

# 深圳证券交易所市场统计年鉴

## SHENZHEN STOCK EXCHANGE FACT BOOK

### 2006

编辑 深圳证券交易所

主编 张育军

副主编 宋丽萍 周明 黄铁军 戴文华 张颖 陈鸿桥



# 目 录

## CONTENTS

指标说明

NOTES TO STATISTICS INDICATORS

一、历年市场概貌 .....	( 1—18 )
<b>HISTORICAL MARKET OVERVIEW</b>	
(一) 市场统计记录 .....	( 3 )
<b>HISTORICAL STATISTICAL MARKET RECORDS</b>	
1. 二〇〇六年市场概况 .....	( 3 )
MARKET OVERVIEW , 2006	
2. 成交总值(一九九六至二〇〇六年) .....	( 4 )
VALUE TRADED , 1996—2006	
3. 成交额最高纪录(一九九一至二〇〇六年) .....	( 4 )
TOP 10 VALUE TRADED , 1991—2006	
4. 深证综合指数十大升跌纪录(一九九一至二〇〇六年) .....	( 5 )
TOP 10 RISES AND FALLS OF SSE COMPOSITE INDEX , 1991—2006	
5. 深证成份指数十大升跌纪录(一九九四至二〇〇六年) .....	( 5 )
TOP 10 RISES AND FALLS OF SSE COMPONENT INDEX , 1994—2006	
(二) 历年市场概貌 .....	( 6 )
<b>YEARLY MARKET OVERVIEW</b>	
1. 上市证券(年底数字) .....	( 6 )
LISTED SECURITIES ( Year-end Figures )	
2. 成交情况 .....	( 7 )
TRANSACTION DATA	
3. 股价指数 .....	( 8 )
STOCK PRICE INDICES	
4. 股票市盈率(年底数字) .....	( 9 )
P/E RATIO ( Year-end Figures )	

5. 会员( 年底数字 )	( 9 )
MEMBERSHIPS ( Year-end Figures )	
6. 投资者( 年底数字 )	( 9 )
INVESTORS ( Year-end Figures )	
<b>( 三 )二〇〇六年各月概貌</b>	<b>( 10 )</b>
<b>MONTHLY MARKET OVERVIEW ,2006</b>	
1. 上市证券( 月底数字 )	( 10 )
LISTED SECURITIES ( Month-end Figures )	
2. 成交情况	( 12 )
TRANSACTION DATA	
3. 股价指数( 月底数字 )	( 14 )
STOCK PRICE INDICES( Month-end Figures )	
4. 股票市盈率( 月底数字 )	( 16 )
P/E RATIO( Month-end Figures )	
5. 会员( 月底数字 )	( 16 )
MEMBERSHIPS ( Month-end Figures )	
6. 投资者( 月底数字 )	( 16 )
INVESTORS ( Month-end Figures )	
<b>二、二〇〇六年深圳证券市场状况</b>	<b>( 19—108 )</b>
<b>TRANSACTION DATA ,2006</b>	
<b>( 一 )各类证券成交金额</b>	<b>( 21 )</b>
<b>TOTAL VALUE TRADED</b>	
1. 各类证券成交金额( 二〇〇六年 )	( 21 )
TOTAL VALUE TRADED ,2006	
2. 每日成交金额表( 二〇〇六年 )	( 22 )
DAILY VALUE TRADED ,2006	
3. 每日成交笔数表( 二〇〇六年 )	( 23 )
DAILY DEALS TRADED ,2006	
<b>( 二 )深圳证券交易所指数</b>	<b>( 24 )</b>
<b>SSE INDICES</b>	
1. 深证综合指数历史走势图( 一九九一至二〇〇六年 )	( 24 )
SSE COMPOSITE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,1991—2006	
深证成份指数历史走势图( 一九九一至二〇〇六年 )	( 25 )
SSE COMPONENT INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,1991—2006	
2. 深证综合指数全年走势图	( 26 )
SSE COMPOSITE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	

3. 深证综合指数每日收市表(二〇〇六年).....	( 27 )
SSE COMPOSITE INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
4. 深证 A 股指数全年走势图 .....	( 28 )
SSE A-SHARE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
深证 B 股指数全年走势图 .....	( 28 )
SSE B-SHARE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
5. 深证 A 股指数每日收市表(二〇〇六年).....	( 29 )
SSE A-SHARE INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
6. 深证 B 股指数每日收市表(二〇〇六年).....	( 30 )
SSE B-SHARE INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
7. 深证成份指数全年走势图.....	( 31 )
SSE COMPONENT INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
8. 深证成份指数每日收市表(二〇〇六年).....	( 32 )
SSE COMPONENT INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
9. 成份 A 股指数全年走势图 .....	( 33 )
SSE COMPONENT A-SHARE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
成份 B 股指数全年走势图 .....	( 33 )
SSE COMPONENT B-SHARE INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
10. 成份 A 股指数每日收市表(二〇〇六年) .....	( 34 )
SSE COMPONENT A-SHARE INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
11. 成份 B 股指数每日收市表(二〇〇六年) .....	( 35 )
SSE COMPONENT B-SHARE INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
12. 深市基金指数全年走势图 .....	( 36 )
SSE MUTUAL FUND INDEX ,DAILY MOVEMENT CHART ,2006	
13. 深市基金指数每日收市表(二〇〇六年) .....	( 37 )
SSE MUTUAL FUND INDEX ,DAILY CLOSE ,2006	
14. 行业分类指数每月收市表(二〇〇六年) .....	( 38 )
SSE INDUSTRIAL INDEX ,MONTHLY CLOSE ,2006	
15. 指数变动情况(二〇〇六年) .....	( 39 )
CHANGE OF STOCK PRICE INDICES 2006	
<b>( 三 ) 股票市场.....</b>	<b>( 40 )</b>
<b>STOCK MARKET</b>	
1. 股价 .....	( 40 )
STOCK PRICE	
( 1 ) 股价变动分布(二〇〇六年) .....	( 40 )
STOCK PERFORMANCE DISTRIBUTION ,2006	
( 2 ) 各股升跌情况(二〇〇六年) .....	( 41 )
PRICE CHANGE OF STOCKS ,2006	

2. 股票成交统计 .....	( 54 )
TRANSACTION DATA OF STOCKS	
( 1 )成交金额及股数( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 54 )
TRADING VALUE AND VOLUME , 1996—2006	
( 2 )每月成交金额( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 54 )
MONTHLY VALUE TRADED , 1996—2006	
( 3 )分类股份成交额( 二〇〇六年 ) .....	( 55 )
TRADING VALUE BY INDUSTRY , 2006	
( 4 )各股成交量、成交金额及占市场比例( 二〇〇六年 ) .....	( 56 )
TRADING VOLUME , VALUE & MARKET SHARE , 2006	
( 5 )每日成交股数表( 二〇〇六年 ) .....	( 68 )
DAILY TRADING VOLUME , 2006	
( 6 )每日成交金额表( 二〇〇六年 ) .....	( 69 )
DAILY TRADING VALUE , 2006	
( 7 )每日成交笔数表( 二〇〇六年 ) .....	( 70 )
DAILY DEALS , 2006	
3. 市价总值 .....	( 71 )
MARKET VALUE	
( 1 )市价总值( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 71 )
MARKET VALUE , 1996—2006	
( 2 )市价总值柱状图( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 71 )
MARKET VALUE CHART , 1996—2006	
( 3 )上市股份市价总值分布( 二〇〇六年 ) .....	( 72 )
MARKET VALUE BY INDUSTRY , 2006	
( 4 )每日市价总值表( 二〇〇六年 ) .....	( 73 )
DAILY MARKET VALUE , 2006	
( 5 )各股市价总值排名表( 二〇〇六年 ) .....	( 74 )
DAILY MARKET VALUE , 2006	
4. 市盈率 .....	( 86 )
P/E RATIO	
( 1 )上市股份平均市盈率( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 86 )
AVERAGE P/E RATIO , 1996—2006	
( 2 )市盈率分布图( 一九九六至二〇〇六年 ) .....	( 86 )
P/E RATIO DISTRIBUTION , 1996—2006	
( 四 )基金市场 .....	( 87 )
FUND MARKET	
1. 基金价格升跌情况( 二〇〇六年 ) .....	( 87 )
PRICE CHANGE OF MUTUAL FUNDS , 2006	

2. 基金成交统计 .....	( 88 )
TRANSACTION OF MUTUAL FUNDS	
( 1 )各基金成交单位数、成交金额及占市场比例( 二〇〇六年 ) .....	( 88 )
MUTUAL FUNDS TRADING VOLUME , VALUE & MARKET SHARE , 2006	
( 2 )基金每日成交单位数( 二〇〇六年 ) .....	( 89 )
DAILY TRADING VOLUME OF MUTUAL FUNDS , 2006	
( 3 )基金每日成交金额表( 二〇〇六年 ) .....	( 90 )
DAILY TRADING VALUE OF MUTUAL FUNDS , 2006	
( 4 )基金每日成交笔数表( 二〇〇六年 ) .....	( 91 )
DAILY DEALS OF MUTUAL FUNDS , 2006	
( 五 )债券市场 .....	( 92 )
BOND MARKET	
1. 债券现货价格升跌情况( 二〇〇六年 ) .....	( 92 )
PRICE CHANGE OF BONDS , 2006	
2. 二〇〇六年上市债券一览表 .....	( 94 )
LIST OF LISTED BONDS , 2006	
3. 债券现货成交统计 .....	( 97 )
TRANSACTION OF BONDS	
( 1 )债券分类成交金额( 二〇〇六年 ) .....	( 97 )
BONDS TRADING VALUE BY SORT , 2006	
( 2 )各债券成交面值、成交金额及占市场比例( 二〇〇六年 ) .....	( 98 )
BONDS TRADING PAR , VALUE & MARKET SHARE , 2006	
( 3 )债券每日成交面值表( 二〇〇六年 ) .....	( 100 )
DAILY TRADING PAR OF BONDS , 2006	
( 4 )债券每日成交金额表( 二〇〇六年 ) .....	( 101 )
DAILY TRADING VALUE OF BONDS , 2006	
( 5 )债券每日成交笔数表( 二〇〇六年 ) .....	( 102 )
DAILY DEALS OF BONDS , 2006	
4. 债券回购成交统计 .....	( 103 )
TRANSACTION OF BOND REPURCHASES	
( 1 )各回购品种利率标价情况( 二〇〇六年 ) .....	( 103 )
PRICE CHANGE OF BOND REPURCHASES , 2006	
( 2 )债券回购各品种成交金额及占市场比例( 二〇〇六年 ) .....	( 103 )
BOND REPURCHASE TRADING VALUE & MARKET SHARE , 2006	
( 六 )权证市场 .....	( 104 )
WARRANT MARKET	
1. 权证价格升跌情况( 二〇〇六年 ) .....	( 104 )
PRICE CHANGE OF WARRANTS , 2006	

