

会员客户交易行为管理指引

关于发布《会员客户交易行为管理指引》的通知

各会员单位：

为维护市场秩序,加强会员对客户交易行为的规范,明确会员管理职责,根据深圳证券交易所《会员管理规则》及《交易规则》,现发布《会员客户交易行为管理指引》(以下简称指引),请遵照执行。现将有关事项通知如下:

1. 自2007年10月8日起,会员应当于每个交易日登陆本所“会员业务专区-监管信息”栏目,查阅本所对其定向发送的限制交易账户及监管关注账户名单。

2. 会员应当对限制交易账户、监管关注账户进行自查,并

应。

第十四条 客户委托他人代为从事证券交易及其他相关业务,会员应当要求客户本人及受托人到会员营业部当面签署书面授权委托书,并在授权委托书中载明有效期限和授权范围,但客户已提供经公证的书面授权委托书的除外。

第十五条 会员不得为一个资金账户下挂多个证券账户、机构使用个人证券账户等违法违规行为提供便利。

会员如发现客户存在以他人名义设立证券账户或者利用他人证券账户买卖证券等违法违规行为的,应当要求客户立即纠正,并及时向本所报告。

第十六条 会员应当在柜台交易系统中设置前端控制,对客户的一笔委托申报所涉及的交易资格、资金、证券、价格等内容进行审核,确保客户委托申报符合本所规则的规定。

会员还应当留存客户电话委托号码、网上交易IP等信息。

第十七条 会员应当于每个交易日登陆本所“会员业务专区”有关监管信息的栏目,查阅本所对其定向发送的限制交易账户及监管关注账户名单。

前款所述限制交易账户,指正在被本所限制交易或近三年内曾被本所限制交易的账户;前款所述监管关注账户,指本所在证券交易所市场监察中出现的出现异常交易行为的证券账户。

第十八条 会员应当设置交易监控系统,对下列证券账户的交易行为进行重点监控:

- (一)由证券监督管理部门提供的涉嫌违法违规交易的账户;
- (二)本所所列限制交易的账户或监管关注账户;
- (三)不合格账户;
- (四)其他需要重点监控的账户。

自得知上述账户名单之日起五个交易日内,向本所提交书面自查报告,自查报告以WORD文档形式,通过“会员业务专区-会员公文上传”栏目提交。

联系人:张光毅 何卫东

联系电话:0755-25918151,25918309

特此通知

附件:《会员客户交易行为管理指引》

深圳证券交易所
二〇〇七年九月三日

会员发现上述账户继续发生涉嫌违法违规交易行为的,应当及时提醒并要求其纠正,对拒不纠正的,可以拒绝接受委托,并及时向本所报告。

第十九条 会员应当对限制交易的账户、监管关注账户的下列信息自行查:

(一)营业部是否与客户签订了规范的证券交易委托协议,是否了解客户的真实身份及资信状况,是否向客户充分揭示风险;

(二)客户是否委托他人代为进行证券交易,委托人和受托人之间是否已办理完备的授权委托手续,营业部是否了解该账户的开户人、实际控制人或者实际操作人的真实身份及资信状况;

(三)营业部是否保存客户及其代理人的有效联系地址、联系电话等详细信息;

(四)开户人、实际控制人或实际操作人是否开立了其他证券账户或资金账户,资金账户是否下挂了其他证券账户;

(五)本所要求自查的其他信息。

会员应当自得知上述账户名单之日起五个交易日内,向本所提交书面自查报告。

第二十条 对限制交易账户、监管关注账户,会员应当及时将相关情况通知该账户的开户人、实际控制人以及实际操作人,要求其规范交易行为,并对其进行合法合规交易教育。

第四章 自律监管协助

第二十一条 会员应当建立监管协助制度,制定监管协助流程,明确具体负责及联络人员,协助本所对客户异常交易行为进行自律监管。

第二十二条 会员及其营业部因客户出现异常交易行为收到本

所口头警示或书面警示函后,应当及时与客户取得联系,传达本所的相关监管信息,规范和约束客户交易行为。

第二十三条 会员及其营业部应当配合本所进行相关调查,及时、真实、准确、完整地提供客户开户资料、授权委托书、资金存取凭证、资金账户情况以及相关交易情况说明等资料。

本所要求会员及其营业部协助了解相关账户实际控制人情况、资金背景、交易动机以及相关账户实际控制人控制的其他账户等情况的,会员及其营业部应当及时进行调查,并按照本所要求的方式提供相关资料或说明材料。

第二十四条 会员及其营业部收到本所有关清理不合格证券账户的监管文件或要求有关客户提交合规交易承诺书时,应当及时向客户传达本所的监管要求,并采取有效措施,督促客户清理不合格证券账户或提交合规交易承诺书。

