

合同编号：2206070

东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金 基金合同

基金管理人：东航私募基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

二零二二年

合格投资者承诺书

东航私募基金管理有限公司：

本人/本单位作为符合中国证券监督管理委员会规定的私募证券投资基金的合格投资者（即个人投资者的金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元，机构投资者净资产不低于 1000 万元或《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条规定的合格投资者），具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金投资私募基金。本人/本单位在参与贵公司发起设立的私募基金的投资过程中，如果因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述所产生的一切责任，由本人/本单位自行承担，与贵公司无关。

特此承诺。

投资者（自然人签字或机构盖章）：

法定代表人或授权代理人（签字或盖章）：

日期： 年 月 日

投资者告知书

尊敬的投资者：

本基金通过直销机构（基金管理人）或基金管理人委托的代销机构（如有）进行销售。基金投资者认购或申购本基金，以人民币货币资金形式交付，在直销机构认购或申购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集结算专用账户，在代销机构认购或申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

募集结算专用账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。募集结算专用账户是由募集账户监督机构代基金管理人开立，用于本基金募集期间和存续期间所有销售渠道的认购、申购和赎回资金收付的专用账户，并不代表募集结算专用账户监督机构接受投资者的认购、申购资金，也不表明募集结算专用账户监督机构对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

募集结算专用账户信息如下：

账户名称：东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金

账 号：30100367006465

开 户 行：平安银行股份有限公司上海分行营业部

大额支付号：307290002014

本基金代销募集账户由基金管理人委托的代销机构自行开立并自行聘请监督机构对其进行监督，代销募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以基金管理人或代销机构届时公告为准。

本人/机构已认真阅读《投资者告知书》，清楚认识并认可关于募集账户的上述告知内容，并愿意自行承担由此可能导致的一切风险和损失。

基金投资者（自然人）

（签字）

或：基金投资者（机构）

（加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章）

日期： 年 月 日

东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金
基金合同
(正文)

重要提示

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者退出基金产生的流动性风险，管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等，具体投资风险请详细阅读《风险揭示书》。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，投资者认购、申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同。管理人的过往业绩不代表未来业绩。

本合同将按中国证券投资基金业协会的规定提请备案，但中国证券投资基金业协会接受本合同的备案并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

目 录

一、前言	3
二、释义	4
三、声明与承诺	8
四、基金的基本情况	10
五、基金的成立与备案	12
六、基金的认购、申购和赎回	13
七、当事人及权利义务	19
八、基金份额持有人大会及日常机构	25
九、基金份额的登记	29
十、基金的投资	30
十一、投资经理的指定与变更	34
十二、基金的财产	35
十三、指令的发送、确认与执行	38
十四、交易及清算交收安排	41
十五、越权交易	43
十六、基金财产的估值和会计核算	45
十七、基金的费用与税收	51
十八、基金的收益分配	56
十九、信息披露义务	57
二十、风险揭示	59
二十一、基金份额的转让、非交易过户和冻结	63
二十二、基金合同的成立、生效及签署	64
二十三、基金合同的解除、变更和终止	65
二十四、清算程序	67
二十五、违约责任	69
二十六、法律适用和争议的处理	70
二十七、基金合同的效力	71
二十八、其他事项	72

一、前言

订立本合同的目的、依据和原则：

1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本基金的运作、保护基金投资者的合法权益。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）和《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》，《关于私募投资基金开户和结算有关问题的通知》，《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《私募办法》），《私募投资基金募集行为管理办法》，《私募投资基金信息披露管理办法》，《关于发布私募投资基金合同指引的通知》，《内地与香港股票市场交易互联互通机制若干规定》，《上海证券交易所沪港通业务实施办法（2021年修订）》，《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》；及其他法律法规的有关规定。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、公平，维护基金投资者的合法权益，不得损害国家利益和社会公共利益。

本合同是约定本合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本合同为准。本合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金投资者。基金合同的当事人按照《基金法》、本合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

本基金按照中国法律法规成立并运作，若本合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

二、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：《东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金基金合同》及对本合同的任何有效补充。

2. 本基金/本私募基金：东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金。

3. 私募基金：以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。

4. 基金投资者：依法可以投资于私募基金的个人投资者、机构投资者。

5. 基金管理人/管理人/私募基金管理人：东航私募基金管理有限公司。

6. 基金托管人/托管人：海通证券股份有限公司。

7. 本基金投资者：签署本合同，履行出资义务取得基金份额的基金投资者。

8. 专业投资者，包括以下几类：

(1) 经有关金融监管部门批准设立的金融机构，包括证券公司、期货公司、基金管理公司及其子公司、商业银行、保险公司、信托公司、财务公司等；经行业协会备案或者登记的证券公司子公司、期货公司子公司、私募基金管理人。

(2) 上述机构面向投资者发行的理财产品，包括但不限于证券公司资产管理产品、基金管理公司及其子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品、经行业协会备案的私募基金。

(3) 社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）。

(4) 同时符合下列条件的法人或者其他组织：

a) 最近 1 年末净资产不低于 2000 万元；b) 最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元（金融资产，是指银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等）；c) 具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历。

(5) 同时符合下列条件的自然人：

a) 金融资产（指银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等）不低于 500 万元，或者最近 3 年个人年均收入不低于 50 万元；b) 具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历，或者具有 2 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于本条第（1）项规定

的专业投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师。

9. 注册登记机构：基金管理人或其委托办理私募基金份额注册登记业务的机构。

10. 中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。

11. 工作日/交易日：上海、深圳、北京证券交易所的正常交易日。

12. 开放日：指非基金初始销售期间，基金管理人办理基金申购、赎回业务的工作日。

13. T日：本基金在规定的时间内受理基金投资者申购、赎回等业务申请的日期。

14. T+n日：T日后的第n个工作日，当n为负数时表示T日前的第n个工作日。

15. 基金财产：基金投资者拥有合法处分权、基金管理人管理并由基金托管人托管的作为本合同标的的财产。

16. 托管资金专门账户：基金托管人为基金财产在具有基金托管资格的商业银行开立的银行结算账户，用于基金财产中现金资产的归集、存放与支付，该账户不得存放其他性质资金。

17. 私募基金募集结算专用账户：由基金管理人开立的，或基金管理人指定的，或基金管理人委托他人在具有基金托管资格的商业银行开立的，用于私募基金募集结算目的的银行结算账户。基金投资者认购、申购基金，应在募集期内将认购资金汇入该账户；基金投资者退出基金、基金管理人分红、或基金清算，应从该账户汇出资金。

18. 证券账户：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（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由基金托管人为基金财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的证券账户。

19. 证券交易资金账户：基金管理人为基金在证券经纪机构下属的证券营业部开立的证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管资金专门账户建立一一对应关系，其资金密码由基金托管人管理，管理人不得使用或在未经托管人许可的情况下擅自修改，由基金托管人根据基金管理人有效划款指令通过银证转账的方式完成证券交易资金账户与托管资金专门账户间的资金划付。

20. 期货交易资金账户：指基金管理人以本基金名义根据期货备忘录及中国期货保证金监控中心的要求，在期货经纪商处开立的用于存放本基金期货保证金的账户，其用途包括出入金、支付期货交易结算款和相关费用等，期货交易资金账户对应唯一的托管资金专门账户，

其资金密码由基金托管人管理，管理人不得使用或在未经托管人许可的情况下擅自修改，由基金托管人根据基金管理人有效划款指令通过银期转账的方式完成期货交易资金账户与托管资金专门账户间的资金划付。

21. 基金资产总值：本基金拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。
22. 基金资产净值：本基金资产总值减去负债后的价值。
23. 基金份额净值：计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的数值。
24. 基金份额累计净值：基金份额净值和基金成立后累计份额分红金额之和。
25. 基金资产估值：计算、评估基金资产和负债的价值，以确定本基金资产净值和基金份额净值的过程。
26. 单个基金投资者单笔投资：某个基金投资者在募集期认购或开放期申购的某一笔基金份额。
27. 募集期：指本基金的初始销售期限。
28. 存续期：指本基金成立至清算之间的期限。
29. 封闭期：指本基金存续期内不得申购或赎回的期限。
30. 运作年度：按照算头不算尾原则计算，例如首个运作年度为自基金成立日至基金成立日次年对日的前1日之间的期限，后续运作年度以此类推。
31. 投资冷静期：指自基金投资者签署基金合同完毕且交纳认购/申购基金的款项后的【二十四小时】。销售机构在投资冷静期内不得主动联系投资者。基金投资者在投资冷静期内有权解除基金合同。基金投资者为专业投资机构的，可不适用本基金投资冷静期的规定。
32. 回访确认：指销售机构在投资冷静期满后，指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。销售机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。基金投资者在销售机构回访确认成功前有权解除基金合同。未经回访确认成功，投资者交纳的认购/申购基金款项不得由募集账户划转到基金财产账户或托管资金专门账户，私募基金管理人不得投资运作投资者交纳的认购基金款项。
33. 认购：指在募集期间，基金投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。
34. 申购：指在基金开放日，基金投资者按照本合同的规定购买本基金份额的行为。
35. 赎回：指在基金开放日，基金投资者按照本合同的规定将本基金份额兑换为现金的行为。
36. 违约退出：指基金投资者在非合同约定的退出开放日退出基金的行为。
37. 代理募集机构：指符合中国证监会规定的条件，取得基金销售资格并接受基金管理

人委托，代为办理本基金认购、申购、赎回等业务的机构。

38. 外包服务机构、行政服务机构：指接受基金管理人委托，根据与其签订的外包服务协议中约定的服务范围，为本基金提供份额注册登记、基金估值等服务的机构，本基金的行政服务机构为【海通证券股份有限公司】。

39. 募集监督机构：指受基金管理人委托办理私募基金份额募集监督业务的机构，本基金募集监督机构为海通证券股份有限公司

40. 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。

三、声明与承诺

(一) 基金投资者的声明与承诺

私募基金投资者保证本人/本机构为符合相关法律法规、证监会及本合同规定的私募基金合格投资者，并保证投资本基金的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，保证不存在非法汇集他人资金投资私募基金的情形，保证有完全及合法的授权委托管理人和基金托管人进行该财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和基金托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；基金投资者声明已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本投资事项符合其业务决策程序的要求；基金投资者承诺其向管理人或代理募集机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等调查问卷内容的基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知基金管理人或代理募集机构。基金投资者承认，基金管理人、基金托管人及相关机构未对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保。投资者认购基金份额、作出本条规定的声明与承诺或其它相关事项的决定时没有依赖管理人或管理人的任何关联机构，管理人不对认购/申购资金的合法性和合规性负有或承担任何责任，也不对投资者是否遵守适用于其的任何法律、法规或监管政策负有或承担任何责任。

(二) 基金管理人的声明与承诺

基金管理人保证在募集资金前已在中国基金业协会登记为私募基金管理人，管理人登记编码为：P1073178。基金管理人声明，中国基金业协会为基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可，不作为对基金财产安全的保证。

基金管理人声明：中国基金业协会为私募基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对基金财产安全的保证。

基金管理人保证已在签订本合同前充分地向基金投资者揭示了相关风险，自行或委托代销机构采取问卷调查等方式，对投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力进行评估。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证基金财产一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人承诺，一经基金托管人书面要求，基金管理人按时向基金托管人提供基金

管理人所持有的以反洗钱为目的的基金投资者的客户资料。

（三）基金托管人的声明与承诺

基金托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管基金财产，并履行本合同约定的其他义务。

（四）其他合规承诺

1、各方承诺致力于以高的道德规范、行业准则和商业惯例开展业务合作，确保在诚实守信、公开透明、依法合规的前提下签订和履行合同，并使其商业伙伴以相同的行为准则行事，坚决抵制腐败、贿赂等违法违规行为。

2、合同各方及其商业伙伴在开展业务合作过程中，不得为获得不正当利益，直接或间接向对方管理人员或业务人员给付、提供、承诺、授权给予任何有价值物，包括但不限于现金、代金券、折扣、返利、佣金、不适当的礼品、娱乐活动、餐饮招待等；不得为获得不正当利益，通过合谋、串通等方式签订合同或影响合同的正常履行。

3、在合同签订和履行过程中，合同各方及其商业伙伴发现任何涉及业务合作的违法违规行为或存在合规隐患的，可以向东航合规监督邮箱(compliancepoint@ceair.com)进行举报，东航将组织调查核实并对信息提供者进行严格保密，保护信息提供者的合法权益。