2. 权证成交统计 .....	( 105 )
TRANSACTION OF WARRANTS	
( 1 )各权证成交单位数、成交金额及占市场比例( 二〇〇六年 ).....	( 105 )
WARRANTS TRADING VOLUME , VALUE & MARKET SHARE , 2006	
( 2 )权证每日成交单位数( 二〇〇六年 ).....	( 106 )
DAILY TRADING VOLUME OF WARRANTS , 2006	
( 3 )权证每日成交金额表( 二〇〇六年 ).....	( 107 )
DAILY TRADING VALUE OF WARRANTS , 2006	
( 4 )权证每日成交笔数表( 二〇〇六年 ).....	( 108 )
DAILY DEALS OF WARRANTS , 2006	

### 三、上市公司..... ( 109—136 )

#### LISTED COMPANIES

#### ( 一 )上市公司活动纪录 .....

#### RECORD OF LISTED COMPANIES ACTIVITY

1. 新上市公司和证券 .....	( 111 )
NEW LISTED COMPANIES AND SECURITIES	
( 1 )新上市股票 .....	( 111 )
NEW LISTED EQUITIES	
( 2 )新上市权证 .....	( 113 )
NEW LISTED WARRANTS	
( 3 )新上市债券 .....	( 114 )
NEW LISTED BONDS	
2. 除牌证券 .....	( 115 )
DELISTING	
3. 分红配股方案 .....	( 116 )
DISTRIBUTION PLAN	
4. 红股与派息 .....	( 121 )
BONUS ISSUES / DIVIDENDS	
5. 增发 .....	( 127 )
SECONDARY OFFERING	
6. 上市公司股改方案 .....	( 128 )
SHARE STRUCTURE REFORM OF LISTED COMPANIES	

#### ( 二 )上市公司统计资料 .....

#### STATISTICS OF LISTED COMPANIES

1. 上市公司分类( 证券分类 ).....	( 134 )
LISTED COMPANIES BY INDUSTRY	



2. 集资总额(一九九六至二〇〇六年) .....	( 135 )
FUNDS RAISED YEARLY ,1996—2006	
3. 地区集资(二〇〇六年) .....	( 136 )
FUNDS RAISED BY PROVINCES ,2006	

#### 四、投资者与地区统计 ..... ( 137—168 )

#### INVESTORS AND AREAS

( 一 )投资者开户分布 .....	( 139 )
INVESTORS DISTRIBUTION	
1. A 股投资者总开户数 .....	( 139 )
INVESTORS OF A-SHARE	
2. A 股投资者新开户数 .....	( 139 )
NEW INVESTORS OF A-SHARE	
3. B 股投资者总开户数 .....	( 140 )
INVESTSTORS OF B-SHARE	
4. B 股投资者新开户数 .....	( 140 )
NEW INVESTSTORS OF B-SHARE	
( 二 )2006 年底股东持股情况统计.....	( 141 )
SHAREHOLDING DATA ,End of 2006	
( 三 )上市证券成交分布(按每笔成交金额大小分类) .....	( 153 )
SECURITIES TRADING VALUE BY TRADE SIZE	
( 四 )地区分布统计 .....	( 167 )
REGIONAL STATISTICS	
1. 2006 年底 A 股投资者开户地区分布统计 .....	( 167 )
REGIONAL STATISTICS OF A-SHARE INVESTORS ,End of 2006	
2. 2006 年交易金额地区分布 .....	( 168 )
TRADING VALUE BY REGION ,2006	

#### 五、会员..... ( 169—256 )

#### MEMBERSHIP

( 一 )会员统计表 .....	( 171 )
NUMBER OF MEMBER FIRMS AND SEATS	
( 二 )会员交投情况 .....	( 171 )
TRADING OF MEMBERS	

1. 会员交投统计表 .....	( 171 )
TRADING VALUE BY MEMBER SEATS	
2. 二〇〇六年会员股票、基金交易排名 .....	( 172 )
MEMBER RANKING BY TRADING VALUE OF STOCKS & FUNDS ,2006	
3. 二〇〇六年会员债券、权证交易排名 .....	( 175 )
MEMBER RANKING BY TRADING VALUE OF BONDS ,2006	
4. 二〇〇六年证券营业部股票、基金交易排名 .....	( 178 )
MEMBER BRANCH RANKING BY TRADING VALUE OF STOCKS & FUNDS ,2006	
5. 二〇〇六年证券营业部债券、权证交易排名 .....	( 218 )
MEMBER BRANCH RANKING BY TRADING VALUE OF BONDS	

## 六、附录..... ( 257—334 )

### APPENDIX

( 一)上市公司中英文名称对照表 .....	( 259 )
DIRECTORY OF LISTED COMPANIES ( CHINESE ,ENGLISH )	
( 二)上市公司地址一览表.....	( 270 )
ADDRESS LIST OF LISTED COMPANIES	
( 三)会员一览表 .....	( 281 )
DIRECTORY OF MEMBER FIRMS	
( 四)证券营业部一览表 .....	( 285 )
DIRECTORY OF MEMBER BRANCHES	
( 五)深圳证券交易所收费一览表.....	( 332 )
FEES OF SHENZHEN STOCK EXCHANGE	

# 指标说明

1. 本年鉴约定 成交金额、成交数量以交易的买方或卖方单边计算, 交易金额、交易数量以交易的买方和卖方双边计算。所以 总交易金额等于总成交金额的两倍。

2. 单位 除非特别说明 本年鉴中金额的单位为百万元人民币, B 股换算为人民币计算, 数量的单位为百万股(张、份), 债券现货和回购单位为万张。

3. 统计范围 在本所上市交易的各类证券, 包括股票(A 股、B 股)、基金(封闭式、开放式)、企业债券(现券、回购)、可转换债、国债(现货、回购)、权证。

4. 统计内容 包括本所上市各类证券的交易状况和参与者的交易状况, 会员情况及交易状况等。

5. 统计时期 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日。为便于对比, 增加 1996 年至 2005 年的部分相关数据。

6. 数据指标 证券数目及会员数目、股本、市值、市盈率、股价、指数等为月底或年底的时点数字, 不具有可加性, 交易金额、交易数量等为全年或某月的时期数字, 具有可加性, 由相应时期内各交易日的实际数字累加而成。

7. 零股交易 零股交易已计入当月和当年的交易统计数字中, 总交易日数包括零股交易日数。

8. 舍入误差 本年鉴数字采用截尾方式计算, 个别数字采用四舍五入方式计算。由于舍入误差, 分类数字之和未必等于总额数字。

9. 上市公司数 其股票在本所上市的公司数目。

10. 上市证券数目 包括在本所直接挂牌的各类证券数目。

11. 会员数 已批准成为本所会员的机构数目。

12. 席位数 包括本所会员申请的席位及其他非会员申请的特别席位, 如国债专席、B 股境外券商特别席位、代办股份转让席位、及其它特别席位。

13. 发行股本 指上市公司发行在外的 A 股和 B 股股本, 不含 H 股股本。

$$\text{总发行股本} = \sum \text{A 股总股本} + \sum \text{B 股总股本}$$

14. 上市面额 指除股票外的其他证券在本所直接挂牌的面额数量。

$$\text{总上市面额} = \sum \text{企业债券面额} + \sum \text{可转债面额} + \sum \text{基金单位数} + \sum \text{权证份数}$$

15. 市价总值：

$$\text{股票市价总值} = \sum \text{总发行股本} \times \text{收市价}$$

$$\text{其他证券市值} = \sum \text{上市面额} \times \text{收市价} / \text{每张面额}$$

16. 平均市盈率 只计算股票的平均市盈率。

$$\begin{aligned} \text{平均市盈率} &= \sum \text{股票总市值} / \sum \text{股票总收益} \\ &= \sum (\text{收市价} \times \text{总股本}) / \sum (\text{每股盈利} \times \text{总股本}) \end{aligned}$$

$$17. \text{证券升跌幅} = \left( \frac{\text{每日收市价}}{\text{每日前收市}} - 1 \right) \times 100\%$$

除息日的前收市价为除权调整后前收市价。

18. 股价指数 本所编制的综合指数类、成份股指数类和行业分类指数类。除特别说明外，收市采用月（年）底时点数，最高、最低指数皆为收市指数的最高、最低。

19. 交易日数：分 A 股交易日数、B 股交易日数，含零股交易日数。

$$\text{总交易日数} = \text{A 股交易日数和 B 股交易日数中的较大者}$$

20. 总成交金额 = 股票成交额 + 基金成交额 + 权证成交额 + 企业债券成交额 + 国债成交额。

$$\text{全年累计数} = \sum \text{全年每日成交额} \quad (1996 \text{ 年前含零股交易})$$

$$\text{日均成交金额} = \text{总成交金额} / \text{总交易日数}$$

21. 总成交股数 =  $\sum$ A 股成交股数 +  $\sum$ B 股成交股数。

$$\text{日均成交股数} = \text{总成交股数} / \text{总交易日}$$

其他成交数量 除股票外的成交量单位：基金为基金单位，权证为份，债券和回购为张。

22. 股票换手率 =  $\sum$ (股票每日成交股数 / 流通股数)。

23. 成交手数 股票、权证、基金交易单位每手 1 股（份），债券每手 1 张。

24. 成交笔数 由交易系统完成配对交易的记录数。

25. 分红派息 指 2006 年内上市公司根据分红派息方案派发的红股和股息。

26. 配股 2006 年内上市公司的配股活动。配股集资金额 = 配股价  $\times$  实际配股数。

27. 停牌情况 2006 年内发生的证券停牌及原因。

28. 股改方案 2006 年内完成股改的上市公司对流通股东的对价方案。

29. 集资金额 包括上市公司发行集资和配股集资。

30. 分类统计 将上市公司分为农林牧渔、采掘业、制造业、水电煤气、建筑业、运输仓储、信息技术、批发零售、金融保险、房地产业、社会服务、传播文化、综合类十三类，分别进行统计。

# Notes to Statistics Indicators

1. *Agreement of the Fact Book* :Trading value and volume by market or securities are calculated on an uni-lateral basis , while value and volume by members , seats or areas are counted on a bilateral basis ( buy & sell ).

2. *Unit* Except for special notes , calculation unit of trading value shall be RMB million. Trading value of B shares is calculated after converting HK dollar into RMB. Calculation unit of trading volume of equities and funds is one million , while unit of bonds and repurchase is 10 thousands.

3. *Products Included* :All securities listed on the Shenzhen Stock Exchange ( SSE ). These securities include equities ( A & B shares ) , funds ( open – end & close – end ) , corporate bonds ( bonds & repurchases ) , convertible bonds and treasury bonds ( cashes & repurchases ) , warrants.

4. *Contents* :Transaction of all securities listed on SSE , participation of investors , information and performance of member firms.

5. *Covered Period* :1 January — 31 December , 2006. Related information from 1996 to 2005 is added for comparison.

