及2014年12月31日，合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本集团因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情载列如下：

	于2015年6月30日		
	以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		合计
	可供出售金融资产	可供出售金融资产	
基金	471,275,425.63	22,497,528,757.34	22,968,804,182.97
资产管理计划	-	-	-
信托计划	76,875,427.61	-	76,875,427.61
理财产品	953,891,023.82	1,997,197,258.50	2,951,088,282.32
合计	1,502,041,877.06	24,494,726,015.84	25,996,767,892.90

	于2014年12月31日		
	以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		合计
	可供出售金融资产	可供出售金融资产	
基金	342,430,394.86	12,186,904,749.73	12,529,335,144.59
资产管理计划	40,000,000.00	-	40,000,000.00
信托计划	1,391,786,693.48	-	1,391,786,693.48
理财产品	1,667,687,570.84	746,976,944.03	2,414,664,514.87
合计	3,441,904,659.18	12,933,881,693.76	16,375,786,352.94

于2015年6月30日及2014年12月31日，本集团因投资上述基金、资产管理计划、信托计划与理财产品而可能遭受损失的最大风险敞口是上述投资的公允价值。

6、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

本集团作为结构化主体的管理者，在报告期间对资产管理计划拥有管理权。除已于附注七、4所述本集团已合并的结构化主体外，本集团因在结构化主体中拥有的权益而享有可变回报并不重大，因此，本集团并未合并该等结构化主体。

于2015年6月30日及2014年12月31日，上述由本集团管理的未合并结构化主体的资产总额分别为人民币441,318,969,981.80元和人民币298,342,110,431.92元。

于2015年，本集团在上述结构化主体中的投资和获得的收入并不重大。

十、与金融工具相关的风险

√适用 □不适用

1、风险管理政策及组织架构

(1) 风险管理政策

为了提高集团管理和运营的科学性、规范性和有效性，增强对金融风险的防范能力，保障集团各项业务持续、稳定、快速发展，根据《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》等有关规定，本集团制定了《内部控制管理办法》、《风险管理基本制度（修订）》及流动风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险管理指引、《公司日常监控及报告流程》、《压力测试机制实施方案（试行）》、《风险控制指标管理办法》、《营销人员风险管理制度》等多项制度，并就各业务建立了专项的风险管理办法。

本集团在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险和操作风险。本集团制定了相应的政策和程序来识别和分析这些风险，并设定适当的风险指标、风险限额、风险政策及内部控制流程，通过信息系统持续监控来管理上述各类风险。

风险管理是本集团所有员工的共同责任，集团的全体员工应不断增强风险管理意识和风险敏感度，培养良好的风险管理文化，树立对风险管理的正确认知。本集团各业务部门及职能部门负责各自条线的风险管理工作，主动执行集团各项风险管理制度，及时识别、评估、应对、报告其执业行为的相关风险。风险管理部门履行风险管理职责，不能取代各部门、分支机构相关负责人对其业务活动所承担的风险管理责任。

(2) 风险治理组织架构

本公司风险管理组织架构包括四个主要部分：董事会及合规与风险管理委员会、总裁室及风险控制委员会、首席风险官、各职能部门以及各业务部门。

董事会是风险管理的最高决策机构，并对公司全面风险管理体系的有效性承担最终责任。董事会设合规与风险管理委员会，对风险管理的总体目标、基本政策、风险评估报告进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。总裁室是风险管理的最高执行机构，根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，并下设风险控制委员会。公司设首席风险官，负责全面风险管理工作。在主要业务部门都设立了一线的风险控制组织，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，分工明晰，强调相互协作。公司指定风险管理部履行风险管理职责，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议。合规法律部是本公司合规管理的核心职能部门，主要负责对本公司经营管理活动和员工执业行为进行合规管理，以及管理本公司的法律事务工作。稽核部负责对本公司各级部门的风险管理、内部控制及经营管理绩效进行独立、客观地检查、监督、评价，并督促其改进。各部门分工协作，各有侧重，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价三道防线功能。

2、公司面临的主要风险及应对措施

(1) 信用风险管理

信用风险，是指金融工具的一方不能履行义务，造成另一方发生财务损失的风险。

报告期内，本集团面临的信用风险主要包括四类：一是在债券交易业务中，发债企业违约或交易对手违约造成的风险；二是在融资融券、约定购回、股票质押等信用业务中，客户违约致使借出资券及利息遭受损失的风险；三是在信用类创新业务中，融资方违约导致自有资金或客户资金遭受损失的风险；四是除债券投资外的固定收益类金融资产及衍生金融资产的违约风险，即交易对手方出现违约，导致资产遭受损失的风险。

对于债券交易中的信用风险，报告期内本集团重点加强对发债主体和债券的研究，强化信用风险评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质；对交易对手信用状况进行评估，研究交易对手池，防范交易对手违约风险。

融资融券、约定购回、股票质押式回购业务方面，本集团重点加强客户适当性管理，通过征信评级全面了解客户资信水平和风险承受能力，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；加强对融出资券履约保障比例的监控，发现异常时及时与客户沟通反馈，避免客户违约给集团造成损失。信用类创新业务方面，业务人员加强前期尽职调查，提交全面的项目可行性分析报告、尽职调查报告，经评审通过后，项目才可实施。

本集团代理客户买卖证券及进行期货交易等，如在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或客户资金由于其他原因出现缺口，本集团有责任代客户进行结算从而可能给本集团造成损失。对此，本集团代理客户进行证券交易均以全额保证金结算方式进行风险规避；代理客户进行期货交易通过严格筛选客户、逐日盯市来控制信用风险。

本集团除现金以外的货币资金主要存放于信用良好的金融机构，管理层认为其不存在重大的信用风险，预期不会因为对方违约而给本集团造成损失。本集团开展的衍生品交易的交易对手均为国内信用良好的金融机构，并受到授信额度的限制，因此本集团认为面临的信用风险并不重大。

(a) 最大信用风险敞口

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指金融资产扣除减值准备后的账面价值。本集团最大信用风险敞口金额列示如下：

	2015年6月30日	2014年12月31日
货币资金	283,660,885,709.88	89,864,401,674.06
结算备付金	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39
融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	39,881,913,940.53	35,536,609,803.14
衍生金融资产	317,807,279.02	20,814,658.67
买入返售金融资产	24,703,116,263.76	20,710,026,021.64
应收款项	1,677,815,454.50	362,653,212.62
应收利息	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17
存出保证金	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77
可供出售金融资产	520,066,262.70	399,206,657.43
持有至到期投资	5,000,000.00	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	343,089,876.64	152,104,874.73
合计	516,633,409,411.15	236,139,326,884.87

(b) 债券投资的信用风险评级状况

本集团采用信用评级方法来监控债券投资组合的信用风险。下表列示了于资产负债表日本集团债券投资的信用评级情况。其中，未评级的债券投资主要包括国债及政

策性金融债。

(i) 按短期信用评级列示的债券投资

	2015年6月30日	2014年12月31日
A-1	1,809,476,338.06	2,372,397,352.59
未评级	1,441,278,940.00	149,853,360.00
合计	3,250,755,278.06	2,522,250,712.59

(ii) 按长期信用评级列示的债券投资

	2015年6月30日	2014年12月31日
AAA	4,324,284,554.69	6,043,043,130.74
A至AA+	26,287,993,379.85	22,087,556,638.09
未评级	6,210,766,659.19	4,230,338,617.41
合计	36,823,044,593.73	32,360,938,386.24

(2) 流动性风险管理

流动性风险，是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本公司已建立并健全了资金业务的风险评估和监测制度，严格控制资金流动性风险。日常头寸调度外的每笔资金业务在使用前均需进行严格的风险收益评估，使各项资金比例严格控制在公司可承受风险范围之内。本公司对自营业务规模需经董事会下属投资决策委员会审核批准，严格控制自营业务投资规模。

于资产负债表日，本集团各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

	2015年6月30日							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	无期限	
应付短期融资款	-	3,214,910,639.03	8,650,186,606.37	12,999,153,515.00	-	-	-	24,864,250,760.40
拆入资金	-	1,901,293,055.56	1,289,375,000.00	257,875,000.00	-	-	-	3,448,543,055.56
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	9,248,128.87	-	359,570,666.67	15,750,715,987.39	-	-	27,674,075.61	16,147,208,858.54
衍生金融负债	260,940.19	16,702,373.28	706,548,653.34	1,053,328,096.81	65,635,270.89	-	-	1,842,475,334.51
卖出回购金融资产款	-	20,719,766,070.07	11,461,457,338.87	19,965,114,372.54	13,453,167,005.32	-	-	65,599,504,786.80
代理买卖证券款	175,620,904,470.86	-	-	-	-	-	-	175,620,904,470.86
代理承销证券款	40,510,963.43	-	-	-	-	-	-	40,510,963.43
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	-	-	-	-	-	-	29,518,371,795.33
应付款项	723,828,677.43	-	408,384,493.81	2,300,890,171.70	516,321,311.45	-	-	3,949,424,654.39
长期借款	-	1,636,841.73	3,273,683.47	79,158,967.84	320,126,358.20	-	-	404,195,851.24
应付债券	-	-	350,000,000.00	2,884,986,965.16	76,619,681,574.46	6,918,000,000.00	-	86,772,668,539.62
其他负债(金融负债)	100,093,306,086.60	253,055,137.08	-	945,265,343.97	-	2,593,561,299.18	-	103,885,187,866.83
合计	306,006,431,062.71	26,107,364,116.75	23,228,796,442.53	56,236,488,420.41	90,974,931,520.32	9,511,561,299.18	27,674,075.61	512,093,246,937.51

