

股票代码：000898

股票简称：鞍钢股份

公告编号：2006-031

权证代码：030001

权证简称：鞍钢 JTC1

## “鞍钢 JTC1” 认购权证到期风险提示性公告

鉴于“鞍钢 JTC1” 认购权证的到期日将近，受“鞍钢 JTC1” 认购权证的发行人鞍山钢铁集团公司（以下简称“鞍钢集团”）委托，本公司特提请投资者关注“鞍钢 JTC1” 认购权证行权的有关问题和投资风险。

### 一、基本风险提示

1、“鞍钢 JTC1” 认购权证的存续期为 366 天，自 2005 年 12 月 5 日起，至 2006 年 12 月 5 日止。

2、根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》的规定，权证存续期满前 5 个交易日，权证终止交易。“鞍钢 JTC1” 认购权证的最后一个交易日为 2006 年 11 月 28 日（星期二），从 2006 年 11 月 29 日（星期三）起终止交易。

3、“鞍钢 JTC1” 认购权证的行权日为 2006 年 12 月 1 日、2006 年 12 月 4 日、2006 年 12 月 5 日。

4、“鞍钢 JTC1” 认购权证经分红除息调整后的行权价格为 3.386 元，投资者每持有一份“鞍钢 JTC1” 认购权证，有权在行权日以 3.386 元的价格向鞍钢集团购买一股鞍钢股份股票。

5、本公告前一交易日，鞍钢股份的收盘价格为 7.98 元，“鞍钢 JTC1” 认购权证的行权价格为 3.386 元，因此“鞍钢 JTC1” 认购权证的内在价值为 4.594 元。

6、采用 Black-Sholes 公式，以本公告前一交易日鞍钢股份收盘价格 7.98 元、鞍钢股份股价波动率 35.00%（本公告前 120 个交易日历史波动率）、无风险利率 2.25% 计算，“鞍钢 JTC1” 认购权证的理论价值为 4.595 元。

7、本公告前一交易日，“鞍钢 JTC1” 认购权证的收盘价格为 4.371 元，溢价率为-2.79%。

8、请投资者注意相关投资风险。

## 二、特别风险提示

行权日未行权的“鞍钢 JTC1” 认购权证将予以注销。

鞍钢股份有限公司董事会

二〇〇六年十一月二十八日