6. *Statistical Data* :Number of securities , members , stock capital , market value , P/E ratio , stock prices and stock price indices are the month-end or year-end figures , not accumulated. The year or month trading value and volume are accumulated by the daily figures of the trading days in the related period.

7. *Trading of Odd Lot Shares* :Odd lot shares transaction is included in the trading statistics of the month or year , the trading days of odd lot shares is included also.

8. *Rounding-off Error* :Calculation is conducted on an end cut or rounding off basis. Due to the rounding off error , the sum of all detail data may be not equal to the total amount.

9. *Listed Companies* :The number of companies whose equities are listed on SSE.

10. *Listed Securities* :The number of securities listed on SSE.

11. *Member Number* :The total number of member firms registered in SSE.

12. *Seat Number* :The total number of trading seats include those of the members and special trading seats of non-member traders such as TB seats , B share special seats and other special seats.

13. *Stock Capital Issued* :Stock capital of A and B shares issued by companies listed , excluding part of H shares.

Total stock capital =  $\sum$  Capital of A shares +  $\sum$  Capital of B shares

14. *Par Value Listed* :Gross par value of securities , except for equities , listed on SSE.

Total par value listed =  $\sum$  Par value of corporate bonds +  $\sum$  Par value of convertible bonds +  $\sum$  Units of funds +  $\sum$  Units of warrants

15. *Market Value* :Market value of equities =  $\sum$  Total stock capital issued  $\times$  Close price

Market value of other securities =  $\sum$  Total par value listed  $\times$  Close price / Par value of each

16. *Average P/E Ratio* :Average P/E ratio of equities only.

$$\begin{aligned} \text{Average P/E ratio} &= \frac{\sum \text{Total market value of equities}}{\sum \text{Gross profit earnings of equities}} \\ &= \frac{\sum (\text{Close prices} \times \text{Total capital stock})}{\sum (\text{PSE} \times \text{Total capital stock})} \end{aligned}$$

17. *Price change of Securities*

$$= \left( \prod \frac{\text{Daily close price}}{\text{Daily prev-close price}} - 1 \right) \times 100\%$$

The prev-close price of ex-rights day is ex-adjusted prev-close.

18. *Stock Price Indices* : Composite stock price indices , component stock price indices and industrial indices. Close indices are the month-end or year-end indices. Except for special notes , the high and low figure refer to the high and low of close indices.

19. *Trading Days* : Trading days of both A and B shares , including those of odd lot shares.

$$\text{Market trading days} = \text{MAX}(\text{The trading days of A shares or B shares} )$$

20. *Market Trading Value* = Total value of equities , funds , corporate bonds and treasury bonds.

Yealy trading value =  $\sum$  Daily trading value of the year

$$\text{Average daily transaction value} = \frac{\text{Gross transaction value}}{\text{Total number of trading days}}$$

21. *Total Stock Transaction Volume* =  $\sum$  Transaction volume of A shares +  $\sum$  Transaction volume of B shares

$$\text{Daily transaction volume} = \frac{\text{Gross transaction volume}}{\text{Total number of trading days}}$$

Transaction volume of other securities : Trading unit of mutul funds is one fund unit that of bonds and repurchases is one contract , respectively.

$$22. \text{ Stock Turnover Rate} = \left( \frac{\text{Transaction volume}}{\text{Number of tradable shares}} \right) \times 100\%$$

23. *Minimum Trading Units* : A minimum of 1 is required of equities , funds , warrants , bonds and repurchases.

24. *Number of Deals* : The total number of transactions completed via the trading systems in SSE.

25. *Dividend Distribution and Bonus Payment* : Dividend and bonus distributed and paid by the listed companies in 2006 in line with their respective plans.

26. *Share Placement* : Share placing activities conducted by the listed companies in 2006. Fund raised by share placement = Placing price  $\times$  Actual number of shares placed.

27. *Suspension* : Securities suspensions and their causes in 2006.

28. *Scheme of Share Structure Reform* : Share structure reform scheme of listed companies which have completed reform in 2006.

29. *Amount of Money Raised* : Total amount of fund raised by securities IPO , SPO and rights.

30. *Classification of Equities* Listed companies are divided into 13 sectors : agriculture , mining , manufacturing , utilities , construction , transportation , IT , wholesale & retail , financials , real estate , social services , media , conglomerates.

# 一、历年市场概貌

## **HISTORICAL MARKET OVERVIEW**





## (一) 市场统计记录

## HISTORICAL STATISTICAL MARKET RECORDS

## 1. 二〇〇六年市场概况

## MARKET OVERVIEW, 2006

单位: 百万元 RMB Mil.

		2006 年 2006	比 2005 年变动 Change	比 2005 年变动% Change%
深证综合指数	SSE Composite Index	550.5934	271.8478	97.53
深证成份指数	SSE Component Index	6 647.1392	3 783.5263	132.12
上市公司数目	Listed Companies	579	35	6.43
上市证券数目	Listed Securities	768	60	8.47
股票	Stocks	621	35	5.97
债券	Bonds	93	13	16.25
基金	Funds	46	7	17.95
权证	Warrants	8	5	166.67
股票总发行股本	Stock Issued Capital	237 583.29	24 218.48	11.35
A 股	A-Shares	224 766.13	23 797.09	11.84
B 股	B-Shares	12 817.16	421.39	3.40
股票总流通股本	Stock Negotiable Capital	117 690.06	24 260.31	25.97
A 股	A-Shares	105 811.01	23 835.60	29.08
B 股	B-Shares	11 879.04	424.70	3.71
股票市价总值	Stock Market Value	1 779 151.76	845 736.80	90.61
A 股	A-Shares	1 699 601.06	804 153.20	89.80
B 股	B-Shares	79 550.70	41 583.60	109.53
股票流通市值	Stock Negotiable Market Value	857 530.88	469 940.31	121.25
A 股	A-Shares	779 735.82	428 347.10	121.90
B 股	B-Shares	77 795.06	41 593.21	114.89
平均市盈率	Average P/E Ratio	32.72	16.36	100.00
A 股	A-Shares	33.61	16.65	98.17
B 股	B-Shares	21.01	11.90	130.63
会员总数	No. of Member Firms	176	-1	-0.56
交易单元数	No. of Trading Unit	3 128	8	0.26
总户数(百万户)	No. of Investors( Mil. )	38.20	2.82	7.99
总交易日	Trading Days	241	-1	-0.41
总成交金额	Total Value Traded	3 873 808.67	2 546 223.98	191.79
股票	Stock	3 265 228.98	2 022 772.20	162.80
债券	Bonds	14 903.65	-8 040.45	-35.04
基金	Funds	97 830.40	78 193.17	398.19
权证	Warrants	495 845.64	453 299.06	1 065.42
日均成交金额	Daily Value Traded	16 073.89	10 588.01	193.00
总成交数量	Total Volume Traded	1 141 757.11	803 565.49	237.61
股票集资金额	Funds Raised by Listings	62 082.78	59 054.25	1 949.93

2. 成交总值 (一九九六至二〇〇六年)

VALUE TRADED, 1996—2006

单位: 百万元 RMB Mil.

年份 Year	成交金额 Value Traded	交易日数 Trading Days	日均成交 Daily Avg.	最高成交日 High		最低成交日 Low	
				成交额 Value	日期 Date	成交额 Value	日期 Date
				1996	1 394 934.21	247	5 647.51
1997	1 862 796.96	243	7 665.83	23 292.45	05/07/1997	1 328.94	10/07/1997
1998	1 196 497.60	246	4 863.81	10 582.21	05/11/1998	1 548.54	12/31/1998
1999	1 631 085.98	239	6 824.63	39 242.71	06/25/1999	1 288.02	01/04/1999
2000	3 314 378.15	239	13 867.69	42 862.14	02/17/2000	5 721.35	09/25/2000
2001	1 743 248.18	240	7 263.53	21 236.54	03/23/2001	1 664.85	11/15/2001
2002	1 403 968.48	237	5 923.92	36 656.23	06/24/2002	1 917.23	01/07/2002
2003	1 215 160.00	241	5 042.16	20 082.08	05/22/2003	1 801.73	09/22/2003
2004	1 642 053.41	243	6 757.42	20 025.55	09/24/2004	1 891.15	09/07/2004
2005	1 327 584.70	242	5 485.89	14 099.03	08/18/2005	2 568.18	07/07/2005
2006	3 873 808.67	241	16 073.89	43 958.94	05/16/2006	4 891.16	03/14/2006
合计 Total	20 605 516.34	2 658	7 752.26				

3. 成交额最高纪录 (一九九一至二〇〇六年)

TOP 10 VALUE TRADED, 1991—2006

月 Month			日 Date		
顺次 Rank	成交金额 (百万元) Value (RMB Mil)	月份/年 Month/Year	顺次 Rank	成交金额 (百万元) Value (RMB Mil)	月/日/年 M/D/Y
1	590 068.60	12/2006	1	43 958.94	05/16/2006
2	524 351.49	05/2006	2	42 862.14	02/17/2000
3	464 577.95	03/2000	3	39 242.71	06/25/1999
4	448 702.65	06/1999	4	36 761.15	05/15/2006
5	418 818.83	06/2006	5	36 656.23	06/24/2002
6	400 602.05	11/2006	6	34 698.42	02/15/2000
7	373 377.72	07/2006	7	34 353.61	12/18/2006
8	360 982.62	06/2000	8	33 712.99	05/19/2006
9	334 942.51	04/2006	9	33 581.37	12/06/2006
10	328 324.12	04/2000	10	33 509.33	05/11/2006

## 4. 深证综合指数十大升跌纪录(一九九一至二〇〇六年)

## TOP 10 RISES AND FALLS OF SSE COMPOSITE INDEX, 1991—2006

顺次 Rank	升幅率 + %	日期 Date	收市指数 Close Index	顺次 Rank	跌幅率 - %	日期 Date	收市指数 Close Index
1	31.2886	08/01/1994	126.7731	1	-18.6277	11/18/1991	104.1995
2	28.2848	05/18/1995	150.3323	2	-17.2073	05/23/1995	140.4642
3	19.2662	10/09/1991	77.7551	3	-14.8347	08/17/1991	50.1489
4	18.6512	09/05/1994	206.0375	4	-12.6553	10/05/1994	164.4285
5	18.3287	10/08/1991	65.1946	5	-11.7985	08/17/1993	282.9495
6	18.2048	11/19/1991	123.1688	6	-10.0369	11/16/1992	170.8159
7	17.2246	11/12/1991	128.3874	7	-9.9974	12/16/1996	393.2102
8	15.2935	08/03/1994	143.7919	8	-9.9718	12/17/1996	354.0001
9	12.4269	08/24/1993	286.0026	9	-9.7544	02/18/1997	322.6335
10	12.0210	04/13/1992	185.5691	10	-9.6727	05/22/1997	401.3261

