

关于做好公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券实施净价交易准备工作的通知

各会员单位:

本所于2002年3月颁布了《关于实施国债净价交易有关事宜的通知》、《深圳证券交易所国债净价交易技术方案》，对国债实施了净价交易制度。为了更好地促进债券市场发展，本所拟对公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券也实施净价交易，现将有关事宜通知如下，请各会员单位做好准备工作：

一、净价交易概念

净价交易是指在债券现券买卖时，以不含有自然增长应计利息的价格报价并成交的交易方式。

实行净价交易方式后，所有在本所集中竞价系统和综合协议交易平台挂牌交易的国债、公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券均按净价交易方式进行交易，结算价为全价即成交价与每百元应计利息之和。

上述四类债券在发行期间，如采用通过本所交易系统上网分销发行的方式，交易系统按全价模式进行揭示、报盘、交易及结算，不计算和揭示净价交易模式下的应计利息额。

二、实行净价交易应具备的技术条件

1.交易系统:按每百元债券价格的净价进行报盘、竞价、撮合、成交。

2.结算系统:按净价加应计利息额即全价进行资金的冻结、清算交收。

3.券商电脑系统:

委托系统中的柜台系统、电话委托、自助终端、网上委托各种方式，均按每百元债券价格的净价进行报盘；

行情揭示系统需揭示每百元债券价格的净价、每百元债券所含的应计利息；并需揭示成交金额和结算金额中的至少一个：

交割单打印系统需揭示每百元债券价格的净价、每百元债券价格所含的应计利息、结算价、成交量、成交金额、结算金额。

三、相关计算方法

1.全价=净价+应计利息

2.成交量=净价×成交量

3.结算金额=全价×成交量

4.份额实行T+0交收的债券的计息天数=本付息起息日至交易日止期间的实际日历天数，目前实行T+0交收的债券品种有国债、企业债券和分离交易可转债。

份额实行T+1交收的债券的计息天数=本付息起息日至交收日的前一日止期间的实际日历天数（债权登记日进行除息），目前实行T+1交收的债券品种有公司债。

闰年2月29日均不计算利息。

5.应计利息

①附息式债券:每年定期支付利息，到期时一次偿还本金的债券。

应计利息=债券面值×日利率×计息天数

日利率=票面利率÷365天

票面利率:①固定利率型债券指发行的票面利率

②浮动利率型债券指本付息期计息利率

③零息式债券:以票面面值发行，到期一次还本付息的债券。

应计利息=债券面值×日利率×计息天数

日利率=票面利率÷365天

④贴现式债券:以折扣方式发行，到期以票面价值兑付的债券，票面价值与发行价之间的差额即为债券的利息。

应计利息=(100-发行价格)×计息天数÷债券存续天数

债券存续天数:起息日至到期日的实际日历天数

6.年度天数:1年按365天计算

7.当票面利率不能被365天整除

时，电脑系统按默认位数全额计算。交割单应计利息总额按四舍五入原则，以元为单位保留2位小数列示。

四、测试准备工作

请各会员单位按上述要求在2009年2月底前做好相关准备工作，本所将

择机进行全网测试。正式实施时间另行通知。

五、联系方式

技术:0755-25918206

业务:0755-25918532

结算:0755-25946048

附件:《深圳证券交易所公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券净价交易技术方案》

深圳证券交易所

中国证券登记结算公司深圳分公司

二〇〇九年二月九日

附件:

深圳证券交易所公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券净价交易技术方案

DBF数据库中的字段10和SJSXXN。DBF数据库中的字段12:对附息和零息债券，存放票面年利率；对贴现债券，存放贴现发行价。

2 XXBNLR 本年每股利润,SJSXXN。

DBF数据库中的字段11和SJSXXN。

DBF数据库中的字段13:存放每百元债券应计利息。

3 XXSSRQ (上市日期,SJSXX,DBF)

数据库中的字段15和SJSXXN,DBF数据库中的字段18:对附息债券，存放本次付息起息日；对零息和贴现债券，存放发行起息日。

4 XXDJRQ (到期/交割日,SJSXXN)

DBF数据库中的字段16和SJSXXN。

DBF数据库中的字段20:存放债券的到期日。

2.行情库 SJSHQ,DBF)

对于债券，委托价格(WTWTJG)和成交价格(HBCJJG)均为净价。

3 HQSYL2 (字段12:市盈率2):对于国债，存放到期收益率，供市场参考用，其到期收益率采取单利计算，公式为：

式中:y 为到期收益率；

PV 为债券全价 等于成交价格加应计利息；

D 为交易当日至债券兑付日的实

际天数；

FV 为到期本息和。

对于公司债券、企业债券和分离交易的可转换公司债券，不发布到期收益率，该字段取值为0。

3.委托库 SJSWT,DBF)和回报库 SJSHB,DBF)

