

关于东方红建赢 1 号集合资产管理计划

业绩报酬提取方式的公告

根据《东方红建赢 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）的约定，在东方红建赢 1 号集合资产管理计划（以下简称本集合计划）分红日提取业绩报酬的，业绩报酬通过扣减分红资金和/或调减份额的方式提取（具体由管理人在分红公告中确定）。现管理人决定，自 2023 年 2 月 24 日（含）起，本计划分红日提取业绩报酬的，**业绩报酬仅可通过扣减分红资金的方式提取**（具体由管理人在分红公告中确定）。

业绩报酬的计提方法保持不变，具体如下：

业绩报酬计提日为本集合计划分红日、投资者退出日或本集合计划终止日。每份集合计划份额的业绩报酬以该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提确认日（如无上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提确认日，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与确认日，下同）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R ，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的累计单位净值，如无则为该份额认购或参与时适用的累计单位净值；

C 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值，如无则为该份额认购或参与时适用的单位净值；

D 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提确认日（含）与本次业绩报酬计提日（含）的间隔天数。

该笔集合计划份额提取的业绩报酬如下：

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（Hi）计算方法
$R \leq R_x$	0	$H_i = 0$
$R_x < R$	M_1	$H_i = (R - R_x) \times M_1 \times C \times F \times \frac{D}{365}$

其中：F 为该笔提取业绩报酬的份额；业绩报酬计提基准 R_x 为【5.5%】、提取比例 M_1 为【20%】，经管理人、托管人和投资人书面一致同意后，可以修改业

绩报酬计提基准 R_x 、计提比例 M_1 。业绩报酬计提基准 R_x 、计提比例 M_1 调整后退出的份额在整个业绩报酬计算周期内将采用调整后的业绩报酬计提基准 R_x 、计提比例 M_1 进行业绩考核。登记结算机构按最新公告的年化业绩报酬计提基准 R_x 、提取比例 M_1 进行业绩报酬的计提。该业绩报酬金额为含税金额。

业绩报酬计提基准仅用于约定计提业绩报酬的标准，不构成资产管理人对集合计划收益的承诺或保证。

上述调整对投资者利益无实质性不利影响，且修改不涉及《资产管理合同》的变更或当事人权利义务关系发生重大变化。

感谢广大投资者一直以来给予的关注和支持！如有疑问，投资者可咨询通过以下途径查询或咨询，网址：www.dfham.com；服务热线：4009200808。

上海东方证券资产管理有限公司
2023 年 2 月 20 日