

公司代码：601688

公司简称：华泰证券

华泰证券股份有限公司 2016 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	杨雄胜	因公务原因	陈传明
董事	浦宝英	因公务原因	高旭

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人周易、主管会计工作负责人周易及会计机构负责人（会计主管人员）费雷声明：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.....	3
第二节	公司简介.....	3
第三节	会计数据和财务指标摘要.....	5
第四节	董事会报告.....	9
第五节	重要事项.....	38
第六节	股份变动及股东情况.....	56
第七节	优先股相关情况.....	59
第八节	董事、监事、高级管理人员情况.....	59
第九节	公司债券相关情况.....	62
第十节	财务报告.....	65
第十一节	备查文件目录.....	202
第十二节	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
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
江苏证监局	指	中国证监会江苏监管局
江苏国信	指	江苏省国信资产管理集团有限公司
交通控股	指	江苏交通控股有限公司
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
华泰创新	指	华泰证券全资子公司华泰创新投资有限公司
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
《上市规则》、《香港上市规则》	指	《香港联合交易所有限公司证券上市规则》
《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	2016 年 1-6 月

2016 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	周易
公司总经理	周易
公司授权代表	周易、姜健

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	7,162,768,800	7,162,768,800
净资产	43,755,077,768.74	52,362,033,891.72

公司的各单项业务资格情况

报告期内，公司无新增单项业务资格。

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。

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11楼	江苏省南京市江东中路228号12楼
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11楼	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

报告期内，公司基本情况无变更。

公司注册地址	江苏省南京市江东中路228号
公司注册地址的邮政编码	210019
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	无

四、 信息披露及备置地点变更情况简介

报告期内，公司信息披露及备置地点无变更。

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	无

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	6886	无

六、报告期内注册报告期内注册变更情况

注册登记日期	2016 年 6 月 23 日
注册登记地点	江苏省南京市江东中路 228 号
企业法人营业执照注册号	91320000704041011J
税务登记号码	91320000704041011J
组织机构代码	91320000704041011J
报告期内注册变更情况查询索引	无
变更内容	法定代表人由“吴万善”变更为“周易”。企业法人营业执照、组织机构代码证和税务登记证三证合一，统一社会信用代码为 91320000704041011J。

七、其他有关资料

(一) 法律顾问:

中国香港法律顾问: 高伟绅律师行 (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)

办公地址为: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼

国际会计师事务所: 毕马威会计师事务所

办公地址为: 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	本报告期比上年 同期增减(%)
营业收入	7,355,772,624.15	14,644,251,806.44	-49.77
归属于母公司股东的净利润	2,841,253,347.88	6,674,821,930.46	-57.43
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	2,788,139,076.10	6,653,312,958.35	-58.09
经营活动产生的现金流量净额	5,224,877,408.61	139,225,841,847.80	-96.25
其他综合收益	-1,241,997,192.89	1,684,553,023.59	-173.73
	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	402,679,316,739.75	452,614,615,317.16	-11.03
负债总额	322,941,960,721.83	371,085,844,614.99	-12.97
归属于母公司股东的权益	78,802,062,928.42	80,784,924,864.91	-2.45
所有者权益总额	79,737,356,017.92	81,528,770,702.17	-2.20

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期 增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.3967	1.1450	-65.35
稀释每股收益(元/股)	0.3967	1.1450	-65.35
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.3893	1.1413	-65.89
加权平均净资产收益率(%)	3.62	15.33	减少11.71个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	3.56	15.28	减少11.72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	43,755,077,768.74	52,362,033,891.72
净资产	71,762,523,692.36	74,445,317,086.43
净资本/各项风险准备之和(%)	743.04	880.74
净资本/净资产(%)	60.97	70.34
净资本/负债(%)	46.07	39.67
净资产/负债(%)	75.56	56.41
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	70.09	79.45
自营固定收益类证券/净资本(%)	53.36	72.99

二、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

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	539,637.26	
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	18,586,862.18	
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	-	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	50,117,237.76	
少数股东权益影响额	-119,825.30	
所得税影响额	-16,009,640.12	
合计	53,114,271.78	

四、其他

(一) 采用公允价值计量的项目

单位:元 币种:人民币

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	131,238,108,713.37	93,202,794,125.54	-38,035,314,587.83	685,517,369.47
以公允价值变	21,428,292,467.49	27,047,937,515.23	5,619,645,047.74	-2,986,504,745.35

动计入当期损益的金融负债				
可供出售金融资产	38,118,720,503.37	39,781,850,821.51	1,663,130,318.14	-246,780,889.38
持有至到期投资	5,000,000.00	5,000,000.00	-	111,924.33
衍生金融工具	-2,125,595,372.73	235,866,284.68	2,361,461,657.41	4,132,361,172.93
合计	188,664,526,311.50	160,273,448,746.96	-28,391,077,564.54	1,584,704,832.00

(二) 归属于母公司的股东权益变动情况

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	主要变动原因
实收资本(或股本)	7,162,768,800.00	-	-	7,162,768,800.00	-
资本公积	45,837,762,390.89	-	-	45,837,762,390.89	-
其他综合收益	3,263,870,957.42		1,242,730,884.37	2,021,140,073.05	可供出售金融资产浮动亏损所致
盈余公积	2,607,376,049.13	-	-	2,607,376,049.13	-
一般风险准备	6,681,123,964.00	-	-	6,681,123,964.00	-
未分配利润	15,232,022,703.47	2,841,253,347.88	3,581,384,400.00	14,491,891,651.35	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)	80,784,924,864.91	2,841,253,347.88	4,824,115,284.37	78,802,062,928.42	-

(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

单位:元 币种:人民币

资产负债表项目	2016年6月30日	2015年12月31日	变动幅度
结算备付金	13,398,528,605.62	36,068,780,816.99	-62.85%
衍生金融资产	934,651,457.91	334,749,747.33	179.21%
应收款项	1,996,256,127.81	621,553,847.35	221.17%
应收利息	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91	41.26%
在建工程	115,271,280.72	761,146,125.53	-84.86%
递延所得税资产	528,684,107.61	212,609,137.58	148.66%
其他资产	968,704,802.77	613,733,977.73	57.84%
应付短期融资款	175,000,000.00	1,053,004,000.00	-83.38%
拆入资金	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00	-50.00%
衍生金融负债	698,785,173.23	2,460,345,120.06	-71.60%
卖出回购金融资产款	22,061,434,673.80	33,192,019,282.19	-33.53%
代理承销证券款	41,552,500.00	85,485,000.00	-51.39%
应交税费	1,251,588,450.23	2,700,686,858.57	-53.66%
应付款项	2,023,841,339.23	7,435,329,288.96	-72.78%
应付利息	660,114,285.99	2,692,344,618.00	-75.48%
应付股利	3,594,481,040.00	13,096,640.00	27345.83%
递延所得税负债	154,838,446.90	351,818,817.20	-55.99%
其他综合收益	2,021,140,073.05	3,263,870,957.42	-38.08%

利润表项目	2016年1-6月	2015年1-6月	变动幅度
手续费及佣金净收入	3,977,792,106.30	7,969,997,167.12	-50.09%
利息净收入	1,547,841,531.48	2,769,331,690.69	-44.11%

投资收益	1,523,294,836.43	3,179,740,350.49	-52.09%
汇兑收益	-23,437,370.86	331,388,162.11	-107.07%
其他业务收入	83,237,227.84	42,321,992.57	96.68%
营业税金及附加	343,743,698.03	921,431,417.06	-62.69%
业务及管理费	3,164,140,665.94	4,878,355,706.15	-35.14%
资产减值损失	-5,265,130.74	-2,361,942.69	122.92%
营业外收入	72,793,777.62	31,747,969.45	129.29%
营业外支出	3,550,040.42	8,251,167.23	-56.98%
所得税费用	934,458,775.61	2,115,301,390.96	-55.82%
其他综合收益的税后净额	-1,241,997,192.89	1,684,553,023.59	-173.73%

母公司数据

资产负债表项目	2016年6月30日	2015年12月31日	变动幅度
结算备付金	13,740,359,984.50	37,542,778,536.55	-63.40%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	29,177,974,813.30	61,372,284,920.02	-52.46%
衍生金融资产	857,520,593.56	169,412,016.56	406.17%
应收款项	347,070,109.35	255,170,972.27	36.01%
应收利息	2,784,185,562.66	2,104,421,793.75	32.30%
投资性房地产	1,943,669,886.58	1,218,239,214.22	59.55%
在建工程	113,679,899.31	761,146,125.53	-85.06%
递延所得税资产	304,049,320.57	-	不适用
其他资产	433,765,793.83	166,815,106.02	160.03%
应付短期融资款	175,000,000.00	1,053,004,000.00	-83.38%
拆入资金	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00	-50.00%
衍生金融负债	685,182,383.46	2,447,067,855.02	-72.00%
卖出回购金融资产款	15,328,204,438.35	25,682,048,527.71	-40.32%
代理承销证券款	1,542,500.00	5,485,000.00	-71.88%
应交税费	1,003,160,019.70	2,340,716,139.50	-57.14%
应付款项	1,243,022,549.11	7,039,087,891.73	-82.34%
应付利息	632,564,582.38	2,668,712,142.54	-76.30%
应付股利	3,581,384,400.00	-	不适用
其他综合收益	1,481,413,702.48	2,741,713,260.78	-45.97%

利润表项目	2016年1-6月	2015年1-6月	变动幅度
手续费及佣金净收入	2,920,296,318.82	7,072,541,093.84	-58.71%
利息净收入	1,119,341,728.09	2,125,201,118.39	-47.33%
投资收益	536,446,468.95	2,868,094,172.16	-81.30%
公允价值变动(损失)/收益	338,933,869.70	92,831,718.50	265.11%
汇兑收益	4,749,030.32	339,077,225.28	-98.60%
其他业务收入	44,165,411.55	23,659,108.49	86.67%
营业税金及附加	244,309,933.84	836,541,057.53	-70.80%
业务及管理费	1,956,339,509.56	4,046,623,592.25	-51.66%
资产减值损失	-3,338,018.16	2,444,770.03	-236.54%

其他业务成本	28,223,819.68	10,155,779.45	177.91%
营业外收入	44,530,839.55	29,346,829.84	51.74%
营业外支出	2,497,466.30	8,225,363.69	-69.64%
所得税费用	621,540,391.53	1,861,635,323.43	-66.61%
其他综合收益的税后净额	-1,260,299,558.30	1,255,365,821.39	-200.39%

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

2016 年上半年，国际国内经济金融形势错综复杂。国际方面，全球经济局势动荡，世界经济仍处于国际金融危机后的深度调整期，总体呈现复苏乏力状况。国内方面，我国经济金融运行总体平稳，经济结构持续优化，供给侧结构性改革取得积极进展，经济运行处于合理区间，但我国经济内生动力依然不足，经济下行压力依然较大。

2016 年上半年，股票市场整体处于低迷状态，沪深两市主要指数均表现为下跌，同时，市场交投并不活跃，市场交易量同比大幅缩减。报告期末，上证综指收盘于 2929.61 点，报告期内下跌 17.22%；报告期末，深证成指收盘于 10489.99 点，报告期内下跌 17.17%。根据 Wind 资讯 2016 年上半年股票市场发行与交易统计数据，2016 年上半年沪深 A 股市场累计股票成交金额人民币 636,537.31 亿元，较 2015 年同期大幅下跌 54.01%，日均股票成交金额人民币 5,304.48 亿元，较 2015 年同期大幅下跌 54.39%；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人民币 8,046.55 亿元，较 2015 年同期上涨 18.18%，其中，因 IPO 发行节奏放缓，首发实际募集资金较 2015 年同期大幅下跌 78.55%，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 2015 年同期上涨 42.58%。

2016 年上半年，在经济基本面下行、信用风险冲击以及美联储加息和英国脱欧等因素影响下，债券收益率整体呈现震荡走势。报告期末，中证全债指数收于 174.95，报告期内上涨 1.63%；报告期末，中债综合全价指数收于 117.78，报告期内下跌 0.20%。报告期内，债券市场发展迅猛，市场规模快速扩大，产品类型进一步丰富。根据 Wind 资讯 2016 年上半年债券发行规模统计数据，报告期内债券发行总额人民币 183,723.53 亿元，较 2015 年同期大幅上涨 105.38%，其中，地方政府债发行规模人民币 35,755.00 亿元，同比大幅上涨 311.80%；同业存单发行规模人民币 60,493.00 亿元，同比大幅上涨 262.65%；企业债发行规模人民币 3,256.50 亿元，同比大幅上涨 79.86%；公司债发行规模人民币 14,320.51 亿元，同比大幅上涨 1,553.66%；金融债发行规模同比回落；国债、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。

根据中国证券业协会公布的未经审计的 2016 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人民币 1,570.79 亿元，同比下跌 52.47%；代理买卖证券业务净收入人民币 559.76 亿元，同比下跌 64.67%；证券承销与保荐业务净收入人民币 241.16 亿元，同比上涨 50.25%；财务顾问业务净收入人民币 71.43 亿元，同比上涨 64.06%；投资咨询业务净收入人民币 23.33 亿元，同比上涨 21.19%；资产管理业务净收入人民币 134.34 亿元，同比上涨 9.99%；证券投资收益（含公允价值变动）人民币 244.86 亿元，同比下跌 73.40%；利息净收入人民币 169.04 亿元，同比下跌 53.86%；证券行业合计实现净利润人民币 624.72 亿元，同比下跌 59.22%。截至 2016 年 6 月 30 日，我国证券行业总资产人民币 5.75 万亿元，同比下跌 30.47%；净资产人民币 1.46 万亿元，同比上涨 12.31%；净资本人民币 1.18 万亿元，同比上涨 3.51%。

(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	7,355,772,624.15	14,644,251,806.44	-49.77
营业成本	3,547,004,355.00	5,833,875,333.50	-39.20
营业利润	3,808,768,269.15	8,810,376,472.94	-56.77
归属于母公司股东的净利润	2,841,253,347.88	6,674,821,930.46	-57.43
经营活动产生的现金流量净额	5,224,877,408.61	139,225,841,847.80	-96.25
投资活动产生的现金流量净额	1,167,305,633.01	1,538,183,023.72	-24.11
筹资活动产生的现金流量净额	-24,134,816,785.55	76,004,432,158.12	-131.75
现金及现金等价物净(减少)/增加额	-17,675,556,433.06	217,103,062,385.34	-108.14
研发投入	84,133,400.00	53,688,200.00	56.71

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
经纪及财富管理业务	527,462.89	71.71	1,032,503.18	70.51	增加 1.20 个百分点
投资银行业务	96,543.23	13.12	72,271.38	4.94	增加 8.18 个百分点
资产管理业务	121,205.40	16.48	88,381.96	6.04	增加 10.44 个百分点
投资与交易业务	61,022.48	8.30	263,159.42	17.97	减少 9.67 个百分点
海外业务及其他	-69,934.26	-9.51	8,145.96	0.56	减少 10.07 个百分点

报告期内,按合并口径,公司实现营业收入人民币 735,577.26 万元,与上年同期人民币 1,464,425.18 万元相比,营业收入减少人民币 728,847.92 万元,降幅为 49.77%。主要业务类别中,经纪与财富管理业务、投资及交易业务同比分别减少了人民币 50.50 亿元、20.21 亿元,投资银行业务和资产管理业务同比分别增加了人民币 2.43 亿元、3.28 亿元。

从收入结构看,因股指大幅下跌投资收益减少,投资及交易业务收入占比下降了 9.67 个百分点;由于债券承销、再融资业务快速增长及保持并购重组业务领先地位,资产管理规模的持续增长,导致投资银行业务及资产管理业务收入和收入占比出现双增长。

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	本期占总成本比例 (%)	上年同期数	上年同期占总成本比例 (%)	增减
经纪及财富管理业务	业务及管理费、营业税金及附加	213,174.28	60.10	335,094.17	57.44	增加 2.66 个百分点
投资银行业务		55,353.85	15.61	43,801.32	7.51	增加 8.10 个百分点
资产管理业务		36,130.17	10.19	18,659.24	3.20	增加 6.99 个百分点
投资与交易业务		18,918.95	5.33	69,025.96	11.83	减少 6.50 个百分点
海外业务及其他		31,831.74	8.97	116,843.56	20.03	减少 11.06 个百分点

报告期内，按合并口径，公司实现营业成本人民币 354,700.44 万元，与上年同期人民币 583,387.53 万元相比，营业成本下降人民币 228,687.09 万元，降幅为 39.20%。从各项主营业务成本占公司总成本的比例情况看，投资及交易业务、海外业务及其他分别减少了 6.50 个百分点和 11.06 个百分点；经纪及财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务成本占比分别增加了 2.66 个百分点、8.10 个百分点和 6.99 个百分点。投资银行业务、资产管理业务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营业税金及附加和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	316,414.07	487,835.57	-171,421.50	-35.14
所得税费用	93,445.88	211,530.14	-118,084.26	-55.82

报告期内，公司业务及管理费用较上年同期下降 35.14%，主要原因是收入大幅下降导致绩效费用相应减少。利润下降也导致所得税费用减少。

5 研发支出

单位：万元 币种：人民币

本期费用化研发投入	1,655.43
本期资本化研发投入	6,757.91
研发投入合计	8,413.34
研发投入总额占净资产比例 (%)	0.11
研发投入总额占营业收入比例 (%)	1.14
公司研发人员的数量	402
研发人员数量占公司总人数的比例 (%)	7.42
研发投入资本化的比重 (%)	80.32

为长效提升经营效益和管理效率，支持并推动创新业务发展，公司始终坚持研发先行，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人民币 8,413.34 万元。截至报告期末，公司拥有研发人员 402 人，占母公司总人数的 7.42%，较 2015 年底增加 0.56 个百分点。

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：亿元 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	52.25	1,392.26	-1,340.01	-96.25
投资活动产生的现金流量净额	11.67	15.38	-3.71	-24.12
筹资活动产生的现金流量净额	-241.35	760.04	-1,001.39	-131.76
现金及现金等价物净增加额	-176.76	2,171.03	-2,347.79	-108.14

报告期内，公司经营活动产生的现金流量净额为人民币 52.25 亿元，其中经营活动现金流入人民币 641.63 亿元，经营活动现金流出人民币 589.38 亿元；投资活动产生的现金流量净额为人

人民币 11.67 亿元，其中投资活动现金流入人民币 54.65 亿元，投资活动现金流出人民币 42.98 亿元；筹资活动产生的现金流量净额为人民币-241.35 亿元，其中筹资活动现金流入人民币 4.19 亿元，筹资活动现金流出人民币 245.54 亿元。

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情况

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	71.35	177.24	-59.74	市场交易量和两融业务规模下降导致的佣金和利息收入的减少
拆入资金净增加额	0.00	19.00	-100.00	拆入资金减少
回购业务资金净增加额	0.00	104.71	-100.00	回购业务规模下降
代理买卖证券收到的现金净额	0.00	1,349.11	-100.00	代买卖证券款余额下降
收到其他与经营活动有关的现金	31.23	501.08	-93.77	其他经营活动现金流入减少
融出资金净增加额	0.00	500.41	-100.00	融资业务规模下降
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	0.00	95.46	-100.00	证券投资规模下降
支付利息、手续费及佣金的现金	26.92	47.46	-43.28	到期债务利息支出减少，经纪业务佣金支出减少
支付的各项税费	31.07	16.54	87.85	汇总缴纳上年税费支出增加
支付其他与经营活动有关的现金	185.66	74.43	149.44	其他经营活动现金流出增加
收到其他与投资活动有关的资金	52.06	7.19	624.06	应付私募基金份额持有人及有限合伙人净资产增加
投资所支付的现金	38.11	3.07	1,141.37	私募股权投资业务对外投资规模增加
吸收投资收到的现金	0.88	306.24	-99.71	上年同期 H 股股权融资

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下降。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下滑，同时，受熔断机制影响股指的大幅下跌导致投资及交易业务收益同比大幅减少。报告期内，两市股基交易量人民币 138.76 万亿元，较上年同期的人民币 294.73 万亿元减少 52.92%；市场融资融券业务余额人民币 8,535.84 亿元，较上年同期的人民币 20,493.86 亿元减少 58.35%。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	73.56	146.44	-49.77	股基交易量、资本中介业务规模下降，投资收益减少
营业支出	35.47	58.34	-39.20	因收入下降税金减少及费用大幅

				下降
营业利润	38.09	88.10	-56.77	营业收入减少
利润总额	38.78	88.34	-56.10	营业收入减少
净利润	29.44	67.19	-56.18	营业收入减少
其中：归属于母公司股东的净利润	28.41	66.75	-57.44	营业收入减少
资产	4,026.79	4,526.15	-11.03	货币资金、金融资产和融出资金减少
负债	3,229.42	3,710.86	-12.97	有息负债减少及客户资金流出
其中：代理买卖证券款（含信用）	1,125.82	1,283.67	-12.30	客户资金流出
归属于母公司股东的权益	788.02	807.85	-2.46	2015 年度利润分配

(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

报告期内，公司第三届董事会第二十九次会议及 2015 年年度股东大会审议通过了《关于公司发行短期融资券的议案》。为顺应证券行业发展要求，进一步改善公司资产负债结构，增加财务弹性，提高资金使用效率，公司将根据需要适时发行短期融资券融入资金。

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，公司积极践行全业务链战略，积极把握市场发展机遇，持续推进传统业务转型与创新业务发展，顺利完成了年初制定的经营目标。证券经纪业务坚定互联网战略，持续做大客户基础及其资产规模，大力推进营业网点职能转型，加快完善以客户为中心的专业服务体系，全面推进财富管理业务转型。融资融券业务强化逆周期风险调节，主动创造风险价值，实行客户分级管理，升级服务内涵，切实推进客户服务体系建设，报告期内市场份额实现跨越式增长。投资银行业务充分发挥并购业务核心优势，持续推动股权业务、债券业务、资本介入等业务发展，积极构建集场内与场外、境内与境外、卖方与买方业务于一体的大投行综合金融服务体系。资产管理业务持续提升体系化的投资管理能力与产品创设能力，不断锻造核心竞争力，满足客户多元化投融资需求，报告期内业务规模与收入均实现大幅提升。权益类投资业务全面推进投研体系建设，在控制方向性交易规模的条件下，大力发展非方向性投资业务；固定收益类投资业务深入拓展固定收益、大宗商品、外汇、销售交易等业务，推进 FICC 业务战略布局；积极开展场内量化投资交易业务转型，大力推进场外衍生品业务，实现业务协同发展。

报告期内，华泰紫金投资完成进一步增资备案手续，注册资本由人民币 23.50 亿元变更为人民币 40.50 亿元；华泰金控（香港）港币 78 亿元增资于报告期后获中国证监会证券基金机构监管部无异议函批准；华泰期货完成进一步增资备案手续，注册资本由人民币 8.09 亿元变更为人民币 10.09 亿元；江苏股权交易中心出资人民币 1,000 万元参股苏州股权交易中心有限公司，出资比例 20%；公司于香港设立全资子公司 Huatai International Holdings Limited，注册资本港币 2.00 元，公司综合金融服务和集团化运作能力进一步提升。

截至 2016 年 6 月 30 日，按合并口径，公司总资产人民币 40,267,931.67 万元，较年初减少 11.03%，归属于上市公司股东的所有者权益人民币 7,880,206.29 万元，较年初减少 2.45%。2016 年 1—6 月，公司实现营业收入人民币 735,577.26 万元，较上年同期减少 49.77%；利润总额人民币 387,801.20 万元，较上年同期减少 56.10%；归属于上市公司股东的净利润人民币 284,125.33 万元，较上年同期减少 57.43%。

(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

①公司收购 AssetMark Financial Holdings, Inc.（以下简称“AssetMark”）100%股权

本公司及本公司全资子公司 Huatai International Finance Limited 于 2016 年 4 月 11 日(收市后)与 AqGen Liberty Holdings LLC. (以下简称“AqGen Liberty”)签订了股份购买协议, Huatai International Finance Limited 有条件同意按照股份购买协议规定的条款、条件和价格, 直接或通过关联公司向 AqGen Liberty 收购目标股份, 即 AssetMark 全部已发行股本。

Huatai International Finance Limited 就本次收购应付的交易对价为 7.8 亿美元的购买价格, 视情况而定, 加上或减去: (i) 交割时 AssetMark 的营运资金与目标营运资金的差额; 减去 (ii) 交割时 AssetMark 的负债, 减去 (iii) AssetMark 未支付的交易费用; 以及(倘适用)加上或减去: (iv) 交割时 AssetMark 的现金与目标现金的差额。交易对价由相关方经考虑目标公司经调整的财务数据及交易先例后公平磋商议定。本公司将通过内部资源筹集本次交易对价, 根据股份购买协议, Huatai International Finance Limited 将以现金向 AqGen Liberty 支付交易对价。

为留任 AssetMark 主要管理层成员和员工并延续对其的激励, Huatai International Finance Limited 与 AssetMark 及其部分主要管理层成员达成股权激励安排。根据该安排, 该等主要管理层成员将用其在本次收购中所取得的部分出售款项投资于持有 AssetMark 的直接或间接控股公司的股权, 并且将参与一项以任期和绩效为依据的股权激励方案。

本集团致力于扩大现有业务并增加收入来源, 以提升股东价值。本次收购有利于拓展投资管理服务能力, 加强本集团在证券行业的领先地位, 有利于增加投资以及扩展已有能力, 为公司客户建立强化型技术解决方案平台, 因此本次收购将给本集团带来显著的战略价值。

本次交易已经本公司第三届董事会第三十次会议审议批准。本次交易完成后, AssetMark 将成为本公司的间接子公司。本次交易未构成重大资产重组。

本次交易尚需相关监管机构的必要批准, 且需多项条件在 2016 年 12 月 30 日(最终截止日)或之前满足或获豁免(倘适用)后才能实施, 存在不确定性。

②报告期内, 公司不存在其他破产重整, 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。

(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 40%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 (%)
经纪及财富管理业务	527,462.89	213,174.28	59.58	-48.91	-36.38	减少 7.97 个百分点
投资银行业务	96,543.23	55,353.85	42.66	33.58	26.37	增加 3.27 个百分点
资产管理业务	121,205.40	36,130.17	70.19	37.14	93.63	减少 8.70 个百分点
投资与交易业务	61,022.48	18,918.95	69.00	-76.81	-72.59	减少 4.77 个百分点
海外业务及其他	-69,934.26	31,831.74	-145.52	-958.51	-72.76	不适用
合计	736,299.74	355,408.99	51.73	-49.72	-39.08	减少 8.43 个百分点

主营业务分行业 and 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权承销、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及交易、固定收益投资及交易、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，股票市场整体处于震荡整理格局，总体呈现量价齐跌态势，根据沪深交易所统计数据，两市股基交易量人民币 138.76 万亿元，较上年同期人民币 294.73 万亿元减少 52.92%。随着移动端开户的普及以及手续费市场化程度的加强等因素影响，券商经纪业务竞争更趋激烈，行业平均佣金率或将进一步下滑，但后续下滑空间有限。

报告期内，证券经纪业务坚定互联网发展战略，坚持做大客户基础和客户资产规模，持续提升市场份额，不断优化客户结构，加快推进业务转型，各项业务稳步增长，收入结构进一步优化。不断提高互联网引流效应，加强网上渠道覆盖度，持续打造以涨乐财富通为载体满足客户日常服务和需求的能力，创新构建互联网营销服务体系。大力推动营业网点职能转型，持续丰富创新服务工具，不断提升员工素质和执业能力，推动分支机构收入结构优化和业务转型。持续优化紫金理财服务体系，积极适应互联网战略，优化服务内容，完善服务形式，着力打造多层次综合性服务，满足客户多元化投资需求。

报告期内，结合用户需求分析，公司持续优化完善移动终端“涨乐财富通”账户、行情、交易等功能内容，用户体验与用户活跃数显著提升。报告期内，“涨乐财富通”下载量 414.78 万；日均活跃用户数 183.18 万；自“涨乐财富通”上线以来，累计下载量 1,516.49 万。报告期内，“涨乐财富通”移动终端客户开户数 55.5 万，占公司全部开户数的 92.39%；公司 78.27% 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

币种：人民币

2016 年 1—6 月			2015 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	101,909.24	7.96	股票	198,974.04	7.18
基金	15,046.67	14.46	基金	44,684.90	28.62
债券	62,415.32	1.74	债券	41,529.58	3.11
合计	179,371.23	5.29	合计	285,188.52	6.68

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 资讯统计数据，报告期内公司股票基金交易量合计人民币 11.70 万亿元，市场份额为 8.45%，排名继续保持行业第一。根据中国证券登记结算统计数据，截至报告期末，公司证券托管总额人民币 2.29 万亿元，行业排名第三。报告期内，公司港股通业务顺利平稳开展，截至报告期末，港股通累积开通权限客户数 121,469 户，累积交易量人民币 638.98 亿元，市场占比为 7.17%。报告期内，公司股票期权经纪业务开展情况稳中有升，总成交量 367.56 万张，市场份额为 9.67%，截至报告期末累计保有账户 7,351 户。

在期货经纪业务领域，截至报告期末，共有 32 家期货营业部，遍及国内 4 个直辖市和 14 个省份。报告期内，华泰期货（不含结算会员）实现代理成交量 12,244.31 万手，成交金额人民币 55,711.57 亿元，同比分别增长 30.80% 和下降 74.03%，市场份额分别为 2.67% 和 2.80%。报告期内，公司期货 IB 业务继续延续增长势头，报告期内新增期货 IB 业务客户 4,984 户，总客户数达 24,463 户，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性总部共 193 家，较 2015 年增加 10 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金融机构所提供的多种金融产品。报告期内，公司审慎开展金融产品引入评价，持续提升产品销售能力，积极构建以客户为导向、以多样化金融产品提供资产配置职能的业务体系。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销理财产品，并持续优化产品销售服务体系，进一步提升公

司代理销售金融产品业务能力，满足客户资产配置需求。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	12,836,701,527.37	109,339,606.60	19,152,573,983.45	181,178,479.11
信托	-	-	2,183,010,000.00	1,731,048.27
其他	2,031,085,046,783.48	2,427,480.17	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17
合计	2,043,921,748,310.85	111,767,086.77	2,101,680,984,171.40	184,242,656.55

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、RQFII、财务公司及商业银行等。报告期内，公司大力推动完善主经纪商业体系，持续推进基金托管及外包业务开展，优化完善业务体系及流程，立足市场客户需求，积极拓展业务发展空间，基金托管及外包业务数量与规模同比均实现较大幅度增长。截至报告期末，公司基金托管业务上线产品 514 只，托管业务规模人民币 413.91 亿元；私募基金外包业务上线产品 1,232 只（含资管子公司产品 728 只），外包业务规模人民币 8,580.96 亿元（含资管子公司业务规模人民币 8,240.82 亿元）。

报告期内，在国际资本市场波动较大、国内资本市场震荡运行、多维层面改革全面推进、证券行业监管日趋严格及机构投资者队伍迅速壮大等因素影响下，券商研究业务面临新的机遇与挑战。报告期内，公司持续优化内部组织架构，强化研究和销售业务一体化服务体系，不断提高客户服务效率和服务质量，为客户提供全方位、高质量的研究服务以满足其多元化服务需求，增强客户粘性。公司继续加大引进研究业务及机构销售领军人物的力度，持续加强研究团队建设，不断提高研究报告质量，研究业务整体实力及市场影响力进一步提升，研究业务收入较 2015 年同期显著增长。截至报告期末，公司公募基金分仓交易量人民币 2,501.67 亿元，公募基金分仓交易量市场份额为 4.91%，较 2015 年度增长 0.61%。

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，受股票市场低迷、监管部门杠杆管理从严及市场流动性充裕带来资金供求失衡等因素影响，市场融资融券业务整体规模不断降低，截至报告期末，业务余额人民币 8,535.84 亿元。报告期内，公司不断升级产品服务内涵，加强业务创新，同时，持续加强逆周期风险调节，提升业务支撑力度，业务发展势头良好。报告期末，母公司融资融券业务余额人民币 500.91 亿元，市场份额 5.87%（行业排名第二），日均维持担保比例 340.33%。报告期内，公司股票质押式回购业务呈持续增长态势，截至报告期末，业务待购回余额合计人民币 416.79 亿元，整体履约保障比率为 318.48%。报告期内，公司积极推进行权融资与限制性股票融资业务，截至报告期末，行权融资业务待购回余额人民币 377.35 万元、整体履约保障比率为 842.76%，限制性股票融资业务待购回余额人民币 14.00 亿元、整体履约保障比率为 415.24%。

(2) 投资银行业务

①股权承销、债券承销与财务顾问业务方面

报告期内，国内经济发展进入新常态，经济增速换挡、结构调整阵痛与动能转换困难相互交织，经济下行压力较大。报告期内，IPO 发行节奏放缓、再融资市场持续活跃，股权融资规模稳步增长；随着债券配套制度和市场基础设施建设的持续完善，债券市场持续扩容，债券发行量显著增长；在供给侧结构性改革、国企改革及并购重组市场化改革深入推进的背景下，并购重组市场呈现持续活跃态势。

报告期内，公司主动调整并优化业务布局，加强内部协同与资源共享，全业务链服务体系不断完善，“专业化分工+体系化协同”的大投行业务模式持续推进，整体运行效率不断提升。充分发挥并购重组业务的品牌效应和辐射作用，进一步巩固市场优势地位，加大聚焦客户和行业的力度，精心打造明星项目，持续提供优质服务并带动其他业务发展。积极挖掘再融资业务机会，扩大战略客户规模，提升客户粘性，有效抵御新股发行节奏减缓等因素影响，保障股权融资业务稳

中有升。加强债券承销业务资源配置，优化业务条线，加大创新力度并强化销售渠道，债券承销业务业绩显著增长。加大资本介入力度，充分发挥公司资本、并购基金和产业基金的效能，积极促进创新业务发展。

合并数据

币种：人民币

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	1	136	48,832.72	8,208,403.65	5,300.00	357,004.88
	增发新股	15	99	3,795,976.58	13,938,200.67	27,802.11	139,637.30
	配股	0	30	0.00	1,002,136.78	0.00	19,236.96
	可转债	0	11	0.00	627,430.00	0.00	16,520.00
	可交换债	2	10	88,000.00	568,539.76	870.00	4,895.34
	优先股	0	1	0.00	900,000.00	0.00	0.00
	债券发行	49	309	5,442,194.12	27,482,879.44	25,476.26	150,540.37
小计	67	596	9,375,003.42	52,727,590.30	59,448.37	687,834.85	
副主承销	新股发行	0	27	0.00	242,956.30	0.00	1,059.01
	增发新股	0	4	0.00	55,903.50	0.00	469.00
	配股	0	12	0.00	244,241.00	0.00	1,811.00
	可转债	0	3	0.00	13,284.00	0.00	12.00
	可交换债	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
	优先股	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
	债券发行	3	98	0.00	941,575.00	0.00	1,882.62
小计	3	144	0.00	1,497,959.80	0.00	5,233.63	
分销	新股发行	0	161	0.00	1,876,238.51	0.00	1,284.42
	增发新股	0	28	0.00	382,226.97	0.00	701.00
	配股	0	31	0.00	136,077.30	0.00	429.94
	可转债	0	9	0.00	164,536.00	0.00	217.74
	可交换债	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
	优先股	0	0	0.00	0.00	0.00	0.00
	债券发行	278	2,608	2,611,000.00	37,341,569.68	2,362.47	40,527.39
小计	278	2,837	2,611,000.00	39,900,648.46	2,362.47	43,160.49	

报告期内，并购重组、财务顾问业务情况（合并数据）

币种：人民币

	净收入（万元）	家数	
	本期	本期	历年累计
并购重组、财务顾问业务	23,565.77	34	856

报告期内，公司合并主承销 67 次，合并主承销金额人民币 937.50 亿元，合并主承销收入人民币 5.94 亿元；合并股权主承销 18 次，合并股权主承销金额人民币 393.28 亿元，合并股权主承销收入人民币 3.40 亿元，根据 Wind 资讯统计数据，报告期内公司股权承销业务主承销金额行业排名第三；合并债券主承销 49 次，合并债券主承销金额人民币 544.22 亿元，合并债券主承销收入人民币 2.55 亿元。在并购重组业务方面，报告期内，公司并购重组交易数量及金额大幅增长，根据 Wind 资讯统计数据，公司主导的并购重组交易数量行业排名第一。

②场外业务方面

报告期内，新三板市场飞速发展，挂牌企业数量及市场规模呈持续增长态势，随着新三板分层制度的实施及市场持续不断的制度创新，市场流动性有望全面改善，交投活跃度有望持续提升，新三板市场将迎来重大发展机遇。根据全国股份转让系统统计数据，截至报告期末，新三板市场挂牌公司 7,685 家，总市值人民币 31,081.90 亿元。公司适时调整业务结构，持续跟进挂牌企业融资需求，全面推进各项业务，为客户提供全方位的综合金融服务。报告期内共完成推荐挂牌项目 21 家、获同意挂牌函项目 1 家、在审项目 5 家，完成 19 家挂牌企业的 19 次股权私募合计人民币 13.69 亿元，并完成多家挂牌企业股权质押融资及债权融资业务。报告期内，公司控股子公司

江苏股权交易中心积极探索股权性融资工具和债务性融资工具，加大资产管理计划创设并提升主动管理能力，不断创新金融产品与服务，截至报告期末，累计发展会员单位 216 家；累计挂牌企业 684 家，且已有 7 家企业转板至新三板挂牌；累计为挂牌企业股权融资人民币 17,138 万元，股权质押融资人民币 1,500 万元；私募债券、定向融资工具、金融资产收益权产品与理财计划分别累计发行人民币 197.54 亿元、人民币 39.74 亿元、人民币 8.82 亿元与人民币 25.26 亿元。

(3) 资产管理业务

① 证券公司资产管理业务方面

报告期内，随着资产管理行业准入门槛的逐步降低，行业竞争日益激烈，市场化程度不断提升，资产管理业务步入核心竞争力比拼及财富管理孵化的时代。随着居民财富的持续增长、全社会投融资需求的日益扩大、养老及社会保障体系建设的不断完善，券商资管业务的发展空间将极为广阔。截至报告期末，券商资管业务规模达人民币 15.00 万亿元，较 2015 年同期增长 46.34%。

在证券公司资产管理业务领域，华泰资管公司以全业务链战略为指导，以多样化的金融产品满足客户多元化的投融资需求，深入引导与创造客户需求。以资产管理方和资产供给方的双重角色，持续提升主动管理能力和产品创设能力，不断锻造核心竞争力。在集合资管业务方面，业务产品线日益丰富，涵盖固收、权益、融资、跨境、另类投资等领域，截至报告期末，合计管理集合资管计划 86 只，合计管理规模人民币 1,166.58 亿元。在定向资管业务方面，积极强化与第三方金融机构的业务合作，不断拓展面向机构定制的理财服务，截至报告期末，合计管理定向资管计划 621 只，合计管理规模人民币 6,844.13 亿元。在专项资管业务方面，两融债权、租赁债权、互联网消费金融、票据资产、保单质押、保理业务等领域推出多款有特色产品，截至报告期末，合计管理专项资管计划 21 只，合计管理规模人民币 230.11 亿元。

根据中国证券投资者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人民币 2,096 亿元，行业排名第四，资产管理业务总规模行业排名第二。根据 Wind 资讯统计数据，报告期内，华泰资管公司新增资产证券化产品规模及发行数量分别位居行业第三及第二。