对于债券，委托价格(WTWTJG)和成交价格(HBCJJG)均为净价。

4.股份结算信息库 SJSGF,DBF)

每日收市后通过股份结算信息库 SJSGF,dfb)向证券营业部发送下一交易日的债券每百元应计利息数据。

5.证券交易统计库 SJSTJ,DBF)

对于债券，证券交易统计库 SJSTJ,dfb)中的 TMRZJ (字段4:买入资金)和 TMCZJ (字段6:卖出资金)均为结算金额。所有与金额相关的字段按四舍五入原则精确到0.01元。

券代码；

3 GFYWLB (字段4:业务类别):为 X1'；

4 GFWTXH (字段6:委托序号):表示计息日期 CCYYMMDD);对于公司债券，GFWTXH 为交收日的前一日历日，对于非公司债券，GFWTXH 为下一交易日期；

5 GFWTGS (字段7:委托股数):表示应计利息天数；

6 GFQRGS (字段8:确认股数):表示债券每百元应计利息额分母；

7 GFZJJE (字段9:资金金额):表示债券每百元应计利息额分子；

8 GFZJJE/GFORGS 表示下一交易日 (T+1日) 的债券每百元应计利息额，单位为元，保留8位小数；

9 GFSSRQ (字段11:发送日期):表示数据发送当日日期 (T日)；

10) 其他未涉及的字段为空格。

5.证券交易统计库 SJSTJ,DBF)

对于债券，证券交易统计库 SJSTJ,dfb)中的 TMRZJ (字段4:买入资金)和 TMCZJ (字段6:卖出资金)均为结算金额。所有与金额相关的字段按四舍五入原则精确到0.01元。

广发基金管理有限公司关于旗下基金增加青岛银行代销机构的公告

为满足广大投资者的理财需求，广发基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2009年2月17日起通过青岛银行股份有限公司(以下简称“青岛银行”)代销以下基金：广发聚富开放式证券投资基金(基金代码:270001)、广发稳健增长开放式证券投资基金(基金代码:270002)、广发货币市场基金(基金代码:270004)、广发丰享股票型证券投资基金(基金代码:270005)、广发策略优选混合型证券投资基金(基金代码:270007)、广发核心精选股票型证券投资基金、广发大康长盛混合型证券投资基金(基金代码:270008)和广发增利债券型证券投资基金(基金代码:270009)。投资者可在青岛银行代销网点办理以上基金的开户、申购、赎回、基金转换等业务。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金过往业绩及其净值高低并不预示其未来表现。本公司提示投资者在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。基金定投并不等于零存整取，不能规避基金投资固有的风险，也不能保证投资人获得收益。投资人投资基金时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。

特此公告。

1.基金定投指投资者通过本公司指定的基金销售机构提交申请，约定每月扣款时间和扣款金额，由销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购的一种投资方式。

2.投资者可到青岛银行营业网点申请开办基金定投业务并约定每期固定的申购金额，每期申购金额不低于人民币200元(含200元)。

3.投资者可以通过以下方式申请：

①青岛银行股份有限公司

客服电话：020-96588，全国 400-66-96588,0532-85709799

公司网站：www.gdcb.com

②广发基金管理有限公司

客服电话：020-83936999 或 95105828(免长途费)

网址：www.gffunds.com

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金过往业绩及其净值高低并不预示其未来表现。本公司提示投资者在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。基金定投并不等于零存整取，不能规避基金投资固有的风险，也不能保证投资人获得收益。投资人投资基金时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。

特此公告。

广发基金管理有限公司 2009年2月11日

青岛高校软控股份有限公司关于非公开发行A股股票的申请提交发审委审核的公告

本公司及全体董事、监事、高级管理人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，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

青岛高校软控股份有限公司(以下简称“公司”)接到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)通知，中证监局将股票发行审核委员会(以下简称“发审委”)将于2009年2月11日对公司公开发行股票的申请进行审核。

根据有关规定，公司股票于2009年2月11日停牌，待公司公告审核结果后复牌。对发审委审核结果，公司将进一步公告。

特此公告。

青岛高校软控股份有限公司董事会

2009年2月10日

本公司及全体董事、监事、高级管理人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，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

青岛高校软控股份有限公司(以下简称“公司”)接到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)通知，中证监局将股票发行审核委员会(以下简称“发审委”)将于2009年2月11日对公司公开发行股票的申请进行审核。

根据有关规定，公司股票于2009年2月11日停牌，待公司公告审核结果后复牌。对发审委审核结果，公司将进一步公告。