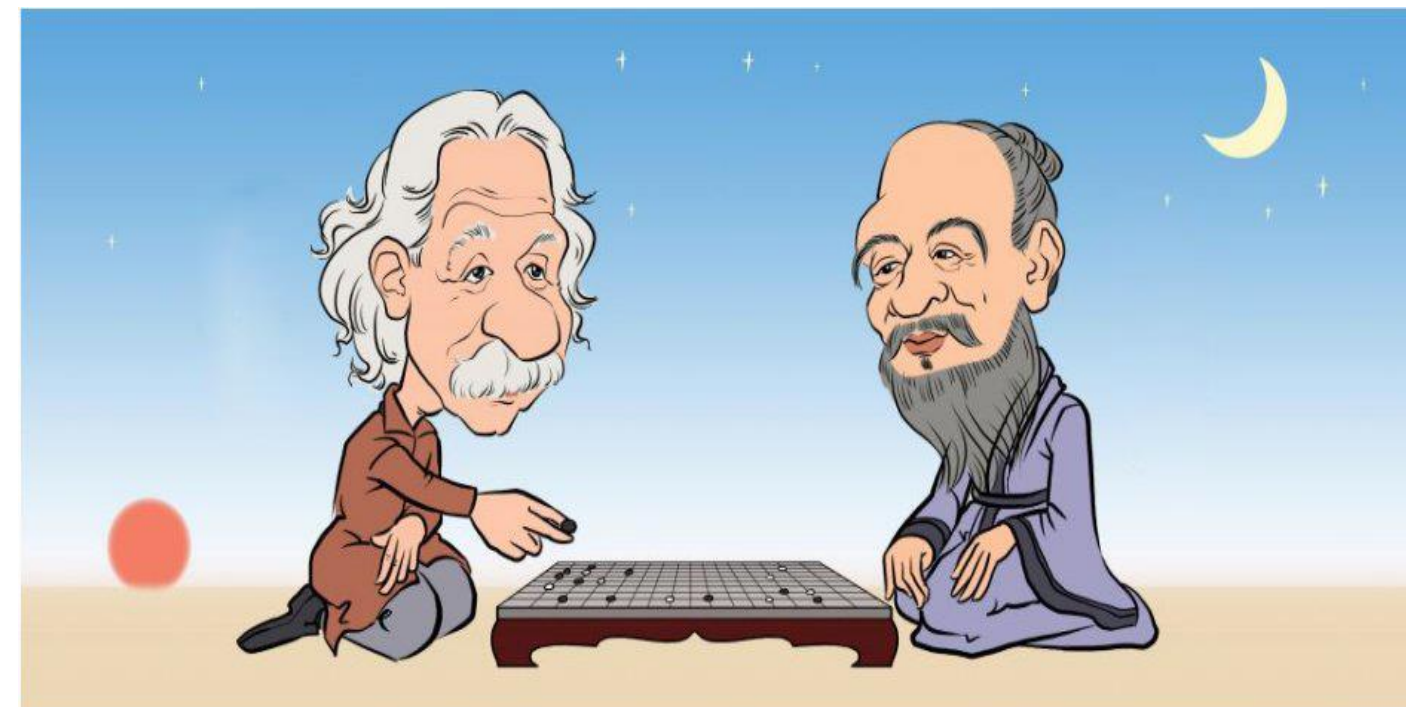


平石T5对冲基金

Pingrock T5 Hedge Fund

深圳市平石资产管理有限公司
PingRock Assets Management Limited



概述

成立时间：2015年4月10日

基金管理人：深圳市平石资产管理有限公司

产品类型：非结构化

产品策略：相对价值复合策略

核心管理人

尹志平先生：

1992年毕业于西南财经大学

25年证券投资经验

1993-1994年：深圳中国国际期货公司经纪人

1994-1998年：深圳南山基金管理公司基金经理

1998年：创业至今

投资策略

➤ 精选品种，精心配置，在控制风险的基础上获取稳健收益

构建最具上升潜力的多头组合：综合考虑投资标的的成长性、风险收益比、内在价值等因素，精选优质的股票、基金、债券等组成多头组合。

同时构建最具效率的空头组合，根据相关性、流动性、价格（升贴水）等因素在期货、期权等衍生品中优选品种，构建空头组合，通过多空组合的相对变化，来达成投资目标。

➤ 持续地寻找市场的低风险套利机会

综合运用融资融券、期货、期权等金融工具，积极捕捉市场出现的低风险有理想回报的套利机会。

➤ 适时理性地使用杠杆

在市场出现确定的无风险或低风险的投资机会时，适时理性地使用杠杆，以提高组合的收益率。

核心客户

➤ 家族信托

由平安信托设立的平安财富*鸿承世家-XX家族信托，存续期70年，是平安信托唯一的以全部家族信托财产定向投资一家私募对冲基金的家族信托产品。

➤ 高净值人群

国内民营企业家、知名企业高管及骨干员工等

➤ 自有资金

管理人平石资产及关联公司将二级市场投资的自有资金全部投入到自有产品中。

要素表

科目		要素
项目名称		平石T5对冲基金
合作方	投资顾问/管理人	基金管理人：深圳市平石资产管理有限公司
	保管户开户银行	建行福州广达支行
	基金托管人	兴业证券
合同要素	开放频率和开放日	每个月开放一次，增加临时开放日
	认购费（价外）	0%
	认购起点	100万
	追加认购	10万起
	委托人数限制	最高不超过200人
	期限	无期限
	封闭期	封闭期：6个月（半年内设临时开放日，只能申购，不能赎回）
	赎回费用	赎回费：12个月以内1%，12个月以上无。由基金管理人收取。
	止损线	无
投资	固定费用	管理费1%、托管运营费0.16%
	投资限制	申购新股申报的金额不超过基金的现金总额，申报的数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。
	投资范围	本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（不包括ETF基金一级市场申购、赎回）、期货、期权、权证、资产支持证券、收益互换、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、证券类信托计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募证券投资基金、银行理财产品。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购、场外期权、大宗交易，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。
	业绩报酬计算	业绩报酬按盈利部分的20%收取，计算采取“单个基金份额持有人单笔投资高水位法”，业绩报酬于每个开放日（不包括临时开放日）计算，并从单个基金份额持有人个人账户中扣除。