报告期内，华泰资管公司资产管理业务规模和收入情况如下表所示：

币种：人民币

项目	2016 年 1-6 月		2015 年 1-6 月	
	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理业务	1,166.58	59,897.90	1,080.11	46,327.54
定向资产管理业务	6,844.13	11,720.31	4,221.21	10,547.99
专项资产管理业务	230.11	1,822.00	40.60	250.00

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，在经济结构调整、资本市场改革持续推进及宏观经济增速放缓等因素影响下，私募股权基金募集、投资和退出各环节依然保持稳健发展态势，资本存量、新募集基金数量及平均募集金额均同比显著增长。报告期内，公司积极开展直投基金的设立及募资工作，持续扩大资金管理规模。截至报告期末，华泰紫金投资合计设立直投基金 14 只，已认缴并进行工商登记的资金规模如下：

币种：人民币

直投基金	已认缴并进行工商登记的资金规模
华泰紫金 (江苏) 股权投资基金 (有限合伙)	20 亿元
北京华泰瑞联并购基金中心 (有限合伙)	10 亿元
江苏华泰瑞联并购基金 (有限合伙)	90 亿元
南京华泰瑞联并购基金一号 (有限合伙)	54.42 亿元
南京华泰瑞联并购基金二号 (有限合伙)	29.02 亿元
南京华泰瑞联并购基金三号 (有限合伙)	6.02 亿元
南京华泰瑞联并购基金四号 (有限合伙)	0.52 亿元
华泰招商 (江苏) 资本市场投资母基金中心 (有限合伙)	100.2 亿元

深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	10 亿元
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	10 亿元
江苏工业和信息产业投资基金（有限合伙）	12.06 亿元
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	25.0005 亿元
江苏华泰互联网产业投资基金（有限合伙）	5.0005 亿元
伊犁苏新投资基金合伙企业（有限合伙）	19 亿元

报告期内，华泰紫金投资及其设立的直投资基金实施投资项目情况如下：

	江苏华泰瑞联 并购基金（有 限合伙）	深圳市华泰 瑞麟股权投 资基金合伙 企业（有限合 伙）	北京华泰瑞 合医疗产业 投资中心 （有限合 伙）	华泰招商（江 苏）资本市 场 投资母基金 中心（有限合 伙）	江苏华泰战 略新兴产业 投资基金（有 限合伙）	伊犁苏新投 资基金合伙 企业（有限 合伙）
合计投资项 目数量	5 个	5 个	1 个	1 个	1 个	1 个
其中：股权 投资类项目	5 个	5 个	1 个	-	1 个	1 个
债权 投资类项目	-	-	-	-	-	-
私募 股权基金投 资类项目	-	-	-	1 个	-	-
合计投资金 额	人民币 170,388 万元 +美元 6,139.55 万 元	人民币 17,000 万元	人民币 10,000 万元	人民币 10,000 万元	人民币 4,985.04 万 元	人民币 29,910.27 万元
其中：股权 投资类项目	人民币 170,388 万元 +美元 6,139.55 万 元	人民币 17,000 万元	人民币 10,000 万元	-	人民币 4,985.04 万 元	人民币 29,910.27 万元
债权 投资类项目	-	-	-	-	-	-
私募 股权基金投 资类项目	-	-	-	人民币 10,000 万元	-	-

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 96 只，公募业务基金总规模合计人民币 3,426.99 亿元，较 2015 年同期人民币 2,303.86 亿元增长 48.75%；非公募业务账户资产净值合计人民币 2,203.40 亿元，较 2015 年同期人民币 1,205.36 亿元增长 82.80%。报告期内，南方基金获《中国证券报》“2015 年度金牛基金管理公司奖”、《上海证券报》“第十三届中国‘金基金’TOP 公司奖”等。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 37 只，公募业务基金总规模合计人民币 876.50 亿元，较 2015 年同期人民币 766.62 亿元增长 14.33%；非公募业务账户资产净值合计人民币 11.44 亿元，较 2015 年同期人民币 20.68 亿元减少 44.68%。报告期内，华泰柏瑞获《上海证券报》“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司奖”、《中国证券报》“被动投资金牛基金公司奖”等。

④其他主要业务方面

在期货资产管理业务领域，报告期内，华泰期货不断丰富资金渠道，积极拓展合作范围，全面提升风险控制能力，持续推进主动管理业务，截至报告期末，存续期内资产管理计划合计 108

只，资产管理总规模人民币 104.65 亿元，同比增长 136.67%，期货端权益规模人民币 29.52 亿元，同比增长 251.53%。

(4) 投资及交易业务

①权益证券投资及交易业务方面

报告期内，世界经济依然低迷，国内经济下行压力依然较大，股票市场持续震荡下行，交易量持续萎缩，沪深 300 指数下跌 15.47%。报告期内，公司注重强调安全边际、控制风险及减少回撤，坚持业务多元化和去方向化发展，大力开展非方向性投资业务，强化价值投资的绝对收益理念，全面提升投研能力并有效运用各类金融工具和交易技术，充分发掘和把握各类投资机会，截至报告期末，投资收益率跑赢沪深 300 指数。场内量化对冲投资业务实现向交易型模式转变，并加强策略研究的深度和广度，完善交易监测体系，结合仓位管理和策略管理，积极进行 Alpha 策略交易，报告期内实现了正收益。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 72 家挂牌公司提供做市报价服务，做市总市值人民币 56,666.92 万元。

②固定收益投资及交易业务方面

报告期内，受国内宏观经济基本面疲弱、市场资金面整体较宽松、信用风险事件频发及美联储加息与英国退欧等因素影响，债券市场整体处于震荡行情。报告期内，公司积极开展创新业务并推动传统业务转型，着力布局 FICC 业务，打造差异化竞争优势。自营投资交易业务继续加强研究力度，及时根据市场走势调整投资策略，把握债市波段性操作机会，适时调整持仓结构，合理利用对冲工具对冲风险并积极开展“现券+IRS”等多种形式利差组合交易，截至报告期末，净值增长率显著超过中债综合全价指数。外汇业务积极推进各项自营和代客外汇交易业务资格的获取，完善业务布局。大宗商品业务着重拓展交易品种并优化交易模式，积极开展结构化黄金租借业务，报告期内，结构化黄金租借业务合计开展 51 笔，融资规模合计人民币 133.46 亿元。

③OTC 金融产品与交易业务方面

报告期内，公司继续推进场外柜台市场交易平台建设，持续完善工作机制与业务流程，全力推进私募业务、场外金融衍生品业务及创新融资业务等发展。目前，公司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，公司发行私募产品 15 只，合计规模人民币 35.68 亿元，其中：收益凭证发行 4 只，规模人民币 2.75 亿元；资管计划发行 8 只，规模人民币 25.93 亿元；私募基金发行 2 只，规模人民币 2.00 亿元；信托计划发行 1 只，规模人民币 5.00 亿元。报告期内，公司净减少 19 笔权益类收益互换交易业务，截至报告期末的业务存量为 18 笔，存量名义本金人民币 24.61 亿元。报告期内，公司场外期权业务净增加 1 笔交易，净增加名义本金人民币 98.24 亿元；截至报告期末的存续场外期权交易 41 笔，存量名义本金人民币 250.57 亿元。

合并数据

单位：元 币种：人民币

项目	2016 年 1—6 月	2015 年 1—6 月
证券投资收益	1,337,660,539.04	2,982,236,406.53
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	-398,745,062.87	5,244,097,020.98
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债收益	-1,257,478,447.80	-
出售可供出售金融资产投资收益	-456,456,672.05	241,159,781.34
金融资产持有期间收益	1,671,507,143.34	851,651,924.35
衍生金融工具的投资收益	1,778,833,578.42	-3,354,672,320.14
公允价值变动损益	247,044,292.96	351,472,443.46
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-377,457,004.00	-118,787,956.38
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-1,729,026,297.55	246,149,771.17
衍生金融工具	2,353,527,594.51	224,110,628.67
合计	1,584,704,832.00	3,333,708,849.99

母公司数据

单位：元 币种：人民币

项目	2016 年 1—6 月	2015 年 1—6 月
证券投资收益	344,393,449.68	2,667,091,751.71
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	-516,442,303.48	5,154,202,213.81
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债收益	-1,258,575,315.67	-
出售可供出售金融资产投资收益	-485,150,113.08	179,479,539.90
金融资产持有期间收益	926,942,609.64	691,597,946.58
衍生金融工具的投资收益	1,677,618,572.27	-3,358,187,948.58
公允价值变动损益	338,933,869.70	92,831,718.50
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-382,640,225.87	-363,551,365.73
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-1,763,152,760.00	250,156,640.00
衍生金融工具	2,484,726,855.57	206,226,444.23
合计	683,327,319.38	2,759,923,470.21

(5) 海外业务及其他

报告期内，华泰金控（香港）海外业务继续深入发展，持续搭建新业务平台、不断拓展新产品条线，业务转型和升级不断推进，实现了以零售经纪业务为主的业务模式转变为拥有多业务条线的金融服务平台。截至报告期末，华泰金控（香港）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。

截至报告期末，证券交易方面，华泰金控（香港）客户数 15,222 户、托管资产总量港币 79.46 亿元、股票交易总量港币 119.70 亿元；期货合约交易方面，客户数 1,168 户、托管资金量港币 1.12 亿元、期货交易总量 4.52 万手；就证券提供意见方面，为约 3,500 个客户提供研究报告及咨询；就机构融资提供意见方面，参与完成 IPO 项目 2 个、股票配售项目 1 个，合计承销家数 3 个，总交易发行规模约 2.52 亿美元；提供证券保证金融资方面，信用资金账户数 4,679 户，累计授信金额港币 6,546.38 万元；提供资产管理方面，受托资金总额港币 24.32 亿元。同时，报告期内，华泰金控（香港）还完成财务顾问项目 8 个，结构性投融资项目 1 个。

其他业务指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，总部中后台部门的费用支出以及对联营企业的投资收益等。其他业务本期营业收入较上年同期大幅减少，主要是公司去年上半年未发行了人民币 180 亿元的次级债和人民币 66 亿元的公司债，造成本期的利息支出同比大幅增加；另外，本期汇兑损益较去年同期也大幅下降，主要是去年同期 H 股发行融资产生了较多的汇兑收益。

(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

信用类创新业务方面。报告期内，公司积极推进定增融资业务，以满足客户认购上市公司非公开发行定向增发股票的融资需求，同时积极推进资管计划份额融资业务创新试点。信用类创新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。

场外衍生品业务方面。报告期内，公司场外衍生品业务积极关注业务及市场发展机会，探索业务创新发展模式，大力推动业务转型发展，业务内涵不断丰富和完善，业务收入来源不断多元化。场外衍生品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，满足客户多元化需求，进一步扩大券商收入来源。

场内期权业务方面。2015 年，经上交所批准，公司成为上交所股票期权交易参与者，并开通股票期权经纪业务与自营业务交易权限。同时，经中国证监会与上交所批准，公司成为上证 50ETF 期权合约品种主做市商。报告期内，公司积极开展期权做市业务，持仓风险暴露可控、行权平稳，

主做市商每月评级均为 A。场内期权业务的开展丰富了量化投资策略，提供了多样化的投资和风险管理工具。

贵金属现货合约代理业务方面。贵金属现货合约代理业务，即公司代理个人客户和机构客户开立贵金属现货合约交易账户并代理买卖的业务。截至报告期末，公司累计开立机构户 1 户、产品户 1 户，白银品种累计成交人民币 5.23 万元。该项业务的开展有利于增加新的代理交易业务资格，扩大代理买卖业务品种，拓展客户投资和资产配置范围，拓宽业务收入渠道，增强业务差异化优势。

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，报告期内公司完成“资管计划份额融资业务”、“定增融资”等创新业务试点。公司结合具体创新业务的特点进一步完善业务评审规则和流程，加强客户尽职调查，强化资金监管，加强业务风险点识别、监控预警和管控。在业务开展过程中，公司风险管理部门设置专岗监控各类风险指标，及时评估风险并报告，以及采用压力测试等多种手段确保业务风险水平满足公司和监管部门的要求。

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。公司也在模型验证和估值复核等方面采取积极措施，以防范模型风险。在具体业务开展过程中，业务一线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要求。

在场内期权业务方面，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、操作流程和应急预案、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。

在贵金属现货合约代理业务方面，公司在事前建立了规范的制度流程、合理的岗位分工及客户适当性管理要求，建立了风险监控指标；业务开展中，公司对贵金属现货合约代理业务的整体开展状况、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。

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	营业收入	营业收入比上年增减 (%)
江苏	98,111.81	-57.93
湖北	15,817.91	-64.12
广东	26,020.28	-61.32
上海	28,259.79	-50.19
北京	13,021.74	-57.55
四川	8,011.49	-60.13
辽宁	4,235.57	-68.86
黑龙江	2,750.15	-66.19
山东	4,222.85	-53.86
天津	5,735.34	-52.25
浙江	6,918.78	-47.18
河南	3,501.45	-53.59

湖南	4,839.63	-62.13
江西	2,507.52	-59.52
广西	1,380.79	-64.72
福建	2,833.48	-56.22
吉林	1,423.78	-38.32
河北	1,130.51	-61.74
陕西	2,478.44	-52.51
安徽	2,078.22	-56.14
海南	980.07	-66.50
宁夏	697.46	-64.63
重庆	1,327.01	-54.28
内蒙古	865.46	-57.65
甘肃	436.22	-28.32
山西	12.44	-97.99
贵州	281.41	-26.88
云南	633.42	-52.29
新疆	155.93	-50.72
青海	123.12	-8.68
营业部小计	240,792.05	-58.01
香港地区	1,039.22	-96.36
总部及子公司	493,745.99	-42.75
合计	735,577.26	-49.77

(2) 公司营业利润地区分部情况

单位：万元 币种：人民币

地区	营业利润	营业利润比上年增减 (%)
江苏	64,699.00	-63.89
湖北	9,030.58	-70.85
广东	11,403.79	-70.40
上海	12,431.88	-61.76
北京	5,133.97	-66.52
四川	4,750.54	-61.58
辽宁	2,454.70	-73.95
黑龙江	1,439.49	-75.51
山东	2,337.33	-63.72
天津	2,847.92	-62.76
浙江	3,785.02	-56.70
河南	1,991.01	-58.57
湖南	2,756.34	-69.28
江西	1,617.96	-65.16
广西	698.76	-71.38
福建	1,210.87	-68.41
吉林	694.97	-52.55
河北	639.42	-69.06
陕西	1,507.65	-60.22
安徽	1,240.17	-55.69
海南	549.40	-74.69
宁夏	392.64	-72.98
重庆	786.39	-60.77

内蒙古	417.50	-67.96
甘肃	178.70	82.25
山西	-35.75	-110.21
贵州	126.54	-17.01
云南	202.07	-62.09
新疆	11.33	-90.69
青海	70.21	10.84
营业部小计	135,370.39	-65.30
香港地区	-15,378.72	-198.85
总部及子公司	260,885.15	-45.12
合计	380,876.83	-56.77

(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

资产项目	2016年6月30日	占本期末总资产比例 (%)	2015年12月31日	占上期末总资产比例 (%)	本期较上期同比变动 (%)	变动情况说明
货币资金	1,523.94	37.85	1,351.34	29.86	12.77	
结算备付金	133.99	3.33	360.69	7.97	-62.85	交易量减少导致的客户资金减少, 结算备付金也相应减少所致
融出资金	514.56	12.78	674.32	14.90	-23.69	两融规模下降
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	932.03	23.15	1,312.38	29.00	-28.98	证券投资规模下降
衍生金融资产	9.35	0.23	3.35	0.07	179.10	黄金远期合约浮动收益增加
买入返售金融资产	277.44	6.89	256.35	5.66	8.23	
应收款项	19.96	0.50	6.22	0.14	220.90	合并结构化主体应收清算款增加
应收利息	46.37	1.15	32.82	0.73	41.29	应收融资融券利息和合并结构化主体应收债券利息增加
存出保证金	76.30	1.90	60.09	1.33	26.98	交易保证金增加
可供出售金融资产	397.82	9.88	381.19	8.42	4.36	
持有至到期投资	0.05	0.00	0.05	0.00	0.00	
长期股权投资	27.58	0.69	26.74	0.59	3.14	
投资性房地产	12.22	0.30	13.02	0.29	-6.14	
固定资产	33.82	0.84	26.18	0.58	29.18	在建工程转入
在建工程	1.15	0.03	7.61	0.17	-84.89	转入固定资产

无形资产	4.07	0.10	4.25	0.09	-4.24	
商誉	0.51	0.01	0.51	0.01	0.00	
长期待摊费用	0.68	0.02	0.78	0.02	-12.82	
递延所得税资产	5.29	0.13	2.13	0.05	148.36	可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	9.69	0.24	6.14	0.14	57.82	应收联营企业分红及预付款增加所致
资产总计	4,026.79	100.00	4,526.15	100.00	-11.03	
负债项目	2016年6月30日	占本期末总负债比例(%)	2015年12月31日	占上期末总负债比例(%)	本期较上期同比变动(%)	变动情况说明
短期借款	7.60	0.24	6.88	0.19	10.47	
应付短期融资款	1.75	0.05	10.53	0.28	-83.38	短期融资券兑付及新增规模下降
拆入资金	15.00	0.46	30.00	0.81	-50.00	拆入资金规模下降
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	270.48	8.38	214.28	5.77	26.23	黄金租赁融资业务规模增加
衍生金融负债	6.99	0.22	24.60	0.66	-71.59	权益互换与黄金远期合约的浮动亏损减少
卖出回购金融资产款	220.61	6.83	331.92	8.95	-33.54	债券收益权融资的偿还
代理买卖证券款	994.71	30.80	1,097.30	29.57	-9.35	客户交易结算资金余额下降
代理承销证券款	0.42	0.01	0.85	0.02	-50.59	客户承销结算资金余额下降
信用交易代理买卖证券款	131.11	4.06	186.37	5.02	-29.65	客户信用交易结算资金下降
应付职工薪酬	20.80	0.64	28.08	0.76	-25.93	
应交税费	12.52	0.39	27.01	0.73	-53.65	税前利润下降引起应交所得税减少
应付款项	20.24	0.63	74.35	2.00	-72.78	开放式基金申、认购款减少及股票受益权互换业务结算
应付利息	6.60	0.20	26.92	0.73	-75.48	债券、收益凭证等到期偿还导致的应付利息减少
应付股利	35.94	1.11	0.13	0.00	27,546.15	宣告但未发放的2015年度应付股利
预计负债	0.73	0.02	0.73	0.02	0.00	
长期借款	4.25	0.13	4.85	0.13	-12.37	

应付债券	528.51	16.37	723.72	19.50	-26.97	部分债券到期偿还
长期应付职工薪酬	37.63	1.17	33.67	0.91	11.76	薪酬发放
递延所得税负债	1.55	0.05	3.52	0.10	-55.97	应纳税暂时性差异减少
递延收益	0.19	0.01	0.15	0.00	26.67	
其他负债	911.80	28.23	884.98	23.85	3.03	
负债合计	3,229.42	100.00	3,710.86	100.00	-12.97	

2、资产结构和资产质量

截至 2016 年 6 月 30 日，本集团的股东权益合计为人民币 797.37 亿元，较 2015 年末减少人民币 17.92 亿元，下降 2.20%，主要原因是报告期内公司计提了 2015 年度分红款人民币 35.81 亿元使得净资产有所下降。

资产结构持续优化，资产质量和流动性保持良好。截至 2016 年 6 月 30 日，本集团总资产人民币 4,026.79 亿元，较年初减少人民币 499.35 亿元，降幅 11.03%。其中，本集团货币资金及结算备付金占总资产的比率为 41.17%，融出资金占总资产的比率为 12.78%；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产占总资产的比率为 23.15%；可供出售金融资产占总资产的比率为 9.88%；投资性房地产、固定资产、在建工程及无形资产占总资产的比率为 1.27%，大部分资产的变现能力较强，本集团资产流动性强，资产结构合理。

资产负债率水平略有下降。截至 2016 年 6 月 30 日，本集团负债为人民币 3,229.42 亿元，较年初减少人民币 481.44 亿元，主要是本报告期内存量债务逐步到期，降低了公司偿债风险。

3、报告期内公司盈利能力情况分析

报告期内，公司收入和利润均较上年同期有较大幅度的下降，主要是上半年受熔断机制推出影响，沪深两市在经历急速下挫后震荡盘底，成交量大幅萎缩，同时两融余额也较上年同期大幅下降，以上市场原因导致公司经纪业务手续费及佣金收入、资本中介利息收入以及自营业务投资收益等均同比大幅下降，但公司投资银行业务和资产管理业务保持良好发展势头，业务收入均较上年同期有一定增长。

在外部市场环境不利的情况下，公司坚定全业务链发展战略，加快财富管理业务的转型步伐，持续打造核心竞争力。2016 年 1-6 月，公司经纪业务市场份额（股基市场份额）8.45%，位居行业第一；截至 6 月末，公司融资融券余额市场份额 5.87%，排名上升为行业第二；2016 年上半年公司并购重组业务按数量和交易金额排名均居行业第一，股权融资业务市场排名与份额名列行业前茅；公司涨乐财富通下载运行数超过 1,500 万，为理财类 APP 榜单的第一；截至 2016 年 6 月底，公司资产管理总规模达人民币 8,240.82 亿元，较 2015 年末增加了 34.13%，排名行业第二。

4、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	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日	增减 (%)	变动原因
结算备付金	13,398,528,605.62	36,068,780,816.99	-62.85	交易量减少导致的客户资金减少，结算备付金也相应减少所致
衍生金融资产	934,651,457.91	334,749,747.33	179.21	黄金远期合约浮动收益增加
应收款项	1,996,256,127.81	621,553,847.35	221.17	合并结构化主体应收清算款增加
应收利息	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91	41.26	融资融券利息收入增加及结构化产品债券利息收入增加

在建工程	115,271,280.72	761,146,125.53	-84.86	在建工程转固定资产
递延所得税资产	528,684,107.61	212,609,137.58	148.66	可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	968,704,802.77	613,733,977.73	57.84	应收联营企业分红及预付款增加所致
应付短期融资款	175,000,000.00	1,053,004,000.00	-83.38	短期融资券兑付
拆入资金	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00	-50.00	拆入资金减少所致
衍生金融负债	698,785,173.23	2,460,345,120.06	-71.60	黄金远期合约到期及权益互换结算所致
卖出回购金融资产款	22,061,434,673.80	33,192,019,282.19	-33.53	以信用业务债权收益权为质押的回购到期
代理承销证券款	41,552,500.00	85,485,000.00	-51.39	承销结算资金余额减少
应交税费	1,251,588,450.23	2,700,686,858.57	-53.66	企业所得税应纳税额减少
应付款项	2,023,841,339.23	7,435,329,288.96	-72.78	开放式基金申、认购款减少及股票受益权互换业务结算
应付利息	660,114,285.99	2,692,344,618.00	-75.48	公司债券及次级债券到期兑付导致应付利息减少
应付股利	3,594,481,040.00	13,096,640.00	27,345.83	宣告但未发放的 2015 年度应付股利
递延所得税负债	154,838,446.90	351,818,817.20	-55.99	应纳税暂时性差异减少
其他综合收益	2,021,140,073.05	3,263,870,957.42	-38.08	可供出售金融资产浮动亏损

利润表项目	2016 年 1-6 月	2015 年 1-6 月	增减 (%)	变动原因
手续费及佣金净收入	3,977,792,106.30	7,969,997,167.12	-50.09	经纪业务、投行业务手续费及资产管理业务收入均有所降低
利息净收入	1,547,841,531.48	2,769,331,690.69	-44.11	融资融券利息收入降低所致
投资收益	1,523,294,836.43	3,179,740,350.49	-52.09	金融工具处置所得减少所致
汇兑收益	-23,437,370.86	331,388,162.11	-107.07	汇兑收益减少所致
其他业务收入	83,237,227.84	42,321,992.57	96.68	酒店经营及租赁收入增加所致
营业税金及附加	343,743,698.03	921,431,417.06	-62.70	应税收入减少所致
业务及管理费	3,164,140,665.94	4,878,355,706.15	-35.14	员工成本减少
资产减值损失	-5,265,130.74	-2,361,942.69	122.92	融出资金拨备转回所致
营业外收入	72,793,777.62	31,747,969.45	129.29	政府补助及税收返还增加所致
营业外支出	3,550,040.42	8,251,167.23	-56.98	固定资产处置损失减少及其他支出减少所致
所得税费用	934,458,775.61	2,115,301,390.96	-55.82	税前利润减少所致

其他综合收益的税后净额	-1,241,997,192.89	1,684,553,023.59	-173.73	可供出售金融资产浮动亏损
-------------	-------------------	------------------	---------	--------------

5、 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

2016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，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。本集团上半年度共计合并新增9个子公司纳入合并报表范围，详见财务报告附注九、5。

(2) 新增纳入合并范围结构化主体而导致的合并范围变更

本集团对同时作为结构化主体的管理人或投资顾问和投资人，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）。本集团较年初减少2只结构化主体纳入合并报表范围，详见财务报告附注十、6。

6、 公司融资渠道和融资能力等情况分析

(1) 公司融资渠道

从融资方式来看，公司的融资渠道有股权融资和债权融资两种方式。从融资期限来看，公司的短期融资渠道主要包括通过银行间市场进行信用拆借，通过银行间市场和交易所市场进行债券回购，发行短期融资券、短期公司债、短期次级债和收益凭证，向银行等金融机构进行两融收益权融资以及资产证券化等融资方式；公司的中长期融资渠道主要包括发行公司债、发行长期次级债、项目贷款以及股权再融资等融资方式。通过多年来卓有成效的努力，探索并建立了包括新型融资工具在内的多融资渠道于一体的，短、中、长相结合的融资平台，在公司业务的快速发展过程中发挥关键作用。

(2) 公司负债结构

截至2016年6月30日，公司总负债为人民币3,229.42亿元。扣除代理买卖证券款、代理证券承销款及合并结构化主体形成的其他金融负债后，公司自有负债为人民币1,216.10亿元，主要包括公司债、次级债、收益凭证、收益权融资、卖出回购等融资。截至2016年6月30日，公司债余额为人民币165.80亿元，占比为13.63%；次级债余额为人民币336.33亿元，占比为27.66%；卖出回购余额为人民币220.61亿元，占比为18.14%。针对负债规模日益增大的趋势，公司加强了流动性风险管理，采取多项有效措施防范流动性风险。目前公司无重大到期未偿还的债务，公司整体偿债能力较强，流动性风险可控。

(3) 公司流动性管理政策和措施

公司一贯重视流动性管理，强调资金管理以坚持安全性、流动性、效益性相统一的原则，在经营发展战略上注重业务规模与负债相匹配，通过合理的资产配置和多元化的负债融资，确保资产负债的期限、规模的合理配比，确保公司保持适度流动性。

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；三是完善流动性风险报告体系，确保管理层及时了解流动性风险水平及其管理状况；四是不断完善流动性管理平台，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；五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，与商业银行保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度，授信额度稳步增长，具备较强的短期和中长期融资能力。作为上市券商，公司也可以通过股权再融资等方式，解决长期发展的资金需求。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。未来，公司将结合业务发展情况采取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。

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；融资融券等资本中介业务、公司债务融资等与利率直接相关，给相应的利息收入和融资利息支出等带来直接影响；同时，公司的股票投资也受到利率变动的间接影响。此外，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。

为保持公司资产的流动性并兼顾收益率，公司自有资金由资金运营部统一管理，并配以健全的管理制度和相应的业务流程。公司通过及时调整各类资产结构，优化资产负债配置结构，加强对利率和汇率市场的研究，运用相应的利率、汇率等衍生金融工具来规避风险和减轻上述因素的影响。

（5）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公司为香港子公司发行的 4 亿美元境外债向中国银行股份有限公司提供反担保、未决诉讼仲裁形成的或有负债，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。

公司通过 A+H 股的发行上市及多品种类型的债券融资，迅速增强了资本实力，净资本和净资产规模大幅提升。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。根据中国证券业协会公布的数据，截至 2015 年末，公司（母公司）总资产、净资产和净资本分别排名行业第 5 位、第 4 位和第 6 位。

报告期内，公司深入推进业务创新与转型发展，持续深化全业务链体系建设，同时积极推进收购 AssetMark 相关事宜。公司业务范围不断拓展，业务体系和业务结构不断完善，能够围绕客户需求整合内外部资源提供体系化、专业化的综合金融服务，具有强大的规模效应、交叉销售潜力，为公司业务发展及发挥整体业务优势提供了有力支撑。

公司始终将创新作为推动战略转型的关键驱动力，坚持以创新求发展，形成了高效的创新推动机制和管理体系。公司多次被监管机构指定为首批参与新业务试点，并在多项业务领域稳居新业务试点第一梯队。公司大力发展创新业务，并以创新推动传统业务转型升级，创新业务与传统业务的协同效应显现，为公司下一阶段发展夯实了基础。

公司坚定推进线上线下渠道及业务资源整合。一方面，公司持续推进以移动互联网平台为核心的互联网发展战略，公司移动互联网服务领航业界，根据易观智库统计数据，截至报告期末，公司移动终端“涨乐财富通”日均活跃用户数位居券商类 App 第一名。另一方面，公司积极升级传统线下营业网点功能，持续优化网点布局，形成了较为完善的业务网络体系。凭借布局合理的营业网点和业内领先的互联网平台，公司运营效率及协同营销能力不断提升，有利于为公司约 980 万的客户群体提供有针对性的优质服务。

近年来，公司大力推进国际化战略，积极推动境内外业务联动，着力打造海外发展的业务平台。随着公司 A+H 股布局的完成、华泰金控（香港）港币 78 亿元增资获中国证监会无异议函批准以及 AssetMark 收购事宜的持续推进，公司海外业务布局进一步延伸，国际化进程进一步加速，有利于满足客户的跨境业务需求，提升公司的国际影响力。

报告期内，公司进一步加强公司治理结构、合规管理体系、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人民币 27.58 亿元，较期初的人民币 26.74 亿元增加人民币 0.84 亿元，增加幅度为 3.14%。

单位：元 币种：人民币

被投资单位名称	期初余额	本期增减变动	期末余额	持股比例 (%)
南方基金	1,597,134,318.42	-50,705,521.40	1,546,428,797.02	45.00
华泰柏瑞	338,501,167.90	897,015.76	339,398,183.66	49.00
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	520,201,558.30	18,429,995.29	538,631,553.59	48.25
江苏小微企业融资产品交易中心有限责任公司	16,988,526.77	-	16,988,526.77	49.00
江苏工业和信息产业投资基金(有限合伙)	201,000,000.00	-912,106.62	200,087,893.38	16.67
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	-	100,153,521.86	100,153,521.86	10.08
其他	8,170.99	16,200,919.81	16,209,090.80	-
合计	2,673,833,742.38	84,063,824.70	2,757,897,567.08	-

(1) 证券投资情况

币种：人民币

√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)	占期末证券投资总额比例 (%)	报告期损益(元)
1	股票	000601	韶能股份	244,981,338.68	27,229,533.00	284,548,619.85	6.25	39,567,281.17
2	股票	000002	万科A	131,550,758.27	9,029,600.00	220,593,128.00	4.85	-340,060.89
3	股票	300237	美晨科技	85,032,909.00	20,539,350.00	193,480,677.00	4.25	-62,028,837.00
4	股票	300207	欣旺达	150,095,956.49	6,399,575.00	164,277,090.25	3.61	-15,945,042.61
5	股票	002221	东华能源	224,305,995.56	13,256,356.00	161,594,979.64	3.55	12,221,660.49
6	股票	000903	云内动力	138,742,796.41	20,000,000.00	160,600,000.00	3.53	21,857,203.59
7	股票	600666	奥瑞德	116,514,486.68	3,620,243.00	125,839,646.68	2.76	-21,776,777.57
8	股票	603008	喜临门	121,879,691.45	7,168,472.00	123,226,033.68	2.71	1,346,342.23
9	股票	300356	光一科技	99,189,475.87	2,449,942.00	118,675,190.48	2.61	-18,737,281.59
10	股票	300201	海伦哲	61,848,387.61	5,420,086.00	102,168,621.10	2.24	-8,390,259.56
期末持有的其他证券投资				2,770,960,569.00	/	2,897,586,240.50	63.65	-355,435,324.07
报告期已出售证券投资损益				/	/	/	/	-487,005,211.99
合计				4,145,102,365.02	/	4,552,590,227.18	100.00	-894,666,307.80

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

币种：人民币 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
601169	北京银行	560,153,953.26	0.57	0.50	656,569,933.94	14,094,348.85	-25,360,474.13	可供出售金融资产	购买
601318	中国平安	604,231,663.30	0.11	0.10	591,607,257.84	-12,411,069.83	-66,331,816.56	可供出售金融资产	购买
002517	恺英网路	196,742,680.00	1.64	1.64	552,986,832.40	0.00	-121,728,913.48	可供出售金融资产	购买
000008	神州高铁	119,999,997.88	2.52	2.20	555,422,591.04	0.00	8,155,110.70	可供出售金融资产	购买
002409	雅克科技	300,000,000.00	-	6.44	476,999,968.20	1,767,857.02	176,999,968.20	可供出售金融资产	购买
000895	双汇发展	401,812,315.44	0.56	0.63	431,659,882.08	26,758,148.94	12,189,836.27	可供出售金融资产	购买
300070	碧水源	461,440,646.76	0.32	0.91	421,631,213.28	-12,856,308.79	-42,351,307.15	可供出售金融资产	购买
002299	圣农发展	309,498,650.69	1.25	1.40	402,820,032.30	-7,110,468.01	68,513,122.61	可供出售金融资产	购买
601009	南京银行	351,309,919.27	0.97	0.69	391,680,318.66	20,096,483.98	-42,772,489.86	可供出售金融资产	购买
002044	美年健康	100,000,000.00	1.33	1.33	386,348,453.68	0.00	52,117,574.84	可供出售金融资产	购买
其他		6,814,772,074.60	/	/	7,413,059,380.00	-418,125,878.87	-359,971,529.87	/	/
合计		10,219,961,901.20	/	/	12,280,785,863.42	-387,786,886.71	-340,540,918.43	/	/

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

币种：人民币

√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	1,275,056,039.63	99.72	99.72	1,275,056,039.63	301,025,358.86	14,253,126.04	长期股权投资	出资购入
华泰期货	491,998,085.65	60	60	611,998,085.65	60,457,183.70	-198,391.18	长期股权投资	出资购入
南方基金	220,291,751.36	45	45	1,546,428,797.02	133,313,044.30	-22,018,565.70	长期股权投资	出资购入
华泰柏瑞	101,838,099.60	49	49	339,398,183.66	58,739,974.97	-8,842,959.21	长期股权投资	出资购入
华泰金控 (香港)	827,472,700.00	100	100	827,472,700.00	-151,640,060.15	8,023,310.71	长期股权投资	出资成立
华泰紫金投资	2,750,000,000.00	100	100	4,050,000,000.00	7,441,288.60	29,919,953.67	长期股权投资	出资成立
华泰资管公司	1,000,000,000.00	100	100	1,000,000,000.00	424,595,809.59	9,476,565.76	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	10	12,000,000.00	1,320,000.00	-	可供出售金融资产	出资成立
江苏银行股份有限公司	1,300,000,000.00	6.16	6.16	3,304,409,638.00	-	-366,429,802.00	可供出售金融资产	出资购入
合计	7,978,656,676.24	/	/	12,966,763,443.96	835,252,599.87	-335,816,761.91	/	/

持有非上市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

币种：人民币

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金额 (元)	期末股份数量 (股)	产生的投资收益 (元)
建设银行	37,120,213.00	104,573,089.00	512,652,594.07	103,475,208.00	526,009,594.18	38,218,094.00	-15,558,276.88
中国银行	22,341,080.00	101,482,400.00	365,654,781.18	86,104,165.00	323,148,444.52	37,719,315.00	-21,105,042.09
农业银	785,155.00	87,049,800.00	270,295,379.24	86,457,964.00	268,523,136.89	1,376,991.00	-291,901.09

光大银行	54,220,997.00	54,701,483.00	198,158,359.43	91,106,209.00	356,659,133.24	17,816,271.00	-24,499,011.41
民生银行	98,980,381.00	15,159,322.00	139,202,087.62	113,655,811.00	1,096,123,220.72	483,892.00	-58,424,632.74

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，每股面值人民币1.00元，每股发行价格人民币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人民币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，累计使用募集资金人民币156.810亿元（含募集资金利息人民币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30,587,689,604.94元（扣除相关上市费用），扣除承销发行费用后共募集资金折合人民币30,015,054,696.76元。截至报告期末，本公司在H股募集资金总额的基础上又取得利息收入折合人民币28,622,442.94元。截至报告期末，累计使用H股募集资金人民币26,884,889,918.87元。

截至本报告日期，本公司就其于香港联交所上市而首次公开发售新股及因超额配股权获部分行使而发行新股的所得款项使用情况如下：人民币18,352,613,762.96元用于拓展融资融券等资本中介业务，人民币3,058,768,960.49元用于拓展投资和交易业务，人民币3,058,768,960.49元用于向华泰紫金投资和华泰资管公司增资，人民币2,414,738,234.91元用于营运资金和其他一般企业用途。除上述资金使用外，本公司所得款项剩余资金约人民币3,702,799,686.07元尚未使用，此部分资金存放于本公司在银行开设的账户中。截至2016年6月30日，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，没有发生变更。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)	3,058,768.96	95,477.93	2,688,488.99	370,279.97	用于拓展海外业务/用于运营资金和其他去向
2010年	首次发行(A股)	1,556,122.55	-	1,568,103.37	-	-
合计	/	4,614,891.51	95,477.93	4,256,592.36	370,279.97	/

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过原募集资金总额人民币 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

(3) 募集资金变更项目情况

适用 不适用

报告期内，公司不存在募集资金变更项目情况。

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 99.72% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，华泰联合证券总资产人民币 698,562.99 万元，净资产人民币 597,314.07 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 94,291.85 万元，利润总额人民币 42,203.77 万元，净利润人民币 30,187.06 万元。

主营业务：证券承销与保荐（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他业务。

(2) 华泰期货有限公司，注册资本人民币 100,900.00 万元，华泰证券持有其 60.00% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，华泰期货总资产人民币 1,974,014.80 万元，净资产人民币 154,027.53 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 51,686.18 万元，利润总额人民币 12,725.06 万元，净利润人民币 10,000.95 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 2016 年 6 月 30 日，华泰金控(香港)总资产人民币 533,697.74 万元，净资产人民币 75,004.52 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 1,039.22 万元，利润总额人民币-15,127.93 万元，净利润人民币-15,164.01 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 405,000.00 万元，华泰证券持有其 100.00% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，华泰紫金投资总资产人民币 1,814,726.17 万元，净资产人民币 506,676.73 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 12,949.15 万元，利润总额人民币 7,411.75 万元，净利润人民币 6,570.34 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。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

