

关于增加“象與行思源3期私募证券投资基金”投资比例限制 并临时开放的公告

尊敬的委托人：

“象與行思源3期私募证券投资基金”（以下简称“本基金”）由我司担当管理人。根据基金业协会《私募证券投资基金运作指引》要求，我公司与托管人协商一致后决定自2024年8月1日起，在原合同条款：

“投资限制”章节增加：

（1）参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的50%；

（2）参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的25%；

（3）新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于1000万元。

“越权交易”章节增加：

投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金托管人的越权交易监督依赖于交易对手方提供的交易信息和行情信息，包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息；由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产，前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；基金管理人应按照监管及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的，基金托管人不承担任何责任。

“基金财产的估值和会计核算”中关于场外衍生品交易估值的修改为：

若本基金参与场外衍生品交易的，基金管理人应当确保交易对手方在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人。基金管理人签订场外衍生品交易文件时，应当明确授权由交易对手方在本基金下一估值日



前直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。基金管理人应确保在本基金每个开放日对应的估值日内，交易对手方向基金托管人提供最新的估值报告。基金管理人应确保上述估值数据的真实、完整和有效，如内容不完整、不准确、不及时或不真实，由此造成的损失由基金管理人承担相应责任。

同时，为维护委托人利益，并根据基金合同约定，我公司决定于 2024 年 7 月 19 日设置本基金临时开放，接受委托人的赎回申请。

我司作为管理人将按照基金业协会的要求进行相关变更备案。

特此公告。

管理人：浙江象行投资管理有限公司

2024 年 7 月 15 日

