

**平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计
划
投资说明书**

资产管理人：深圳平安大华汇通财富管理有限公司

资产托管人：平安银行股份有限公司

二〇一四年 月

目 录

第一节 前言.....	1
第二节 释义.....	1
第三节 资产管理计划概况.....	1
第四节 资产管理合同的主要内容.....	33
第五节 资产管理人与资产托管人的概况.....	40
第六节 投资风险揭示.....	41
第七节 初始销售期间.....	41
第八节 本资产管理计划销售机构.....	46
备查文件.....	47

第一节 前言

平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划投资说明书（以下简称“本投资说明书”）依据《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（证监会令第 83 号，以下简称“《试点办法》”）、《基金管理公司特定多个客户资产管理合同内容与格式准则(2012 年修订)》（以下简称“《准则》”）及其他有关规定编写。

本投资说明书阐述了平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与资产委托人投资决策有关的全部必要事项，资产委托人在作出投资决策前应仔细阅读本投资说明书。

本资产管理人承诺本投资说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划根据本投资说明书所载明资料申请募集。本投资说明书由深圳平安大华汇通财富管理有限公司解释。本资产管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本投资说明书中载明的信息，或对本投资说明书作出任何解释或者说明。

第二节 释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1. 本合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更。
2. 资产委托人/委托人/投资者：指签订本合同，交付委托资金给资产管理人，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。
3. 资产管理人：指深圳平安大华汇通财富管理有限公司。
4. 资产托管人：指平安银行股份有限公司。
5. 投资顾问：指平安磐海资本有限责任公司。全体委托人知悉并一致同意，本资产管

理计划聘请平安磐海资本有限责任公司提供投资顾问服务及投资的相关管理服务。

6. 注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的机构。

7. 资产管理计划/资管计划/计划：指按照本合同的约定设立，为资产委托人的利益，将特定多个资产委托人交付的资金进行集中管理、运用或处分，进行特定证券投资活动的集合资产管理安排。

8. 投资说明书：指“平安汇通磐海创富量化对冲5号特定客户资产管理计划资产管理合同投资说明书”，内容包括资产管理计划概况、资产管理合同的主要内容、资产管理人与资产托管人概况、投资风险揭示、初始销售期间、中国证监会规定的其他事项等。

9. 工作日：资产管理人和资产托管人均办理相关业务的营业日。

10. 交易日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

11. 开放日：指非计划初始销售期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日。本资产管理计划成立后，后每自然季度有一个开放日，开放日为资管计划自成立年后每自然季度次月的第5个工作日，如遇特殊情况需变更开放日，则具体日期见平安大华基金管理有限公司网站公告。

12. 募集账户：指销售机构用于募集资产委托人交付的认购资金或参与资金的募集帐户。

13. 资金账户/托管账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门用于资金收付、清算交收的银行账户。

14. 委托财产：指资产委托人拥有合法处分权、用于购买本资产管理计划份额的认购资金。

15. 资产管理计划财产/计划财产：指本资管计划项下委托人交付的全部委托财产以及资产管理人因委托财产的运用、管理、处分或其他情形取得的财产(含债务或其他权利负担)的总和。

16. 初始销售期间：指资产管理合同及投资说明书中载明，并经中国证监会核准的计划初始销售期限，自计划份额发售之日起最长不超过1个月。

17. 存续期：指本合同生效至终止之间的期限。

18. 销售机构：指资产管理人的母公司平安大华基金管理有限公司或代理销售机构。

19. 认购：指在资产管理计划初始销售期间，资产委托人按照本合同的规定购买本资产管理计划份额的行为。

20. 参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定购买本资产管理计划份额的行为。

21. 退出：指本合同生效后，资产委托人按本合同约定的条件要求将资产管理计划份额兑换为现金的行为。

22. 参与受理期：指开放日前的第【3】个工作日（含当日）至开放日前的第【1】个工作日（含当日）的期间。在参与受理期内，资产管理人接收投资者参与本计划的申请。

23. 退出受理期：指开放日前的第【5】个工作日（含当日）至开放日前的第【4】个工作日（含当日）的期间。在退出受理期内，资产管理人接收投资者退出本计划的申请。

24. 认购资金：投资者欲认购本资产管理计划份额，将准备认购本资产管理计划份额的资金划款至本计划募集账户的资金（不包括实现此次认购行为所需的认购费用）。

25. 认购金额：投资者认购本资产管理计划的资金（包括实现此次认购行为所需的认购费用）。

26. 计划财产总值：指资产管理计划所拥有的各类证券类金融产品及票据、银行存款本息以及其他资产的价值总和。

27. 计划财产净值：指估值日计划财产总值扣除计划财产需承担的费用和负债后的净资产值。

28. 计划份额净值：指估值日计划财产净值除以估值日资产管理计划份额总数所得的数值。

29. 计划份额累计净值：指计划份额净值与计划份额累计分红之和；

30. 计划财产估值：指计算、评估计划财产和负债的价值，以确定计划财产净值和计划份额净值的过程。

31. 估值日：指资产管理人计算该日计划份额净值的日期，本资产管理计划计划份额净值的估值日为每个工作日，估值对账日为每周第一个工作日（如遇节假日，则以节假日后第一个工作日为估值对账日）、违约退出受理日、开放日、收益分配基准日等。

32. 估值对账日：指资产管理人与资产托管人核对计划份额净值的日期。

33. 收益分配基准日：每次分红的可供分配收益是以收益分配基准日为准的，收益分配基准日以资产管理人母公司网站公告为准。

34. 业绩报酬计提日：指投资顾问计提业绩报酬之日，业绩报酬计提日为资产管理计划收益分配基准日、委托人持有的计划份额退出之日和计划终止日。

35. 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。

36. 证券账户：指根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司、债券登记结算机构的有关业务规则，由资产管理人和资产托管人根据实际情况，为资产管理计划在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户，以及在债券登记结算机构开立的专用债券账户。

37. 期货账户：由资产管理人和资产托管人根据实际情况，为资产管理计划在中国金融期货交易所开设的专用账户及其他有关账户。

38. 资产管理人母公司网站：指平安大华基金管理有限公司：<http://fund.pingan.com>。

第三节 资产管理计划概况

一、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划。

（二）资产管理计划的类别

一对多非保本浮动收益型特定客户资产管理计划。

（三）资产管理计划的运作方式

定期开放式。在本合同存续期内，逢开放日打开计划的参与和退出。

（四）资产管理计划的投资目标

全体委托人知悉并一致同意，管理人参考投资顾问的建议进行投资，在加强风险管理的前提下实现计划资产增值。

（五）资产管理计划的存续期限

本资产管理计划的预定期限为 5 年，自本资产管理计划成立日起，发生本合同约定的提前终止或延期情形的，存续期相应调整。

（六）资产管理计划的开放期设置

本资产管理计划成立后，每自然季度有一个开放日，开放日为资管计划自成立年后每自然季度次月的第 5 个工作日，如遇特殊情况需变更开放日，则具体日期见平安大华基金管理

有限公司网站公告。

（七）资产管理计划的最低资产要求

单个资产委托人的初始委托财产不得低于100万元人民币（不含认购费），各资产委托人初始委托财产合计不得低于3000万元人民币，但不得超过50亿元人民币，中国证监会另有规定的除外。

