

关于茂典资产盛典季开纯债1号私募证券投资基金 持有固定收益品种估值方法调整的说明函

尊敬的投资者：

我司作为管理人的茂典资产盛典季开纯债1号私募证券投资基金（以下简称“盛典1号基金”）持有佳尾3B3（证券代码：136330.SZ），现该资产支持证券已实质性违约。

故我司与托管人兴业证券股份有限公司达成一致，自2022年8月10日起，对佳尾3B3的估值方法做如下调整：

（1）每估值日的债券估值价格取当日中债特殊证券行情，如当日发生无法获取中债特殊证券行情时，取最近一次可获取的中债特殊证券行情进行估值；

（2）持有期间计提利息全部冲销（买入债券时的应收利息归入债券成本）并暂停计息；

（3）当期缴税期间的期初至实际账务调整日，因该债券计提利息所产生的增值税及附加税全部冲销，历史期间已计提并计入增值税及附加税的应缴未缴部分不做变更；

（4）如债券到期兑付或债券回售未到账，则不进行债券兑付转出或回售转出处理。

按照上述估值方式，盛典1号基金的净值将出现一定波动。但管理人再次强调：盛典1号基金已进入清算程序，在清算阶段，基金份额持有人收到的分配金额将直接以持仓资产的处置情况为准。因此，本次估值方法的调整并不必然会影响基金份额持有人的分配金额。

后续，我司也将持续跟进佳尾3B3及其原始权益人佳兆业集团（深圳）有限公司的情况。

特此说明。

上海茂典资产管理有限公司