四、基金的基本情况

(一) 基金的名称：东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金。

(二) 基金的运作方式：契约型开放式。

(三) 基金的投资目标和投资范围：

1、投资目标：通过积极投资股指期货、商品期货和国债期货等，灵活采用多种投资策略，以实现较高收益。

2、本私募基金的投资范围：

固定收益品种（包括债券、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券（不含劣后级份额）等）、股指期货、商品期货、国债期货、国内依法发行上市的股票、公募证券投资基金、ETF、现金及银行存款、私募基金管理人（协会登记）发行的基金产品及资产管理计划（不含劣后级份额）等。

基金管理人可运用私募基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本私募基金投资策略详见本合同第十章“基金的投资”章节。

(四) 基金的存续期限：20 年，自本基金成立之日起至 20 年以后的对日（不含本日）止，如该日为非工作日的，则顺延至下一工作日。

合同期满前，可以采用以下三种方式中的一种进行基金合同展期。

1、经基金委托人、管理人及基金托管人协商一致可签订书面的延期协议。

2、按照基金合同的约定召开基金份额持有人大会决议通过。

3、基金管理人、基金托管人首先就本合同展期事项达成一致。基金管理人就本合同展期事项在基金管理人网站或书面通知的方式发布征求意见，并在十五个工作日内以书面或电子方式向基金投资者发送合同展期征询意见函（或通知）。基金投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。基金投资者不同意展期的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内退出本基金；基金投资者未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内退出本基金的，视为基金投资者同意合同展期。展期事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

基金的提前终止详见本基金“基金合同的解除、变更和终止”章节。

(五) 基金份额的初始销售面值：人民币 1.00 元。

(六) 基金的初始资产规模限制

本基金成立时委托财产的初始资产净值不得低于中国证监会、中国基金业协会等监管机构的相关规定。

(七) 私募基金的托管事项

本基金的托管人为：海通证券股份有限公司，其在中国证监会的托管人代码为：23030000。

(八) 私募基金的外包事项

本基金的外包服务机构为：海通证券股份有限公司，其在中国基金业协会登记的外包业务登记编码：A00021。外包服务机构提供的外包服务内容为：基金份额登记服务、基金估值服务。但基金管理人将相关基金运营事项委托外包服务机构代为办理并不意味着基金管理人放弃相应事项的管理职责，外包服务机构不是本基金合同的当事人，对基金的投资运作不承担任何责任。外包服务机构的权利义务由基金管理人与其签订的相关《外包服务协议》另行约定。基金管理人就外包服务机构的服务质量向基金投资者负责。

特别提示：本基金的托管人以及服务机构均由海通证券股份有限公司担任，海通证券股份有限公司在本基金实际运作中已将其托管职能和基金服务职能进行分离，能够按照法律法规的要求采取有效措施恰当的识别、管理、监控潜在的利益冲突。

(九) 其他

除基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

五、基金的成立与备案

（一）基金成立的条件

本基金募集期内，当全部满足如下条件时，基金才能成立：

- 1、 单个基金投资者交付的扣除认购费的净认购金额合计不低于 100 万元人民币；
- 2、 有效签署本合同并交付认购资金的基金投资者人数不超过 200 人，监管部门另有规定的除外。
- 3、 通过代销机构进行认购的，人数规模控制以基金管理人和代销机构约定的方式为准。

（二）基金的成立

本基金募集期结束后，基金管理人将全部募集资金划入托管资金专门账户。基金托管人核实资金到账情况，并向基金管理人出具资金到账通知书，基金成立。

认购款在基金成立前产生的利息在基金成立时转为基金投资者的认购份额，利息金额以基金注册登记机构的记录为准。

（三）不能满足基金成立条件的处理方式

- 1、 募集期限届满，不符合基金合同生效条件的，则本基金募集失败。
- 2、 基金募集失败的，基金管理人应当承担下列责任：
 - （1） 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用；
 - （2） 在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

（四）基金的备案

基金管理人在募集完毕后 20 个工作日内，向基金业协会办理基金备案手续，私募基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

（五）基金备案不通过的处理方式

本基金应该在基金业协会规定的期限内完成备案手续，不能满足基金备案条件的，基金管理人应及时通知基金份额持有人和基金托管人，若备案不通过，且管理人决定终止时，本合同相应终止，具体终止流程参见本合同“清算程序”章节。

六、基金的认购、申购和赎回

（一） 认购、申购和赎回的场所

本基金的募集机构包括直销机构（基金管理人）和基金管理人委托的代销机构。

在中国基金业协会办理私募基金管理人登记的机构可以作为直销机构自行募集其设立的私募基金，在中国证监会注册取得基金销售业务资格并成为中国基金业协会会员的机构可以受私募基金管理人的委托作为代销机构募集私募基金。

本基金的募集对象为符合《私募投资基金募集行为管理办法》的合格投资者。

基金投资者应当在募集机构办理基金销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理基金份额的认购、申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站予以公告或书面通知基金投资者。

基金管理人及其委托的代销机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件等方式，向不特定对象宣传推介。若基金管理人明确约定本基金购买人范围的，代销机构不能超出基金管理人确定的购买人范围销售金融产品。

（二） 认购、申购和赎回的时间

1、基金投资者可在募集期内的工作日认购本基金。本基金的初始销售期由私募基金管理人自行决定，基金管理人有权根据本基金销售的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时在基金管理人或代销机构网站专区公告，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

2、 申购和赎回的开放日和时间

本基金每个交易日开放申购与赎回，受理截至开放日当日 15:00，超过 15:00 的于下一个交易日受理。基金投资者可在本基金的开放日申购和赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知基金份额持有人。基金管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

3、 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

在基金合同变更、基金展期等情况下，为保障投资者选择退出基金的权利，管理人有权设置临时开放期开放份额退出。具体以管理人公告为准。管理人在网站上发布公告即视为履行了告知义务。临时开放期不受本条第 2 款的限制。

（三）出资方式及认缴期限

本基金不接受现金申购，存续期间开放，基金投资者认购、申购本基金，以人民币转账形式交付。

基金投资者通过直销机构或代销机构认购本基金的，应在募集期内将认购资金汇入基金管理人开立或指定的用于销售结算资金归集目的的私募基金募集结算专用账户或按代销机构的规定缴付认购份额所需资金。

基金投资者通过直销机构或代销机构申购本基金的，应在申购有效期（T-n 日至 T 日）内将申购资金汇入私募基金募集结算专用账户或按代销机构的规定缴付认购份额所需资金。

基金管理人和代销机构应当将募集期间募集的投资者资金存放于私募基金募集结算专用账户。该账户由本基金的行政服务机构负责开立，由海通证券股份有限公司进行监督。该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购、赎回、分红、费用等资金的归集与支付以及基金财产清算过程中剩余资产的归集与分配。在基金募集行为结束之前，任何机构和个人不得动用。

本基金募集结算专用账户信息请参见投资者告知书。

基金投资者赎回本基金或者基金终止，基金管理人应确保投资者退出资金返回到认（申）购资金打款账户，即同进同出。客户变更银行卡，或者非交易过户的，提供相关银行及第三方机构证明，可变更收款账户。

（四）认购、申购和赎回的方式、价格及程序

1、基金投资者认购时，按照面值（人民币 1.00 元）认购，申购及赎回按“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以开放日当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、基金认购、申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。

3、基金投资者赎回基金时，基金管理人按先进先出的原则，按基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行顺序赎回。

4、认购申请一经受理，不得撤销。当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的当日开放时间以内撤销，在当日开放时间结束后不得撤销。投资冷静期按其具体条款约定执行。

（五）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的开放日作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，注册登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

（六）认购、申购和赎回的金额限制

投资者在私募基金存续期开放日购买私募基金份额的,首次购买金额应不低于 100 万元人民币(不含认/申购费)且符合合格投资者标准,已持有本私募基金份额的投资者在资产存续期开放日追加购买基金份额的,每次追加的金额应不低于 10 万元且为 5 万元的整数倍(不含申购费)。

投资者持有的基金资产净值高于 100 万元时,可以选择部分赎回基金份额,投资者在赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元,投资者申请赎回基金份额时,其持有的基金资产净值低于 100 万元的,必须选择一次性赎回全部基金份额,投资者没有一次性全部赎回持有份额的,管理人应当将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理。投资者赎回时单笔赎回份额不低于 5 万份且为 5 份的整数倍(全部赎回除外)。

《私募办法》第十三条列明的投资者可不适用本项。

管理人可根据市场情况,合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制,管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日告知投资者及注册登记机构。管理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

(七) 认购、申购和赎回的费用

1、认购、申购费用

本基金认购费率为 0.5%, 归基金管理人。

本私募基金采取金额申购的方式,以现金形式交付,并采用前端收费模式,本私募基金的申购费率为 0.5%, 归基金管理人。

2、赎回费用

赎回费用: 本基金份额持有期不足【12 个月】的赎回, 赎回费费率为【1%】, 本基金份额持有期满【12 个月】的不收取赎回费。本基金赎回费归基金管理人所有。

3、本基金红利再投份额不收取申购费、赎回费。

4、私募基金管理人可以视市场情况调整申购费率、赎回费率或调整收费方式,并提前告知私募基金投资者(在基金管理人网站予以公告视为已履行告知义务)。

(八) 认购、申购份额与赎回金额的计算方式

1、认购份额计算

认购份额=认购金额÷面值

认购份额保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位舍去, 由此产生的误差计入基金财产。

2、申购份额计算

申购份额=申购金额÷开放日的基金份额净值

申购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位舍去，由此产生的误差计入基金财产。

3、赎回金额计算

赎回金额=赎回份数×赎回价格-业绩报酬（若有）

赎回价格为开放日当日的单位基金份额净值。

赎回金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

（九）申购和赎回的预约申请方式

1、直销预约程序

（1）基金投资者拟于开放日（T 日）申购基金时，应于 T-4 日至 T 日之间填写基金管理人提供的申请表进行申购预约登记，并将申请表以传真、扫描后发送电子邮件或者邮寄的方式送达基金管理人处。预约登记成功以基金投资者已签署基金合同并且申购资金到达销售结算资金归集账户为准，或基金管理人认可的其他方式。

基金投资者于 T 日前将申购资金汇入销售结算资金归集账户的，申购资金在销售结算资金归集账户产生的利息计入基金资产。

（2）基金投资者拟于开放日（T 日）赎回基金时，应填写基金管理人提供的申请表进行赎回登记，并将申请表以传真、扫描后发送电子邮件或者邮寄的方式送达基金管理人处。

2、代销预约程序

基金投资者通过代销机构申购、赎回本基金时，预约程序以基金管理人和代销机构约定的方式为准。

（十）本基金给予投资者的投资冷静期为 24 小时，投资冷静期自本合同签署完毕且投资者交纳认购/申购基金的款项后起算。

（十一）募集机构应当在投资冷静期满后，指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。回访应当包括但不限于以下内容：

- （1）确认受访人是否为投资者本人或机构；
- （2）确认投资者是否为自己购买了该基金产品以及投资者是否按照要求亲笔签名或盖章；
- （3）确认投资者是否已经阅读并理解基金合同和风险揭示的内容；
- （4）确认投资者的风险识别能力及风险承担能力是否与所投资的私募基金产品相匹配；
- （5）确认投资者是否知悉投资者承担的主要费用及费率，投资者的重要权利、私募基金信息披露的内容、方式及频率；
- （6）确认投资者是否知悉未来可能承担投资损失；

(7) 确认投资者是否知悉投资冷静期的起算时间、期间以及享有的权利;

(8) 确认投资者是否知悉纠纷解决安排。

基金委托人在投资冷静期届满前有权解除本合同。委托人在该情形下解除其与管理人、托管人签订的基金合同,不影响本基金的运作,不会导致本基金的清算。出现前述情形时,募集机构应当及时退还投资者的全部认购/申购款项。投资冷静期届满前,投资者缴纳的认购/申购基金款项不得由销售结算专用账户划转到基金财产账户或托管资金账户,私募基金管理人不得投资运作投资者缴纳的认购/申购基金款项。

(十二) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情形下,基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请:

(1) 根据市场情况,基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;

(2) 因基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因,使基金管理人认为短期内接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形;

(3) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形;

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝接受某些基金投资者的申购申请时,申购款项将退回基金投资者账户。

2、在如下情形下,基金管理人可以暂停接受基金投资者的申购申请:

(1) 因不可抗力导致无法受理基金投资者的申购申请的情形;

(2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形;

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形;

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时,应当以公告的形式告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理并以公告的形式告知基金投资者。

3、在如下情形下,基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的赎回申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形;

(2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的

情形；

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；

(4) 基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的，基金管理人应当以公告形式告知基金份额持有人。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回金额占已接受的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人，其余部分在【10个工作日内】予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并以公告形式告知基金份额持有人。

(十三) 巨额赎回的认定及处理方式

1、 巨额赎回的认定

在一次开放周期内，本基金需处理的基金净赎回申请份额超过本基金当期最后一个开放日基金总份额的【20%】时，即认为本基金发生了巨额赎回。

2、 巨额赎回的处理方式

发生巨额赎回时，管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延期支付：
全额赎回：当管理人认为有条件支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序办理。