（八）资产管理计划份额的初始销售面值

人民币1.00元。

（九）其他

资产管理计划设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份同类型计划份额具有同等的合法权益。

二、资产管理计划份额的初始销售

（一）资产管理计划份额的初始销售期间、销售方式、销售对象

1、初始销售期间

本计划初始销售期间自计划份额发售之日起不超过1个月，初始销售的具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在本计划《投资说明书》中披露。如果在此期间提前满足《试点办法》第十一条规定的条件的，资产管理人可与销售机构协商决定提前终止初始销售。

资产管理人与销售机构协商决定提前终止初始销售，并在资产管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止初始销售的程序。资产管理人发布公告提前结束初始销售的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

2、销售方式

本计划通过资产管理人母公司平安大华基金管理有限公司直销网点和平安证券有限责任公司进行销售。具体名单以本投资说明书为准。

资产委托人认购本计划，必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

3、销售对象

委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人和依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

本资产管理计划的委托人不少于 2 人且不得超过 200 人若法律法规将来另有规定的，从其规定。

（二）资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金及认购费用应以银行转账方式交付。投资者在初始销售期间的认购金额不得低于 100 万元人民币（不含认购费用），并可多次认购，不设单个账户最高认购金额上限。原则上本资产管理计划初始募集金额不得超过 50 亿元人民币。证监会另有规定的除外。

（三）资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划的认购费率为 0.5%。

（四）资产管理计划份额的计算

1、本资产管理计划采用金额认购的方式。认购份额的计算方式如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

初始认购份额=净认购金额/基金份额初始净值

2、认购金额的有效份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分舍去，由此误差产生的收益或者损失由资产管理计划财产承担。

（五）初始销售期间的认购程序

1、认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

2、认购申请确认。本资产管理计划资产委托人签署本合同，且认购资金及实现本次认购的认购费用自投资者自有账户全额划入销售机构收款账户，销售机构办理认购申请事宜。认购申请受理完成后，资产委托人不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否

成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。在计划募集期结束时，注册登记机构按照“金额优先、时间优先”的原则将初始销售期间累计的全部认购申请进行确认。“金额优先、时间优先”是指按照该资产管理计划的全部认购申请汇总计算，认购总金额高的优先确认；认购总金额相同的投资者中，足额缴纳认购资金及实现该次认购所需要的认购费用在前的投资者优先确认。

（六）初始销售期间客户资金的管理

资产管理计划份额初始销售期间，资产管理人应当将初始销售期间客户的资金存入专门账户。在资产管理计划初始销售行为结束之前，任何机构和个人不得动用。

本计划通过平安大华基金管理有限公司直销网点购买的份额，募集账户的信息如下：

户名：平安大华基金管理有限公司直销清算账户

账号：0122500000624

开户行：平安银行深圳分行桂园支行

本计划通过平安证券有限责任公司代销的份额，募集账户信息以平安证券有限责任公司公布募集账户为准。

（七）资产管理计划初始销售资金利息的处理方式

在初始销售期间资产委托人的认购参与款项（不含认购费）到达本计划募集账户后产生的利息，在本计划成立后 5 个工作日内支付给各销售机构，由销售机构支付给资产委托人；或在该时限内直接支付给资产委托人（没有销售机构的情况下）。具体金额以注册登记机构记录的结果为准。

三、资产管理计划的备案

（一）资产管理计划备案的条件

本资产管理计划初始销售期限届满，符合下列条件的，资产管理人应当按照规定办理验资和资产管理计划备案手续：

资产管理计划的委托人不得超过 200 人，委托人委托的初始资产合计不得低于 3000 万元人民币，但不得超过 50 亿元人民币；中国证监会另有规定的除外。

（二）资产管理计划的备案

初始销售期限届满，资产管理人应当自初始销售期限届满之日起10日内聘请验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。客户资料表应包括资产委托人名称、资产委托人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与资产管理计划的金额和其他信息。

自中国证监会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购参与款项（不含认购费用）在资产管理合同生效后折算成相应的资产管理计划份额归资产委托人所有，初始销售期形成的利息在资产管理合同生效后5个工作日内返还给资产委托人，其中利息的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（三）资产管理计划销售失败的处理方式

资产管理计划销售期限届满，不能满足上述条件的，资产管理人应当：

1、以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。

2、在资产管理计划销售期限届满后30日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

四、资产管理计划的参与、退出和非交易过户

（一）参与和退出条款

1. 资产管理计划的参与

本资产管理计划运作期间定期（逢开放日）开放计划份额的参与。资产委托人只能在资产管理计划的初始销售期间或参与受理期认购资产管理计划份额。

2. 参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销网点及代理销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

3. 参与和退出的开放日和时间

开放日：指非计划初始销售期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日。本资产管理计划成立后，后每自然季度有一个开放日，开放日为资管计划自成立年后每自然季度

次月的第 5 个工作日，如遇特殊情况需变更开放日，则具体日期见平安大华基金管理有限公司网站公告。

参与受理期：指开放日前的第【3】个工作日（含当日）至开放日前的第【2】个工作日（含当日）的期间。在参与受理期内，资产管理人接收投资者参与本计划的申请。

退出受理期：指开放日前的第【5】个工作日（含当日）至开放日前的第【4】个工作日（含当日）的期间。在退出受理期内，资产管理人接收投资者退出本计划的申请。

存续期间，经资产管理人和代销机构共同同意，资产管理人有权调整开放日。资产管理人提前 30 个工作日在资产管理人母公司网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

4. 参与程序

投资者参与申请应提交的文件和办理的手续等事项，在遵守本合同和投资说明书的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

资产管理人与销售机构在参与受理期接收投资者参与本计划的申请。客户将签署的资产管理合同以及妥善填写的相关参与申请材料全部送至销售机构，并将参与申请资金及相应参与费用自其自有银行账户划款到其在销售机构开立的募集账户后，方视为销售机构已受理投资者的参与申请。销售机构受理参与申请并不表示投资者参与成功，而仅代表销售机构确实收到了参与申请。参与申请是否有效以登记结算机构的确认为准，经登记结算机构确认后不可撤销。未经确认的参与申请资金不划入资产管理计划托管账户。登记结算机构在开放日第二个工作日对销售机构提交的参与申请进行确认。