(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 2016 年 6 月 30 日，江苏股权交易中心总资产人民币 24,312.76 万元，净资产人民币 23,294.95 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 2,050.34 万元，利润总额人民币 1,008.05 万元，净利润人民币 758.38 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 2016 年 6 月 30 日，华泰创新总资产人民币 68,222.89 万元，净资产人民币 56,230.39 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 8,874.72 万元，利润总额人民币-2,032.31 万元，净利润人民币-1,553.87 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 100,000.00 万元，华泰证券持有其 100.00% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，华泰资管公司总资产人民币 249,993.61 万元，净资产人民币 216,689.55 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 76,178.57 万元，利润总额人民币 56,613.92 万元，净利润人民币 42,459.58 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，华泰证券持有其 45.00% 的股权。截至 2016 年 6 月 30 日，南方基金总资产人民币 560,905.21 万元，净资产人民币 360,409.78 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 139,719.97 万元，利润总额人民币 44,846.85 万元，净利润人民币 30,969.00 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 2016 年 6 月 30 日，华泰柏瑞总资产人民币 87,482.75 万元，净资产人民币 69,264.94 万元；2016 年上半年实现营业收入人民币 39,215.52 万元，利润总额人民币 15,769.51 万元，净利润人民币 11,987.75 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、公司控制的结构化主体情况

(1) 合并的结构化主体

本集团合并的结构化主体指本集团同时作为管理人或投资顾问及投资者的资产管理计划。本集团综合评估本集团因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人或投资顾问的报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。于 2016 年 6 月 30 日，集团共计合并 34 个结构化主体，合并资产管理计划的总资产为人民币 96,437,277,313.54 元。本集团持在上述合并资产管理计划中的权益总金额为人民币 7,248,494,899.47 元。

(2) 第三方机构发起设立的结构化主体

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财务报表范围，主要包括信托计划、基金、银行理财产品与其他理财产品。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。于 2016 年 6 月 30 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为人民币 39,241,200,246.93 元。

(3) 未纳入合并财务报表范围的结构化主体

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而享有可变回报并不重大并未合并该等结构化主体。于 2016 年 6 月 30 日，上述由本集团管理的未合并结构化主体的资产总额为人民币 767,771,735,310.39 元。

7、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和对企业基本面的分析，择取合适标的，稳健参与市场投资，同时围绕限额标准，合理配置资产规模，灵活控制投资品种比重，分散投资，积极运用对冲工具以降低风险；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，加大 IRS 对冲力度，有效锁定资金成本以降低市场风险；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，进一步推进发行人信用评级系统建设，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，公司设定实施两融业务关键风控措施的市场策略性调节方案，提升业务风控措施针对市场及业务变化情况的有效性与灵活性；推进优化两融业务长期停牌股票估值风控方案，更准确地分析客户账户信用风险；开发风险分析和压力测试系统，实现对重点业务资产质量及风险承压能力的实时监测及潜在大额违约风险客户的及时筛查和预警，避免客户违约给公司造成损失。信用类创新业务方面，在严格的风控方案设计、实施前提下，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。针对公司涉及信用风险的业务，统一收集、处理客户产生的不良信用行为，将之与客户业务准入及授信额度相关联，完成集团层面客户不良信用行为统一管理方案。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，重点评估自营持仓变现能力，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，并确保投资组合的流动性。公司资金管理方面，加强了逐日流动性缺口的测算以及优质流动资产的主动配置和管理，合理规划优质流动资产的规模和结构。在负债管理方面，加强资产负债管理能力，提高资金组织工作力度，合理规划债务的融资规模、融资期限，不断优化公司的资产负债结构。公司重视流动性监测系统建设，持续完善流动性管理平台，提高流动性风险管理的效率和效果。

(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，公司持续推动流程梳理优化工作的落实及分级授权体系的完善，在风险可控的前提下提高流程效率。同时，公司对操作风险三大管理工具进行了持续优化：一是拓展内外部损失数据收集范围及渠道，加大对损失影响及频率分布的分析；二是完善风险及控制自我评估方法论

及不定期触发机制；三是着手建立关键风险指标的分层分级机制；四是分析建立三大管理工具间的联动机制并着手开展对操作风险管理系统的二期开发工作。

(5) 合规风险

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

报告期内，公司持续完善合规管理体系，强化一线合规风控人员管理，截至报告期末，已完成 27 家分公司的合规风控集中工作，进一步提升基层合规人员履职的专业性和有效性；持续完善业务合规管理机制，通过合规评估、流程梳理、提示督导、列席会议等方式加大对重点业务的管控和支持力度；进一步健全合规培训体系、丰富培训形式，力求将监管要求和合规意识渗透到业务人员思想中，促使业务部门及早做好自我规范；审慎开展合规审查，及时指出合规问题或瑕疵、提出规范建议、制作审核指引及制式模板，促进相关业务或产品合规运作；加大合规检查尤其是专项检查力度，以问题和风险为导向，对有关重点领域开展多次检查，并就发现的问题及时提出改进要求，跟踪整改落实情况；贯彻“风险为本”的反洗钱工作原则，有序开展反洗钱各项重点工作，履行客户身份识别、客户风险等级划分以及大额交易、可疑交易报告义务；升级合规管理系统、反洗钱客户风险等级评估系统并测试上线新合同管理系统，全面提升合规管理工作效率。

(6) 信息技术风险

公司的各项业务和中后台管理均高度依赖于信息技术，信息技术系统与业务的高度融合，已成为公司各项业务正常开展的关键要素。信息技术风险主要指证券公司信息系统发生故障，在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面，影响到交易与业务管理的持续稳定、高效、安全运行，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 2015 年年度股东大会审议通过了《关于公司 2015 年度利润分配的议案》。

公司 2015 年度利润分配方案情况如下：公司实现归属于上市公司股东的净利润为人民币 10,696,870,875.92 元，以 2015 年 12 月 31 日总股本 7,162,768,800 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利人民币 5.00 元（含税），共计分配现金红利人民币 3,581,384,400.00 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 33.48%。

现金红利以人民币计值和宣布，以人民币向 A 股股东和港股通投资者支付，以港币向 H 股股东（不含港股通投资者）支付。港币实际派发金额按照公司 2015 年度股东大会召开日前五个工作日中国人民银行公布的人民币兑换港币平均基准汇率（即：人民币 0.846026 元兑 1.00 港元）计算，即每 10 股 H 股派发现金红利港币 5.909984 元（含税）。

报告期后，公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、上海证券交易所网站、香港联交所网站及本公司网站刊登了 2015 年度利润分配实施的有关公告，公司 2015 年度利润分配方案已于 2016 年 8 月 5 日实施完毕。

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

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
华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案：华泰联合证券原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用华泰联合证券资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出（2001）深中法经一初第 315 号民事判决书和（2002）深中法经一初第 430 号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还华泰联合证券 7,345 万元及其利息和 9,940 万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。对于另一案，华泰联合证券于 2008 年 6 月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向华泰联合证券支付欠款总额人民币 23,775.36 万元、利息人民币 2,187.72 万元，合计标的约人民币 2.6 亿元。本案由北京市高级人民法院于 2009 年 12 月 17 号作出的（2008）高民初字第 1080 号民事判决书结案，对方没有上诉，该一审判决已经生效，该判决确认四通集团应付公司本金人民币 17,553.389311 万元及利息。此案正在执行中。	可在 2011 至 2015 年年报中查询。
华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司（以下简称“华诚集团公司”）、华诚投资管理有限公司（以下简称“华诚投资公司”）债权债务纠纷案：因华诚集团公司无偿占用华泰联合证券营业部资金共人民币 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人民币 1,738 万元，华诚集团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，要求华诚投资公司和华诚集团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人民币 12,598 万元，但由于债权未经法院判决，债权	可在 2011 至 2015 年年报中查询。

<p>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，要求华诚投资公司和华诚集团公司连带支付华泰联合证券人民币 5,458.4 万元，并承担诉讼费人民币 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（以下简称“二中院”）民事裁定书，裁定终结华诚投资公司破产程序，华诚投资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人民币 182.3979 万元。2012 年 7 月法院裁定华诚集团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，二中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集团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，二中院于 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公司享有债权金额人民币 39,387,194.72 元。双方股权纠纷，由二中院于 2015 年 10 月 26 日出具的（2015）二中民（商）初字第 05326 号民事判决书结案，驳回华诚股权确认诉讼请求。确认原登记在华诚投资公司名下的 252 万股减资注销有效。</p>	
<p>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2013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。</p>	<p>可在 2013 至 2015 年年报中查询</p>

(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(被申请人)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)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况
华泰证券	昆山凯虹汽车贸易有限公司		执行异议	见表下概述	25,000,000.00	否	见表下概述	见表下概述	见表下概述

华泰联合证券	北京华资银团集团		债权债务纠纷	见表下概述	24,391,031	否	见表下概述	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	200 万股股权	否	见表下概述	见表下概述	见表下概述

1、华泰证券就质权项下存单提起执行异议：华泰证券作为“华泰证券金陵六号定向资产管理计划”（简称：金陵六号计划）管理人，根据委托人投资指令，于 2014 年 4 月 22 日以定向计划资金投资昆山凯虹汽车贸易有限公司（简称：昆山凯虹）持有的存单收益权，并与昆山凯虹约定 2016 年 4 月 21 日由昆山凯虹全额购回该存单。为确保回购条款的正常履行，昆山凯虹将该存单（2,500 万）质押给华泰证券。因昆山凯虹其他纠纷，其相关资产（包括为该笔业务所质押的 2500 万存单）被昆山市人民法院冻结。依据相关合同约定，如存单转让人涉及纠纷，金陵六号计划管理人可提前行使质权。2015 年 10 月，华泰证券向昆山市人民法院提出执行异议，请求法院解冻该企业质押给华泰证券的 2,500 万存单。昆山市人民法院已受理华泰证券执行异议（受理编号：（2016）苏 0583 执异 9 号），该案已于 2016 年 5 月出裁定，裁定生效后，已解除冻结。由于昆山凯虹其他诉讼纠纷，法院轮候冻结该存单，华泰证券于 2016 年 5 月向法院提交执行异议。之后因异议被驳回，2016 年 6 月，华泰证券向法院提起执行异议之诉。华泰证券为金陵六号计划管理人，接受该计划委托人委托进行诉讼，形成损益归入该计划资产。该计划资产与华泰证券资产相互独立，本次诉讼对公司报告期利润或期后利润没有不利影响。

2、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人民币 3,457.89 万元，2011 年 2 月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合证券欠款人民币 2,430 万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011 年 6 月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判。目前，该案仍在执行过程中。华泰联合证券起诉黄祖祥、黄平、黄祖峰、北京华资银团集团与华泰联合证券有关的纠纷一案，北京市第三中级人民法院于 2015 年 12 月 4 日出具（2015）三中民（商）初字第 03020 号，确定黄祖祥、黄祖峰为华资银团股东代华资银团向华泰联合证券偿付债务本金人民币 2,430 万元、案件受理费人民币 9.1031 万元。2016 年至今，黄祖祥、黄祖峰未履行偿还义务，2016 年 5 月 31 日，华泰联合证券向北京市第三中级人民法院申请执行。

3、中国原子能工业有限公司（以下简称“原子能公司”）诉华诚集团公司、华诚投资公司存单纠纷一案，二中院于 1999 年 2 月 10 日作出（1998）二中经初字第 1218 号民事判决。判决生效后，原子能公司于 1999 年 7 月 12 日向二中院申请执行。二中院依法查封了华诚投资公司持有的联合证券有限责任公司（以下简称“联合证券公司”）股权，此后，原子能公司通过拍卖竞买了华诚投资公司持有的联合证券公司 3,660 万股股权。后因联合证券公司认为华诚投资公司在出资入股联合证券公司之初存在人民币 1,498 万元的不实出资（被法院执行扣划），通过向北京市高级人民法院、最高人民法院申诉、提出执行异议等措施，最后二中院、原子能公司将人民币 1,498 万元对应的联合证券公司股权 1,348 万股股权从原子能公司拍卖所得的联合证券公司 3,660 万股股权中扣除，其余的 2,312 万股股权过户至原子能公司名下，但上述 1,348 万股股权仍以原子能公司的名义申请二中院继续冻结。

2003 年底，联合证券公司向法院起诉华诚集团公司和华诚投资公司，后因最高人民法院以明传电报的形式通知全国各地法院暂停受理所有针对华诚集团公司及其下属公司的案件。在这种背景下，联合证券公司主动与原子能公司协商，就上述仍以原子能公司名义申请二中院冻结的 1,348 万股股权的处置事宜，双方在互利互惠的基础上达成一致，上述 1348 万股股权联合证券公司同意继续执行到原子能公司名下，但这 1,348 万股股权按照大致四六开的比例，原子能公司拿 550 万股，联合证券公司拿 798 万股以抵偿华诚投资公司对其的债务。2008 年，华诚投资公司 1,348 万

股股权过户到原子能公司名下，由此形成原子能公司代联合证券公司持有原华诚投资公司在联合证券公司的股权 798 万股的情况。

2009 年，华泰证券重组联合证券公司，联合证券公司名称变更为华泰联合证券有限责任公司，缩股后原子能公司持有华泰联合证券股权 1,098 万股，其中自持 858.6 万股，代持 239.4 万股。之后华泰证券亦与原子能公司进行协商，最终达成原子能公司代持的 239.4 万股中的 200 万股转让给华泰证券，转让款支付给华泰联合证券。剩余 39.4 万股与原子能公司的 858.6 万股合计 898 万股换成华泰证券股权。但原子能公司代持 200 万股的问题至今没有解决。

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原子能公司合同纠纷一案。2016 年 6 月 28 日，北京市西城区人民法院出具（2015）西民（商）初字第 1048 号民事判决书判决华泰联合证券胜诉。法院判决被告继续履行《股权代持协议》、《代持股权挂牌转让协议》，并于判决生效之日起三十日内完成 200 万股股权的挂牌转让事宜，并将股权转让所得价款给付华泰联合证券。有待法院方面确认被告是否上诉。

(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

报告期内未发生公司及其董事、监事、高级管理人员、持有 5%以上股份的股东、实际控制人、收购人被有权机关调查、被司法机关或纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚，以及被证券交易所公开谴责的情形。

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

报告期内，公司并无资产交易、企业合并事项。报告期内，公司积极推进 AssetMark 100%股权收购事项，相关情况请参阅本报告“第四节 董事会报告、董事会关于公司报告期内经营情况的讨论与分析、主营业务分析、资产重组，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”。

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) 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2016 年 1-6 月	2015 年 1-6 月
南方基金	基金分仓及尾随佣金和销售服务费	10,093,176.60	24,077,646.66
华泰柏瑞	基金分仓及尾随佣金和销售服务费	6,393.45	30,402,845.86

南方基金	证券代理买卖交易佣金	19,225.39	4,000.00
江苏国信	证券代理买卖交易佣金	38,648.36	1,831,539.02
交通控股	证券代理买卖交易佣金	-	18,179.70
合计		10,157,443.80	56,334,211.24

(2) 关联租赁情况

单位:元 币种:人民币

承租方名称	租赁资产种类	2016年1-6月确认的租赁收入	2015年1-6月确认的租赁收入
南方基金	房屋建筑物	552,194.25	552,194.28
华泰柏瑞	办公设备	-	50,000.00
合计		552,194.25	602,194.28

(3) 投资收益

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
江苏国信	持有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收益	1,459,487.03	917,031.12
交通控股	持有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收益	8,989,365.84	261,649.51
华泰柏瑞	购买的基金产品分红	11,531,798.31	3,778,108.68
南方基金	购买的基金产品分红	12,187,484.76	3,442,052.30
合计		34,168,135.94	8,398,841.61

(4) 本公司认购关联方管理的基金情况

币种:人民币

关联方	认购基金名称	2016年6月30日				
		本报告期初持有份额(万份)	本报告期新增份额(万份)	本报告期减少份额(万份)	本报告期末持有份额(万份)	本报告期末余额(万元)
南方基金	深成ETF	8.87	-	6.87	2.00	2.22
	中证500ETF联接(LOF)	17.95	-	17.95	-	-
	南方现金B	2,043.48	29.35	-	2,072.83	2,072.83
	南方收益宝货币B	100,008.46		50,008.46	50,000.00	50,000.00
	理财金H	167.34	147,012.95		147,180.29	147,180.29
	南方中证500ETF	241.57		241.57	-	-
	合计	102,487.67	147,042.30	50,274.85	199,255.12	199,255.34
华泰柏瑞	华泰柏瑞沪深300ETF	126.06		114	12.06	38.12
	华泰柏瑞货币B	16,232.17	74,950.00		91,182.17	91,182.17
	华泰柏瑞量化增强混合A	2,155.10		2,155.10	-	-
	华泰柏瑞交	6.76	2,320.17	-	2,326.93	2,326.93

	易货币 A					
	合计	18,520.09	77,270.17	2,269.10	93,521.16	93,547.22

关联方	认购基金名称	2015 年 12 月 31 日				
		本报告期初持有份额(万份)	本报告期新增份额(万份)	本报告期减少份额(万份)	本报告期末持有份额(万份)	本报告期末余额(万元)
南方基金	深成 ETF	99.00	-	90.13	8.87	11.86
	中国梦	999.90	-	999.90	-	-
	中证 500ETF 联接 (LOF)	2,817.95	-	2,800.00	17.95	32.42
	南方恒指 ETF	500.00	-	500.00	-	-
	南方现金 B	110,000.00	2,043.48	110,000.00	2,043.48	2,043.48
	南方薪金宝	3,061.81	3,066.78	6,128.59	-	-
	南方收益宝货币 B	-	100,008.46	-	100,008.46	100,008.46
	南方利鑫混合	-	17,946.06	17,946.06	-	-
	理财金 H	-	167.34	-	167.34	16,735.66
	南方中证 500ETF	-	241.57	-	241.57	1,893.43
	合计	117,478.66	123,473.69	138,464.68	102,487.67	120,725.31
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	64,942.44	91,763.96	126.06	476.25
	华泰柏瑞上证红利 ETF	154.52	-	154.52	-	-
	华泰柏瑞货币 B	25,594.98	26,232.17	35,594.98	16,232.17	16,232.17
	华泰柏瑞量化增强混合 A	-	2,155.10	-	2,155.10	3,792.98
	华泰柏瑞交易货币 A	-	6.76	-	6.76	676.18
	合计	55,697.21	93,336.47	130,513.59	18,520.09	21,177.58

(5) 本集团持有关联方发行债券情况

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2016 年 1-6 月	2015 年 1-6 月
江苏国信	投资企业债	63,049,318.00	63,473,480.00
交通控股	投资企业债	502,949,525.92	349,863,792.36
合计		565,998,843.92	413,337,272.36

(6) 与关联方相关取得的股利

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2016 年 1-6 月	2015 年 1-6 月
华泰柏瑞	收到的股利	49,000,000.00	-
合计		49,000,000.00	-

(7) 关键管理人员报酬

单位:元 币种:人民币

关联交易内容	2016 年 1-6 月	2015 年 1-6 月
关键管理人员报酬	25,559,438.00	13,893,578.00

2、临时公告未披露的事项

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

关联交易方	关联关系	关联交易类型	关联交易内容	关联交易定价原则	关联交易金额	占同类交易金额的比例 (%)
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	联营公司	其它流入	基金管理费收入	市价原则	19,714,233.37	25.49
江苏工业和信息产业投资基金(有限合伙)	联营公司	其它流入	基金管理费收入	市价原则	594,384.14	0.77
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	合营公司	其它流入	基金管理费收入	市价原则	633,238.57	0.82
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	联营公司	其它流出	集合资产管理计划	市价原则	-402,971,750.00	0.32
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	合营公司	增资扩股	对合营企业投资增资		100,000,000.00	86.13
南京华泰瑞联并购基金二号(有限合伙)	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		2,000,000.00	1.72
南京华泰瑞联并购基金三号(有限合伙)	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		2,000,000.00	1.72
南京华泰瑞联并购基金四号(有限合伙)	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		2,000,000.00	1.72
苏州股权交易中心有限公司	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		10,000,000.00	8.16
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		50,000.00	0.04
江苏华泰互联网产业投资基金(有限合伙)	联营公司	增资扩股	对联营企业投资增资		50,000.00	0.04
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	联营公司	其它流入	资管计划处置所得		459,711.56	0.00
合计				/	/	/
关联交易的说明					无	

(二) 资产收购、出售发生的关联交易

1、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 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

应收项目

单位:元 币种:人民币

关联方	关联方交易内容	2016年6月30日		2015年12月31日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
华泰柏瑞	基金分仓佣金及销售服务费	-	-	5,518,975.58	27,594.88
南方基金	基金分仓佣金及销售服务费	2,911,621.14	14,558.11	4,048,888.44	20,244.44
合计		2,911,621.14	14,558.11	9,567,864.02	47,839.32

应付款项

单位:元 币种:人民币

关联方	关联方交易内容	2016年6月30日	2015年12月31日
江苏国信	应付款项	3,211,190.78	3,211,190.78
江苏国信	代理买卖证券款	50,000.00	171,475.09
华泰柏瑞	代理买卖证券款	3,803,053.62	12,399,012.24
南方基金	代理买卖证券款	35,819.13	19,487.86
交通控股	代理买卖证券款	-	11,349.77
合计		7,100,063.53	15,812,515.74

应收利息

单位:元 币种:人民币

关联方	关联方交易内容	2016年6月30日	2015年12月31日
江苏国信	应收债券投资利息	861,926.79	2,343,425.67
交通控股	应收债券投资利息	13,847,905.49	3,946,393.45
合计		14,709,832.28	6,289,819.12

应收股利

单位:元 币种:人民币

关联方	关联方交易内容	2016年6月30日	2015年12月31日
南方基金	应收股利	162,000,000.00	
南方现金增利B	应收红利	21,183.08	-

华泰柏瑞货币 B	应收红利	11,130,670.57	
合计		173,151,853.65	-

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	关联关系	关联内容	向关联方提供资金			关联方向上市公司提供资金			
			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	基金管理费	-	20,000,000.00	20,000,000.00				
江苏工业和信息产业投资基金（有限合伙）	联营公司	基金管理费	-	721,567.42	721,567.42				
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	合营公司	基金管理费	-	671,232.88	671,232.88				
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	联营公司	代理买卖证券款	-	988.09	988.09				
合计				21,393,788.39	21,393,788.39				
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

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

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	0
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	0
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	0
报告期末对子公司担保余额合计（B）	42
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	42
担保总额占公司净资产的比例（%）	5.85
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	0
直接或间接为资产负债率超过70%的被	0

担保对象提供的债务担保金额 (D)	
担保总额超过净资产50%部分的金额 (E)	0
上述三项担保金额合计 (C+D+E)	0
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	无
担保情况说明	<p>1、华泰金控（香港）公司下设的Huatai International Finance I Limited于2014年10月8日完成了首期境外债券发行。为增强本次首期境外债券的偿债保障，降低发行利率，根据公司2013年度股东大会的授权，公司获授权人士确定由中国银行澳门分行以开立备用信用证方式为本次首期境外债券提供担保。同时，根据公司第三届董事会第九次会议决议，公司就发行的首期境外债券开立的备用信用证向中国银行出具反担保函，反担保金额不超过本次债券本金、利息及其他相关费用合计30亿元人民币等值美元。保证方式为连带责任保证，保证期结束日期为备用信用证有效期届满之日起六个月。</p> <p>2、2015年1月，华泰资管公司正式营业。为保证华泰资管公司各项风险控制指标持续符合监管要求，经公司第三届董事会第十六次会议和2014年度股东大会审议批准，公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币12亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。</p>

3 其他重大合同或交易

币种:人民币

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		
华泰证券广场施工总承包合同	华泰证券与中国江苏国际经济技术合作公司	2010年7月30日					113,285.18万元	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主要分包合同价款1,613.857485万元。截止报告期末,公司已按约累计支付总承包合同价款72,426.511782万元。
华泰证券广场智能化施工合同	华泰证券与上海浩德科技股份有限公司	2012年3月6日					21,300万元	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

	公司								签定了补充协议合同价由原来的 19,889.97 万元调整为 21,300 万元,报告期内合同正常履行,公司已按约支付智能化施工合同价款 1,038.6111 万元。截至报告期末,公司已按约累计支付智能化施工合同价款 17,169.6385 万元。
华泰证券广场室内装饰装修二标段工程施工合同	华泰证券与浙江亚厦装饰股份有限公司	2013 年 5 月 21 日						11,758.45 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 0 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 8,305.239933 万元。
华泰证券广场室内装饰装修一标段工程施工合同	华泰证券与中国建筑集团有限公司	2013 年 5 月 21 日						7,877.18 万元	2013 年 5 月 21 日,公司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 400.00 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 7,862.138436 万元。
华泰证券广场工程内装三标段施工合同	华泰证券与深圳市深装总装饰工程工业有限公司	2013 年 10 月						13,505.26 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》。报告期内签定补充协议合同价由原 13,158.63043 万元调整为 13,505.26 万元,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 747.83 万元。截至报告期末，公司已按约累计支付内装三标段施工合同价款 10,056.679742 万元。
华泰证券恒益 15402 号收益凭证	华泰证券与上海银行股份有限公司	2015 年 6 月 24 日						520,000 万元	2015 年 6 月 24 日，公司与上海银行股份有限公司签订了恒益 15402 号收益凭证合同，报告期内履行完毕。

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）。	承诺出具日：2014 年 6 月 27 日；到期日：长期	否	是

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 2015 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 2016 年度会计报表和内部控制审计服务机构，并出具 A 股审计报告和内控审计报告；批准公司聘请毕马威会计师事务所为公司 H 股审计服务机构，并出具 H 股审计报告。审计服务费合计不超过人民币 500 万元。

会议还批准将公司 2015 年度支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费用由原来的人民币 200 万元增加至 255 万元，并批准就 2015 年度 H 股审阅和审计服务新增 H 股审阅和审计服务费合计人民币 200 万元。公司 2015 年度支付给外聘审计机构的审计服务费合计为人民币 455 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

十、可转换公司债券情况

适用 不适用

十一、公司治理情况

作为在中国大陆和香港两地上市的公众公司，公司严格按照境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，规范运作，不断致力于维护和提升公司良好的市场形象。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。

（一）符合《香港上市规则》附录十四《企业管治守则》的要求

报告期内，公司召开股东大会 2 次，董事会 8 次，监事会 3 次，审计委员会 4 次，合规与风险管理委员会 1 次，发展战略委员会 1 次，薪酬与考核委员会 1 次，提名委员会 2 次，共计 22 次会议，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。

2015 年 12 月 18 日，吴万善先生因工作变动原因提请辞任公司第三届董事会执行董事、董事长及董事会发展战略委员会主席职务。该辞任自即日起生效。本公司按照《公司法》及公司章程等相关规定并按程序，于 2016 年 6 月 20 日选举周易先生为本公司第三届董事会董事长。自即日起周易先生为本公司董事长兼总裁。根据《企业管治守则》第 A.2.1 条的规定，主席及行政总裁之角色应有所区分，而且不应由一人同时兼任。鉴于周易先生自 2006 年 8 月加入本集团以来，一直承担监管本公司日常经营与管理工作、制定公司及业务战略及决定或提名本公司高级管理人员的职责，董事会相信周易先生同时承担有效管理及业务发展的职责符合本公司的最佳利益。因此，董事会认为公司目前安排与《企业管治守则》第 A.2.1 条不一致在有关情况下乃属恰当。尽管有上述情况，但董事会认为此管理层架构对本公司营运而言乃属有效且有足够的制衡。

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。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，除以上披露外，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。

（二）独立非执行董事

本公司已根据《上市规则》的规定委任足够数目、并具备适当的专业资格、或具备适当的会计或相关财务管理专长的独立非执行董事。本公司共委任五名独立非执行董事，分别为白维先生、刘红忠先生、李志明先生、陈传明先生、杨雄胜先生。

（三）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守则。根据境内监管要求，2014 年 11 月 25 日，公司第三届董事会第十三次会议审议通过了《公司董事、监事和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》”），以规范公司董事、监事和高级管理人员持有本公司股份及买卖本公司股份的行为。2015 年，为满足公司 H 股挂牌上市相关监管要求，公司对该《管理制度》进行了修订，并经公司第三届董事会第十六次会议审议通过。《管理制度》与《标准守则》中的强制性规定相比更加严格。根据对公司董事、监事及高级管理人员的专门查询后，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。公司董事会将不时检查公司的公司治

理及运作，以符合《香港上市规则》有关规定并保障股东的利益。本公司也没有发现有关雇员违反指引。

十二、审计委员会及审计事项

公司第三届董事会审计委员会由独立董事与股东单位派驻的董事组成。报告期初，公司第三届董事会审计委员会由独立董事李志明先生、刘红忠先生、陈志斌先生和董事浦宝英女士组成，其中李志明先生任审计委员会主任委员（召集人）。2016年6月20日，公司第三届董事会第三十三次会议审议通过了《关于调整公司第三届董事会部分专门委员会组成方案的议案》，明确公司第三届董事会审计委员会由独立董事李志明先生、杨雄胜先生和董事陈宁先生组成，其中李志明先生任审计委员会主任委员（召集人）。

报告期内，公司董事会审计委员会共召开了4次会议。具体情况如下：

1、公司第三届董事会审计委员会2016年第一次会议于2016年2月1日以现场及视频会议方式召开，会议听取了毕马威华振会计师事务所人员介绍对公司2015年审计工作范围、专业服务团队主要成员、审计总体安排、审计方案及关注重点、内部控制审计工作汇报。会上，委员们就审计过程中有无发现新的风险点、2015年股市动荡的信用风险及接受处罚后的声誉风险如何、通道类业务的规模怎样及如何防范风险、公司对下属公司管理操作流程等环节中如何管控风险等问题与毕马威华振会计师事务所相关人员进行了广泛的讨论与沟通。

2、公司第三届董事会审计委员会2016年第二次会议于2016年2月25日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于公司2015年度审计计划的议案》。

3、公司第三届董事会审计委员会2016年第三次会议于2016年3月28日在南京召开，会议审议通过了《公司2015年度财务决算报告》、《公司2016年度财务预算报告》、《关于公司2015年度利润分配的预案》、《关于公司2015年年度报告的预案》、《关于公司2015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2015年年度履职情况的报告》、《关于增加公司2015年度审计服务费的预案》、《关于公司续聘会计师事务所的预案》、《关于预计公司2016年日常关联交易的预案》、《关于提请审查公司2015年度会计估计变更事项专项报告的议案》、《公司2016年内部审计工作计划》，听取了《关于公司2015年度内部审计工作情况的报告》。

4、公司第三届董事会审计委员会2016年第四次会议于2016年4月27日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于公司2016年第一季度财务报表的议案》。

十三、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，公司无分公司或证券营业部新设情况。

(2) 报告期内，公司证券营业部迁址情况

序号	营业部	地址	获得许可证日期
1	广州黄埔大道西证券营业部	广州市天河区黄埔大道西638号1509房	2016年1月4日
2	济南花园路证券营业部	山东省济南市历城区花园路35号	2016年2月3日
3	牡丹江西一条路证券营业部	黑龙江省牡丹江市西安区西一条路236号	2016年2月24日
4	深圳龙岗黄阁北路证券营业部	深圳市龙岗区龙城街道黄阁路441号龙岗天安数码创业园1号厂房A102-2单元	2016年2月24日
5	徐州建国西路证券营业部	江苏省徐州市建国西路75号财富广场1A	2016年3月14日

		座 1 层 109、2 层 205 室	
6	合肥创新大道证券营业部	安徽省合肥市高新区创新大道 2760 号创新公寓 C 座 4 楼	2016 年 3 月 22 日
7	安陆紫金路证券营业部	湖北省安陆市紫金路 1 号	2016 年 4 月 26 日
8	神农架神农大道证券营业部	神农架林区松柏镇神农大道 225 号	2016 年 5 月 10 日
9	上海长宁区仙霞路证券营业部	上海市长宁区仙霞路 1398 号-1 临	2016 年 6 月 29 日
10	漳州水仙大街证券营业部	福建省漳州市龙文区水仙大街 88 号融信·希尔顿·逸林酒店 B 座 4 层 03-04 单元	2016 年 6 月 16 日

① 经广东证监局同意，公司广州东风西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广州黄埔大道西证券营业部”，地址变更为“广州市天河区黄埔大道西 638 号 1509 房”。

② 经山东证监局同意，公司济南阳光新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花园路证券营业部”，地址变更为“山东省济南市历城区花园路 35 号”。

③ 经黑龙江证监局同意，公司牡丹江新华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牡丹江西一条路证券营业部”，地址变更为“黑龙江省牡丹江市西安区西一条路 236 号”。

④ 经深圳证监局同意，公司深圳龙岗黄阁北路证券营业部同城迁址开业，营业部名称不变，地址变更为“深圳市龙岗区龙城街道黄阁路 441 号龙岗天安数码产业园 1 号厂房 A102-2 单元”。

⑤ 经江苏证监局同意，公司徐州中山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徐州建国西路证券营业部”，地址变更为“江苏省徐州市建国西路 75 号财富广场 1A 座 1 层 109、2 层 205 室”。

⑥ 经安徽证监局同意，公司合肥阜阳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合肥创新大道证券营业部”，地址变更为“安徽省合肥市高新区创新大道 2760 号创新公寓 C 座 4 楼”。

⑦ 经湖北证监局同意，公司安陆碧涓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安陆紫金路证券营业部”，地址变更为“湖北省安陆市紫金路 1 号”。

⑧ 经湖北证监局同意，公司神农架常青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神农架神农大道证券营业部”，地址变更为“神农架林区松柏镇神农大道 225 号”。

⑨ 经上海证监局同意，公司上海威宁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上海长宁区仙霞路证券营业部”，地址变更为“上海市长宁区仙霞路 1398 号-1 临”。

⑩ 经福建证监局同意，公司漳州九龙大道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漳州水仙大街证券营业部”，地址变更为“福建省漳州市龙文区水仙大街 88 号融信·希尔顿·逸林酒店 B 座 4 层 03-04 单元”。（因福建当地监管要求，先办理许可证，后办理营业执照，现仍在办理营业部执照）

(3) 报告期内，公司证券营业网点撤销情况

序号	营业部	批复文号	批复日期	核查函日期	核查意见函
1	牡丹江长安街证券营业部	黑证监许可字[2015]5号	2015/10/30	2016/4/19	黑证监机构字【2016】23号
2	重庆上清寺路证券营业部	渝证监许可[2015]6号	2015/10/26	2015/12/18	渝证监函【2015】125号

注：上述营业部已经撤销完毕。

2、公司增资华泰紫金投资

报告期内，公司对华泰紫金投资进行两次增资，华泰紫金投资分别于 2016 年 1 月 18 日和 3 月 30 日各完成一次工商变更，注册资本由人民币 235,000 万元增加至人民币 275,000 万元，并再次增加至人民币 405,000 万元。

3、公司增资华泰期货

报告期内，华泰期货注册资本由人民币 80,900 万元增加至人民币 100,900 万元；其中，本公司增资人民币 12,000 万元，持股比例不变，华丽家族股份有限公司增资人民币 8,000 万元。

4、华泰紫金投资出资及设立下属公司

(1)伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司、伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)、伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)

华泰紫金投资于2015年11月24日发起设立了伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司，注册资本人民币200万元，其中华泰紫金投资认缴出资人民币102万元，占比51%。

伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司于2015年12月30日发起设立了伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)。伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司作为执行事务合伙人、普通合伙人认缴出资人民币2万元，占总认缴出资额的1%，承担无限责任；华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资人民币102万元，占总认缴出资额的51%，承担有限责任。截至2016年6月30日，华泰紫金投资对伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)完成实缴出资人民币16.32万元。

伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)于2016年2月19日发起设立了伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)。伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)作为执行事务合伙人、普通合伙人和基金管理人认缴出资人民币100万元，占总认缴出资额的0.0526%，承担无限责任；华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资人民币46,900万元，占总认缴出资额的24.68%，承担有限责任。截至2016年6月30日，华泰紫金投资对伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)实缴出资人民币14,070万元。

(2)南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)

南京华泰瑞联股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)于2015年11月25日发起设立了南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)，南京华泰瑞联股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)作为执行事务合伙人、普通合伙人和基金管理人认缴出资人民币6,300万元，占认缴出资总额的1.16%，承担无限责任；华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资人民币260,000万元，占认缴出资总额的47.78%，承担有限责任。南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)的经营范围为从事非证券股权投资活动及相关咨询业务(依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)。截至2016年6月30日，华泰紫金投资以其所持有的江苏华泰瑞联并购基金(有限合伙)的基金份额完成对该基金的实缴出资人民币125,966万元；以现金方式完成对该基金的实缴出资人民币134,034万元，合计完成实缴出资人民币260,000万元。

(3)华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)

华泰瑞联基金管理有限公司与上海招银股权投资基金管理有限公司于2016年3月22日发起设立了华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)。华泰瑞联基金管理有限公司作为执行事务合伙人、普通合伙人认缴出资人民币1,000万元，占总认缴出资额的0.10%，承担无限责任；上海招银股权投资基金管理有限公司作为普通合伙人认缴出资人民币1,000万元，占总认缴出资额的0.10%，承担无限责任；华泰紫金投资作为有限合伙人认缴出资人民币100,000万元，占总认缴出资额的9.98%，承担有限责任。截至2016年6月30日，华泰紫金投资对华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)完成实缴出资人民币10,000万元。

5、公司新设子公司华泰金融国际控股有限公司

2016年6月16日，公司在香港新设一家全资子公司华泰金融国际控股有限公司，注册资本港币2元，周易、姜健、陆戎、陆挺为公司董事。

6、华泰金控（香港）设立两家下属公司

报告期内，华泰金控（香港）注册成立了Huatai International Investment Holdings Limited(以下简称“HIIH”)和AssetMark Holdings LLC 两家下属公司。HIIH是一家开曼群岛公司，经营范围为投资控股。AssetMark Holdings LLC是HIIH下设的一家全资子公司，注册于美国特拉华州，经营范围为投资控股。

7、江苏股权交易中心出资人民币 1,000 万元参股苏州股权交易中心有限公司

为了推动在苏州地区的业务发展，经江苏省人民政府、江苏省金融办同意，苏州工业园区元禾控股有限公司、江苏股权交易中心、苏州工业园区经济发展有限公司、东吴证券股份有限公司、苏州信托有限公司、苏州产权交易中心在苏州共同出资组建苏州股权交易中心有限公司。经江苏股权交易中心董事会临时会议审议通过，江苏股权交易中心于2016年1月11日出资人民币1,000万元参股苏州股权交易中心有限公司，出资比例为20%；苏州股权交易中心有限公司已于2016年3月25日取得营业执照。

8、华泰期货出资华泰资本管理（香港）有限公司

2016年2月2日，华泰期货投资华泰资本管理（香港）有限公司港币2,331万元（折合人民币1,975.52万元），持有其70%股权，并享有其70%表决权。

9、2016年2月2日，华泰期货聘任徐炜中为公司总经理；副总经理王俊卿代为履行总经理职责结束。

10、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	华泰证券非公开发行 2015 年第一期次级债券兑息公告	2016-01-18
2	华泰证券 2015 年年度业绩预增公告	2016-01-27
3	华泰证券第三届董事会第二十七次会议决议公告（选举陈传明先生、杨雄胜先生为公司第三届董事会独立非执行董事、召开公司 2016 年第一次临时股东大会）	2016-01-28
4	华泰证券 2016 年第一次临时股东大会决议公告（选举陈传明先生、杨雄胜先生为公司第三届董事会独立非执行董事）	2016-03-19
5	华泰证券关于陈传明独立非执行董事任职等事项的公告	2016-03-19
6	华泰证券关于齐亮先生辞任公司副总裁的公告	2016-03-23
7	华泰证券关于行使“15 华泰 02”次级债券发行人赎回选择权的提示性公告	2016-03-25 2016-03-29 2016-04-01
8	华泰证券关于公司监事董军政辞职的公告	2016-03-26
9	华泰证券第三届董事会第二十九次会议决议公告（2015 年度利润分配、增加公司 2015 年度审计服务费、续聘会计师事务所、申请扩大外汇业务范围、公司发行短期融资券、2015 年度会计估计变更事项、公司董事 2015 年度绩效考核和薪酬情况、公司高级管理人员 2015 年度履行职责、绩效考核和薪酬情况等）	2016-03-30
10	华泰证券第三届监事会第十二次会议决议公告（公司 2015 年度利润分配、2015 年度会计估计变更事项、公司监事 2015 年度绩效考核和薪酬情况等）	2016-03-30
11	华泰证券关于预计 2016 年度日常关联交易的公告	2016-03-30
12	华泰证券关于杨雄胜独立非执行董事任职等事项的公告	2016-04-07
13	华泰证券关于实施“15 华泰 02”次级债券赎回的公告	2016-04-08
14	华泰证券第三届董事会第三十次会议决议公告（Huatai International Finance Limited 收购 AssetMark Financial Holdings, Inc.）	2016-04-12
15	华泰证券关于 Huatai International Finance Limited 收购 AssetMark	2016-04-12

