

海通宝汇跨境美债 1 号分级集合资产管理计划

优先级份额第三个运作期起始公告

海通宝汇跨境美债 1 号分级集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）为分级的债券型产品。自 2018 年 8 月 16 日起，本集合计划进入第三个运作期。优先级份额（SF6253）于第三个运作期的具体安排如下：

名称	海通宝汇跨境美债 1 号分级集合资产管理计划优先级份额							
产品代码	SF6253							
份额类别	优先级份额（第一期）							
第二个运作期起始日	2018 年 8 月 16 日 管理人有权对具体日期进行调整							
封闭期	第三个封闭期限为第三个运作期起始日至计划终止日(即 2018 年 8 月 16 日至 2019 年 8 月 5 日)，封闭期结束后将办理优先级份额的清退业务。管理人可根据合同约定对计划进行展期或提前终止，具体安排见管理人届时公告。							
优先级收益(第二年)	本集合计划优先级份额享有预期收益并承担汇率浮动的收益或风险。 优先级第一期在第三个运作期间的预期年化收益率为 3.09%,该预期年化收益率的估值覆盖区间是自第三个运作期起始日到计划终止日。 优先级份额收益情况不仅仅受到管理人对其事先披露的人民币预期年化收益率的影响，还将受持有期间的汇率汇兑损益情况影响上下波动。优先级委托人本金存在或有损失的风险。							
参与、退出费率	<div>1、参与费（包括认购/申购费）：0%。</div> <div>2、退出费：委托人申请退出本集合计划时须按退出份额的持有期限缴纳退出费，具体退出费率如下：</div> <table><tr><td>持有期限（T）（年以 365 天为单位）</td><td>退出费率（%）</td></tr><tr><td>T ≤3 年</td><td>2</td></tr><tr><td>3 年< T</td><td>0</td></tr></table> <div>对于委托人参与本集合计划，但是直至计划终止之日（包括提前终止日），其持有份额的期限仍不超过 3 年的，管理人对该部分份额免收退出费。对于管理人为委托人办理强制退出的，亦免收退出费。</div>		持有期限（T）（年以 365 天为单位）	退出费率（%）	T ≤3 年	2	3 年< T	0
持有期限（T）（年以 365 天为单位）	退出费率（%）							
T ≤3 年	2							
3 年< T	0							
自有资金参与	管理人有权在存续期间以自有资金参与本集合计划份额。							
风险提示	优先级份额为 R2 收益品种，适合具有一定风险承受能力的投资者。优先级份额具有相对稳定收益和本金保护的安排，但考虑到投资风险的不确定性、汇率波动影响，其约定的预期收益的获得及其分配也具有不确定性，在本集合计划资产出现极端损失情况下，优先级份额仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。							

特别风险揭示	<p>根据预期年化收益率所计算的优先级委托人的预期收益率仅为优先级委托人可得收益的估计，并不代表优先级委托人的实际可得收益。预期收益率并不是管理人向委托人保证其资产不受损失或保证其取得最低收益的承诺。</p> <p>优先级份额收益情况不仅仅受到管理人对其事先披露的人民币预期年化收益率的影响，还将受持有期间的汇率汇兑损益情况影响上下波动。优先级委托人本金存在或有损失的风险。</p>
强制退出风险揭示	<p>管理人可根据法律法规或监管部门对集合资产管理计划的最新规定限制，相应调整份额配比及杠杆倍数，管理人有权通过强制退出优先级份额下调杠杆比例。</p>

特此公告。

上海海通证券资产管理有限公司

2018年8月3日

