

## 深圳市能源集团有限公司关于深圳能源投资股份有限公司人民币普通股股票之认沽权证发行及上市公告书

(上接 C57 版)

股权分置改革股份对价实施前后股份结构变动情况如下表:

项目	改革前		改革后	
	股份数量 (股)	股份比例(%)	股份数量 (万股)	股份比例(%)
一、未上市流通股	716,179,151	59.56	690,709,219	54.11
合计	495,546,077		492,381,388	
国家股	664,778,900	56.28	629,388,448	52.34
募集法人股	5,140,019	4.27	21,138,019	1.76
二、已流通股	486,316,181	40.46	561,796,113	45.89
合计	486,316,181	40.46	561,796,113	45.89
人民币普通股	1,202,496,332	100.00	1,202,496,332	100.00
三、股份总数				

注:上表数据未包含认沽权证发行权后的股份结构变动情况。  
权证发行权前后股份结构变动情况如下表:

项目	权证发行前		权证发行权后 (假设全部行权)	
	持股数 (万股)	持股比例 (%)	持股数 (万股)	持股比例 (%)
能源集团	60,383.82	50.22	104,152.27	86.61
其他法人股股东	4,668.83	3.88	4,668.83	3.88

三、标的证券上市公司财务状况  
标的证券上市公司深能源 2003 年、2004 年、2005 年简要财务信息如下:  
1、合并资产负债表主要数据

项目	单位:万元		
	2006年12月31日	2004年12月31日	2003年12月31日
资产总计	1,106,117.09	1,080,419.57	907,917.45
其中:流动资产	499,112.21	494,112.21	492,781.66
负债合计	314,070.33	334,593.36	233,317.22
其中:流动负债	102,756.04	132,341.63	133,942.22
股东权益合计	449,244.27	415,489.57	373,196.48

2、合并利润表主要数据

项目	单位:万元		
	2006年度	2004年度	2003年度
主营业务收入	630,840.67	594,276.06	492,781.66
主营业务利润	178,771.17	162,032.28	167,414.11
营业利润	157,994.01	147,300.74	156,532.51
利润总额	159,662.35	140,859.64	155,175.80
净利润	72,719.80	65,963.89	74,354.91

3、主要财务指标

项目	单位:万元		
	2006年度	2004年度	2003年度
每股收益(元)	0.60	0.55	0.62
每股净资产(元)	3.74	3.46	3.10
净资产收益率(%)	16.19	15.88	19.92
每股经营活动现金流量净额(元/股)	1.72	1.67	1.94
总资产周转率(%)	29.39	30.97	25.70

四、标的证券价格资料  
截止本发行及上市公告书签署之日,本次派发的认沽权证所对应的标的证券在流通股市场、流通市值和交易换手率等方面均符合《权证管理办法》规定的对权证交易的要素:

- 1.最近 20 个交易日的流通 A 股股份市值  
深能源流通 A 股最近 20 个交易日(自 2006 年 1 月 13 日至 2006 年 4 月 7 日)的流通 A 股市值累计为 746.98 亿元,平均每个交易日的流通股股份市值为 37.40 亿元。
- 2.最近 60 个交易日股票交易的累计换手率  
深能源流通 A 股最近 60 个交易日(自 2005 年 11 月 15 日至 2006 年 4 月 7 日)股票交易的累计换手率为 87.97%。
- 3.最近一年成交量情况  
深能源流通 A 股最近一年(自 2005 年 3 月 8 日至 2006 年 4 月 7 日)或

交易量为 962,804,300 股,成交金额累计为 67.42 亿元。

4、最近一年股票交易价格最高价、最低价  
深能源流通 A 股最近一年(自 2005 年 3 月 8 日至 2006 年 4 月 7 日)的最高价和最低价及其出现时间为:

最高价	8.20元	出现时间	2006年4月3日
最低价	6.56元	出现时间	2006年6月3日

5、最近一年股票交易价格的各月末收盘价

时间	2006年						2005年								
	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月
收盘价	7.5	6.26	6.73	7.26	7.14	6.77	6.20	6.33	6.75	6.94	7.64	6.18			

五、投资者查阅标的证券上市公司有关资料的途径和方法  
投资者可以通过以下渠道查阅标的证券上市公司有关资料:  
1、深圳证券交易所网址: http://www.szse.cn  
2、深圳能源投资股份有限公司董事会秘书处

第八节 董事会议事规则

截至本发行及上市公告书签署日,本公司已根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》的规定与深交所的有关要求,就所派发的认沽权证向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提交了由中国建设银行股份有限公司深圳市分行依法经授权出具的总额达 31.16 亿元人民币的不可撤销连带责任履约担保函,以尽可能降低认沽权证的履约风险。

