

关于“太平洋证券太盈1号集合资产管理计划”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，根据资产管理合同及相关规定，经本公司与产品托管人协商一致，决定自2020年11月18日起，对“太平洋证券太盈1号集合资产管理计划”的“债券估值方法”进行调整：

1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日中证指数有限公司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、公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

7、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照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估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且中央国债登记结算有限责任公司未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

以上“第三方估值机构”指中证指数有限公司或中央国债登记结算有限责任公司。

特此公告。

