

## 关于调整华西证券东风3号集合资产管理计划所持有的部分 债券估值方法的公告

鉴于近期地产债券市场成交价格 and 第三方估值大幅下跌，且近期第三方估值存在明显的滞后性，华西证券东风3号集合资产管理计划（下称“东风3号”）当前使用的估值方法已无法充分反映资产公允价值，根据《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及资产管理合同有关规定，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。为使产品估值公平、合理，经与产品托管人协商一致，决定自2021年11月26日起调整东风3号所持有的部分债券估值方法，具体如下：

(1) 对集合产品持有的民营地产债按照“该债券第三方估值（根据具体债券所在交易场所选择中债或中证）与调整基准日该债券发行主体发行的所有债券在竞价交易平台的最低收盘价孰低”的规则进行调整，若调整基准日当日无竞价交易平台的收盘价，则选取最近一日竞价交易平台的收盘价；若该主体发行债券无竞价交易平台的收盘价，则适用第三方估值。

截至2021年11月25日，东风3号持有的地产债为19金辉01、融信03优、21飞驰奥园ABN001优先，合计占当日产品净值的比例为23.01%，均将按上述方法进行估值调整。

(2) 本次调整后，估值价格不再动态调整，直至产品每次开放期前 10 个工作日内，按照上述第 (1) 项规则对产品再次做估值评估调整；鉴于债券部分还本后的第三方估值及收盘价均会因还本而调整，因此，在产品收到本金当日，估值直接按上述第 (1) 项规则调整。

(3) 鉴于东风 3 号下一个开放期为 2021 年 12 月 1 日，距离本次调整日较近，在市场、债券基本面等未发生重大变化下东风 3 号在 2021 年 12 月 1 日的开放期前将不做调整。

以上估值方法调整，将对产品净值产生影响，请投资者关注，并根据产品开放期安排自行决定申赎，在进行决策前，仔细阅读本集合计划合同、风险揭示书和计划说明书等文件，全面认识本集合计划的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力。

请投资者及时关注管理人官方网站 [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn) 或拨打华西证券全国统一客服热线 4008-888-818 获取相关信息。

特此公告。

