

海通半年升集合资产管理计划 睿系列 1 期第一个运作周期结束的公告

根据《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）及 2017 年 7 月 3 日发布的《海通半年升集合资产管理计划睿系列 1 期封闭运作期起始的公告》、2017 年 7 月 5 日发布的《海通半年升集合资产管理计划睿系列 1 期建仓期结束的公告》，海通半年升集合资产管理计划睿远 1 期（代码：852201）、海通半年升集合资产管理计划睿丰 1 期（代码：852202）第一个运作周期的起始日为 2017 年 7 月 4 日，到期日为 2018 年 7 月 3 日。现将第一个运作周期的到期情况公告如下：

1、睿系列 1 期于 2017 年 7 月 4 日当日建仓完毕，建仓期届满日中证 500 指数为 6146.85 点，睿远 1 期单位净值为 0.9963 元；2018 年 7 月 3 日中证 500 指数为 5197.13 点，第一个运作周期天数为 365 天，期间指数收益率为-15.45%，跟踪指数净值为 0.8424 元。根据《资产管理合同》及相关公告的约定，睿远 1 期的收益为期间中证 500 指数涨跌幅+7%，即 7 月 3 日折算前睿远 1 期的单位净值为 $0.8424+7\%=0.9124$ (元)。折算后单位净值为 1.0000 元，折算将使睿远 1 期份额持有人份额减少，但持有金额不变。

2、睿丰 1 期 2018 年 7 月 3 日折算前单位净值为 1.0738 元，折算后单位净值为 1.0000 元，第一个运作周期睿丰 1 期的年化收益率为 7.38%。折算将使睿丰 1 期份额持有人份额增加，但持有金额不变。根据《资产管理合同》的约定，管理人于 2018 年 7 月 3 日对睿丰 1 期退出份额年化收益率超过 5%以上的部分收取 20%作为管理人业绩报酬。

特此公告。

上海海通证券资产管理有限公司



2018年7月4日