	2014年12月31日							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	无期限	
应付短期融资款	-	6,022,077,299.18	5,802,137,698.08	15,244,839,642.74	-	-	-	27,069,054,640.00
拆入资金	-	-	1,286,652,777.78	257,330,555.56	-	-	-	1,543,983,333.34
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	-	-	-	-	-	-	9,244,846.63	9,244,846.63
衍生金融负债	-	-	104,096,028.92	106,093,520.67	520,553,593.34	-	-	730,743,142.93
卖出回购金融资产款	-	9,661,346,950.08	5,833,954,294.44	30,801,877,855.56	5,542,998,055.56	-	-	51,840,177,155.64
代理买卖证券款	60,398,770,689.39	-	-	-	-	-	-	60,398,770,689.39
代理承销证券款	41,400,000.00	-	-	-	-	-	-	41,400,000.00
信用交易代理买卖证券款	9,829,634,190.63	-	-	-	-	-	-	9,829,634,190.63
应付款项	2,451,723,533.08	-	107,547,442.70	812,934,173.38	822,000,231.43	-	-	4,194,205,380.59
长期借款	-	692,051.85	1,386,577.84	6,239,600.28	142,829,771.38	-	-	151,148,001.35
应付债券	-	93,035,458.33	186,070,916.67	837,319,125.00	15,919,120,625.00	7,045,500,000.00	-	24,081,046,125.00
其他负债(金融负债)	50,498,474,627.14	48,051,263.62	-	713,477,300.48	-	843,786,589.23	-	52,103,789,780.47
合计	123,220,003,040.24	15,825,203,023.06	13,321,845,736.43	48,780,111,773.67	22,947,502,276.71	7,889,286,589.23	9,244,846.63	231,993,197,285.97

(3) 市场风险管理

市场风险指市场价格变动，如外汇汇率、利率和证券价格的变动等，影响本集团收入或持有的金融工具的价值而形成的风险。市场风险管理的目标是在可接受范围内管理和控制市场风险，并使风险报酬率最大化。

(a) 汇率风险

汇率风险是指本集团进行的外币业务因外汇汇率变动所产生的风险。本集团除了于香港首次公开发行股票部分行使超额配售权所募集的港币资金以及境外子公司持有以港元为记账本位币的资产及负债外，其他外币资产及负债主要为B股业务交易手续费等佣金费用，且占整体资产及负债的比重不重大。对于不是以记账本位币计价的货币资金、结算备付金、存出保证金、应收款项、代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、应付款项、应付债券等外币资产和负债，如果出现短期的失衡情况，本集团会在必要时按市场汇率买卖外币，以确保将净风险敞口维持在可接受的水平。本集团的外币资产及外币负债详见附注五、60(1)。

敏感性分析

假定除汇率以外的其他风险变量不变，于2015年6月30日及2014年12月31日人民币对美元和港币的汇率变动使人民币升值1% 将导致本集团股东权益和净利润的减少情况如下。此影响按资产负债表日即期汇率折算为人民币列示。

	股东权益	净利润
2015年6月30日		
美元	2,773,751.58	3,722,311.58
港币	(28,411,213.92)	(28,411,213.92)
合计	(25,637,462.34)	(24,688,902.34)
2014年12月31日		
美元	(992,580.31)	(992,580.31)
港币	(274,093.29)	(274,093.29)
合计	(1,266,673.60)	(1,266,673.60)

在假定其他变量保持不变的前提下，人民币对美元和港币的汇率变动使人民币贬值1%将导致本集团股东权益和损益的变化和上表列示的金额相同但方向相反。

上述敏感性分析是假设资产负债表日汇率发生变动，以变动后的汇率对资产负债表日本集团持有的、面临汇率风险的金融工具进行重新计量得出的。

(b) 利率风险

利率风险是指公司的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本公司的生息资产主要为银行存款、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金及债券投资等，付息负债主要为应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、长期借款、应付债券等。

对于资产负债表日持有的使本集团面临公允价值利率风险的金融工具，本集团利用敏感性分析作为监控利率风险的主要方法。采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对净利润和股东权益产生的影响。

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

	2015年6月30日						合计
	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	不计息	
金融资产							
货币资金	275,907,801,415.77	873,198,101.11	6,879,886,193.00	-	-	525,675.09	283,661,411,384.97
结算备付金	41,311,813,173.22	-	-	-	-	-	41,311,813,173.22
融出资金	1,446,904,228.80	7,189,546,282.98	106,041,540,962.52	-	-	-	114,677,991,474.30
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	29,332,726,655.59	1,027,744,413.84	7,831,157,414.06	16,542,118,218.91	6,150,362,413.42	24,013,083,168.84	84,897,192,284.66
衍生金融资产	27,101,145.10	-	-	-	-	290,706,133.92	317,807,279.02
买入返售金融资产	6,601,817,019.20	3,014,815,634.04	11,884,526,110.52	3,201,957,500.00	-	-	24,703,116,263.76
应收款项	-	-	-	-	-	1,677,815,454.50	1,677,815,454.50
存出保证金	2,724,367,083.20	-	-	-	-	3,912,050,952.99	6,636,418,036.19
可供出售金融资产	507,912,418.21	110,161,429.87	192,588,973.14	229,315,165.00	-	10,305,577,348.82	11,345,555,335.04
持有至到期投资	-	-	-	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	-	343,089,876.64	343,089,876.64
金融资产合计	357,860,443,139.09	12,215,465,861.84	132,829,699,653.24	19,978,390,883.91	6,150,362,413.42	40,542,848,610.80	569,577,210,562.30

	2015年6月30日						合计
	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	不计息	
金融负债							
应付短期融资款	(3,109,987,000.00)	(8,481,386,000.00)	(12,778,450,509.44)	-	-	-	(24,369,823,509.44)
拆入资金	(1,900,000,000.00)	(1,250,000,000.00)	(250,000,000.00)	-	-	-	(3,400,000,000.00)
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	-	(352,410,000.00)	(15,199,208,360.00)	-	-	(36,922,204.48)	(15,588,540,564.48)
衍生金融负债	(93,122,402.76)	-	-	-	-	(1,749,352,931.75)	(1,842,475,334.51)
卖出回购金融资产款	(20,539,907,481.35)	(10,849,100,000.00)	(18,766,000,000.00)	(12,800,000,000.00)	-	-	(62,955,007,481.35)
代理买卖证券款	(175,620,904,470.86)	-	-	-	-	-	(175,620,904,470.86)
代理承销证券款	-	-	-	-	-	(40,510,963.43)	(40,510,963.43)
信用交易代理买卖证券款	(29,518,371,795.33)	-	-	-	-	-	(29,518,371,795.33)
应付款项	-	-	-	-	-	(3,949,424,654.39)	(3,949,424,654.39)
长期借款	-	-	(62,500,000.00)	(304,595,074.05)	-	-	(367,095,074.05)
应付债券	-	-	-	(64,938,608,817.80)	(5,989,456,709.49)	-	(70,928,065,527.29)
其他负债(金融负债)	-	-	-	-	-	(103,885,187,866.83)	(103,885,187,866.83)
金融负债合计	(230,782,293,150.30)	(20,932,896,000.00)	(47,056,158,869.44)	(78,043,203,891.85)	(5,989,456,709.49)	(109,661,398,620.88)	(492,465,407,241.96)
利率敏感度 敞口合计	127,078,149,988.79	(8,717,430,138.16)	85,773,540,783.80	(58,064,813,007.94)	160,905,703.93	(69,118,550,010.08)	77,111,803,320.34

