中证估值信用事件及估值调整

2020 年 7 月 7 日

2020 年 7 月 6 日晚，泰禾集团股份有限公司（发行人）发布公告称：“17 泰禾 MTN001（101774002.IB）”应于 2020 年 7 月 6 日兑付本息，截至 2020 年 7 月 6 日日终，发行人未按期足额兑付“17 泰禾 MTN001（101774002.IB）”本息，构成实质性违约。根据我司违约债券估值相关流程规范，我们根据发行人财务报告和公告信息计算相关债券的估值全价。“17 泰禾 MTN001（101774002.IB）”的估值全价于今日通过中证指数数据服务平台（中证 FTP）特殊品种文件发布，其余相关债券估值全价将于 2020 年 7 月 8 日通过中证指数数据服务平台（中证 FTP）特殊品种估值发布。我司会密切关注发行人偿债能力变化和相关事件动态。

慕盛(北京)公寓管理有限公司作为发行人的控股子公司，发行的“中信证券-泰禾集团慕盛长租公寓 1 号资产支持专项计划”信用风险加大，今日调整相关债券估值。