

关于调整中信证券积极策略 5 号集合资产管理计划停牌股票估值方法的公告

来源：中信证券资管 时间：2024-05-16 17:20:53

依据中信证券积极策略 5 号集合资产管理计划资产管理合同估值条款的约定：如有确凿证据表明现有估值方法不能客观反映组合公允价值的，管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映资产管理计划公允价值的方法估值。

为更好地反映集合资产管理计划的净值，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务指导意见》（中国证券监督管理委员会公告【2017】13号）第二条第三项，参照《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》等相关规定，经与托管人协商一致，中信证券积极策略 5 号集合资产管理计划停牌股票估值方法拟调整为：

所持有的股票若发生停牌，且其潜在估值调整对前一估值日该计划资产净值影响在 0.25%以上的，于停牌之日起，采用“指数收益法”对相关停牌股票进行估值，其中指数为停牌股票所在的中国证券投资基金业协会的行业指数（AMAC）。自相应股票复牌之日且其交易体现了活跃市场交易特征后，将采用最近交易日的报价确定相应股票的公允价值。

估值方法调整将于 2024 年 5 月 21 日起执行，特此公告。

中信证券资产管理有限公司

2024 年 5 月 16 日