合规交易承诺书包括但不限于以下内容:

(一)严格遵守证券法律法规和本所业务规则的规定,合法合规地参与证券交易;

(二)愿意配合本所及相关会员采取相应的措施;

(三)自行承担因其违法违规行为而产生的法律后果。

第二十五条 会员及其营业部收到本所有关调查函、监管函等监管文件时,应当注意保密,未经本所许可,不得将监管文件的内容以任何方式泄露给任何与该监管文件无关的第三方。

第二十六条 会员应当积极配合本所就客户异常交易行为相关事宜约见会员高级管理人员及相关人员。对本所在约见时提出的监管意见,会员应当按要求认真落实,采取有效措施督促客户消除异常交易行为对市场秩序的影响。

第二十七条 本所对会员遵守和执行本指引的情况进行专项检查。

对违反本指引有关规定的会员,本所按照《会员管理规则》的规定,采取相应的监管措施或纪律处分。

第五章 附则

第二十八条 本指引下列用语具有如下含义:

(一)异常交易行为:指本所《交易规则》第6.1条所列的异常交易行为。

(二)不合格账户:指不符合合格账户要件的账户。合格账户是指开户资料真实、准确、完整,投资者身份真实,资产权属关系清晰,证券账户与资金账户实名对应,符合账户相关规定的账户。

(三)限制交易:指本所根据《深圳证券交易所限制交易实施细则》,对出现重大异常交易情况的证券账户采取限制买卖的措施。

第二十九条 本指引由本所负责解释。

第三十条 本指引自发布之日起施行。

证券代码:000799 证券简称:s*st 酒鬼 公告编号:2007-51

酒鬼酒股份有限公司
股权分置改革进展公告

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。

本公司于2007年2月15日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮网(<http://www.cninfo.com.cn>)上刊载了公司股权分置改革方案沟通情况调整股权分置改革方案。

由于本次股权分置改革中皇有限公司收购酒鬼酒股份有限公司股权组合件,本公司股权分置改革相关股东会议须在国家相关主管部门批复同意后召开。截止公告日,中皇有限公司收购酒鬼酒公司股权事宜已经国家商务部批复同意,中皇有限公司收购报告书及豁免要约收购材料已报中国证监会备案,尚未正式受理,故公司尚未确定股东大会召开时间。本公司将根据进展情况作好信息披露工作,请投资者留意公司相关公告。

酒鬼酒股份有限公司董事会
2007年8月31日

申万巴黎基金管理有限公司
关于高管人员变更的公告

申万巴黎基金管理有限公司(以下简称“本公司”)总经理唐嘉明先生基于个人原因,已向本公司董事会提出辞职。董事会经讨论,于2007年8月30日作出决议,同意唐嘉明先生辞去总经理职务,并指定本公司副总经理过振华先生为代理总经理。以上事项已按规定上报中国证监会。

特此公告。

申万巴黎基金管理有限公司
2007年9月3日

股票简称:ST 攀钢 股票代码:000569 编号:2007-038

攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司重大事项进展公告

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

本公司于8月10日发布了《重大事项停牌公告》,因公司实际控制人攀钢(集团)公司存在与本公司有关的重大事项需要协商,本公司股票自2007年8月13日起临时停牌。

经向攀钢钢铁(集团)公司询问,目前攀钢钢铁(集团)公司仍在就该项事项的有关问题与有关部门、单位进行沟通、协商,该事项仍存在重大不确定性。

本公司股票自2007年9月3日起继续停牌,直至相关事项初步确定并予以披露后复牌。

攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司董事会
二〇〇七年九月三日

股票代码:000629 股票简称:攀钢钒钢 公告编号:2007-42

攀枝花新钢钒股份有限公司
重大事项进展公告

本公司及其董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司于2007年8月13日、8月20日、8月27日公告实际控制人攀钢(集团)公司有重大事项需与公司协商,经向攀钢(集团)公司询问,目前攀钢(集团)公司正就该事项的有关问题与相关部门、单位进行沟通、协商,该事项仍存在重大不确定性,本公司:

1. 股票简称:“攀钢钒钢”,股票代码:000629
2. 认股权证简称:“钢钒 GPC1”,权证代码:031002

将继续停牌,直至相关事项初步确定并予以披露后恢复交易。

攀枝花新钢钒股份有限公司董事会
二〇〇七年八月三十一日

(上接八)

经毕马威会计师事务所审计,截至2006年12月31日,ING银行总资产为8,949.85亿欧元,净资产为225.02亿欧元,2006年度净利润为38.13亿欧元。

