

股票简称：华菱管线

股票代码：000932

编号：2006-21

转债简称：华菱转债

转债代码：125932

湖南华菱管线股份有限公司关于湖南华菱钢铁集团有限责任公司和Mittal Steel Company N.V. 发行的认沽权证开盘参考价的公告

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

湖南华菱钢铁集团有限责任公司和Mittal Steel Company N.V. 发行的633,180,787份本公司流通A股之认沽权证将于2006年3月2日在深圳证券交易所上市，权证代码为"038003"，权证简称为"华菱JTP1"，交易期为2006年3月2日至2008年2月22日。根据保荐机构兴业证券股份有限公司及国泰君安证券股份有限公司测算，本次上市的认沽权证的当日开盘参考价为1.161元，权证的涨停板价格为1.645元，跌停板价格为0.677元。

“华菱 JTP1”为标准的欧式认沽权证，其 3 月 2 日开盘参考价可用经典的 Black-Scholes 模型来计算其价值：

- 1、标的股票价格：3 月 1 日的 G 华菱（000932）的收盘价 3.87 元；
- 2、行权价格：4.90 元；
- 3、存续期：24 个月；
- 4、无风险利率：2.16%（与权证存续期 2 年同期的税后银行定期存款利率）；
- 5、标的股票波动率：28.06%（华菱管线最近 240 个交易日历史波动率）。

受湖南华菱钢铁集团有限责任公司和Mittal Steel Company N.V. 委托，特此公告。

湖南华菱管线股份有限公司董事会

二〇〇六年三月二日