

关于公司旗下“金元宝”系列产品估值调整情况的公告

为进一步确保产品估值合理性和公允性，根据资产管理合同、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，经本公司与“金元宝”系列产品托管人协商一致，决定自2020年11月16日起，对我公司旗下“金元宝”系列产品的债券估值方法进行调整，其中涉及证券交易所债券品种按照以下方式：

1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2、交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

3、交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。

4、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

5、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

6、只在上交所固定收益平台和深交所综合协议平台挂牌交易的债券按第三方提供的估值数据确定公允价值。在第三方未提供估值价格的情况下，按成本估值；

7、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

以上“第三方”指中证指数有限公司。

特此公告。



太平洋证券股份有限公司
2020年11月16日