(二)北京市国有资产经营有限责任公司
北京市国有资产经营有限责任公司是北京市授权的国有独资公司。该公司注册资本人民币50亿元,法定代表人李爱庆,注册地址北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座16层,主要经营业务为:货物进出口、技术进出口;代理进出口;法律、行政法规、国务院决定规定应经许可的,经审批机关批准并经工商行政管理机关登记注册后方可经营;法律、行政法规、国务院决定未规定许可的,自主选择经营项目开展经营活动。

截至2006年12月31日,北京市国有资产经营有限责任公司总资产为1,930,165.57万元,净资产为1,054,573.19万元,2006年度净利润为20,140.14万元(以上数据经北京京都会计师事务所审计)。

(三)北京能源投资(集团)有限公司
北京能源投资(集团)有限公司为北京市人民政府国有资产监督管理委员会出资设立的国有独资公司,2004年12月8日由原北京国际电力开发投资公司和原北京市综合投资公司合并重组成立。该公司注册资本人民币88亿元,法定代表人李凤玲,注册地址为北京市西城区复兴门内大街2号甲天银大厦A座9层,主要经营业务为:法律、行政法规、国务院决定禁止的,不得经营;法律、行政法规、国务院决定未规定许可的,经审批机关批准并经工商行政管理机关登记注册后方可经营;法律、行政法规、国务院决定未规定许可的,自主选择经营项目开展经营活动。

截至2006年12月31日,北京市能源投资(集团)有限公司总资产为4,198,247.83万元,净资产为1,232,855.38万元(以上数据未经审计)。

(四)国际金融公司(IFC)
国际金融公司(IFC)系其会员国于1956年依据《国际金融协定》而成立的国际组织,注册地址为2121 Pennsylvania Avenue, N.W. Washington D.C., 20043 USA,共有178个国家会员,实收资本为23.65亿美元(截至2006年6月30日)。作为世界银行集团中一员,国际金融公司的宗旨是促进发展中国家私营部门的可持续投资,为发展中国家的债权与股权投资提供多方位金融渠道,并为政府机构和民营企业提供技术支持。

截至2006年6月30日(国际金融公司财政年度截至日为每年的6月30日),该公司总资产384.20亿美元,净资产110.76亿美元,截至2006年6月30日止的财政年度的净利润12.78亿美元(以上数据经德勤会计师事务所审计)。

十一、财务会计信息及管理层的讨论与分析
(一)主要会计数据和财务指标

项目	2007年3月31日	2006年12月31日	2005年12月31日	2004年12月31日
总资产	263,981	272,969	233,044	202,940
贷款余额	132,927	129,577	111,783	109,026
总负债	253,660	263,129	225,202	199,465
存款余额	222,588	233,090	198,547	173,527
股东权益	10,321	9,840	7,842	3,475

2.本行经审计的利润表的主要数据如下:

项目	2007年1-3月	2006年度	2005年度	2004年度
利息净收入	1,520	5,491	4,118	4,050
营业利润	1,189	3,062	2,295	1,865
利润总额	1,189	3,082	2,331	1,968
净利润	550	2,140	1,686	1,384

3.本行经审计的现金流量表的主要数据如下:

项目	2007年1-3月	2006年度	2005年度	2004年度
经营活动产生的现金流量净额	(13,517)	20,720	5,599	20,225
投资活动产生的现金流量净额	1,018	(22,706)	(12,349)	(9,056)
筹资活动产生的现金流量净额	-	(380)	6,085	642
现金及现金等价物净增加额	(12,499)	(2,368)	(668)	11,810

4.本行主要财务指标如下:

项目	2007年1-3月	2006年度	2005年度	2004年度
按照归属于本行普通股股东的净利润计算				
基本每股收益(元)	0.11	0.43	0.43	0.41
稀释每股收益(元)	0.11	0.43	0.43	0.41
按照扣除非经常性损益后归属于本行普通股股东的净利润计算				
基本每股收益(元)	0.11	0.42	0.43	0.39
稀释每股收益(元)	0.11	0.42	0.43	0.39
按照归属于本行普通股股东的加权平均净资产收益率(%)	5.33	22	21	40
按照扣除非经常性损益后归属于本行普通股股东的加权平均净资产收益率(%)	5.46	24	34	51
按照归属于本行普通股股东的全面摊薄净资产收益率(%)	5.33	22	21	38
按照扣除非经常性损益后归属于本行普通股股东的全面摊薄净资产收益率(%)	5.46	24	34	48