	Financial Holdings, Inc. 的公告	
16	华泰证券 2015 年第二期次级债券兑付、兑息公告	2016-04-14
17	华泰证券非公开发行 2014 年第一期次级债券（2 年期）2016 年还本付息公告	2016-04-14
18	华泰证券第三届董事会第三十一次会议决议公告（选举公司第三届董事会非执行董事、增加公司 2015 年度股东大会议程）	2016-04-16
19	华泰证券第三届监事会第十三次会议决议公告（选举王会清先生为公司第三届监事会监事）	2016-04-16
20	华泰证券关于行使“15 华泰 02”次级债券赎回结果及摘牌公告	2016-04-19
21	华泰证券关于 2015 年第二期次级债券（2 年期）兑付完成的公告	2016-04-21
22	华泰证券关于 2013 年、2015 年公司债券和 2014 年、2015 年次级债券跟踪评级结果的公告	2016-04-30
23	华泰证券第三届董事会第二十八次会议决议公告（拟收购 AssetMark Financial Holdings, Inc、增加公司全资子公司华泰金控（香港）注册资本金）	2016-05-11
24	华泰证券 2013 年公司债券 2016 年付息公告	2016-05-27
25	华泰证券 2015 年年度股东大会决议公告	2016-06-09
26	华泰证券关于高旭、陈宁和徐清三位非执行董事任职等事项的公告	2016-06-09
27	华泰证券关于王会清监事任职等事项的公告	2016-06-09
28	华泰证券 2015 年第三期次级债券 2016 年付息公告	2016-06-20
29	华泰证券第三届董事会第三十三次会议决议公告（选举公司第三届董事会董事长、调整公司第三届董事会部分专门委员会组成方案、调整公司内部组织机构）	2016-06-21
30	华泰证券 2015 年公司债券（第一期）2016 年付息公告	2016-06-22
31	华泰证券第三届董事会第三十四次会议决议公告（《公司“十三五”发展战略规划》）	2016-06-30

11、报告期内，公司接待调研、沟通、采访等工作开展情况

投资者关系是公司规范发展、合规经营的重要工作之一，公司董事会高度重视投资者关系管理工作。公司以高度负责的精神策划、安排和组织各类投资者关系管理活动，包括协调来访接待，保持与监管机构、投资者、中介机构及新闻媒体的联系等。

报告期内，公司接待调研、沟通、采访等工作开展情况：

接待时间	接待地点	接待方式	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料
2016 年 1 月 7 日	公司	电话访谈	富国基金、南方基金、保银投资、冠泽鼎投资、中国出口信用保险资管、华安基金、华强投资、恒德投资、启元资产、持久投资、涌容资产、泽远投资、盈泰投资、睿盟投资、安际投资（16 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 1 月 20 日	公司	现场访谈	中银国际控股有限公司（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 1 月 21 日	公司	电话访谈	民生商银国际控股有限公司（3 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 1 月 27 日	公司	现场访谈	东兴证券（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 5 日	公司	电话访谈	King Capital Management, L. L. C.（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月	公司	电话	汇丰、中金、美银美林、高盛、摩	公司业务发展情况、创新业务开

月 12 日		访谈	根大通（10 多人次）	展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 15 日	公司	电话访谈	招银国际（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 18 日	公司	现场访谈	兴业证券（2 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 18 日	公司	现场访谈	汇添富基金、东兴证券、东吴证券、国寿安保基金、长信基金、太平洋证券（6 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 21 日	公司	电话访谈	JT Capital Management Limited(嘉泰新兴资本管理有限公司)(1 人次)	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 4 月 29 日	公司	现场访谈	广发证券（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 5 月 6 日	公司	现场访谈	国泰君安证券、中国人保资产管理公司、华融证券、上投摩根基金、华福证券（7 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 5 月 11 日	公司	电话访谈	汇丰（1 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 6 月 2 日	公司	现场访谈	高盛高华、Capital Group（3 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 6 月 7 日	公司	现场访谈	中银国际证券（2 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 6 月 20 日	公司	现场访谈	东北证券、太平洋证券（2 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 6 月 21 日	公司	电话访谈	JPMorgan（3 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 6 月 23 日	公司	现场访谈	兴业证券（2 人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	公司	电话沟通	机构投资者、个人投资者等	公司经营情况、行业状况等

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

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

2、 股份变动情况说明

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%。报告期内，股份无变动。

(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)	134,271
---------------	---------

其中，A 股股东 124,181 户，H 股登记股东 10,090 户。

(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 (全称)	报告期内增 减	期末持股数量	比例(%)	持有有 限售条 件股份 数量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
香港中央结算(代 理人)有限公司	-57,612	1,715,226,848	23.9464	-	无	-	境外法人
江苏国信	-	1,250,928,425	17.4643	-	无	-	国有法人
交通控股	-3,544,000	448,471,418	6.2611	-	无	-	国有法人
江苏高科技投资集 团有限公司	-	342,028,006	4.7751	-	无	-	国有法人
江苏省苏豪控股集 团有限公司	-19,000,253	237,587,391	3.3170	-	无	-	国有法人
江苏汇鸿国际集团 股份有限公司	-22,802,260	220,045,036	3.0721	-	无	-	国有法人
中国证券金融股份 有限公司	4,633,338	216,789,682	3.0266	-	无	-	未知
江苏宏图高科技股 份有限公司	-	137,403,149	1.9183	-	未知	123,169,146	境内非国 有法人
中央汇金资产管理 有限责任公司	-	98,222,400	1.3713	-	无	-	未知
江苏苏豪国际集团 股份有限公司	-4,030,000	92,650,000	1.2935	-	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	1,715,226,848	境外上市外资股	1,715,226,848				
江苏国信	1,250,928,425	人民币普通股	1,250,928,425				
交通控股	448,471,418	人民币普通股	448,471,418				
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	237,587,391	人民币普通股	237,587,391				
江苏汇鸿国际集团股份有限公司	220,045,036	人民币普通股	220,045,036				
中国证券金融股份有限公司	216,789,682	人民币普通股	216,789,682				
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				
中央汇金资产管理有限责任公司	98,222,400	人民币普通股	98,222,400				
江苏苏豪国际集团股份有限公司	92,650,000	人民币普通股	92,650,000				
上述股东关联关系或一致行动的 说明	江苏国信、交通控股、江苏高科技投资集团有限公司、江苏省苏豪控股集团有限公司以及江苏汇鸿国际集团股份有限公司的母公司江苏苏汇资产管理有限公司（持股比例为 100%）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 49,244.1768 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。						

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2016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	江苏国信	A股	实益拥有人(注1)	1,250,928,425	17.46	22.98	好仓
2	交通控股	A股	实益拥有人(注1)	448,471,418	6.26	8.24	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)	237,587,391	3.32	4.36	好仓
		A股	受控法团权益 (注4)	92,650,000	1.29	1.70	好仓
5	社保基金会	H股	实益拥有人(注1)	142,346,200	1.99	8.28	好仓
6	BlackRock, Inc.	H股	实益拥有人(注1)	92,028,298	1.28	5.35	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2016年6月30日，江苏国信持有1250,928,425股A股股份，交通控股持有448,471,418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237,587,391股A股股份，社保基金会持有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香港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92,650,000股股份中拥有权益。

除上述披露外，于2016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2016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

中根据《证券及期货条例》第XV部第347条须通知本公司及香港联交所的权益及淡仓：

序号	姓名	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/淡仓/可 供借出的股 份
1	周易	H股	拥有上市法团的权益 (注1)	353,261	0.005	0.02	好仓

注1: 2015年7月, 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, 通过合格境内机构投资者(QDII)定向资产管理计划渠道, 在符合有关法律法规的前提下, 购入本公司的H股股份。

除上述披露外, 于2016年6月30日, 本公司并不知悉其他本公司董事、监事及最高行政人员在本公司或其相关法团的股份、相关股份或债权证中拥有任何根据《证券及期货条例》第XV部及第7及8分部须通知本公司及香港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《标准守则》的规定需要通知本公司和香港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、高级管理人员情况

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
沈坤荣	独立非执行董事	离任	根据相关规定, 辞任公司第三届董事会独立非执行董事职务以及公司董事会发展战略委员会委员的职务
陈志斌	独立非执行董事	离任	根据相关规定, 辞任公司第三届董事会独立非执行董事职务以及公司董事会审计委员会委员的职务
董军政	监事	离任	因单位工作安排, 辞任公司第三届监事会监事的职务
孙鲁	非执行董事	离任	因单位工作安排, 辞任公司第三届董事会非执行董事的职务
王树华	非执行董事	离任	因单位工作安排, 辞任公司第三届董事会非执行董事的职务
徐敏	非执行董事	离任	因单位工作安排, 辞任公司第三届董事会非执行董事的职务
高旭	监事	离任	因单位工作安排, 改任公司第三届董事会非执行董事的职

			务
高旭	非执行董事	聘任	
陈宁	非执行董事	聘任	
徐清	非执行董事	聘任	
王会清	监事	聘任	
陈传明	独立非执行董事	聘任	
杨雄胜	独立非执行董事	聘任	
周易	董事长、总裁	选举	
齐亮	副总裁	离任	因工作变动，辞任公司副总裁职务

2015年12月7日，公司独立非执行董事沈坤荣先生根据相关规定向公司提请辞任公司第三届董事会独立非执行董事职务以及发展战略委员会委员的职务；2015年12月21日，公司独立非执行董事陈志斌先生根据相关规定向公司提请辞任公司第三届董事会独立非执行董事职务以及审计委员会委员的职务，但由于沈坤荣先生、陈志斌先生的辞职导致公司独立非执行董事成员不足董事会成员的三分之一，根据相关法律法规以及公司章程的规定，沈坤荣先生和陈志斌先生的辞职申请应当在继任独立非执行董事填补其缺额后生效。

2016年3月18日，公司2016年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司独立非执行董事的议案》，会议选举陈传明先生、杨雄胜先生为公司第三届董事会独立董事。因陈传明先生已事先取得江苏证监局核准的证券公司独立董事任职资格，根据公司章程规定，自2016年3月18日起，陈传明先生接替沈坤荣先生履行公司第三届董事会独立非执行董事职责，任期至本届董事会任期结束。2016年4月5日，公司收到江苏证监局《关于杨雄胜证券公司独立董事任职资格的批复（苏证监机构字[2016]73号）》。根据相关规定及公司2016年第一次临时股东大会决议，自即日起，杨雄胜先生接替陈志斌先生履行公司第三届董事会独立非执行董事职责，任期至本届董事会任期结束。

2016年3月22日，公司董事会收到副总裁齐亮先生的书面辞职报告。由于个人工作变动原因，齐亮先生提请辞去公司副总裁职务。该辞任自即日起生效。

2016年3月25日，公司监事会收到监事董军政女士的书面辞职报告。由于个人工作调动原因，董军政女士提请辞去公司第三届监事会监事职务。根据相关法律法规以及公司章程的规定，董军政监事的辞职自其辞职报告送达公司监事会时生效。

2016年6月7日，孙鲁先生、王树华先生、徐敏女士由于工作安排原因提请辞任公司董事会非执行董事以及董事会各专门委员会职务，高旭先生由于工作安排原因提请辞任公司监事职务，当日召开的公司2015年年度股东大会审议通过了《关于选举公司第三届董事会非执行董事的议案》和《关于选举王会清为公司第三届监事会监事的议案》，分别选举高旭先生、陈宁先生、徐清先生为公司第三届董事会非执行董事，选举王会清先生为公司第三届监事会监事。鉴于高旭先生、陈宁先生、徐清先生、王会清先生均已事先取得江苏证监局核准的证券公司董事或监事任职资格，根据公司章程规定，自该日起，高旭先生、陈宁先生、徐清先生分别接替孙鲁先生、王树华先生、徐敏女士履行公司第三届董事会非执行董事职责，任期至本届董事会任期结束；王会清先生接替高旭先生履行公司第三届监事会监事职责，任期至本届监事会任期结束。

2016年6月20日，公司第三届董事会第三十三次会议选举周易先生为公司第三届董事会董事长，任期至本届董事会任期结束。

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守则。根据对公司董事、监事及高级管理人员的专门查询后，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。公司现任及报告期内离任董事、监事、高级管理人员于报告期内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

2016 年 6 月 20 日，公司召开第三届董事会第三十三次会议，审议通过了《关于选举公司第三届董事会董事长的议案》，会议选举周易先生为公司第三届董事会董事长，任期至本届董事会任期结束。

（三）董事、监事服务合约的说明

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

集团共有员工 6956 人，其中本公司 5419 人，子公司 1537 人。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。

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，还为员工提供了丰富、自主激励性福利，包括意外险、医疗险、大病险等。

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，将 E-learning 与微信、APP 平台打通构造三位一体学习模式，年度培训计划有序实施。上半年完成 17 场集中培训，33 场外派培训，现场参训人员约 1044 人；在移动学习方面，微信公众号自去年 12 月底推出以来，共发布微课程及简报等 30 篇，粉丝达到 2000 余人，微课程阅读量超 28616 人次；E-learning 网络学院在网页版、APP 端和微信端同时推进，截至 6 月完成人均 19.62 学时。

第九节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

一、公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率	还本付息方式	交易所
华泰证券 2013 年公司债券(5 年期)	13 华泰 01	122261.SH	2013.6.5	2018.6.5	40.00	4.68%	到期还本,按年付息	上交所
华泰证券 2013 年公司债券(10 年期)	13 华泰 02	122262.SH	2013.6.5	2023.6.5	60.00	5.10%	到期还本,按年付息	上交所
华泰证券 2015 年公司债券(第一期)(品种一)	15 华泰 G1	122388.SH	2015.6.29	2018.6.29	66.00	4.20%	到期还本,按年付息	上交所

公司债券其他情况的说明

经公司第二届董事会第十七次会议审议通过,并经公司 2013 年第一次临时股东大会审议批准公司公开发行不超过人民币 100 亿元(含人民币 100 亿元),期限为不超过 10 年(含 10 年)的公司债券。2013 年 5 月 15 日,经中国证监会发行审核委员会审核,本次公开发行公司债券申请获得通过。2013 年 5 月 31 日,获得中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司公开发行公司债券的批复》(证监许可[2013]707 号)文件,核准公司向社会公开发行面值不超过人民币 100 亿元的公司债券,批复自核准发行之日起 6 个月内有效。2013 年 6 月 7 日,公司完成“13 华泰 01”和“13 华泰 02”公司债的发行工作。报告期内,公司于 2016 年 6 月 6 日兑付了债券“13 华泰 01”和“13 华泰 02”自 2015 年 6 月 5 日至 2016 年 6 月 4 日期间的利息共计人民币 49,320 万元(含税)。

经公司第三届董事会第十六次会议,并经公司 2014 年年度股东大会审议批准公开发行不超过人民币 70 亿元(含人民币 70 亿元),期限为不超过 10 年(含 10 年)的公司债券。2015 年 6 月 24 日,获得中国证监会《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)文件,核准公司向社会公开发行面值不超过人民币 66 亿元的公司债券,批复自核准发行之日起 24 个月内有效。2015 年 7 月 1 日,公司完成“15 华泰 G1”公司债的发行工作。本期债券面向合格投资者公开发行,认购本期债券的投资者,应符合《公司债券发行与交易管理办法》第十四条对合格投资者的资质要求。本期债券发行完毕后,也将仅限于合格投资者范围内交易流通。报告期内,公司于 2016 年 6 月 29 日兑付了债券“15 华泰 G1”自 2015 年 6 月 29 日至 2016 年 6 月 28 日期间的利息共计人民币 27,720 万元(含税)。

二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

债券受托管理人(13 华泰 01 和 13 华泰 02)	名称	广发证券股份有限公司
	办公地址	广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)
	联系人	左亚秀、陈光、李青蔚
	联系电话	020-8755 5888
债券受托管理人(15 华泰 G1)	名称	兴业证券股份有限公司
	办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 1103 室
	联系人	孟翔
	联系电话	010-66553783
资信评级机构(13 华泰 01 和 13 华泰 02)	名称	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
	办公地址	上海市汉口路 398 号华盛大厦 14 楼
资信评级机构(15 华泰 G1)	名称	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
	办公地址	上海市汉口路 398 号华盛大厦 14 楼

三、公司债券募集资金使用情况

2013 年期公司债券募集资金已全部用于补充公司运营资金，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；2015 年期公司债券募集资金已全部用于补充公司运营资金，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和其他符合监管规定的创新业务以及与公司主营业务相关的用途，上述投向与募集说明书的约定一致。

四、公司债券资信评级机构情况

根据中国证监会《公司债券发行与交易管理办法》和上交所《上海证券交易所公司债券上市规则》的有关规定，公司委托上海新世纪资信评估投资服务有限公司（以下简称“上海新世纪”）对公司债券“13 华泰 01”、“13 华泰 02”、“15 华泰 G1”进行了跟踪信用评级。

2016 年 4 月 25 日，上海新世纪出具了《华泰证券股份有限公司 2013、2015 年公司债券跟踪评级报告》，维持本公司债券“13 华泰 01”、“13 华泰 02”、“15 华泰 G1”的信用等级为 AAA，维持本公司主体信用级别为 AAA，评级展望稳定。《华泰证券关于 2013 年、2015 年公司债券和 2014 年、2015 年次级债券跟踪评级结果的公告》于 2016 年 4 月 30 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、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

公司发行的两期公司债券的增信机制是均采用无担保的发行方式，偿债计划均为在债券存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。报告期内，公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更，公司严格履行募集说明书中有关偿债计划的约定，按时兑付公司债券利息，及时披露公司相关信息，以保障投资者的合法权益。

六、公司债券持有人会议召开情况

报告期内，未召开公司债券持有人会议。

七、公司债券受托管理人履职情况

报告期内，广发证券股份有限公司作为受托管理人出具了《华泰证券股份有限公司 2013 年公司债券受托管理事务报告（2015 年度）》，报告全文在上交所网站（www.sse.com.cn）披露。

报告期内，兴业证券股份有限公司作为受托管理人出具了《华泰证券股份有限公司 2015 年公司债券（第一期）受托管理事务报告（2015 年度）》，报告全文在上交所网站（www.sse.com.cn）披露。

八、截至报告期末和上年末（或本报告期和上年同期）下列会计数据和财务指标

单位：元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)	变动原因
流动比率	3.97	3.53	12.46	-
速动比率	3.97	3.53	12.46	-
资产负债率	72.51%	74.85%	-3.13	-
贷款偿还率	100%	100%	-	-
	本报告期 (1-6 月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)	变动原因
EBITDA 利息保障倍数	2.49	3.01	-17.28	-
利息偿付率	100%	100%	-	-

九、报告期末公司资产情况

截至报告期末，公司以土地使用权抵押向中国工商银行南京新街口支行进行项目借款，最高额度人民币 500,000,000.00 元。此块土地使用权原值为人民币 353,732,401.40 元，累计摊销人民币 57,935,179.56 元，账面价值为人民币 295,797,221.84 元。

十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

（一）公司债券的兑付兑息情况

报告期内，公司于 2016 年 6 月 6 日兑付了债券“13 华泰 01”和“13 华泰 02”自 2015 年 6 月 5 日至 2016 年 6 月 4 日期间的利息，共计人民币 49,320 万元(含税)。

报告期内，公司于 2016 年 6 月 29 日兑付了债券“15 华泰 G1”自 2015 年 6 月 29 日至 2016 年 6 月 28 日期间的利息，共计人民币 27,720 万元(含税)。

（二）次级债的兑付兑息情况

报告期内，公司对次级债的兑付兑息情况具体如下：

单位：亿元 币种：人民币

债券简称	发行规模	期末余额	票面利率(%)	起息日	到期日	兑付兑息
14 华泰 02	30.00	-	6.15	2014.4.21	2016.4.21	兑付本息
15 华泰 01	60.00	60.00	5.90	2015.1.23	2017.1.23	兑付利息
15 华泰 02	70.00	-	5.60	2015.4.21	2017.4.21	兑付本息
15 华泰 03	50.00	50.00	5.80	2015.4.21	2020.4.21	兑付利息
15 华泰 04	180.00	180.00	5.50	2015.6.26	2017.6.26	兑付利息

注：1、“15 华泰 02”附第 1 年末发行人赎回选择权

2、“15 华泰 03”附第 3 年末发行人赎回选择权

报告期内，公司对 2014 非公开发行的第一期次级债 14 华泰 02（123381）进行了本息兑付，兑付金额为人民币 3,184,500,000.00 元（含税）；对 2015 年非公开发行的第一期次级债 15 华泰 01（123265）支付了自 2015 年 1 月 23 日至 2016 年 1 月 22 日的利息，本期付息金额为人民币 354,000,000.00 元(含税)。公司对 2015 年 4 月 20 日非公开发行的第二期次级债 15 华泰 02(123099)进行了本息兑付，兑付金额为人民币 7,392,000,000.00 元（含税）；对 2015 年非公开发行次级债 15 华泰 03（123100）支付了自 2015 年 4 月 21 日至 2016 年 4 月 20 日的利息，本期付息金额为人民币 290,000,000.00 元(含税)。对 2015 年非公开发行次级债 15 华泰 04(125978)支付了自 2015 年 6 月 26 日至 2016 年 6 月 25 日的利息，本期付息金额为人民币 990,000,000.00 元（含税）。相关公告详见公司在《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）上的披露。

十一、 公司报告期内的银行授信情况

报告期内，公司加强了授信管理工作，截止 2016 年 6 月底，公司获得商业银行的授信总额度为人民币 3,300 亿元，较上年度大幅提升，有效满足了公司各项业务的发展需求。

公司信誉良好，报告期内公司按时偿还银行贷款，未发生贷款展期、减免情形。

十二、 公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

报告期内，公司严格执行公司债券募集说明书相关约定或承诺，募集资金投向与募集说明书的约定一致；严格履行信息披露责任，按期兑付债券利息，保障投资者的合法权益。报告期内，公司已发行债券兑付兑息不存在违约情况；公司经营稳定，盈利情况良好，未发现可能导致未来出现不能按期偿付情况的风险。

十三、 公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

报告期内，公司未发生对公司的经营情况和偿债能力造成影响的重大事项。

第十节 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
2016 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	152,394,050,633.63	135,134,061,740.17
其中：客户存款		95,668,729,834.92	98,427,446,720.03
结算备付金	七、2	13,398,528,605.62	36,068,780,816.99
其中：客户备付金		11,911,339,179.79	33,517,077,681.89
拆出资金			
融出资金	七、3	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	七、4	93,202,794,125.54	131,238,108,713.37
衍生金融资产	七、5	934,651,457.91	334,749,747.33
买入返售金融资产	七、6	27,743,600,233.36	25,634,527,505.12
应收款项	七、7	1,996,256,127.81	621,553,847.35
应收利息	七、8	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91
存出保证金	七、9	7,630,317,575.84	6,009,299,999.56
应收股利			
划分为持有待售的资产			
可供出售金融资产	七、10	39,781,850,821.51	38,118,720,503.37
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	2,757,897,567.08	2,673,833,742.38
投资性房地产	七、13	1,221,645,622.32	1,301,531,373.67
固定资产	七、14	3,381,649,186.82	2,617,871,780.37
在建工程	七、15	115,271,280.72	761,146,125.53
无形资产	七、16	407,045,631.22	424,967,732.51
开发支出			
商誉	七、17	51,341,567.30	51,341,567.30
长期待摊费用	七、18	67,634,909.06	78,175,227.06
递延所得税资产	七、19	528,684,107.61	212,609,137.58
其他资产	七、20	968,704,802.77	613,733,977.73
资产总计		402,679,316,739.75	452,614,615,317.16
负债：			
短期借款	七、22	759,935,520.00	688,321,600.00
应付短期融资款	七、23	175,000,000.00	1,053,004,000.00
拆入资金	七、24	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	七、25	27,047,937,515.23	21,428,292,467.49
衍生金融负债	七、5	698,785,173.23	2,460,345,120.06
卖出回购金融资产款	七、26	22,061,434,673.80	33,192,019,282.19
代理买卖证券款	七、27	99,470,572,628.65	109,730,351,512.70
代理承销证券款	七、28	41,552,500.00	85,485,000.00
信用交易代理买卖证券款	七、29	13,111,364,503.52	18,637,027,667.89
应付职工薪酬	七、30	2,079,539,238.19	2,807,786,387.59
应交税费	七、31	1,251,588,450.23	2,700,686,858.57

应付款项	七、32	2,023,841,339.23	7,435,329,288.96
应付利息	七、33	660,114,285.99	2,692,344,618.00
应付股利	七、34	3,594,481,040.00	13,096,640.00
划分为持有待售的负债			
预计负债	七、35	72,941,100.00	72,941,100.00
长期借款	七、36	425,125,728.32	484,985,041.19
应付债券	七、37	52,850,564,005.02	72,372,177,624.17
长期应付款			
长期应付职工薪酬	七、38	3,763,396,011.30	3,366,621,360.80
专项应付款			
递延所得税负债	七、19	154,838,446.90	351,818,817.20
递延收益	七、39	19,145,246.58	14,755,246.58
其他负债	七、40	91,179,803,315.64	88,498,454,981.60
负债合计		322,941,960,721.83	371,085,844,614.99
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	七、41	7,162,768,800.00	7,162,768,800.00
其他权益工具			
资本公积	七、42	45,837,762,390.89	45,837,762,390.89
减：库存股			
其他综合收益	七、43	2,021,140,073.05	3,263,870,957.42
专项储备			
盈余公积	七、44	2,607,376,049.13	2,607,376,049.13
一般风险准备	七、45	6,681,123,964.00	6,681,123,964.00
未分配利润	七、46	14,491,891,651.35	15,232,022,703.47
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		78,802,062,928.42	80,784,924,864.91
少数股东权益		935,293,089.50	743,845,837.26
所有者权益（或股东权益） 合计		79,737,356,017.92	81,528,770,702.17
负债和所有者权益（或股东 权益）总计		402,679,316,739.75	452,614,615,317.16

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

母公司资产负债表
2016 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		98,275,109,089.56	92,075,152,987.03
其中:客户存款		83,188,033,172.60	85,564,820,966.17
结算备付金		13,740,359,984.50	37,542,778,536.55
其中:客户备付金		11,900,703,774.79	33,516,801,769.94
拆出资金			
融出资金		51,399,717,189.63	67,352,031,973.73
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		29,177,974,813.30	61,372,284,920.02
衍生金融资产		857,520,593.56	169,412,016.56
买入返售金融资产		19,487,864,191.75	16,620,674,774.13
应收款项		347,070,109.35	255,170,972.27
应收利息		2,784,185,562.66	2,104,421,793.75
存出保证金		873,028,093.48	1,141,826,157.19
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		28,848,723,574.06	30,838,347,839.35
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		10,254,353,805.96	8,884,162,311.60
投资性房地产		1,943,669,886.58	1,218,239,214.22
固定资产		2,519,163,562.46	2,559,142,743.87
在建工程		113,679,899.31	761,146,125.53
无形资产		398,473,472.72	415,088,431.22
开发支出			
商誉		-	-
长期待摊费用		57,608,499.27	68,600,220.58
递延所得税资产		304,049,320.57	-
其他资产		433,765,793.83	166,815,106.02
资产总计		261,821,317,442.55	323,550,296,123.62
负债:			
短期借款			
应付短期融资款		175,000,000.00	1,053,004,000.00
拆入资金		1,500,000,000.00	3,000,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		14,292,538,400.00	14,417,704,840.00
衍生金融负债		685,182,383.46	2,447,067,855.02
卖出回购金融资产款		15,328,204,438.35	25,682,048,527.71
代理买卖证券款		82,046,444,894.20	95,229,638,886.84
代理承销证券款		1,542,500.00	5,485,000.00
信用交易代理买卖证券款		12,944,953,730.52	18,461,817,287.55
应付职工薪酬		1,438,618,184.45	1,880,696,247.81

应交税费		1,003,160,019.70	2,340,716,139.50
应付款项		1,243,022,549.11	7,039,087,891.73
应付利息		632,564,582.38	2,668,712,142.54
应付股利		3,581,384,400.00	-
划分为持有待售的负债			
预计负债		72,941,100.00	72,941,100.00
长期借款		425,125,728.32	484,985,041.19
应付债券		49,580,225,760.17	69,175,434,333.55
长期应付款			
长期应付职工薪酬		3,392,961,244.83	3,008,576,393.35
专项应付款			
递延所得税负债		-	193,661,998.85
递延收益		12,987,428.58	12,987,428.58
其他负债		1,701,936,406.12	1,930,413,922.97
负债合计		190,058,793,750.19	249,104,979,037.19
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		7,162,768,800.00	7,162,768,800.00
其他权益工具			
资本公积		45,577,448,327.12	45,577,448,327.12
减：库存股			
其他综合收益		1,481,413,702.48	2,741,713,260.78
专项储备			
盈余公积		2,607,376,049.13	2,607,376,049.13
一般风险准备		5,426,660,912.75	5,426,660,912.75
未分配利润		9,506,855,900.88	10,929,349,736.65
外币报表折算差额			
所有者权益（或股东权益）合计		71,762,523,692.36	74,445,317,086.43
负债和所有者权益（或股东权益）总计		261,821,317,442.55	323,550,296,123.62

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

合并利润表
2016 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		7,355,772,624.15	14,644,251,806.44
手续费及佣金净收入	七、47	3,977,792,106.30	7,969,997,167.12
其中: 经纪业务手续费净收入		2,889,515,027.10	7,128,400,815.29
投资银行业务手续费净收入		834,559,750.94	612,749,245.08
资产管理业务手续费净收入		46,554,394.94	130,418,528.77
利息净收入	七、48	1,547,841,531.48	2,769,331,690.69
投资收益(损失以“-”号填列)	七、49	1,523,294,836.43	3,179,740,350.49
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		185,634,297.39	197,503,943.96
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	七、50	247,044,292.96	351,472,443.46
汇兑收益(损失以“-”号填列)		(23,437,370.86)	331,388,162.11
其他业务收入	七、51	83,237,227.84	42,321,992.57
二、营业支出		3,547,004,355.00	5,833,875,333.50
营业税金及附加	七、52	343,743,698.03	921,431,417.06
业务及管理费	七、53	3,164,140,665.94	4,878,355,706.15
资产减值损失	七、54	(5,265,130.74)	(2,361,942.69)
其他业务成本	七、55	44,385,121.77	36,450,152.98
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		3,808,768,269.15	8,810,376,472.94
加: 营业外收入	七、56	72,793,777.62	31,747,969.45
减: 营业外支出	七、57	3,550,040.42	8,251,167.23
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,878,012,006.35	8,833,873,275.16
减: 所得税费用	七、58	934,458,775.61	2,115,301,390.96
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,943,553,230.74	6,718,571,884.20
其中: 归属于母公司所有者(或股东)的净利润		2,841,253,347.88	6,674,821,930.46
少数股东损益		102,299,882.86	43,749,953.74
六、其他综合收益的税后净额	七、43	(1,241,997,192.89)	1,684,553,023.59
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额			
(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		(1,242,730,884.37)	1,682,915,626.12
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		(12,718,235.75)	43,189,483.55
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		(1,250,201,686.50)	1,636,508,948.98
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		20,189,037.88	3,217,193.59
6. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		733,691.48	1,637,397.47
七、综合收益总额		1,701,556,037.85	8,403,124,907.79
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,598,522,463.51	8,357,737,556.58
归属于少数股东的综合收益总额		103,033,574.34	45,387,351.21
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)	七、59	0.3967	1.1450
（二）稀释每股收益(元/股)	七、59	0.3967	1.1450

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

母公司利润表
2016 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		4,963,932,827.43	12,521,404,436.66
手续费及佣金净收入		2,920,296,318.82	7,072,541,093.84
其中:经纪业务手续费净收入		2,775,162,985.35	6,981,607,700.07
投资银行业务手续费净收入		73,228,297.60	29,458,856.12
资产管理业务手续费净收入		-	4,796,292.60
利息净收入		1,119,341,728.09	2,125,201,118.39
投资收益(损失以“-”号填列)		536,446,468.95	2,868,094,172.16
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		192,053,019.27	201,002,420.45
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		338,933,869.70	92,831,718.50
汇兑收益(损失以“-”号填列)		4,749,030.32	339,077,225.28
其他业务收入		44,165,411.55	23,659,108.49
二、营业支出		2,225,535,244.92	4,895,765,199.26
营业税金及附加		244,309,933.84	836,541,057.53
业务及管理费		1,956,339,509.56	4,046,623,592.25
资产减值损失		(3,338,018.16)	2,444,770.03
其他业务成本		28,223,819.68	10,155,779.45
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		2,738,397,582.51	7,625,639,237.40
加:营业外收入		44,530,839.55	29,346,829.84
减:营业外支出		2,497,466.30	8,225,363.69
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,780,430,955.76	7,646,760,703.55
减:所得税费用		621,540,391.53	1,861,635,323.43
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,158,890,564.23	5,785,125,380.12
六、其他综合收益的税后净额		(1,260,299,558.30)	1,255,365,821.39
(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		(1,260,299,558.30)	1,255,365,821.39
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		(30,861,524.91)	43,189,483.55
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		(1,229,438,033.39)	1,212,176,337.84
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		898,591,005.93	7,040,491,201.51
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:周易

主管会计工作负责人:周易

会计机构负责人:费雷

合并现金流量表
2016 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		37,920,803,589.99	-
收取利息、手续费及佣金的现金		7,134,776,835.05	17,723,572,951.20
拆入资金净增加额		-	1,900,000,000.00
回购业务资金净增加额		-	10,471,210,830.72
融出资金净减少额		15,984,608,795.59	
代理买卖证券收到的现金净额		-	134,910,871,386.17
收到其他与经营活动有关的现金	七、60(1)	3,122,921,505.47	50,107,547,151.98
经营活动现金流入小计		64,163,110,726.10	215,113,202,320.07
融出资金净增加额		-	50,041,252,017.05
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
回购业务资金净减少额		12,796,691,908.37	-
拆入资金净减少额		1,500,000,000.00	-
代理买卖证券支付的现金净额		17,422,822,557.15	-
支付利息、手续费及佣金的现金		2,691,796,820.48	4,746,084,709.33
支付给职工以及为职工支付的现金		2,853,451,648.23	2,457,033,662.71
支付的各项税费		3,107,309,112.43	1,654,159,104.26
支付其他与经营活动有关的现金	七、60(2)	18,566,161,270.83	7,442,742,117.91
经营活动现金流出小计		58,938,233,317.49	75,887,360,472.27
经营活动产生的现金流量净额	七、61(1)	5,224,877,408.61	139,225,841,847.80
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
取得投资收益收到的现金		258,787,707.00	151,070,111.87
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、60(3)	5,206,248,429.50	718,797,672.28
投资活动现金流入小计		5,465,036,136.50	2,222,995,858.95
投资支付的现金		3,811,286,758.49	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		214,739,366.36	378,212,835.23
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		116,100,000.00	-
支付其他与投资活动有关的现金		155,604,378.64	-
投资活动现金流出小计		4,297,730,503.49	684,812,835.23
投资活动产生的现金流量净额		1,167,305,633.01	1,538,183,023.72
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		88,413,677.90	30,624,270,946.94
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		88,413,677.90	-
取得借款收到的现金		55,844,960.00	228,437,290.21
发行债券收到的现金		274,600,000.00	77,691,716,000.00
筹资活动现金流入小计		418,858,637.90	108,544,424,237.15

偿还债务支付的现金		20,812,463,312.87	28,543,063,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		3,655,286,143.81	3,975,311,442.31
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、60(4)	85,925,966.77	21,617,636.72
筹资活动现金流出小计		24,553,675,423.45	32,539,992,079.03
筹资活动产生的现金流量净额		(24,134,816,785.55)	76,004,432,158.12
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		67,077,310.87	334,605,355.70
五、现金及现金等价物净增加额	七、61(1)	(17,675,556,433.06)	217,103,062,385.34
加：期初现金及现金等价物余额		150,540,283,811.18	102,590,278,912.60
六、期末现金及现金等价物余额	七、61(4)	132,864,727,378.12	319,693,341,297.94

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

母公司现金流量表
2016 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		30,623,502,741.48	3,190,295,743.69
收取利息、手续费及佣金的现金		7,328,785,399.02	15,112,821,611.78
拆入资金净增加额		-	1,900,000,000.00
回购业务资金净增加额		-	13,515,315,749.23
融出资金净减少额		15,960,472,517.24	-
代理买卖证券收到的现金净额		-	129,183,672,558.87
收到其他与经营活动有关的现金		1,073,000,995.48	332,073,991.66
经营活动现金流入小计		54,985,761,653.22	163,234,179,655.23
融出资金净增加额		-	50,033,958,318.73
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		-	-
回购业务资金净减少额		13,037,934,103.22	-
拆入资金净减少额		1,500,000,000.00	-
代理买卖证券支付的现金净额		19,023,558,857.76	-
支付利息、手续费及佣金的现金		2,424,124,531.49	4,596,524,234.87
支付给职工以及为职工支付的现金		1,688,436,379.66	1,747,315,326.06
支付的各项税费		2,578,509,205.97	1,390,791,795.96
支付其他与经营活动有关的现金		15,377,312,798.71	2,360,209,794.19
经营活动现金流出小计		55,629,875,876.81	60,128,799,469.81
经营活动产生的现金流量净额		(644,114,223.59)	103,105,380,185.42
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
取得投资收益收到的现金		196,381,435.45	122,374,835.47
处置子公司及其他营业单位收到的现金		-	-
收到其他与投资活动有关的现金		1,149,941.79	786,525.06
投资活动现金流入小计		197,531,377.24	1,493,853,073.89
投资支付的现金		156,443,013.04	-
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		200,337,528.42	368,762,963.22
取得子公司及其他营业单位支付的现金		1,420,000,000.00	1,750,000,000.00
支付其他与投资活动有关的现金		-	-
投资活动现金流出小计		1,776,780,541.46	2,118,762,963.22
投资活动产生的现金流量净额		(1,579,249,164.22)	(624,909,889.33)
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
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		274,600,000.00	77,630,580,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			

筹资活动现金流入小计		274,600,000.00	108,446,706,895.15
偿还债务支付的现金		20,812,463,312.87	28,543,063,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		3,573,559,386.16	3,934,785,581.55
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		85,925,966.77	8,648,439.78
筹资活动现金流出小计		24,471,948,665.80	32,486,497,021.33
筹资活动产生的现金流量净额		(24,197,348,665.80)	75,960,209,873.82
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		4,749,030.32	339,077,225.28
五、现金及现金等价物净增加额		(26,415,963,023.29)	178,779,757,395.19
加：期初现金及现金等价物余额		130,617,931,523.58	81,038,846,562.82
六、期末现金及现金等价物余额		104,201,968,500.29	259,818,603,958.01