顺次 Rank	升幅 +	日期 Date	收市指数 Close Index	顺次 Rank	跌幅 -	日期 Date	收市指数 Close Index
1	42.5953	02/14/2000	512.2447	1	-45.3508	05/16/1997	443.5001
2	42.5496	10/23/2001	481.9124	2	-43.6773	12/16/1996	393.2102
3	42.5374	06/24/2002	512.3754	3	-42.9760	05/22/1997	401.3261
4	33.1459	05/18/1995	150.3323	4	-40.5393	07/01/1999	466.6267
5	32.8974	06/28/1999	512.7468	5	-39.2101	12/17/1996	354.0001
6	32.3878	09/05/1994	206.0375	6	-37.8496	08/17/1993	282.9495
7	31.6128	08/24/1993	286.0026	7	-34.8726	02/18/1997	322.6335
8	30.7978	07/20/1999	469.0646	8	-33.6231	07/30/2001	577.8843
9	30.2125	08/01/1994	126.7731	9	-31.6621	12/19/1996	338.6730
10	29.5188	02/01/1993	309.9688	10	-31.2013	07/07/1997	358.5794

## 5. 深证成份指数十大升跌纪录(一九九四至二〇〇六年)

## TOP 10 RISES AND FALLS OF SSE COMPONENT INDEX, 1994—2006

顺次 Rank	升幅率 + %	日期 Date	收市指数 Close Index	顺次 Rank	跌幅率 - %	日期 Date	收市指数 Close Index
1	26.1962	08/01/1994	1 224.7147	1	-16.7533	05/23/1995	1 178.1364
2	23.4624	05/18/1995	1 287.3563	2	-11.8958	10/05/1994	1 515.9176
3	17.2857	09/05/1994	1 909.4584	3	-9.9973	12/16/1996	3 776.1703
4	13.6718	04/26/1996	1 462.4231	4	-9.9906	12/17/1996	3 398.9071
5	13.1756	08/03/1994	1 383.0526	5	-9.4577	02/18/1997	3 337.8013
6	10.3976	08/10/1994	1 560.4086	6	-8.8561	05/16/1997	5 124.9957
7	9.9988	10/23/2001	3 458.0284	7	-8.6545	05/22/1997	4 788.8839
8	9.5914	02/22/1995	1 255.5037	8	-8.2215	09/29/1994	1 865.9731
9	9.3605	02/14/2000	4 322.3731	9	-8.0611	07/07/1997	4 267.6985
10	9.3425	06/24/2002	3 478.1212	10	-7.7918	05/21/1996	1 572.7746

顺次 Rank	升幅 +	日期 Date	收市指数 Close Index	顺次 Rank	跌幅 -	日期 Date	收市指数 Close Index
1	369.9659	02/14/2000	4 322.3731	1	-497.9763	05/16/1997	5 124.9957
2	341.3550	06/28/1999	4 705.5792	2	-453.7230	05/22/1997	4 788.8839
3	330.1227	06/20/1997	4 980.5990	3	-419.4504	12/16/1996	3 776.1703
4	314.3329	10/23/2001	3 458.0284	4	-396.7590	05/08/1997	5 598.7906
5	309.8157	12/11/2006	5 951.2945	5	-377.2632	12/17/1996	3 398.9071
6	305.6336	07/20/1999	3 962.8047	6	-377.1794	05/14/1997	5 505.1407
7	297.1788	06/24/2002	3 478.1212	7	-374.1849	07/07/1997	4 267.6985
8	292.3276	05/06/1997	5 785.4854	8	-348.6528	02/18/1997	3 337.8013
9	282.4146	05/05/1997	5 493.1578	9	-295.4825	11/21/1996	3 865.9883
10	281.4186	09/05/1994	1 909.4584	10	-293.2951	07/01/1999	4 409.4786

(二)历年市场概貌

YEARLY MARKET OVERVIEW

1. 上市证券(年底数字)

LISTED SECURITIES ( Year-end Figures )

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
上市公司数目	Listed Companies	463	514	508	508	505	536	544	579
上市证券数目	Listed Securities	540	596	598	615	627	673	708	768
股票	Stocks	504	557	550	551	548	578	586	621
A股	A-Shares	450	499	494	494	491	522	531	566
B股	B-Shares	54	58	56	57	57	56	55	55
企业债	Corporate Bonds	3	2	1	4	9	13	16	24
现券	Bonds	3	2	1	4	5	9	12	20
回购	Repurchases					4	4	4	4
可转换债券	Convertible Bonds	2	3	3	6	10	13	11	7
国债	Treasury Bonds	15	16	19	25	31	39	53	62
现货	Cashes	6	7	10	16	20	28	42	53
回购	Repurchases	9	9	9	9	11	11	11	9
基金	Funds	16	18	25	29	29	30	39	46
封闭式	Close-end	16	18	25	29	29	29	29	29
开放式	Open-end						1	10	15
ETFs	ETFs								2
权证	Warrants							3	8
股票总发行股本 (百万股)	Stock Issued Capital ( Mil. Shs. )	132 870.12	158 096.84	167 391.49	173 514.77	182 753.84	200 446.79	213 364.81	237 583.29
A股	A-Shares	125 920.28	149 225.31	157 669.19	164 815.35	173 276.68	189 572.66	200 969.04	224 766.13
B股	B-Shares	6 949.84	8 871.53	9 722.31	8 699.41	9 477.15	10 874.12	12 395.77	12 817.16
股票总流通股本 (百万股)	Stock Negotiable Capital ( Mil. Shs. )	45 793.17	58 432.53	64 335.18	68 740.56	74 022.26	82 280.97	93 429.75	117 690.06
A股	A-Shares	39 751.63	51 440.87	56 835.84	60 824.83	65 568.42	72 547.58	81 975.41	105 811.01
B股	B-Shares	6 041.54	6 991.65	7 499.33	7 915.73	8 453.84	9 733.39	11 454.34	11 879.04
其它上市面额 (百万元)	Other Listed Par ( Mil. RMB ¥ )	28 553.95	32 860.00	38 300.00	54 910.32	61 849.61	75 778.59	79 730.68	92 899.19
企业债	Corporate Bonds	4 200.00	2 200.00	1 500.00	8 500.00	12 500.00	20 500.00	26 000.00	36 700.00
现券	Bonds	4 200.00	2 200.00	1 500.00	8 500.00	12 500.00	20 500.00	26 000.00	36 700.00
回购	Repurchases					0.00	0.00	0.00	0.00
可转换债券	Convertible bonds	1 700.00	3 000.00	1 500.00	4 510.32	7 449.61	12 438.21	8 194.90	6 206.11
国债	Treasury Bonds								
现货	Cashes								
回购	Repurchases								
基金	Funds	22 653.95	27 660.00	35 300.00	41 900.00	41 900.00	42 840.38	43 049.07	47 021.91
封闭式	Close-end	22 653.95	27 660.00	35 300.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00
开放式	Open-end						940.38	1 149.07	2 639.32
ETFs	ETFs								2 482.59
权证(百万份)	Warrants( Mil. )							2 486.72	2 971.17
股票市价总值 (百万元)	Stock Market Value ( Mil. RMB ¥ )	1 189 070.42	2 116 008.44	1 593 163.91	1 296 540.62	1 265 279.40	1 104 122.72	933 414.96	1 779 151.76
A股	A-Shares	1 172 690.97	2 085 943.42	1 531 104.92	1 260 513.64	1 211 983.20	1 059 527.51	895 447.86	1 699 601.06
B股	B-Shares	16 379.44	30 065.02	62 058.99	36 026.98	53 296.21	44 595.21	37 967.10	79 550.70
股票流通市值 (百万元)	Stock Nego. Market Val ( Mil. RMB ¥ )	396 427.59	760 618.89	608 105.63	501 725.78	497 737.65	433 776.26	387 590.57	857 530.88
A股	A-Shares	382 752.70	737 742.13	561 883.58	469 375.13	450 904.78	394 785.83	351 388.72	779 735.82
B股	B-Shares	13 674.88	22 876.76	46 222.05	32 350.65	46 832.87	38 990.43	36 201.85	77 795.06

## 2. 成交情况

## TRANSACTION DATA

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
总交易日	Trading Days	239	239	240	237	241	243	242	241
A 股	A-Shares	239	239	240	237	241	243	242	241
B 股	B-Shares	232	231	234	237	241	243	242	241
总成交金额 (百万元)	Total Value Traded (Mil. RMB ¥)	1 631 085.98	3 314 378.15	1 743 248.18	1 403 968.48	1 215 160.00	1 642 053.41	1 327 584.70	3 873 808.67
股票	Stocks	1 435 381.54	2 945 278.83	1 559 579.54	1 103 136.23	1 129 113.29	1 586 335.07	1 242 456.78	3 265 228.98
A 股	A-Shares	1 422 335.81	2 924 898.34	1 336 520.25	1 070 033.05	1 072 872.16	1 534 689.29	1 203 789.07	3 197 200.07
B 股	B-Shares	13 045.73	20 380.49	223 059.29	33 103.18	56 241.13	51 645.78	38 667.71	68 028.91
企业债	Corporate Bonds	215.01	136.62	84.39	1 929.42	4 783.60	2 168.72	2 982.68	4 025.04
现券	Bonds	215.01	136.62	84.39	1 929.42	4 756.70	1 748.72	2 982.68	3 801.79
回购	Repurchases					26.90	420.00	0.00	223.25
可转换债券	Convertible Bonds	4 473.35	13 506.68	4 568.04	5 087.70	21 807.51	29 871.66	19 177.74	10 547.37
国债	Treasury Bonds	79 050.47	208 689.95	57 720.40	232 829.77	27 406.16	535.55	783.68	331.25
现货	Cashes	2 409.29	50 043.30	43 254.66	232 784.74	25 575.33	495.95	783.68	331.25
回购	Repurchases	76 641.18	158 646.65	14 465.74	45.03	1 830.83	39.60	0.00	0.00
基金	Funds	111 965.61	146 766.08	121 295.81	60 985.36	32 049.44	23 142.40	19 637.23	97 830.40
封闭式	Close-end	111 965.61	146 766.08	121 295.81	60 985.36	32 049.44	23 037.47	18 523.27	84 900.64
开放式	Open-end						104.93	1 113.96	3 632.37
ETFs	ETFs								9 297.39
权证	Warrants							42 546.58	495 845.64
日均成交金额	Daily Value Traded	6 824.63	13 867.69	7 263.53	5 923.92	5 042.16	6 757.42	5 485.89	16 073.89
股票总成交量 (百万股)	Stock Volume Traded (Mil. Shs.)	137 200.61	232 072.82	133 233.33	123 509.88	147 035.52	221 999.12	263 714.40	586 129.22
A 股	A-Shares	132 149.62	224 714.41	103 371.63	116 595.94	135 964.61	212 202.88	254 398.17	568 433.96
B 股	B-Shares	5 050.99	7 358.40	29 861.70	6 913.94	11 070.92	9 796.24	9 316.23	17 695.27
日均成交量	Daily Volume Traded	574.06	971.02	555.14	521.14	610.11	913.58	1 089.73	2 432.07
其它证券成交量	Volume of Others								
企业债(万张)	Corporate Bonds	170.68	115.89	61.68	1 848.22	4 497.97	2 221.39	2 914.09	4 376.71
现券	Bonds	170.68	115.89	61.68	1 848.22	4 471.07	1 801.39	2 914.09	4 153.46
回购	Repurchases					26.90	420.00	0.00	223.25
可转债(万张)	Convertible bonds	3 133.56	11 717.49	3 684.55	4 602.95	19 425.13	26 619.17	17 869.89	9 131.61
国债(万张)	Treasury Bonds	78 833.17	208 089.62	56 865.81	231 284.33	27 366.61	566.85	795.09	334.76
现货	Cashes	2 191.99	49 442.96	42 400.06	231 239.30	25 535.78	527.25	795.09	334.76
回购	Repurchases	76 641.18	158 646.65	14 465.74	45.03	1 830.83	39.60	0.00	0.00
基金(百万单位)	Funds(Mil.)	79 516.68	118 529.94	106 027.20	64 491.44	40 755.79	29 302.08	31 967.28	101 531.32
封闭式	Close-end	79 516.68	118 529.94	106 027.20	64 491.44	40 755.79	29 194.24	30 834.66	90 902.00
开放式	Open-end						107.84	1 132.62	2 836.08
ETFs	ETFs								7 793.24
权证(百万份)	Warrants(Mil.)							42 294.15	453 958.14