	2014年12月31日						合计
	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	不计息	
金融资产							
货币资金	81,421,371,719.19	2,414,224,384.87	6,028,805,570.00	-	-	542,256.36	89,864,943,930.42
结算备付金	18,217,248,432.39	-	-	-	-	-	18,217,248,432.39
融出资金	544,822,201.50	4,173,507,780.77	59,918,409,474.98	-	-	-	64,636,739,457.25
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	11,967,038,205.05	1,628,813,274.42	7,234,595,933.38	16,355,729,080.42	8,325,945,143.04	10,487,836,280.44	55,999,957,916.75
衍生金融资产	17,245,694.51	83,799.55	-	-	-	3,485,164.61	20,814,658.67
买入返售金融资产	5,776,242,073.13	858,369,398.59	11,675,294,549.92	2,400,120,000.00	-	-	20,710,026,021.64
应收款项	-	-	-	-	-	362,653,212.62	362,653,212.62
存出保证金	2,103,832,841.02	-	-	-	-	2,379,012,142.75	4,482,844,983.77
可供出售金融资产	1,216,024,756.30	1,211,070,870.40	1,512,207,877.15	57,116,888.70	-	5,279,727,695.32	9,276,148,087.87
持有至到期投资	-	-	-	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	-	152,104,874.73	152,104,874.73
金融资产合计	121,263,825,923.09	10,286,069,508.60	86,369,313,405.43	18,817,965,969.12	8,325,945,143.04	18,665,361,626.83	263,728,481,576.11

	2014年12月31日						合计
	1 个月内	1 个月至3 个月	3 个月至1 年	1 年至5 年	5 年以上	不计息	
金融负债							
应付短期融资款	(4,482,000,000.00)	(5,737,290,000.00)	(14,567,780,000.00)	-	-	-	(24,787,070,000.00)
拆入资金	-	(1,250,000,000.00)	(250,000,000.00)	-	-	-	(1,500,000,000.00)
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	-	-	-	-	-	(9,244,846.63)	(9,244,846.63)
衍生金融负债	(49,065,838.38)	(93,972.98)	-	-	-	(681,583,331.57)	(730,743,142.93)
卖出回购金融资产款	(9,642,128,233.78)	(5,667,800,000.00)	(29,358,300,000.00)	(5,000,000,000.00)	-	-	(49,668,228,233.78)
代理买卖证券款	(60,398,770,689.39)	-	-	-	-	-	(60,398,770,689.39)
代理承销证券款	-	-	-	-	-	(41,400,000.00)	(41,400,000.00)
信用交易代理买卖证券款	(9,829,634,190.63)	-	-	-	-	-	(9,829,634,190.63)
应付款项	-	-	-	-	-	(4,194,205,380.59)	(4,194,205,380.59)
长期借款	-	-	-	(138,657,783.84)	-	-	(138,657,783.84)
应付债券	-	-	-	(15,357,126,436.52)	(5,988,197,698.79)	-	(21,345,324,135.31)
其他负债(金融负债)	-	-	-	-	-	(52,103,789,780.47)	(52,103,789,780.47)
金融负债合计	(84,401,598,952.18)	(12,655,183,972.98)	(44,176,080,000.00)	(20,495,784,220.36)	(5,988,197,698.79)	(57,030,223,339.26)	(224,747,068,183.57)
二							
利率敏感度 敞口合计	36,862,226,970.91	(2,369,114,464.38)	42,193,233,405.43	(1,677,818,251.24)	2,337,747,444.25	(38,364,861,712.43)	38,981,413,392.54

市场利率的波动主要影响本集团持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动100个基点，对本集团各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

	2015年6月30日		2014年12月31日	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
收益率曲线向上 平移100 个基点	(644, 021, 444. 61)	(640, 389, 056. 69)	(538, 141, 482. 13)	(533, 147, 398. 65)
收益率曲线向下 平移100 个基点	707, 218, 086. 97	703, 382, 699. 29	590, 401, 718. 09	585, 127, 752. 86

(c) 其他价格风险

其他价格风险是指本集团所持权益类金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集团主要投资于证券交易所上市的股票、基金等，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。下表汇总了本集团的其他价格风险敞口：

	2015年6月30日		2014年12月31日	
	公允价值	占净资产比例	公允价值	占净资产比例
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
-股票	20, 650, 431, 815. 92	27%	8, 360, 220, 307. 03	20%
-基金	22, 497, 528, 757. 34	29%	12, 186, 904, 749. 73	29%
-债券	39, 557, 354, 484. 34	51%	34, 486, 847, 798. 83	82%
-其他	2, 191, 877, 227. 06	3%	965, 985, 061. 16	2%
可供出售金融资产				
-股票	2, 407, 629, 421. 64	3%	607, 677, 141. 44	1%
-基金	471, 275, 425. 63	1%	342, 430, 494. 86	1%
-债券	511, 445, 387. 45	1%	391, 341, 300. 00	1%
-证券公司理财产品	147, 372, 119. 69	1%	207, 255, 630. 10	1%
-银行理财产品	105, 663, 173. 14	1%	275, 000, 000. 00	1%
-信托计划	76, 875, 427. 61	1%	1, 391, 786, 693. 48	3%
-其他股权投资	6, 775, 066, 529. 20	9%	4, 617, 969, 257. 15	11%
-其他	850, 227, 850. 68	1%	1, 442, 687, 570. 84	4%
合计	96, 242, 747, 619. 70	128%	65, 276, 106, 004. 62	156%

截至2015年6月30日，若本集团持有的上述投资的公允价值上升5%且其他市场变量保持不变，本集团净资产将相应增加5%（2014年12月31日：6%）；反之，若本集团持有金融工具的公允价值下降5%且其他市场变量保持不变，本集团净资产则将相应下降5%（2014年12月31日：6%）。

(4) 操作风险管理

操作风险是指由于公司内部流程设置不合理，员工操作失误或未严格执行流程等导致公司损失的风险。风险管理部是本公司操作风险的牵头管理部门，各业务部门、支持部门等按照职能分工，分别执行本业务领域的操作风险管控。公司利用技术手段覆盖各项业务及管理流程，防范关键环节的操作风险，并加强流程管控，以保证风险管理的政策、纪律能够有效落实。针对投资交易业务，公司通过系统固化实现了交易熔断机制、强行止损机制和各类交易前端的风险控制。公司于本年度逐步建立操作风险管理系统来收集、分析、监控关键风险指标，对操作风险进行监控。

2012年，本公司根据财政部、证监会、审计署、银监会、保监会联合发布的《企业内部控制基本规范》及其配套指引以及监管部门和公司相关工作要求，开展了以风

险为导向的内部控制规范工作，并从 2013 年起开展持续优化工作，将操作风险自我评估与内控自评相结合，对各业务流程中的固有风险、控制活动等进行了全面梳理、评估，对控制设计及执行的有效性进行了测试，对内控缺陷落实整改，全面梳理优化了公司各业务环节和制度流程，同时补充完善了风险控制矩阵及内控手册，记录了风险点、关键控制活动及业务主要流程图，以保障公司监管措施的到位以及风险管理的有效性。此外，公司在日常工作中将风险管理及内部控制工作前移，全程参与新业务或新产品的制度流程及方案设计，充分识别和全面评估操作风险，通过设置前端控制、规范业务流程等，以落实关键风险点的内部控制措施。

十一、公允价值的披露

√适用 □不适用

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

单位:元 币种:人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
一、持续的公允价值计量				
(一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	56,477,758,336.69	28,165,289,917.68	254,144,030.29	84,897,192,284.66
1. 交易性金融资产	56,477,758,336.69	27,104,178,806.63	254,144,030.29	83,836,081,173.61
(1) 债务工具投资	14,563,570,231.28	24,789,640,222.77	254,144,030.29	39,607,354,484.34
(2) 权益工具投资	41,914,188,105.41	2,314,538,583.86	-	44,228,726,689.27
(3) 衍生金融资产	-	-	-	-
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	1,061,111,111.05	-	1,061,111,111.05
(1) 债务工具投资	-	-	-	-
(2) 权益工具投资	-	1,061,111,111.05	-	1,061,111,111.05
(二) 可供出售金融资产	1,351,089,191.41	2,298,461,762.12	7,620,081,309.31	11,269,632,262.84
(1) 债务工具投资	259,865,300.00	144,799,038.14	920,937,852.31	1,325,602,190.45
(2) 权益工具投资	1,091,223,891.41	2,153,662,723.98	6,699,143,457.00	9,944,030,072.39
(3) 其他	-	-	-	-
(三) 投资性	-	-	-	-

房地产				
1.出租用的土地使用权	-	-	-	-
2.出租的建筑物	-	-	-	-
3.持有并准备增值后转让的土地使用权	-	-	-	-
(四) 生物资产	-	-	-	-
1.消耗性生物资产	-	-	-	-
2.生产性生物资产	-	-	-	-
衍生金融资产	15,532,305.84	302,274,973.18		317,807,279.02
持续以公允价值计量的资产总额	57,844,379,833.94	30,766,026,652.98	7,874,225,339.60	96,484,631,826.52
(五) 交易性金融负债	-27,674,075.61	-15,551,618,360.00	-	-15,579,292,435.61
其中：发行的交易性债券	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
其他	-27,674,075.61	-15,551,618,360.00	-	-15,579,292,435.61
(六) 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	-	-9,248,128.87	-	-9,248,128.87
衍生金融负债	-29,350,947.47	-1,812,403,144.38	-721,242.66	-1,842,475,334.51
持续以公允价值计量的负债总额	-57,025,023.08	-17,373,269,633.25	-721,242.66	-17,431,015,898.99
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

