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

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。

管理人拟将大集合产品东北证券元伯 2 号债券优选分级集合资产管理计划(以下简称"元伯 2 号")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 2 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 6 月 2 日将元伯 2 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 2 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 2 号原次级份额持有人所有。本次估值调整不会对元伯 2 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6月3日