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

合并所有者权益变动表
2016 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	7,162,768,800.00	45,837,762,390.89	3,263,870,957.42	2,607,376,049.13	6,681,123,964.00	15,232,022,703.47	743,845,837.26	81,528,770,702.17
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	7,162,768,800.00	45,837,762,390.89	3,263,870,957.42	2,607,376,049.13	6,681,123,964.00	15,232,022,703.47	743,845,837.26	81,528,770,702.17
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)			(1,242,730,884.37)			(740,131,052.12)	191,447,252.24	(1,791,414,684.25)
(一)综合收益总额			(1,242,730,884.37)			2,841,253,347.88	103,033,574.34	1,701,556,037.85
(二)所有者投入和减少资本							88,413,677.90	88,413,677.90
1. 股东投入的普通股							88,413,677.90	88,413,677.90
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						(3,581,384,400.00)		(3,581,384,400.00)
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						(3,581,384,400.00)		(3,581,384,400.00)
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	45,837,762,390.89	2,021,140,073.05	2,607,376,049.13	6,681,123,964.00	14,491,891,651.35	935,293,089.50	79,737,356,017.92

项目	上期							少数股东权益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益								
	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

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

母公司所有者权益变动表
2016 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	7,162,768,800.00	45,577,448,327.12	2,741,713,260.78	2,607,376,049.13	5,426,660,912.75	10,929,349,736.65	74,445,317,086.43
加: 会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年期初余额	7,162,768,800.00	45,577,448,327.12	2,741,713,260.78	2,607,376,049.13	5,426,660,912.75	10,929,349,736.65	74,445,317,086.43
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)			(1,260,299,558.30)			(1,422,493,835.77)	(2,682,793,394.07)
(一) 综合收益总额			(1,260,299,558.30)			2,158,890,564.23	898,591,005.93
(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						(3,581,384,400.00)	(3,581,384,400.00)
1. 提取盈余公积							
2. 对所有者(或股东)的分配						(3,581,384,400.00)	(3,581,384,400.00)
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	1,481,413,702.48	2,607,376,049.13	5,426,660,912.75	9,506,855,900.88	71,762,523,692.36

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	17,125,162,430.36	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

法定代表人：周易

主管会计工作负责人：周易

会计机构负责人：费雷

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。

本公司于2010年2月公开发行人民币普通股(A股)784,561,275股,并在上海证券交易所挂牌上市,每股面值人民币1元。

本公司于2015年6月在香港联合交易所有限公司(“香港联交所”)完成境外上市外资股(“H股”)的首次公开发售,共向公众发售1,562,768,800股每股面值人民币1元的新股。

截至2016年6月30日,本公司累计发行股本总额为人民币7,162,768,800.00元,注册资本为人民币7,162,768,800.00元。本公司于2016年6月23日办理了统一社会信用代码为91320000704041011J的“三证合一”变更。

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,直接投资业务,创新投资业务,期货经纪业务,实业投资,货物进出口,转口贸易,农产品、各类金属与橡胶等商品的销售服务以及中国证监会批准的其他业务。

截至2016年6月30日,本公司经批准设立分公司29家,证券营业部243家,本公司下设子公司情况参见附注十、1。

截至2016年6月30日,本公司拥有员工5,419人,其中高级管理人员9人。

2. 合并财务报表范围

合并财务报表范围变动详见附注十。

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

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2016年6月30日的合并财务状况和财务状况、2016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，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及本公司子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本公司的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币，在编制本财务报表时，这些子公司的外币财务报表按照附注五、8 进行了折算。

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、本公司控制的子公司及受本公司控制的结构化主体。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，以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为基础，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。

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。

(6) 资产证券化

资产证券化业务，一般是指将金融资产出售给结构化主体，然后再由该结构化主体向投资者发行资产支持证券。证券化金融资产的权益以优先级资产支持证券、次级资产支持证券或其他剩余权益的形式体现。对于资产证券化业务，本集团按照附注五、6 所述的会计政策判断是否需要对该结构化主体予以合并，并按照附注五、9(3)所述的会计政策判断是否应终止确认资产证券化业务中所转移的金融资产。

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
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五、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，在与支出相关的经济利益很可能流入本集团时资本化计入固定资产成本，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 - 50 年	3%	1.94% - 3.23%
运输工具		3 - 8 年	3%	12.13% - 32.33%
电子设备		5 年	3%	19.40%
办公设备及其他设备		2 - 5 年	3%	19.40% - 48.50%

本集团至少在每年年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核。

(3) 减值测试方法及减值准备计提方法参见附注五、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。

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(参见附注五、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，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

(1). 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	不确定
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。本集团在每个会计期间对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。如果有证据表明无形资产的使用寿命是有限的，则估计其使用寿命，并按上述使用寿命有限的无形资产处理。

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，按预计受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。

资产组由创造现金流入相关的资产组成，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。

买入返售金融资产中，涉及向客户融出资金的，参照融资类业务的方法计提减值准备。详见附注五、28。

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，将实际发生或按规定的基准和比例计提的职工工资、奖金、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，并计入当期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) 买入返售金融资产利息收入

买入返售金融资产的利息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、衍生金融工具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

(1)、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。

本集团在资产负债表日，对融资类业务计提减值准备。对有充分证据、可识别并可确定具体损失的业务进行逐笔梳理，将确定可能损失的债权按照个别认定法，单独进行减值测试，计提专项减值准备。对未计提专项减值准备的融资类业务，根据融资类业务资产分类结合资产风险分级按一定比例计提减值准备。

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

现金股利于股东大会批准的当期，确认为负债。

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，不构成关联方。

此外，本公司同时根据证监会颁布的《上市公司信息披露管理办法》确定本集团或本公司的关联方。

32. 风险准备计提

本公司及相关子公司根据《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；本公司及相关子公司根据《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。如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时在各单项产品或劳务的性质、生产过程的性质、产品或劳务的客户类型、销售产品或提供劳务的方式、生产产品及提供劳务受法律及行政法规的影响等方面具有相同或相似性的，可以合并为一个经营分部。本集团以经营分部为基础考虑重要性原则后确定报告分部。

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 和附注十二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。

- 融出资金及买入返售金融资产中涉及向客户融资业务(以下简称“融资类业务”)的减值

本集团定期检查融资类业务以评估减值。在确认减值损失时，本集团须作出判断，以确定是否存在任何可观察数据显示有客观证据需要计提减值。本集团按个别基础复核客户所提供的资金及证券抵押品的价值，再对剩余部分按组合基础判断是否出现减值。本集团定期复核融资类业务减值方法及假设，以减少预计损失与实际损失之间的差异。

- 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。当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时，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

六、税项

1. 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	6%和 5% 17%和 13%
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%和 16.5%
教育费附加	按实际缴纳营业税及应交增值税计征	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%

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%
本公司的香港子公司	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：	/	/	361,800.77	/	/	334,352.63
人民币	/	/	346,200.79	/	/	319,063.49

美元	86.00	6.6312	570.28	86.00	6.4936	558.45
港元	17,584.77	0.8547	15,029.70	17,582.58	0.8378	14,730.69
银行存款:	/	/	152,393,617,017.36	/	/	134,995,442,508.59
其中: 自有资金	/	/	56,724,887,182.44	/	/	36,567,995,788.56
人民币	/	/	55,501,889,771.42	/	/	34,565,271,168.30
美元	64,958,942.28	6.6312	430,755,738.06	106,940,611.55	6.4936	694,429,555.16
港元	924,059,077.30	0.8547	789,793,293.37	1,553,334,403.34	0.8378	1,301,383,563.12
其他			2,448,379.59			6,911,501.98
客户资金	/	/	95,668,729,834.92	/	/	98,427,446,720.03
人民币	/	/	92,993,233,201.09	/	/	96,273,835,300.40
美元	264,711,936.39	6.6312	1,755,357,792.59	223,479,142.46	6.4936	1,451,184,159.48
港元	1,075,742,443.37	0.8547	919,437,066.34	833,703,607.45	0.8378	698,476,882.32
其他			701,774.90			3,950,377.80
其他货币资金:	/	/	71,815.50	/	/	138,284,878.95
人民币	/	/	71,815.50	/	/	61,259.47
美元	-	6.6312	-	21,286,130.88	6.4936	138,223,619.48
合计	/	/	152,394,050,633.63	/	/	135,134,061,740.17

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包括质押定期存单以及结构化主体计提的风险准备金共计人民币 985,821,512.51 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 1,132,605,354.48 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:	/	/	1,487,189,425.83	/	/	2,551,703,135.10
人民币	/	/	1,481,513,736.13	/	/	2,549,953,359.52
港元	6,640,563.59	0.8547	5,675,689.70	2,088,536.14	0.8378	1,749,775.58
客户备付金:	/	/	11,911,339,179.79	/	/	33,517,077,681.89
人民币	/	/	8,146,001,054.20	/	/	23,812,947,738.09
美元	6,151,527.40	6.6312	40,792,008.49	10,297,739.66	6.4936	66,869,402.26
港元	121,988,831.61	0.8547	104,263,854.38	127,599,187.41	0.8378	106,902,599.21
客户信用备付金			3,620,282,262.72			9,530,357,942.33
人民币			3,620,282,262.72			9,530,357,942.33
信用备付金:	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
合计	/	/	13,398,528,605.62	/	/	36,068,780,816.99

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	49,080,638,478.89	66,261,285,139.26
机构	2,426,650,896.00	1,230,613,031.22
减：减值准备	(51,622,264.48)	(59,779,997.62)
合计	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86

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

融出资金的说明

(1) 按类别列示

	2016年6月30日	2015年12月31日
融资融券业务融出资金	51,507,289,374.89	67,491,898,170.48
减：减值准备	(51,622,264.48)	(59,779,997.62)
融出资金净值	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86

于2016年6月30日，本公司将上述融资融券业务中共计人民币9,632,231,619.15元(2015年12月31日：人民币20,853,545,326.86元)的债权收益权进行了质押式回购(参见附注七、26)；并将上述融资业务中共计人民币533,672,012.20元(2015年12月31日：511,833,436.92元)的债权作为基础资产转让给资产支持专项计划进行了资产证券化业务(参见附注八)。

(2) 按账龄分析

	2016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	28,356,296,344.96	55.05%	28,394,362.20	0.10%
3 - 6个月	3,953,483,089.23	7.68%	3,966,616.84	0.10%
6个月以上	19,197,509,940.70	37.27%	19,261,285.44	0.10%
合计	51,507,289,374.89	100.00%	51,622,264.48	0.10%

	2015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	51,131,251,980.82	75.76%	39,806,009.03	0.08%
3 - 6个月	5,529,832,941.14	8.19%	5,668,699.17	0.10%
6个月以上	10,830,813,248.52	16.05%	14,305,289.42	0.13%
合计	67,491,898,170.48	100.00%	59,779,997.62	0.09%

(3) 按客户类别列示

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
个人	49,080,638,478.89	66,261,285,139.26
机构	2,426,650,896.00	1,230,613,031.22
小计	51,507,289,374.89	67,491,898,170.48
减：减值准备	(51,622,264.48)	(59,779,997.62)
合计	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86

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						
项目	公允价值			初始投资成本		
	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	63,917,280,588.65	-	63,917,280,588.65	63,429,081,339.19	-	63,429,081,339.19
基金	20,075,129,067.33	-	20,075,129,067.33	20,086,796,856.54	-	20,086,796,856.54
股票	4,329,472,995.39	-	4,329,472,995.39	3,921,771,184.34	-	3,921,771,184.34
其他	3,664,244,808.72	1,216,666,665.45	4,880,911,474.17	3,653,449,077.01	1,000,000,000.00	4,653,449,077.01
合计	91,986,127,460.09	1,216,666,665.45	93,202,794,125.54	91,091,098,457.08	1,000,000,000.00	92,091,098,457.08
期初余额						
项目	公允价值			初始投资成本		
	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	55,945,942,472.63	-	55,945,942,472.63	55,290,530,498.60	-	55,290,530,498.60
基金	49,917,226,971.66	-	49,917,226,971.66	49,893,158,956.92	-	49,893,158,956.92
股票	10,284,934,058.55	-	10,284,934,058.55	9,512,588,659.84	-	9,512,588,659.84
其他	13,890,005,211.73	1,199,999,998.80	15,090,005,210.53	13,884,836,068.19	1,000,000,000.00	14,884,836,068.19
合计	130,038,108,714.57	1,199,999,998.80	131,238,108,713.37	128,581,114,183.55	1,000,000,000.00	129,581,114,183.55

其他说明

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中的融出证券情况

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
成本	14,073,205.59	62,309,437.31
公允价值变动	(32,396.21)	3,299,677.41
净值	14,040,809.38	65,609,114.72

本集团融出证券的担保物信息参见附注十九、9(2)。

(2) 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	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
企业债	质押	9,178,447,635.97	6,914,645,055.48
国债	质押	3,193,357,337.12	3,439,906,480.00
短期融资券	质押	1,797,895,854.27	2,960,510,090.00
公司债	质押	1,005,041,139.29	2,003,981,707.08
中期票据	质押	1,170,495,470.00	1,897,998,648.20
地方债	质押	755,221,599.50	420,800,000.00
政府支持机构债	质押	-	287,204,880.00
金融债	质押	1,309,210,790.00	113,126,944.00
可转债	质押	19,069,400.00	-
非公开定向债务 融资工具	质押	-	60,561,780.00
股票	已融出证券	10,875,485.73	56,447,297.72
基金	已融出证券	3,165,323.65	9,161,817.00
合计		18,442,780,035.53	18,164,344,699.48

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
利率衍生工具 (按类别列示)			30,867,329,800.00	19,660,849.30	(67,095,523.76)			25,710,000,000.00	27,513,684.32	(85,241,995.08)
- 国债期货			997,329,800.00	-	-			-	-	-
- 利率互换			29,870,000,000.00	19,660,849.30	(67,095,523.76)			25,710,000,000.00	27,513,684.32	(85,241,995.08)
货币衍生工具 (按类别列示)			66,312,000.00	1,161,161.88	-			451,538,930.04	5,301,420.42	(4,418,130.64)
- 货币互换			66,312,000.00	1,161,161.88	-			451,538,930.04	5,301,420.42	(4,418,130.64)
权益衍生工具 (按类别列示)			28,173,852,030.48	187,761,620.39	(631,219,939.56)			22,873,943,680.00	298,524,570.44	(1,063,020,055.74)
- 股指期货			617,200,486.83	-	-			298,513,680.00	-	-
- 权益互换			1,094,320,900.00	110,655,220.68	(597,324,991.24)			6,460,570,000.00	134,313,713.44	(1,023,191,211.00)
- 股指期货			1,307,620,925.29	6,386,687.52	(29,928,912.22)			679,917,000.00	7,625,755.00	(39,533,565.00)
- 场外期权			25,154,709,718.36	70,719,712.19	(3,966,036.10)			15,434,943,000.00	156,585,102.00	(295,279.74)
信用衍生工具 (按类别列示)			99,468,000.00	647,826.34	(469,709.91)			292,198,395.06	3,410,072.15	(3,250,278.60)
- 信贷违约互换			99,468,000.00	647,826.34	(469,709.91)			292,198,395.06	3,410,072.15	(3,250,278.60)
其他衍生工具 (按类别列示)			13,537,526,380.00	725,420,000.00	-			15,514,407,495.00	-	(1,304,414,660.00)
- 远期合约			13,345,910,000.00	725,420,000.00	-			15,451,525,000.00	-	(1,304,414,660.00)
- 商品期货			191,616,380.00	-	-			62,882,495.00	-	-
合计			72,744,488,210.48	934,651,457.91	(698,785,173.23)			64,842,088,500.10	334,749,747.33	(2,460,345,120.06)

衍生金融工具的说明：

(i) 本集团进行的国债期货与股指期货交易为每日无负债结算。于 2016 年 6 月 30 日，本集团持有的用于非套期的未到期国债期货与股指期货合约的公允价值为浮亏人民币 99,974.53 元 (2015 年 12 月 31 日:0 元) 与浮亏人民币 11,442,072.19 元 (2015 年 12 月 31 日: 浮亏人民币 6,239,681.47 元)，与本集团因参与该国债期货与股指期货交易所确认的相关金融资产相互抵销。

(ii) 2016 年本集团进行的在银行间市场清算所股份有限公司集中清算的利率互换交易为每日无负债结算。于 2016 年 6 月 30 日，本集团持有在银行间市场清算所股份有限公司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 39,082,376.03 (2015 年 12 月 31 日: 浮亏人民币 85,253,536.40 元)，与本集团因参与该利率互换交易所确认的相关金融资产或负债相互抵销。

(iii) 本集团通过期货子公司进行的商品期货交易为每日无负债结算。于 2016 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 2,215,750.00 元 (2015 年 12 月 31 日: 浮亏人民币 187,470.00 元)，与本集团因参与该商品期货交易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	25,003,176,245.39	23,352,219,316.78
债券	2,420,694,899.61	1,975,731,231.28
其他	339,140,840.10	322,588,686.33
减：减值准备	19,411,751.74	16,011,729.27
买入返售金融资产账面价值	27,743,600,233.36	25,634,527,505.12

(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	1,601,691,354.11	2,018,228,239.49
一个月至三个月内	3,544,583,624.58	3,148,135,836.67
三个月至一年内	17,284,512,892.68	14,666,806,570.63
一年以上	2,577,660,000.00	3,532,240,000.00
减：减值准备	19,411,751.74	16,011,729.27
合计	24,989,036,119.63	23,349,398,917.52

(3) 按业务类别列示

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
股票质押式回购	25,008,447,871.37	23,365,410,646.79
债券质押式回购	2,315,332,134.50	1,972,501,110.00
约定购回式证券	-	-
其他	439,231,979.23	312,627,477.60
减：减值准备	(19,411,751.74)	(16,011,729.27)
合计	27,743,600,233.36	25,634,527,505.12

(4) 按交易场所类别列示

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
证券交易所	25,757,448,371.37	23,607,710,646.79
银行间同业市场	1,282,302,711.43	1,260,001,110.00
其他	723,260,902.30	782,827,477.60
减：减值准备	(19,411,751.74)	(16,011,729.27)
合计	27,743,600,233.36	25,634,527,505.12

(5) 担保物信息

于 2016 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 99,481,471,865.68 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 102,241,481,453.24 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	1,102,077,063.52	12,548,578.36
应收经纪、交易商及结算所	359,148,142.21	170,459,695.80
应收手续费及佣金	170,785,391.56	148,399,682.34
应收开放式基金赎回款	233,261,230.64	132,807,794.65
应收申购款	88,189,939.52	111,142,303.19
其他	44,923,766.13	48,045,390.57
合计	1,998,385,533.58	623,403,444.91
减：减值准备	2,129,405.77	1,849,597.56
应收款项账面价值	1,996,256,127.81	621,553,847.35

(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	1,989,457,497.38	99.55	1,626,003.96	0.08	617,169,344.91	99.00	1,354,392.56	0.22
1-2 年	8,748,036.20	0.44	437,401.81	5.00	3,524,100.00	0.56	176,205.00	5.00
2-3 年	60,000.00	0.00	6,000.00	10.00	2,590,000.00	0.42	259,000.00	10.00
3 年以上	120,000.00	0.01	60,000.00	50.00	120,000.00	0.02	60,000.00	50.00
合计	1,998,385,533.58	100.00	2,129,405.77	0.11	623,403,444.91	100.00	1,849,597.56	0.30

(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	1,998,385,533.58	100	2,129,405.77	0.11	623,403,444.91	100	1,849,597.56	0.30
合计	1,998,385,533.58	100	2,129,405.77	0.11	623,403,444.91	100	1,849,597.56	0.30

(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:

	2016年6月30日	2015年12月31日
年初余额	1,849,597.56	397,889.36
本年计提	279,808.21	1,451,708.20
本年收回或转回	-	-
本年核销	-	-
年末余额	2,129,405.77	1,849,597.56

(6) 按欠款方归集的期末余额前五名的应收款项情况

单位名称	与本公司关系	金额	账龄	占应收款项 总额的比例 (%)
Clearstream	第三方	427,047,283.35	1年以内	21.37
中国证券登记结算有限公司	第三方	233,261,230.64	1年以内	11.67
Marex	第三方	20,715,850.40	1年以内	1.04
华泰紫金(江苏)股权投资 投资基金(有限合伙)	联营公司	20,000,000.00	1年以内	1.00
香港中央结算有限公司	第三方	19,891,377.00	1年以内	1.00
合计		720,915,741.39		36.08

应收款项余额中无应收持有本公司 5%(含 5%)以上股份的股东之款项。

(7) 应收关联方款项情况

单位名称	与本公司关系	金额	占应收款项 总额的比例 (%)
南方基金管理有限公司	联营公司	2,911,621.14	0.15
华泰紫金(江苏)股权投资基金 (有限合伙)	联营公司	20,000,000.00	1.00
江苏工业和信息产业投资基金	联营公司	721,567.42	0.04

(有限合伙)			
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	合营公司	671,232.88	0.03
合计		23,304,421.44	1.22

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	1,579,528,947.75	1,114,297,189.97
存放金融同业	662,233,662.57	419,705,020.62
资金拆借		
融资融券	1,554,686,547.13	1,022,791,218.92
买入返售	715,206,043.78	545,045,739.13
其他	125,070,171.99	180,644,438.27
合计	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91

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	524,668,579.92	698,071,526.78
信用保证金	229,619,996.37	393,890,344.79
履约保证金		
期货保证金	6,876,028,999.55	4,917,338,127.99
合计	7,630,317,575.84	6,009,299,999.56

存出保证金的说明：

其中：外币保证金

	2016年6月30日			2015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	89,999.53	6.6312	596,804.85	70,000.00	6.4936	454,552.00
港币	9,822,905.91	0.8547	8,395,637.68	7,000,000.00	0.8378	5,864,600.00
合计			8,992,442.53			6,319,152.00

	2016年6月30日			2015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：						
港币	-	-	-	2,604,708.82	0.8378	2,182,225.05
韩元	-	-	-	-	-	-
合计			-			2,182,225.05

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	1,061,857,274.21	5,655,086.86	-	1,067,512,361.07	428,035,372.96	14,541,394.83	-	442,576,767.79
基金	503,837,236.37	171,080.04	-	504,008,316.41	247,816,263.17	9,624,834.75	-	257,441,097.92
股票	10,219,961,901.20	2,060,823,962.23	-	12,280,785,863.43	9,848,478,777.86	2,401,364,880.65	-	12,249,843,658.51
证券公司理财产品	286,993,165.18	(2,604,295.90)	-	284,388,869.28	300,413,711.56	9,195,022.79	-	309,608,734.35
银行理财产品	572,660,773.19	132,118.84	-	572,792,892.03	666,050,473.15	1,237,360.73	-	667,287,833.88
信托计划	-	-	-	-	70,000,000.00	1,423,780.82	-	71,423,780.82
其他股权投资	8,190,706,954.70	3,191,965,543.06	5,716,470.66	11,376,956,027.10	5,829,955,496.22	3,545,486,440.00	5,716,470.66	9,369,725,465.56
其他	14,798,349,892.00	(1,102,943,399.81)	-	13,695,406,492.19	14,865,013,092.00	(114,199,927.46)	-	14,750,813,164.54
合计	35,634,367,196.85	4,153,200,095.32	5,716,470.66	39,781,850,821.51	32,255,763,186.92	5,868,673,787.11	5,716,470.66	38,118,720,503.37

可供出售金融资产的说明

于 2016 年 6 月 30 日，以上可供出售金融资产包括本公司与其他若干家证券公司投资于中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）设立的专户投资，根据本公司与证金公司签订的相关合同，本公司分别于 2015 年 7 月 6 日和 2015 年 9 月 2 日出资人民币 10,000,000,000.00 元和人民币 4,439,640,000.00 元投入该专户。该专户由本公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险分享投资收益，由证金公司进行统一运作与投资管理。于 2016 年 6 月 30 日，本公司根据证金公司提供的资产报告确定期末账面价值。

(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	34,572,509,922.64	1,061,857,274.21	35,634,367,196.85
公允价值	38,714,338,460.44	1,067,512,361.07	39,781,850,821.51
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	4,147,545,008.46	5,655,086.86	4,153,200,095.32
已计提减值金额	5,716,470.66	-	5,716,470.66

(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	5,716,470.66	-	5,716,470.66
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	5,716,470.66	-	5,716,470.66

(4) 变现受限制的可供出售金融资产

	限制条件	2016年6月30日	2015年12月31日
股票	存在限售期限	1,415,308,795.84	1,427,226,869.57
证券公司理财产品	以管理人身份认购的发行的集合资产管理计划	64,922,673.71	89,818,585.92
基金	存在限售期限	3,012,000.00	3,810,000.00
股票	已融出证券	53,958,271.38	2,528,092.40
其他	自有资金投资	12,750,309,276.33	13,783,382,154.04
合计		14,287,511,017.26	15,306,765,701.93

其中：存在限售期限的股票、基金明细：

	限制条件	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
神州高铁	限售	555,422,591.04	547,267,480.34
恺英网络	限售	376,666,832.40	432,555,745.88
美年健康	限售	386,348,453.68	334,230,878.84
众信旅游	限售	96,870,918.72	113,172,764.51
基金鸿阳	限售	3,012,000.00	3,810,000.00
收益互换	自有资金投资	12,750,309,276.33	-
合计		14,168,630,072.17	1,431,036,869.57

(5) 可供出售金融资产中已融出证券情况

本集团融出证券情况及融出证券担保物信息参见附注十九、9(2)。

11、持有至到期投资

√适用 □不适用

(1) 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	5,090,540.00
其中（按类别列示）：			
企业债	5,000,000.00	5,000,000.00	5,090,540.00
其他			
持有至到期投资合计			
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	5,090,540.00

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		
一、合营企业										
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）		100,000,000.00	-	153,521.86	-	-	-	-	100,153,521.86	
小计		100,000,000.00	-	153,521.86	-	-	-	-	100,153,521.86	
二、联营企业										
南方基金管理有限公司	1,597,134,318.42	-	-	133,313,044.30	(22,018,565.70)	-	(162,000,000.00)	-	1,546,428,797.02	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	338,501,167.90	-	-	58,739,974.97	(8,842,959.21)	-	(49,000,000.00)	-	339,398,183.66	-
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	520,201,558.30			(5,626,073.12)	24,056,068.41	-	-	-	538,631,553.59	
江苏小微企业融资产品交易中心有限责任公司	16,988,526.77								16,988,526.77	
江苏工业和信息产业投资基金（有限合伙）	201,000,000.00			(912,106.62)	-	-	-	-	200,087,893.38	
其他	8,170.99	16,100,000.00	-	(34,064.00)	134,983.81				16,209,090.80	
小计	2,673,833,742.38	16,100,000.00	-	185,480,775.53	(6,670,472.69)	-	(211,000,000.00)	-	2,657,744,045.22	-
合计	2,673,833,742.38	116,100,000.00	-	185,634,297.39	(6,670,472.69)	-	(211,000,000.00)	-	2,757,897,567.08	-

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	1,508,102,497.37			1,508,102,497.37
2. 本期增加金额				
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额	62,388,094.14			62,388,094.14
(1) 处置				
(2) 其他转出	62,388,094.14			62,388,094.14
4. 期末余额	1,445,714,403.23			1,445,714,403.23
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	(202,024,105.99)			(202,024,105.99)
2. 本期增加金额	(29,548,994.30)			(29,548,994.30)
(1) 计提或摊销	(29,548,994.30)			(29,548,994.30)
3. 本期减少金额	(12,051,337.09)			(12,051,337.09)
(1) 处置				
(2) 其他转出	(12,051,337.09)			(12,051,337.09)
4. 期末余额	(219,521,763.20)			(219,521,763.20)
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	1,221,645,622.32			1,221,645,622.32
2. 期初账面价值	1,301,531,373.67			1,301,531,373.67

(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况:

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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	2,767,126.92	注 1
上海市浦东新区乳山路 229 号 1 - 3 层	50,874,030.18	注 2
天津市河西区大沽南路 387 号	4,384,856.92	注 3
哈尔滨南岗区马端头街道街 110 号 1 号楼 7-8 车库	109,212.24	注 4

哈尔滨道里区西十六道街 15 号 3 - 7 层	8,951,863.86	注 4
海口市龙昆北路 38 号华银大厦 11 层	2,368,325.17	注 5
北京西城区月坛北街 2 号 A 座 14 层 2 - 5	29,957,372.88	注 6
济南市历下区趵突泉北路 1 号 117、118	31,720,687.30	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	14,033,808.73	注 7

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: 此二处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, 于 2013 年转入投资性房地产, 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	2,572,137,129.07	150,655,431.05	610,790,771.25	78,998,653.52	3,412,581,984.89
2. 本期增加金额	816,759,842.88	2,913,796.08	36,995,506.92	5,244,110.13	861,913,256.01
(1) 购置	764,348.74	2,913,796.08	36,995,506.92	5,244,110.13	45,917,761.87
(2) 在建工程转入	753,607,400.00	-	-	-	753,607,400.00
(3) 企业合并增加		-	-	-	
- 投资性房地产转入	62,388,094.14				62,388,094.14
3. 本期减少金额	388,395.00	1,387,385.13	21,256,917.10	2,777,459.90	25,810,157.13
(1) 处置或报废	388,395.00	1,387,385.13	21,256,917.10	2,777,459.90	25,810,157.13
4. 期末余额	3,388,508,576.95	152,181,842.00	626,529,361.07	81,465,303.75	4,248,685,083.77
二、累计折旧					
1. 期初余额	260,089,223.31	106,740,916.38	365,945,109.64	61,934,955.19	794,710,204.52
2. 本期增加金额	47,701,800.21	5,388,494.48	38,833,378.44	4,571,657.94	96,495,331.07
(1) 计提	35,650,463.12	5,388,494.48	38,833,378.44	4,571,657.94	84,443,993.98
投资性房地产转入	12,051,337.09				12,051,337.09
3. 本期减少金额	165,269.10	1,256,796.62	20,356,617.66	2,390,955.26	24,169,638.64
(1) 处置或报废	165,269.10	1,256,796.62	20,356,617.66	2,390,955.26	24,169,638.64
4. 期末余额	307,625,754.42	110,872,614.24	384,421,870.42	64,115,657.87	867,035,896.95
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	3,080,882,822.53	41,309,227.76	242,107,490.65	17,349,645.88	3,381,649,186.82
2. 期初账面价值	2,312,047,905.76	43,914,514.67	244,845,661.61	17,063,698.33	2,617,871,780.37

于 2016 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(2015 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

单位：元 币种：人民币

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	6,119,650.05	注 1
江苏省南通市环城西路 18 号银都大厦 2 - 3 层	1,847,542.50	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	1,449,355.92	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	426,657.02	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	604,634.90	注 4
辽宁营口市站前区渤海大街东 16-甲 1 号	5,913,703.16	注 5
哈尔滨道里区西十六道街 15 号办公楼 1 - 2 层、8 层	4,369,733.70	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	19,607,922.77	注 7
成都市武侯区燃灯寺北街 184 号 1 栋 4 单元 4 层 7、8 号	317,364.62	注 8
广东省深圳市福田区福田中路统建商住楼丙幢 8D	179,736.64	注 9
三亚市吉阳镇迎宾路与龙坡南路交汇处同心家园八期 10 幢 B 单元 803 号房	563,169.44	注 10

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，房屋所有权于本年度归属于华泰证券股份有限公司，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。

注 10：该房屋尚在装修建设，尚未交房。

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	-	-	-	714,694,161.39	-	714,694,161.39
其他工程	115,271,280.72	-	115,271,280.72	46,451,964.14	-	46,451,964.14
合计	115,271,280.72	-	115,271,280.72	761,146,125.53	-	761,146,125.53

(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	2,825,752,400.00	714,694,161.39	38,913,238.61	(753,607,400.00)			100	100	31,767,837.89	10,649,743.32	4.75%	金融机构贷款
其他工程	-	46,451,964.14	72,711,920.74	-	(3,892,604.16)	115,271,280.72						
合计	2,825,752,400.00	761,146,125.53	111,625,159.35	(753,607,400.00)	(3,892,604.16)	115,271,280.72	/	/	31,767,837.89	10,649,743.32	/	/

(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	362,295,748.53	847,022,643.24
2. 本期增加金额		11,138.30	34,029,668.74	34,040,807.04
(1) 购置				
(2) 内部研发				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额			79,303.86	79,303.86
(1) 处置				
4. 期末余额	359,161,122.60	125,576,910.41	396,246,113.41	880,984,146.42
二、累计摊销				
1. 期初余额	(56,535,500.69)	(124,311,842.44)	(241,207,567.60)	(422,054,910.73)
2. 本期增加金额	(3,597,774.60)	(394,636.32)	(47,970,408.88)	(51,962,819.80)
(1) 计提				
3. 本期减少金额			(79,215.33)	(79,215.33)
(1) 处置				
4. 期末余额	(60,133,275.29)	(124,706,478.76)	(289,098,761.15)	(473,938,515.20)
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	299,027,847.31	870,431.65	107,147,352.26	407,045,631.22
2. 期初账面价值	302,625,621.91	1,253,929.67	121,088,180.93	424,967,732.51

(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 2016 年 6 月 30 日和 2015 年 12 月 31 日, 本公司将账面金额为人民币 295,797,221.84 元和人民币 299,334,545.85 元的土地使用权用作长期借款的抵押物(附注七、36)。

于 2016 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(2015 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

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
		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

单位: 元 币种: 人民币

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	71,020,361.71	8,671,082.70	20,478,116.61		59,213,327.80
其他	7,154,865.35	2,513,688.73	1,246,972.82		8,421,581.26
合计	78,175,227.06	11,184,771.43	21,725,089.43		67,634,909.06

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	476,604,316.76	119,151,079.21	484,201,660.13	121,050,415.03
内部交易未实现利润				
可抵扣亏损				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具公允价值变动	730,821,739.83	182,705,434.96	648,577.32	162,144.33
可供出售金融资产公允价值变动	747,746.05	186,936.51	39,204.06	9,801.02
衍生金融工具的公允价值变动			2,337,772,602.98	584,443,150.75
应付职工薪酬	4,037,390,573.60	1,009,347,643.38	3,567,210,327.51	891,802,581.88
应付利息	-	-	1,304,816,134.74	326,204,033.69
其他	230,878,821.49	57,719,705.37	151,929,816.66	37,982,454.15
合计	5,476,443,197.73	1,369,110,799.43	7,846,618,323.40	1,961,654,580.85

(2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具公允价值变动	(1,269,153,951.32)	(316,710,726.20)	(2,611,692,400.33)	(652,923,100.09)
可供出售金融资产公允价值变动	(2,462,460,741.69)	(615,615,185.40)	(4,124,303,073.19)	(1,031,075,768.30)
衍生金融工具的公允价值变动	(146,954,252.59)	(36,738,563.15)	(31,879,955.58)	(7,969,988.90)
应付利息	-	-	(1,554,970,009.09)	(388,742,502.27)
其他	(104,802,655.87)	(26,200,663.97)	(80,611,603.69)	(20,152,900.91)
合计	(3,983,371,601.47)	(995,265,138.72)	(8,403,457,041.88)	(2,100,864,260.47)

(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	(840,426,691.82)	528,684,107.61	(1,749,045,443.27)	212,609,137.58
递延所得税负债	840,426,691.82	(154,838,446.90)	1,749,045,443.27	(351,818,817.20)

(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	354,576,555.90	199,382,748.65
合计	354,576,555.90	199,382,748.65

(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	-	-	
2020 年及以后年度	354,576,555.90	199,382,748.65	
合计	354,576,555.90	199,382,748.65	/

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	513,126,658.32	452,186,089.66
抵债资产	37,907,230.30	29,912,930.75
代理兑付债券		
待摊费用	17,288,841.72	19,451,302.59
预付投资款	197,074,378.64	44,765,985.05
其他	203,307,693.79	67,417,669.68
合计	968,704,802.77	613,733,977.73

其他资产的说明：

其他资产中预付投资款为尚未完成股权交割的权益类投资款。

(1) 其他应收款

(a) 其他应收款按类别分析如下

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
其他应收款余额	880,191,133.96	820,037,793.58
减：坏账准备	(367,064,475.64)	(367,851,703.92)
其他应收款净值	513,126,658.32	452,186,089.66

(b) 其他应收款按账龄分析如下

	2016 年 6 月 30 日		坏账准备	
	账面余额		金额	计提
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)

1 年以内	466,053,215.51	52.95	10,736,317.00	2.30
1 至 2 年(含 2 年)	48,004,534.13	5.45	3,244,014.27	6.76
2 至 3 年(含 3 年)	5,558,754.26	0.63	607,398.91	10.93
3 年以上	360,574,630.06	40.97	352,476,745.46	97.75
合计	880,191,133.96	100.00	367,064,475.64	41.70

	2015 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	400,863,829.88	48.88	8,735,514.66	2.18
1 至 2 年(含 2 年)	47,447,172.97	5.79	3,276,525.65	6.91
2 至 3 年(含 3 年)	6,387,893.58	0.78	619,984.48	9.71
3 年以上	365,338,897.15	44.55	355,219,679.13	97.23
合计	820,037,793.58	100.00	367,851,703.92	44.86

账龄自其他应收款确认日起开始计算。

(c) 其他应收款按减值准备评估方式分析如下

	2016 年 6 月 30 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单独计提减值准备	365,195,752.54	41.49	352,892,328.29	96.63
组合计提减值准备	514,995,381.42	58.51	14,172,147.35	2.75
合计	880,191,133.96	100.00	367,064,475.64	41.70

	2015 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单独计提减值准备	365,200,298.43	44.53	353,683,735.78	96.85
组合计提减值准备	454,837,495.15	55.47	14,167,968.14	3.11
合计	820,037,793.58	100.00	367,851,703.92	44.86

账龄自其他应收款确认日起开始计算。

(d) 本年计提、收回或转回的坏账准备情况:

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
年初余额	367,851,703.92	378,660,272.09
本年计提	1,423,871.72	9,088,484.96
核销后收回	-	-
本年收回或转回	(2,211,100.00)	(15,404,969.07)
本年核销	-	(4,492,084.06)
年末余额	367,064,475.64	367,851,703.92

(e) 按欠款方归集的年末余额前五名的其他应收款项情况

单位名称	性质	金额	账龄	占其他应收款 总额的比例(%)
四通集团公司	占用原受托管理营业部 资金	152,216,847.74	3 年以上	17.29
海容通信集团有限 公司	资金往来	132,620,853.24	1 年以内	15.07
Niutou International (HK) Limited	资金往来	33,155,213.31	1 年以内	3.77
华诚投资管理有限 公司	占用原受托管理营业部 资金	36,128,158.38	3 年以上	4.10
天津南大科技公司	代垫款项	30,869,930.42	3 年以上	3.51
合计		384,991,003.09		43.74

(f) 截至 2016 年 6 月 30 日,其他应收款项余额中无持本公司 5%以上(含 5%)表决权股份的股东单位欠款。

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	16,011,729.27	3,400,022.47			19,411,751.74
坏账准备					
可供出售金融资产减值准备	5,716,470.66				5,716,470.66
持有至到期投资减值准备					
长期股权投资减值准备					
投资性房地产减值准备	4,547,017.71				4,547,017.71
固定资产减值准备					
在建工程减值准备					
无形资产减值准备					
商誉减值准备					