对于存在活跃市场的以公允价值计量且其变动计入当期损益的资产及负债、可供出售金融资产，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。

3、持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。

国债期货合约、股指期货合约、商品期货合约及利率互换合约的公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。权益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关证券交易所报价计算的相关权益证券回报来确定的。股指期货、场外期权的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

2015年，本集团上述持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

4、持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

本集团制定了相关流程来确定持续的第三层次公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本集团定期复核相关流程以及公允价值确定的合适性。

第三层次公允价值计量的量化信息如下：

	2015年6月30日 的公允价值	估值技术	不可观察输入值	对公允价值影响
上市公司可供 出售权益工具	6,699,143,457.00	上市公司比较法	流动性折价	折扣越高， 公允价值越低
理财产品、可转债、 私募债等投资	1,175,081,882.60	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整 折现率越高， 公允价值越低
场外期权			标的资产价格	不适用
场外期权	(721,242.66)	B-S期权定价模型	标的资产价格波动率	不适用

本集团采用第三层次估值的金融工具主要为以公允价值计量的其他股权投资和其他理财产品以及衍生金融工具等。

2015年，上述持续第三层次公允价值计量的资产和负债的公允价值的估值技术并未发生变更。

本集团采用第三层次估值的金融工具主要为以公允价值计量的其他股权投资和其他理财产品等。

2015年，上述持续第三层次公允价值计量的资产和负债的公允价值的估值技术并未发生变更。

5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

	本年利得或损失总额				购买、发行、出售和结算				负债，计入损		
	2014年12月 31日余额	转入第三层次	转出第三层次	计入损益(i)	计入其他 综合收益(i)	购买	发行	出售	结算	2015年6月 30日余额	益的当年未实 现利得或损失
资产											
以公允价值计量且其 变动计入当期											
损益的金融资产	186,370,541.81	-	-	131,887,677.19	-	-	-	(62,275,217.32)	(1,838,971.39)	254,144,030.29	60,730,082.51
- 交易性债券投资	186,370,541.81	-	-	131,887,677.19	-	-	-	(62,275,217.32)	(1,838,971.39)	254,144,030.29	60,730,082.51
可供出售金融资产	5,793,994,780.62	-	-	33,754,622.23	1,525,522,268.27	1,401,575,081.89	-	(1,131,281,711.53)	(3,483,732.37)	7,620,081,309.11	3,483,732.37
-可供出售债券	149,310,000.00	-	-	-	(335,152.75)	19,269,375.00	-	-	-	168,244,222.25	-
- 可供出售其他											
债务工具	1,119,009,183.67	-	-	32,294,896.75	2,693,240.97	692,002,026.89	-	(1,089,821,986.05)	(3,483,732.37)	752,693,629.86	3,483,732.37
-可供出售权益工具	4,525,675,596.95	-	-	1,459,725.48	1,523,164,180.05	690,303,680.00	-	(41,459,725.48)	-	6,699,143,457.00	-
合计	5,980,365,322.43	-	-	165,642,299.42	1,525,522,268.27	1,401,575,081.89	-	(1,193,556,928.85)	(5,322,703.76)	7,874,225,339.40	64,213,814.88

	2014年1月			本年利得或损失总额		购买、发行、出售和结算				2014年12月 31日余额	负债，计入损 益的当年未实 现利得或损失
	1日余额	转入第三层次	转出第三层次	计入损益	计入其他 综合收益	购买	发行	出售	结算		
资产											
以公允价值计量且其 变动计入当期 损益的金融资产	-	-	-	49,816,117.87	-	138,052,253.25	-	-	(1,497,829.32)	186,370,541.80	49,816,117.87
- 交易性债券投资	-	-	-	49,816,117.87	-	138,052,253.25	-	-	(1,497,829.32)	186,370,541.80	49,816,117.87
可供出售金融资产	2,923,297,000.00	-	-	12,648,256.67	1,765,889,418.62	1,253,808,362.00	-	(152,795,236.11)	(8,853,020.56)	5,793,994,780.62	5,243,158.90
- 可供出售债券	-	-	-	-	3,500,000.00	145,810,000.00	-	-	-	149,310,000.00	-
- 可供出售其他 债务工具	189,000,000.00	-	-	11,448,256.67	11,010,821.67	1,050,000,000.00	-	(152,795,236.11)	(7,653,020.56)	1,101,010,821.67	4,043,158.90
- 可供出售权益工具	2,734,297,000.00	-	-	1,200,000.00	1,751,378,596.95	57,998,362.00	-	-	(1,200,000.00)	4,543,673,958.95	1,200,000.00
合计	2,923,297,000.00	-	-	62,464,374.54	1,765,889,418.62	1,391,860,615.25	-	(152,795,236.11)	(10,350,849.88)	5,980,365,322.42	55,059,276.77

- (i) 上述本集团于2015年1-6月确认的利得或损失计入损益或其他综合收益的具体项目情况如下:

	2015年1-6月	
	项目	金额
本年计入损益的已实现利得或损失	投资收益	106,751,188.30
本年计入损益的未实现利得或损失	公允价值变动损益	58,891,111.12
合计		165,642,299.42
计入其他综合收益的利得或损失	可供出售金融资产公允价值变动损益	1,525,522,268.27

6、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

于2015年6月30日及2014年12月31日，本集团不以公允价值计量的各项金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

十二、资本管理

本集团资本管理的主要目标是保障本集团的持续经营，能够通过制定与风险水平相当的产品和服务价格并确保以合理融资成本获得融资的方式，持续为股东提供回报。

本集团定期复核和管理自身的资本结构，力求达到最理想的资本结构和股东回报。本集团考虑的因素包括：本集团未来的资金需求、资本效率、现实的及预期的盈利能力、预期的现金流、预期资本支出等。如果经济状况发生改变并影响本集团，本集团将会调整资本结构。

十三、关联方及关联交易

1、本企业的母公司情况

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例(%)	母公司对本企业的表决权比例(%)
江苏省国信资产管理集团有限公司	南京	国有资产管理等	人民币200亿元	17.46	17.46
江苏交通控股有限公司	南京	国有资产管理等	人民币168亿元	5.57	5.57
江苏高科技投资集团有限公司	南京	投资咨询等	人民币15亿元	4.78	4.78
江苏省苏豪控股集团有限公司	南京	投资、贸易等	人民币20亿元	3.74	3.74

本企业最终控制方是江苏省人民政府国有资产监督管理委员会

2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注九、1

3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注九、3

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

☐适用 ☒不适用

4、其他关联方情况

☒适用 ☐不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
江苏金苏证投资发展有限公司	其他

其他说明

本公司监事高旭为该公司董事

5、关联交易情况

(1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

☒适用 ☐不适用

采购商品/接受劳务情况表

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
南方基金管理有限公司	席位费分仓佣金	24,077,646.66	7,113,959.58
华泰柏瑞基金管理有限公司	席位费分仓佣金	30,402,845.86	2,725,634.05
江苏国信资产管理集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	1,831,539.02	21,502.38
江苏交通控股有限公司-	证券代理买卖交易佣金	18,179.70	
江苏高科技投资集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	32,392.03	4,768.38
江苏苏豪控股集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	120,044.12	226,133.04
南方基金管理有限公司	证券代理买卖交易佣金	4,000.00	18,783.92
华泰柏瑞基金管理有限公司	证券代理买卖交易佣金	-	288.18
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	基金管理费收入	20,000,000.00	20,000,000.00

(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

☐适用 ☒不适用

(3). 关联租赁情况

☒适用 ☐不适用

本公司作为出租方：

单位：元 币种：人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
南方基金管理有限公司	房屋建筑物	552,194.28	552,194.28
华泰柏瑞基金管理有限公司	设备租赁	50,000.00	

本公司作为承租方：

单位：元 币种：人民币

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上期确认的租赁费
江苏省国信资产管理集团有限公司	房屋建筑物		1,137,713.52

(4). 关联担保情况

☐适用 ☒不适用

(5). 关联方资金拆借

☐适用 ☒不适用

(6). 关联方资产转让、债务重组情况

☐适用 ☒不适用

(7). 关键管理人员报酬

☒适用 ☐不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	13,893,578.00	17,200,694.80

(8). 其他关联交易

①认购关联方管理的基金情况

关联方	认购基金名称	2015年1-6月				
		年初持有 份额(万份)	本年新增 份额(万份)	本年减少 份额(万份)	期末持有 份额(万份)	期末余额 (万元)
南方基金	深成ETF	99.00		66.00	33.00	49.20
	中国梦	999.90		999.90	-	-
	中证500ETF	2,817.95		2,800.00	17.95	36.92
	南方恒指EF	500.00		500.00	-	-
	南方现金B	110,000.00		107,990.15	2,009.85	2,009.85
	南方薪金宝	3,061.81		3,061.81	-	-
	南方利鑫混合		17,946.06		17,946.06	18,125.52
	理财金H		52.87		52.87	5,286.82