一、履约担保协议的主要条款  
中国建设银行股份有限公司深圳市分行出具担保书的主要条款如下:  
“担保人:持有由被担保人发行的深能源认沽权证的投资者;  
被担保人:深圳市能源集团有限公司;  
本保证担保主债权种类为:被担保人履行其在深能源股权分置改革时派发的认沽权证中的义务;本保证担保主债权数额为:总计叁拾壹亿壹仟陆佰叁拾叁壹萬肆仟零捌拾捌元整(3,116,314,088 元),币种为人民币;  
债务人(被担保人)履行债务的期限:《方案》所述认沽权证存续期内最后 5 个交易日;  
保证方式:不可撤销的连带责任保证;  
保证担保的范围:被保证的主债权及利息、实现债权的费用等;  
保证期间:自《方案》所述行权日前 1 个月起至主债务履行期届满后 6 个月内;本保证的生效日期:本保证自我行签署之日起生效,一经签发,不可撤销;  
法律适用:本保证适用中华人民共和国法律,并根据中华人民共和国法律解释。我行保证在本保证保证期间收到深能源提交的以下文件后,立即在上述担保金额范围内将下述第 3 项文件中资金证明文件要求的金额(最高不超过人民币 3,116,314,088 元整)支付至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的专用资金结算账户中,前述款项专门用于支付被担保人向投资者承担行权义务。  
本保证为连带责任保证担保,一经签发,不可撤销,本保证项下的权利不得转让。若《方案》未获得深能源相关股东会议通过,或被担保人履行了行权义务,或本保证担保期间届满,则本保证自动失效。”二、认沽权证持有人的基本情况  
中文名称:中国建设银行股份有限公司  
英文名称:CHINA CONSTRUCTION BANK CORPORATION  
成立日期:2004 年 9 月 17 日  
注册资本:人民币 224,689,000,000 元  
法定代表人:郭树清注册地址:北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址:北京市西城区金融大街 25 号  
授权人:中国建设银行股份有限公司  
被授权人:中国建设银行股份有限公司深圳市分行  
邮政编码:518010

联系人:钱彤彤

联系电话:0755-82228704

传真:0755-82228824

三、认沽权证履约担保人与发行人关系说明

中国建设银行股份有限公司与深圳市能源集团有限公司不存在股权关系,深圳市能源集团有限公司为中国建设银行股份有限公司重点客户之一。

四、权证履约担保入 2005 年经审计的主要财务数据

项目	单位:人民币亿元	
	2005年	2004年
总资产	45857.42	42980.05
股东权益	2676.77	
净利润	470.96	
流动性比例(人民币资产)	59.08%	
流动性比例(外币资产)	108.68%	
核心资本充足率	11.8%	

六、认沽权证履约担保入有关资料的查询途径  
认沽权证履约担保入有关资料可从以下渠道查询:  
中国建设银行网站: http://www.ccb.cn

第九节 权证主要交易商

本公司已委托国泰君安证券股份有限公司与招商证券股份有限公司担任本次派发的认沽权证上市后的主交易商,双方已签署了《认沽权证主交易商服务协议》。

一、权证主交易商基本情况  
公司名称: 国泰君安证券股份有限公司  
法定代表人: 祝幼一  
注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号  
注册资本: 四十七亿元人民币  
公司名称: 招商证券股份有限公司  
法定代表人: 宫少林注册地址: 深圳市益田路江苏大厦 A 座 38—45 楼  
注册资本: 二十四亿零二千万零陆百三十捌元人民币  
二、主交易商义务  
1、在认沽权证存续期间,当权证交易价格差超过权证最近成交价格的 3%时,主交易商对上述权证进行双向报价,出现下列情况之一时除外:  
(1) 持有权证数量为零;  
(2) 权证交易价格低于申报价格最小变动单位时;  
(3) 无法根据风险对冲策略进行风险对冲,并经深交所认可的;  
(4) 权证暂停交易;(5) 交易系统出现技术问题,并经深交所认可的;  
(6) 深交所认定的其他情况。  
2、双向报价的最大价差不得超过权证最近成交价格的 3%与 50 个权证申报价格最小变动单位的较大值。  
3、当主交易商持有权证数量为 0 且权证交易状况已严重影响深圳市能源集团有限公司市场形象时,主交易商将停止买入单向报价。第十节 权证交易与行权  
一、认沽权证交易与行权程序  
1、根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》以及深交所和登记结算公司的有关规定,经深交所和登记结算公司认定,同时取得权证交易资格和结算资格的证券公司,可以自营或代理投资者买卖权证。单笔权证买卖申报数量不得超过 100 万份,申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币。权证买入申报数量为 100 份的整数倍,当日买入的权证,当日可以卖出。

