

清算事项说明

2007年6月24日至2007年7月4日
(除另有说明外,以人民币元为货币单位)

一、东方红1号集合资产管理计划简介

1、基本情况

东方红1号集合资产管理计划(简称“本集合计划”)经中国证券监督管理委员会证监机构字[2005]40号文《关于同意东方证券股份有限公司设立东方红1号集合资产管理计划的批复》的批准,由东方证券股份有限公司作为集合资产管理计划的推广机构和管理人,于2005年6月24日正式成立。本集合计划类型为非限定性集合资产管理计划,存续期为2年,自2005年6月24日至2007年6月23日止。本集合计划的托管人为中国农业银行。

本集合计划在推广期间实收参与资金为632,160,014.00元(含利息转份额),折合632,160,014.00份计划份额,该资金已经安永大华会计师事务所有限责任公司出具“安永大华业字(2005)第0687号”验资报告审验。

2、清算原因

存续期限到期。

3、清算期间

根据本集合计划资产管理合同约定,于2007年6月23日终止本集合计划,并于2007年6月24日开始清算,清算期自2007年6月24日开始至2007年7月4日。

4、其他重要清算事项

根据管理人——东方证券股份有限公司《关于“东方红1号”清算方案的报告》的决定,首先,对于因停牌而不能流通变现的股票,以最大限度地保护投资者利益为原则,由管理人用自有资金按停牌前一日的收盘价并考虑停牌后除权除息因素后的估值金额垫付,将停牌的股票在复牌后进行陆续变现,待全部停牌股票变现后,如果全部变现后的金额大于垫付的资金,这部分的收益归投资者所有,按投资者的份额进行再次分配;如果全部变现后的金额小于垫付的资金,产生的亏损由管理人承担。其次,由于股票停牌等原因,中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金账户和保证金账户的资金由管理人用自有资金垫付。

二、清算报表编制基础

自本集合计划终止日起,资产负债按清算价格计价。对于因停牌而不能流通变现的股票,详见“清算事项说明一之4”。

三、清算情况

自2007年6月24日起,清算组对公司的资产、负债进行清算,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

(一) 资产处置情况

1、截止2007年6月23日银行存款为1,132,005,467.93元,清算期间收到银行存款8,313,187.28元(其中收到管理人——东方证券股份有限公司用自有资金的垫付金额5,793,961.29元),偿还各项负债和费用共计322,244,247.65元,清算结束日银行存款为818,074,407.56元。

2、截止2007年6月23日结算备付金为2,689,114.87元,清算期间收回2,616,535.10元,清算结束日结算备付金为72,579.77元。

3、截止2007年6月23日交易保证金为992,120.29元,清算期间增加97,309.11元,清算结束日交易保证金为1,089,429.40元。

4、截止2007年6月23日应收利息为61,931.80元,清算期间计提应收利息407,965.60元,清算期间收回0.00元,清算结束日应收利息为469,897.40元,其中应收银行存款利息468,445.28元、应收结算备付金利息1,452.12元。

应收银行存款利息为应收托管人——中国农业银行的存款利息,计息期为自2007年6月21日开始至剩余财产分配日2007年7月9日。

5、截止2007年6月23日股票投资市值为4,630,500.00元(其中股票投资成本为4,630,500.00元),系股票名称为西飞国际(股票代码000768)15万股于2007年5月18日停牌而不能流通变现,清算期间该股票仍处于停牌,清算结束日股票投资市值为4,630,500.00元(其中股票投资成本为4,630,500.00元)。

(二) 负债处置情况

1、截止2007年6月23日应付管理人报酬为321,195,151.04元,清算期间计提管理人——东方证券股份有限公司业绩报酬0.00元,偿还管理人业绩报酬321,195,151.04元,清算结束日应付管理人报酬为0.00元。

2、截止2007年6月23日应付佣金为785,066.15元,清算期间偿还管理人——东方证券股份有限公司佣金785,066.15元,清算结束日应付佣金为0.00元。

3、截止2007年6月23日应付托管费为177,861.81元,清算期间计提托管费5,604.25元,清算期间偿还托管人——中国农业银行托管费183,466.06元,清算结束日应付托管费为0.00元。

4、截止2007年6月23日其他应付款为0.00元，清算期间管理人——东方证券股份有限公司用自有资金的垫付金额5,793,961.29元，清算结束日其他应付款为5,793,961.29元，其中管理人——东方证券股份有限公司垫付结算备付金72,579.77元、交易保证金1,089,429.40元、应收结算备付金利息1,452.12元、股票投资市值4,630,500.00元（股票投资成本4,630,500.00元）。

（三）持有人权益情况

截止2007年6月23日持有人权益为818,221,055.89元，清算结束日持有人权益为818,542,852.84元。

（四）清算损益情况

清算期间共发生清算净损益818,542,852.84元，明细如下：

项 目	金额
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（注）	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

注：托管费5,604.25元系2007年6月24日计提2007年6月23日的托管费。

四、清算结束日的资产负债及剩余财产分配情况

清算结束日剩余财产818,542,852.84元，根据本集合计划资产管理合同约定，将全部分配给本集合计划全部持有人。

管理人——东方证券股份有限公司决定于2007年7月9日分配清算结束日剩余财产。

截止2007年6月23日单位净值为1.5104元，清算结束日单位净值为1.5110元。