	南方多利增强A		885.10		885.10	995.21
	合计	117,478.66	18,884.03	115,417.86	20,944.83	26,503.52
华泰柏瑞	华泰柏瑞增利	3,000.13	-	3,000.13	-	-
	华泰柏瑞沪深					
	300ETF	26,947.58	-	25,274.42	1,673.16	7,502.45
	华泰柏瑞上证					
	红利ETF	154.52	-	126.00	28.52	101.13
	华泰柏瑞量化		2,155.10		2,155.10	4,202.45
	华泰柏瑞货币B	25,594.98		9,621.01	15,973.97	15,973.97
	合计	55,697.21	2,155.10	38,021.56	19,830.75	27,780.00

② 与关联方相关取得的投资收益

关联方	关联交易内容	2015年1-6月	2014年1-6月
南方基金管理 有限公司	购买的基金产品分红	3,442,052.30	1,680,062.81
华泰柏瑞基金 管理有限公司	收到基金分红	-	19,600,000.00
	购买的基金产品分红	3,778,108.68	-
江苏金苏证投资 发展有限公司	权益互换投资收益	-	-123,410.60
合计		7,220,160.98	21,156,652.21

③ 对联营企业的投资

关联方名称	关联交易内容	2015年1-6月	2014年1-6月
华泰紫金（江苏） 股权投资基金 （有限合伙）	对联营企业投资	193,000,000.00	
合计		193,000,000.00	

④ 投资本集团发行的集合资管计划

关联方	关联交易内容	2015年6月31日	2014年12月31日
华泰紫金（江苏） 股权投资基金			

(有限合伙) 集合资管计划 301,643,360.00 -

6、关联方应收应付款项

√适用 □不适用

(1). 应收项目

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
基金分仓佣金	华泰柏瑞	22,452,894.93	112,264.47	5,218,983.99	15,656.95
基金分仓佣金	南方基金	14,771,566.57	73,857.83	8,957,462.22	26,872.39
基金产品分红	华泰柏瑞	412,329.65	-	-	-
基金产品分红	南方基金	135,000,000.00	-	-	-

(2). 应付项目

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款项	江苏省国信资产管理集团有限公司	3,211,190.78	3,211,190.78
代理买卖证券款	江苏省国信资产管理集团有限公司	171,268.61	171,046.15
代理买卖证券款	江苏交通控股有限公司	674,453.13	3,093.74
代理买卖证券款	南方基金管理有限公司	20,938.22	11,332.59
代理买卖证券款	华泰柏瑞基金管理有限公司	725.81	3,204.81
代理买卖证券款	江苏高科技投资集团有限公司	2,641.69	-
代理买卖证券款	江苏苏豪控股集团有限公司	24,000,100.15	100.00
其他负债-合并结构化主体形成的其他金融负债	华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	303,743,444.31	-

十四、分部报告

本集团根据内部组织结构、管理要求及内部报告制度确定了经纪及财富管理业务分部，投资银行分部，资产管理业务分部，投资与交易分部和海外及其他分部共五个报告分部。每个报告分部为单独的业务分部，提供不同的劳务，由于每个分部需要不同的技术及市场策略而需要进行单独的管理。本集团管理层将会定期审阅不同分部的财务信息以决定向其配置资源、评价业绩。

经纪及财富管理业务分部从事于代理客户买卖股票、基金、债券及期货，同时也向机构投资者客户推广和销售证券服务及产品，并提供专业化研究服务，协助机构投资者客户作出投资决策。另外，也涵盖了金融产品代理销售、融资融券、约定购回以及股票质押式回购等业务。

投资银行分部向机构客户提供企业金融服务，包含财务顾问、股票承销、债务承销以及全国中小企业股份转让系统与区域股权交易中心相关服务。

资产管理业务分部根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务，提供传统资产管理业务，同时，该分部还通过全资子公司参与经营私募股权资产管理业务。

投资与交易分部为本集团进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的交易。

海外业务及其他分部包括香港子公司的海外业务及总部除主营业务外的其他业务，包括公司总部一般营运资本用途产生的利息收入与开支。

1、业务分部

	2015年1-6月/2015年6月30日						
	经纪及财富管理	投资银行	资产管理	投资与交易	海外业务及其他	分部间抵销	合计
营业收入							
手续费及佣金净收入	7,136,822,304.56	599,375,128.73	160,585,298.89	11,064,787.30	62,516,848.92	(367,201.28)	7,969,997,167.12
利息净收入/(支出)	3,396,122,711.36	63,517,339.93	490,190,866.09	(314,226,158.33)	(866,273,068.36)	-	2,769,331,690.69
投资收益	(169,368.01)	55,765,257.90	180,747,120.48	2,618,879,355.55	324,517,984.57		3,179,740,350.49
公允价值变动收益/(损失)	(229,140,552.99)	-	51,649,032.31	315,307,542.60	213,656,421.54	-	351,472,443.46
其他	21,396,702.29	4,056,102.90	647,321.14	568,630.15	347,041,398.20	-	373,710,154.68
营业收入合计	10,325,031,797.21	722,713,829.46	883,819,638.91	2,631,594,157.27	81,459,584.87	(367,201.28)	14,644,251,806.44
营业支出	(3,350,941,686.24)	(438,013,174.97)	(186,592,441.82)	(690,259,619.96)	(1,168,435,611.79)	367,201.28	(5,833,875,333.50)
营业利润/(亏损)	6,974,090,110.97	284,700,654.49	697,227,197.09	1,941,334,537.31	(1,086,976,026.92)	-	8,810,376,472.94
利润/(亏损)总额	6,997,202,142.13	286,003,667.86	698,245,326.12	1,941,354,527.01	(1,088,932,387.96)	-	8,833,873,275.16
分部资产	358,782,273,174.07	4,005,645,455.31	114,764,576,970.48	48,664,847,593.03	157,540,876,161.00	(103,596,954,216.97)	580,161,265,136.93
分部负债	(348,645,489,142.39)	(773,435,235.32)	(106,974,488,984.47)	(44,725,821,828.41)	(104,888,359,229.54)	103,596,954,216.97	(502,410,640,203.16)
补充信息							
利息收入	5,607,935,696.04	63,517,378.80	555,366,786.53	19,725,009.07	206,101,574.21	-	6,452,646,444.65
利息支出	(2,211,812,984.68)	(38.87)	(65,175,920.44)	(333,951,167.40)	(1,072,374,642.57)	-	(3,683,314,753.96)
折旧与摊销费用	(62,952,313.88)	(6,123,953.21)	(748,894.28)	(2,339,003.31)	(81,215,093.00)	-	(153,379,257.68)
资本性支出	23,764,621.15	1,806,033.76	824,357.68	1,481,871.83	549,920,814.84	-	577,797,699.26
资产减值转回/(损失)	(12,045.87)	4,876,200.00	-	(69,487.28)	(2,432,724.16)	-	2,361,942.69

	2014年1-6 月/2014年12月31日						
	经纪及财富管理	投资银行	资产管理	投资与交易	海外业务及其他	分部间抵销	合计
营业收入							
手续费及佣金净收入	1,555,482,601.79	440,469,339.32	116,451,403.67	6,618,293.33	25,606,451.33	(547,192.98)	2,144,080,896.46
利息净收入/(支出)	1,133,627,855.95	60,751,042.05	329,346,506.35	(310,783,872.20)	(226,848,606.39)	-	986,092,925.76
投资收益	-	4,377,560.06	(21,985,266.48)	616,286,884.85	154,391,960.58	(8,878,799.99)	744,192,339.02
公允价值变动收益/(损失)	-	150,646.44	63,031,506.71	399,880,144.10	513,118.54	-	463,575,415.79
其他	17,828,628.32	4,978,466.14	1,652,011.37	2,912,621.36	3,942,565.46	-	31,314,292.65
营业收入合计	2,706,939,086.06	510,727,054.01	488,496,161.62	714,914,071.44	(42,394,510.48)	(9,425,992.97)	4,369,255,869.68
营业支出	(1,102,542,414.54)	(428,803,266.74)	(57,583,472.13)	(67,428,551.57)	(699,216,941.74)	547,192.98	(2,355,027,453.74)
营业利润/(亏损)	1,604,396,671.52	81,923,787.27	430,912,689.49	647,485,519.87	(741,611,452.22)	(8,878,799.99)	2,014,228,415.94
利润/(亏损)总额	1,621,877,293.14	88,844,060.48	430,912,489.49	647,485,449.87	(745,340,019.15)	(8,878,799.99)	2,034,900,473.84
分部资产	151,991,707,319.37	3,911,596,139.61	60,855,372,327.03	31,038,255,265.66	70,882,121,156.90	(46,453,016,703.88)	272,226,035,504.69
分部负债	(148,246,432,574.30)	(899,627,636.84)	(55,390,532,359.59)	(28,640,444,384.95)	(43,557,607,530.89)	46,453,016,703.88	(230,281,627,782.69)
补充信息							
利息收入	1,366,632,102.30	60,751,042.62	345,160,645.00	20,271,901.69	94,937,246.52	-	1,887,752,938.13
利息支出	(233,004,246.35)	(0.57)	(15,814,138.65)	(331,055,773.89)	(321,785,852.91)	-	(901,660,012.37)
折旧与摊销费用	(79,296,694.46)	(8,549,562.37)	(96,391.80)	(1,152,641.46)	(71,825,663.36)	-	(160,920,953.45)
资本性支出	23,881,884.35	1,184,133.74	120,514.28	680,485.51	309,442,442.49	-	335,309,460.37
资产减值转回/(损失)	-	-	-	-	344,967.96	-	344,967.96