延期支付：当管理人认为支付投资者的赎回申请可能会对基金资产净值造成较大波动时，管理人对巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过20个工作日。延期支付赎回款项的赎回价格为基金份额持有人申请赎回开放日的基金份额净值。延期支付的赎回款项不支付利息。

3、 巨额赎回延期支付的通知：当发生巨额赎回并且基金管理人决定延期支付时，基金管理人应当在基金管理人或代销机构网站专区以公告的方式通知基金份额持有人。

七、当事人及权利义务

(一) 基金份额持有人

1、基金份额持有人概况

基金投资者签署本合同，履行出资义务并取得基金份额，符合规定的私募基金合格投资者的条件，即成为本基金份额持有人。基金份额持有人的详细情况在合同签署页列示。

2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金份额；
- (4) 投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时，募集机构应当按合同约定及时退还投资者的全部认购款项；
- (5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (6) 按照本合同约定的时间和方式获得基金的运作信息资料；
- (7) 基金设定为均等份额，除基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每份基金份额具有同等的合法权益；
- (8) 因私募基金管理人、私募基金托管人违反法律法规或基金合同的约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (9) 根据基金合同的约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；
- (10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

4、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读并遵守本合同；
- (2) 按照基金合同约定缴纳购买基金份额的认购、申购款项，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- (3) 按照基金合同约定承担基金的投资损失；
- (4) 接受合格投资者确认程序，如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者；承诺其资质、资金来源、投资行为没有任何法律法规、已生效或即将生效的合同、协议、承诺等方面的障碍，并于此承诺就其违反本款规定给管理人、基金托管人造成的损失承担全面、及时、恰当的赔偿责任；

(5) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于私募基金的，应向私募基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《私募办法》第十三条规定的除外；

(6) 认真阅读并签署风险揭示书

(7) 向基金管理人或募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其募集机构就基金投资者风险承受能力、反洗钱等事项进行的尽职调查；

(8) 保守商业秘密，不得泄露私募基金的投资计划或意向等

(9) 不得违反本合同的规定干涉管理人的投资行为；

(10) 不得从事任何有损基金及其他基金投资者、管理人管理的其他资产及基金托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(11) 确保投资资金来源合法，不得非法汇集他人资金投资私募基金；

(12) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 基金管理人

1、基金管理人概况

名称：东航私募基金管理有限公司

住所：上海市闵行区吴中路 686 弄 3 号

法定代表人：钟中

联系人：江映秋

联系电话：021-23502737

2、基金管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，在约定范围内独立管理和运用基金财产；

(2) 依照本合同的约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬(若有)；

(3) 依照有关规定和基金合同约定行使因基金财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督基金托管人；对于基金托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对基金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。

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对募集机构的销售行为进行必要的监督；

(6) 自行办理或者委托第三方机构进行注册登记、估值核算及信息披露等业务，对第三方机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(7) 为保护投资者权益，可以在法律法规规定范围内，根据市场情况对本基金的认购、申购业务规则(包括但不限于基金总规模、单个基金投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制等)进行调整；

(8) 基金管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，基金管理人应及时通知基金份额持有人；

(9) 除法律法规另有规定的情况外，基金管理人对于因基金托管人过错造成的基金财产损失不承担责任；

(10) 以基金管理人的名义，代表私募基金与其他第三方签署基金投资相关协议文件、行使诉讼权利或者实施国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

(11) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

(1) 根据基金业协会要求进行登记，并办理基金的备案手续；

(2) 按规定开设或指定基金的销售结算资金归集账户；按证券、期货备忘录开设和注销基金的证券交易资金账户、期货交易资金账户等投资所需账户；

(3) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理履行受托人义务，在合同约定范围内管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业能力的人员进行本基金的投资监督；

(5) 未经回访确认成功，投资者缴纳的认购、申购基金款项不得由募集账户划转到基金财产账户或托管资金账户，基金管理人不得投资运作投资者缴纳的认购、申购基金款项；

(6) 建立健全内部制度，保证所管理的基金财产与其管理的其他基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账、分别投资；

(7) 不得利用基金财产或者职务之便，为本人或者投资者以外的人牟取利益，进行利益输送；

(8) 自行担任或者委托其他机构担任基金的基金份额登记机构，委托其他基金份额登记机构办理注册登记业务时，对基金份额登记机构的行为进行必要的监督；

(9) 按照本合同的约定接受基金投资者和基金托管人的监督；

(10) 以基金管理人的名义，代表基金投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(11) 根据法律法规和本合同的规定，编制基金年度报告等报告，并向基金投资者进行披露；

(12) 计算基金份额净值，并向基金投资者进行披露；

- (13) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (14) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外；
- (15) 保存基金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，保存期限自私募基金清算终止之日起不得少于 10 年；
- (16) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动；
- (17) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (18) 按照基金合同约定及时向托管人提供非证券类资产凭证或股权证明(包括股东名册和工商部门出具并加盖公章的权利证明文件)等重要文件；
- (19) 按照基金合同的约定确定私募基金收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (20) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (21) 建立并保存投资者名册；
- (22) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国基金业协会并通知私募基金托管人和基金投资者；
- (23) 自主履行或委托销售机构履行反洗钱管理的相关义务；
- (24) 不参与非法配资活动。除经中国证监会批准外，未参与其他客户或第三方融资、融券等相关事宜；未参与场外配资活动；
- (25) 未参与内幕交易、操纵市场、规避信息披露义务及其他不正当交易的活动等；未为其他外部机构或者个人非法从事证券活动提供便利；不存在与海通证券进行利益输送或者商业贿赂的情况；不存在其他违法违规行为；
- (26) 严禁管理人及其实际控制人、股东、关联方或本基金代理销售机构在营销过程中利用托管人声誉就本产品资金安全性、本产品盈利能力等方面向委托人做出任何承诺，不得向投资者承诺最低收益、承诺本金不受损失、或限定损失金额和比例，如托管人通过任何途径知悉有此情形，本合同自动作废，项目终止，由此产生的委托人、托管人损失由管理人承担；
- (27) 管理人不得通过设置增强资金、费用返还等方式调节基金收益或亏损，不得以自有资金认购的基金份额先行承担亏损的形式提供风险补偿，变相保本保收益。
- (28) 管理人承诺每只私募基金的单独管理、单独建账、单独核算，不得开展或者参与

任何形式的资金池业务，不得存在短募长投、期限错配、分离定价、滚动发行、集合运作等违规操作。

(29) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人

1、基金托管人概况

名称：海通证券股份有限公司

住址：上海市黄浦区广东路 689 号第 30 层第 3002 室单元

法定代表人：周杰

授权代理人：凌如水

联系人：张贞妮

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

2、基金托管人的权利

(1) 按照本合同的约定，及时、足额获得托管费；

(2) 根据本合同及其他有关规定，监督管理人对基金财产的投资运作，对于管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对基金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、基金业协会等监管机构并采取必要措施；

(3) 按照本合同的约定，依法保管基金财产；

(4) 除法律法规另有规定的情况外，基金托管人对因基金管理人过错造成的基金财产损失不承担责任；

(5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 按规定开设和注销基金的托管资金专门账户、证券账户、期货账户等账户；

(6) 复核基金份额净值；

- (7) 办理与基金托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 复核基金定期报告，将复核结果书面通知基金管理人，并定期出具书面意见；
- (9) 按照本合同的约定，根据基金管理人的投资指令，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，保存基金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基金财产，不得从事任何有损基金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要求外，不得向他人泄露本基金的有关信息；
- (13) 根据相关法律法规要求的保存期限，保存私募基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料；
- (14) 根据法律法规及本合同的规定监督基金管理人的投资运作，基金托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律、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，立即通知管理人，并向中国证监会和基金业协会报告；基金托管人发现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，应当立即通知管理人；
- (15) 按照私募基金合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。基金托管人根据上述约定独立履行相关义务，与基金管理人不构成共同受托人。

八、基金份额持有人大会及日常机构

（一）基金份额持有人大会的组成

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（二）基金份额持有人大会的召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）决定本基金采取非现金资产方式进行分配；

（2）基金管理人客观上丧失继续管理私募基金的能力时，由基金份额持有人大会接管基金的运营，决定是否更换基金管理人或对基金进行清算，在此期间基金托管人应保障基金财产安全，根据基金份额持有人大会有效决议进行资金的划付；

（3）单独或合计持有本基金总份额 20%以上（含 20%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（4）法律法规、本合同或监管部门规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、当出现或需要决定下列事由之一，基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会直接作出决议，并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章：

（1） 决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；

（2） 决定延长基金合同期限；

（3） 决定更换基金管理人、基金托管人；

（4） 决定调高基金管理人、基金托管人和行政服务机构的收费标准；

（5） 调整基金止损线、预警线；

（6） 决定调高申购、赎回费率；

（7） 法律法规、本合同或监管部门规定的其他情形。

（三）基金份额持有人大会日常机构

1、基金份额持有人大会日常机构职权

基金份额持有人大会可以设立日常机构，行使下列职权：

（1） 召集基金份额持有人大会；

（2） 提请更换基金管理人、基金托管人；

- (3) 监督基金管理人的投资运作、基金托管人的保管活动;
- (4) 提请调高基金管理人、基金托管人和行政服务机构的收费标准;
- (5) 基金合同约定的其他职权。

2、 基金份额持有人大会日常机构的人员构成应当由基金份额持有人大会选举产生。基金份额持有人大会及其日常机构不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。

(四) 基金份额持有人大会的召集

1、 基金份额持有人大会由基金管理人或基金份额持有人大会日常机构召集;

2、 代表基金份额 20%以上(含 20%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 30 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 20%以上(含 20%)的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人应当予以配合,不得阻碍、干扰。

(五) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

召开基金份额持有人大会,召集人最迟应于会议召开前 10 个工作日通知全体基金份额持有人,基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式;
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;
- (3) 授权委托书的内容要求(包括但不限于授权代表身份、代理权限和代理有效期限等)、送达的期限、地点;
- (4) 会务联系人姓名、电话及其他联系方式;
- (5) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (6) 召集人需要通知的其他事项。

3、 采取通讯方式开会并进行表决的情况下,由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

(六) 召开方式、会议方式

- 1、 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2、 现场开会由基金份额持有人亲自或委派授权代表出席,现场开会时基金份额持有人

的授权代表应当出席。基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式应采用书面方式。

3、通讯方式开会应当以书面方式进行表决；基金份额持有人出具书面表决意见并送达给基金管理人的，视为出席了会议。

（七）基金份额持有人大会召开条件

1、现场开会

代表基金份额持有人大会召开日基金总份额 2/3 以上（含 2/3）的基金份额持有人或代表出席会议，现场会议方可举行。未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并通知重新开会的时间。

2、通讯方式开会

出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总份额占基金份额持有人大会召开日基金总份额 2/3 以上（含 2/3）的，通讯会议方可举行。

（八）表决

1、议事内容：基金份额持有人大会不得对事先未通知的议事内容进行表决。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、基金份额持有人大会决议（包括变更基金管理人的基金份额持有人大会决议）须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（九）基金份额持有人大会决议的效力

基金管理人召集的基金份额持有人大会决议，自基金份额持有人大会通过并由基金份额持有人签署后生效，并自生效之日起对全体基金份额持有人、基金管理人均有约束力。

基金份额持有人大会日常机构召集的基金份额持有人大会决议自通过之日起，对全体基金份额持有人有约束力；该等决议内容通知至基金管理人之日起，对基金管理人有约束力。

（十）基金份额持有人大会决议的披露

基金份额持有人大会决定的事项，应通过书面通知、电子邮件、传真等形式通知全体基金份额持有人和其他相关当事人。

（十一）基金份额持有人不同意基金份额持有人大会决议的，基金管理人应在决议函（或通知）指定的日期内增设临时赎回开放日，允许不同意决议的基金份额持有人赎回本基金；基金份额持有人未在指定的日期内赎回本基金的，视为基金份额持有人同意基金份额持有人大会决议。

(十二) 本基金存续期间，上述关于基金份额持有人大会召开事由、召集、召开条件、议事程序、表决条件、决议的效力、决议的披露等规定，凡是直接引用法律法规或监管部门规定的部分，如将来法律法规或监管部门的规定修改导致相关内容被取消或变更，或者相关部分与届时有效的法律法规或监管部门的规定相冲突，则基金管理人可直接对本部分的相关内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

东航金融

九、基金份额的登记

(一) 本基金份额的注册登记业务指本基金的登记、存管、清算和交收业务，具体内容
包括基金投资者账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管基金客
户资料表等。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他机构办理。基金管
理人委托其他机构代为办理本基金注册登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议，并
列明代为办理基金份额登记机构的权限和职责。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

