

关于《云汉宏观择时平衡3号私募证券投资基金合同》启用虚拟单位净值进行估值的函

致国泰君安证券股份有限公司：

【上海云汉资产管理有限公司】（以下简称“我公司”）在国泰君安证券股份有限公司估值的【备案代码：SZM531产品名称：云汉宏观择时平衡3号私募证券投资基金】（以下简称“本基金”）自成立起规范运作，稳健运营，该产品投资了场外投资品种，且该等场外投资品种的合同约定了业绩报酬的计提条款，其净值中包含了应当计提的业绩报酬，高于其真实价值。因此，根据该等场外投资品种之份额净值估算的本基金净值已经偏离其公允价值，为公平对待投资者，根据基金合同之约定，我司将对场外投资品种的相关估值方法进行变更，对于需使用虚拟单位净值进行估值的场外投资标的，由使用该等场外投资品种的份额净值进行估值变更为使用虚拟单位净值进行估值，具体需使用虚拟单位净值估值的场外投资标的及对应的生效日以双方认约定的为准。

在与贵司达成一致意见后，我司将按照基金合同的约定履行相应程序，并以公告形式向基金份额持有人披露本函内容。本基金将自2023年06月27日起启用虚拟净值进行估值核算，启用日期前的本基金估值不追溯调整，我司承诺在启用日期前将本函内容向投资者进行充分披露，并安排不同意本函内容的投资者，通过设置临时开放日的形式进行赎回。因未披露或延迟披露引发的任何争议，与贵司无关，我司将承担全部责任。

以上事宜，请贵司确认。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。

管理人（盖章）：上海云汉资产管理有限公司



2023年06月27日