

证券代码：000001

证券简称：深发展 A

公告编号：2007 - 045

深圳发展银行股份有限公司关于“深发 SFC1” 和“深发 SFC2”认股权证上市首日开盘参考价的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

深圳发展银行股份有限公司（以下简称“本公司”）发行的以本公司 A 股股票为标的证券的认股权证（“深发 SFC1”和“深发 SFC2”认股权证）将于 2007 年 6 月 29 日在深圳证券交易所上市。

“深发 SFC1”认股权证上市首日开盘参考价格为每份认股权证人民币 11.472 元。

“深发 SFC1”认股权证上市首日涨幅价格为每份认股权证人民币 15.240 元；跌幅价格为每份认股权证人民币 7.705 元。

“深发 SFC2”认股权证上市首日开盘参考价格为每份认股权证人民币 12.819 元。

“深发 SFC2”认股权证上市首日涨幅价格为每份认股权证人民币 16.587 元；跌幅价格为每份认股权证人民币 9.052 元。

“深发 SFC1”和“深发 SFC2”认股权证上市首日开盘参考价格是由保荐机构海通证券股份有限公司采用 Black-Scholes 模型进行测算。该参考价格已经过本公司确认。

相应权证开盘参考价的计算参数如下：

认股权证为存续期 6 个月的“深发 SFC1”开盘参考价格的计算参数为行权价格 19.00 元，行权比例为 1:1。本公司 A 股价半年波动率为 37%（公司最近半年的历史股价波动率），无风险收益率为 2.61%（参考半年期定期存款利率）。

认股权证为存续期 12 个月的“深发 SFC2”开盘参考价格的计算参数为行权价格 19.00 元，行权比例为 1:1。本公司 A 股价年波动率为 52%（公司最近一年的历史股价波动率），无风险收益率为 3.06%（参考 1 年期定期存款利率）。

特此公告。

深圳发展银行股份有限公司董事会

2007 年 6 月 29 日