1、建立和保管基金投资者账户资料、交易资料、基金客户资料表等，并将客户资料表
提供给基金管理人。

2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务。

3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务。

4、严格按照法律法规和本基金合同规定计算业绩报酬（若有），并提供交易信息和计
算过程明细给基金管理人。

5、收益分配以及基金份额变动的计算

6、接受基金管理人的监督。

7、按照法律法规的要求，保存基金投资者资料表及相关的申购和赎回等业务记录。

8、对基金投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对基金投资者或基金带
来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

9、按本基金合同，为基金投资者提供基金收益分配等其他必要的服务。

10、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

11、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。

(五) 基金管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除

全体基金份额持有人同意私募基金管理人、份额登记机构按照中国基金业协会的规定办
理基金份额登记数据的备份。

十、基金的投资

（一）投资目标：

通过积极投资股指期货、商品期货和国债期货等，灵活采用多种投资策略，以实现较高收益。

（二）投资范围：

1、投资范围

固定收益品种（包括债券、央行票据、短期融资券、中期票据、资产支持证券（不含劣后级份额）等）、股指期货、商品期货、国债期货、国内依法发行上市的股票、公募证券投资基金、ETF、现金及银行存款、私募基金管理人（协会登记）发行的基金产品及资产管理计划（不含劣后级份额）等。

基金管理人可运用私募基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、投资超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等管理人之外的因素导致本基金投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人不承担责任，但应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。

本基金的实际投向如有改变，应先行取得投资者书面同意。本合同各方当事人同意，以下情况管理人有权单方决定而无需另行取得投资者同意，且不视为违反本合同约定的投向、比例及风险收益特征：（1）在本基金成立后备案完成前，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种；（2）符合法律法规及本合同约定的建仓期投资活动；（3）触及本基金预警线和止损线而进行的平仓变现（若有）；（4）为应付巨额退出而进行的平仓变现；（5）本基金终止前1个月及清算期内，为财产变现需要而进行的操作；（6）符合法律法规或本合同约定的其他情形。

（三）投资策略：

1、固定收益投资策略

基金管理人基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，运用利率预期、收益率曲线预测等策略，通过数量分析构造有效的债券投资组合。

2、股票投资策略

基金管理人采取谨慎、稳健的投资管理策略，通过自下而上地精选具有显著行业地位的、或因基本面重大变化而预期高速成长的、或契合市场投资主题等三类公司股票构建投资组合，力求获取较优回报。

3、股指期货投资策略

本基金股指期货投资将采用定量与定性相结合的投资策略。基于定性策略，基金管理人将对资本市场的整体投资机会做出基本判断；基于定量策略，基金管理人主要根据股指的历史走势，通过对股指趋势判断，买卖股指期货。同时基金管理人将结合市场估值策略及趋势反转策略，增强或降低做空或做多的动能，增强投资策略的灵活性。

4、商品期货投资策略

同股指期货投资策略。

5、国债等期货策略

同股指期货投资策略。

（四）投资限制

1、本基金不设预警线、止损线。

2、投资比例限制

（1）本基金参与股票发行申购时，所申报的金额不得超过本基金总资产的 40%，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票规定的可申购上限。

（2）股票、股票型基金、ETF 总金额（按照成本计）不得超过本基金资产总额的 40%。

（3）本合同生效后的两个月内，投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 60%；

1) 当 基金份额净值 ≥ 1.30 元，投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 80%；

2) 当 $1.10 \text{ 元} \leq \text{基金份额净值} < 1.30$ 元，投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 70%；

3) 当 $0.95 \text{ 元} \leq \text{基金份额净值} < 1.10$ 元，投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 60%；

4) 当 $0.90 \text{ 元} \leq \text{基金份额净值} < 0.95$ 元时，投资股指期货、商品期货和国债期货等合

计的保证金不得超过基金财产净值的 40%;

5) 当 $0.85 \text{ 元} \leq \text{基金份额净值} < 0.90 \text{ 元}$ 时, 投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 30%;

6) 当基金份额净值 $< 0.85 \text{ 元}$ 时, 投资股指期货、商品期货和国债期货等合计的保证金不得超过基金财产净值的 20%;

期货仓位控制由基金管理人负责执行, 基金托管人不对此进行监督。

(4) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策, 为被动超标。发生上述情形时, 基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个工作日内进行调整, 以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

3、特定风险下的比例超限

本基金存续期间, 在为规避特定风险, 投资者同意: 可突破上述第 2 点的投资比例限制, 但不得持续 6 个月不符合。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的, 从其规定。

(五) 投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为:

- 1、承销证券;
- 2、向他人贷款或提供担保;
- 3、从事承担无限责任的投资;
- 4、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
- 5、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资禁止政策, 为被动超标。发生上述情形时, 管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个工作日内调整完毕, 以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

(六) 管理人可运用基金财产买卖管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券, 但需要遵循基金投资者利益优先的原则、防范利益冲突。

(七) 在特殊情况下 (包括但不限于极端行情时, 但因市场原因无法平仓的), 基于保护份额投资人利益的目标, 基金管理人有权进行合理的对冲操作以避免损失进一步扩大, 由

此产生的一切损益由基金财产承担，管理人不承担责任。

东航金融

十一、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

委托财产投资经理由基金管理人负责指定。

基金管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，基金管理人应及时通知基金投资者及基金托管人。

本私募基金的投资经理为沈航先生。

投资经理简历：

沈航，金融学学士，上海交通大学上海高级金融学院 MBA 在读，CFA 持证人。现任东航私募投资经理。擅长量化策略研究和组合投资管理。

（二）投资经理的变更

基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知基金投资者。（基金管理人在其网站、募集机构网站公告或书面通知基金投资者前述事项即视为履行了告知义务）。

十二、基金的财产

（一）基金财产的保管与处分

1、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金托管人对实际交付并控制下的基金财产承担保管职责，对于非基金托管人保管的财产不承担责任。基金托管人仅负责保管本基金项下托管资金账户内的资金，对于除此之外的本基金项下的其他基金财产，由基金管理人保管相关财产或财产权利凭证的，基金管理人应当自行安全保管，基金托管人不承担保管责任。基金托管人依据基金管理人的划款指令将委托资金划出托管资金账户后至委托财产相关投资本金及收益以现金形式划回托管资金账户期间，基金托管人不再承担资金或资产的保管职责。

2、除本款第3项规定的情形外，基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归属基金财产。

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

4、基金管理人、基金托管人不得违反法律法规的规定和基金合同约定擅自将基金资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

5、基金财产产生的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，基金管理人、基金托管人不得主张其债权人对基金财产强制执行。上述债权人对基金财产主张权利时，基金管理人、基金托管人应明确告知基金财产的独立性。

6、对于本基金的投资事宜，根据相关法律规定，可能出现基金管理人代表本基金签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续等情况，基金托管人对于因此而产生的风险或损失不承担责任。

7、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日期届满基金应收资产没有到达基金托管资金账户的，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

（二）基金财产相关账户的开立和管理

基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户，基金管理人应给予必要的配合。证券账户等投资所需的持有人名称应当符合证券登记结算机构等机构的有关规定。证券账户存续期限应当符合证券登记结算机构等机构的有关规定。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金募集机构和基金份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

1、基金募集期间的账户开立及管理

（1）基金初始销售期间募集的资金应存于“私募基金募集结算专用账户”。该账户由基金管理人开立或指定，并由基金管理人管理或委托募集机构管理。

（2）基金初始销售期满或停止初始销售时，初始销售后的基金金额、基金投资者人数符合相关法律法规的有关规定后，基金管理人将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的托管资金专门账户。

（3）若基金初始销售期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

2、托管资金专门账户的开立和管理

（1）基金托管人可以基金的名义在商业银行开立基金的资金账户，具体账户名称以实际开立账户为准，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。托管人为本托管资金专门账户开立网上银行，网上银行的电子密钥和密码由托管人保管和使用。

（2）托管资金专门账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和管理人不得假借本基金的名义开立任何其他资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。除法律法规另有规定外，管理人、托管人、基金投资者均不得采取使得该账户无效的任何行为。

（3）托管资金专门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。

3、基金证券账户的开立和管理

（1）基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金证券账户，具体账户名称以实际开立账户为准。

（2）基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和

运作由管理人负责。

(4) 若相关监管机构在本合同生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

(5) 基金证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

4、证券交易资金账户的开立和管理

证券交易资金账户是以基金名义在基金管理人选择的证券公司的下属营业机构开立的，基金管理人、证券经纪商应协助托管人将该账户与托管资金专门账户建立第三方存管关系，如因管理人、证券经纪商原因致使对应关系无法建立，托管人不承担任何责任。

在本合同有效期内，管理人应将证券交易资金账户资金密码交付托管人保管与使用。由基金托管人根据基金管理人有效划款指令通过银证转账的方式完成证券交易资金账户与托管资金专门账户间的资金划付。管理人不得使用资金密码。未经托管人同意，管理人不得修改资金密码或注销该证券交易资金账户（本基金终止除外）。

5、期货账户的开立和管理

(1) 基金管理人应当代表本基金，按照中国期货保证金监控中心及期货备忘录的要求，开立期货交易资金账户，在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所获取交易编码。期货交易资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

(2) 本基金的管理人授权托管人选择具有期货保证金存管资格的商业银行办理相关银期转账业务。

(3) 在本合同有效期内，管理人应将期货交易资金账户的资金密码交付托管人保管与使用。由基金托管人根据基金管理人有效划款指令通过银期转账的方式完成期货交易资金账户与托管资金专门账户间的资金划付。管理人不得使用资金密码。未经托管人同意，管理人不得修改资金密码或注销该期货交易资金账户（本基金终止除外）。

6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。开立的上述基金财产账户应与私募基金管理人、私募基金托管人、私募基金募集机构和私募基金份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。未经托管人同意，管理人变更、解除与托管资金账户之间的关联关系或增设其他关联账户给基金财产造成损失的，托管人不承担任何责任。对于非由基金托管人开立、管理并实际控制的账户，基金托管人不承担任何形式的职责。

(2) 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。

十三、指令的发送、确认与执行

(一) 基金管理人发送指令人员的书面授权

基金管理人应向基金托管人提供资金划拨授权书（简称“授权书”），授权书中应包括被授权人的名单、电话、传真、预留印鉴和签字样本，规定基金管理人向基金托管人发送指令时基金托管人确认有权发送指令人员身份的方法。授权书由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。基金托管人在收到授权书当日向基金管理人确认。授权书须载明授权生效日期，授权书自载明的生效日期开始生效。基金托管人收到授权书的日期晚于载明生效日期的，则自基金托管人收到授权书时生效。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

(二) 指令的内容

指令是在管理基金财产时，基金管理人向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章，并按照托管人要求向托管人提供加盖基金管理人预留印鉴的相关附件，如合同各方已签字盖章完成的信托计划合同、资产管理计划合同等与本基金投资品种有关的合同协议等。

(三) 指令的发送、确认和执行的时间及程序

指令由授权书确定的被授权人代表基金管理人用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发送。基金管理人负有义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。传真以获得收件人（基金托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因基金管理人未能及时与基金托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，基金托管人不承担责任。基金托管人依照授权书规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权书发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令所必需的时间。由基金管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个工作日的 13:00 以后接收基金

管理人发出的银证转账、银期转账划款指令的，基金托管人不保证当日完成划转流程；在每个工作日的 14:30 以后接收基金管理人发出的其他划款指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对传真划款指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，基金托管人立即与基金管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求基金管理人重新发送经修改的指令。基金托管人可以要求基金管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保托管资金专门账户及其他账户有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，并立即通知基金管理人，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

（四）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知基金管理人纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，由此造成的损失由基金管理人承担。

（五）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。基金托管人在履行监督职能时，发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。

（六）更换被授权人的程序

基金管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前使用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发出由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署的被授权人变更授权书，并提供新被授权人签字样本，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到变更授权书当日通过电话向基金管理人确认。被授权人变更授权书须载明新授权的生效日期。被授权人变更授权书自载明的生效时间开始生效。基金托管人收到变更授权书的日期晚于载明的生效日期的，则自基金托管人收到时生效。基金管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本送交基金托管人。被授权人变更授权书生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，基金管理人不承担责任。

(七) 指令的保管

指令若以传真形式发出，则正本由基金管理人保管，基金托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以基金托管人收到的投资指令传真件为准。

(八) 相关责任

基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但托管资金专门账户及其他账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，基金托管人不承担因正确执行有关指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由基金管理人承担，但基金托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