2、认沽权证证券代码:038005

3、认沽权证证券简称:深能 JTP1

4、认沽权证持有人行权的,应委托深交所会员通过深交所交易系统申报;认沽权证行权以份为单位进行申报;当日行权申报指令,当日有效,当日可以撤销。认沽权证的持有人行权时,应交付标的证券,并取得依照行权价格及标的证券数量计算的价款。

5、认沽权证上市交易日:2006 年 4 月 27 日

6、认沽权证的上市数量:437,684,562 份

7、根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》的规定,认沽权证存续期间前 5 个交易日,认沽权证终止交易,但可以行权。

二、认沽权证行权价格和行权比例的调整  
标的证券除权、除息的,认沽权证的行权价格和行权比例将按以下规则调整:1、标的证券除权时,认沽权证的行权价格、行权比例将按以下公式调整:  
新行权价格 = 原行权价格 × (标的证券除权日参考价 / 除权前一交易日标的证券收盘价);

新行权比例 = 原行权比例 × (除权前一交易日标的证券收盘价 / 标的证券除权日参考价)。

2、标的证券除息时,认沽权证的行权比例保持不变,行权价格按下列公式调整:  
新行权价格 = 原行权价格 × (标的证券除息日参考价 / 除息前一交易日标的证券收盘价)三、认沽权证的理论价值分析  
认沽权证的理论价值可以按国际通行的权证估值模型 Black-Scholes 期权定价模型测算。本次派发的认沽权证的行权价为 7.12 元/股,截至 2006 年 4 月 7 日深能源收盘价格为 8.18 元/股,假设支付认沽权证时标的证券价格为 6.98 元/股,标的证券价格的波动率为 33.16%,无风险利率为 1.6500%,并依据认沽权证的存续期等其他要素,则每份认沽权证的理论价值为 0.6960 元。注:1、无风险利率参考半年期银行定期存款利率并考虑税后因素。  
2、本认沽权证作为深能源 A 股派发的衍生品,价值与深能源股票价值密切相关;上述理论价值分析均为模拟计算,上市后本认沽权的实际价值将受深能源股当日交易价格及其他因素的影响而波动;

3、该理论价值并非本认沽权证上市当日的开盘参考价格,根据有关规定,相应权证上市当日开盘参考价格将由保荐机构计算后提交给深交所,保荐机构将按照上述 Black-Scholes 公式,依据权证上市前一交易日标的证券的收盘价格计算权证上市日的开盘参考价;

4、权证交易实行涨跌幅限制,涨跌幅的计算公式为:  
权证涨跌幅 = 权证前一日收盘价 + (标的证券当日涨幅价格 - 标的证券前一日收盘价) × 125% × 行权比例

权证跌幅价格 = 权证前一日收盘价 - (标的证券前一日收盘价 - 标的证券当日跌幅价格) × 125% × 行权比例

当其计算结果小于等于零时,权证跌幅价格为价格最小变动单位。其中,权证上市当日的前一日收盘价格为权证上市当日的开盘参考价。

第十一章 备置文件

1、深圳能源投资股份有限公司股权分置改革说明书(修订稿);

2、深圳市人民政府国有资产监督管理委员会《关于深圳能源投资股份有限公司股权分置改革有关问题的批复》;

3、深交所深证上[2006] 号文《关于深圳市能源集团有限公司权证发行及上市交易的通知》;

4、深圳市能源集团有限公司 2002 年、2003 年、2004 年审计报告;

5、国浩律师集团《深圳》事务所之法律意见书;

6、深圳市能源集团有限公司承诺函。

深圳市能源集团有限公司  
法人代表:高自民  
2006 年 4 月 21 日

证券代码:000027 证券简称:深能源 A 编号:2006-021

## 深圳能源投资股份有限公司关于股权分置改革方案实施公告

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,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示:  
■深圳能源投资股份有限公司(以下简称“公司”或“深能源”)全体非流通股股东拟向流通股股东实施股权分置改革方案变更登记日登记在册的流通股股东每 10 股支付 1.35 股股份及 2.60 元现金;能源集团拟向流通股股东每 10 股派发 9 份百慕大式认沽权证,存续期为 6 个月,行权价为 7.12 元/股,认沽权证的证券简称为“深能 JTP1”,证券代码为 038005。