2、地区分部

本集团按不同地区列示的有关 (i) 取得的对外交易收入及 (ii) 固定资产、在建工程、投资性房地产、商誉、无形资产、长期待摊费用及长期股权投资等非流动资产 (简称“非流动资产”) 的信息如下。对外交易收入的地区分布是按接受服务的客户所在地进行划分。非流动资产是按资产实物所在地 (对于固定资产、在建工程、投资性房地产和长期待摊费用而言) 或被分配到相关业务的所在地 (对商誉和无形资产而言) 或联营企业的所在地进行划分。

国家或地区	对外交易收入总额		非流动资产总额	
	2015年6月30日	2014年6月30日	2015年6月30日	2014年12月31日
中国				
其中：中国大陆	14,358,681,394.02	4,327,471,957.97	7,120,060,767.51	6,398,135,564.89
中国香港	285,570,412.42	41,783,911.71	14,319,762.37	15,426,048.71
合计	14,644,251,806.44	4,369,255,869.68	7,134,380,529.88	6,413,561,613.60

3、主要客户

本集团来自各单一客户的收入均低于本集团总收入的10%。

十五、承诺及或有事项

1、重要承诺事项

√适用 □不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

(1) 资本承担

项目	2015年6月30日	2014年12月31日
华泰证券广场	780,458,634.22	1,060,601,648.29
上海金融发展投资基金		200,000,000.00
对联营公司和私募基金的承担	1,128,089,933.00	1,167,625,433.00
	1,908,548,567.22	2,428,227,081.29

(2) 经营租赁承担

根据不可撤销的有关房屋经营租赁协议，本集团于2015年6月30日以后应支付的最低租赁付款额如下：

项目	2015年6月30日	2014年12月31日
1年以内（含1年）	181,432,596.03	182,741,906.98
1年以上2年以内（含2年）	147,748,739.59	124,131,634.98
2年以上3年以内（含3年）	44,547,962.46	67,273,421.35
3年以上	37,956,910.64	42,887,364.17
合计	411,686,208.72	417,034,327.48

2、或有事项

√适用 □不适用

(1). 未决诉讼仲裁形成的或有负债及其财务影响

①周宗浩账户余额纠纷

本公司中央路营业部客户周宗浩声称其账户在2008年4月至2013年6月期间，在未经授权的情况下进行了多笔交易，并产生了相应的交易损失。2014年9月，周宗浩以上述交易未经授权为由起诉本公司中央路营业部赔偿其交易损失人民币1,934,845.97元及相应利息和本案诉讼费用。截止至2015年6月30日，南京市玄武区人民法院认为该案证据不足，要求原告和被告双方继续寻找新的证据以继续审理。因此，本公司无法判断损失(包括相关费用支出)的可能性。

(2). 为其他单位提供债务担保形成的或有负债及其财务影响

截至2015年06月30日，本集团不存在为其他单位提供债务担保形成的或有负债。

(3). 其他或有负债及其财务影响

截至2015年06月30日，本集团不存在其他或有负债。

(4). 或有资产

截至2015年06月30日，本集团不存在或有资产。

十六、资产负债表日后事项

1、重要的非调整事项

√适用 □不适用

(1)与中国证券金融公司签署协议投资于蓝筹股ETF

于2015年7月6日，本公司与中国证券金融股份有限公司签署了相关协议并出资人民币100亿元，与其余20家证券公司共同投资蓝筹股ETF等投资标的。

上述资金由中国证券金融有限公司设立专户进行统一运作，21家证券公司根据投资比例分担投资风险和收益，根据本公司2014年度股东大会和第三届董事会第四次会议对自营业务的授权，本次对蓝筹股ETF的投资已纳入公司年度自营权益类证券及证券衍生品投资规模。前述款项已划转至中国证券金融有限公司。

(2)公司执行董事、职工监事、高级管理人员及员工参与的集合理财计划购买公司H

股股份

本公司执行董事、职工监事、高级管理人员及部分员工自愿筹集资金约2.3亿元人民币，通过合格境内机构投资者（QDII）集合理财计划渠道（“集合理财计划”），在符合有关法律法规的前提下，购入本公司的H股股份。截止2015年7月16日，上述投资计划已实施完毕，共计购入1625万股公司H股股份，平均成本为每股17.6港元。上述集合理财计划产品封闭期为六个月，全体参与者承诺将自觉遵守相关法律法规的规定和产品规则的要求。本公司没有参与上述集合理财计划，亦未对有关执行董事、职工监事、高级管理人员及部分员工参与上述集合理财计划提供任何财务资助。上述集合理财计划并不构成一项员工持股计划或股权激励计划。

2、利润分配情况

☐适用 ☒不适用

十七、风险管理

1、风险管理政策及组织架构

(1). 风险管理政策

附注十、1

(2). 风险治理组织架构

附注十、1

2、信用风险

附注十、2

3、流动风险

附注十、2

4、市场风险

附注十、2

十八、其他重要事项

1、融资融券业务

核算科目	2015年6月30日	2014年12月31日
融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25

融券业务情况：

	2015年6月30日	2014年12月31日
融出证券		
-可供出售金融资产	8,620,875.25	7,865,357.43
-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	324,559,456.19	1,049,762,004.31

-转融通融入证券	1,323,278.00	18,521,006.38
融出证券总额	334,503,609.44	1,076,148,368.12
转融通融入证券总额	1,079,825,716.00	667,968,000.00

2、以公允价值计量的资产和负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	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	期末金额
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）	55,999,957,916.75	-118,787,956.38			84,897,192,284.66
2、衍生金融资产	20,814,658.67	843,140,080.00			317,807,279.02
3、可供出售金融资产	9,143,854,427.67		5,670,682,761.00		11,269,632,262.84
金融资产小计	65,164,627,003.09	724,352,123.62	5,670,682,761.00		96,484,631,826.52
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	65,164,627,003.09	724,352,123.62	5,670,682,761.00		96,484,631,826.52
金融负债					
1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（不含衍生金融负债）	-9,244,846.63	246,149,771.17			-15,588,540,564.48
衍生金融负债	-730,743,142.93	-619,029,451.33			-1,842,475,334.51
金融负债	-739,987,989.56	-372,879,680.16			-17,431,015,898.99

注：本表不存在必然的勾稽关系。

3、外币金融资产和金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公	本期计提	期末金额
----	------	------------	----------	------	------

			允价值变 动	的减 值	
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)	505,534,357.88	219,655,331.87			1,676,186,854.19
2、衍生金融资产	3,482,104.61	-25,865.78			4,720,816.06
3、贷款和应收款	225,369,333.27				350,647,710.50
4、可供出售金融 资产					113,600,000.00
5、持有至到期投 资					
金融资产小计	734,385,795.76	219,629,466.09			2,145,155,380.75
金融负债					
以公允价值计量 且其变动计入当 期损益的金融负 债(不含衍生金融 负债)	-9,244,846.63	-2,758,739.96			-27,674,075.61
衍生金融负债	-1,428,952.84	-3,214,304.59			-5,526,961.72
金融负债	-10,673,799.47	-5,973,044.55			-33,201,037.33

4、所有权或使用权受到限制的资产

	2015年6月30日	2014年12月31日
货币资金	157,666,567.25	69,502,847.18
融出资金	59,140,852,043.86	44,931,541,941.58
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	16,854,302,783.71	12,194,646,725.55
可供出售金融资产	811,514,970.61	249,117,881.66
无形资产	303,438,757.20	306,409,193.88
合计	77,267,775,122.63	57,751,218,589.85

十九、母公司财务报表主要项目注释

1、应收款项

(1) 应收款项按类别分析如下

	2015年6月30日	2014年12月31日
应收手续费及佣金	210,775,757.61	124,719,803.12
其他	-	7,909,984.00
减：坏账准备	(1,219,475.79)	(397,889.36)

应收款项账面价值	209, 556, 281. 82	132, 231, 897. 76
----------	-------------------	-------------------