5. 资产管理计划的退出

本计划在资产管理计划运作期间定期开放计划份额的退出。资产委托人只能在退出受理期申请退出、或本合同终止后退出，退出费按本条第（八）款约定。本资产管理计划不接受违约退出。所谓违约退出，是指资产委托人在本资产管理计划非退出受理期内提出的部分或全部退出本计划的申请行为

在退出受理期内，客户将签署的资产管理合同以及妥善填写的相关退出申请材料全部送至销售机构，销售机构受理资产委托人的退出申请后，并将资产委托人的退出申请以销售机构和登记结算机构协商一致的方式发送至登记结算机构。销售机构受理退出申请并不表示投

投资者退出成功，而仅代表销售机构确实收到了退出申请。退出是否有效以登记结算机构的确认为准。登记结算机构在开放日第二个工作日对销售机构提交的退出申请进行确认。

在开放日之后5个工作日内，经登记结算机构确认后成功退出的退出资金划付至委托人账户内。

6. 参与、退出价格

(1) “未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以开放日当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

(2) “金额优先、时间优先”原则，即为了保证资产委托人人数不超过200人，在开放日按照该资产管理计划的全部参与申请汇总计算，参与总金额高的优先确认；参与总金额相同的投资者中，足额缴纳参与资金及实现该次参与所需要的参与费用在前的投资者优先确认。

(3) 资产管理计划金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

(4) 资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

(5) 当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

(6) 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取金额优先、时间优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。特定客户应在一个开放周期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

(7) 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的委托款项将退回资产委托人指定资金账户。资产委托人退出申请成交后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项自确认之日起5个工作日内划往资产委托人银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

(8) 资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的

原则实施前10个工作日告知资产委托人。资产管理人提前10个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

7. 参与和退出的费用

(1) 本资产管理计划参与费率为【0.5】%；

(2) 委托人退出本计划的，收取退出费用，委托人申请退出某份持有时间不满90天的计划份额的，该份额适用的退出费率为1.5%；委托人申请退出某份持有时间满90天不满180天的计划份额的，该份额适用的退出费率为1%；委托人申请退出某份持有时间满180天不足360天的计划份额的，该份额适用的退出费率为0.5%；委托人申请退出某份持有时间满360天的计划份额的，该份额适用的退出费率为0；委托人在本计划终止后退出计划的，不收取退出费用。

(3) 资产管理人可以在法律法规和本合同规定范围内调整参与费率、退出费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，资产管理人应在调整实施前10个工作日告知资产委托人。资产管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

(4) 参与份额与退出金额的计算

a. 本计划参与份额的计算：

本资产管理计划的参与金额包括参与费用和净参与金额，其中：

净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

参与费用=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额/参与时对应开放日所适用估值日的资产管理计划份额净值

b. 本计划退出金额的计算：

采用“份额退出”方式，退出价格以退出申请时对应开放日所适用的估值日的资产管理计划份额净值为基准进行计算，计算公式：

退出费用=委托人申请于该次退出的计划份额总数×退出申请时对应开放日所适用估值日的资产管理计划份额净值×申请退出的份额所适用的退出费率

退出总金额=委托人申请于该次退出的计划份额总数×退出申请时对应开放日所适用估

值日的资产管理计划份额净值

净退出金额=退出总金额-退出费用

某委托人申请退出其所持本计划份额中的部分份额的，就该委托人而言，其认购/参与在前的份额，应先于其认购/参与在后的份额退出。

退出费用归本计划所有，归入本计划的财产。

(5) 参与份额、余额的处理方式：

参与的有效份额为按实际确认的参与金额在扣除相应的费用后，以当日资产管理计划份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

(6) 净退出金额的处理方式：

净退出金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

8. 参与和退出的金额限制

(1) 参与金额不得低于 100 万元人民币（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者除外，具体约定详见投资说明书。

(2) 当投资者持有的计划资产净值高于 100 万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划；选择部分退出资产管理计划的，投资者在退出后持有的计划资产净值不得低于 100 万元人民币（按委托人申请退出的开放日的上一个月底估值日的资产管理计划份额净值计算）。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元人民币的（按委托人申请退出的开放日的上一个月底估值日的资产管理计划份额净值计算），资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币（按委托人申请退出的开放日的上一个月底估值日的资产管理计划份额净值计算）。“某个委托人持有的计划资产净值”即为该委托人持有的计划份额乘以委托人申请退出的开放日的上一个月底估值日计划份额净值，下同。

(3) 当委托人持有的计划资产净值低于 100 万元（含）时（按委托人申请退出的开放

日的上一个月底估值日的资产管理计划份额净值计算), 需要退出计划的, 委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划。

9. 巨额退出的认定及处理方式

(1) 巨额退出的认定

在某一开放日, 资产管理计划的净份额退出申请超过资产管理计划总份额的 20% 为巨额退出。某一开放日净份额退出申请=该开放日退出申请的份额-该开放日经确认有效的参与申请的份额。

(2) 巨额退出的处理方式

出现巨额退出时, 资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

a. 接受全额退出: 当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时, 按正常退出程序执行。

b. 部分退出: 当资产管理人认为全额兑付资产委托人的退出申请有困难, 或认为兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划财产净值发生较大波动时, 资产管理人在接受退出比例不低于资产管理计划总份额 10% 的前提下, 办理部分退出, 并按单个资产委托人申请退出份额占该次退出申请总份额的比例, 确定该资产委托人的退出份额; 未受理部分予以撤销, 以后开放日委托人需要继续退出的, 应当另外提出退出申请, 本次已撤销的退出申请在以后开放日不优先办理。部分退出导致资产委托人持有的计划资产净值低于 100 万元 (含) 的, 资产管理人可按全额退出处理。

c. 当发生巨额退出并只接受部分退出时, 资产管理人应当通过邮寄、传真等本合同或投资说明书规定的其他方式, 在开放日后的 3 个工作日内及时告知资产委托人, 说明有关处理方法。

(二) 非交易过户的认定及处理方式

1、资产管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”是指资产委托人死亡, 其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形。

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

五、资产管理计划份额的登记

(一)本资产管理计划份额的登记结算业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二)本资产管理计划的登记结算业务由资产管理人母公司平安大华基金管理有限公司办理。

(三)注册登记机构履行如下职责：

1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将账户资料、交易资料、客户资料表提供给资产管理人。

2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的登记结算业务。

3、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本资产管理计划的登记结算业务，并接受资产管理人的监督。