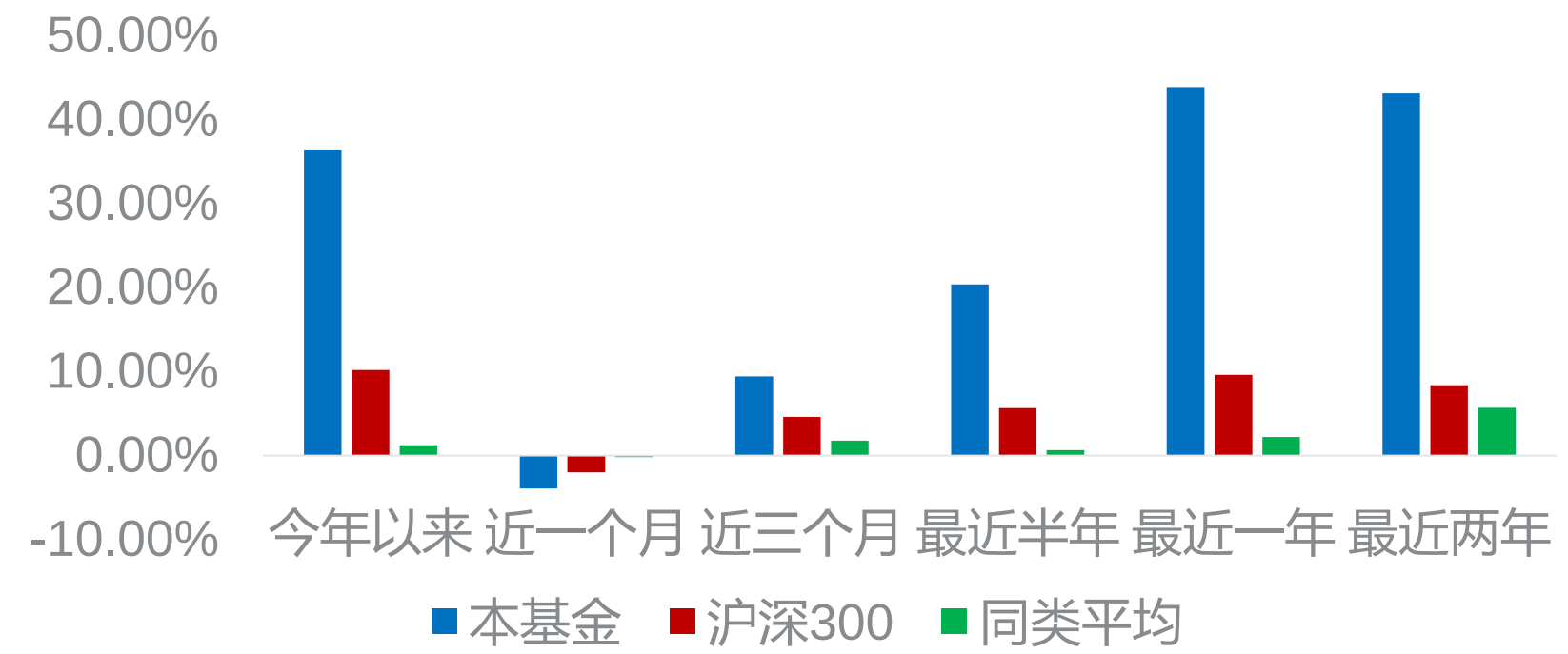
业绩表现					
相对价值私募基金最近一年收益排名（ 1 / 346 ）					
排名	产品名称	投资策略	基金公司	最近一年收益	累计收益
1	平石T5对冲基金	相对价值	平石资产	58.15%	38.67%
2	白鹭投资进取一期	相对价值	白鹭投资	56.16%	92.70%
3	第二基金中国300指数基金	相对价值	第二基金	47.79%	19.21%
4	外贸信托-朱雀专享3号	相对价值	朱雀股权	47.53%	53.80%
5	牛市基金	相对价值	第二基金	38.91%	53.50%
6	平石2n对冲	相对价值	平石资产	27.67%	32.21%
7	双隆隆腾1号	相对价值	双隆投资	26.55%	51.10%
8	幻方中证500指数增强1号	相对价值	幻方量化	24.95%	23.70%
9	幻方300创想1期	相对价值	幻方量化	24.50%	24.50%
10	谦璞多策略稳健一号	相对价值	谦璞投资	20.98%	18.20%
...					
346	天风天勤8号	相对价值	天风证券	-44.89%	-40.93%
备注： 以上数据来源于私募排排网（数据截止至2017年8月11日）					