(二)主要监管指标

下表所列截至所示日期,商业银行依据人民银行于1996年颁布的《商业银行资本充足率比例管理监控、监测指标和考核办法》和其他相关法规规定的若干运营比率,以及本行向人民银行和银监会申报的若干运营比率。

指标值	2005年12月31日	2004年12月31日
核心资本充足率	≥4%	7.59%
资本充足率	≥8%	12.06%
不良贷款率	≤5%	4.38%
拨备覆盖率	≥60%	81.99%
单一客户贷款比例	≤10%	24.61%
最大十家客户贷款比例	≤50%	96.76%
单一最大集团客户授信比例	≤15%	13.56%
流动性比例(人民币)	≥25%	70.87%
流动性比例(外币)	≥60%	146.58%
存贷比(人民币)	≤75%	52.80%
存贷比(外币)	≤85%	33.29%
拆入资金比例	≤4%	0.00%
拆出资金比例	≤8%	0.39%

下表所列截至2007年3月31日和2006年12月31日,按《商业银行风险监管核心指标(试行)》计算的与本行相关比率情况:

指标类别	一级指标	二级指标	指标标准	2007年3月31日	2006年12月31日
风险水平类	流动性风险	流动性比例	≥25%	外币:67.56%	人民币:71.30%
		流动性缺口率	≤(10%)	外币:202.86%	人民币:114.01%
		核心负债依存度	≥60%	65.18%	61.77%
		流动性缺口率	≥(10%)	(8.64%)	7.28%
信用风险	不良资产率	不良资产率	≤4%	1.99%	2.11%
		不良贷款率	≤5%	3.34%	3.58%
		单一集团客户授信集中度	≤15%	12.97%	17.53%
		单一客户贷款集中度	≤10%	9.87%	14.07%
		全部关联度	≤50%	7.85%	8.01%
市场风险	累计外汇敞口头寸比例	≤20%	0.00%	2.72%	
风险抵补类	资本充足率	资本充足率	≥8%	19.65%	27.97%
		盈利能力	≥0.6%	0.82%	0.85%
		资产利润率	≥11%	21.85%	24.21%
		资本利润率	≥100%	100.00%	100.00%
		准备充足率	≥100%	100.00%	100.00%
		贷款损失准备充足率	≥100%	100.00%	100.00%
		资本充足程度	≥8%	13.23%	12.78%
		资本充足率	≥4%	8.99%	8.60%

(三)管理层对本行近三年财务状况和经营成果的分析与讨论

1.资产负债重要项目分析
(1)主要资产分析

截至2007年3月31日,本行总资产为2,639.81亿元,较2006年12月31日下降3.3%。截至2006年12月31日,本行总资产为2,729.69亿元,较2005年12月31日下降2,330.44亿元增长17.1%;截至2005年12月31日的本行总资产较2004年12月31日的2,029.40亿元增长14.8%。近年来,本行总资产的快速增长主要归因于本行资产组合中的两项重要资产-客户贷款和证券投资的增长,反映出本行业务的整体增长。

(2)主要负债分析
截至2007年3月31日,本行总负债合计为2,536.60亿元,较2006年12月31日的2,631.29亿元下降3.6%;截至2006年12月31日,本行总负债合计为2,631.29亿元,较2005年12月31日的2,252.02亿元增长16.8%;截至2005年12月31日,本行总负债2,252.02亿元,较2004年12月31日的1,994.65亿元增长12.9%。客户存款为本行主要的资金来源,截至2006年12月31日、2005年12月31日和2004年12月31日分别占本行总负债的88.6%、88.2%和87.0%。

2.利润表重要项目分析
本行2006年的净利润为21.40亿元,比2005年的16.86亿元增长了27.0%,2005年的净利润比2004年的13.84亿元增长了21.8%。

本行的净利润在2004年至2006年期间的增长主要是以下因素综合作用的结果。

- 本行利息净收入的复合年增长率为16.4%;
- 净手续费和佣金收入的年复合增长率为21.91%;
- 投资收益从2004年到2006年增长了近十倍;
- 公允价值变动亏损从2004年到2006年一直保持下降的趋势;
- 汇兑收益2006年比2005年增长了2倍多,且从2004年到2006年一直保持上升的趋势;
- 营业税金及附加从2004年到2006年保持上升的趋势;
- 2006年本行的减值损失准备比2005年增长1倍多,2005年比2004年下降39.3%;
- 营业外净收入从2004年到2006年保持下降的趋势;
- 本行所得税费用的复合年均增长率为27.0%。