4、严格按照法律法规和本合同规定计算业绩报酬，并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。

5、保管资产管理计划客户资料表及非交易过户等业务记录15年以上。

6、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外。

7、按照资产管理合同，为资产委托人提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

- 8、在法律法规允许的范围内，制定和调整登记结算业务的相关规则。
- 9、法律法规规定的其他职责。

(四) 注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

六、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

全体委托人知悉并一致同意，管理人参考投资顾问的建议进行投资，在加强风险管理的前提下实现计划资产增值。

(二) 投资范围

- 1、公开发行上市股票、首次公开发行股票的网上申购、股票型基金、混合型基金等权益类证券（除上下文特别说明外，本合同中所称“基金”均指公开募集的证券投资基金）；
- 2、债券型基金、逆回购等固定收益类金融产品；
- 3、股指期货等金融衍生产品；
- 4、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金（包括管理人母公司平安大华基金管理有限公司管理的货币基金）等金融产品。

(三) 投资策略

本计划根据投资顾问的投资指令进行投资，具体的投资策略如下：

1、股指期货期现套利策略

股指期货期现套利策略的核心思想是利用到期日沪深 300 现货和期货价格趋同的特性套取两市场之间的差价，获取股指期货与现货之间基差回归产生的收益。期现套利策略的现货可以是沪深 300ETF、也可以是由沪深 300 指数成份股构成的股票组合。当沪深 300 股指期货出现对股指现货较大升水时，通过同时分别投资于沪深 300 股指现货和沪深 300 股指期货，套取两市场之间的差价。

2、ETF 套利策略

ETF 套利策略包括沪深 300ETF 为现货的期现套利和 ETF 二级市场的申赎套利。其中，

ETF 期现套利原理与以股票组合为现货的期现套利原理一致；申赎套利的核心思想是由于 ETF 在二级市场交易，受供需关系的影响，会造成 ETF 在二级市场的交易价格与其在一级市场的净值之间产生偏差，利用 ETF 交易中特有的实物申赎机制套取一二级市场的价差。

3、统计套利策略

统计套利策略的核心思想是对股票间相对价值的分析和预测，通过寻找中短期内相对大盘会走强的股票，然后买入这些股票并且通过卖空股指期货对冲市场风险获利。

（四）资产管理计划的预警线和止损线

为保护全体委托人的利益，本计划设置预警线和止损线。

1、本计划预警线为份额净值 0.95 元；

T 日收盘时，经管理人估算的计划资产份额净值不高于预警线的，管理人应及时以电话或传真的方式向投资顾问提示风险，投资顾问应于 T+1 日下午 13:00 前追加增强资金使得本资产管理计划份额净值不低于 0.95 元或者对本资产管理计划的股票、股指期货等非现金资产发出相应的平仓/赎回建议，使得本资产管理计划持有的股票与股指期货所占用的保证金合计不超过经管理人估算的资产净值的 50%。若投资顾问在 T+1 日下午 13:00 之前未追加增强资金或者追加增强资金之后未能使得本资产管理计划份额净值大于等于 0.95 元，同时投资顾问也未向管理人发出平仓/赎回投资建议，则无论之后份额净值是否可能恢复到预警线之上，资产管理人都无须征求投资顾问建议，自 T+1 日下午 13:00 起，管理人有权对本计划所持有的股票、股指期货等非现金类资产进行平仓/赎回操作，直至本资产管理计划持有的股票与股指期货所占用的保证金合计不超过经管理人估算的资产净值的 50%，若在此期间份额净值触及止损线，则按照本说明书关于止损线的约定进行处理。

当资产计划单位净值连续 5 个工作日超过 1 元时，投资顾问之前已追加资金可申请返还。但扣除返还部分的追加资金后，资产管理计划单位净值不得低于 1 元。

2、本计划止损线为份额净值 0.9 元。

T 日收盘时，经管理人估算的资管计划份额净值触及或低于 0.90 元时，则无论之后份额净值是否可能恢复到 0.90 元之上，则资产管理人无须征求投资顾问建议，即可对计划所持有的所有股票、股指期货等非现金资产进行平仓操作，如果因为停牌、涨跌停的限制不能

进行平仓操作的，则顺应延期平仓。直至计划资产全部变为现金资产，该资产管理计划自行终止。发生上述提前终止情形的，资产管理人应于资产管理合同终止之日通知资产托管人和资产委托人，并按照本资产管理合同的约定进行清算。

（五）风险收益特征

本资产管理计划属于承担中等风险、收益浮动的品种。

（六）投资顾问服务

全体委托人知悉并一致同意，本资产管理计划聘请平安磐海资本有限责任公司作为本计划的投资顾问，由其在资产管理人授权的范围内根据本计划的投资范围、策略及限制为本计划提供投资顾问服务。投资顾问向资产管理人发送投资建议书或投资策略建议，应保证投资建议符合证券监管体系相关法律法规。不得违反法律法规、本合同约定等。若因投资顾问违反法律法规、合同等相关规定并造成重大损失的，资产管理人有权决定解聘投资顾问，在此情形下，资产管理人有权决定终止该资产管理计划。资产管理人不承担因合理执行该等投资建议而引起的任何损失或风险。投资顾问负责根据本资产管理计划的开放期流动性安排以及资产管理计划终止时的资产变现安排提供资产变现的投资建议，全体委托人知悉并一致同意，管理人不承担任何由于投资顾问未做好流动性管理或者未及时变现资产而给委托人带来的风险与损失。具体事宜以管理人和投资顾问另行签署的《投资顾问协议》为准。

委托人签署本合同即表明其已认可和同意管理人聘请平安磐海资本有限责任公司作为本资产管理计划的投资顾问，并同意授权投资顾问按约定的方式为管理人管理运用计划财产提供投资顾问服务。委托人认可该投资顾问提供的投资建议，并承诺接受因资产管理人采纳该投资建议所带来的任何收益或损失。

七、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不相互兼任。

2、资产管理计划投资经理

本资产管理计划投资经理为王名伦先生。

投资经理简历：

王名伦先生，毕业于武汉大学，先后任职于中国移动、信达澳银基金。2012年6月加入平安大华基金，现任深圳平安大华汇通财富管理有限公司综合金融二部投资经理。

王名伦先生无兼任基金管理人母公司所管理的证券投资基金基金经理职务。

（二）投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后5个工作日内告知资产委托人及资产托管人。

八、特定客户资产管理计划的财产

（一）特定客户资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并由资产托管人保管。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

2、资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

3、资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费，以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