2. 成交情况(续)

TRANSACTION DATA (Continued)

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
总成交笔数	Total Deals Traded	174 901 968	308 658 766	161 331 787	130 658 325	130 048 750	170 469 093	153 889 502	310 169 564
股票	Stocks	160 842 147	296 304 280	154 167 966	127 354 114	127 668 086	167 984 750	148 663 321	274 406 118
A股	A-Shares	159 990 224	294 993 896	143 024 316	124 320 290	123 351 958	164 149 245	145 728 144	269 528 800
B股	B-Shares	851 923	1 310 384	11 143 650	3 033 824	4 316 128	3 835 505	2 935 177	4 877 318
企业债	Corporate Bonds	7 933	7 030	3 354	16 349	22 564	16 602	21 405	33 128
现券	Bonds	7 933	7 030	3 354	16 349	22 540	16 560	21 405	33 058
回购	Repurchases					24	42	0	70
可转换债券	Convertible Bonds	513 702	827 248	208 841	113 571	251 603	347 669	199 382	136 280
国债	Treasury Bonds	10 034	55 379	35 421	107 609	40 801	25 759	38 409	29 399
现货	Cashes	5 284	38 279	32 908	107 599	40 487	25 751	38 409	29 399
回购	Repurchases	4 750	17 100	2 513	10	314	8	0	0
基金	Funds	13 528 152	11 464 829	6 916 205	3 066 682	2 065 696	2 094 313	1 666 119	5 519 315
封闭式	Close-end	13 528 152	11 464 829	6 916 205	3 066 682	2 065 696	2 090 674	1 610 909	4 990 618
开放式	Open-end						3 639	55 210	295 957
ETFs	ETFs								232 740
权证	Warrants							3 300 866	30 045 324
日均成交笔数	Daily Deals Traded	731 807	1 291 459	672 216	551 301	539 621	701 519	635 907	1 287 011

3. 股价指数

STOCK PRICE INDICES

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
深证综合指数	SSE Composite Index								
最高	High	525.1434	654.3736	664.8533	512.3754	449.4237	470.5456	333.2787	550.5934
最低	Low	310.6499	414.6861	439.3628	371.7915	350.7382	315.1652	237.1837	283.4824
收市	Close	402.1834	635.7310	475.9432	388.7550	378.6287	315.8121	278.7456	550.5934
深证A股指数	SSE A Share Index								
最高	High	561.5638	703.9719	698.1044	540.5943	472.8825	490.5565	344.0537	569.5760
最低	Low	333.7717	445.3171	461.9501	391.1014	364.2559	328.2483	244.7070	294.9705
收市	Close	431.8363	682.6065	499.3941	409.9503	393.4719	328.6927	290.0619	569.5760
深证B股指数	SSE B Share Index								
最高	High	125.4224	137.6855	435.5728	262.3107	281.7811	315.8078	276.8419	433.3181
最低	Low	41.5629	75.9168	124.6027	185.5211	184.8916	212.0202	186.5296	199.2200
收市	Close	84.6619	137.6855	265.6747	186.9789	272.0487	219.8041	195.6136	433.3181
深证成份指数	SSE Component Index								
最高	High	4 849.6585	5 036.5498	5 074.7786	3 568.0135	3 530.6709	4 170.2786	3 464.6634	6 647.1392
最低	Low	2 534.7177	3 486.2853	3 143.6955	2 682.4550	2 687.7204	2 997.8819	2 622.0264	2 948.7983
收市	Close	3 369.6137	4 752.7505	3 325.6641	2 759.3003	3 479.7963	3 067.5703	2 863.6129	6 647.1392
深证100指数	SSE 100 Index								
最高	High					1 211.0011	1 365.3505	1 059.5060	2 109.2485
最低	Low					975.9477	972.3635	798.7714	939.2445
收市	Close					1 097.6822	991.1304	917.5029	2 109.2485
中小板指数	SSE SME Composite Index								
最高	High							1 438.9996	2 540.8458
最低	Low							1 333.1649	1 401.9039
收市	Close							1 415.6519	2 493.2616
深市基金指数	SSE Mutual Fund Index								
最高	High		1 145.1976	1 362.8388	1 167.4420	967.2084	999.2676	779.8507	1 997.6166
最低	Low		1 018.9090	1 043.1645	876.9702	830.9564	747.1370	640.9724	760.1999
收市	Close		1 145.1976	1 139.7541	876.9702	938.4713	771.2467	772.1327	1 997.6166

## 4. 股票市盈率( 年底数字 )

## P/E RATIO ( Year-end Figures )

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
平均市盈率	Average P/E Ratio	36.30	56.04	39.79	36.97	36.19	24.63	16.36	32.72
A 股	A-Shares	37.56	58.75	40.76	38.21	37.43	25.64	16.96	33.61
B 股	B-Shares	10.38	13.06	25.30	17.51	20.92	12.90	9.11	21.01

## 5. 会员( 年底数字 )

## MEMBERSHIPS ( Year-end Figures )

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
会员总数	No. of Member Firms	318	326	284	237	205	189	177	176
本地	Local	14	16	16	17	18	18	20	22
外地	Nonlocal Floor-tra	304	310	268	220	187	171	157	154
进场会员数	ding Members	309	300	264	208	182	179	166	163
本地	Local	11	13	15	16	18	18	20	21
外地	Nonlocal	298	287	249	192	164	161	146	142
交易单元数	No. of Trading Unit	1 555	1 697	3 230	3 424	3 427	3 425	3 120	3 128

## 6. 投资者( 年底数字 )

## INVESTORS ( Year-end Figures )

		1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
A 股总户数 ( 百万 )	No. of A-Share Investors ( Mil. )	21.52	28.06	31.11	32.61	33.24	34.06	34.75	37.56
本地	Local	2.38	2.58	2.70	2.81	2.87	2.94	2.99	3.13
外地	Nonlocal	19.15	25.48	28.41	29.80	30.37	31.12	31.76	34.43
B 股总户数 ( 万 )	No. of B-Share Investors ( 10 000 )	11.14	12.69	55.15	57.73	59.70	61.28	61.92	63.47

(三)二〇〇六年各月市场概貌

MONTHLY MARKET OVERVIEW , 2006

1. 上市证券(月底数字)

LISTED SECURITIES ( Month-end Figures )

		一月 Jan	二月 Feb	三月 Mar	四月 Apr
上市公司数目	Listed Companies	542	541	541	536
上市证券数目	Listed Securities	707	707	707	708
股票	Stocks	584	583	583	578
A 股	A-Shares	529	528	528	523
B 股	B-Shares	55	55	55	55
企业债	Corporate Bonds	16	16	16	16
现券	Bonds	12	12	12	12
回购	Repurchases	4	4	4	4
可转换债券	Convertible Bonds	11	11	10	9
国债	Treasury Bonds	53	53	53	55
现货	Cashes	42	42	42	44
回购	Repurchases	11	11	11	11
基金	Funds	40	41	41	43
封闭式	Close-end	29	29	29	29
开放式	Open-end	11	12	12	13
ETFs	ETFs				1
权证	Warrants	3	3	4	7
股票总发行股本 (百万股)	Stock Issued Capital ( Mil. Shs. )	211 813.06	212 714.55	214 054.08	213 527.91
A 股	A-Shares	199 387.61	200 289.09	201 628.62	201 074.83
B 股	B-Shares	12 425.46	12 425.46	12 425.46	12 453.08
股票总流通股本 (百万股)	Stock Negotiable Capital ( Mil. Shs. )	94 381.42	96 140.15	99 135.03	102 205.86
A 股	A-Shares	82 897.38	84 656.35	87 651.21	90 694.43
B 股	B-Shares	11 484.04	11 483.80	11 483.82	11 511.43
其它上市面额 (百万元)	Other Listed Par ( Mil. RMB ¥ )	78 624.55	77 729.76	78 014.76	81 768.56
企业债	Corporate Bonds	26 000.00	26 000.00	26 000.00	26 000.00
现券	Bonds	26 000.00	26 000.00	26 000.00	26 000.00
回购	Repurchases	0.00	0.00	0.00	0.00
可转换债券	Convertible bonds	7 427.42	6 631.11	6 480.37	5 774.95
国债	Treasury Bonds				
现货	Cashes				
回购	Repurchases				
基金	Funds	42 710.41	42 611.93	42 414.49	45 825.01
封闭式	Close-end	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00
开放式	Open-end	810.41	711.93	514.49	506.84
ETFs	ETFs				3 418.17
权证(百万份)	Warrants( Mil. )	2 486.72	2 486.72	3 119.90	4 168.61
股票市价总值 (百万元)	Stock Market Value ( Mil. RMB ¥ )	1 003 189.12	1 026 055.86	1 020 917.57	1 059 831.11
A 股	A-Shares	955 384.40	977 793.52	970 113.24	1 005 338.33
B 股	B-Shares	47 804.72	48 262.34	50 804.33	54 492.78
股票流通市值 (百万元)	Stock Nego. Market Val ( Mil. RMB ¥ )	431 497.12	445 875.20	459 094.86	497 108.93
A 股	A-Shares	385 890.10	399 757.24	410 547.46	444 698.37
B 股	B-Shares	45 607.03	46 117.96	48 547.40	52 410.56



