

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”认股权证的行权日将近，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、特别提示

根据 2007 年 6 月 26 日公告的《深圳发展银行股份有限公司认股权证上市公告书》，“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 19 日到 2008 年 6 月 27 日之间的交易日。鉴于权证上市后，国务院于 2007 年 12 月 14 日发布了《国务院关于修改〈全国年节及纪念日放假办法〉的决定》，将端午节新增为国家法定假日，深圳证券交易所将于端午节假期期间（2008 年 6 月 7 日至 6 月 9 日）休市。为充分保护投资者权益，确保“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，现将“深发 SFC2”认股权证的行权起始日由原公告的 2008 年 5 月 19 日（星期一）提前至 2008 年 5 月 16 日（星期五），行权终止日仍为 2008 年 6 月 27 日（星期五）。

二、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 30.00 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 11.00 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 30.00 元、股价波动率 36.57%(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 11.18 元。

7、本公告前一交易日，“深发 SFC2”认股权证的收盘价格为 15.27 元，溢价率为 14.23%。

8、请投资者注意相关投资风险。

三、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 4 月 8 日