融出资金减值准备	59,779,997.62		8,157,733.14		51,622,264.48
应收款项坏账准备	1,849,597.56	279,808.21			2,129,405.77
其他应收款坏账准备	367,851,703.92	1,423,871.72	2,211,100.00		367,064,475.64
抵债资产减值准备	26,112,930.76	-			26,112,930.76
其他资产减值准备	2,332,212.63	-		2,332,212.63	-
合计	484,201,660.13	5,103,702.40	10,368,833.14	2,332,212.63	476,604,316.76

22、短期借款

√适用 □不适用

(1). 短期借款分类

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款	759,935,520.00	688,321,600.00
抵押借款		
保证借款		
信用借款		
合计	759,935,520.00	688,321,600.00

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

□适用 √不适用

23、应付短期融资款

项目	票面利率	年初账面余额	本年增加	本年减少	年末账面余额
收益凭证(注1)	1.00% - 2.00%	1,053,004,000.00	274,600,000.00	(1,152,604,000.00)	175,000,000.00
合计		1,053,004,000.00	274,600,000.00	(1,152,604,000.00)	175,000,000.00

注 1：本公司于自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间共发行 4 期期限小于一年的收益凭证，未到期收益凭证的收益率为 1.00%至 2.00%。

24、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	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00
转融通融入款项		
合计	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00

拆入资金的说明：

(2) 银行拆入资金剩余期限和利率分析

剩余期限	2016 年 6 月 30 日		利率	剩余期限	2015 年	
	余额	利率			余额	利率
5 天	1,500,000,000.00	2.88%	4 天	300,000,000.00	2.15%	

-	-	-	5 天	1,500,000,000.00	2.70%
-	-	-	6 天	1,200,000,000.00	2.70%
合计	1,500,000,000.00	合计		3,000,000,000.00	

25、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	724,682,607.30		724,682,607.30			
基金						
股票	31,846,455.84	-	31,846,455.84	113,144.53	-	113,144.53
黄金租赁	-	14,075,000,000.00	14,075,000,000.00	14,417,704,840.00	-	14,417,704,840.00
其他	-	12,216,408,452.09	12,216,408,452.09	-	7,010,474,482.96	7,010,474,482.96
合计	756,529,063.14	26,291,408,452.09	27,047,937,515.23	14,417,817,984.53	7,010,474,482.96	21,428,292,467.49

其他说明：

于 2016 年 6 月 30 日，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债主要为资产管理计划其他份额持有者或私募基金其他有限合伙人在合并结构化主体中享有的权益。

26、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		
债券	14,261,434,673.80	14,492,019,282.19
其他		
信用业务债权收益权	7,800,000,000.00	18,700,000,000.00
合计	22,061,434,673.80	33,192,019,282.19

卖出回购金融资产款的说明：

(2) 按业务类别

	附注	2016 年 6 月 30 日	2015 年
信用业务债权收益权	(i)	7,800,000,000.00	18,700,000,000.00
交易所质押式回购		7,054,392,424.50	6,861,300,000.00
银行间质押式卖出回购		6,867,049,300.00	7,119,660,754.48
银行间买断式卖出回购		301,154,438.35	511,058,527.71
其他		38,838,510.95	-

合计 22,061,434,673.80 33,192,019,282.19

(i) 截至 2016 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 9,632,231,619.15 元(2015 年: 人民币 22,279,745,326.86 元)。

(3) 担保物信息

截至 2016 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 26,918,149,799.22 元(2015 年: 38,419,277,489.51 元)。

27、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	75,238,402,778.18	85,572,463,013.75
机构	24,232,169,850.47	24,157,888,498.95
合计	99,470,572,628.65	109,730,351,512.70

28、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	40,010,000.00	80,000,000.00
债券	1,542,500.00	5,485,000.00
其中: 国债		
金融债券		
企业债券		
短期融资券	1,522,500.00	2,985,000.00
中期票据	20,000.00	1,500,000.00
定向工具	-	1,000,000.00
其他有价证券		
合计	41,552,500.00	85,485,000.00

29、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	12,877,261,214.64	18,287,470,297.96
机构	234,103,288.88	349,557,369.93
合计	13,111,364,503.52	18,637,027,667.89

30、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	2,238,667,666.53	1,182,680,236.93	2,035,218,279.55	1,386,129,623.91
二、离职后福利-设定提存	485,651.06	95,601,598.42	95,258,502.43	828,747.05

计划				
三、辞退福利				
四、一年内到期的其他福利	568,633,070.00	692,580,867.23	568,633,070.00	692,580,867.23
合计	2,807,786,387.59	1,970,862,702.58	2,699,109,851.98	2,079,539,238.19

(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	2,219,558,538.59	1,033,417,803.59	1,877,646,044.33	1,375,330,297.85
二、职工福利费	829,215.47	25,871,969.20	26,132,726.35	568,458.32
三、社会保险费	175,096.80	58,023,452.93	57,670,125.50	528,424.23
其中: 医疗保险费	165,596.02	53,898,121.32	53,572,403.85	491,313.49
工伤保险费	9,082.98	1,543,050.59	1,536,666.39	15,467.18
生育保险费	417.80	2,582,281.02	2,561,055.26	21,643.56
四、住房公积金	-	52,399,811.65	52,165,571.69	234,239.96
五、工会经费和职工教育经费	18,104,815.67	12,967,199.56	21,603,811.68	9,468,203.55
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	2,238,667,666.53	1,182,680,236.93	2,035,218,279.55	1,386,129,623.91

2016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2,555.94万元(2015年1-6月: 人民币1,389.36万元)。

(3). 设定提存计划列示

√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
1、基本养老保险	138,155.92	86,265,861.39	85,621,306.15	782,711.16
2、失业保险费	16,814.07	9,335,737.03	9,306,515.21	46,035.89
3、企业年金缴费	330,681.07	-	330,681.07	-
合计	485,651.06	95,601,598.42	95,258,502.43	828,747.05

31、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	85,557,677.37	
消费税		
营业税	232,194.27	96,484,155.90
城市维护建设税	8,488,425.97	10,487,580.22
个人所得税	647,390,308.13	370,847,463.47
企业所得税	492,089,614.48	2,193,031,160.25
教育费附加	6,144,110.21	7,186,082.59
房产税	7,556,876.51	9,669,379.53
其他	4,129,243.29	12,981,036.61
合计	1,251,588,450.23	2,700,686,858.57

32、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
开放式基金申、认购款	91,934,828.44	3,546,983,302.87
应付收益互换业务款项	1,151,087,720.67	3,408,998,027.68
应付手续费及佣金	86,959,588.96	185,990,459.03
应付实物销售款	-	140,754,521.87
应付清算款	676,001,268.73	132,136,833.02
其他	17,857,932.43	20,466,144.49
合计	2,023,841,339.23	7,435,329,288.96

33、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	8,722,596.11	18,434,554.24
短期借款		
拆入资金	360,125.00	535,416.67
其中：转融通融入资金	-	-
次级债券	398,592,237.21	1,496,716,324.11
应付债券	63,000,853.67	726,955,356.03
卖出回购	17,913,866.35	53,206,418.55
应付黄金租赁利息	41,000,724.91	253,504,911.78
应付利率互换利息	104,839,590.52	85,898,813.30
应付短期融资款利息	273,972.85	46,370,234.99
应付长期借款利息	602,879.63	680,669.50
资产证券化	21,270,763.88	-
其他	3,536,675.86	10,041,918.83
合计	660,114,285.99	2,692,344,618.00

34、应付股利

2016年6月30日

2015年

应付股利

3,594,481,040.00

13,096,640.00

35、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			
产品质量保证			
重组义务			
待执行的亏损合同			

其他			
预计罚没支出	72,941,100.00	72,941,100.00	根据中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(编号:处罚字[2015]72号)计提相应预计负债。
合计	72,941,100.00	72,941,100.00	/

36、长期借款

√适用 □不适用

(1). 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	425,125,728.32	484,985,041.19
保证借款		
信用借款		
合计	425,125,728.32	484,985,041.19

其他说明,包括利率区间:

贷款单位	借款 起始日	首期 还款日	币种	利率	2016年6月30日	2015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	4.75%	425,125,728.32	484,985,041.19

37、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
公司债 13 华泰 01(1)	4,000,000,000.00	2013/06/05	5年	4,000,000,000.00	4.68%	3,996,504,354.92	3,995,676,433.40
公司债 13 华泰 02(1)	6,000,000,000.00	2013/06/05	10年	6,000,000,000.00	5.10%	5,990,522,663.53	5,989,980,664.87
公司债 15 华泰 G1(2)	6,600,000,000.00	2015/06/29	3年	6,600,000,000.00	4.20%	6,593,198,741.72	6,591,599,370.86
次级债 14 华泰 02(3)	3,000,000,000.00	2014/04/18	2年	3,000,000,000.00	6.15%	-	2,998,177,864.42
次级债 14 华泰 04(4)	4,000,000,000.00	2014/09/26	4年	4,000,000,000.00	5.90%	4,000,000,000.00	4,000,000,000.00
次级债 15 华泰 01(5)	6,000,000,000.00	2015/01/22	2年	6,000,000,000.00	5.90%	6,000,000,000.00	6,000,000,000.00
次级债 15 华泰 02(6)	7,000,000,000.00	2015/04/20	2年	7,000,000,000.00	5.60%	-	7,000,000,000.00
次级债 15 华泰 03(6)	5,000,000,000.00	2015/04/20	5年	5,000,000,000.00	5.80%	5,000,000,000.00	5,000,000,000.00
次级债	18,000,000,000.0	2015/06/25	2年	18,000,000,000.00	5.50%	18,000,000,000.0	18,000,000,000.00

15 华泰 04(7)	0					0	
次级债 15 华泰 期(8)	600,000,000.00	2015/07/22	4 年	600,000,000.00	5.80%	632,797,808.22	615,445,479.45
境外债 HUATAI B1910(9)	美元 400,000,000.00	2014/10/08	5 年	美元 399,664,600.00	3.625%	2,637,540,436.63	2,581,297,811.17
收益凭证(10)	9,900,000,000.00		2 年	9,900,000,000.00	5.50-5.60%	-	9,600,000,000.00

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) 经中国证监会核准，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 亿元的公司债。该两笔公司债于 2013 年 7 月 17 日在上海证券交易所上市。

(2) 经中国证监会核准，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 亿元的公司债券。

(3) 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。2016 年 4 月 21 日，本公司对 14 华泰 02 次级债全部兑付。

(4) 本公司于 2014 年 9 月 26 日发行了 4 年期面值总额为人民币 40 亿元的次级债，该笔次级债附第 2 年末发行人赎回选择权。截至 2016 年 6 月 30 日，本公司计划于一年内赎回 14 华泰 04 次级债，该笔次级债将在一年内赎回。

(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 2 年期面值总额为人民币 70 亿元的次级债和 5 年期面值总额为人民币 50 亿元的次级债。2016 年 4 月 21 日，本公司对 15 华泰 02 次级债行使发行人赎回选择权，对该笔次级债全部赎回。

(7) 本公司于 2015 年 6 月 25 日发行了 2 年期面值总额为人民币 180 亿元的次级债。

(8) 华泰期货于 2015 年 7 月 22 日发行了 4 年期面值总额为人民币 6 亿元的次级债券，该笔次级债附第 1 年末发行人赎回选择权。截至 2016 年 6 月 30 日，计划于一年内赎回 15 华泰期次级债，该笔次级债将在一年内赎回。

(9) 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。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。

(10) 本公司于 2015 年共发行 11 期总计人民币 99 亿元期限大于一年的收益凭证，未到期产品的收益率为 5.50%至 5.60%。截至 2016 年 6 月 30 日与 2015 年 12 月 31 日，本公司分别对金额为人民币 96 亿元和人民币 3 亿元收益凭证全部赎回。

38、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	4,455,976,878.53	3,935,254,430.80
减：一年内支付的部分	(692,580,867.23)	(568,633,070.00)
合计	3,763,396,011.30	3,366,621,360.80

(2) 设定受益计划变动情况

适用 不适用

39、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	14,755,246.58	4,390,000.00	-	19,145,246.58	补贴购置/租赁办公用房及交易平台建设
合计	14,755,246.58	4,390,000.00	-	19,145,246.58	/

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	12,987,428.58	-			12,987,428.58	资产相关
交易平台建设	1,767,818.00	-			1,767,818.00	资产相关
金融专项补贴	-	1,670,000.00			1,670,000.00	收益相关
办公场地租赁补贴		2,720,000.00			2,720,000.00	收益相关
合计	14,755,246.58	4,390,000.00			19,145,246.58	/

40、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	1,531,726,424.80	1,559,637,188.18
代理兑付债券款	9,759,099.62	9,770,170.42
预提费用		
合并结构化主体形成的其他金融负债	88,708,485,320.43	85,761,378,502.63
应付资产证券化产品	475,000,000.00	475,000,000.00
期货风险准备金	98,513,030.07	92,131,607.19
其他	356,319,440.72	600,537,513.18
合计	91,179,803,315.64	88,498,454,981.60

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享有的权益。纳入合并范围的结构化主体信息详见附注十、6。

(b) 其他应付款

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	864,524,870.04	华泰证券河西办公楼应付工程款
应付经纪人佣金	36,000,000.00	经纪人佣金款项
应付经纪人风险金	56,933,297.58	经纪人业务风险款项
应付证券投资者保护基金款项	36,833,896.11	应付保护基金款项
合计	994,292,063.73	

(c) 本集团将资产支持专项计划发行资产支持证券收到的对价确认为其他负债，资产证券化业务的会计处理详见附注八。

(d) 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。

41、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	7,162,768,800.00						7,162,768,800.00

其他说明：

本公司于 2015 年 6 月完成向境外投资者溢价发行 1,562,768,800 股面值为每股人民币 1.00 元的境外上市外资股(H 股)，并于香港联交所上市，每股发行价格为港币 24.80 元。通过上述 H 股发行，截至 2015 年 6 月 24 日止，本公司累计募集资金总额共计港币 38,756,666,240.00 元，折合人民币 30,594,754,996.86 元，扣除股本人民币 1,562,768,800.00 元及相关发行费用人民币 441,058,152.80 元后的股本溢价金额为人民币 28,590,928,044.06 元计入资本公积。同时，根据国有股减持相关规定，人民币 156,276,880.00 元人民币普通股(A 股)股本被划转至全国社会保障基金理事会并转换为境外上市外资股(H 股)的股本。

截至 2016 年 6 月 30 日，上述股份包括无限售条件的人民币普通股(A 股)人民币 5,443,723,120.00 元和无限售条件的境外上市外资股(H 股)人民币 1,719,045,680.00 元。所有人民币普通股(A 股)及境外上市外资股(H 股)在宣派、派付或作出一切股息或发派将享有同等地位。

42、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)	45,836,029,215.49	-	-	45,836,029,215.49
其他资本公积	1,733,175.40	-	-	1,733,175.40
合计	45,837,762,390.89	-	-	45,837,762,390.89

43、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	(1,651,271,896.47)	2,056,720,326.18
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	(415,606,970.94)	397,854,484.23
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	14,536,760.97	22,356,892.97
小计	(1,250,201,686.50)	1,636,508,948.98
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	(6,670,472.69)	43,189,483.55
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	6,047,763.06	
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小计	(12,718,235.75)	43,189,483.55
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	20,189,037.88	3,217,193.59
减：处置境外经营当期转入损益的净额		
小计	20,189,037.88	3,217,193.59
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	(1,242,730,884.37)	1,682,915,626.12

44、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	2,607,376,049.13			2,607,376,049.13
任意盈余公积				
储备基金				
企业发展基金				
其他				
合计	2,607,376,049.13			2,607,376,049.13

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。

45、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	3,404,440,504.54				3,404,440,504.54
交易风险准备	3,276,683,459.46				3,276,683,459.46
合计	6,681,123,964.00				6,681,123,964.00

一般风险准备的说明

一般风险准备包括本公司及本公司下属子公司根据相关规定计提的一般风险准备和交易风险准备(参见附注五、32)。

46、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	15,232,022,703.47	10,319,188,382.86
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	15,232,022,703.47	10,319,188,382.86
加：本期归属于母公司所有者的净利润	2,841,253,347.88	6,674,821,930.46
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	3,581,384,400.00	2,800,000,000.00
转作股本的普通股股利		
期末未分配利润	14,491,891,651.35	14,194,010,313.32

47、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	5,381,540,596.73	11,096,769,889.41
证券经纪业务	4,009,416,601.30	10,094,404,273.73
其中：代理买卖证券业务	3,652,375,214.75	9,577,074,732.97
交易单元席位租赁	245,274,299.78	333,086,884.21
代销金融产品业务	111,767,086.77	184,242,656.55
期货经纪业务	113,938,371.61	135,712,416.19
投资银行业务	875,585,267.47	633,929,643.41
其中：证券承销业务	605,003,429.03	423,325,656.70
证券保荐业务	19,464,150.95	70,842,408.71
财务顾问业务	251,117,687.49	139,761,578.00
资产管理业务	173,345,244.53	133,632,893.50
基金管理业务	77,338,449.21	31,473,886.56
投资咨询业务	93,076,667.97	57,518,837.03
其他	38,839,994.64	10,097,938.99
手续费及佣金支出	(1,403,748,490.43)	(3,126,772,722.29)
证券经纪业务	(1,225,362,182.03)	(3,090,136,791.45)
其中：代理买卖证券业务	(1,225,361,749.34)	(3,090,136,791.45)
交易单元席位租赁	-	-
代销金融产品业务	(432.69)	-
期货经纪业务	(8,477,763.78)	(11,579,083.18)
投资银行业务	(41,025,516.53)	(21,180,398.33)
其中：证券承销业务	(11,433,258.91)	(20,080,398.33)
证券保荐业务	(14,132,257.62)	-
财务顾问业务	(15,460,000.00)	(1,100,000.00)
资产管理业务	(126,790,849.59)	(3,214,364.73)
基金管理业务		

投资咨询业务	(5,845.35)	(662,084.60)
其他	(2,086,333.15)	-
手续费及佣金净收入	3,977,792,106.30	7,969,997,167.12
其中：财务顾问业务净收入	235,657,687.49	138,661,578.00
— 并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	195,864,438.70	120,350,000.00
— 并购重组财务顾问业务净收入—其他	16,241,173.31	3,400,000.00
— 其他财务顾问业务净收入	23,552,075.48	14,911,578.00

(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	12,836,701,527.37	109,339,606.60	19,152,573,983.45	181,178,479.11
银行理财产品				
信托			2,183,010,000.00	1,731,048.27
其他	2,031,085,046,783.48	2,427,480.17	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17
合计	2,043,921,748,310.85	111,767,086.77	2,101,680,984,171.40	184,242,656.55

(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
期末产品数量	176	646	21
期末客户数量	954,175	232	201
其中：个人客户	947,865	78	8
机构客户	6,310	154	193
期初受托资金	107,143,693,008.55	503,044,907,682.49	13,321,288,466.50
其中：自有资金投入	2,270,394,774.88	3,071,207,867.55	5,814,310.93
个人客户	86,413,832,092.48	1,068,676,502.08	17,186,681.72
机构客户	18,459,466,141.19	498,905,023,312.86	13,298,287,473.85
期末受托资金	126,282,565,570.66	686,689,028,479.05	23,011,006,966.50
其中：自有资金投入	2,527,148,272.08	3,167,165,003.35	2,814,310.93
个人客户	92,815,032,372.90	1,108,025,519.17	17,186,681.72
机构客户	30,940,384,925.68	682,413,837,956.53	22,991,005,973.85
期末主要受托资产初始成本	126,509,386,631.46	705,182,582,209.02	23,068,179,367.60
其中：股票	6,550,539,571.48	2,402,705,175.24	8,680,536.48
基金	23,729,237,878.57	36,729,222,679.03	2,776,622.33
国债	1,366,331,694.87	1,659,163,664.91	-
其他债券	45,488,859,203.72	67,080,276,514.22	-
银行理财产品	10,000,000.00	15,663,820,000.00	-
信托计划	199,000,000.00	24,588,146,943.63	4,857,000,000.00
资产收益权	-	56,473,079,923.12	18,115,222,208.79
银行承兑汇票	-	392,286,858,956.58	-

协议或定期存款	33,259,680,237.61	7,595,443,815.42	84,500,000.00
期货	884,033,064.94	53,714,403.99	-
其他	15,021,704,980.27	100,650,150,132.88	-
当期资产管理业务净收入	612,666,622.89	120,736,996.41	18,220,044.84
结构化主体合并抵销影响数	(702,702,512.05)	(2,316,610.61)	(50,146.54)
当年资产管理业务净收入	(90,035,889.16)	118,420,385.80	18,169,898.30

48、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	4,482,460,093.30	6,452,646,444.65
存放金融同业利息收入	1,604,000,520.96	1,607,264,029.05
其中：自有资金存款利息收入	587,915,100.08	509,113,984.35
客户资金存款利息收入	1,016,085,420.88	1,098,150,044.70
融资融券利息收入	2,134,595,147.54	4,042,995,060.53
买入返售金融资产利息收入	743,513,582.74	539,698,070.41
其中：约定购回利息收入	2,270.00	17,794,385.91
股权质押回购利息收入	706,319,605.17	504,153,363.96
拆出资金利息收入		
其他	350,842.06	262,689,284.66
利息支出	2,934,618,561.82	3,683,314,753.96
客户资金存款利息支出	225,001,882.50	221,157,882.57
卖出回购金融资产利息支出	610,995,123.22	1,609,794,082.91
其中：报价回购利息支出	706,584.02	2,005.66
短期借款利息支出	13,608,017.02	-
拆入资金利息支出	25,046,107.33	116,171,306.36
其中：转融通利息支出	-	61,828,369.08
长期借款利息支出		
次级债券利息支出	1,131,550,377.45	723,324,345.87
应付债券利息支出	687,260,234.12	293,121,310.24
其他	58,133,122.14	13,872,892.16
短期融资券利息支出	13,655,534.19	552,488,106.82
黄金租赁利息支出	169,368,163.85	153,384,827.03
利息净收入	1,547,841,531.48	2,769,331,690.69

49、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	-	-
权益法核算的长期股权投资收益	185,634,297.39	197,503,943.96
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	1,337,660,539.04	2,982,236,406.53
其中：持有期间取得的收益	1,671,507,143.34	851,651,924.35
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,461,719,436.34	700,581,812.48
—持有至到期投资	111,924.33	113,671.49

—可供出售金融资产	209,675,782.67	150,956,440.38
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	(333,846,604.30)	2,130,584,482.18
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	(398,745,062.87)	5,244,097,020.98
—持有至到期投资		
—可供出售金融资产	(456,456,672.05)	241,159,781.34
—衍生金融工具	1,778,833,578.42	(3,354,672,320.14)
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	(1,257,478,447.80)	-
其他		
合计	1,523,294,836.43	3,179,740,350.49

投资收益的说明：

(1) 对联营企业或合营企业的投资收益

被投资单位	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	133,313,044.30	155,569,517.24	被投资单位净利润变化
华泰柏瑞基金管理 有限公司	58,739,974.97	45,432,903.21	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)	(5,626,073.12)	(3,498,476.49)	被投资单位净利润变化
江苏工业和信息产业投资基金 (有限合伙)	(912,106.62)		- 被投资单位净利润变化
华泰招商(江苏)资本市场投资 母基金(有限合伙)	153,521.86		- 被投资单位净利润变化
其他	(34,064.00)		- 被投资单位净利润变化
合计	185,634,297.39	197,503,943.96	

(2) 按成本法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原 因
华泰期货有限公司	-	-	-

(3) 本集团不存在投资收益汇回的重大限制。

50、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的金融资产	(377,457,004.00)	(118,787,956.38)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	(1,729,026,297.55)	246,149,771.17
衍生金融工具	2,353,527,594.51	224,110,628.67

合计	247,044,292.96	351,472,443.46
----	----------------	----------------

51、其他业务收入

	本期金额	上期金额
租赁收入	35,167,145.56	20,108,132.21
贸易销售收入	11,327,745.43	18,892,251.37
酒店经营收入	27,090,085.00	-
其他	9,652,251.85	3,321,608.99
合计	83,237,227.84	42,321,992.57

52、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	289,658,573.63	823,000,411.74	
城市维护建设税	29,514,804.59	55,688,212.32	
教育费附加	22,558,601.98	39,803,513.38	
资源税			
其他	2,011,717.83	2,939,279.62	
合计	343,743,698.03	921,431,417.06	/

53、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
安全防范费	3,901,844.31	4,158,776.03
物业管理费	18,725,609.83	20,670,878.33
员工成本	2,356,853,433.18	4,091,490,910.52
租赁费	109,871,593.18	110,675,365.41
固定资产折旧	96,495,331.07	77,494,992.43
办公及后勤事务费用	140,560,206.63	145,531,278.17
业务招待费	39,198,457.86	46,606,714.14
差旅费	44,019,714.95	37,862,466.07
无形资产摊销	51,962,819.80	37,436,962.93
证券投资者保护基金	36,320,404.18	81,328,807.03
咨询费	26,700,339.07	67,852,101.58
长期待摊费用摊销	21,725,089.43	27,076,724.57
其他	217,805,822.45	130,169,728.94
合计	3,164,140,665.94	4,878,355,706.15

54、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	(507,420.07)	(2,431,429.97)
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
融出资金减值损失	(8,157,733.14)	-
买入返售金融资产减值损失	3,400,022.47	-
合计	(5,265,130.74)	(2,361,942.69)

55、其他业务成本

	本期金额	上期金额
投资性房地产折旧	17,497,657.21	11,370,577.75
贸易销售成本	9,876,928.60	12,286,591.18
酒店经营成本	16,792,165.59	-
其他	218,370.37	12,792,984.05
合计	44,385,121.77	36,450,152.98

56、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
政府补助	18,586,862.18	3,241,023.71	18,586,862.18
非流动资产处置利得合计	969,250.24	180,777.34	969,250.24
其中：固定资产处置利得	969,250.24	180,777.34	969,250.24
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			
税收返还	38,322,512.62	26,925,036.29	38,322,512.62
其他	14,915,152.58	1,401,132.11	14,915,152.58
合计	72,793,777.62	31,747,969.45	72,793,777.62

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
扶持资金	7,078,821.00	217,280.71	
新三板挂牌奖励	-	600,000.00	
租金补贴	934,662.00	1,305,743.00	
发展基金	-	1,020,000.00	
财政补贴与资金补助	9,173,379.18	-	
可再生能源补贴	1,350,000.00	-	
其他	50,000.00	98,000.00	
合计	18,586,862.18	3,241,023.71	/

其他说明：

本集团于 2016 年上半年度取得的政府补助详情如下：

(i) 本公司上海分公司证券营业部和本公司子公司江苏股权交易中心有限责任公司以及本公司子公司华泰紫金投资有限责任公司获得的财政扶持资金。

(ii) 公司子公司紫金投资和资管子公司获得的财政补贴

(iii) 本公司盐城阜宁阜城大街证券营业部和本公司子公司华泰联合证券有限公司获得的房屋租赁补贴款。

(iv) 本公司子公司江苏股权交易中心有限责任公司获得的省级现代服务业发展专项引导资金。

(v) 母公司获得的可再生能源补贴

57、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	429,612.98	1,676,057.87	429,612.98
其中：固定资产处置损失	429,612.98	1,676,057.87	429,612.98
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			
捐赠支出	1,812,200.00	1,997,550.00	1,812,200.00
罚款、违约和赔偿损失	163,933.92	90.00	163,933.92
其他	1,144,293.52	4,577,469.36	1,144,293.52
合计	3,550,040.42	8,251,167.23	3,550,040.42

58、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		
递延所得税费用		
按税法及相关规定计算的当年所得税	1,049,183,734.76	2,095,388,166.25
汇算清缴差异调整	(11,126,822.86)	(5,554,685.36)
递延所得税的变动	(103,598,136.29)	25,467,910.07

合计	934,458,775.61	2,115,301,390.96
----	----------------	------------------

(2) 会计利润与所得税费用调整过程:

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额
利润总额	3,878,012,006.35
按法定/适用税率计算的所得税费用	969,503,001.59
子公司适用不同税率的影响	-
调整以前期间所得税的影响	(11,126,822.86)
非应税收入的影响	(53,441,921.98)
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	2,812,462.94
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-
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	38,798,451.81
其他	(12,086,395.89)
所得税费用	934,458,775.61

59、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:

	本期金额	上期金额
归属于本公司普通股股东的合并净利润	2,841,253,347.88	6,674,821,930.46
本公司发行在外普通股的加权平均数	7,162,768,800.00	5,829,705,043.09
基本每股收益(元/股)	0.3967	1.1450

普通股的加权平均数计算过程如下:

	本期金额	上期金额
年初已发行普通股股数	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00
本期新增普通股加权平均数	-	-
年末普通股的加权平均数	7,162,768,800.00	5,600,000,000.00

(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。

60、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	2,947,106,817.80	48,790,291,938.76
其他业务收入	83,237,227.84	42,321,992.57
存出保证金净流入	16,362,932.45	-
营业外收入	76,214,527.38	31,747,969.45
收到的往来款项	-	1,243,185,251.20
合计	3,122,921,505.47	50,107,547,151.98

(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	12,711,658,565.88	1,715,521,012.31
存出保证金本年净支付	-	2,153,573,052.42
支付的其他费用	594,402,165.40	795,166,388.00
支付的往来款项	5,260,100,539.55	2,778,481,665.18
合计	18,566,161,270.83	7,442,742,117.91

(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	5,204,068,185.22	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	2,180,244.28	797,672.28
合计	5,206,248,429.50	718,797,672.28

(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	644,062.73	1,552,810.00
短期融资券发行费用	-	4,095,629.78
发行港股支付的发行费用	85,281,904.04	3,000,000.00
股利分红交易所费用	-	12,969,196.94
合计	85,925,966.77	21,617,636.72

61、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	2,943,553,230.74	6,718,571,884.20
加: 资产减值准备	(5,265,130.74)	(2,361,942.69)
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	113,992,988.28	88,865,570.18
无形资产摊销	51,962,819.80	37,436,962.93

长期待摊费用摊销	21,725,089.43	27,076,724.57
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）	(539,637.26)	1,495,280.53
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）	(203,672,303.31)	(351,472,343.46)
利息支出	1,869,903,859.78	2,114,380,991.03
汇兑收益	23,437,370.86	(331,388,162.11)
财务费用（收益以“-”号填列）		
投资损失（收益以“-”号填列）	51,237,727.51	(2,590,006,513.32)
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	(316,074,970.03)	(12,879,549.27)
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	212,609,584.24	436,201,943.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的增加	36,302,899,036.40	(28,897,234,367.91)
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	(2,753,383,663.97)	(5,321,245,599.00)
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	(33,087,508,593.12)	167,308,400,968.57
其他		
经营活动产生的现金流量净额	5,224,877,408.61	139,225,841,847.80
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	130,445,860,817.39	315,626,241,297.94
减：现金的期初余额	148,567,782,701.18	99,700,700,737.87
加：现金等价物的期末余额	2,418,866,560.73	4,067,100,000.00
减：现金等价物的期初余额	1,972,501,110.00	2,889,578,174.73
现金及现金等价物净增加额	(17,675,556,433.06)	217,103,062,385.34

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

适用 不适用

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

适用 不适用

(4) 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	130,445,860,817.39	315,626,241,297.94
其中：库存现金	361,800.77	525,675.08
可随时用于支付的银行存款	117,046,898,595.50	273,687,314,291.47
可随时用于支付的其他货币资金	71,815.50	626,588,230.17
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	13,398,528,605.62	41,311,813,173.22
二、现金等价物	2,418,866,560.73	4,067,100,000.00
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	132,864,727,378.12	319,693,341,297.94
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		

62、外币货币性项目

√适用 □不适用

(1). 外币货币性项目：

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	329,670,964.67	6.6312	2,186,114,100.93
港币	1,999,819,105.44	0.8547	1,709,245,389.41
其他			3,150,154.49
应收账款			
其中：美元	60,024,738.44	6.6312	398,036,045.55
港币	140,011,838.47	0.8547	119,668,118.34
其他			39,283,921.53
长期借款			
其中：美元			
欧元			
港币			
人民币			
人民币			
结算备付金			
美元	6,151,527.40	6.6312	40,792,008.49
港元	128,629,395.20	0.8547	109,939,544.08
存出保证金			
美元			
港元			
存出保证金			
美元	89,999.53	6.6312	596,804.85
港元	9,822,905.91	0.8547	8,395,637.68
其他应收款			
美元	48,466,050.00	6.6312	321,388,070.76
港元	7,942,405.97	0.8547	6,788,374.38
短期借款			
美元	(114,600,000.00)	6.6312	(759,935,520.00)
代理买卖证券款			
美元	(64,965,993.45)	6.6312	(430,802,495.77)
港元	(706,665,338.26)	0.8547	(603,986,864.61)
其他			(1,516,717.22)
应付款项			
美元	(22,253,543.62)	6.6312	(147,567,698.45)
港元	(103,024,245.30)	0.8547	(88,054,822.46)
其他			13,293.96
应付债券			
美元	(397,747,079.96)	6.6312	(2,637,540,436.63)

其他应付款			
美元	(534,250.10)	6.6312	(3,542,719.27)
港元	(2,215,670.91)	0.8547	(1,893,733.93)

其他说明：

	年末外币余额	2015 年 12 月 31 日	
		折算汇率	年末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	351,705,970.89	6.4936	2,283,837,892.57
港币	2,387,055,593.37	0.8378	1,999,875,176.13
其他			10,861,879.81
结算备付金			
其中：美元	10,297,739.66	6.4936	66,869,402.26
港币	129,687,723.55	0.8378	108,652,374.79
应收款项			
其中：美元	13,535,415.13	6.4936	87,893,571.66
港币	148,334,758.14	0.8378	124,274,860.37
其他			5,368,202.54
存出保证金			
其中：美元	70,000.00	6.4936	454,552.00
港币	9,604,708.82	0.8378	8,046,825.05
其他应收款			
其中：美元	30,123,404.86	6.4936	195,609,341.80
港币	762,549.71	0.8378	638,864.15
短期借款			
其中：美元	(106,000,000.00)	6.4936	(688,321,600.00)
代理买卖证券款			
其中：美元	(211,737,844.55)	6.4936	(1,374,940,867.39)
港币	(764,461,861.28)	0.8378	(640,466,147.38)
其他			(3,509,891.00)
应付款项			
其中：美元	(117,198.54)	6.4936	(761,040.46)
港币	(23,403,747.89)	0.8378	(19,607,659.98)
其他			(22,596.02)
应付债券			
其中：美元	(397,514,138.72)	6.4936	(2,581,297,811.17)
其他应付款			
其中：美元	(442,056.63)	6.4936	(2,870,538.93)
港币	(2,283,441.26)	0.8378	(1,913,067.09)

(2). 境外经营实体说明, 包括对于重要的境外经营实体, 应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据, 记账本位币发生变化的还应披露原因。

适用 不适用

本公司主要境外经营实体为本公司子公司华泰金融控股(香港)有限公司, 其经营地在香港, 记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定, 本年度未发生变化。

63、套期

适用 不适用

64、融券业务情况

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
融出证券	67,999,080.76	68,137,207.12
—可供出售金融资产	53,958,271.38	2,528,092.40
—转融通融入证券	-	-
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	14,040,809.38	65,609,114.72
转融通融入证券总额		

65、拆出资金

适用 不适用

66、应收股利

适用 不适用

67、划分为持有待售的资产

适用 不适用

68、长期应收款

适用 不适用

69、开发支出

适用 不适用

70、衍生金融负债

适用 不适用

71、划分为持有待售的负债

适用 不适用

72、长期应付款

适用 不适用

73、专项应付款

适用 不适用

74、次级债券

适用 不适用

75、其他权益工具

适用 不适用

76、库存股

适用 不适用

77、专项储备

适用 不适用

78、所有权或使用权受到限制的资产

适用 不适用

79、其他综合收益

详见附注

八、资产证券化业务的会计处理

适用 不适用

1 说明资产证券化业务的主要交易安排及其会计处理、破产隔离条款

(1) 交易安排

于 2015 年 8 月，本公司以向特定融资融券客户借出资金后，本公司对该客户享有的债权及权利(以下简称“融出资金债权”或“基础资产”)转让给“华泰国君融出资金债权 1 号资产支持专项计划”(以下简称“该专项计划”)。该专项计划同时发行优先级资产支持证券和次级资产支持证券，其中优先级资产支持证券规模人民币 475,000,00.00 元，次级资产支持证券规模人民币 25,000,000.00 元，优先级资产支持证券均由第三方投资者进行认购，次级资产支持证券均由本公司进行认购。优先级资产支持证券的预期收益率为 4.9%，次级资产支持证券不设预期收益率。资产支持专项计划所募集的认购资金只能用于向本公司购买基础资产，在首批受让的基础资产产生回收款后，该专项计划对符合基础资产合格标准约定的融出资金债权进行循环投资。该专项计划的到期日为 2016 年 9 月 7 日。本公司将在到期日前对融出资金债权进行回购。

(2) 会计处理

在本公司个别财务报表中，本公司将融出资金债权转移至资产支持专项计划。由于本公司从融出资金债权获取的现金流量并未及时转移给资产支持专项计划，并且本公司有责任于未来指定日期以约定价格回购融出资金债权，本公司保留了融出资金债权所有权上几乎所有的风险和报酬，不符合终止确认条件，因此本公司未终止确认已转移的融出资金债权，并将收到的对价确认为一项金融负债。

在本集团合并财务报表中，本集团评估其在资产支持专项计划中的权力、享有的可变回报以及有能力运用权力影响其回报的金额，从而以判断本集团是否为资产支持专项计划的主要责任人。如本集团作为资产支持专项计划的主要责任人，应将该资产支持专项计划纳入合并范围。由于资产支持专项计划从融出资金债权获取的现金流量并未及时转移给资产支持证券的持有人，并且本公司有责任于未来指定日期以约定价格回购融出资金债权，因此本集团未终止确认上述金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。

截至 2016 年 6 月 30 日，本集团未予终止确认的已转移融出资金债权的账面价值为人民币 533,672,012.20 元(2015 年 12 月 31 日：511,833,436.90 元)；并将收到的对价人民币 475,000,000.00 元确认为金融负债(2015 年 12 月 31 日：475,000,000.00 元)。由于本集团为华泰国君融出资金债权 1 号资产支持专项计划的主要责任人，因此该计划已纳入本集团的合并财务报表范围，详见附注十、6。

(3) 破产隔离条款

在资产专项计划存续期间，如果本公司进入破产程序，该专项计划不得再使用专项计划回收款后续循环购买任何基础资产，且专项计划应立即指令托管人将专项计划资金归集账户的全部余额划付至专项计划托管账户，用以向资产支持专项计划持有人进行分配。