五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
528	530	532	543	546	553	566	579
703	706	710	724	729	736	752	768
570	572	574	585	588	595	608	621
515	517	519	530	533	540	553	566
55	55	55	55	55	55	55	55
17	18	18	20	20	21	21	24
13	14	14	16	16	17	17	20
4	4	4	4	4	4	4	4
9	9	8	7	7	7	7	7
56	55	57	59	60	60	62	62
45	44	46	48	49	51	53	53
11	11	11	11	11	9	9	9
43	43	44	44	46	46	46	46
29	29	29	29	29	29	29	29
13	13	14	14	15	15	15	15
1	1	1	1	2	2	2	2
8	9	9	9	8	7	8	8
212 782.85	218 471.90	221 928.68	225 211.94	226 742.51	231 515.31	234 122.73	237 583.29
200 229.47	205 900.10	209 147.59	212 423.38	213 953.95	218 726.75	221 305.57	224 766.13
12 553.38	12 571.80	12 781.09	12 788.56	12 788.56	12 788.56	12 817.16	12 817.16
103 342.31	106 487.82	109 460.81	111 235.80	112 369.91	113 461.87	115 486.34	117 690.06
91 789.70	94 916.79	97 680.53	99 448.09	100 582.24	101 674.20	103 607.31	105 811.01
11 552.61	11 571.03	11 780.29	11 787.71	11 787.67	11 787.66	11 879.03	11 879.04
81 989.04	82 927.27	82 931.36	84 578.04	85 869.59	85 981.38	85 665.33	92 899.19
27 000.00	28 500.00	28 500.00	30 500.00	30 500.00	31 500.00	31 500.00	36 700.00
27 000.00	28 500.00	28 500.00	30 500.00	30 500.00	31 500.00	31 500.00	36 700.00
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
5 704.57	5 324.80	5 154.50	4 805.70	6 206.49	6 206.48	6 206.42	6 206.11
44 691.76	44 389.75	44 564.15	44 559.62	46 590.67	46 140.15	45 674.64	47 021.91
41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00	41 900.00
529.59	477.58	723.99	716.46	868.86	757.71	671.39	2 639.32
2 262.17	2 012.17	1 940.17	1 943.17	3 821.81	3 482.44	3 103.25	2 482.59
4 592.71	4 712.71	4 712.71	4 712.71	2 572.43	2 134.74	2 284.27	2 971.17
1 248 682.28	1 310 416.74	1 216 445.53	1 272 931.25	1 332 320.00	1 377 036.49	1 561 525.63	1 779 151.76
1 190 444.61	1 254 031.48	1 162 876.43	1 218 171.13	1 272 168.38	1 314 465.24	1 492 731.46	1 699 601.06
58 237.67	56 385.25	53 569.10	54 760.11	60 151.62	62 571.25	68 794.17	79 550.70
592 363.08	616 766.84	580 647.77	608 133.08	639 563.07	655 654.17	748 583.16	857 530.88
536 679.22	562 736.80	529 382.45	555 730.54	582 283.12	595 881.35	681 587.73	779 735.82
55 683.87	54 030.05	51 265.32	52 402.54	57 279.95	59 772.82	66 995.43	77 795.06

2. 成交情况

TRANSACTION DATA

		一月	二月	三月	四月
		Jan	Feb	Mar	Apr
总交易日	Trading Days	16	17	23	20
A 股	A-Shares	16	17	23	20
B 股	B-Shares	16	17	23	20
总成交金额	Total Value Traded	148 053.70	153 738.08	174 310.19	334 942.51
(百万元)	(Mil. RMB ¥)				
股票	Stocks	134 245.77	134 672.36	149 308.94	279 824.74
A 股	A-Shares	128 330.95	130 423.22	145 135.23	272 201.80
B 股	B-Shares	5 914.82	4 249.14	4 173.70	7 622.94
企业债	Corporate Bonds	69.18	41.43	387.84	33.70
现券	Bonds	69.18	41.43	387.84	33.70
回购	Repurchases	0.00	0.00	0.00	0.00
可转换债券	Convertible Bonds	1 320.39	1 166.14	718.35	944.55
国债	Treasury Bonds	46.29	24.06	24.71	22.55
现货	Cashes	46.29	24.06	24.71	22.55
回购	Repurchases	0.00	0.00	0.00	0.00
基金	Funds	2 192.43	2 017.62	3 417.37	7 926.73
封闭式	Close-end	1 994.52	1 806.91	3 282.24	5 473.55
开放式	Open-end	197.91	210.71	135.13	179.58
ETFs	ETFs				2 273.61
权证	Warrants	10 179.64	15 816.47	20 452.98	46 190.24
日均成交金额	Daily Value Traded	9 253.36	9 043.42	7 578.70	16 747.13
股票总成交量	Stock Volume Traded	29 328.12	28 671.09	32 906.61	55 727.87
(百万股)	(Mil. Shs.)				
A 股	A-Shares	27 568.84	27 536.85	31 817.52	53 879.66
B 股	B-Shares	1 759.29	1 134.24	1 089.09	1 848.21
日均成交量	Daily Volume Traded	1 833.01	1 686.53	1 430.72	2 786.39
其它证券成交量	Volume of Others				
企业债(万张)	Corporate Bonds(10 000)	62.97	37.98	369.52	31.18
现券	Bonds	62.97	37.98	369.52	31.18
回购	Repurchases	0.00	0.00	0.00	0.00
可转债(万张)	Convertible bonds(10 000)	1 232.58	1 057.59	655.68	867.45
国债(万张)	Treasury Bonds(10 000)	46.60	24.00	24.73	22.74
现货	Cashes	46.60	24.00	24.73	22.74
回购	Repurchases	0.00	0.00	0.00	0.00
基金(百万单位)	Funds(Mil.)	3 397.88	3 105.56	5 150.87	9 751.31
封闭式	Close-end	3 206.39	2 908.09	5 026.25	7 568.98
开放式	Open-end	191.49	197.47	124.61	138.72
ETFs	ETFs				2 043.61
权证(百万份)	Warrants(Mil.)	10 423.48	16 938.28	23 151.96	39 110.89
总成交笔数	Total Deals Traded	14 553 706	14 781 885	17 015 742	28 813 368
股票	Stocks	13 396 035	13 357 085	15 102 588	25 374 361
A 股	A-Shares	12 964 027	13 052 619	14 808 425	24 870 186
B 股	B-Shares	432 008	304 466	294 163	504 175
企业债	Corporate Bonds	941	952	840	672
现券	Bonds	941	952	840	672
回购	Repurchases	0	0	0	0

五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
18	22	21	23	21	17	22	21
18	22	21	23	21	17	22	21
18	22	21	23	21	17	22	21
524 351.49	418 818.83	373 377.72	239 827.62	259 141.59	256 576.30	400 602.05	590 068.60
403 717.12	340 854.38	307 643.71	202 489.32	232 577.53	231 828.93	339 564.33	508 501.85
395 217.52	336 478.66	304 733.35	200 178.81	226 481.92	226 314.78	332 175.05	499 528.77
8 499.61	4 375.72	2 910.36	2 310.51	6 095.61	5 514.15	7 389.28	8 973.07
37.13	36.42	86.46	39.38	20.81	765.31	241.44	2 265.93
37.13	36.42	86.46	39.38	20.81	765.31	106.54	2 177.58
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	134.90	88.35
1 006.82	1 111.64	558.15	605.67	969.50	416.25	623.25	1 106.64
30.03	28.07	18.70	16.77	22.68	26.99	27.97	42.44
30.03	28.07	18.70	16.77	22.68	26.99	27.97	42.44
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
9 894.49	8 122.53	5 363.54	3 348.49	5 376.81	7 356.92	15 964.68	26 848.80
7 786.24	6 955.97	4 721.87	3 067.82	4 374.80	6 520.01	14 693.60	24 223.11
338.41	207.40	161.09	95.83	148.20	153.16	310.00	1 494.96
1 769.84	959.16	480.58	184.8	853.81	683.74	961.09	1 130.73
109 665.91	68 665.79	59 707.15	33 328.00	20 174.26	16 181.90	44 180.37	51 302.94
29 130.64	19 037.22	17 779.89	10 427.29	12 340.08	15 092.72	18 209.18	28 098.50
73 037.04	61 147.90	53 572.43	38 006.06	42 355.48	40 589.21	53 730.60	77 056.81
70 940.30	60 010.58	52 772.83	37 390.78	40 475.74	38 956.29	52 013.89	75 070.69
2 096.73	1 137.32	799.60	615.28	1 879.75	1 632.92	1 716.72	1 986.12
4 057.61	2 779.45	2 551.07	1 652.44	2 016.93	2 387.60	2 442.30	3 669.37
35.52	35.15	82.73	38.28	20.00	749.11	238.94	2 675.31
35.52	35.15	82.73	38.28	20.00	749.11	104.04	2 586.96
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	134.90	88.35
906.84	932.10	440.18	527.30	827.24	360.95	510.95	812.74
30.02	28.41	19.09	17.01	23.16	27.35	28.33	43.33
30.02	28.41	19.09	17.01	23.16	27.35	28.33	43.33
0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11 480.97	9 219.83	5 944.83	4 010.77	6 227.72	8 114.81	15 077.29	20 049.48
9 896.72	8 367.11	5 494.34	3 800.22	5 311.66	7 400.82	13 973.45	17 947.97
210.62	128.63	101.50	64.26	115.69	115.00	217.56	1 230.52
1 373.63	724.09	348.99	146.29	800.37	598.99	886.28	870.99
63 451.43	48 208.57	76 267.72	86 948.65	19 780.84	25 538.67	21 746.39	22 391.25
39 194 344	34 466 652	30 979 150	21 557 118	21 581 302	19 865 899	28 236 662	39 123 736
32 919 791	29 778 993	26 790 617	18 871 720	19 938 801	18 419 902	25 111 776	35 344 449
32 349 887	29 439 122	26 550 074	18 686 661	19 420 297	17 980 762	24 628 642	34 778 098
569 904	339 871	240 543	185 059	518 504	439 140	483 134	566 351
773	657	744	807	634	818	747	24 543
773	657	744	807	634	818	705	24 515
0	0	0	0	0	0	42	28

2. 成交情况(续)

TRANSACTION DATA (Continued)

		一月 Jan	二月 Feb	三月 Mar	四月 Apr
可转换债券	Convertible Bonds	14 944	14 895	11 430	13 943
国债	Treasury Bonds	3 174	2 103	2 356	2 345
现货	Cashes	3 174	2 103	2 356	2 345
回购	Repurchases	0	0	0	0
基金	Funds	155 401	140 729	237 590	410 733
封闭式	Close-end	145 741	131 562	229 877	363 642
开放式	Open-end	9 660	9 167	7 713	13 116
ETFs	ETFs				33 975
权证	Warrants	983 211	1 266 121	1 660 938	3 011 314
日均成交笔数	Daily Deals Traded	909 607	869 523	739 815	1 440 668

3. 股价指数(月底数字)

STOCK PRICE INDICES( Month-end Figures )