4、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵消。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、资产托管人可以资产管理计划的名义在其营业机构开立资产管理计划的资金账户，账户名称以实际开立账户为准，并根据资产管理人合法合规的指令办理资金收付。

资产管理人授权资产托管人办理本资产管理计划资金账户的开立、销户、变更工作，本资产管理计划资金账户无需预留印鉴，具体按资产托管人要求办理。

2、资产管理计划资金账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借本资产管理计划的名义开立任何其他资金账户；亦不得使用资产管理计划的任何账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

3、资产管理计划资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规规定的条件下，资产托管人可以通过资产托管人专用账户办理资产管理计划资产的支付。

5、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和资产管理合同的规定，由资产托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

6、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

十、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）资产管理计划财产的估值

1、估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

2、估值时间

本资产管理计划计划份额净值的估值日为每个工作日。估值对账日为每周第一个工作日（如遇节假日，则以节假日后第一个工作日为估值日对账日）、违约退出受理日、开放日、收益分配基准日等。

3、估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。

资产管理计划所拥有的股票、债券、基金、计划和银行存款本息等资产及负债。

4、估值方法

(1) 银行存款每日计提应收利息，按本金加应收利息计入资产。

(2) 证券交易所交易的有价证券估值

1) 上市流通的有价证券（包括封闭债券基金、分级基金的优先级等）以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日收盘价计算；

2) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

A. 实行净价交易的债券按估值日收盘价净价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价净价估值；

B. 实行全价交易的债券，按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息（自债券计息起始日或上一一起息日至估值当日的利息）净价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的债券收盘价减去该交易日债券收盘价中所含债券应收利息所得到的净价估值；

(3) 债券利息收入、买入返售证券收入等固定收益的确认以权责发生制计入委托财产；

(4) 银行间市场交易金融工具（包括债券等）按照监管机构或行业协会有关规定发布的公允价值信息加应收利息进行估值。债券应收利息（自债券计息起始日或上一一起息日至估值当日的利息）每日计提。交易手续费逐笔从委托财产中扣收，作为应付累计，按季度支付；

(5) 同一债券、开放式基金同时在两个或两个以上市场交易的，按债券、开放式基金所处的市场分别估值；

(6) 未上市债券、私募发行的债券按成本估值；

(7) 期货合约估值方法：

期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；

(8) 开放式基金（包括保管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日基金净值估值（持有的货币市场基金，按估值日的前一工作日基金管理公司公布的每万份收益计提每日货币基金收益），估值日前一工作日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金份额净值的，应以账面价值估值。如果前一开放日至估值日该基金分红除权，则按前一开放日基金份额净值减单位份额分红额后的差额估值；

(9) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，资产管理人可根据具体情况，在与资产托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据

具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

5、估值程序

资产管理人于每个估值日计算本估值日的计划财产净值，资产管理人应于每周第一个工作日（如遇节假日，则以节假日后第一个工作日为估值日对账日）、违约退出受理日、开放日、收益分配基准日等，对估值结果进行书面确认，并以传真方式将估值结果发送给资产托管人。资产托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以传真方式发送给资产管理人。

6、估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划财产净值的 0.5%时，资产管理人和资产托管人应该立即报告资产委托人，说明采取的措施，并立即更正。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认、但因双方共同的主观或人为操作失误导致资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后工作日计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于不可抗力原因，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

7、暂停估值的情形

- (1) 计划投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (2) 因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；
- (3) 中国证监会认定的其他情形。

8、资产管理计划份额净值的确认

用于向资产委托人报告的计划份额净值由资产管理人负责计算，资产托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照资产管理人对计划份额净值的计算结果为准。

计划份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

10、特殊情况的处理

(1) 资产管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易场所及注册登记公司发送的数据错误，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的计划财产估值错误，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(二) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

- 1、资产管理人为本资产管理计划的主要会计责任方。
- 2、本资产管理计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 3、计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关会计制度。
- 5、本资产管理计划单独建账、独立核算。

6、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。

7、资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

十一、资产管理计划的费用与税收

（一）资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理费。
- 2、资产托管费。
- 3、投资顾问的投资顾问费。
- 4、销售机构的销售服务费。
- 5、资产管理计划的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）。
- 6、资产管理计划备案后与之相关的会计师费和律师费。
- 7、银行账户的资金结算汇划费、账户维护费。
- 8、资产管理计划财产开立账户需要支付的费用。
- 9、按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为【0.3】%年费率，计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div 365$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日的计划财产净值

本计划的管理费自资产管理合同生效日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产

托管人核对后,由资产托管人于每个自然季度次月的前五个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。

管理费收费账户信息如下:

户 名: 深圳平安大华汇通财富管理有限公司

账 号: 19014482481004

开户银行: 平安银行深圳分行营业部

2、资产托管人的托管费

资产管理计划财产的年托管费率为【0.2】%,计算方法如下:

$$T=E \times 0.2\% \div 365$$

T 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的托管费自资产管理合同生效日起,每日计提,按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后,由资产托管人于每自然季度次月的前五个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。

托管费收入帐户

户 名: 平安银行

账 号: 99262005300010

开户行: 平安银行

大额支付号: 307584007998

3、投资顾问的投资顾问费

1) 投资顾问的固定投资顾问费

资产管理计划财产的固定投资顾问费率为【0.6】%。计算方法如下:

$$G=E \times 0.6\% \div 365$$

G 为每日应计提的投资顾问费

E 为前一日的计划财产净值

本资产管理计划的投资顾问费自本合同生效之日起，每日计提，按季支付。资产托管人于下季初十个工作日内，按照资产管理人的指令从资产管理计划财产中将前一季度已计提的投资顾问费支付给投资顾问。如遇计划财产不可变现，则递延至最近一个可变现交易日进行支付。

2) 投资顾问的浮动投资顾问费

投资顾问收取业绩报酬的原则：

- (1) 同一委托人不同时间多次参与的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；
- (2) 在收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；
- (3) 在收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；
- (4) 在委托人退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；
- (5) 委托人申请退出时，按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

业绩报酬的计提方法：每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

业绩报酬计提日为收益分配基准日、委托人参与份额退出日或计划终止日；

P_1 为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

投资顾问业绩报酬计提如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R < 6\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 6\%$	20%	$Y = A \times (R - 6\%) \times 20\% \times D$

Y=业绩报酬;

A=每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

业绩报酬支付：当收益分配、计划份额退出或计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额(含业绩报酬和退出费用)或分红金额(含业绩报酬)划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬和退出费用支付给投资顾问，并将扣除业绩报酬和退出费用的退出款项转入推广机构在注册登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