业绩表现



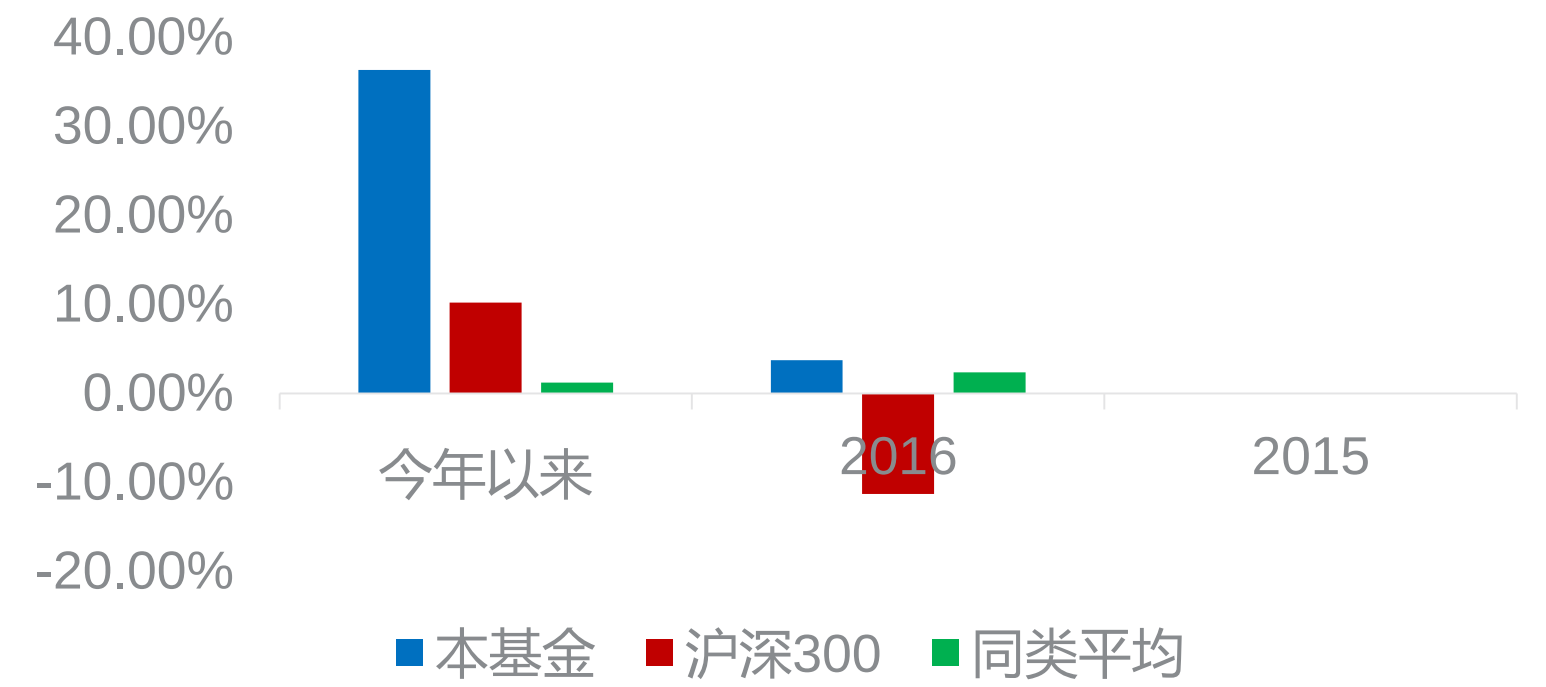
备注：以上数据来源于私募排排网（数据截止至2017年8月11日）

平石T5对冲基金（区间收益）



数据项/区间	今年以来	近一个月	近三个月	最近半年	最近一年	最近两年
■ 本基金	36.34%	-3.93%	9.41%	20.36%	43.88%	43.12%
■ 沪深300	10.19%	-2.00%	4.61%	5.63%	9.60%	8.36%
■ 同类平均	1.21%	-0.20%	1.77%	0.66%	2.21%	5.70%

平石T5对冲基金（年度收益）



数据项\区间	今年以来	2016	2015
■ 本基金	36.34%	3.75%	—
■ 沪深300	10.19%	-11.28%	—
■ 同类平均	1.21%	2.38%	—

备注：以上数据来源于私募排排网（数据截止至2017年8月11日）



深圳市平石资产管理有限公司

PingRock Assets Management Limited

电话：0755-83244848

地址：深圳市福田区下梅林二街颂德国际408室

提示：本文件为基金管理人演示用品，不作为商业用途，未经许可，任何情况下任何人或机构不得复制、传播本文件。