		一月 Jan	二月 Feb	三月 Mar	四月 Apr
深证综合指数	SSE COMPOSITE INDEX	307.1082	315.2953	323.4532	353.9352
深证 A 股指数	SSE A SHARE INDEX	317.3630	325.9856	333.9373	365.7655
深证 B 股指数	SSE B SHARE INDEX	246.8362	250.0642	263.8458	283.4152
深证成份指数	SSE COMPONENT INDEX	3 242.3474	3 351.6383	3 516.3964	3 848.1058
成份 A 股指数	SSE COMPONENT A	3 395.4950	3 500.9254	3 653.6814	3 990.1367
成份 B 股指数	SSE COMPONENT B	1 889.9488	1 964.5397	2 110.0819	2 331.1866
深证 100 指数	SSE 100 INDEX	1 016.7693	1 057.2488	1 101.0471	1 231.6203
中小板指数	SSE SME COMPOSITE	1 440.7537	1 449.6062	1 517.3219	1 738.7234
深市基金指数	SSE MUTUAL FUND	786.5731	784.9210	856.9974	931.1613
农林牧渔指数	AGRICULTURE INDEX	179.1770	191.1588	187.4579	203.9979
采掘业指数	MINING INDEX	542.2855	550.1497	574.5456	585.1809
制造业指数	MANUFACTURING INDEX	302.6725	311.5826	320.3407	357.8776
水电煤气指数	UTILITIES INDEX	292.9163	302.4741	294.8064	318.7607
建筑业指数	CONSTRUCTION INDEX	253.6606	249.5035	269.4900	317.0094
运输仓储指数	TRANSPORTATION INDEX	478.6196	473.3155	468.0995	514.3218
信息技术指数	IT INDEX	324.6766	306.5777	310.8283	300.8035
批发零售指数	WHOLESALE & RETAIL	246.2266	264.1799	282.1042	322.6773
金融保险指数	FINANCIALS INDEX	270.8147	292.3138	277.7771	328.0833
房地产业指数	REAL ESTATE INDEX	419.5115	448.6629	506.4813	493.6093
社会服务指数	SOCIAL SERVICES	285.7498	290.6128	299.2166	350.7467
传播文化指数	MEDIA INDEX	193.1182	194.2850	199.4735	193.0797
综合类指数	CONGLOMERATES INDEX	200.5637	207.6990	197.0622	215.0713
食品饮料指数	FOOD & BEVERAGE	423.0312	445.2475	475.7074	609.0371
纺织服装指数	TEXTILES & APPAREL	204.0531	207.6658	207.2381	214.4806
木材家具指数	TIMBER & FURNISHINGS	98.9120	103.8661	95.9257	88.4216
造纸印刷指数	PAPER & PRINTING	277.9226	275.5600	276.5960	273.5689
石化塑胶指数	PETROCHEMICALS INDEX	324.7512	336.8428	344.3194	363.0830
电子指数	ELECTRONICS INDEX	203.9494	202.7267	198.4913	206.6464
金属非金属指	METALS & NON - METALS	393.7046	402.8649	425.5304	480.3701
机械设备指数	MACHINERY INDEX	275.1376	285.4995	286.4149	316.2810
医药生物指数	PHARMACEUTICALS	206.7182	213.2896	219.4616	252.8883

五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
16 369	19 260	9 072	5 956	10 687	4 886	7 085	7 753
2 786	2 790	1 965	1 772	2 279	2 138	2 239	3 452
2 786	2 790	1 965	1 772	2 279	2 138	2 239	3 452
0	0	0	0	0	0	0	0
542 843	490 919	332 868	220 296	289 349	387 926	884 028	1 426 633
484 173	455 153	307 689	201 290	248 565	354 797	815 776	1 252 353
23 118	17 994	14 789	10 809	12 563	13 089	29 132	134 807
35 552	17 772	10 390	8 197	28 221	20 040	39 120	39 473
5 711 782	4 174 033	3 843 884	2 456 567	1 339 552	1 050 229	2 230 787	2 316 906
2 177 464	1 566 666	1 475 198	937 266	1 027 681	1 168 582	1 283 485	1 863 035

五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
417. 0194	433. 2211	406. 0947	421. 4694	438. 8965	446. 4893	495. 8849	550. 5934
433. 1452	451. 2080	422. 3463	438. 5580	455. 4540	462. 7491	514. 0660	569. 5760
301. 5149	295. 0983	285. 3117	292. 7954	323. 3582	337. 9234	373. 1688	433. 3181
4 292. 0951	4 301. 6572	3 946. 9028	4 178. 8391	4 326. 7794	4 621. 9769	5 666. 9958	6 647. 1392
4 507. 2186	4 543. 7951	4 116. 5157	4 378. 9872	4 543. 1401	4 853. 0990	5 950. 3739	6 979. 5295
2 454. 3989	2 390. 7366	2 336. 5987	2 417. 4699	2 503. 4153	2 720. 5948	3 129. 7905	3 824. 7600
1 450. 2916	1 489. 4682	1 374. 7192	1 440. 8532	1 492. 7407	1 548. 8921	1 838. 9877	2 109. 2485
2 115. 6672	2 251. 5528	2 026. 2510	2 119. 6910	2 225. 4382	2 156. 5753	2 306. 2786	2 493. 2616
1 011. 9289	1 096. 8411	1 020. 7277	1 076. 0791	1 132. 9986	1 318. 8697	1 642. 0762	1 997. 6166
268. 0502	305. 2243	274. 8906	281. 7273	297. 1290	292. 5160	311. 2231	356. 2677
658. 0833	647. 5284	551. 9431	557. 4614	551. 2266	561. 5599	622. 4174	687. 5385
424. 9064	444. 3111	416. 8758	426. 5324	442. 4538	455. 2177	496. 1850	555. 2092
381. 3151	409. 4587	375. 7009	374. 4037	381. 8627	395. 8021	429. 8181	452. 5693
400. 0133	409. 2351	391. 9948	401. 2202	393. 7196	387. 5388	420. 2679	438. 6820
573. 7950	622. 9650	579. 2973	587. 2377	614. 1738	622. 8535	664. 5267	692. 7103
345. 1564	374. 2313	334. 4477	350. 8558	369. 1135	365. 3475	395. 3013	402. 6937
411. 8924	450. 1534	418. 8764	448. 9177	473. 6362	457. 7991	528. 4358	606. 9957
404. 4503	377. 5986	312. 8639	345. 1829	374. 3079	391. 7344	504. 9116	612. 6445
530. 3031	490. 1307	505. 6681	592. 0822	626. 5865	639. 1381	849. 8009	1 008. 3933
412. 3972	379. 5669	374. 7782	409. 7985	440. 8934	438. 3372	485. 2603	518. 3177
247. 2647	264. 8137	254. 0142	255. 1993	294. 5934	264. 2457	245. 1215	249. 0709
250. 4839	265. 2158	262. 2071	274. 2406	282. 9504	270. 6590	297. 8927	310. 9734
726. 4815	803. 4473	749. 5480	736. 0358	766. 9811	750. 0674	883. 4237	1 086. 5213
261. 9939	278. 6039	268. 6905	269. 8897	286. 0189	290. 6115	286. 3150	316. 0715
108. 3366	112. 5964	115. 0993	121. 0955	127. 8453	134. 3848	124. 4781	126. 9071
322. 1597	331. 3583	300. 2147	324. 2584	333. 5146	334. 2187	348. 6333	357. 0537
426. 2766	440. 7958	421. 3858	433. 9130	453. 1031	458. 1364	475. 7829	481. 2676
249. 5696	259. 4788	233. 9225	245. 8497	257. 3526	251. 7715	250. 0484	261. 4847
555. 3680	560. 0848	512. 1617	535. 0261	539. 0754	599. 2649	678. 1218	762. 2232
385. 5812	405. 8266	389. 8163	395. 5917	415. 2688	419. 4814	452. 4390	512. 4186
300. 3294	320. 4164	306. 5562	311. 6372	331. 0374	322. 7596	343. 1760	394. 5002

4. 股票市盈率( 月底数字 )

P/E RATIO ( Month-end Figures )

		一月	二月	三月	四月
		Jan	Feb	Mar	Apr
平均市盈率	Average P/E Ratio	17.79	18.05	18.20	20.98
A 股	A-Shares	18.32	18.57	18.78	21.64
B 股	B-Shares	11.46	11.69	11.60	13.62

5. 会员( 月底数字 )

MEMBERSHIPS ( Month-end Figures )

		一月	二月	三月	四月
		Jan	Feb	Mar	Apr
会员总数	No. of Member Firms	177	176	176	176
本地	Local	20	20	20	20
外地	Nonlocal	157	156	156	156
进场会员数	Floor-trading Members	166	166	166	166
本地	Local	20	20	20	20
外地	Nonlocal	146	146	146	146
交易单元数	No. of Trading Unit	3 120	3 120	3 120	3 119

6. 投资者( 月底数字 )

INVESTORS ( Month-end Figures )

		一月	二月	三月	四月
		Jan	Feb	Mar	Apr
A 股总户数( 百万 )	No. of A-Share Investors( Mil. )	34.81	34.89	34.99	35.17
本地	Local	3.00	3.00	3.01	3.02
外地	Nonlocal	31.82	31.88	31.98	32.14
B 股总户数( 万 )	No. of B-Share Investors( 10 000 )	62.02	62.12	62.19	62.30

五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
24.47	25.37	23.57	24.53	25.43	25.57	28.90	32.72
25.37	26.35	24.41	25.41	26.28	26.34	29.77	33.61
14.35	13.99	13.65	14.02	15.19	15.95	17.83	21.01

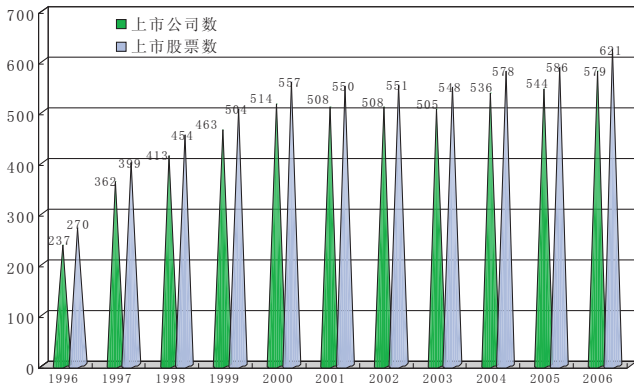
五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
176	175	175	175	176	177	176	176
20	20	20	20	21	22	22	22
156	155	155	155	155	155	154	154
167	167	167	168	166	164	164	163
20	20	20	20	20	20	21	21
147	147	147	148	146	143	143	142
3 119	3 122	3 121	3 124	3 117	3 119	3 121	3 128
122	120	117	117	114	113	110	107
2 881	2 883	2 885	2 888	2 884	2 887	2 892	2 901
35	35	35	35	35	35	35	35
44	44	44	44	44	44	44	45

