

关于东方红 1 号集合资产管理计划第一次提取业绩报酬的公告

根据《东方红 1 号集合资产管理合同》和《东方红 1 号集合资产管理计划说明书》，因我公司管理的东方红 1 号集合资产管理计划（以下简称“东方红 1 号”）第一年收益率大于 2.25%，因此我公司作为管理人应于第一年的最后一个工作日（即 2006 年 6 月 23 日）提取业绩报酬，业绩报酬的计算公式如下：

年收益率 (R)	计提比例	年业绩报酬 (F) 计算方法
当 $2.25\% < R \leq 7\%$	30%	$F = A^* \times (R - 2.25\%) \times 30\%$
当 $7\% < R \leq 10\%$	40%	$F = A \times (7\% - 2.25\%) \times 30\% + A \times (R - 7\%) \times 40\%$
当 $R > 10\%$	50%	$F = A \times (7\% - 2.25\%) \times 30\% + A \times (10\% - 7\%) \times 40\% + A \times (R - 10\%) \times 50\%$

* 注：A：管理人在对集合计划运作的第 1 年收益计提业绩报酬时，A 为集合计划成立日的总净值；

其中，收益率 R 的计算方法为：

$$\text{第1年收益率} = \frac{\text{第1年年末份额净值} + \text{第1年份额累计分红} - \text{份额面值}}{\text{份额面值}}$$

因此，

$$R = (\text{2006 年 6 月 23 日份额净值 1.3668 元} + \text{第一年份额累积分红 0.376 元} - \text{份额面值 1.00 元}) / \text{份额面值 1.00 元} = 74.28\%$$

管理人提取业绩报酬为：

$$F = Ax(7\% - 2.25\%) \times 30\% + Ax(10\% - 7\%) \times 40\% + Ax(74.28\% - 10\%) \times 50\% = 219770428.87 \text{ 元} \text{（即每一份额提取业绩报酬为 0.34765 元）}$$

A 为东方红 1 号成立日净值 632160014.00 元。

经第一年两次向客户分红和我公司提取业绩报酬后，东方红 1 号 2006 年 6 月 23 日的单位净值为 1.0191 元。

东方红 1 号于 2006 年 6 月 24 日进入第二年的新一期封闭运作，以 1.0191 元作为单位初始净值，仅在经管理人精心运作、东方红 1 号单位净值达到 1.0420 元以上（即当期收益 2.25% 以上）后，管理人才能按上述公式累进提取业绩报酬。

以上各项均经东方红 1 号托管人中国农业银行复核、确认。

特此公告。

