

关于公司旗下“太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划” 估值调整情况的公告

尊敬的投资者：

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，我司作为管理人已与“太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划”的托管人协商一致，决定自 2021 年 12 月 20 日起，对我公司旗下“太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划”的固定收益品种估值方法进行调整，具体如下：

1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（含资产支持证券和私募债券），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；交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（含资产支持证券和私募债券），选取估值日中证指数有限公司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。

2、交易所上市交易的可转换债券以估值日收盘价作为估值全价。

3、交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对于存在活跃市场的情况下，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，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。

4、全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司提供的相应品种估值日当日的估值净价估值；银行间市场上含权的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司提供的相应品种估值日当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。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。

5、对银行间市场未上市，且中债金融估值中心有限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。

特此公告。