五月 May	六月 Jun	七月 Jul	八月 Aug	九月 Sep	十月 Oct	十一月 Nov	十二月 Dec
35.44	35.71	35.89	35.98	36.10	36.21	36.41	37.56
3.05	3.06	3.07	3.08	3.08	3.09	3.10	3.13
32.39	32.64	32.82	32.90	33.02	33.12	33.31	34.43
62.49	62.61	62.68	62.73	62.98	63.13	63.27	63.47

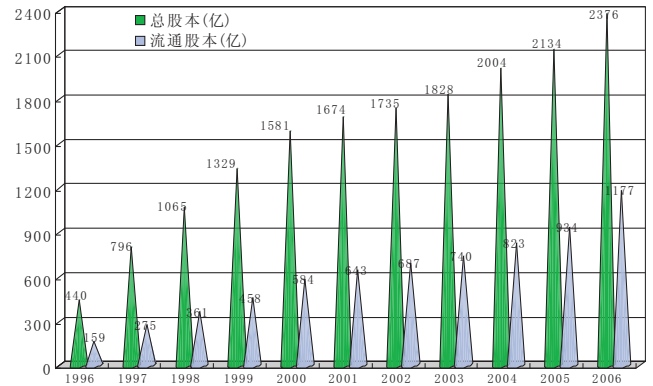
### 深圳证券市场近十年来的发展

### SHENZHEN SECURITIES MARKET, 1996—2006

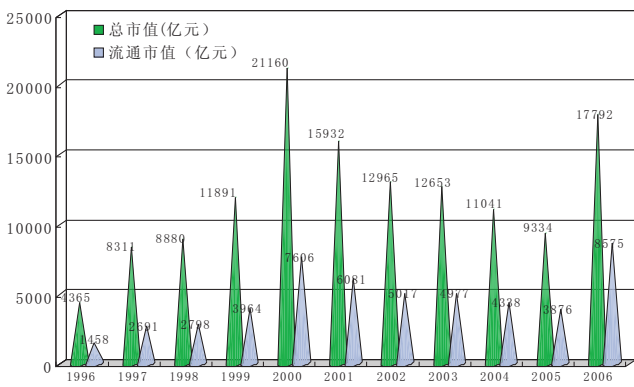
上市公司数和上市股票数



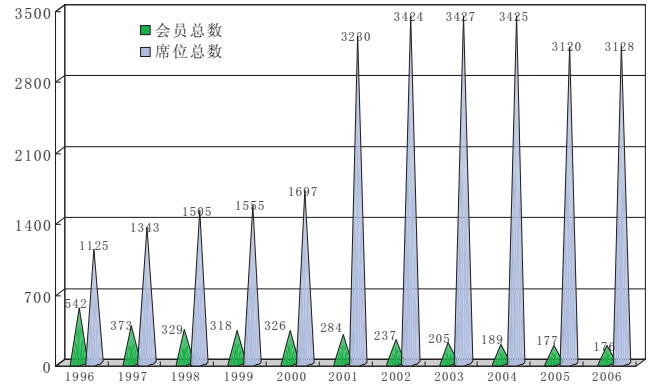
上市公司总股本和流通股本



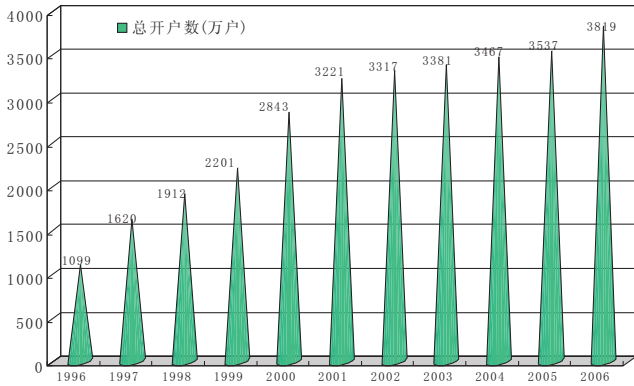
上市公司总市值和流通市值



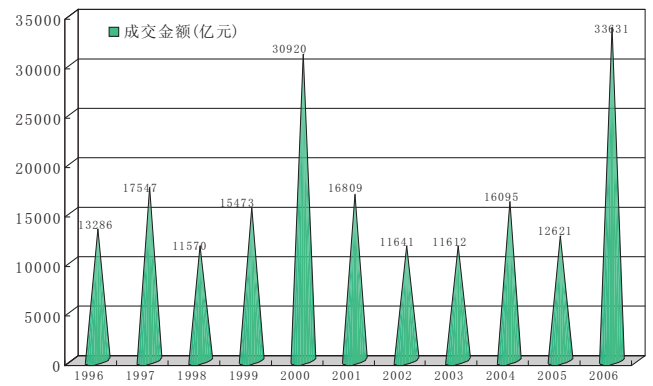
会员数和席位数



投资者开户数



股票、基金成交总额





## (五)深圳证券交易所收费一览表

## FEES OF SHENZHEN STOCK EXCHANGE

收费项目 Items	收费标准 Fees	备注 Remarks
1. A股、基金、债券、权证等的交易		
(1) A股		
佣金	不得高于成交金额的0.3%，也不得低于代收的证券交易 监管费和证券交易所手续费，起点5元	投资者交证券公司
印花税	成交金额的0.1%	投资者交国家税务局
交易经手费	成交金额的0.01475%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.004%	证券公司交证监会
(2) 国债现货		
佣金	不超过成交金额的0.1%	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额100万以下(含100万)的0.1元/笔 成交金额100万以上的10元/笔	证券公司交深交所
(3) 企业债现货		
佣金	不超过成交金额的0.1%	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额的0.004%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.001%	证券公司交证监会
(4) 国债回购		
佣金	1天按不超过成交金额的0.002%收取 2天按不超过成交金额的0.003%收取 3天按不超过成交金额的0.005%收取 4天按不超过成交金额的0.006%收取 7天按不超过成交金额的0.01%收取 14天按不超过成交金额的0.02%收取 28天按不超过成交金额的0.04%收取 63天按不超过成交金额的0.05%收取 91天按不超过成交金额的0.06%收取 182天按不超过成交金额的0.07%收取 273天按不超过成交金额的0.07%收取	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额100万以下(含100万)的0.1元/笔 成交金额100万以上的1元/笔 反向交易不再收取	证券公司交深交所
(5) 企业债回购		
佣金	1天按不超过成交金额的0.002%收取 2天按不超过成交金额的0.003%收取 3天按不超过成交金额的0.005%收取 4天按不超过成交金额的0.006%收取 7天按不超过成交金额的0.01%收取	投资者交证券公司
(6) 可转换债券		
佣金	不超过成交金额的0.1%	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额的0.004%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.001%	证券公司交证监会

## (五) 深圳证券交易所收费一览表(续)

## FEES OF SHENZHEN STOCK EXCHANGE (Continued)

收费项目 Items	收费标准 Fees	备注 Remarks
(7) 证券投资基金		
佣金	不得高于成交金额的0.3%，也不得低于代收的证券交易监管费和证券交易所手续费，起点5元	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额的0.00975%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.004%	证券公司交证监会
(8) 大宗交易		
A股的经手费	按集中竞价交易方式下A股交易经手费率标准下浮30%收取	
B股、基金的经手费	按集中竞价交易方式下同品种的费率标准下浮50%收取	
债券、回购的经手费	按集中竞价交易方式下同品种的费率标准收取。	
(9) 权证		
佣金	不得高于成交金额的0.3%，也不得低于代收的证券交易监管费和证券交易所手续费，起点5元	投资者交证券公司
交易经手费	成交金额的0.0045%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.004%	证券公司交证监会
(10) 要约收购	参照A股收费标准。	
(11) 代办A股		
佣金	成交金额的0.3%	投资者交证券公司
印花税	成交金额的0.1%	投资者交国家税务局
交易经手费	成交金额的0.01%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.05%	证券公司交证券业协会
(12) 代办B股		
佣金	成交金额的0.4%	投资者交证券公司
印花税	成交金额的0.1%	投资者交国家税务局
交易经手费	成交金额的0.013%	证券公司交深交所
证券交易监管费	成交金额的0.067%	证券公司交证券业协会
(13) 专项资产管理计划		
佣金	不超过转让金额的0.3%	投资者交证券公司
交易经手费	转让金额的0.032%	证券公司交深交所
证券交易监管费	按转让金额双边收取0.01%	证券公司交证监会

## 2. B股交易

## (1) B股/B股权证交易

佣金	不得高于成交金额的0.3%，也不得低于代收的证券交易监管费和证券交易所手续费，起点5港元	投资者交证券公司
印花税	成交金额的0.1%	投资者交国家税务局
交易经手费	成交金额的0.0301%	证券公司交深交所
证券管理费	成交金额的0.004%	证券公司交证监会

## (五)深圳证券交易所收费一览表(续)

## FEES OF SHENZHEN STOCK EXCHANGE (Continued)

收费项目 Items	收费标准 Fees	备注 Remarks
<b>3. 上市费用</b>		
(1) 股票		发行人交深交所
上市初费	3 万元	
上市月费	5000 万元股本以下 500 元, 每增加 1000 万元股本增收 100 元, 上限 2500 元	
(2) 证券投资基金		发行人交深交所
上市初费	3 万元	
上市月费	5000 元	
(3) 企业债/转债		发行人交深交所
上市初费	上市总额的 0.01%, 不超过 3 万元	
上市月费	1 亿元以下 500 元, 每增加 2000 万元增收 100 元, 上限 2000 元	
(4) 权证		发行人交深交所
上市初费	20 万元	
(5) 配股		发行人交深交所
配股手续费	按配股金额 0.35% 收取	
(6) 专项资产管理计划		设立人交深交所
上市初费	转让份额总额的 0.008%, 最高不超过 25000 元。	
上市月费	转让份额总额为依据, 1 亿元为基数, 每月交纳 500 元, 每增加 2000 万元月费增加 100 元, 最高不超过 2000 元。	
<b>4. 席位管理费</b>		
(1) 席位费	60 万元/个	会员交深交所
(2) 交易单元费用		会员交深交所
交易单元使用费	对会员使用超出交费席位(指已交席位初费的席位)数量以外的交易单元, 每年收取 30000 元/个的交易单元使用费。	
流速费	对会员使用超出交费席位(指已交席位初费的席位)数量以外的流速, 每年收取 9600 元/份的流速费。	
流量费	每笔交易类申报(指买入、卖出、撤单申报)收取 0.15 元, 每笔非交易类申报(指除买入、卖出、撤单以外的申报)收取 0.01 元。此项费用以会员为单位收取, 最低收费标准为每家会员每年 2 万元。详细计收方法见本所《关于调整席位管理年费收费模式的通知》(深证会[2004]191 号)。	
(3) 席位转让费	6 000 元/个	会员交深交所

注:经手费和证券交易监管费包含在佣金之中,证券交易所风险基金由交易所自行计提,不另外收取。