关于东北证券元伯2号债券优选分级集合资产管理计划调整持仓债券估值的公告

证券业协会发布的《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》规定，“在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值”。同时，《东北证券元伯2号债券优选分级集合资产管理计划管理合同》约定，“在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。”

为使东北证券元伯2号债券优选分级集合资产管理计划（以下简称“元伯2号”）估值公平、合理，管理人经与托管人招商银行股份有限公司协商一致，自

2018年12月28日起调整元伯2号持有的15五洋债（122423）、15永泰能源MTN002（101573022）估值价格，即将估值价格由目前采用的交易所和银行间最近收盘价改为中央国债登记结算有限责任公司发布的特殊价格估值。

此后，若发生重大事项，管理人将再合理评估，进一步确定其估值价格。

特此公告。

东证融汇证券资产管理有限公司

2018年12月28日