2 公司不具有控制权但实质上承担其风险的特殊目的主体情况

适用 不适用

九、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 2016 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，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/实缴资本	持股比例(%) (或类似权益比例)		取得方式
						直接	间接	
华泰资本管理（香港）有限公司	香港	香港	期货经纪	港元	33,300,000.00	-	70.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司	伊宁	伊宁	股权投资	人民币	2,000,000.00	-	51.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业 （有限合伙）	伊宁	伊宁	股权投资	人民币	2,000,000.00	-	52.00	设立
伊犁苏新投资基金合伙企业（有限合伙）	伊宁	伊宁	股权投资	人民币	1,900,000,000.00	-	24.73	设立
华泰（美国）期货有限公司	美国	美国	期货经纪	美元	3,000,000.00	-	100.00	设立
华泰（香港）期货有限公司	香港	香港	期货经纪	港元	33,300,000.00	-	100.00	设立
Huatai International Investment Holdings Limited	香港	开曼	股权投资	美元	1.00	-	100.00	设立
南京丰同投资中心（有限合伙）	南京	南京	股权投资	人民币	1,071,000,000.00	-	100.00	设立
Relian Investment Limited(瑞联投资有限 公司)	上海	英属维尔京群 岛	股权投资	美元	-	-	21.18	设立

2 纳入合并范围结构化主体而导致的合并范围变更

本集团对同时作为结构化主体的管理人或投资顾问和投资人，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)。本集团本年新增 5 个，减少了 7 个结构化主体纳入合并报表范围，详见附注十、6。

十、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	注释	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册/实缴资本	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	人民币	997,480,000.00	99.72	-	购买
华泰期货有限公司	注 1	广州	广州	期货经纪	人民币	1,009,000,000.00	60.00	-	购买
华泰紫金投资有限责任公司	注 2	南京	南京	股权投资	人民币	4,050,000,000.00	100.00	-	设立
华泰金融控股(香港)有限公司		香港	香港	证券经纪	港币	1,000,000,000.00	100.00	-	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	人民币	200,000,000.00	52.00	-	设立
华泰创新投资有限公司		北京	北京	创新投资	人民币	500,000,000.00	100.00	-	设立
华泰证券(上海)资产管理有限公司		上海	上海	资产管理	人民币	1,000,000,000.00	100.00	-	设立
华泰瑞通投资管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	50,000,000.00	-	54.00	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	人民币	30,000,000.00	-	51.00	设立
华泰瑞联基金管理有限公司	注 3	北京	北京	投资管理	人民币	101,000,000.00	-	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	港币	10,000,000.00	-	100.00	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	人民币	5,000,000.00	-	51.00	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	人民币	200,000,000.00	-	60.00	设立
华泰长城国际贸易有限公司		上海	上海	风险管理	人民币	100,000,000.00	-	60.00	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	人民币	1,000,000,000.00	-	32.00	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	人民币	30,000,000.00	-	52.00	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	人民币	1,000,000,000.00	-	31.00	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	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		深圳	深圳	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立

六号投资中心(有限合伙)				资					
深圳前海瑞联七号投资中心(有限合伙)		深圳	深圳	股权投资	人民币	3,001,000,000.00	-	50.02	设立
上海京瑞投资(有限合伙)		上海	上海	股权投资	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	股权投资	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
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
南京华泰瑞鑫股权投资管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	1,000,000.00	-	51.00	设立
南京华泰瑞泰股权投资管理中心(有限合伙)		南京	南京	投资管理	人民币	1,000,000.00	-	52.00	设立
江苏华泰瑞联基金管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	100,000,000.00	-	100.00	设立
江苏华泰瑞联并购基金(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	9,000,000,000.00	-	60.49	设立
南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)	注 4	南京	南京	股权投资	人民币	5,442,000,000.00	-	48.94	设立
南京华泰瑞联股权投资基金管理合伙企业(有限合伙)		南京	南京	投资管理	人民币	71,000,000.00	-	100.00	设立
南京瑞联一号投资中心(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	1,851,000,000.00	-	64.88	设立
南京瑞联二号投资中心(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
南京瑞联三号投资中心(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	200,000,000.00	-	100.00	设立
上海瀛翊投资中心(有限合伙)	注 4	上海	上海	股权投资	人民币	369,680,000.00	-	21.18	设立
上海瑞瀚投资中心(有限合伙)		上海	上海	股权投资	人民币	1,000,000,000.00	-	100.00	设立
Shanghai Yingyi Investment Co., Ltd. (上海瀛翊投资有		上海	英属维尔京群岛	股权投资	美元	-	-	100.00	设立

限公司)										
Tiandiren Holding Co., Ltd. (天地人控股有限公司)		上海	英属维尔京群岛	股权投资	美元	-	-	100.00	设立	
Tiandiren Groups Co., Ltd. (天地人集团有限公司)		上海	英属维尔京群岛	股权投资	美元	-	-	100.00	设立	
HTSC LIMITED		香港	香港	控股投资	港币	1.00	-	100.00	设立	
Huatai HK Investment (Cayman) Limited		开曼群岛	开曼群岛	投资管理	美元	0.01	-	100.00	设立	
Huatai HK SPC		开曼群岛	开曼群岛	基金管理	美元	1.00	-	100.00	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	美元	1.00	-	100.00	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	美元	1.00	-	100.00	设立	
Huatai Capital Finance Limited (华泰资本财务有限公司)		香港	香港	财务业务	港币	2.00	-	100.00	设立	
Huatai Capital Investment Limited (华泰资本投资有限公司)		香港	香港	自营投资	港币	2.00	-	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		香港	英属维	控股投	美元	1.00	-	100.00	设立	

Enterprises Limited			尔京群岛	资					
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
华泰资本管理(香港)有限公司		香港	香港	期货经纪	港元	33,300,000.00	-	70.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司		伊宁	伊宁	股权投资	人民币	2,000,000.00	-	51.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)		伊宁	伊宁	股权投资	人民币	2,000,000.00	-	52.00	设立
伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)	注 4	伊宁	伊宁	股权投资	人民币	1,900,000,000.00	-	24.73	设立
华泰(美国)期货有限公司		美国	美国	期货经纪	美元	3,000,000.00	-	100.00	设立
华泰(香港)期货有限公司		香港	香港	期货经纪	港元	33,300,000.00	-	100.00	设立
Huatai International Investment Holdings Limited		香港	开曼	股权投资	美元	1.00	-	100.00	设立
南京非同投资中心(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	1,071,000,000.00	-	100.00	设立
Relian Investment Limited(瑞联投资有限公司)	注 4	上海	英属维尔京群岛	股权投资	美元	-	-	21.18	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 2016 年 6 月 30 日，本公司间接持有华泰瑞联基金管理有限公司 42.33% 的股权比例。根据华泰瑞联基金管理有限公司的章程，本公司可以控制董事会的投资决策。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，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。（注 3）

截至 2016 年 6 月 30 日，本公司间接持有北京华泰瑞联并购基金中心(有限合伙)、深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)、北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)、深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)、南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)、上海瀛翊投资中心(有限合伙)及其全资子公司瑞联投资有限公司、伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)的股权比例均小于 50%。根据上述有限合伙基金的合伙协议，本公司拥有控制这些基金的权力，并且有能力运用该权力影响本公司的可变回报金额。因此，本公司管理层认为本公司对这些基金具有实际控制，故纳入合并财务报表范围。（注 4）

其他说明：

注 1：于 2016 年 5 月 13 日，本公司子公司华泰期货有限公司注册资本增加至 10.09 亿，本公司增资 1.2 亿，持股比例不变。

注 2：于 2016 年 3 月 30 日，本公司子公司华紫金投资有限责任公司进行增资，注册资本由年初的人民币 27.5 亿元增加至人民币 40.5 亿元。

(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%	39,552,323.09	-	620,706,833.92

(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
华泰期货有限公司			19,740,147,970.27			(18,199,872,703.26)			18,371,592,716.03			(17,139,409,981.75)

子公司名称	本期发生额					上期发生额				
	营业收入	净利润	其他综合收益	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	其他综合收益	综合收益总额	经营活动现金流量
华泰期货有限公司	516,861,799.55	100,009,506.79	(330,651.96)	99,678,854.83	(1,013,345,692.17)	1,391,044,049.31	85,756,978.51	3,637,181.31	89,394,159.82	7,534,017,750.76

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

3、在合营企业或联营企业中的权益

适用 不适用

2016年06月30日 2015年12月31日

联营企业		
- 重要的联营企业	2,424,458,534.27	2,455,837,044.62
- 不重要的联营企业	233,285,510.95	217,996,697.76
合营企业	100,153,521.86	
小计	2,757,897,567.08	2,673,833,742.38
减: 减值准备	-	-
合计	2,757,897,567.08	2,673,833,742.38

(1). 重要的合营企业或联营企业

单位:万元 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	注册/认缴资本	对集团活动是否具有战略性
				直接	间接			
南方基金管理有限公司	深圳	深圳	基金管理	45.00	-	权益法	30,000.00	是
华泰柏瑞基金管理有限公司	上海	上海	基金管理	49.00	-	权益法	20,000.00	是
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	200,000.00	是
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	南京	江苏	股权投资	-	10.08	权益法	1,002,000.00	是

在合营企业或联营企业的持股比例不同于表决权比例的说明:

无

持有 20%以下表决权但具有重大影响,或者持有 20%或以上表决权但不具有重大影响的依据:

无

(2). 重要合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
	华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)
流动资产		
其中: 现金和现金等价物	7,279,504.75	-
非流动资产		
资产合计	1,002,279,504.75	-
流动负债		
非流动负债		
负债合计	(744,286.17)	-
净资产	1,001,535,218.58	
少数股东权益	-	-
归属于母公司股东权益	1,001,535,218.58	-
按持股比例计算的净资产份额	100,954,750.03	-
调整事项	(801,228.17)	-

—商誉		
—内部交易未实现利润		
—其他	(801, 228. 17)	-
对合营企业权益投资的账面价值	100, 153, 521. 86	-
存在公开报价的合营企业权益投资的公允价值		
营业收入	2, 214, 278. 59	-
财务费用		
所得税费用		
净利润	1, 535, 218. 58	-
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	1, 535, 218. 58	-
本年度收到的来自合营企业的股利	-	-

(3). 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		
	南方基金管理有限公司	华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	南方基金管理有限公司	华泰柏瑞基金管理有限公司	华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)
流动资产						
其中：现金和现金等价物	652,854,317.36	321,298,875.75	15,798,743.69	532,374,349.00	45,655,913.00	8,386,311.68
非流动资产						
资产合计	5,609,052,077.56	874,827,482.48	1,105,924,136.92	5,391,750,968.92	973,664,784.00	1,047,901,472.94
流动负债						
非流动负债						
负债合计	(2,004,954,257.18)	(182,178,128.24)	(20,041,670.12)	(1,636,146,327.18)	(282,846,074.00)	(215,887.57)
净资产	3,604,097,820.38	692,649,354.24	1,085,882,466.80	3,755,604,641.74	690,818,710.00	1,047,685,585.37
少数股东权益	167,589,382.55	-	-	206,417,267.48	-	-
归属于母公司股东权益	3,436,508,437.83	692,649,354.24	1,085,882,466.80	3,549,187,374.26	690,818,710.00	1,047,685,585.37
按持股比例计算的净资产份额	1,546,428,797.02	339,398,183.66	523,938,290.23	1,597,134,318.42	338,501,167.90	505,508,294.94
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						
对联营企业权益投资的账面价值	1,546,428,797.02	339,398,183.66	538,631,553.59	1,597,134,318.42	338,501,167.90	520,201,558.30
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值						
营业收入	1,397,199,712.00	392,155,205.13	8,538,443.47	1,440,799,650.74	285,169,487.09	13,167,897.01
净利润	309,690,042.62	119,877,499.99	(11,660,255.18)	394,665,348.48	92,720,210.64	(7,250,728.50)
终止经营的净利润						
其他综合收益						
综合收益总额	(46,249,656.86)	(18,046,855.56)	49,857,136.61	79,400,404.04	17,898,982.83	-
本年度收到的来自联营企业的股利	-	49,000,000.00	-	-	-	-

(4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

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
联营企业：		
投资账面价值合计	233,285,510.95	217,996,697.76
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	(946,170.62)	-
--其他综合收益	134,983.81	-
--综合收益总额	(811,186.81)	-

4、重要的共同经营

适用 不适用

5、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。除已于附注十、6 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 2016 年 6 月 30 日，上述由本集团管理的未合并结构化主体的资产总额为人民币 767,771,735,310.39 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 551,860,637,400.12 元)。

于 2016 年 6 月 30 日，本集团在上述结构化主体中获得的收益包括管理费收入及业绩报酬共计人民币 173,345,244.53 元(2015 年 6 月 30 日：人民币 133,632,893.50 元)。

6、其他

(1) 本集团在合并的结构化主体中的权益

本集团合并的结构化主体主要是指本集团同时作为管理人或投资顾问及投资者的资产管理计划。本集团综合评估本集团因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人或投资顾问的报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

于 2016 年 6 月 30 日，本集团共合并 34 个结构化主体(2015 年 12 月 31 日：36 个结构化主体)，合并结构化主体的总资产为人民币 96,437,277,313.54 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 93,767,003,692.87 元)。本集团持在上述合并结构化主体中的权益总金额为人民币 7,248,494,899.47 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 5,816,381,079.23 元)。

(2) 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财务报表范围，主要包括信托计划、基金、银行理财产品与其他理财产品。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。

于 2016 年 6 月 30 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：

	2016 年 6 月 30 日	
以公允价值计量且其变动计入当期	可供出售金融资产	合计

<u>损益的金融资产</u>			
基金	20,075,129,067.33	504,008,316.41	20,579,137,383.74
理财产品	4,398,911,474.17	14,263,151,389.02	18,662,062,863.19
合计	24,474,040,541.50	14,767,159,705.43	39,241,200,246.93

<u>2015 年 12 月 31 日</u>			
	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	合计
基金	49,917,226,971.66	257,441,097.92	50,174,668,069.58
理财产品	15,090,005,210.53	15,799,133,513.59	30,889,138,724.12
合计	65,007,232,182.19	16,056,574,611.51	81,063,806,793.70

十一、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》等有关规定并结合业务和管理实际情况，本集团制定了《风险管理基本制度(修订稿)》并经董事会审议通过，明确了风险管理目标、原则、公司总体及各风险类型的风险偏好及容忍度、风险管理流程、相关资源保障及考核机制。经营管理层方面，制定并发布了信用风险、市场风险、操作风险和流动性风险管理指引，明确了各类风险的管理流程及措施、风险指标及限额；此外，经营层面还制定了《风险控制指标管理办法》、《风险报告制度》、《压力测试实施方案及实施细则》等政策。具体业务层面，集团根据各业务和管理条线自身的风险点，建立了业务风险管理制度或风险管理手册。

本集团在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动风险、市场风险、操作风险和合规风险等。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，集团通过培训和考核的方式，促进全体员工不断增强风险管理意识和风险敏感度以培养良好的风险管理文化。

(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。公司指定风险管理部履行全面风险管理职责，在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，并牵头管理市场风险、信用风险和操作风险。公司相关职能部门根据职责定位分别负责牵头管理其他类型风险；公司各业务部门及其他职能部门、分支机构具体负责各自条线的风险管理工作，落实公司及各类风险牵头管理部门制定的各项政策、流程和措施，接受各类风险牵头管理部门的指导以及风险牵

头管理部门对各类风险管理、执行责任的分解。稽查部负责对公司风险管理流程的有效性 & 执行情况稽核检查,并牵头对公司全面风险管理体系进行评估。公司各部门分工协作,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金及息费遭受损失的风险;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,进一步推进发行人信用评级系统建设,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、股票质押式回购、约定购回业务方面,本集团设定实施两融业务关键风控措施的市场策略性调节方案,提升业务风控措施针对市场及业务变化情况的有效性 & 灵活性;推进优化两融业务长期停牌股票估值风控方案,更准确地分析客户账户信用风险;开发风险分析和压力测试系统,实现对重点业务资产质量及风险承压能力的实时监测及潜在大额违约风险客户的及时筛查和预警,避免客户违约给集团造成损失。

信用类创新业务方面,在严格的风控方案设计、实施前提下,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,经集团评审通过后,项目才可实施。针对集团涉及信用风险的业务,统一收集、处理客户产生的不良信用行为,将之与客户业务准入及授信额度相关联,完成集团层面客户不良信用行为统一管理方案。

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;加强对融出资金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:

	<u>2016 年 6 月 30 日</u>	<u>2015 年 12 月 31 日</u>
货币资金	152,393,688,832.86	135,133,727,387.54
结算备付金	13,398,528,605.62	36,068,780,816.99
融出资金	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	63,931,321,398.03	56,011,551,587.35
衍生金融资产	934,651,457.91	334,749,747.33
买入返售金融资产	27,743,600,233.36	25,634,527,505.12

应收款项	1,996,256,127.81	621,553,847.35
应收利息	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91
存出保证金	7,630,317,575.84	6,009,299,999.56
可供出售金融资产	1,121,470,632.45	445,104,860.19
持有至到期投资	5,000,000.00	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	513,126,658.32	452,186,089.66
合计	<u>325,760,354,005.83</u>	<u>331,431,083,620.86</u>

(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、政策性金融债及私募债。

(i) 按短期信用评级列示的债券投资

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
A-1	4,469,164,372.83	4,309,946,221.07
未评级	1,649,261,150.00	1,441,031,730.00
合计	6,118,425,522.83	5,750,977,951.07

(ii) 按长期信用评级列示的债券投资

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
AAA	9,644,629,199.81	5,694,204,055.86
A至AA+	26,491,475,882.73	23,828,561,733.44
未评级	22,735,262,344.35	21,119,775,500.05
合计	58,871,367,426.89	50,642,541,289.35

(2) 流动性风险管理

流动性风险，是指企业无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。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。报告期内公司密切关注市场变化，重点评估自营持仓变现能力，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，并确保投资组合的流动性。公司资金管理方面，加强了逐日流动性缺口的测算以及优质流动资产的主动配置和管理，合理规划优质流动资产的规模和结构。在负债管理方面，加强资产负债管理能力，提高资金组织工作力度，合理规划债务的融资规模、融资期限，不断优化公司的资产负债结构。公司重视流动性监测系统建设，持续完善流动性管理平台，提高流动性风险管理的效率和效果。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：

华泰证券股份有限公司 2016 年半年度报告

	2016年6月30日							合计	资产负债表 账面价值
	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		
短期借款	-	-	4,827,961.79	764,763,481.79	-	-	-	769,591,443.58	759,935,520.00
应付短期融资款	-	50,243,835.62	125,554,109.59	-	-	-	-	175,797,945.21	175,000,000.00
拆入资金	-	1,500,840,291.67	-	-	-	-	-	1,500,840,291.67	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	76,864,224.17	-	217,538,400.00	6,747,085.90	15,312,178,283.59	12,139,544,227.92	31,846,455.84	27,784,718,677.42	27,047,937,515.23
衍生金融负债	-	15,626,670.91	119,940,429.76	346,551,404.02	216,666,668.54	-	-	698,785,173.23	698,785,173.23
卖出回购金融资产款	-	14,266,590,482.43	2,183,180,555.55	5,747,266,666.67	838,600,000.00	-	-	23,035,637,704.65	22,061,434,673.80
代理买卖证券款	99,470,572,628.65	-	-	-	-	-	-	99,470,572,628.65	99,470,572,628.65
代理承销证券款	41,552,500.00	-	-	-	-	-	-	41,552,500.00	41,552,500.00
信用交易代理买卖证 券款	13,111,364,503.52	-	-	-	-	-	-	13,111,364,503.52	13,111,364,503.52
应付款项	1,931,906,510.79	91,934,828.44	-	-	-	-	-	2,023,841,339.23	2,023,841,339.23
长期借款	-	-	64,818,236.87	69,212,776.34	325,036,091.66	-	-	459,067,104.87	425,125,728.32
应付债券	-	634,800,000.00	4,413,000,000.00	26,500,552,400.00	21,099,337,200.00	6,612,000,000.00	-	59,259,689,600.00	52,850,564,005.02
其他负债(金融负债)	89,694,546,726.03	81,537,241.29	500,214,583.33	928,719,348.32	-	-	-	91,205,017,898.97	91,179,803,315.64
合计	204,326,807,093.16	16,641,373,350.36	7,629,074,276.89	34,363,813,163.04	37,791,818,243.79	18,751,544,227.92	31,846,455.84	319,536,476,811.00	311,345,916,902.64

华泰证券股份有限公司 2016 年半年度报告

	2015年12月31日							合计	资产负债表 账面价值
	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		
短期借款	-	-	-	704,008,056.40	-	-	-	704,008,056.40	688,321,600.00
应付短期融资款	-	-	585,158,232.00	529,750,000.00	-	-	-	1,114,908,232.00	1,053,004,000.00
拆入资金	-	3,001,489,166.67	-	-	-	-	-	3,001,489,166.67	3,000,000,000.00
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	62,020,094.97	45,004,106.53	11,216,010,904.04	3,693,402,016.82	-	6,948,454,387.99	113,144.53	21,965,004,654.88	21,428,292,467.49
衍生金融负债	-	132,190,086.38	1,193,010,981.81	868,367,028.42	266,777,023.45	-	-	2,460,345,120.06	2,460,345,120.06
卖出回购金融资产款	-	15,905,050,397.91	263,437,500.00	7,151,392,777.78	10,893,122,884.35	-	-	34,213,003,560.04	33,192,019,282.19
代理买卖证券款	109,730,351,512.70	-	-	-	-	-	-	109,730,351,512.70	109,730,351,512.70
代理承销证券款	85,485,000.00	-	-	-	-	-	-	85,485,000.00	85,485,000.00
信用交易代理买卖证券款	18,637,027,667.89	-	-	-	-	-	-	18,637,027,667.89	18,637,027,667.89
应付款项	7,435,329,288.96	-	-	-	-	-	-	7,435,329,288.96	7,435,329,288.96
长期借款	-	1,956,549.24	75,196,051.72	76,725,063.97	380,269,759.46	-	-	534,147,424.39	484,985,041.19
应付债券	-	354,000,000.00	-	6,344,649,910.08	74,477,980,736.97	6,612,000,000.00	-	87,788,630,647.05	72,372,177,624.17
其他负债(金融负债)	86,930,808,859.13	138,599,937.27	-	1,452,321,185.20	-	-	-	88,521,729,981.60	88,498,454,981.60
合计	222,881,022,423.65	19,578,290,244.00	13,332,813,669.57	20,820,616,038.67	86,018,150,404.23	13,560,454,387.99	113,144.53	376,191,460,312.64	359,065,793,586.25

(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、子公司所购买外币金融资产及子公司所发行外币债券，该部分外币金融资产及负债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七、62。

敏感性分析

假定除汇率以外的其他风险变量不变，于 6 月 30 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。

	<u>股东权益</u>	<u>净利润</u>
2016 年 6 月 30 日		
美元	9,813,908.76	15,683,183.88
港币	(5,497,594.57)	(5,497,594.57)
	<hr/>	<hr/>
合计	4,316,314.19	10,185,589.31
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
	<u>股东权益</u>	<u>净利润</u>
2015 年 12 月 31 日		
美元	3,850,048.15	9,597,533.51
港币	(7,065,066.92)	(7,065,066.92)
	<hr/>	<hr/>
合计	(3,215,018.77)	2,532,466.59
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

于 6 月 30 日，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净利润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、短期借款、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金及债券投资等，付息负债主要为短期借款、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，按合同重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

	2016年6月30日						
	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	合计
金融资产							
货币资金	110,803,207,004.69	15,937,823,993.03	25,252,657,835.14	400,000,000.00	-	361,800.77	152,394,050,633.63
结算备付金	13,398,528,605.62	-	-	-	-	-	13,398,528,605.62
融出资金	2,333,499,867.76	4,223,742,657.93	43,499,410,480.84	1,399,014,103.88	-	-	51,455,667,110.41
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	22,450,622,152.70	12,853,078,975.25	17,186,789,022.31	25,193,134,775.95	8,446,350,353.13	7,072,818,846.20	93,202,794,125.54
衍生金融资产	1,493,744.52	18,167,104.77	-	-	-	914,990,608.62	934,651,457.91
买入返售金融资产	4,019,138,575.42	3,541,298,882.57	17,271,520,218.21	2,911,642,557.16	-	-	27,743,600,233.36
应收款项	-	-	-	-	-	1,996,256,127.81	1,996,256,127.81
存出保证金	774,921,623.27	-	-	-	-	6,855,395,952.57	7,630,317,575.84
可供出售金融资产	1,241,089,295.37	41,511,214.56	911,711,599.07	72,660,000.00	-	37,514,878,712.51	39,781,850,821.51
持有至到期投资	-	-	-	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	-	513,126,658.32	513,126,658.32
金融资产合计	155,022,500,869.35	36,615,622,828.11	104,122,089,155.57	29,981,451,436.99	8,446,350,353.13	54,867,828,706.80	389,055,843,349.95

	2016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							
短期借款	-	-	(759,935,520.00)	-	-	-	(759,935,520.00)
应付短期融资款	(50,000,000.00)	(125,000,000.00)	-	-	-	-	(175,000,000.00)
拆入资金	(1,500,000,000.00)	-	-	-	-	-	(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	-	(217,538,400.00)	-	-	-	(26,830,399,115.23)	(27,047,937,515.23)
衍生金融负债	(5,131,761.16)	(61,963,762.60)	-	-	-	(631,689,649.47)	(698,785,173.23)
卖出回购金融资产款	(14,261,434,673.80)	(2,000,000,000.00)	(5,100,000,000.00)	(700,000,000.00)	-	-	(22,061,434,673.80)
代理买卖证券款	(99,470,572,628.65)	-	-	-	-	-	(99,470,572,628.65)
代理承销证券款	(41,552,500.00)	-	-	-	-	-	(41,552,500.00)
信用交易代理买卖证券款	(13,111,364,503.52)	-	-	-	-	-	(13,111,364,503.52)
应付款项	(1,931,906,510.79)	(91,934,828.44)	-	-	-	-	(2,023,841,339.23)
长期借款	-	(60,724,217.87)	(60,724,217.87)	(303,677,292.58)	-	-	(425,125,728.32)
应付债券	(632,797,808.22)	(4,000,000,000.00)	(24,000,000,000.00)	(18,227,243,533.27)	(5,990,522,663.53)	-	(52,850,564,005.02)
其他负债(金融负债)	-	(475,000,000.00)	-	-	-	(90,704,803,315.64)	(91,179,803,315.64)
金融负债合计	(131,004,760,386.14)	(7,032,161,208.91)	(29,920,659,737.87)	(19,230,920,825.85)	(5,990,522,663.53)	(118,166,892,080.34)	(311,345,916,902.64)
利率敏感度敞口合计	24,017,740,483.21	29,583,461,619.20	74,201,429,417.70	10,750,530,611.14	2,455,827,689.60	(63,299,063,373.54)	77,709,926,447.31

	2015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	112,555,564,252.71	5,417,485,013.85	17,160,678,120.98	-	-	334,352.63	135,134,061,740.17
结算备付金	36,068,780,816.99	-	-	-	-	-	36,068,780,816.99
融出资金	2,099,877,869.89	4,642,392,979.06	59,318,038,988.82	1,371,808,335.09	-	-	67,432,118,172.86
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产	62,971,063,768.19	4,767,097,712.16	14,371,504,129.08	23,268,937,015.52	10,415,364,600.14	15,444,141,488.28	131,238,108,713.37
衍生金融资产	1,831,410.34	25,682,273.98	555,047.08	-	-	306,681,015.93	334,749,747.33
买入返售金融资产	3,989,197,726.69	3,147,468,725.27	14,654,493,007.58	3,843,368,045.58	-	-	25,634,527,505.12
应收款项	-	-	-	-	-	621,553,847.35	621,553,847.35
存出保证金	2,148,188,696.76	-	-	-	-	3,861,111,302.80	6,009,299,999.56
可供出售金融资产	814,696,218.42	5,611,723.25	270,055,562.68	236,055,649.39	-	36,792,301,349.63	38,118,720,503.37
持有至到期投资	-	-	-	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	-	452,186,089.66	452,186,089.66
金融资产合计	220,649,200,759.99	18,005,738,427.57	105,775,324,856.22	28,725,169,045.58	10,415,364,600.14	57,478,309,446.28	441,049,107,135.78

	2015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							
短期借款	-	-	(688,321,600.00)	-	-	-	(688,321,600.00)
应付短期融资款	-	(553,004,000.00)	(500,000,000.00)	-	-	-	(1,053,004,000.00)
拆入资金	(3,000,000,000.00)	-	-	-	-	-	(3,000,000,000.00)
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	(43,234,840.00)	(10,808,710,000.00)	(3,565,760,000.00)	-	-	(7,010,587,627.49)	(21,428,292,467.49)
衍生金融负债	(6,282,896.76)	(78,959,098.32)	-	-	-	(2,375,103,124.98)	(2,460,345,120.06)
卖出回购金融资产款	(15,892,019,282.19)	-	(6,500,000,000.00)	(10,800,000,000.00)	-	-	(33,192,019,282.19)
代理买卖证券款	(109,730,351,512.70)	-	-	-	-	-	(109,730,351,512.70)
代理承销证券款	-	-	-	-	-	(85,485,000.00)	(85,485,000.00)
信用交易代理买卖证券款	(18,637,027,667.89)	-	-	-	-	-	(18,637,027,667.89)
应付款项	-	-	-	-	-	(7,435,329,288.96)	(7,435,329,288.96)
长期借款	-	(62,500,000.00)	(62,500,000.00)	(359,985,041.19)	-	-	(484,985,041.19)
应付债券	-	-	(2,998,177,864.42)	(63,384,019,094.88)	(5,989,980,664.87)	-	(72,372,177,624.17)
其他负债(金融负债)	-	-	(475,000,000.00)	-	-	(88,023,454,981.60)	(88,498,454,981.60)
金融负债合计	<u>(147,308,916,199.54)</u>	<u>(11,503,173,098.32)</u>	<u>(14,789,759,464.42)</u>	<u>(74,544,004,136.07)</u>	<u>(5,989,980,664.87)</u>	<u>(104,929,960,023.03)</u>	<u>(359,065,793,586.25)</u>
利率敏感度敞口合计	<u>73,340,284,560.45</u>	<u>6,502,565,329.25</u>	<u>90,985,565,391.80</u>	<u>(45,818,835,090.49)</u>	<u>4,425,383,935.27</u>	<u>(47,451,650,576.75)</u>	<u>81,983,313,549.53</u>

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：

	2016年6月30日		2015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	(972, 164, 777. 81)	(970, 881, 328. 06)	(744, 111, 984. 76)	(741, 508, 693. 06)
收益率曲线向下 平移 100 个基点	1, 021, 042, 484. 52	1, 019, 728, 737. 89	814, 934, 090. 32	812, 226, 605. 79

(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：

	2016年6月30日		2015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	2, 909, 725, 708. 10	4%	1, 526, 534, 959. 84	1%
- 基金	20, 075, 129, 067. 33	25%	49, 917, 226, 971. 66	61%
- 债券	63, 917, 280, 588. 65	80%	55, 945, 942, 472. 63	69%
- 其他	3, 664, 244, 808. 72	5%	13, 890, 005, 211. 73	17%
可供出售金融资产				
- 股票	12, 280, 785, 863. 43	15%	12, 249, 843, 658. 51	15%
- 基金	504, 008, 316. 41	1%	257, 441, 097. 92	1%
- 债券	1, 067, 512, 361. 07	1%	442, 576, 767. 79	1%
- 证券公司理财产品	289, 436, 864. 48	1%	309, 608, 734. 35	1%
- 银行理财产品	567, 744, 896. 83	1%	667, 287, 833. 88	1%
- 信托计划	-	1%	71, 423, 780. 82	1%
- 其他股权投资	11, 376, 956, 027. 10	14%	9, 369, 725, 465. 56	11%
- 其他	13, 695, 406, 492. 19	17%	14, 750, 813, 164. 54	18%
小计	130, 348, 230, 994. 31	163%	159, 398, 430, 119. 23	197%
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债				
交易性金融负债	(756, 529, 063. 14)	(1%)	(113, 144. 53)	0%
指定为以公允价值计量且其变 动计入当期损益的金融负债	(12, 216, 408, 452. 09)	(15%)	(7, 010, 474, 482. 96)	(9%)
小计	(12, 972, 937, 515. 23)	(16%)	(7, 010, 587, 627. 49)	(9%)
<u>合计</u>	<u>117, 375, 293, 479. 08</u>	<u>147%</u>	<u>152, 387, 842, 491. 74</u>	<u>187%</u>

截至2016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6%(2015年：7%)；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6%(2015年：7%)。

(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。

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。报告期内，公司持续推动流程梳理优化工作的落实及分级授权体系的完善，在风险可控的前提下提高流程效率；同时，公司对操作风险三大管理工具进行了持续优化：一是拓展内外部损失数据收集范围及渠道，加大对损失影响及频率分布的分析；二是完善风险及控制自我评估方法论及不定期触发机制；三是着手建立关键风险指标的分层分级机制；四是分析建立三大管理工具间的联动机制并着手开展对操作风险管理系统的二期开发工作。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。

(5) 金融资产转移

在日常业务中，本集团通过卖出回购协议将已确认的金融资产转让给对手方。本集团尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团与客户订立卖出回购协议，借出分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产的证券、融出资金债权收益权及买入返售金融资产。卖出回购协议是指如下交易，将证券、融出资金债权收益权及买入返售金融资产出售并同时达成回购协议，在未来某时间以约定价格购回。即使回购价格是约定的，本集团仍面临着显著的信用风险、市场风险和出售这些证券、融出资金债权收益权及买入返售金融资产获取回报的风险。本集团尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团与客户订立融出证券协议，借出分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产的股票及交易所交易基金。根据融出证券协议规定，股票及交易所交易基金的法定所有权转让给客户。尽管客户可于协议期间出售相关证券，但有责任于未来指定日期向本集团归还该等证券。由于本集团尚保留该部分已转让证券的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团将融出资金债权转让给资产支持专项计划，再由资产支持专项计划以融出资金债权为基础资产向投资者发行资产支持证券。本集团将该资产支持专项计划纳入合并范围内，故融出资金债权自本集团转移至资产支持证券持有人，本集团承担了将从融出资金债权获取的现金流量转移至持有人的义务。

由于资产支持专项计划从融出资金债权获取的现金流量并未及时转移给持有人，并且本集团有责任于未来指定日期以约定价格回购融出资金债权，因此本集团未终止确认上述金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。其他与上述金融资产转移相关信息详见附注八。

于6月30日，本集团已转移但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

2016年6月30日	以公允价值计量且						合计
	其变动计入当期损益的金融资产		可供出售金融资产	融出资金		买入返售金融资产	
	卖出回购协议	融出证券	融出证券	债权收益权回购	资产证券化	股票质押式回购	
转让资产的账面金额	301,236,964.88	14,040,809.38	53,958,271.38	9,632,231,619.15	533,672,012.20	-	10,535,139,676.99
相关负债的账面金额	(301,154,438.35)	-	-	(7,800,000,000.00)	(475,000,000.00)	-	(8,576,154,438.35)
净头寸	82,526.53	14,040,809.38	53,958,271.38	1,832,231,619.15	58,672,012.20	-	1,958,985,238.64
2015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		可供出售金融资产	融出资金		买入返售金融资产	合计
	卖出回购协议	融出证券	融出证券	债权收益权回购	资产证券化	股票质押式回购	
转让资产的账面金额	507,719,660.00	65,609,114.72	2,528,092.40	20,853,545,326.86	511,833,436.92	1,426,200,000.00	23,367,435,630.90
相关负债的账面金额	(511,058,527.71)	-	-	(17,700,000,000.00)	(475,000,000.00)	(1,000,000,000.00)	(19,686,058,527.71)
净头寸	(3,338,867.71)	65,609,114.72	2,528,092.40	3,153,545,326.86	36,833,436.92	426,200,000.00	3,681,377,103.19

(6) 金融资产和金融负债的抵销

当本集团具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额列示。

本集团已就衍生金融工具应用了可执行的总抵销协议进行了抵销列示。

根据本集团与客户签订的权益类收益互换协议，与同一客户间的应收及应付款项于同一结算日以净额结算。

在本集团与香港中央结算有限公司进行持续净额结算的情况下，与该公司间同一结算日内应收及应付款项以净额结算。

2016年6月30日

金融资产	已确认	于合并资产负债表	于合并资产负债表	未于合并资产负债表抵销的金额		净额
	金融资产总额	抵销所确认金融负债总额	列示的金融资产净额	金融工具	收到的现金抵押	
衍生金融资产	936,967,182.44	(2,315,724.53)	934,651,457.91	-	-	934,651,457.91
应收款项	436,157,114.39	(77,008,972.18)	359,148,142.21	-	-	359,148,142.21
合计	1,373,124,296.83	(79,324,696.71)	1,293,799,600.12	-	-	1,293,799,600.12

金融负债	已确认	于合并资产负债表	于合并资产负债表	未于合并资产负债表抵销的金额		净额
	金融负债总额	抵销所确认金融资产总额	列示的金融负债净额	金融工具	收到的现金抵押	
衍生金融负债	(749,309,621.45)	50,524,448.22	(698,785,173.23)	-	-	(698,785,173.23)
应付款项	(1,442,538,279.76)	291,450,559.09	(1,151,087,720.67)	-	-	(1,151,087,720.67)
合计	(2,191,847,901.21)	341,975,007.31	(1,849,872,893.90)	-	-	(1,849,872,893.90)

2015年12月31日

金融资产	已确认	于合并资产负债表	于合并资产负债表	未于合并资产负债表抵销的金额		净额
	金融资产总额	抵销所确认金融负债总额	列示的金融资产净额	金融工具	收到的现金抵押	
衍生金融资产	334,749,747.33	-	334,749,747.33	-	-	334,749,747.33
应收款项	78,130,161.00	(18,177,066.77)	59,953,094.23	-	-	59,953,094.23
合计	412,879,908.33	(18,177,066.77)	394,702,841.56	-	-	394,702,841.56

金融负债	已确认	于合并资产负债表	于合并资产负债表	未于合并资产负债表抵销的金额		净额
	金融负债总额	抵销所确认金融资产总额	列示的金融负债净额	金融工具	收到的现金抵押	
衍生金融负债	(2,552,025,807.93)	91,680,687.87	(2,460,345,120.06)	-	-	(2,460,345,120.06)
应付款项	(3,974,488,068.35)	565,490,040.67	(3,408,998,027.68)	-	-	(3,408,998,027.68)
合计	(6,526,513,876.28)	657,170,728.54	(5,869,343,147.74)	-	-	(5,869,343,147.74)

十二、公允价值的披露

√适用 □不适用

下表列示了本集团在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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	51,133,205,654.53	40,621,961,914.02	1,447,626,556.99	93,202,794,125.54
1. 交易性金融资产	51,133,205,654.53	39,405,295,248.57	1,447,626,556.99	91,986,127,460.09
(1) 债务工具投资	25,334,276,794.03	38,329,037,237.63	253,966,556.99	63,917,280,588.65
(2) 权益工具投资	23,979,437,131.78	688,164,930.94	1,193,660,000.00	25,861,262,062.72
(3) 衍生金融资产				
(4) 其他债务工具投资	1,819,491,728.72	388,093,080.00	-	2,207,584,808.72
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	-	1,216,666,665.45	-	1,216,666,665.45
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资	-	1,216,666,665.45	-	1,216,666,665.45
(二) 可供出售金融资产	11,881,430,311.31	16,289,950,101.03	11,534,547,336.97	39,705,927,749.31

