

关于兴业期货有限公司管理的资产管理计划集合资产管理计划 持有固定收益品种估值方法的说明函

致全体委托人、托管人、外包机构：

中国证券投资基金业协会已于 2022 年底发布《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称《标准》），为了更好地满足《标准》对于固定收益品种估值的要求，现对合同条款中关于固定收益品种估值做以下修改，请托管人及外包机构予以执行，并特此知悉全体委托人。

固定收益品种（可转债除外）以第三方估值机构提供的估值净价进行估值，上述第三方估值机构，证券交易所固定收益品种默认采用中证指数有限公司（简称“中证”）提供的估值净价进行估值，银行间固定收益品种默认采用中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的估值净价进行估值。

上述函件内容自【2023】年【5】月【10】日生效。

特此公告

兴业期货有限公司

2023 年 5 月 10 日

注：上述固定收益品种是指在证券交易所上市交易或指在全国银行间债券市场交易的投资品种，包括但不限于债券、资产支持证券等，**但可转债除外。**