(2) 应收款项按账龄分析如下

	2015年6月30日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
1年以内	207, 229, 157. 61	98. 71	1, 211, 345. 79	0. 58
1至2年	3, 426, 600. 00	12. 29	7, 770. 00	0. 30
2至3年	120, 000. 00	0. 00	360. 00	0. 30
合计	210, 775, 757. 61	100. 00	397, 889. 36	0. 58

	2014年12月31日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
1年以内	129, 919, 787. 12	97. 96	389, 759. 36	0. 30
1至2年	2, 590, 000. 00	1. 95	7, 770. 00	0. 30
2至3年	120, 000. 00	0. 09	360. 00	0. 30
合计	132, 629, 787. 12	100. 00	397, 889. 36	0. 30

账龄自应收款项确认日起开始计算。

(3) 按评估方式列示

	2015年6月30日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
组合计提减值准备	210, 775, 757. 61	100. 00	1, 219, 475. 79	0. 58

	2014年12月31日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
组合计提减值准备	132, 629, 787. 12	100. 00	397, 889. 36	0. 30

本公司并无就上述已计提坏账准备的应收款项持有任何抵押品。

(4) 本年计提、收回或转回的坏账准备情况

	<u>2015年6月30日</u>	<u>2014年12月31日</u>
年初余额	397,889.36	55,215.32
本年计提	821,586.43	342,674.04
本年收回或转回	-	-
年末余额	1,219,475.79	397,889.36

2、长期股权投资

(1) 按类别列示

	<u>2015年6月30日</u>	<u>2014年12月31日</u>
对子公司的投资	5,809,465,925.28	4,047,567,267.28
对联营企业投资	1,711,905,037.87	1,602,713,133.87
小计	7,521,370,963.15	5,650,280,401.15
减：减值准备	-	-
合计	7,521,370,963.15	5,650,280,401.15

(2) 对子公司的投资

单位名称	年初余额	本年增加	本年减少	年末余额	减值准备 年末余额
华泰联合证券有限责任公司	1,224,096,481.63	11,898,658.00	-	1,235,995,139.63	-
华泰期货有限公司	491,998,085.65	-	-	491,998,085.65	-
华泰紫金投资有限责任公司	600,000,000.00	1,750,000,000.00	-	2,350,000,000.00	-
华泰金融控股（香港）有限公司	827,472,700.00	-	-	827,472,700.00	-
江苏股权交易中心有限责任公司	104,000,000.00	-	-	104,000,000.00	-
华泰创新投资有限公司	500,000,000.00	-	-	500,000,000.00	-
华泰证券（上海）资产管理有限公司	300,000,000.00	-	-	300,000,000.00	-
合计	4,047,567,267.28	1,761,898,658.00	-	5,809,465,925.28	-

本公司子公司的相关信息参见附注九。

(3) 对联营企业的投资

联营企业	年初余额	追加投资	减少投资	本年增减变动					年末余额	减值准备 期末余额
				权益法 下确认的 投资收益	其他 综合收益	其他权 益变动	宣告发 放现金股 利或利润	计提 减值准备		
南方基金管理有限公司	1,359,324,049.23	-	-	155,569,517.24	34,418,981.96	-	(135,000,000.00)	-	1,414,312,548.43	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	243,389,084.64	-	-	45,432,903.21	8,770,501.59	-	-	-	297,592,489.44	-
合计	1,602,713,133.87	-	-	201,002,420.45	43,189,483.55	-	(135,000,000.00)	-	1,711,905,037.87	-

3、 手续费及佣金净收入

	附注	2015年1-6月	2014年1-6月
手续费及佣金收入			
经纪业务收入		10,063,273,804.12	1,923,252,723.69
其中：证券经纪业务收入		10,063,273,804.12	1,923,252,723.69
其中：代理买卖证券业务		9,545,944,263.36	1,850,357,643.90
交易单元席位租赁		333,086,884.21	52,451,117.07
代销金融产品业务	(i)	184,242,656.55	20,443,962.72
投资银行业务收入	(ii)	43,869,254.45	21,212,283.33
其中：证券承销业务		43,869,254.45	21,212,283.33
投资咨询服务收入		57,187,837.03	26,386,864.51
资产管理业务收入		4,796,292.60	301,249,080.30
其他		152,492.62	-
手续费及佣金收入小计		10,169,279,680.82	2,272,100,951.83
手续费及佣金支出			
经纪业务支出		(3,081,666,104.05)	(449,250,648.84)
其中：证券经纪业务支出		(3,081,666,104.05)	(449,250,648.84)
其中：代理买卖证券业务		(3,081,666,104.05)	(443,412,293.63)
交易单元席位租赁		-	(25,000.00)
代销金融产品业务	(i)	-	(5,813,355.21)
投资银行业务支出	(ii)	(14,410,398.33)	(4,656,309.32)
其中：证券承销业务		(14,410,398.33)	(4,656,309.32)
投资咨询服务支出		(662,084.60)	(1,136,110.02)
资产管理业务支出		-	(516,948.70)
手续费及佣金支出小计		(3,096,738,586.98)	(455,560,016.88)
手续费及佣金净收入		7,072,541,093.84	1,816,540,934.95

(i) 代销金融产品业务

	2015年1-6月		2014年1-6月	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	19,152,573,983.45	181,178,479.11	5,337,405,709.42	19,004,280.41
证券公司				
理财产品	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17	389,680,824,098.25	433,315.19
信托	2,183,010,000.00	1,731,048.27	1,383,520,000.00	1,006,367.12
合计	2,101,680,984,171.40	184,242,656.55	396,401,749,807.67	20,443,962.72

(ii) 投资银行业务净收入

	<u>2015年1-6月</u>	<u>2014年1-6月</u>
投资银行业务收入	43,869,254.45	21,212,283.33
其中：证券承销业务	43,869,254.45	21,212,283.33
投资银行业务支出	(14,410,398.33)	(4,656,309.32)
其中：证券承销业务	(14,410,398.33)	(4,656,309.32)
投资银行业务净收入	<u>29,458,856.12</u>	<u>16,555,974.01</u>

4、投资收益

(1) 投资收益按类别列示

	<u>2015年1-6月</u>	<u>2014年1-6月</u>
成本法核算的长期股权投资收益	-	14,798,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	201,002,420.45	116,572,205.24
金融工具投资收益	2,667,091,751.71	645,396,500.85
持有期间取得的分红和利息	691,597,946.58	587,668,182.13
其中：以公允价值计量且其变动		
计入当期损益的金融资产	569,109,439.62	516,680,309.10
可供出售金融资产	122,374,835.47	70,874,201.54
持有至到期金融资产	113,671.49	113,671.49
处置金融工具取得的收益	1,975,493,805.13	57,728,318.72
其中：以公允价值计量且其变动		
计入当期损益的金融资产	5,154,202,213.81	(150,601,108.74)
可供出售金融资产	179,479,539.90	(108,431,319.27)
衍生金融工具	(3,358,187,948.58)	316,760,746.73
合计	<u>2,868,094,172.16</u>	<u>776,766,706.09</u>

(2) 对联营企业的投资收益

	<u>本期发生额</u>	<u>上期发生额</u>	<u>本期比上期增减变动的原因</u>
南方基金管理			
有限公司	155,569,517.24	99,786,637.67	被投资单位净利润变化
华泰柏瑞基金管理			
有限公司	45,432,903.21	16,785,567.57	被投资单位净利润变化
合计	<u>201,002,420.45</u>	<u>116,572,205.24</u>	

(3) 按成本法核算的长期股权投资收益

	<u>本期发生额</u>	<u>上期发生额</u>	<u>本期比上期增减变动的原因</u>
华泰期货有限公司	-	14,798,000.00	被投资单位分红

(4) 本公司不存在投资收益汇回的重大限制

5、现金流量表补充资料

(1) 将净利润调节为经营活动现金流量

	2015年1-6月	2014年1-6月
净利润	5,785,125,380.12	1,362,804,099.72
加：资产减值损失	2,444,770.03	(344,967.96)
固定资产及投资性房地产折旧	79,416,365.51	75,514,442.21
无形资产摊销	35,737,911.58	26,793,844.25
长期待摊费用摊销	23,833,985.61	33,338,008.33
处置固定资产、无形资产和 其他长期资产的损失	1,486,997.91	297,959.53
公允价值变动(收益)/损失	925,010,999.34	(364,542,504.36)
利息支出	1,524,384,706.49	557,253,062.82
汇兑(收益)/损失	(339,077,225.28)	(840.56)
投资收益	(502,856,795.82)	(116,572,205.24)
递延所得税资产减少/(增加)	-	105,502,579.13
递延所得税负债减少	24,001,518.79	(2,585,809.93)
以公允价值计量且其变动计入当期 损益的金融资产等的增加	(136,212,768.92)	(2,127,288,247.15)
经营性应收项目的增加	(52,652,540,710.55)	(831,970,823.51)
经营性应付项目的增加/(减少)	148,334,625,050.61	8,097,500,025.62
经营活动产生的 现金流量净额	103,105,380,185.42	6,815,698,622.90

