

平安银行资产托管部保管报告

报告期：（2018年07月01日-2018年09月30日）

招商证券资产管理有限公司：

根据平安银行（以下简称“我行”或“本保管人”）与贵方签署的《招商汇智之中证金牛量化对冲FOF1期集合资产管理计划》（以下简称《保管合同》），我行授权我部对贵方“招商汇智之中证金牛量化对冲FOF1期集合资产管理计划（以下简称“本信托计划”）项下的现金类财产进行了保管。

根据有关法律法规规定及《保管合同》约定，本保管人负有以下职责：

- 1、安全保管信托财产；
- 2、对所保管的本信托计划分别设置账户，确保信托财产的独立性；
- 3、确认与执行贵方管理运用信托财产的指令，核对信托财产交易记录、资金和财产账目；记录信托资金划拨情况，保存贵方的资金用途说明；
- 4、遇有贵方违反法律法规和信托文件、本保管合同操作时，立即以书面形式通知贵方限期纠正；当出现重大违法违规或者发生严重影响信托财产安全的事件时，及时报告中国银行业监督管理委员会；
- 5、根据中国银监会规定及保管协议的约定，在受托财产的保管过程中，我部严格遵守《信托法》、《信托公司管理办法》等法律、法规及信托文件、保管协议，勤勉履行了保管人的上述职责，没有从事任何损害本信托计划委托人、受益人利益的行为。

报告期内，本保管人根据法律、法规规定和信托文件、保管合同约定，在保管职责范围内对贵方的相关业务进行了监督与核查，未发现贵方的相关业务存在违反法律法规、信托文件和保管合同，损害本信托计划委托人、受益人利益的行为。

平安银行深圳分行资产托管部

2018年10月17日