十四、交易及清算交收安排

（一）选择证券、期货经纪机构的程序

基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪机构、期货经纪机构，并与其签订证券经纪合同、期货经纪合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构、期货经纪机构可就基金参与证券交易、期货交易的具体事项另行签订协议。

（二）投资证券、期货后的清算交收安排

（1）本基金通过证券经纪机构、期货经纪机构进行的交易由证券经纪机构、期货经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。

（2）证券交易所证券资金结算

基金托管人、基金管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理本基金财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。

（3）期货交易所期货资金结算

基金管理人应遵守期货交易所制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

管理人在投资前，应充分知晓与理解期货交易所针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

期货经纪机构代理本基金财产与期货交易所完成期货交易涉及的期货资金结算业务，并承担由期货经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。

（4）对于任何原因发生的证券资金、期货资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决，协商不成的，按照另行签订的协议处理。

（三）资金、证券、期货账目及交易记录的核对

基金管理人和基金托管人定期对资产的证券账目、期货账目、实物券账目、交易记录进行核对。

（四）申购或赎回的资金清算

1、T 日，基金投资者进行申购或赎回申请。T+1 日，基金管理人和基金托管人分别计算 T 日基金资产净值、基金份额净值，并进行核对；基金管理人向注册登记机构发送基金资产净值、基金份额净值。

2、T+1 日，注册登记机构按照本合同约定计算申购份额或赎回金额，更新基金投资者数据库；并将确认的申购或赎回汇总数据向基金托管人传送。基金管理人、基金托管人根据确认数据进行账务处理。

3、基金投资者赎回申请确认后，基金管理人将在 T+7 日(包括 T+7 日)内支付赎回款项。(基金托管人根据基金管理人的赎回款项划款指令进行划款，将赎回款项划往基金管理人指定的份额登记机构，并由份额登记机构将赎回款项划入基金份额持有人的指定资金账户或代销机构指定的资金账户)。

4、基金管理人应对注册登记数据的准确性负责。基金托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据基金管理人指令及时划付赎回款项。托管人负责将赎回及转出款项至基金管理人开立的基金销售结算资金归集账户，基金管理人负责将收到的款项继续向各基金委托人分配。

十五、越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下基金投资者的授权而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用基金财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

基金托管人对管理人的投资行为行使监督权。基金托管人根据本合同约定，对本基金的投资范围及投资比例在投资监督系统可见范围内进行监督。

（二）越权交易的处理程序

1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

基金托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人并有权及时报告中国证监会、中国基金业协会等监管机构。

基金托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人并有权及时报告中国证监会、中国基金业协会等监管机构。

管理人应向基金投资者和基金托管人主动报告越权交易。在限期内，基金投资者和基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对基金投资者和基金托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会、中国基金业协会等监管机构。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

基金托管人在行使监督职能时，如果发现基金财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给基金托管人及基金财产造成的损失由管理人承担。如果因非基金托管人的原因发生超买行为，管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，确保完成清算交收。

3、因证券市场波动等管理人之外的因素致使基金投资不符合法律法规规定的比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内调整完毕，法律法规另有规定的除外。

4、因管理人的原因发生的越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，因托管人的原因发生的越权交易所发生的损失及相关交易费用由基金托管人负担，非因管理人、

托管人的原因发生的越权交易所发生的损失及相关交易费用由本基金财产负担,所发生的收益归本基金财产所有。

东航金融

十六、基金财产的估值和会计核算

（一）基金财产的估值

1、估值目的

基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额申购、赎回提供计价依据。

2、估值时间

基金管理人与基金托管人在 T+1 日对 T 日基金财产进行估值核对。

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》以及证券投资基金的行业规范。

4、估值对象

基金所拥有的债券、权证、基金、其他衍生工具和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

5、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

C、交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘

价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券、私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

C、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确认公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 期货合约权益的估值方法：期货合约品种按照估值基准日相关期货交易所公布的对应合约当日结算价及相关规则进行估值。估值基准日无交易的，以估值基准日前的最近一个交易日的结算价进行估值。

(5) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(7) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(8) 对于基金管理公司及其子公司的特定资产管理计划、证券公司集合资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、信托计划、私募证券投资基金，估值方式具体如下：

1) 如在标的产品权益确认日当天收到了标的产品权益确认原始凭证的，则在标的产品权益确认日当天以权益确认原始凭证为依据入账；如无法在权益确认日当天提供收到标的产品的权益确认原始凭证的，则以收到标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整；

2) 按份额净值计价的投资标的, 按照标的产品的最新份额净值估值, 未提供最新份额净值的, 以最近一次得到的标的产品份额净值进行估值;

3) 本基金管理人可选择使用标的产品的“虚拟份额净值”(即份额净值扣除预估业绩报酬后得到的份额净值)对本基金进行估值。

4) 按面值及每万份收益计价的投资标的, 以成本列示, 按标的产品公布的最新每万份收益计提收益。

5) 如不属于上述情况的, 则管理人可与托管人协商一致, 按最能反映该投资标的公允价值的方法估值。

(9) 基金持有的衍生工具等其他有价证券, 上市交易的按估值日的收盘价估值; 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值; 未上市交易的, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下, 按成本估值; 停止交易、但未行权的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。

(10) 银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息, 在利息到账日以实收利息入账。

(11) 若本基金进行收益互换或场外期权等场外衍生品投资的, 根据交易对手或第三方提供的估值基准日估值报告进行估值。第三方或交易对手无法提供估值报告的, 按成本估值。基金管理人应确保在本基金每个开放日对应的估值日内向基金托管人提供交易对手或第三方出具的最新估值报告。如果不属于上述情况的, 则基金管理人应向基金托管人提供标的产品的估值方法和估值数据, 并确保提供数据的真实、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。

(12) 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, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

(13) 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。

如基金管理人或基金托管人发现基金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基金投资者利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 因此, 就与本基金有关的会计问题, 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, 以基金管理人对基金资产净值的计算结果为准。如以基金管理人计算或确认的结果对外公布, 基金管理人应在单方面对

外公告基金份额净值计算结果时注明未经基金托管人复核，而基金托管人有权将有关情况向中国证监会报告，由此给基金投资者和基金造成的损失，由基金管理人承担相应责任。

6、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式或者双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。基金管理人与基金托管人基金日常估值核对的程序如有其它约定的，在合法合规的情况下，可从其约定执行。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

7、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生计算错误时，视为估值错误。

本合同的当事人应按照以下约定处理：

（1）估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、证券交易所、期货交易所、注册登记机构、募集机构或基金投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，按如下估值错误处理原则和处理程序执行。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由于不可抗力造成基金投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

（2）估值错误处理原则

A、如基金管理人或基金托管人发现基金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，导致基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生计算错误时，应立即通知双方，共同查明原因，协商解决；

B、估值错误的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的直接当事人的直接损失承担赔偿责任；估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

C、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务；

D、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；

E、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准；

F、基金管理人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

G、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

(3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

A、基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

B、当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生计算错误时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法，对估值错误进行处理；

D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

8、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易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基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(4) 中国证监会、中国基金业协会等监管机构认定的其他情形。

9、基金份额净值计算

$$T \text{ 日基金份额净值 } NAV_T = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金份额总数}$$

基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入私募基金财产。基金管理人可以设立大额赎回或其他特殊情况下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人可根据实际情况，修改基金份额净值计算的小数点后保留位数及保留规则。

10、基金份额净值的确认

基金管理人为基金主办会计，用于向基金投资者报告的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果为准。

基金资产净值，是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

(二) 基金的会计政策

基金的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

- 1、基金管理人为本基金的主要会计责任方。
- 2、本基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 3、基金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、本基金单独建账、独立核算。
- 6、基金管理人（或其委托的外包服务机构）及基金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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

十七、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、管理费；
- 2、托管费；
- 3、行政服务费；
- 4、业绩报酬；
- 5、基金的证券交易费用及开户费用，期货交易费用及开户费用；
- 6、基金成立后与之相关的会计师费和律师费；
- 7、托管资金专门账户的账户开户费、网银开户费、资金结算汇划费、账户维护费等；

本合同另有约定的除外；

- 8、合同印刷费、电子签约服务费（如有）；
- 9、按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金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、管理费

本基金的基金管理人东航私募基金管理有限公司收取固定管理费。基金管理人的年固定管理费率按基金资产净值的 2.00%/年收取。计算方法如下：

$$H=E \times 2.00\% \div N$$

H 为每日应计提的基金管理费

E：前一日的基金资产净值

N 为每个运作年度的实际天数

基金管理人的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付。支付日为每自然季度起始 10 个工作日内，支付上一自然季管理费。基金管理费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出支付给基金管理人东航私募基金管理有限公司。

管理费收款账户为：

户 名：东航私募基金管理有限公司

账 号：1001229429310145307

开户银行：中国工商银行股份有限公司上海市虹桥机场支行

2、托管费

基金的年托管费率为基金资产净值 0.015%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div N$$

H：每日应计提的托管费

E：前一日的基金资产净值

N：每个运作年度的实际天数

托管费自基金成立日起，每日计提，按季支付。支付日为每自然季度起始 10 个工作日内，支付上一自然季托管费。托管费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出支付给基金托管人。

托管费收款账户：

户名：海通证券股份有限公司

账号：310066726018150012219

开户银行：交通银行上海分行第一支行

大额支付号：301290050037

3、行政服务费

基金的年行政服务费率率为基金资产净值 0.015%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div N$$

H：每日应计提的行政服务费

E：前一日的基金资产净值

N：每个运作年度的实际天数

本基金的行政服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付。支付日为每自然季度起始 10 个工作日内，支付上一自然季行政服务费。行政服务费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出支付给行政服务机构海通证券股份有限公司。

行政服务费收款账户：

户名：海通证券股份有限公司

账号：310066726018150012219

开户银行：交通银行上海分行第一支行

大额支付号：301290050037

4、业绩报酬

本基金管理人收取业绩报酬。

（1）业绩报酬的计提原则

业绩报酬提取时点分为分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取；分红、赎回、终止时计提相应从分红款、赎回款或清算款中扣除（分红金额不足以扣除业绩报酬时以分红款为限）。

分红时提取业绩报酬，基准日为分红除权日；赎回时提取业绩报酬，基准日为赎回日；合同终止时提取业绩报酬，基准日为合同终止日。

除投资者赎回基金份额或基金在清算时，连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于 3 个月。

（2）业绩报酬的计算方法

单个基金份额持有人单笔投资基金份额业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{i,j} = \text{MAX}\{0, F_{i,j} \times (\text{NAV}' - \text{HWM}_{i,j}) \times 25\%\}$$

$PF_{i,j}$ ：本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：分红时点提取时，表示第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额；赎回和合同终止提取时，表示赎回份额；

NAV' ：本业绩报酬计提日基金份额累计净值；

$\text{HWM}_{i,j}$ ：第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位，为该笔份额上一次成功提取业绩报酬时的基金份额累计净值。若该笔份额还未成功提取过业绩报酬，则为该笔份额认购/申购时的基金份额累计净值；

某计提日计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该基金份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。存续期间分红转份额部分作为新增申购份额处理。

（3）业绩报酬的收取时间

对于非合同终止时提取业绩报酬的情形，业绩报酬由基金管理人于提取基准日起 5 个工作日内向基金托管人发送划付指令从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

合同终止时相应业绩报酬的支付时间，请参考第二十四章“清算程序”。

业绩报酬的收款账户信息如下：

户 名：东航私募基金管理有限公司

账 号：1001229429310145307

开户银行：中国工商银行股份有限公司上海市虹桥机场支行

5、上述（一）中所列其他费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。

6、基金管理人、基金托管人、行政服务机构中任意一方的收款账户信息如有变更，变更方可单独决定而无须变更本基金合同，但须在账户信息变更生效时通知基金管理人和基金托管人。

（三）不列入基金业务费用的项目

- 1、管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。
- 2、管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。
- 3、私募基金募集结算专用账户的账户开户费、网银开户费、资金结算汇划费、账户维护费等，由账户管理方承担。
- 4、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基金费用的项目。

（四）费用调整

管理人、基金托管人与基金投资者协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率 and 托管费率。

（五）基金的税收

1、根据国家税收法律、法规相关要求，本基金运营过程中如发生增值税应税行为，形成的增值税及其附加税费等相关税负由本基金资产承担。相关税款由基金管理人计算后向基金托管人出具指令，由基金托管人划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

基金管理人账户信息如下：

户 名：东航私募基金管理有限公司

账 号：1001229409300081050

开户银行：中国工商银行股份有限公司上海市虹桥机场支行

基金管理人的收款账户信息如有变更，可单独决定而无须变更本基金合同，但须在账户信息变更生效时通知基金托管人。

2、本基金清算后，如基金管理人被税务机关要求补缴由本基金增值税应税行为而形成的应由本基金资产承担的增值税及其附加税费等相关税负的，由基金管理人向基金投资者就补缴金额进行追索。

