

润享收益凭证 11 号集合资金信托计划第 3 期 B 类标的收益 凭证增强收益率及开放日的公告

尊敬的委托人暨受益人：

我司作为受托人发起设立了“华润信托·润享收益凭证 11 号集合资金信托计划第 3 期 B 类”（以下简称“本期信托单位”）。本期信托单位成立时根据信托文件约定投资于由海通证券股份有限公司（以下简称“标的收益凭证发行人”）发行的海通证券收益凭证智盈系列中证 500 雪球式（含指数增强）第 150 号（产品代码【SRQ989】，以下简称“标的收益凭证”）。

根据标的收益凭证合同约定，标的收益凭证最后一个敲出观察日（即敲出观察日【22】）为2023年11月6日（逢节假日顺延），若发生下列事件中的任意一种的，视为标的收益凭证产品发生提前终止事件：（1）在任一敲出观察日 i （ $i=1$ 到22），若挂钩标的收益表现水平大于或等于敲出观察日 i 对应的敲出水平，则该敲出观察日发生提前终止事件。（2）若在所有敲出观察日 i （ $i=1$ 到22），挂钩标的收益表现水平均小于敲出观察日 i 对应的敲出水平，且期初观察日（含）至敲出观察日22（含）内的所有交易日，挂钩标的收益表现水平均大于或等于敲入水平，则在敲出观察日22发生提前终止事件。

若标的收益凭证产品在所有敲出观察日 i （ $i=1$ 到22），挂钩标的收益表现水平均小于敲出观察日 i 对应的敲出水平，且期初观察日（含）至敲出观察日22（含）内的所有交易日，挂钩标的收益表现水平曾小于敲入水平，标的收益凭证将变为指数增强收益结构。根据标的收益凭证发行人通知，标的收益凭证增强收益率 $R(1)$ 为 $1\% \times$ 敲出观察日22挂钩标的收盘价 \div 期初价格，此增强收益率为年化概念，增强收益区间1：2023年11月【06】日（含）至2024年11月【06】（不含）。

根据信托文件的约定，本期信托单位第一个开放日为标的收益凭证的最后一个敲出观察日，即【2023】年【11】月【6】日，委托人/受益人可在本次开放日赎回申请截止日（即【2023】年【10】月【30】日（含））前提交赎回申请。本期信托单位第二个及之后的开放日为标的收益凭证的最后一个敲出观察日后每个自然月的15日，如当日为非交易日，则顺延至下一交易日。开放

日只能赎回，不能认购。本期信托单位第二个开放日为 2023 年 12 月 15 日，第三个开放日为 2024 年 1 月 15 日，后续开放日以此类推。

为更好的维护委托人暨受益人利益，本期信托单位受托人管理费由“1.99%/年”调整为“前 24 个月的管理费为 1.99%年；后 24 个月不收管理费”。

因标的收益凭证进入指数增强收益结构,导致本信托计划投资非保本标的收益凭证存在投资风险及投资损失增大的风险，由本期信托单位财产承担，受托人不承担任何责任，委托人和受益人应充分知悉和理解，自愿承担由此产生的所有风险和损失并合理规划自身资金安排。

特此公告。

重要提示：

本信托并不保证盈利，亦不保证投资者本金不受损失，证券投资有风险，投资须谨慎！投资者应仔细阅读信托文件，并与受托人进行充分沟通，审慎做出购买决策。

受托人咨询电话：400-678-8883

华润深国投信托有限公司

2023 年 10 月 23 日