(1) 债务工具投资	197,171,580.00	636,826,399.00	233,514,382.07	1,067,512,361.07
(2) 权益工具投资	11,684,258,731.31	15,653,123,702.03	11,301,032,954.90	38,638,415,388.24
(3) 其他				
(三) 衍生金融资产	6,386,687.52	857,545,058.20	70,719,712.19	934,651,457.91
持续以公允价值计量的资产总额	63,021,022,653.36	57,769,457,073.25	13,052,893,606.15	133,843,373,332.76
(五) 交易性金融负债	(756,529,063.14)	-	-	(756,529,063.14)
其中：发行的交易性债券				
衍生金融负债				
其他				
(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	-	(21,100,318,612.16)	(5,191,089,839.83)	(26,291,408,452.09)
衍生金融负债	(29,928,912.22)	(664,890,224.91)	(3,966,036.10)	(698,785,173.23)
持续以公允价值计量的负债总额	(786,457,975.36)	(21,765,208,837.07)	(5,195,055,876.03)	(27,746,722,688.46)
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。此市场报价取自活跃市场中与交易价，经销商及交易对手以及公平切磋商为基础的市场交易。

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

对于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。

对于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。

衍生金融资产和负债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率来确定的。股指期货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。

2016年1-6月，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：

	2016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
理财产品及 私募配售债 券	1,287,686,767.10	贴现现金流量模型	经风险调整的贴现率	经风险调整的 贴现率越高， 公允价值越低
私募可转换 债券	393,454,171.96	期权定价模型	股价波动率	股价波动越大， 公允价值越高
未上市股权 投资	11,301,032,954.90	市场可比公司法	缺乏市场流通性贴现率	贴现率越高， 公允价值越低
私募基金其 他合伙人于 合并结构化 主体享有的 权益	(5,191,089,839.93)	投资标的市场可比 公司法	缺乏市场流通性贴现率	贴现率越高 公允价值越低
场外期权	66,753,676.09	布莱克-斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格 标的资产的价格波动率	不适用 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非上市股权投资和理财产品等。

2016年1-6月，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

	2015年12月 31日余额	转入第三层次	转出第三层次	本年利得或损失总额		购买、发行、出售和结算				2016年6月 30日余额	对于年末持有的 资产和承担的 负债，计入损 益的当年未实 现利得或损失
				计入损益(i)	计入其他 综合收益(i)	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	1,444,571,300.36	-	-	5,522,204.63	-	-	-	-	(2,466,948.00)	1,447,626,556.99	3,055,256.63
- 交易性债券投资	250,911,300.36	-	-	5,522,204.63	-	-	-	-	(2,466,948.00)	253,966,556.99	3,055,256.63
- 交易性权益工具	1,193,660,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	1,193,660,000.00	-
可供出售金融资产	9,298,723,257.39	-	-	(1,282,717.54)	(487,301,719.49)	2,754,554,946.51	-	(29,200,296.63)	(946,133.27)	11,534,547,336.97	-
- 可供出售债券	134,786,817.39	-	-	(1,282,717.54)	774,815.59	129,381,896.53	-	(29,200,296.63)	(946,133.27)	233,514,382.07	-
- 可供出售其他债 务											
工具	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- 可供出售权益工 具	9,163,936,440.00	-	-	-	(488,076,535.08)	2,625,173,049.98	-	-	-	11,301,032,954.90	-
衍生金融资产	156,585,102.00	-	-	(17,538,510.00)	-	-	-	(68,326,879.81)	-	70,719,712.19	-
衍生金融负债	(295,279.74)	-	-	2,550,206.31	-	(3,574,784.66)	-	-	(2,646,178.01)	(3,966,036.10)	(3,574,784.66)
以公允价值计量且其变 动计入当期损益的金融 负债	-	-	-	32,323,945.29	-	(5,223,413,785.22)	-	-	-	(5,191,089,839.93)	32,323,945.29
合计	10,899,584,380.01	-	-	21,575,128.69	(487,301,719.49)	(2,472,433,623.37)	-	(97,527,176.44)	(6,059,259.28)	7,857,837,730.12	31,804,417.26

(i) 上述本集团于本年度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：

	<u>2016年1-6月</u>	
	<u>项目</u>	<u>金额</u>
本年计入损益的已实现利得或损失	投资收益	(10,229,288.55)
本年计入损益的未实现利得或损失	公允价值变动损益	31,804,417.26
合计		<u>21,575,128.71</u>
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	(487,301,719.49)
		<u><u>(487,301,719.49)</u></u>
	<u>2015年1-6月</u>	
	<u>项目</u>	<u>金额</u>
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		<u>165,642,299.42</u>
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
		<u><u>1,525,522,268.27</u></u>

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2016年6月30日及2015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。

十三、 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。

根据证监会颁布的《证券公司风险控制指标管理办法(2008年修订版)》等相关规定,本公司须就风险控制指标持续达到下列标准:

1. 净资本与各项风险资本准备之和的比例不得低于100%(“比率1”);
2. 净资本与净资产的比例不得低于40%(“比率2”);
3. 净资本与负债的比例不得低于8%(“比率3”);
4. 净资产与负债的比例不得低于20%(“比率4”);
5. 自营权益类证券及证券衍生品的合计额不得超过净资本的100%(“比率5”);及
6. 自营固定收益类证券的合计额不得超过净资本的500%(“比率6”)。

净资本是在净资产的基础上对资产负债等项目和有关业务进行风险调整后得出的综合性风险控制指标。

于2016年6月30日和2015年12月31日,本公司的上述比率如下:

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
净资本(人民币元)	43,755,077,768.74	52,362,033,891.72
比率1	743.04%	880.74%
比率2	60.97%	70.34%
比率3	46.07%	39.67%
比率4	75.56%	56.41%
比率5	70.09%	79.45%
比率6	53.36%	72.99%

十四、 关联方及关联交易

1、 本企业的母公司情况

持有本公司5%(含5%)以上表决权股份的股东单位情况如下:

单位:亿元 币种:人民币

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	200	17.4643	17.4643
江苏交通控股有限	南京	国有资产管理等	168	6.2611	6.2611

公司					
----	--	--	--	--	--

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十、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十、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

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	席位费分仓佣金及销售服务费	10,093,176.60	24,077,646.66
华泰柏瑞基金管理有限公司	席位费分仓佣金及销售服务费	6,393.45	30,402,845.86
江苏交通控股有限公司	证券代理买卖交易佣金	-	18,179.70
江苏省国信资产管理集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	38,648.36	1,831,539.02
南方基金管理有限公司	证券代理买卖交易佣金	19,225.39	4,000.00
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	基金管理费收入	19,714,233.37	20,000,000.00
江苏工业和信息产业投资基金(有限合伙)	基金管理费收入	594,384.14	-
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	基金管理费收入	633,238.57	-

(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	552,194.25	552,194.28
华泰柏瑞基金管理有限公司	办公设备	-	50,000.00

(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：万元 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	25,559,438.00	13,893,578.00

(8). 其他关联交易

① 与关联方有关的投资收益

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
江苏省国信资产管理集团有限公司	持有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收益	1,459,487.03	917,031.12
江苏交通控股有限公司	持有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收益	8,989,365.84	261,649.51
华泰柏瑞基金管理有限公司	购买的基金产品分红	11,531,798.31	3,778,108.68
南方基金管理有限公司	购买的基金产品分红	12,187,484.76	3,442,052.30
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	处置的资管计划	459,711.56	
合计		34,627,847.50	8,398,841.61

② 认购关联方管理的基金情况

2016年6月30日

关联方	认购基金名称	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	8.87	-	(6.87)	2.00	2.22
	中证500ETF					
	联接(LOF)	17.95	-	(17.95)	-	-
	南方现金B	2,043.48	29.35	-	2,072.83	2,072.83
	南方收益宝					

货币 B	100,008.46		(50,008.46)	50,000.00	50,000.00
理财金 H	167.34	147,012.95		147,180.29	147,180.29
南方中证 500ETF	241.57		(241.57)	-	-
合计	102,487.67	147,042.30	(50,274.85)	199,255.12	199,255.34

华泰柏瑞基金
管理有限

公司	华泰柏瑞沪深 300ETF	126.06		(114)	12.06	38.12
	华泰柏瑞货币 B	16,232.17	74,950.00		91,182.17	91,182.17
	华泰柏瑞量化 增强混合 A	2,155.10		(2,155.10)	-	-
	华泰柏瑞交易 货币 A	6.76	2,320.17	-	2,326.93	2,326.93
合计		18,520.09	77,270.17	(2,269.10)	93,521.16	93,547.22

③ 本集团持有关联方发行债券情况

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
江苏省国信资产管理 集团有限公司	投资企业债	63,049,318.00	63,473,480.00
江苏交通控股 有限公司	投资企业债	502,949,525.92	349,863,792.36
合计		565,998,843.92	413,337,272.36

④ 投资/(处置)本集团发行的资产管理计划

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
华泰紫金(江苏) 股权投资基金 (有限合伙)	集合资管计划	(402,971,750.00)	301,643,360.00

⑤ 与关联方相关取得的股利

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
华泰柏瑞基金管理有限公司	收到的股利	49,000,000.00	-

⑥ 对关联方投资增资

关联方	关联交易内容	2016年1-6月	2015年1-6月
-----	--------	-----------	-----------

华泰紫金(江苏)股权 投资基金(有限合伙)	对联营企业投资增资	-	193,000,000.00
江苏工业和信息产业 投资基金(有限合伙)	对联营企业投资增资	-	201,000,000.00
华泰招商(江苏)资本市场投资 母基金(有限合伙)	对合营企业投资增资	100,000,000.00	-
南京华泰瑞联并购基金二号(有 限合伙)	对联营企业投资增资	2,000,000.00	
南京华泰瑞联并购基金三号(有 限合伙)	对联营企业投资增资	2,000,000.00	
南京华泰瑞联并购基金四号(有 限合伙)	对联营企业投资增资	2,000,000.00	
苏州股权交易中心有限公司	对联营企业投资增资	10,000,000.00	
江苏华泰战略新兴产业投资基金 (有限合伙)	对联营企业投资增资	50,000.00	
江苏华泰互联网产业投资基金 (有限合伙)	对联营企业投资增资	50,000.00	
合计		116,100,000.00	394,000,000.00

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	华泰柏瑞管理有限公司	-	-	5,518,975.58	(27,594.88)
基金分仓佣金	南方基金管理有限公司	2,911,621.14	(14,558.11)	4,048,888.44	(20,244.44)
基金管理费	华泰紫金(江苏)股权 投资基金(有限合伙)	20,000,000.00			
基金管理费	江苏工业和信息产业投 资基金(有限合伙)	721,567.42			
基金管理费	华泰招商(江苏)资本 市场投资母基金(有限 合伙)	671,232.88			

(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
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	50,000.00	171,475.09
代理买卖证券款	华泰柏瑞基金管理有限公司	3,803,053.62	12,399,012.24
代理买卖证券款	南方基金管理有限公司	35,819.13	19,487.86
代理买卖证券款	江苏交通控股有限公司	-	11,349.77
代理买卖证券款	华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	988.09	

(3) 应收利息

本集团

<u>关联方</u>	<u>关联方交易内容</u>	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
江苏省国信资产管理集团有限公司	应收债券投资利息	861,926.79	2,343,425.67
江苏交通控股有限公司	应收债券投资利息	13,847,905.49	3,946,393.45
合计		<u>14,709,832.28</u>	<u>6,289,819.12</u>

(4) 应收股利

<u>关联方</u>	<u>关联方交易内容</u>	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
南方基金管理有限公司	应收股利	162,000,000.00	
南方现金增利B	应收红利	21,183.08	-
华泰柏瑞货币B	应收红利	11,130,670.57	
合计		<u>173,151,853.65</u>	<u>-</u>

十五、股份支付

1、 股份支付总体情况

适用 不适用

2、 以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

3、 以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

十六、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

<u>项目</u>	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
已签约但未拨付	<u>118,655,466.16</u>	<u>685,483,157.07</u>

上述资本承担主要为本集团建造办公楼承诺的资本承担。

(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6月30日以后应支付的最低租赁付款额如下：

项目	2016年6月30日	2015年12月31日
1年以内(含1年)	159,213,761.65	193,132,321.73
1年以上2年以内(含2年)	126,886,943.98	139,111,894.09
2年以上3年以内(含3年)	88,054,107.46	87,255,244.86
3年以上	54,508,706.08	70,516,478.02
合计	428,663,519.16	490,015,938.70

2、或有事项

√适用 □不适用

(1). 资产负债表日存在的重要或有事项

① 未决诉讼仲裁形成的或有负债及其财务影响

华泰证券就质权项下存单提起执行异议：

华泰证券作为“华泰证券金陵六号定向资产管理计划”（简称：金陵六号计划）管理人，根据委托人投资指令，于2014年4月22日以定向计划资金投资昆山凯虹汽车贸易有限公司（简称：昆山凯虹）持有的存单收益权，并与昆山凯虹约定2016年4月21日由昆山凯虹全额购回该存单。为确保回购条款的正常履行，昆山凯虹将该存单（2,500万）质押给华泰证券。因昆山凯虹其他纠纷，其相关资产（包括为该笔业务所质押的2,500万存单）被昆山市人民法院冻结。依据相关合同约定，如存单转让人涉及纠纷，金陵六号计划管理人可提前行使质权。2015年10月，华泰证券向昆山市人民法院提出执行异议，请求法院解冻该企业质押给华泰证券的2,500万存单。昆山市人民法院已受理华泰证券执行异议（受理编号：（2016）苏0583执异9号），该案已于2016年5月出裁定，裁定生效后，已解除冻结。由于凯虹汽车其他诉讼纠纷，法院轮候冻结该存单，华泰证券于2016年5月向法院提交执行异议。之后因异议被驳回，2016年6月，华泰证券向法院提起执行异议之诉。华泰证券为金陵六号计划管理人，接受该计划委托人委托进行诉讼，形成损益归入该计划资产。该计划资产与华泰证券资产相互独立，本次诉讼对公司本期利润或期后利润没有不利影响。

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

于2014年，中国银行股份有限公司向华泰证券香港子公司 Huatai International Finance I Limited 发行的4亿美元境外债券提供了担保，本公司为该笔担保向中国银行股份有限公司提供了反担保。反担保金额不超过上述债券本金、利息及其他相关费用合计人民币30亿元等值美元。

③ 其他或有负债及其财务影响

截至2016年6月30日，本集团不存在其他或有负债。

④ 或有资产

截至2016年6月30日，本集团不存在或有资产。

十七、资产负债表日后事项

1、重要的非调整事项

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	内容	对财务状况和经营成果的影响数	无法估计影响数的原因
重要的对外投资	向华泰金融控股（香港）有限公司增资及华泰金融控股（香港）有限公司收购 AssetMark Financial Holdings, Inc.	-	本次交易尚需其他监管机构的必要批准，且需多项条件在 2016 年 12 月 30 日（最终截止日）或之前满足或获豁免（倘适用）后才能实施，存在不确定性。

2016 年 7 月 5 日，公司收到中国证监会证券基金机构监管部《关于对华泰证券股份有限公司向华泰金融控股（香港）有限公司增资无异议及收悉华泰金融控股（香港）有限公司收购 AssetMark Financial Holdings, Inc. 报备文件的函》（机构部函 [2016] 1529 号）。根据该函，中国证监会证券基金机构监管部对公司向华泰金融控股（香港）有限公司增加 78 亿港元实缴资本无异议，已收悉公司关于收购 AssetMark Financial Holdings, Inc.（“本次交易”）的报备文件，并要求收购完成后报告。根据该函，公司于 2016 年 8 月 8 日向华泰金融控股（香港）有限公司增资 2,947,242,000.00 港元。

本次交易尚需其他监管机构的必要批准，且需多项条件在 2016 年 12 月 30 日（最终截止日）或之前满足或获豁免（倘适用）后才能实施，存在不确定性。

2、利润分配情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

拟分配的利润或股利	-
经审议批准宣告发放的利润或股利	3,581,384,400.00

公司股东大会于 2016 年 6 月 7 日通过本公司向普通股股东派发现金股利，以 2015 年 12 月 31 日总股本 7,162,768,800.00 股为基数，2015 年度公司利润分配方案为每 10 股分配现金股利 5.00 元（含税），分红金额为人民币 3,581,384,400.00 元（2014 年：人民币 2,800,000,000.00 元），于 2016 年 8 月 5 日发放完毕。

3、销售退回

□适用 √不适用

4、其他资产负债表日后事项说明

2016 年 7 月 29 日，华泰证券股份有限公司全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司收到中国证监会《关于核准华泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可 [2016] 1682 号）。根据该批复，中国证监会核准华泰资管公司公开募集证券投资基金管理业务资格。

十八、风险管理

1、风险管理政策及组织架构

(1). 风险管理政策

附注十一、1

(2). 风险治理组织架构

附注十一、1

2、信用风险

附注十一、2

3、流动风险

附注十一、2

4、市场风险

附注十一、2

十九、其他重要事项

1、前期会计差错更正

适用 不适用

2、债务重组

适用 不适用

3、资产置换

适用 不适用

4、年金计划

适用 不适用

5、终止经营

适用 不适用

6、分部信息

适用 不适用

(1) 报告分部的确定依据与会计政策：

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业务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。

(2) 报告分部的财务信息 (2016年1-6月/2016年6月30日)

单位: 元 币种: 人民币

项目	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	2,906,101,359.64	863,701,968.59	119,813,467.98	58,582,615.43	30,059,932.76	467,238.10	3,977,792,106.30
利息净收入/(支出)	2,348,814,752.91	85,228,435.14	266,730,110.24	(156,862,811.95)	(996,068,954.86)	-	1,547,841,531.48
投资收益	4,936,368.48	13,777,256.33	934,954,329.87	314,187,569.84	255,227,160.02	(212,151.89)	1,523,294,836.43
公允价值变动(损失)/收益	263,532.23	-	(90,647,742.68)	340,117,928.04	(2,689,424.63)		247,044,292.96
其他	14,512,925.26	2,724,653.86	(18,796,174.02)	54,199,497.72	14,128,641.92	6,969,687.76	59,799,856.98
营业收入合计	5,274,628,938.52	965,432,313.92	1,212,053,991.39	610,224,799.08	(699,342,644.79)	7,224,773.97	7,355,772,624.15
营业支出	(2,131,742,787.37)	(553,538,498.23)	(361,301,719.48)	(189,189,481.31)	(318,317,386.04)	(7,085,517.43)	(3,547,004,355.00)
营业利润/(亏损)	3,142,886,151.15	411,893,815.69	850,752,271.91	421,035,317.77	(1,017,660,030.83)	139,256.54	3,808,768,269.15
利润/(亏损)总额	3,183,334,565.72	429,148,198.57	860,384,534.68	421,042,297.72	(1,015,758,333.80)	139,256.54	3,878,012,006.35
分部资产	191,299,475,856.31	3,847,005,992.06	121,815,617,935.62	49,910,454,007.39	139,685,435,298.94	103,878,672,350.57	402,679,316,739.75
分部负债	(184,824,812,378.81)	(1,022,667,281.78)	(109,886,749,730.10)	(49,375,870,784.51)	(81,710,532,897.20)	(103,878,672,350.57)	(322,941,960,721.83)
补充信息							
利息收入	3,852,562,377.85	85,228,544.68	336,360,326.00	72,096,080.65	136,212,764.12	-	4,482,460,093.30
利息支出	(1,503,747,624.94)	(109.54)	(69,630,215.76)	(228,958,892.60)	(1,132,281,718.98)	-	(2,934,618,561.82)
折旧与摊销费用	(51,890,803.22)	(5,920,611.74)	(1,333,017.81)	(4,969,200.61)	(123,567,264.13)	-	(187,680,897.51)
资本性支出	51,683,147.02	2,135,352.80	3,865,461.85	4,145,326.99	136,146,969.08	-	197,976,257.74
资产减值(损失)/转回	3,338,018.16	2,211,100.00	(144,730.88)	-	(139,256.54)	-	5,265,130.74

2015年1-6月/2015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	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(损失)/收益	(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	225,408,326,565.58	3,927,544,915.25	111,375,630,017.20	66,913,967,585.79	156,018,416,950.97	(111,029,270,717.63)	452,614,615,317.16
分部负债	(223,363,303,689.56)	(1,309,545,883.49)	(102,015,328,431.68)	(64,907,118,745.89)	(90,519,818,582.00)	111,029,270,717.63	(371,085,844,614.99)
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(损失)/转回	(12,045.87)	4,876,200.00	-	(69,487.28)	(2,432,724.16)	-	2,361,942.69

(3) 其他说明:

① 地区信息

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	
	2016年1-6月	2015年1-6月	2016年6月30日	2015年12月31日
中国				
其中: 中国大陆	7,345,380,434.67	14,358,681,394.02	7,989,651,690.73	7,627,751,664.10
中国香港	10,392,189.48	285,570,412.42	12,834,073.79	14,422,314.11
合计	7,355,772,624.15	14,644,251,806.44	8,002,485,764.52	7,642,173,978.21

② 主要客户

于2016年1-6月及2015年度,本集团来自各单一客户的收入均低于本集团总收入的10%。

7、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)	131,238,108,713.37	(377,457,004.00)	-	-	93,202,794,125.54
2、衍生金融资产	334,749,747.33	604,752,593.32	-	-	934,651,457.91
3、可供出售金融资产	37,912,931,477.82	-	4,153,200,095.32	-	39,705,927,749.31
金融资产小计	169,485,789,938.52	227,295,589.32	4,153,200,095.32	-	133,843,373,332.76
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	169,485,789,938.52	227,295,589.32	4,153,200,095.32	-	133,843,373,332.76
金融负债	(23,888,637,587.55)	19,748,703.64	-	-	(27,746,722,688.46)

8、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）	1,619,408,536.87	4,478,484.98	-	-	1,559,263,225.61
2、衍生金融资产	8,752,628.76	(1,260,509.29)	-	-	7,492,119.48
3、贷款和应收款					
4、可供出售金融资产	953,533,416.63	-	36,170,347.57	-	1,545,824,203.09
5、持有至到期投资					
应收款项	350,647,710.50	-	-	-	479,979,113.24
金融资产小计	2,932,342,292.76	3,217,975.69	54,703,654.87	-	3,592,558,661.42
金融负债	(13,364,552.56)	(3,446,836.34)	-	-	(518,158,990.91)

9、其他

(1) 新设证券营业部

截至2016年6月30日，本公司无新获准设立营业部。

(2) 其他需要披露的重要事项

① 截至2016年6月30日，公司未办理产权证的投资性房地产及固定资产原值为人民币320,038,695.60元，账面价值为人民币187,554,120.99元，明细情况详见附注七、13(2)及附注七、14(5)。

② 融资融券业务

(i) 融资融券业务明细情况

核算科目	2016年6月30日	2015年12月31日
融出资金	51,455,667,110.41	67,432,118,172.86
融出证券	67,999,080.76	68,137,207.12
合计	51,523,666,191.17	67,500,255,379.98

融出资金详见附注七、3。

(ii) 融券业务明细情况

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
融出证券		
– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	14,040,809.38	65,609,114.72
– 可供出售金融资产	53,958,271.38	2,528,092.40
– 转融通融入证券	–	–
融出证券总额	<u>67,999,080.76</u>	<u>68,137,207.12</u>

(iii) 融出资金及融出证券担保物公允价值

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
股票	164,387,230,314.54	206,477,323,183.79
资金	12,944,432,808.32	18,461,809,362.25
基金	868,043,578.21	724,254,931.07
债券	42,368,961.24	29,075,991.64
合计	<u>178,242,075,662.31</u>	<u>225,692,463,468.75</u>

(iv) 本期融券业务无违约情况。

③ 本公司为履行社会责任,在公益项目、慈善捐赠、扶贫捐赠、教育资助等方面的支出合计 166.22 万元。

④ 所有权或使用权受到限制的资产

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
货币资金	985,821,512.51	1,132,605,354.48
融出资金	10,165,903,631.35	21,365,378,763.78
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	18,442,780,035.52	18,164,344,699.48
可供出售金融资产	14,287,511,017.26	15,306,765,701.93
无形资产	295,797,221.84	299,334,545.85
买入返售金融资产	–	1,426,200,000.00
合计	<u>44,177,813,418.48</u>	<u>57,694,629,065.52</u>

二十、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

	<u>2016年6月30日</u>	<u>2015年12月31日</u>
应收开放式基金赎回款	233,261,230.64	-
应收手续费及佣金	50,166,432.30	210,775,757.61
其他	64,861,922.20	-
减：坏账准备	(1,219,475.79)	(1,219,475.79)
	<hr/>	<hr/>
应收款项账面价值	347,070,109.35	209,556,281.82
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

(2) 应收款项按账龄分析如下

	<u>2016年6月30日</u>			
	<u>账面余额</u>		<u>坏账准备</u>	
	<u>金额</u>	<u>比例(%)</u>	<u>金额</u>	<u>计提比例(%)</u>
1年以内	339,361,548.94	97.44	716,073.98	0.21
1至2年	8,748,036.20	2.51	437,401.81	5.00
2至3年	60,000.00	0.02	6,000.00	10.00
3年以上	120,000.00	0.03	60,000.00	50.00
	<hr/>	<hr/>	<hr/>	<hr/>
合计	348,289,585.14	100.00	1,219,475.79	0.35
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

	<u>2015年12月31日</u>			
	<u>账面余额</u>		<u>坏账准备</u>	
	<u>金额</u>	<u>比例(%)</u>	<u>金额</u>	<u>计提比例(%)</u>
1年以内	250,156,348.06	97.57	724,270.79	0.29
1至2年	3,524,100.00	1.37	176,205.00	5.00
2至3年	2,590,000.00	1.01	259,000.00	10.00
3年以上	120,000.00	0.05	60,000.00	50.00
	<hr/>	<hr/>	<hr/>	<hr/>
合计	256,390,448.06	100.00	1,219,475.79	0.48
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

账龄自应收款项确认日起开始计算。

(3) 按评估方式列示

	<u>2016年6月30日</u>			
	<u>账面余额</u>		<u>坏账准备</u>	
	<u>金额</u>	<u>比例(%)</u>	<u>金额</u>	<u>计提比例(%)</u>
组合计提减值准备	348,289,585.14	100.00	1,219,475.79	0.35
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

	2015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	256,390,448.06	100.00	1,219,475.79	0.48

本公司并未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

	2016年6月30日	2015年12月31日
年初余额	1,219,475.79	397,889.36
本年计提	-	821,586.43
本年收回或转回	-	-
年末余额	1,219,475.79	1,219,475.79

(5) 按欠款方归集的年末余额前五名的应收款项情况

单位名称	与本公司关系	金额	账龄	占应收款项总额的比例(%)
中国证券登记结算有限公司	第三方	233,261,230.64	1年以内	66.97
中国城市建设控股集团 集团有限公司	第三方	22,400,000.00	1年以内	6.43
湖南省高速公路建设开发总 公司	第三方	14,750,000.00	1年以内	4.23
北京首钢股份有限公司	第三方	7,100,000.00	1年以内	2.04
漳州市九龙江集团有限公司	第三方	6,000,000.00	1年以内	1.72
合计		283,511,230.64		81.40

(6) 本年应收款项中无持有公司5%(含5%)以上表决权股份的股东单位情况。

(7) 本年应收款项中应收关联方款项情况

单位名称	与本公司关系	金额	账龄	占应收款项总额的比例(%)
南方基金管理有限公司	联营公司	2,911,621.14	1年以内	0.84
合计		2,911,621.14		0.84

2 长期股权投资

(1) 按类别列示

	<u>2016年6月30日</u>		
	<u>账面余额</u> 人民币元	<u>减值准备</u> 人民币元	<u>账面价值</u> 人民币元
对子公司投资	8,368,526,825.28	-	8,368,526,825.28
对联营企业投资	1,885,826,980.68	-	1,885,826,980.68
合计	<u>10,254,353,805.96</u>	<u>-</u>	<u>10,254,353,805.96</u>

	<u>2015年12月31日</u>		
	<u>账面余额</u> 人民币元	<u>减值准备</u> 人民币元	<u>账面价值</u> 人民币元
对子公司投资	6,948,526,825.28	-	6,948,526,825.28
对联营企业投资	1,935,635,486.32	-	1,935,635,486.32
合计	<u>8,884,162,311.60</u>	<u>-</u>	<u>8,884,162,311.60</u>

(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	减值准备年初余额
华泰联合证券有限责任公司	1,275,056,039.63	-	-	1,275,056,039.63	-
华泰期货有限公司	491,998,085.65	120,000,000.00	-	611,998,085.65	-
华泰紫金投资有限责任公司	2,750,000,000.00	1,300,000,000.00	-	4,050,000,000.00	-
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	1,000,000,000.00	-	-	1,000,000,000.00	-
合计	6,948,526,825.28	1,420,000,000.00	-	8,368,526,825.28	-

本公司子公司的相关信息参见附注十。

(3) 对联营企业的投资

联营企业	年初余额	本年增减变动		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	年末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资							
南方基金管理有限公司	1,597,134,318.42	-	-	133,313,044.30	(22,018,565.70)	-	(162,000,000.00)	-	1,546,428,797.02	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	338,501,167.90	-	-	58,739,974.97	(8,842,959.21)	-	(49,000,000.00)	-	339,398,183.66	-
合计	1,935,635,486.32	-	-	192,053,019.27	(30,861,524.91)	-	(211,000,000.00)	-	1,885,826,980.68	-

3 手续费及佣金净收入

	附注	<u>本期金额</u>	<u>上期金额</u>
手续费及佣金收入			
经纪业务收入		3,999,653,713.64	10,063,273,804.12
其中：证券经纪业务收入		3,999,653,713.64	10,063,273,804.12
其中：代理买卖证券业务		3,641,079,368.16	9,545,944,263.36
交易单元席位租赁		245,529,385.99	333,086,884.21
代销金融产品业务	(i)	113,044,959.49	184,242,656.55
投资银行业务收入	(ii)	74,931,497.60	43,869,254.45
其中：证券承销业务		74,931,497.60	43,869,254.45
投资咨询服务收入		53,241,213.68	57,187,837.03
资产管理业务收入		-	4,796,292.60
其他		19,313,730.27	152,492.62
手续费及佣金收入小计		<u>4,147,140,155.19</u>	<u>10,169,279,680.82</u>
手续费及佣金支出			
经纪业务支出		(1,224,490,728.29)	(3,081,666,104.05)
其中：证券经纪业务支出		(1,224,490,728.29)	(3,081,666,104.05)
其中：代理买卖证券业务		(1,224,490,295.60)	(3,081,666,104.05)
交易单元席位租赁		-	-
代销金融产品业务		(432.69)	-
投资银行业务支出	(ii)	(1,703,200.00)	(14,410,398.33)
其中：证券承销业务		(1,703,200.00)	(14,410,398.33)
投资咨询服务支出		(5,845.35)	(662,084.60)
资产管理业务支出		-	-
其他		(644,062.73)	-
手续费及佣金支出小计		<u>(1,226,843,836.37)</u>	<u>(3,096,738,586.98)</u>
手续费及佣金净收入		<u>2,920,296,318.82</u>	<u>7,072,541,093.84</u>

(i) 代销金融产品业务

	<u>本期金额</u>		<u>上期金额</u>	
	<u>销售总金额</u>	<u>销售总收入</u>	<u>销售总金额</u>	<u>销售总收入</u>
基金	12,836,701,527.37	109,339,173.91	19,152,573,983.45	181,178,479.11
信托	-	-	2,183,010,000.00	1,731,048.27
其他	2,031,085,046,783.48	2,427,480.17	2,080,345,400,187.95	1,333,129.17
合计	<u>2,043,921,748,310.85</u>	<u>111,766,654.08</u>	<u>2,101,680,984,171.40</u>	<u>184,242,656.55</u>

(ii) 投资银行业务净收入

本期金额 上期金额

投资银行业务收入	74,931,497.60	43,869,254.45
其中：证券承销业务	74,931,497.60	43,869,254.45
投资银行业务支出	(1,703,200.00)	(14,410,398.33)
其中：证券承销业务	(1,703,200.00)	(14,410,398.33)
投资银行业务净收入	73,228,297.60	29,458,856.12

4 投资收益

(1) 投资收益按类别列示

	本期金额	上期金额
成本法核算的长期股权投资收益	-	-
权益法核算的长期股权投资收益	192,053,019.27	201,002,420.45
金融工具投资收益	344,393,449.68	2,667,091,751.71
持有期间取得的分红和利息	926,942,609.64	691,597,946.58
其中：以公允价值计量且其变动		
计入当期损益的金融资产	779,272,315.45	569,109,439.62
可供出售金融资产	147,558,369.86	122,374,835.47
持有至到期金融资产	111,924.33	113,671.49
处置金融工具取得的收益	(582,549,159.96)	1,975,493,805.13
其中：以公允价值计量且其变动		
计入当期损益的金融资产	(516,442,303.48)	5,154,202,213.81
可供出售金融资产	(485,150,113.08)	179,479,539.90
衍生金融工具	1,677,618,572.27	(3,358,187,948.58)
以公允价值计量且其变动		
计入当期损益的金融负债	(1,258,575,315.67)	-
合计	536,446,468.95	2,868,094,172.16

(2) 对联营企业的投资收益

	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	133,313,044.30	155,569,517.24	被投资单位净利润变化
华泰柏瑞基金管理 有限公司	58,739,974.97	45,432,903.21	被投资单位净利润变化
合计	192,053,019.27	201,002,420.45	

(3) 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

	本期金额	上期金额
净利润	2,158,890,564.23	5,785,125,380.12

加：资产减值损失	(21,371,780.66)	2,444,770.03
固定资产及投资性房地产折旧	103,111,091.62	79,416,365.51
无形资产摊销	49,767,573.68	35,737,911.58
长期待摊费用摊销	19,349,827.91	23,833,985.61
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	(556,155.51)	1,486,997.91
公允价值变动损失/(收益)	(295,352,627.29)	925,010,999.34
利息支出	1,765,961,595.39	1,524,384,706.49
汇兑收益	(4,749,030.32)	(339,077,225.28)
投资收益	145,426,799.62	(502,856,795.82)
递延所得税资产减少(增加)	(304,049,320.57)	-
递延所得税负债增加(减少)	216,150,678.95	24,001,518.79
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的增加	29,923,350,680.91	(136,212,768.92)
经营性应收项目的减少(增加)	12,709,771,488.83	(52,652,540,710.55)
经营性应付项目的增加(减少)	(47,109,815,610.38)	148,334,625,050.61
经营活动产生的现金流量净额	(644,114,223.59)	103,105,380,185.42

(2) 现金及现金等价物净变动情况

	2016年6月30日	2015年6月30日
现金的年末余额	104,201,968,500.29	259,818,603,958.01
减：现金的年初余额	130,617,931,523.58	81,038,846,562.82
现金及现金等价物净增加(减少)	(26,415,963,023.29)	178,779,757,395.19

二十一、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	539,637.26	
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或定量享受的政府补助除外)	18,586,862.18	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		

对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	50,117,237.76	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	(16,009,640.12)	
少数股东权益影响额	(119,825.30)	
合计	53,114,271.78	

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及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、衍生金融工具及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

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	3.62	0.3967	0.3967
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	3.56	0.3893	0.3893

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

适用 不适用

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2016年1-6月及2015年1-6月的净利润、2016年06月30日及2015年12月31日的净资产无差异。

二十二、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	2016年6月30日	2015年12月31日	变动幅度	变动原因
结算备付金	13,398,528,605.62	36,068,780,816.99	(62.85%)	交易量减少导致的客户资金减少，结算备付金也相应减少所致
衍生金融资产	934,651,457.91	334,749,747.33	179.21%	黄金远期合约浮动收益增加
应收款项	1,996,256,127.81	621,553,847.35	221.17%	合并结构化主体应收清算款增加
应收利息	4,636,725,373.22	3,282,483,606.91	41.26%	融资融券利息收入增加及结构化产品债券利息收入增加
在建工程	115,271,280.72	761,146,125.53	(84.86%)	在建工程转固定资产

递延所得税资产	528,684,107.61	212,609,137.58	148.66%	可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	968,704,802.77	613,733,977.73	57.84%	应收联营企业分红及预付款增加所致
应付短期融资款	175,000,000.00	1,053,004,000.00	(83.38%)	短期融资券兑付
拆入资金	1,500,000,000.00	3,000,000,000.00	(50.00%)	拆入资金减少所致
衍生金融负债	698,785,173.23	2,460,345,120.06	(71.60%)	黄金远期合约到期及权益互换结算所致
卖出回购金融资产款	22,061,434,673.80	33,192,019,282.19	(33.53%)	以信用业务债权收益权为质押的回购到期
代理承销证券款	41,552,500.00	85,485,000.00	(51.39%)	承销结算资金余额减少
应交税费	1,251,588,450.23	2,700,686,858.57	(53.66%)	企业所得税应纳税额减少
应付款项	2,023,841,339.23	7,435,329,288.96	(72.78%)	开放式基金申、认购款减少及股票受益权互换业务结算
应付利息	660,114,285.99	2,692,344,618.00	(75.48%)	公司债券及次级债券到期兑付导致应付利息减少
应付股利	3,594,481,040.00	13,096,640.00	27345.83%	宣告但未发放的2015年度应付股利
递延所得税负债	154,838,446.90	351,818,817.20	(55.99%)	应纳税暂时性差异减少
其他综合收益	2,021,140,073.05	3,263,870,957.42	(38.08%)	可供出售金融资产浮动亏损

利润表项目	2016年1-6月	2015年1-6月	变动幅度	变动原因
手续费及佣金净收入	3,977,792,106.30	7,969,997,167.12	(50.09%)	经纪业务、投行业务手续费及资产管理业务收入均有所降低
利息净收入	1,547,841,531.48	2,769,331,690.69	(44.11%)	融资融券利息收入降低所致
投资收益	1,523,294,836.43	3,179,740,350.49	(52.09%)	金融工具处置所得减少所致
汇兑收益	(23,437,370.86)	331,388,162.11	(107.07%)	汇兑收益减少所致
其他业务收入	83,237,227.84	42,321,992.57	96.68%	酒店经营及租赁收入增加所致
营业税金及附加	343,743,698.03	921,431,417.06	(62.69%)	应税收入减少所致
业务及管理费	3,164,140,665.94	4,878,355,706.15	(35.14%)	员工成本减少
资产减值损失	(5,265,130.74)	(2,361,942.69)	122.92%	融出资金拨备转回所致
营业外收入	72,793,777.62	31,747,969.45	129.29%	政府补助及税收返还增加所致

营业外支出	3,550,040.42	8,251,167.23	(56.98%)	固定资产处置损失减少及其他支出减少所致
所得税费用	934,458,775.61	2,115,301,390.96	(55.82%)	税前利润减少所致
其他综合收益的税后净额	(1,241,997,192.89)	1,684,553,023.59	(173.73%)	可供出售金融资产浮动亏损

二十三、财务报表的批准报出

本财务报表经公司董事会于2016年8月19日批准报出。

第十一节 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
	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
	公司章程

董事长：周易

董事会批准报送日期：2016-08-19

第十二节 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、2016年3月17日，《关于陈传明证券公司独立董事任职资格的批复》（苏证监机构字【2016】64号）
- 2、2016年3月30日，《关于杨雄胜证券公司独立董事任职资格的批复》（苏证监机构字【2016】73号）
- 3、2016年5月24日，《关于徐清证券公司董事任职资格的批复》（苏证监机构字【2016】135号）
- 4、2016年5月24日，《关于陈宁证券公司董事任职资格的批复》（苏证监机构字【2016】136号）
- 5、2016年5月24日，《关于王会清证券公司监事任职资格的批复》（苏证监机构字【2016】137号）

二、监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2014、2015年，公司在证券公司分类评价的结果为A类AA级，2016年为B类BBB级。