3、本基金运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的各纳税主体、扣缴主体，其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行。

4、如本基金存续期内，本基金所适用的税收相关法律法规及具体执行方式因相关政策调整而发生变化，则本基金管理人经与基金托管人协商一致并经由本基金管理人提前公告后，可直接对本基金合同中涉及的相关税收内容进行修改和调整。

东航金融

十八、基金的收益分配

（一）可供分配利润的构成

本私募基金可供分配利润为截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

私募基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）收益分配原则

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，管理人有权决定是否对本基金进行期间收益分配。
- 2、每一基金份额享有同等分配权。
- 3、收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。
- 4、基金收益分配基准日的私募基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值 1 元。
- 5、基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配。
- 6、本基金在每个分红日当天分红后的单位净值均归 1.000 元。
- 7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案的确定与通知

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

1、在本基金存续期内，收益分配方式为现金分红或分红转投资，默认分红转投资，基金份额持有人如需修改收益分配方式，应提前向管理人提出书面申请。分配时间、分配数额及比例等收益分配方案的具体内容由基金管理人以官网公示为准（视为已尽告知义务）。

2、基金投资者选择将收益转换为份额单位时，由管理人根据分红方案制作份额明细表，3 个工作日内委托注册登记机构进行相应份额登记。

十九、信息披露义务

(一) 本私募基金的信息披露应符合《基金法》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

(二) 基金管理人应如实向投资者披露以下事项：

- 1、基金投资情况；
- 2、资产负债情况；
- 3、投资收益分配；
- 4、基金承担的费用和业绩报酬（如有）；
- 5、可能存在的利益冲突、关联交易以及可能影响投资者合法权益的其他重大信息；
- 6、法律法规及基金合同约定的其他事项。

(三) 运作期报告

1、基金管理人向私募基金投资者提供的报告种类、内容和频率

(1) 净值报告

基金管理人按照固定频率（每周）将经基金托管人复核的基金份额净值告知私募基金投资者。

(2) 定期报告

基金管理人定期（按月（若有）、季、年度）向投资者报告定期报告。

(3) 临时报告

发生基金合同约定的、可能影响私募基金投资者利益的重大事项时，私募基金管理人应按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时进行报告。

(4) 法律法规和中国证券投资基金业协会规定的其他报告。

2、向私募基金投资者提供报告及私募基金投资者信息查询的方式

私募基金管理人有权采用下列一种或多种方式向私募基金投资者提供报告或进行相关通知。

(1) 私募基金管理人官方网站和 APP

私募基金管理人通过私募基金管理人官方网站（www.cesfund.com）和东航财富 APP 向私募基金投资者提供报告和信息查询窗口，内容包括净值报告、定期报告等。私募基金投资者可通过登录管理人官方网站和 APP 并通过身份认证后，查询基金资产数据、报告等。

(2) 邮寄服务

私募基金管理人或代理销售机构向私募基金投资者邮寄临时报告等有关本私募基金的信息。私募基金投资者在开户资料书上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，私募基金投资者应当及时通知私募基金管理人。

(3) 短信、电子邮件、传真

私募基金管理人也可通过短信、电子邮件、传真等方式将信息告知私募基金投资者。

(4) 本基金涉及代销的，则由管理人将相关报告发送代销机构，由代销机构披露给投资者。

(四) 向监管机构提供的报告

私募基金管理人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。

(五) 私募基金管理人或其他信息披露义务人应当按照中国基金业协会的规定对基金信息披露信息进行备份。

二十、风险揭示

基金投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一） 基金合同与中国基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金合同与中国基金业协会合同指引不一致可能导致基金合同未能充分保护投资者权利，引发投资者损失。

（二） 基金委托募集所涉风险

基金委托第三方机构募集可能因募集机构管理行为中的故意或过失行为导致募集资金被挪用，损失等风险。

（三） 外包事项所涉风险

基金资产可能因外包机构的故意或过失行为导致基金资产以及投资者的损失。

（四） 未在中国基金业协会登记备案的风险

未在中国基金业协会登记备案可能导致基金无法进行投资运作，造成投资者损失。

（五） 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

1、股票投资风险主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

2、债券投资风险主要包括：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；

（2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；

（3）债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

（六） 管理风险

在实际操作过程中，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,其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

(七) 流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下,管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划,从而对基金收益造成不利影响。

在基金投资者提出追加或减少基金财产时,可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

(八) 信用风险

本基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息,导致基金财产损失。

(九) 特定的投资方法及基金财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本基金采取的投资策略可能存在使基金收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

(十) 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。

在基金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基金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、募集机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

(十一) 募集失败风险

本基金可能因募集失败而无法成立,从而导致基金资产与投资者资产的损失。

(十二) 投资标的的风险

本基金投资的投资标的已在投资范围中列示,该等投资标的因其特性收到政策、法律、市场环境、交易对手方的影响,存在投资该等标的可能出现损失的风险

(十三) 税收风险

受国家税收法律、政策的规定与要求,本基金与投资者可能会额外承担部分税收,从而造成基金与投资者资产的损失。

(十四) 代持风险

由于基金本身不具备独立的法律主体资格,根据相关法律法规规定及本合同约定,管理人运用基金财产对外投资时,相关权属将登记在基金管理人名下,由基金管理人代基金持有、

管理基金对外投资所形成的资产。如管理人因自身债务或所承担的义务而被采查封、扣押、冻结或强制执行等司法强制措施的，可能对基金财产带来损害。

（十五） 提前终止风险

如本基金运作中发生基金合同“基金合同的解除、变更和终止”章约定的基金合同终止情形，本基金可提前终止运作。

（十六） 期货投资风险

1、流动性风险

本基金在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2、基差风险

基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3、合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4、期货保证金不足风险

由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

5、杠杆风险

期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

（十七） 关联交易风险

1、基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；或上述主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本基金合同投资范围规定的投资产品。基金管理人亦可与基金管理人、基金托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体进行融资融券（若有）、收益互换（若有）、场外期权（若有）等交易。

2、私募基金投资者签署本基金合同即表明其已经知晓并同意本基金可能进行上述关联交易。

3、私募基金投资者不得因本基金进行上述关联交易或投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害赔偿的要求，投资者可能面临资金损失的风险。

（十八） 基金平仓风险（若有）

若本基金约定清盘线（止损线），但基金合同约定止损线不是基金实施止损后的必然实时净值，基金止损后的实际损失可能超过或大幅超过合同约定的止损线，由此产生的一切损益由基金财产承担。

在特殊情况下（包括但不限于极端行情时、基金临近清盘或已在止损线下，但因市场原因无法平仓的），基于保护投资者利益的目标，基金管理人有权进行合理的对冲操作以避免损失进一步扩大，由此产生的一切损益由基金财产承担。

（十九） 聘请投资顾问所涉风险（若有）

基金管理人保证该投资顾问的所有建议都正确无误，也不保证该投资顾问的所有建议都能够得到执行。基金资产可能因投资顾问的故意或过失行为导致基金资产以及投资者的损失。

（二十） 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，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金投资者利益受损。

二十一、基金份额的转让、非交易过户和冻结

（一）基金份额的转让和转登记

1、基金存续期内，若条件成熟的，经基金管理人同意，基金份额持有人有权通过交易所交易平台或协商转让的形式，向符合条件的合格投资者转让其持有的基金份额。

2、基金份额的转让和转登记应符合国家有关法律、法规及部门规章的要求，并按照基金管理人的要求提供相关资料并履行必要的手续，具体操作规则详见基金管理人届时提前通知的相关信息。受让基金份额的投资者，必须是符合基金文件规定的合格投资者。

（二）基金份额的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定的规则从某一基金投资者账户转移到另一基金投资者账户的行为。基金管理人只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的基金份额非交易过户，注册登记机构按照基金管理人受理的申请执行。

（三）基金份额的冻结

基金管理人只受理国家有权机关依法要求的基金份额冻结与解冻事项，注册登记机构按照基金管理人受理的申请执行。

二十二、基金合同的成立、生效及签署

（一）合同的成立、生效

1、合同成立

本合同文本由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署后合同即告成立。

2、合同生效

本合同生效应当同时满足如下条件：

- （1）本合同经基金投资者、基金管理人与基金托管人合法签署；
- （2）本基金管理人就变更管理人事项公告生效；
- （3）基金投资者认购或申购资金实际交付并经注册登记确认成功，基金投资者获得基金份额；
- （4）本基金依法有效成立，对本合同各方具有法律效力。

本合同生效后，任何一方都不得单方解除。

（二）合同的签署

1、本合同的签署应当采用纸质合同的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。

2、基金投资者在签署合同后方可进行认购、申购。

（三）经注册登记确认有效的基金投资者认购、申购、赎回本基金的申请材料或数据电文和各推广机构出具的本基金认购、申购、赎回业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

二十三、基金合同的解除、变更和终止

(一) 非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时,可采用以下三种方式中的一种进行基金合同变更。

1、全体基金投资者、管理人和基金托管人协商一致后,可对本合同内容进行变更。但下列管理人有权单独变更合同内容的情形除外:

- (1) 变更本基金投资经理;
- (2) 降低本基金管理费、业绩报酬(如有);
- (3) 调整本基金的投资策略;
- (4) 投资范围增加现金管理类资产;
- (5) 基金认购、申购、赎回的时间、业务规则等变更。

其他对投资者利益无实质性不利影响情形的变更,或法律法规或中国证监会的相关规定发生变化需要对本合同进行变更的,管理人可与托管人协商后修改基金合同,并由管理人按照本合同的约定向投资者披露变更的具体内容。

2、按照基金合同的约定召开基金份额持有人大会决议通过。

3、基金管理人、基金托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。基金管理人就本合同变更事项在基金管理人网站或书面通知的方式发布征求意见,并在十五个工作日内以书面或电子方式向基金投资者发送合同变更征询意见函(或通知)。基金投资者应在征询意见函(或通知)指定的日期内按指定的形式回复意见。基金投资者不同意变更的,应在征询意见函(或通知)指定的日期内退出本基金;基金投资者未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内退出本基金的,视为基金投资者同意合同变更。变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的次工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

(二) 法律法规或中国证监会的相关规定发生变化需要对本合同进行变更的,基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同,并由基金管理人按照本合同的约定向基金投资者披露变更的具体内容。

(三) 对基金合同进行重大的变更、补充,基金管理人应当在变更或补充发生之日起5个工作日内向基金业协会报备。

(四) 基金投资者的合同解除权:

投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时,募集机构应当按合同约定及时退还投资者的全部认购款项。

(五) 基金合同终止的情形包括下列事项:

- 1、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的;
- 2、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的;
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接
- 4、经全体投资者、基金管理人和基金托管人协商一致决定终止的;
- 5、基金份额持有人大会决定终止;
- 6、基金合同期限届满而未延期;
- 7、基金管理人根据基金运作、市场行情等情况决定终止的;
- 8、基金备案失败的;
- 9、本基金存续期间,所有投资者全部赎回的;
- 10、本基金存续期间触发合同约定清算条件(包括止损机制等)的;
- 11、法律法规和本合同规定的其他情形。

二十四、清算程序

（一）清算小组

- (1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立清算小组。
- (2) 清算小组成员由基金管理人、基金托管人等相关人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。
- (3) 清算小组负责基金清算资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（二）清算程序

- (1) 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 对基金财产进行分配。

（三）清算费用的来源和支付方式

清算费用是指清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

（四）基金财产清算过程中剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用及其他基金费用后，按私募基金的份额持有人持有的基金份额比例分配给基金投资者。

1、分配顺序为：

- (1) 已计提但未支付的基金费用。
- (2) 份额持有人根据持有份额比例分配剩余基金财产。

2、分配时，基金管理人以分配完前一部分后剩余的全部基金财产为限进行基金财产的分配，不足部分不进行补偿。

（五）清算未尽事宜

本合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人公告或书面通知为准。

（六）资料保存

管理人、托管人及代销机构应当妥善保存私募基金投资决策、交易和投资者适当性管理等方面的记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年；托管人对

基金的会计凭证、交易记录、合同协议等重要文件档案保存 15 年以上。

(七) 私募基金财产相关账户的注销。

私募基金财产清算完毕后，私募基金财产相关账户的开立方应及时注销相关账户。

产品银行账户销户产生的利息和费用由委托人享有和承担。

东航金融

二十五、违约责任

(一) 当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；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；因共同行为给其他当事人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

1、管理人及和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。

2、在没有故意或重大过失的情况下，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、不可抗力。

(二) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金投资者利益的前提下，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) 由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或基金投资者损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(四) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

二十六、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交【上海仲裁委员会】，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为【上海】，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁庭另有裁决，仲裁费应由败诉一方负担。

