

关于东方红 1 号集合资产管理计划

第二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”）第二年收益率大于 2.25%，因此我公司作为管理人应于第二年的最后一个工作日（即 2007 年 6 月 23 日）提取业绩报酬 321,195,151.04 元，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：

$$\text{第2年收益率} = \frac{\text{第2年年末份额净值} + \text{第2年份额累计分红} + L - \text{第1年年末份额净值}}{\text{第1年年末份额净值}}$$

注：L 为第 1 年份额亏损

当第 1 年年末份额净值 + 第 1 年份额累计分红 < 份额面值时，L = 第 1 年年末份额净值 + 第 1 年份额累计分红 - 份额面值

当第 1 年年末份额净值 + 第 1 年份额累计分红 ≥ 份额面值时，L = 0

因此，第 2 年份收益率（R）=121.1068%

$R = (2007 \text{ 年 } 6 \text{ 月 } 23 \text{ 日份额净值 } 2.1033 \text{ 元} + \text{第 } 2 \text{ 年份份额累积分红 } 0.15 \text{ 元} + 0 - \text{第 } 1 \text{ 年年末份额净值 } 1.0191 \text{ 元}) / \text{第 } 1 \text{ 年年末份额净值 } 1.0191 \text{ 元} = 121.1068\%$

当年收益率（R）>10%时，管理人提取业绩报酬为：

$$F = A \times (7\% - 2.25\%) \times 30\% + A \times (10\% - 7\%) \times 40\% + A \times (R - 10\%) \times 50\%$$

$$F = A \times \{ (7\% - 2.25\%) \times 30\% + (10\% - 7\%) \times 40\% + (121.1068\% - 10\%) \times 50\% \}$$

$$F = 321,195,151.04 \text{ 元}$$

（注：A = 1.0191 元 * 541,739,378.80 份 = 552,086,600.94 元）

管理人在对“东方红 1 号”运作的第 2 年收益计提业绩报酬时，A 为集合计划成立日起，第 1 年最后一个交易日的份额净值与集合计划退出办理结束后的总份额的乘积。

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。