(2) 现金及现金等价物净变动情况

	2014年	2013年
现金的年末余额	259,818,603,958.01	39,169,593,645.91
减：现金的年初余额	81,038,846,562.82	29,381,774,912.08
现金及现金等价物净增加/(减少)额	178,779,757,395.19	9,787,818,733.83

二十、补充资料

1、当期非经常性损益明细表

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-1,495,280.53	
越权审批或无正式批准文件的税收返 还、减免		
计入当期损益的政府补助(与企业业 务密切相关,按照国家统一标准定额	3,241,023.71	

或定量享受的政府补助除外)		
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	5,512,041.46	
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	21,751,059.04	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	-7,252,210.92	
少数股东权益影响额	-247,660.65	
合计	21,508,972.11	

本集团持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量

且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产投资期间取得的投资收益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具和可供出售金融资产取得的投资收益不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目，原因为本集团作为证券公司，上述业务均属于本集团的正常经营业务。

2、净资产收益率及每股收益

本集团按照证监会颁布的《公开发行证券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）以及会计准则相关规定计算的净资产收益率和每股收益如下：

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	15.33	1.1450	1.1450
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	15.28	1.1413	1.1413

因本公司不存在稀释性潜在股，故本公司稀释每股收益等于基本每股收益。

3、境内外会计准则下会计数据差异境内外会计准则下会计数据差异

☒ 适用 ☐ 不适用

(1). 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

☐ 适用 ☒ 不适用

(2). 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

☐ 适用 ☒ 不适用

(3). 境内外会计准则下会计数据差异说明，对已经境外审计机构审计的数据进行差异调节的，应注明该境外机构的名称。

本公司按照中国企业会计准则编制的合并财务报表及按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的2015年1-6月及2014年1-6月的净利润、2015年6月30日及2014年12月31日的净资产无差异。

(4). 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

☐ 适用 ☒ 不适用

(5). 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

☐ 适用 ☒ 不适用

4、 会计政策变更相关补充资料

2014年度，公司根据财政部新颁布/修订的《企业会计准则第2号——长期股权投资》等八项企业会计准则变更了相关会计政策，报告期内，公司对比较财务报表进行了追溯重述。采用变更后的会计政策编制的2014年1-6月合并利润表的各项目增减情况如下：

会计科目	本集团		
	调整前	调整数	调整后
手续费及佣金收入	2,357,671,496.16	-213,590,599.70	2,144,080,896.46
利息净收入	658,657,926.99	327,434,998.77	986,092,925.76
投资收益	873,620,638.20	-129,428,299.18	744,192,339.02
公允价值变动损益	399,729,072.71	63,846,343.08	463,575,415.79
其他业务收入	28,409,189.29	1,652,011.36	30,061,200.65
业务及管理费	2,092,763,697.83	-1,074,054.61	2,091,689,643.22
其他业务成本	24,172,765.78	552,535.10	24,725,300.88
所得税费用	490,933,935.06	10,909,504.78	501,843,439.84
其他综合收益	9,254,278.47	-21,119,436.08	-11,865,157.61

5、 主要会计报表项目的异常情况及原因的说明

资产负债表项目	期末余额	期初余额	变动幅度	变动原因说明
货币资金	283,661,411,384.97	89,864,943,930.42	215.65%	客户资金增加及公司发行H股所致
结算备付金	41,311,813,173.22	18,217,248,432.39	126.77%	客户备付金增加所致
融出资金	114,677,991,474.30	64,636,739,457.25	77.42%	融资业务规模大幅度增长所致
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	84,897,192,284.66	55,999,957,916.75	51.60%	期末持有的股票增加及合并结构化主体所致
衍生金融资产	317,807,279.02	20,814,658.67	1426.84%	权益互换浮动盈亏增加
应收款项	1,677,815,454.50	362,653,212.62	362.65%	合并结构化主体所致
应收利息	2,897,491,940.41	1,751,677,109.17	65.41%	融资融券应计利息增加所致
存出保证金	6,636,418,036.19	4,482,844,983.77	48.04%	子公司期货保证金增加
固定资产	2,603,579,520.34	1,258,361,600.29	106.90%	启用新建的办公大楼由在建工程转为固定资产
在建工程	1,086,170,068.11	2,045,324,758.06	-46.89%	启用新建的办公大楼由在建工程转为固定资产
其他资产	703,514,440.27	305,542,089.10	130.25%	收关联方红利及合并资管产品
拆入资金	3,400,000,000.00	1,500,000,000.00	126.67%	银行短期拆入资金增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融	15,588,540,564.48	9,244,846.63	168518.70%	本期新增黄金租赁业务所致

负债				
衍生金融负债	1,842,475,334.51	730,743,142.93	152.14%	权益互换浮动盈亏增加
代理买卖证券款	175,620,904,470.86	60,398,770,689.39	190.77%	客户资金流入所致
信用交易代理买卖证券款	29,518,371,795.33	9,829,634,190.63	200.30%	融资融券业务规模大幅度增长
应付职工薪酬	3,759,075,265.64	1,740,596,909.95	115.96%	计提的职工薪酬增加
应交税费	2,998,377,479.63	1,429,904,303.41	109.69%	本期应税收入增加。
应付利息	1,821,595,255.57	1,025,326,598.95	77.66%	本期短融及次级债规模增加所致
长期借款	367,095,074.05	138,657,783.84	164.75%	本期工程借款增加
应付债券	70,928,065,527.29	21,345,324,135.31	232.29%	发行次级债所致
长期应付职工薪酬	298,041,770.93	705,434,340.93	-57.75%	长期职工薪酬中一年内需支付的部分转入应付职工薪酬
递延所得税负债	1,037,375,485.71	601,173,542.16	72.56%	应纳税暂时性差异增加。
其他负债	103,885,187,866.83	52,103,789,780.47	99.38%	合并结构化主体所致
实收资本（或股本）	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00	27.91%	发行H股所致
资本公积	45,855,964,803.72	17,221,260,799.97	166.28%	H股发行溢价
其他综合收益	3,536,559,397.51	1,853,643,771.39	90.79%	可供出售金融资产的浮动收益增加所致
未分配利润	14,194,010,313.32	10,319,188,382.86	37.55%	本期净利润增加及现金分红所致
利润表科目	本期数	上年同期数	变动幅度	变动原因说明
手续费及佣金净收入	7,969,997,167.12	2,144,080,896.46	271.72%	经纪业务、投行业务手续费及资产管理业务收入均有所增加
利息净收入	2,769,331,690.69	986,092,925.76	180.84%	本期融资融券利息收入增加
投资收益	3,179,740,350.49	744,192,339.02	327.27%	本期证券投资业务收入增加
汇兑收益	331,388,162.11	1,253,092.00	26345.64%	H股募集资金结售汇所致
其他业务收入	42,321,992.57	30,061,200.65	40.79%	子公司咨询服务费收入
营业税金及附加	921,431,417.06	238,957,477.60	285.60%	本期应税收入增加。
业务及管理费	4,878,355,706.15	2,091,689,643.22	133.23%	本期在队伍建设、高端人才引进、信息技术、客户营销与服务方面支出增加
资产减值损失	-2,361,942.69	-344,967.96	584.68%	前期计提减值准备转回
其他业务成本	36,450,152.98	24,725,300.88	47.42%	子公司备用信用证成本
所得税费用	2,115,301,390.96	501,843,439.84	321.51%	本期利润总额增加

其他综合收益的税后净额	1,684,553,023.59	-11,865,157.61	不适用	可供出售金融资产的浮动收益增加
-------------	------------------	----------------	-----	-----------------

6、 财务报表的批准报出

本财务报表业经公司董事会于2015年8月21日批准报出。

第十节 备查文件目录

备查文件目录	载有公司法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报表
备查文件目录	报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露过的所有公司文件的正本及公告原稿
备查文件目录	公司章程

董事长：吴万善

董事会批准报送日期：2015-08-21

第十一节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

1. 2015年1月19日，《关于周勇证券公司董事任职资格的批复》（苏证监机构字[2015]25号）；
2. 2015年1月29日，《关于核准华泰证券股份有限公司股票期权做市业务资格的批复》（证监许可[2015]162号）；
3. 2015年2月13日，《关于核准华泰证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（苏证监机构字[2015]55号）；
4. 2015年4月21日，《关于核准华泰证券股份有限公司发行境外上市外资股的批复》（证监许可[2015]685号）；
5. 2015年4月28日，《关于李志明证券公司独立董事任职资格的批复》（苏证监机构字[2015]112号）；
6. 2015年6月4日，《关于核准华泰证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（苏证监机构字[2015]142号）；
7. 2015年6月19日，《关于核准华泰证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2015]1326号）。

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2013-2015年度，在证券公司分类评价中，公司均被评为A类AA级。