

国泰基金管理有限公司调整估值方法及影响的公告

国泰基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下部分基金所持有的 11 海螺 01 (代码: 122068) 2015 年 2 月 13 日收盘价格严重偏离公允价值。为使持有该债券的基金估值更加公平、合理, 根据《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会[2008]38 号公告) 及本公司的估值政策和程序, 经和托管人协商, 本公司决定自 2015 年 2 月 13 日起对旗下基金持有的 11 海螺 01 按照该债券当日在交易所市场剔除尾盘异动因素后的价格调整估值。

自上述证券当日收盘价已能反映其公允价值之日起对其恢复按交易所收盘价进行估值, 届时不再另行公告。

特此公告。

国泰基金管理有限公司

2015 年 2 月 17 日