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、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金投资者的合法权益。

二十七、基金合同的效力

(一) 基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。基金投资者为法人的，本合同自基金投资者、基金管理人和基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签章或盖章之日起成立；基金投资者为自然人的，本合同自基金投资者本人签章或授权的代理人签章且基金管理人和基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立；基金投资者为投资计划等非法人形式的，本合同自基金投资者的管理人签章或其他法律规定的主体签章且基金管理人和基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。

(二) 本合同自生效之日起对基金投资者、基金管理人、基金托管人具有同等的法律约束力。自本合同生效之日起，原签署的《东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金基金合同》（合同编号：DHJK-ICBC-2014QH005）、《东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金基金合同之补充协议》自动解除/废止。

(三) 本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

二十八、其他事项

(一) 申明条款

各当事人申明：在签署本合同时，各当事人已仔细阅读本合同及基金说明书，对本合同及基金说明书所有条款均无异议，并对当事人之间的基金关系及有关权利、义务和责任条款的法律含义有准确无误的理解。

(二) 基金合同中约定的通讯地址或联络方式即为管理人处理基金事务过程中与投资者（或基金份额持有人）联系的通讯地址或联络方式；投资者（或基金份额持有人）通讯地址或联络方式发生变化，应自发生变化之日起十天内以书面文件形式通知管理人，若在基金期限届满前十天内发生变化，应在两天内以书面文件形式通知管理人；若投资者（或基金份额持有人）未将有关变化及时通知管理人，投资者（或基金份额持有人）应对由此造成的影响和损失负责；管理人的通讯地址或联络方式发生变化，应自发生变化之日起十天内依据“信息披露义务”章节中约定的任何一种通知方式向私募基金投资者通知，若在基金期限届满前十天内发生变化，应在两天内依据“信息披露义务”章节中约定的任何一种通知方式向私募基金投资者通知。

(三) 若基金份额持有人账户信息发生变化，基金份额持有人须及时到管理人处办理变更手续，否则，基金份额持有人应对由此造成的影响和损失负责。

(四) 本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(五) 本合同一式肆份，基金份额持有人执壹份，基金管理人执贰份，基金托管人执壹份，每份具有同等的法律效力。

(以下无正文)

(请基金投资者务必确保填写的资料正确有效,如因填写错误导致的任何损失,基金管理人和基金托管人不承担任何责任)

基金投资者请填写:

(一) 基金投资者

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证、军官证、护照

证件号码:

2、法人或其他组织

名称:

证件类型:

证件号码:

法定代表人或负责人:

联系地址:

邮编:

联系电话:

联系人:

(二) 基金投资者认购/申购金额

人民币 元整 (¥)

以实际交易业务申请单据为准。

(三) 基金投资者账户

基金投资者认购、申购基金的划出账户与赎回基金的划入账户,必须为以基金投资者名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、申购和赎回基金的账户名称不一致时,基金投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(本页无正文, 为东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金基金合同签署页。)

基金投资者:

自然人(签字):

或法人或其他组织(盖章):

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 年 月 日

基金管理人: 东航私募基金管理有限公司

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

签署日期: 年 月 日

基金托管人: 海通证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

签署日期: 年 月 日



凌如水

关于“东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金”

变更投资经理的通知

尊敬的投资者：

为更好管理基金产品，根据基金管理人内部工作安排，本公司决定变更“东航金融-CTA 精英孵化私募投资基金”的投资经理。具体调整内容如下：

基金名称	原投资经理	变更后投资经理
东航金融-CTA 精英孵化 私募投资基金	沈航	王倩

变更后投资经理简历如下：

王倩女士：上海财经大学金融学博士，加拿大女王大学联合培养博士。2010 年加入东航金控有限责任公司，历任资产管理部策略研究员、投资经理，财富管理中心基金经理、投研交易部负责人、组合投资部负责人。现任东航私募基金管理有限公司组合投资部经理、投资经理。有 9 年基金投资管理经验，对经济周期和大类资产轮动具有较深的理解，擅长 CTA 多策略组合投资管理。

此变更自 2023 年 2 月 1 日起生效。如有任何疑问，请拨打 021-23502737 咨询。感谢您对我们的信任与支持！

特此通知。


东航私募基金管理有限公司
2023 年 1 月 20 日

附件一：

《东航私募基金管理有限公司与上海汇付基金销售有限公司之代销主协议》之
相关权利义务条款

本基金管理人：东航私募基金管理有限公司（下文简称“东航私募”）

本基金代理销售机构：上海汇付基金销售有限公司（下文简称“汇付基金”）

（一）东航私募的权利和义务

1. 东航私募的权利

（1）根据国家法律、法规及其他有关规定，对汇付基金的代理销售资质进行审慎性调查，并对汇付基金的代理销售资质和提供服务的能力、方式等进行持续关注和定期评估。委托汇付基金或汇付基金以外的任何第三方代理本私募基金的销售业务，增加或缩小委托范围，并有权按照本协议约定的条件和程序解除本协议。

（2）要求汇付基金按照法律法规、《基金合同》及本协议的约定办理募集业务，并以合理方式对汇付基金的募集活动进行监督，汇付基金应当对此予以配合。东航私募发现汇付基金有违法违规行为的，有权要求汇付基金改正，汇付基金改正前，东航私募有权暂停合作并暂停支付销售费用（如有）。对汇付基金在销售代理过程中因故意或过失而给东航私募或基金投资者造成的损失，有权要求汇付基金承担相应的赔偿责任。

（3）依照法律法规和本协议的约定，及时、准确、完整地获得汇付基金代理销售的私募基金的相关信息、资料、款项和数据等。

（4）根据法律法规或《基金合同》的规定，有权决定拒绝接受任何一笔或任何一段时间内的所有通过汇付基金进行的认/申购、赎回申请，但必须及时通知汇付基金并说明原因。

（5）法律法规、本协议及补充协议规定的其他权利。

2. 东航私募的义务

（1）向汇付基金提供东航私募的品牌、发展战略、投资策略、管理团队、高管信息，制作并向汇付基金提供与基金代理销售业务相关的《基金合同》、基金风险揭示书、募集说明书（如有）等文件和资料，并保证其真实、准确、完整、

及时。

(2) 制作并向汇付基金提供私募基金推介材料，并对材料内容的真实性、完整性、准确性负责。如东航私募委托汇付基金印刷推介材料时，东航私募应向汇付基金提供委托书及加盖东航私募公章的原始材料模板。

(3) 及时向汇付基金发送基金净值等数据，并对数据的准确性负责。代销产品的净值可通过邮件或自行登录申报系统添加产品净值(申报系统账号由汇付基金数据部提供，合作代销产品授权在汇付基金官网展示业绩)。

(4) 东航私募如有定期或不定期举办的客户见面会，需尽早通知汇付基金，由汇付基金统一通知其介绍的客户参加；

(5) 经双方确认的客户维护工作由汇付基金负责，未经汇付基金同意东航私募不得主动联络客户。如客户主动咨询东航私募相关产品问题，东航私募提供给客户的信息仅限于产品相关内容。如客户主动邀请东航私募人员拜访，需由汇付基金人员陪同进行。

(6) 对基金运作中已经或有可能对募集活动产生重大影响的事项，应当及时通知汇付基金。

(7) 按照本协议及补充协议约定的标准和方式，及时足额向汇付基金支付销售费用。

(8) 负责保管基金合同、风险揭示书等应由东航私募保管的私募基金募集业务相关记录及资料。

(9) 东航私募应配备本基金需要的合格的交易、清算、结算等相关人员，并建立相关业务系统，完善相关业务流程，保证业务正常运转。

(10) 东航私募有义务根据与托管人签订的相关合同履行估值义务，并定期将本计划的估值结果提交汇付基金。

(11) 法律法规、本协议及补充协议规定的其他义务。

(二) 汇付基金的权利和义务

1、汇付基金的权利

(1) 在本协议规定的范围内，根据有关法律法规、《基金合同》、募集说明书等文件和资料，制定业务流程，并在与东航私募协商的基础上，依法独立确定汇付基金的募集策略并安排募集活动。

(2) 按照本协议及补充协议约定的标准和方式，及时足额取得销售费用。

(3) 从东航私募取得基金产品的净值信息。

(4) 法律法规、本协议及补充协议规定的其他权利。

2、汇付基金的义务

(1) 汇付基金应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，严格遵守中国基金业协会发布的《私募投资基金募集行为管理办法》，防范利益冲突，履行说明义务、反洗钱义务等相关义务，承担协助东航私募完成特定对象确定、投资者适当性审查、私募基金推介及合格投资者确认等工作相关责任，并协助经确认后的合格投资者与东航私募签署《基金合同》。

(2) 汇付基金不得公开推介、宣传东航私募基金产品，但法律法规或相关规则豁免可以公开宣传的内容除外。

(3) 汇付基金应履行投资者评估、适当性匹配等适当性义务。汇付基金应当通过问卷调查等方式履行特定对象确定程序，对投资者风险识别能力和风险承担能力进行评估。未经特定对象确定程序，汇付基金不得向任何人宣传推介私募基金。如果投资者欲增持基金产品，且距离上一次评估的期限已经超过3年，汇付基金需对该名投资者重新进行风险评估。对于汇付基金在委托销售中违反适当性义务的行为，汇付基金应承担相应法律责任。

(4) 汇付基金应根据上一项评估结果和东航私募对基金产品评定的风险等级，决定是否继续向特定投资者主动推介基金产品，汇付基金应确定基金产品适合于特定的潜在投资者。如果特定投资者的风险承担能力低于基金产品的风险等级，但执意认购/申购的，汇付基金应在对其做出特别风险警示后，方可继续推介。

(5) 汇付基金在推介时应使用东航私募制作并提供的推介材料，不得私自制作私募基金推介材料。如东航私募委托汇付基金印刷推介材料，汇付基金不得对东航私募提供的原始材料模板进行更改。汇付基金在推介基金产品时，所使用的术语不得有虚假陈述、误导性陈述或重大遗漏；不得以任何方式或通过任何手段承诺、保证投资者资金不受损失，或者承诺投资者最低收益，包括宣传“预期收益”“预计收益”“预测投资业绩”等相关内容；不得宣传或使用“零风险”“收益有保障本金无忧”等概念；不得夸大或者片面推介，使用“安全”“保证”

“承诺”“保险”“避险”“有保障”“高收益”“无风险”等可能误导投资人进行风险判断的措辞；不得使用“欲购从速”“申购良机”等片面强调集中营销时间限制的措辞；不得任意使用“业绩最佳”“规模最大”等相关措辞。

(6) 对于不属于《证券期货投资者适当性管理办法》规定的专业投资者的合格投资者，汇付基金应当依照《证券期货投资者适当性管理办法》为其提供特别保护措施，履行特别的告知义务，并依法进行录音录像。

(7) 汇付基金应取得潜在投资者如下书面承诺：(a) 承诺其符合合格投资者标准；(b) 承诺其为自己购买私募基金，不会以非法拆分转让的目的购买私募基金。

(8) 汇付基金不得与投资者私下签订回购协议或承诺函等文件，或以其它任何形式直接或间接承诺保本保收益。

(9) 汇付基金不得在推介时恶意贬低汇付基金、东航私募的同行；不得允许非本汇付基金雇佣的人员进行私募基金推介。

(10) 在特定投资者签署《基金合同》之前，汇付基金应当向该投资者说明有关法律法规，说明投资冷静期、回访确认等程序性安排以及投资者的相关权利，重点揭示基金产品的风险，并安排特定投资者签署风险揭示书。

(11) 在特定投资者签署《基金合同》之前，汇付基金应要求投资者提供必要的资产证明文件或收入证明并进行核验，以实质认定该投资者符合私募基金合格投资者的标准，并依法履行反洗钱义务。

(12) 汇付基金应安排特定投资者与东航私募签署《基金合同》，并指示投资者向指定的募集账户划付投资款项。

(13) 汇付基金应当为其代销的私募基金开立募集账户，用于统一归集代销该基金而募集到的结算资金、向投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余基金财产等，保证资金原路返还。汇付基金应当依照《私募投资基金募集行为管理办法》的规定聘请一家募集账户监督机构，并与其签署募集账户监督协议，明确对募集账户的控制权、责任划分及保障资金划转安全的条款。汇付基金不得将私募基金募集结算资金归入其自有财产，不得以任何形式挪用私募基金募集结算资金。汇付基金有义务将签署完成的募集账户监督协议的扫描件或复印件提供给东航私募。