投资顾问费收款帐户信息如下：

户名：平安磐海资本有限责任公司

开户行：平安银行深圳平安大厦支行

账号：2000015542314

大额支付行号：307584021517

4. 销售服务费

销售服务费主要用于支付销售机构的客户维护、服务发生的费用。本计划的销售服务费率【0.6】%（年化），按前一日的计划财产净值计提，销售服务费按以下公式计算：

每日销售服务费=前一日的计划财产净值×0.6%/365

销售服务费每日计提，按季支付，资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，按资产管理人出具的划款指令或者其他双方协商一致的方式，于下季初十个工作日之内向代销机构支付。

销售服务费收款帐户信息如下：

户名：平安证券有限责任公司

开户行：44201613000050002312

账号：中国建设银行深圳市分行营业部

5. 上述（一）中 5-9 费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用。由资产托管人根据资产管理人的指令从计划财产中支付。

（三）不列入资产管理业务费用的项目

1、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或计划财产的损失。

2、资产管理人和资产托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

(四) 对于管理费率、托管费率调高的,须经资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致,并报中国证监会备案。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。对于管理费率、托管费率调低的,则管理人无须与资产委托人协商,可以直接调低费率,并报中国证监会备案。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

(五) 税收

本计划运作过程中涉及各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。资产管理计划根据实际从登记结算机构收到的股息、利息等相关收入直接确认收益。资产委托人应缴纳的税收,由资产委托人负责,资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

十二、资产管理计划的收益分配

(一) 资产管理计划利润的构成

资产管理计划利润指利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二) 资产管理计划可供分配利润

资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日(具体参见管理人母公司平安大华基金管理有限公司网站公告)资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三) 收益分配原则

本资产管理计划收益分配应遵循下列原则:

1. 本资产管理计划的每份资产管理计划份额享有同等分配权;

2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。当委托人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,资产管理计划注册登记机构可将委托人的现金红利按除权后的计划份额净值自动转为资产管理计划份额;

3. 在符合有关资产管理计划分红条件的前提下，本资产管理计划收益每年最多分配 4 次，每次资产管理计划收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

4. 若资产管理合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

5. 本资产管理计划收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的计划份额净值自动转为资产管理计划份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；

6. 资产管理计划收益分配后每一资产管理计划份额净值不能低于面值，即资产管理计划收益分配基准日的资产管理计划份额净值减去每单位资产管理计划份额收益分配金额后不能低于面值；

7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四) 收益分配方案

资产管理计划收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、资产管理计划收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

(五) 收益分配的时间和程序

1. 资产管理计划收益分配方案由资产管理人拟订，由资产托管人复核，由资产管理人通知资产委托人；

2. 在收益分配方案确定后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十二、报告义务

(一) 初始销售期间报告

1、投资说明书

资产管理人应当在正式办理资产管理计划推介业务前，将投资说明书在管理人网站上公布。

2、合同生效公告

资产管理人应当在收到中国证监会备案文件的第二个工作日在资产管理人母公司网站上公告。

（二）运作期报告

1、资产管理人向资产委托人以及项目管理顾问提供的报告种类、内容和提供时间

（1）年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起 30 个工作日内，编制完成计划年度报告并经资产托管人复核，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。

资产管理人应于每年结束之日起 20 个工作日内完成年度报告，并将年度报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。

（2）季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成计划季度报告并经托管人复核后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。

资产管理人应于每季度结束之日起 10 个工作日内完成季度报告，并将季度报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。

（3）临时报告

发生本合同约定的、可能影响客户利益的重大事项时，资产管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时进行报告。

①投资经理发生变动。

②涉及资产管理人、计划财产、资产托管业务的诉讼。

③资产管理人、资产托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的调查。

④资产管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚。

⑤法律法规和中国证监会规定的其他事项。

上述向资产委托人提供的报告中涉及证券投资明细的，原则上每季度至多报告一次。

(4) 资产管理计划份额净值报告

资产管理人每周将经资产托管人复核的上周最后一个交易日的计划财产份额净值进行披露。

2、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照《试点办法》及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

(1) 资产管理人母公司网站

《资产管理合同》、《投资说明书》、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人母公司网站上披露，资产委托人可随时查阅。

(2) 邮寄服务

资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息。资产委托人在开户合约书上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知管理人。

(3) 传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

(二) 向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和中国证监会的要求履行报告义务。

十三、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 合同的变更

全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更，资

产管理合同约定资产管理人有权变更合同内容的情形除外。

出现下列情况时，资产管理人有权变更本合同内容，无须与全体资产委托人协商一致，但资产管理人须与资产托管人协商后修改资产管理合同，并及时披露，资产管理人应在其网站上向资产委托人履行告知义务。

- 1、调低资产管理计划的费用；
- 2、因相应的法律法规发生变动必须对本合同进行修改；
- 3、对本合同的修改不涉及本合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 4、按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。

（二）合同变更的备案

对资产管理合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内将资产管理合同样本报中国证监会备案。

（三）合同终止的情形（含提前终止）

资产管理合同终止的情形包括下列事项：

- 1、资产管理合同存续期限届满而未延期的。
- 2、资产管理合同的资产委托人少于 2 人的。
- 3、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的。
- 4、资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 5、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 6、经全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的。
- 7、计划财产全部变现的。
- 8、法律法规和本合同规定的其他情形。

（四）资产管理计划财产的清算

- 1、资产管理计划财产清算小组

(1) 本计划终止事由发生之日起 10 个工作日内，由资产管理人组织成立计划财产清算小组。在计划财产清算小组接管计划财产之前，资产管理人和资产托管人应按照规定继续履行保护计划财产安全的职责。

(2) 计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、清算程序

(1) 计划合同终止情形发生后，由计划财产清算小组统一接管计划财产。

(2) 计划财产清算小组根据计划财产的情况确定清算期限。

(3) 计划财产清算小组对计划财产进行清理和确认。

(4) 对计划财产进行评估和变现。

(5) 制作清算报告。

(6) 将清算报告报中国证监会备案。

(7) 对计划财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

4、计划剩余财产的分配

计划财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用。

(2) 交纳所欠税款。

(3) 支付管理费、托管费、投资顾问费固定投资顾问费、销售服务费、投资顾问浮动投资顾问费（若有应付未付费用）。

(4) 清偿计划债务。

(5) 按计划资产委托人持有的计划份额比例进行分配。

计划财产未按前款(1)、(2)、(3)、(4)项规定清偿前,不分配给计划资产委托人。

5、计划财产清算报告的告知安排

计划财产清算小组做出清算报告后,报中国证监会备案。

6、计划财产清算账册及文件由计划管理人保存15年以上。

(五) 资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后,资产托管人按照规定注销资产管理计划财产的资金账户、证券账户、期货账户及其他账户,资产管理人应给予必要的配合。

