

## 关于浦信恒寿资产管理 1 号基金调整的说明

各位基金份额持有人：

浦信恒寿资产管理 1 号基金（以下简称“该基金”）由上海恒基浦业资产管理有限公司（以下简称“我公司”）管理，坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资理财服务，我公司拟根据《浦信恒寿资产管理 1 号基金基金合同》的约定对该基金的条款进行调整。具体如下：

### 一、关于债券估值方法的调整

根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《基金合同》以及《行政管理服务协议》的约定，我司与基金托管方协商一致，决定对该基金持有的债券投资进行估值调整，自【2022】年【9】月【1】日起债券投资的估值方法修改如下：

#### 1、证券交易所上市债券的估值方法（如适用）

（1）交易所上市实行净价交易的债券选取估值基准日第三方估值机构（如中证指数）提供的相应品种对应的估值净价估值。

（2）交易所上市交易的可转换债券按估值基准日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值基准日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取估值基准日第三方估值机构（如中证指数）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

（4）证券交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，选取估值基准日第三方估值机构（如中证指数）提供的估值净价估值；中证指数有限公司未提供估值净价的，经管理人同意可采用估值技术确定公允价值。

#### 2、处于未上市期间的债券的估值方法（如适用）

首次公开发行未上市的债券，使用相关估值技术确定公允价值。

#### 3、银行间债券市场的估值方法（如适用）

全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构（如中债指数）提供的估值价格和估值技术。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。



#### 4、债券回购（如适用）

债券回购等计息资产及负债按照约定利率在持有期内逐日计提利息，分别在利息到账日、利息支出日以实际利息入账。

#### 二、生效安排

我司将于【2022】年【8】月【29】日设置临时开放日，如基金份额持有人不同意本次调整，则应于该日提交赎回申请。如基金份额持有人未于【2022】年【8】月【29】日赎回的，视为基金份额持有人【同意】本次调整。

特此说明

上海恒基浦业资产管理有限公司

2022年8月15日

