

深圳发展银行股份有限公司

“深发 SFC2”认股权证到期风险提示性公告

本公司及董事保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

鉴于“深发 SFC2”认股权证将于 2008 年 5 月 16 日开始行权，本公司特提请投资者关注“深发 SFC2”认股权证行权的有关事项和投资风险。

一、基本风险提示

1、“深发 SFC2”认股权证的存续期自 2007 年 6 月 29 日起，至 2008 年 6 月 27 日止。

2、“深发 SFC2”认股权证的最后一个交易日为 2008 年 6 月 20 日（星期五），从 2008 年 6 月 23 日（星期一）起终止交易。

3、“深发 SFC2”认股权证的行权期为权证存续期的最后 30 个交易日，即 2008 年 5 月 16 日（星期五）至 2008 年 6 月 27 日（星期五）之间的交易日，其中 2008 年 6 月 23 日（星期一）至 2008 年 6 月 27 日（星期五）为不可交易的行权期。

4、“深发 SFC2”认股权证的行权价格为 19.00 元，投资者每持有 1 份“深发 SFC2”认股权证，有权在行权期内以 19.00 元的价格购买 1 股“深发展 A”的股票。

5、本公告前一交易日，“深发展 A”的收盘价格为 27.89 元，“深发 SFC2”认股权证的行权价格为 19.00 元，因此“深发 SFC2”认股权证的内在价值为 8.89 元。

6、采用 Black—Sholes 公式，以本公告前一交易日“深发展 A”收盘价格为 27.89 元、股价波动率 36.83%（本公告前 120 个交易日历史股价波动率）、无风险利率 4.14% 计算（参考一年期定期存款利率），“深发 SFC2”认股权证的理论价值为 9.05 元。

7、本公告前一交易日，“深发 SFC2”认股权证的收盘价格为 10.686 元，溢价率为 6.44%。

8、请投资者注意相关投资风险。

二、特别风险提示

“深发 SFC2”认股权证的行权日为 2008 年 5 月 16 日（星期五）至 2008 年 6 月 27 日（星期五）之间的交易日（其中 2008 年 6 月 23 日至 2008 年 6 月 27 日为不可交易的行权期）。行权终止日未行权的“深发 SFC2”认股权证将予以注销。

特此公告。

深圳发展银行股份有限公司董事会

2008 年 5 月 15 日