十四、对资产委托人的服务

资产管理人承诺为资产委托人提供以下至少一种服务,资产管理人根据资产委托人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一) 客户服务中心(CALL-CENTER)电话服务

呼叫中心自动语音系统提供7×24小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日9:00-17:00为资产委托人提供服务,资产委托人可以通过该热线获得业务咨询,信息查询,服务投诉,信息定制,资料修改等专项服务。

客服电话:400-800-4800(免长途话费)

(二) 网上查询服务

资产委托人还可通过平安大华基金公司网站的“账户查询”平台完成资产管理计划账户的查询业务。

公司网址: <http://fund.pingan.com>

第四节 资产管理合同的主要内容

一、资产委托人、资产管理人和资产托管人的权利、义务

（一）资产委托人的权利与义务

除资产管理合同另有约定外，每份同类型计划份额具有同等的合法权益。

1、资产委托人的权利

- （1）分享资产管理计划财产收益。
- （2）参与分配清算后的剩余资产管理计划财产。
- （3）按照资产管理合同的约定参与和退出资产管理计划。
- （4）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。
- （5）按照资产管理合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料。
- （6）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他权利。

2、资产委托人的义务

- （1）遵守本合同。
- （2）交纳购买资产管理计划份额的款项及规定的费用。
- （3）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。
- （4）及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。
- （5）向资产管理人或其代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人履行反洗钱义务；
- （6）不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为。
- （7）不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。
- （8）按照本合同的约定承担资产管理费、托管费、业绩报酬以及因资产管理计划财产

运作产生的其他费用。

(9) 保证购买资产管理计划份额的款项来源及用途合法。

(10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 资产管理人的权利与义务

1、资产管理人的权利

(1) 按照本合同的规定，独立管理和运用资产管理计划财产。

(2) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产管理人报酬。

(3) 依照有关规定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会。

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构代理销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对代理销售机构的销售行为进行必要的监督。

(6) 自行担任或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查。

(7) 委托其母公司对特定客户资产管理计划进行投资管理；

(8) 委托其他机构对投资涉及的资产进行尽职调查、资产评估等；

(9) 以受托人的名义，代表特定客户资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、资产管理人的义务

(1) 办理资产管理计划的备案手续。

(2) 自本合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产。

(3) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产。

(4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理的基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

(5) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

(6) 办理或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理资产管理计划份额的登记事宜。

(7) 按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。

(8) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(9) 根据《试点办法》和本合同的规定，编制并向资产委托人报送资产管理计划财产的投资报告，对报告期内资产管理计划财产的投资运作等情况做出说明。

(10) 根据《试点办法》和本合同的规定，编制特定资产管理业务季度及年度报告，并向中国证监会备案。

(11) 计算并按照本合同的规定向资产委托人报告资产管理计划份额净值。

(12) 进行资产管理计划会计核算。

(13) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外。

(14) 保存资产管理计划资产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。

(15) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

(16) 对相关交易主体和资产进行全面的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告。

(17) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(三) 资产托管人的权利与义务

1、资产托管人的权利

(1) 按照本合同的规定，及时、足额获得资产托管费。

(2) 根据本合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施。

(3) 按照本合同的规定，依法保管资产管理计划财产。

(4) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、资产托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产。

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

(3) 对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。

(4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的资金账户和证券账户。

(6) 复核资产管理计划份额净值。

(7) 复核资产管理人编制的资产管理计划财产的投资报告，并出具书面意见。

(8) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案。

(9) 按照本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

(10) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料。

(11) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

(12) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露。

(13) 根据法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会。

(14) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

3、平安银行股份有限公司属于资产管理人的关联方，本资产管理计划聘请平安银行股份有限公司作为托管人属于关联交易，全体投资者知悉并同意上述安排。

二、违约责任

(一) 因本合同当事人的违约行为造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、资产管理人和/或资产托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等。

2、资产管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、资产托管人对因所引用的证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任。

4、因证券市场波动、上市公司合并、委托财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为。

5、不可抗力。

(二) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者资产委托人造成损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；资产管理人、资产托管人因共同行为给计划财产或资产委托人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

(三) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护资产委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

三、争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交位于深圳的华南国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

四、资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，本合同经资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同经资产委托人本人签字或授权代表签字、资产管理人和资产托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字之日起成立。本合同自资产管理计划备案手续办理完毕，获中国证监会书面确认之日起生效。

(二) 资产管理合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

(三) 资产管理合同一式肆份, 资产管理人执贰份, 资产委托人执壹份, 资产托管人执壹份, 每份具有同等的法律效力。

(四) 本合同有效期 5 年, 经各方协商一致同意可延期。

第五节 资产管理人与资产托管人的概况

一、资产管理人

名称: 深圳平安大华汇通财富管理有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址: 深圳市福田区福华三路星河发展中心 5 楼

法定代表人: 罗春风

组织形式: 有限责任公司

存续期间: 持续经营

联系人: 王名伦

联系电话: 0755-22621337

传真: 0755-23997878

网址: <http://fund.pingan.com.cn>

二、资产托管人

名称: 平安银行股份有限公司

住址: 深圳市深南东路 5047 号

法定代表人: 孙建一

组织形式: 股份有限公司

存续期间: 持续经营

联系人: 李玉彬

联系电话: 0755-22168677

网址：www.bank.pingan.com

第六节 投资风险揭示

本计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响所引起的波动，将对本资产管理计划产生潜在风险，主要包括：

政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对投资标的产生一定的影响，导致市场价格波动，从而影响本资管计划投资收益而产生风险；由于国家法律、法规、政策的变化、交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因导致本资产管理计划持有的金融资产可能无法继续持有从而导致损失。

经济周期风险：经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如业内竞争、市场前景、管理能力、财务状况等都会导致公司盈利发生变化。若资管计划所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌或可分配利润减少，使投资收益下降，从而给资管计划的投资带来风险。

大宗交易风险：大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

利率风险：利率的变化直接影响国债的价格，同时也影响到证券市场资金供求关系，还会在一定程度上影响上市公司的盈利水平。上述变化将直接或间接影响到本资管计划的收益水平。

金融产品发行方风险：金融产品的发行方可能存在因其违规经营和管理疏忽等原因而使该金融产品财产蒙受损失的风险。以上所指的金融产品是指包含在资产管理计划投资范围内的金融产品。

交易对手信用风险：企业债券和金融债券的发行人可能因经营不善或其他原因拒付债券本息，或者在债券交易时交易对家违约，从而使资管计划财产受到损失。

购买力风险：委托人将主要通过现金形式来获取收益，而现金可能因为通货膨胀因素而

使其购买力下降。

（二）管理风险

在实际操作过程中，资产管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其筛选出的投资品种的业绩表现不一定能够优于其他投资品种。

