



立信會計師事務所有限公司

Shu Lun Pan Certified Public Accountants Co., Ltd.

审计报告

信会师报字（2007）第 23171 号

东方红 1 号集合资产管理计划清算组：

我们审计了后附的东方红 1 号集合资产管理计划（简称“东方红 1 号”）清算报表，包括 2007 年 7 月 4 日的清算资产负债表及清算财产表以及 2007 年 6 月 24 日至 2007 年 7 月 4 日的清算损益表及债务清偿表。

一、管理人对清算报表的责任

按照清算事项说明二所述的编制基础编制清算报表是集合计划管理人——东方证券股份有限公司的责任。这种责任包括：设计、实施和维护与清算报表编制相关的内部控制，以使清算报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对清算报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师执业准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师执业准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对清算报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关清算报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的清算报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与清算报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。



立信會計師事務所有限公司

Shu Lun Pan Certified Public Accountants Co., Ltd.

三、审计意见

我们认为，东方红 1 号清算报表已经按照清算事项说明二所述的编制基础编制，在所有重大方面公允地反映了 2007 年 7 月 4 日的清算资产负债状况以及 2007 年 6 月 24 日至 2007 年 7 月 4 日的清算损益及债务清偿情况。

立信会计师事务所

有限公司

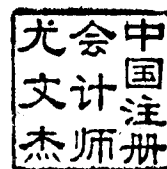


中国·上海

中国注册会计师：朱 颖



中国注册会计师：尤文杰



二〇〇七年七月六日

东方红1号集合资产管理计划 清算资产负债表

2007年7月4日

金额单位:人民币元

项 目	清算结束日 2007-7-4	集合计划终止日 2007-6-23
资产		
普通资产:		
银行存款	818,074,407.56	1,132,005,467.93
结算备付金	72,579.77	2,689,114.87
交易保证金	1,089,429.40	992,120.29
应收利息	469,897.40	61,931.80
股票投资市值	4,630,500.00	4,630,500.00
其中: 股票投资成本	4,630,500.00	4,630,500.00
资产总计	824,336,814.13	1,140,379,134.89
债务及清算净损益		
普通债务:		
应付管理人报酬		321,195,151.04
应付佣金		785,066.15
应付托管费		177,861.81
其他应付款	5,793,961.29	
债务合计	5,793,961.29	322,158,079.00
清算净损益:		
清算净收益(清算净损失以“-”号表示)	818,542,852.84	818,221,055.89
债务及清算净损益总计	824,336,814.13	1,140,379,134.89
计划管理人:	计划托管人:	

东方红1号集合资产管理计划

清算财产表

2007年7月4日

金额单位:人民币元

项 目	清算结束日 2007-7-4	预计可变现金额
普通财产:		
银行存款	818,074,407.56	818,074,407.56
结算备付金	72,579.77	72,579.77
交易保证金	1,089,429.40	1,089,429.40
应收股利		
应收利息	469,897.40	469,897.40
其他应收款		
股票投资市值	4,630,500.00	4,630,500.00
其中: 股票投资成本	4,630,500.00	4,630,500.00
债券投资市值		
其中: 债券投资成本		
买入返售证券		
待摊费用		
其他资产		
清算财产总计	824,336,814.13	824,336,814.13

计划管理人:

计划托管人:

东方红1号集合资产管理计划 清算损益表

2007年6月24日至2007年7月4日

金额单位:人民币元	
项 目	本期数
一、清算收益 (清算损失以 “-” 号表示)	818,221,055.89
二、存款利息收入	407,965.60
清算收入小计	818,629,021.49
三、托管费	5,604.25
四、清算费用	80,564.40
1、财产清理费	
2、诉讼费	
3、审计费	80,000.00
4、银行手续费	564.40
5、律师费	
清算支出小计	86,168.65
五、清算净收益 (清算净损失以 “-” 号表示)	818,542,852.84

计划管理人:

计划托管人:

东方红1号集合资产管理计划 债务清偿表

2007年6月24日至2007年7月4日

金额单位：人民币

项目	集合计划终止日 2007-6-23	本期增加	本期减少	清算结束日 2007-7-4	本期以现金清偿
普通债务：					
应付管理人报酬	321,195,151.04		321,195,151.04		321,195,151.04
应付佣金	785,066.15		785,066.15		785,066.15
应付托管费	177,861.81	5,604.25	183,466.06		183,466.06
其他应付款		5,793,961.29		5,793,961.29	
债务合计	322,158,079.00	5,799,565.54	322,163,683.25	5,793,961.29	322,163,683.25

计划管理人：

计划托管人：