

关于东北证券元伯1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

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]40号，以下简称《大集合操作指引》）及相关监管要求，东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）应在2021年底前完成大集合资产管理业务规范工作，分级大集合产品应改造为平层大集合产品，并对标公募基金进行规范。

管理人拟于2021年5月21日将大集合产品东北证券元伯1号债券优选分级集合资产管理计划（以下简称“元伯1号”）改造为平层产品，次级份额持有人退出，并将改造后的平层产品对标公募基金进行规范。鉴于元伯1号持有低流动性资产（15五洋债（122423.SH）），为顺利完成平层化改造进而完成公募化规范工作，并维护大集合产品份额持有人的合法权益，管理人已于2021年5月14日将元伯1号持有的15五洋债的估值调整为0元，本次已经计提减值的资产在元伯1号平层改造合同变更生效后实现的收益归计提减值时的元伯1号原次级份额持有人所有。本次估值调整不会对元伯1号原优先级份额持有人及平层改造后的份额持有人造成不利影响。

特此公告。

东证融汇证券资产管理有限公司

2021年5月17日