净利息收入

利息净收入历来是本行营业收入的最大组成部分,2006年、2005年和2004年度的利息净收入分别占本行营业收入的96.3%、98.0%和100.8%。

非利息收入

2006年,本行手续费及佣金净收入1.75亿元,较2005年增长191.01%;主要原因为各项手续费及佣金收入均增长,主要包括代理手续费收入,结算与清算手续费收入,银行卡手续费收入,同时手续费支出减少32.1%。2005年本行手续费及佣金净收入0.60亿元,较2004年的0.48亿元增长25.4%,主要原因为各项手续费及佣金收入均增长,主要包括代理手续费收入,结算与清算手续费收入,银行卡手续费收入,同时部分地为手续费支出增加而抵销。手续费及佣金净收入变化的主要原因是本行为推动业务发展和盈利模式转变,加强了对中间业务资源投入和营销拓展。

(四)股利分配情况
1.股利分配政策
弥补上一年度的亏损;提取10%作为法定公积金;提取一般准备;提取任意公积金;支付股东股利。

本行法定公积金计提为本行注册资本的50%以上的,将不再提取。提取法定公积金和一般准备后,是否提取任意公积金由股东大会决定,本行不得在弥补本行亏损和提取法定公积金和一般准备以前向股东分配利润。

本行股利分配采取现金、股票及其他合法的方式。

2.本行近三年股利分配情况
本行2004年度分配普通股股利210,325,407.47元。本行2005年度分配普通股股利204,583,039.92元。本行2006年度分配普通股股利301,653,712.86元(尚未实施)。

3.本行发行前滚存利润分配政策
本行于2007年4月25日召开的2006年度股东大会审议通过了《关于发行前滚存利润分配方案的议案》,本行在实施2006年度利润分配方案后,未分配利润为0元。由于新旧会计准则变更形成的累计未分配利润的差异,计入本行风险资产一般准备。若本行于2007年12月31日前发行上市,则本行拟自2007年1月1日至上市日期间实现的可供分配利润,由新老股东共享。若本行未能在2007年12月31日前发行上市,则本行2007年度实现的净利润由老股东享有。2008年1月1日至本行上市日实现的可供分配利润由新老股东共享。

4.本行发行前滚存利润分配政策
本行于2007年4月25日召开的第二次股东大会审议通过了本次发行募集资金使用方案,本次股东大会募集资金扣除发行费用后,将全部用于补充本行资本金,以支持业务持续发展。

第五节 风险因素和其他重要事项

一、风险因素
(一)与本行业务有关的风险

1.如果本行不能有效保持本行贷款组合的质量,本行的财务状况和经营业绩将受到重大不利影响;

2.本行可能将进一步增加贷款损失的拨备,以覆盖未来贷款组合的实际损失;

3.本行的贷款损失准备根据中国企业会计准则确定,如中国企业会计准则或其应用解释将来有任何修订,本行可能需要更改现行的贷款损失准备政策;

4.本行贷款的抵押物、质押物或保证等担保可能不足,本行可能无法变现抵押物、质押物或保证的全部价值;

5.本行业务面临客户在国内资本市场发行证券等直接融资方式的竞争,这种竞争将对本行利息收入的稳定产生不利影响;

6.本行对一些贷款和客户有较高的依赖;

7.本行大多数贷款和客户主要集中在北京,如北京经济发生重大下滑,将可能对本行的财务状况和经营业绩造成重大不利影响;

8.本行可能不能成功扩张本行的经营地域、客户基础以及产品服务;

9.本行不能保证本行的风险管理、内部控制政策和程序能充分保证本行抵御所有的信用风险和其他风险;

10.本行可能不能有效发现和防止员工或其他第三方的诈骗或其他不当行为;

11.本行的投资多样化能力受限于我国若干法规规定,因此,某项特定投资价值的下降可能对本行的财务状况和经营业绩造成重大的不利影响;

12.本行在一些承诺或担保事项方面面临信用风险;

13.本行在衍生交易中面临交易对手的风险;

14.本行的业务高度依赖于本行的信息技术系统的良好运行和不断完善;

15.本行可能不能满足监管机构对资本充足率的要求;

16.本行需要遵守我国许多监管政策的要求。如果不满足这些监管政策的规定,将可能对本行的业务、财务状况、经营业绩和声誉造成重大不利影响;

17.本行面临流动性风险;

18.本行不拥有某些物业的土地使用权证和房产证。同时,可能因出租方缺少相关土地使用权证或房产证,本行需要寻找替代办公场所;

19.本行的主要股东可能会对对本行施加重要影响;

20.本行可能无法聘用、培训和留住足够的合格员工;

21.本行与ING银行在一些地区各自开展业务可能会对本行的业务经营带来一定的影响。

(二)与我国银行业有关的风险
1.本行面临国内,特别是北京地区银行业的激烈竞争;