■流通股股东本次获得的对价不需要纳税。

■股权分置改革方案实施变更登记日为 2006 年 4 月 25 日;派发认沽权证的股权登记日为 2006 年 4 月 25 日。

■对价股份与现金到账日期为 2006 年 4 月 26 日;认沽权证的到账日期为 2006 年 4 月 26 日。自 2006 年 4 月 26 日起,公司非流通股股东所持有的原非流通股股份获得流通股,转为有限售条件的流通股股份。

■对价股份上市交易日为 2006 年 4 月 26 日;认沽权证上市交易日为 2006 年 4 月 27 日。

■公司股票于 2006 年 4 月 26 日复牌,对价股份上市流通,股票简称由“深能源”变更为“G 深能源”,股票代码“000027”保持不变。复牌当日公司股票不计算对价除权参考价,不设涨跌幅限制,不纳入当日指数计算。

■认沽权证上市有关事宜详见同日公告的《认沽权证发行及上市公告书》。

深圳能源投资股份有限公司(以下简称“深能源”或“公司”)股权分置改革方案实施事宜公告如下:  
一、股权分置改革方案的表决情况

深圳能源投资股份有限公司股权分置改革方案已经 2006 年 4 月 18 日召开的公司股权分置改革相关股东会议表决通过。表决结果公告刊登在 2006 年 4 月 19 日的《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和深圳证券交易所网站: http://www.szse.cn。

二、股权分置改革方案的主要内容  
1、本次股权分置改革对价方案:  
公司非流通股股东为获得其所持股份的流通股向流通股股东安排的对价:

公司非流通股股东向方案实施股份变更登记日登记在册的流通股股东共计支付 65,652,684 股股份,方案实施股份变更登记日登记在册的流通股股东每持有 10 股流通股将获得非流通股股东支付的 1.35 股股份;

公司非流通股股东向方案实施股份变更登记日登记在册的流通股股东共计支付 126,442,207.06 元现金,方案实施股份变更登记日登记在册的流通股股东每持有 10 股流通股将获得非流通股股东支付的 2.60 元现金;

深圳市能源集团有限公司(以下简称“能源集团”)向方案实施股份变更登记日登记在册的流通股股东派发 437,684,562 份认沽权证,即流通股股东每持有 10 股流通股将获得 9 份认沽权证,每份认沽权证赋予权证持有人可行权日(认沽权证存续期内最后 5 个交易日,即 2006 年 10 月 21 日至 2006 年 10 月 26 日期间的交易日)以 7.12 元/股的价格向能源集团出售 1 股深能源股票的权利。

2、流通股股东本次获得的对价不需要纳税。

3、公司全体非流通股股东将遵守法律、法规和规章的规定,履行法定承诺义务。

三、股权分置改革方案实施进程

序号	日期	事项	是否停牌
1	2006 年 4 月 24 日	刊登股权分置改革方案实施公告; 刊登权证上市公告书。	继续停牌
2	2006 年 4 月 25 日	股权分置改革方案实施的股份变更登记日; 派发认沽权证的股权登记日。	继续停牌
3	2006 年 4 月 26 日	流通股股东获得对价股份的到账日; 流通股股东派发的认沽权证的到账日; 自 2006 年 4 月 26 日起,公司非流通股股东所持有的原非流通股股份获得流通股,转为有限售条件的流通股股份。 股票复牌和对价股份上市交易日; 股票简称由“深能源”变更为“G 深能源”; 复牌当日公司股票不计算对价除权参考价,不设涨跌幅限制,不纳入指数计算。	股票复牌
4	2006 年 4 月 27 日	派发的认沽权证上市交易日; 认沽权证的涨跌幅限制遵守《深圳证券交易所权证管理暂行办法》相关规定; 深能源股票交易复牌,不设涨跌幅限制,以前一交易日为基准纳入指数计算。	正常交易

公司非流通股股东深能源集团派发的认沽权证上市的有关事宜详见同日公告的《认沽权证发行及上市公告书》。

四、股权分置改革方案实施办法  
公司非流通股股东执行对价安排情况如下表:

执行对价 股东名称	拟执行对价		本次执行对价		执行对价安排后	
	持股数 (万股)	持股比例 (%)	股份数量 (万股)	现金数量 (万元)	持股数 (万股)	持股比例 (%)
能源集团	68,477.90	56.29	6,094.08	11,728.74	60,383.82	50.22
其他法人股股东	5,140.02	4.27	471.19	907.48	4,668.83	3.88

