

**上投摩根基金管理有限公司**  
**关于旗下基金所持债券估值调整的公告**

上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下基金所持有的 PR 五国投（交易所代码：122695）于 2015 年 3 月 16 日发生异常交易，在交易所收盘价格严重偏离公允价值。

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（[2008]38 号文），经与托管行协商一致，本公司决定于 2015 年 3 月 16 日起对旗下基金所持有的 PR 五国投采用前一交易日的交易所收盘价除权予以估值。自其交易体现了活跃市场交易特征或以前述计算方式计算的收益率明显偏离可比债券的平均收益率之日起，对其恢复按交易所收盘价进行估值, 届时不再另行公告。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司

2015 年 3 月 18 日