（三）资产托管人风险

资管计划存续期间内，资产托管人的资质、管理能力、相关知识和经验以及操作能力等也对计划财产的投资运用和管理有着较大程度的影响；也可能发生违反本合同或相关聘用合同的情形；资产托管人的经营和操作失误、系统故障也可能导致计划财产受到损失。

（四）再投资风险

再投资获得的收益有时又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的利率水平和再投资的策略。因未来市场利率的变化而引起给定投资策略下再投资率的不确定性为再投资风险。

（五）投资损失风险

委托人认购资管计划的投资，受到计划份额净值的变化影响；计划份额净值根据计划财产投资运作状况以及其他因素可能发生变动。管理人按照法律法规的规定不得对委托人承诺投资不受损失或最低收益，委托人对投资收益分配的金额和时间也不作出任何保证。这些都可能导致委托人的投资受到损失。

（六）流动性风险

本计划面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：计划财产不能迅速转变成现金，或变现成本很高，不能应付可能出现的委托人大额退出的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现都有可能因流动性问题而增加变现成本，对本计划的资产净值造成不利影响。这种风险在发生大额退出时表现尤为突出；

证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个股的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本计划在个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

（七）信用风险

企业债券和金融债券的发行人可能因经营不善或其他原因拒付债券本息，或者在债券交易时交易对象违约，从而使本资产管理计划受到损失。

（八）提前终止或延期风险

发生本计划文件规定的情形或其他法定情形时，管理人将按照法律法规、资管计划文件以及其他规定提前终止资管计划，可能造成委托人的投资损失。

因所持投资品种被暂停退出等原因导致计划财产无法及时变现的，计划将延期至计划财产全部变现为止；资管计划投资收益仅以扣除应付未付的资产管理计划的费用和其他负债后的货币资金形式计划财产为限分配，可能造成委托人的投资损失，并导致委托人不能及时取得资管计划收益。

（九）现金管理风险

本资管计划期间设置开放日，必须保持一定的现金比例以应付退出的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。

（十）平仓风险

当资产管理计划份额净值触及预警线、止损线时，资产管理人均可能对资产管理计划进行强制平仓，在强制平仓过程中，资管计划由于快速变现资产的原因，平仓价格可能低于市场均价，同时也无法继续长期持有某些在未来可能获得更高收益的投资品种，可能给资产委托人造成严重损失。

另外，本资产管理计划能否快速平仓变现取决于本资产管理计划所投资品种的流动性，存在本资产管理计划无法快速完成平仓的可能。

（十一）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、相关交易所、证券注册登记机构等。

(十二) 预警止损机制的风险

虽然本资产管理计划设计有预警止损机制,且资产管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按合同规定及时执行预警止损,但在极端情况下,资产管理计划可能不能及时止损或本资产管理计划终止时的份额净值仍有可能远低于止损线。

(十三) 投资顾问风险

本资产管理计划的资产管理人将参考投资顾问的投资建议进行投资交易。投资顾问的投资服务能力、服务水平将直接影响本资产管理计划的收益水平。在本资产管理计划管理运作过程中,可能因投资顾问对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等因素影响本资产管理计划的收益水平。

(十四) 投资于金融衍生品的风险

1、本资产管理计划将投资于股指期货、商品期货、国债期货等金融衍生品。无论资产管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资,由于金融衍生品的高杠杆性等特征,对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。

2、资产管理人并非期货交易所会员,以期货交易所会员(即期货经纪人)之客户的身份参与期货交易,可能存在因期货经纪人违规经营、管理疏忽、资金能力出现问题等原因而导致本资产管理计划蒙受损失。

3、期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本资产管理计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓,进而可能给本资产管理计划造成重大损失;本资产管理计划所委托的交易所会员除接受本资产管理计划委托外,还可

能同时接受其他主体的委托,本资产管理计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施,而这种不足不一定是本资产管理计划的保证金不足造成的,还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的,但即便如此本资产管理计划也可能因此受到重大损失;为及时缴纳保证金,本资产管理计划可能紧急变现部分资产管理计划财产,在上述情况下,该部分资产管理计划财产的变现可能并非以最优价格进行,从而造成本资产管理计划的损失。本资产管理计划及本资产管理计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算,一旦本资产管理计划或本资产管理计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给本资产管理计划财产造成损失。

4、金融衍生品具有高杠杆性的特征,当出现不利行情时,本计划所投资期货合约品种微小的变动就可能使本计划遭受较大损失。

5、在市场剧烈变化的情况下,资产管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失,本资产管理计划必须承担由此导致的全部损失。同时本资产管理计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险。

6、相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理,本计划如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的,可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易。

7、相比于其他交易品种,金融衍生品的投资交易可能更加频繁,频繁操作将可能增加资产管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性,存在操作风险。

(十五) 股指期货的特别风险

除本合同提示的“投资于金融衍生品的风险”的风险外,投资于股指期货还存在以下特别风险:

作为股指期货合约标的的股票指数受股票交易市场价格波动的影响,从而给股指期货的投资带来风险。

(十六) 投资策略变更的风险

本计划在存续期间,可能会发生投资策略的变更,投资策略的变更可能加大本计划所面临的投资风险,也可能导致本计划可获得收益降低,资产委托人应当仔细衡量投资策略变更

对本计划的影响，以决定是否及时退出本计划或减少对本计划的投资。

（十七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致资产委托人利益受损。

第七节 初始销售期间

本资产管理计划自2014年11月26日至2014年12月26日进行初始销售。

如果在此期间提前满足《试点办法》第十三条规定的条件的，资产管理人可与销售机构协商决定提前终止初始销售。

第八节 本资产管理计划销售机构

1. 名称：平安大华基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区福华三路星河发展中心5楼

法定代表人：杨秀丽

联系人：王源

联系电话：0755-22621713

客服电话：4008004800

传真：0755-23997878

2. 名称：平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：谢永林

联系人：郑舒丽

联系电话：0755-22627707

备查文件

- (一)《平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划资产管理合同》
- (二)《平安汇通磐海创富量化对冲 5 号特定客户资产管理计划投资说明书》
- (三)深圳平安大华汇通财富管理有限公司营业执照及业务许可证（即合法经营特定客户资产管理业务的证明）
- (四) 托管人的营业执照及业务许可证
- (五) 其他资产管理人认为需要且可以提供的备查文件

出于行业惯例和保护商业秘密的需要,资产委托人可在资产管理人处查阅上述备查文件,但资产管理人有权拒绝其复印、拷贝的要求。