1、对价股份支付办法  
根据对价安排,流通股股东所获得的股份,由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司根据股权分置改革方案实施的股份变更登记日登记在册的流通股股东持股数,按每 10 股获送 1.35 股的比例自动记入账户。流通股股东所持对价股份按计算后不足一股部分的处理办法,按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司上市公司权益分派及配股登记业务运作指引》中的零碎股处理方法处理。2、权证派发办法  
能源集团委托中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司,按照每 10 股流通股派发 9 份认沽权证的比例向股权登记日登记在册的流通股股东派发 437,684,562 份认沽权证。流通股股东所获权证按比例计算后不足一份部分的处理方法,按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司上市公司权益分派及配股登记业务运作指引》中的零碎股处理方法处理。3、认沽权证行权履约担保的说明  
能源集团已根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》的规定与深圳证券交易所有关要求,就所派发的认沽权证向中国证券登记结算有限责任公

司深圳分公司提交了由中国建设银行股份有限公司深圳市分行出具的 31.16 亿元人民币的不可撤销连带责任履约担保函。

五、方案实施前后股份结构变动  
改革方案实施前后,公司股份结构变动情况列表如下:

项目	改革前		改革后	
	股份数量 (股)	股份比例 (%)	股份数量 (万股)	股份比例(%)
一、未上市流通股	716,179,151	59.56	690,709,219	54.11
合计	495,546,077		492,381,388	
国家股	664,778,900	56.28	629,388,448	52.34
募集法人股	5,140,019	4.27	21,138,019	1.76
二、已流通股	486,316,181	40.46	561,796,113	45.89
合计	486,316,181	40.46	561,796,113	45.89
人民币普通股	1,202,496,332	100.00	1,202,496,332	100.00
三、股份总数				

注:1、本表数据未包含认沽权证发行权后的股份结构变动情况;  
2、本表中的限售条件是指根据股权分置改革相关法律、法规的要求和公司非流通股股东的承诺,给予原非流通股股东所持公司非流通股股份的相关限售条件。

本次股权分置改革方案实施后,公司股东的持股数量和持股比例将发生变动,但本公司股本总数不因方案的实施而发生变化。

六、有限售条件的股份可上市流通的预计时间安排

股东名称	所持有限售条件股份(万股)	占总股本比例	可上市流通时间	承诺限售条件
深圳市能源集团有限公司	6,012.48	5.0000%	G+12个月之后	注 1
	6,012.48	5.0000%	G+24个月之后	
	48,388.86	40.2154%	G+36个月之后	
广东电力发展股份有限公司	746.65	0.6239%		
陕西电力建设总公司	477.77	0.3973%		
深圳市“福沙”电力有限公司	346.21	0.2879%		
广东核电投资有限公司	332.36	0.2764%		
广东粤能(集团)有限公司	276.97	0.2303%		
深圳市天行能科技有限公司	276.97	0.2303%		
深圳鸿基(集团)股份有限公司	276.97	0.2303%		
深圳市投资管理公司	276.97	0.2303%		
秦皇岛港务总公司	276.97	0.2303%		
深圳佳鑫高新技术开发有限公司	169.26	0.1408%		
深圳市能源运输有限公司	166.18	0.1382%		
大同铁路万泰实业有限公司	138.48	0.1152%	G+12个月之后	注 2
哈尔滨电站设备集团有限公司	138.48	0.1152%		
龙源电力集团公司	138.48	0.1152%		
广州海运(集团)有限公司	138.48	0.1152%		
昆山华新能源实业公司	124.64	0.1036%		
深圳外拓投资企业协会	69.24	0.0576%		
综合开发研究院	69.24	0.0576%		
杭州福耀玻璃有限公司	69.96	0.0499%		
上海万景投资管理有限公司	43.65	0.0363%		
深圳市丰大物业管理设备有限公司	34.88	0.0290%		
深圳市儿童福利会	34.62	0.0285%		
深圳市金达科技实业有限公司	27.70	0.0230%		
深圳市科学技术协会	27.70	0.0230%		

股票代码:000958 股票简称:东方热电 公告编号:2006-008

石家庄东方热电股份有限公司  
关于进行股权分置改革的提示性公告

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。

根据《关于上市公司股权分置改革的指导意见》、《上市公司股权分置改革管理办法》、《上市公司股权分置改革业务操作指引》等有关规定,公司第一大股东石家庄东方热电集团有限公司等非流通股股东提出了股权分置改革动议,公司董事会委托的保荐机构东方证券股份有限公司正在就公司股权分置改革方案的可行性和相关事项作出相关安排,并与深圳证券交易所协商,现将有关事项公告如下:  
一、公司股票自本公告发布之日起开始停牌;二、公司将依据股权分置改革工作的进展适时于近期披露股权分置改革相关文件。  
特此公告。

石家庄东方热电股份有限公司董事会

2006 年 4 月 21 日

股票简称:苏常柴 A、苏常柴 B 股票代码:000570