(14) 汇付基金开立募集账户用于统一归集私募基金募集结算资金、向投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余基金财产等，确保资金原路返还。除东航私募应向汇付基金支付的销售服务费及双方另有约定外，双方发生的资金往来均应通过汇付基金募集账户办理，包括投资者的认购资金、申购资金、赎回资金、分红资金、认购退款、申购退款或其他回款等。如：基金投资者通过汇付基金认购、申购私募基金的，应将认购资金、申购资金划入汇付基金指定的募集账户，汇付基金归集后划转至私募基金财产账户或托管资金账户。

汇付基金募集账户的具体信息如下：

账户名称： 上海汇付基金销售有限公司募集监督户

开户行： 平安银行上海凯旋支行

账号： 19011986123101

大额支付号： 307290023187

募集账户监督机构： 平安银行

如汇付基金变更募集账户信息，汇付基金应提前告知东航私募并于更新后5个工作日内向东航私募出具正式盖章函件说明更新后的募集账户信息。

(15) 汇付基金在《基金合同》签署完毕且投资者划付了投资款款项后的二十四小时“投资冷静期”内，不得主动联系投资者。在投资冷静期满后，汇付基金应当指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员，以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。在回访确认成功前，如投资者要求解除基金合同的，汇付基金应安排办理合同解除手续，并及时退还投资者的全部投资款。

(16) 汇付基金应对介绍、推广过程的合规性着力做到某种方式的留痕。

(17) 汇付基金采取互联网技术进行基金募集的，应保证履行本条前述第(1)至(13)项的义务，并进行系统留痕，确保线上销售的流程、电子合同的签约流程等符合法律法规及监管规定，妥善留存投资者签署的全套文件，保证可以对互联网募集的全过程进行事后审计或检查，并根据东航私募及监管要求提供投资者的相关认/申购及赎回资料。汇付基金应遵守法律法规及国家金融监管机构关于募集东航私募基金产品的其他所有规定。

就《私募投资基金募集行为管理办法》第三十二条规定的投资者而言，汇付

基金可以依照规定豁免履行以上各项义务中由《私募投资基金募集行为管理办法》第三十二条所豁免的义务。但汇付基金不得因豁免履行而损害东航私募的利益。

(18) 汇付基金应当采取有效措施，保障基金募集业务的正常进行，负责经由汇付基金认/申购、赎回基金的基金投资者的客户服务工作，并接受东航私募对汇付基金的募集业务情况的合理监督。汇付基金应协助东航私募受理汇付基金代销客户咨询、查询、投诉，并将有关的问题及时向东航私募反馈。

(19) 汇付基金应当建立健全投资者回访制度，对购买基金产品或者服务的普通投资者进行回访，对回访时发现的异常情况进行持续跟踪，对异常情况进行核查，存在风险隐患的及时排查，并定期整理总结，以完善投资者适当性制度。回访内容应当符合相关法律法规的规定。

(20) 汇付基金应当妥善保存投资者适当性管理制度、投资者信息资料、告知警示投资者资料、录音录像资料以及其他与私募基金募集业务相关的记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于法律及法规及相关监管规则要求的期限。汇付基金线下销售的，除投资者签署的纸质版产品合同及纸质版风险揭示书须提供给东航私募妥善保管外，投资者书面填写的各类业务申请表、投资者适当性等书面资料，均由汇付基金依相关法律、法规及参照汇付基金资料保管规定妥善保管，汇付基金线上销售投资者签署的电子合同及全套资料均由汇付基金妥善保管，汇付基金应在募集结束后的10个工作日内将投资者签署的基金合同及相关协议通过双方认可的方式发送至东航私募。

根据业务需要，东航私募可以在汇付基金的协助和配合下，对上述资料进行查阅。若东航私募应监管要求，需向有关监管机构提供投资者签署的电子合同及全套资料时，汇付基金应协助东航私募提供。

(21) 汇付基金应根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》（以下简称“《非居民涉税办法》”）的规定，对相关非居民的金融账户开展尽职调查工作，并将《非居民涉税办法》要求的信息向东航私募提供。

(22) 汇付基金应协助东航私募及时向汇付基金代销客户进行信息披露、风险揭示。汇付基金未能将通过汇付基金认购/申购东航私募私募投资基金的投资者联络信息披露给东航私募的，应代东航私募向该等投资者履行通知和/或信息披露义务。汇付基金应在东航私募提供所需通知和/或披露的文件及信息后的

一个工作日内,真实、准确、完整、一致地将该等文件及信息通知投资者或对投资者进行信息披露。汇付基金应指定信息披露的专职人员,在收到东航私募所披露的信息文本后,应由专职人员通过书面或电子方式向东航私募发出收到回执。汇付基金应着力取得投资者已获悉相关文件或信息的回执或其他书面、电子可留痕的文件。如在合理期限内,汇付基金未能向其负责代销的全部投资者进行披露,或未取得投资者已获悉相关文件或信息的回执或其他可留痕文件的,汇付基金应书面通知东航私募,协同东航私募采取其他补救措施。

汇付基金未能履行前款约定的通知或信息披露义务,或其他法律法规及监管规章规定的、应由东航私募履行但东航私募实际不具备条件履行、只能由汇付基金代为履行的通知或信息披露义务,给东航私募造成损失的,包括但不限于东航私募被采取监管措施、东航私募被投资者起诉并要求赔偿等,汇付基金应承担相应的违约责任;如东航私募有声誉损失的,汇付基金应消除影响公开赔礼道歉;如东航私募有直接经济损失的,汇付基金应予以赔偿。

(23) 汇付基金应当对投资者的商业秘密及个人信息严格保密。汇付基金只能在募集环节向投资人出具本协议和补充协议,不得用于其他对外宣传。

(24) 未经东航私募事先书面同意,汇付基金不得以东航私募的名义采取其他与基金募集无关的其他任何行动。在任何情况下,汇付基金不得采取东航私募及/或东航私募关联方声誉造成负面影响的行为。

(25) 法律法规、本协议及补充协议规定的其他义务。

附件二：

《上海天天基金销售有限公司与东航私募基金管理有限公司之私募投资基金代理销售协议》之相关权利义务条款

本基金管理人：东航私募基金管理有限公司（下文简称“东航私募”）

本基金代理销售机构：上海天天基金销售有限公司（下文简称“天天基金”）

（二）天天基金的权利和义务

1、天天基金的权利：

（1）根据国家法律、法规及其他有关规定，接受东航私募委托办理基金代理销售业务，及按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

（2）有权获得代理销售产品或者服务的信息，包括产品和服务的风险特征和程度，风险等级资料、私募基金的推介资料、东航私募经营活动中的重大变化（包括但不限于东航私募存在的对天天基金履行本协议下义务具有重要影响的有关信息），有权获得东航私募对天天基金代理销售业务的支持。

（3）在本协议约定的范围内，根据基金合同和销售计划等资料，独立制定天天基金的销售策略、业务流程，安排非公开的销售网点（包括通过互联网等非现场的方式和平台），办理基金代理销售业务。

（4）有权安排东航私募人员参加路演，但对路演的管理应符合法律法规、监管规定、自律规范及其他有关规定。

（5）有权拒绝执行东航私募不符合相关法律法规规定和私募投资基金相关法律文件约定的业务要求。

（6）有权向东航私募获得基金运作期间需披露的信息，并有权获得约定需由天天基金向投资者披露的各项信息。

（7）按照本协议及补充协议规定的标准、方式和时间，足额取得基金销售服务费。

（8）在与东航私募合作代销东航私募基金的同时，有权选择代理销售东航私募以外的其他基金管理人发行的基金。

（9）对因东航私募的过错而给投资者及/或天天基金造成的损失，有权要求东航私募立即纠正，并承担损失赔偿责任。

（10）天天基金仅作为私募投资基金的销售机构，不承担为该私募投资基金

垫付任何资金的义务。

(11) 东航私募同时委托天天基金以外的其他符合条件的机构代理销售同一个基金时，天天基金有权请求东航私募披露其他代销机构的名单。

(12) 有权按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

(13) 法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他权利。

2、天天基金的义务：

(1) 在符合监管要求、风险可控下，整合内部资源为东航私募提供品牌宣传服务。

(2) 严格依照国家法律法规及其他关于私募基金销售的有关规定、依照基金合同及本协议的约定，办理基金代理销售业务，勤勉、尽责地履行基金代理销售职责。

(3) 采取有效手段和方式，保障基金代理销售业务的正常、高效进行，并为通过天天基金认购、申购基金的投资者提供客户服务。

(4) 天天基金在为东航私募代销私募基金时，需依照《适当性办法》、《适当性指引》、《募集办法》等规定，履行法定义务包括但不限于告知、警示、说明义务、反洗钱义务、反恐怖融资、投资者评估、适当性匹配等，并协助经确认后的合格投资者与东航私募签署《基金合同》；就特定投资者而言，天天基金可以按规定豁免履行相关义务，但不得损害东航私募的利益。

(5) 天天基金应严格按照法律、行政法规、中国证监会和中国基金业协会规定和本协议约定使用东航私募制作的基金销售宣传推介资料，推介材料的内容应当如实披露基金产品的基本信息，与基金合同保持一致；如有不一致，天天基金应当向投资者特别说明，并以基金合同记载的信息为准。天天基金不得通过报刊、电视、广播、未设置特定对象确定程序的互联网（天天基金网站除外）及其他公共媒体销售基金，不得通过违规承诺收益或承担损失等方式，或者采用虚假宣传和商业贿赂等不正当手段销售基金；不得作出其他法律、行政法规、中国证监会和中国基金业协会规定和本协议约定的禁止行为。

(6) 对于东航私募提供的私募基金宣传推介资料，天天基金应向经过了特定对象确定程序的合格投资者提供。

(7) 天天基金组织路演并宣传东航私募私募基金产品的，应事先对参加路演的潜在投资者开展风险测评，只有达到《适当性指引》规定的潜在投资者方可

参加覆盖东航私募私募基金产品的路演。

(8) 天天基金持有并保存通过天天基金认购/申购东航私募私募基金的投资
者联络信息的，应代东航私募向该等投资者履行通知和/或信息披露义务。天天
基金应在东航私募提供所需通知和/或披露的文件及信息后的一个工作日内，真
实、准确、完整、一致地将该等文件及信息通知投资者或对投资者进行信息披
露。如在合理期限内，天天基金未能向其负责代销的全部投资者进行披露，或未
取得投资者已获悉相关文件或信息的回执或其他可留痕文件的，天天基金应书
面通知东航私募，协同东航私募采取其他补救措施。如因天天基金过错造成投
资者及/或东航私募损失，天天基金应承担相应赔偿责任。

(9) 当发生特定情形时，如东航私募被有权监管机构问询时，东航私募应
向天天基金披露该等具体情形，并有权合理主张天天基金在此情形下向东航私
募披露认购/申购东航私募私募基金的特定投资者的信息，以保证东航私募能
履行自身的义务；天天基金应向东航私募提供配合并请求东航私募提供有权监
管机构问询的证明材料。

(10) 天天基金应当依法对所获取的私募基金非公开披露的全部信息、商业
秘密、投资者的商业秘密及个人隐私等信息负有保密义务，除法律法规、自律
规则和基金合同另有规定的，不得以任何方式对外披露。

(11) 天天基金应确保代销的单只私募基金的投资者人数累计不得超过《证
券投资基金法》、《公司法》、《合伙企业法》等法律规定的特定数量。

(12) 天天基金应采取有效手段，确保及时、足额办理基金代理销售的资
金交收。

(13) 天天基金应建立完善的客户服务制度和流程，向通过天天基金认购/
申购基金的投资者提供持续服务。但在持续服务过程中需要东航私募履行法
律法规规定义务和提供协助的，东航私募应当本着诚实信用原则履行义务并
给予及时全面的协助。若因东航私募未能履行法律法规规定义务、本协议约
定义务或其他过错和过失导致天天基金、投资者发生纠纷或产生经济损失，
东航私募应向天天基金、投资者赔偿经济损失。

(14) 未经东航私募书面同意，天天基金不得将本协议项下天天基金的代
理销售业务转包或变相转包。

(15) 天天基金不得利用与基金相关的未公开信息进行任何违法活动。

(16) 因天天基金故意或重大过失导致与基金投资者产生的客户纠纷，应由天天基金妥善解决。但如有任何已经发生或潜在发生的客户纠纷与东航私募相关的，天天基金应在知道或应当知道之日起三个工作日内以书面方式告知东航私募，东航私募应当配合天天基金处理相应纠纷，并分别按照各自的过错承担相应的责任。

(17) 非经东航私募事先书面同意，天天基金不得以东航私募的名义采取其他与基金募集或销售无关的其他任何行动。

(18) 法律法规、自律规则、基金合同、本协议及补充协议规定的其他义务。

(三) 东航私募的权利和义务

1、东航私募的权利：

(1) 对天天基金的代理销售资质进行审慎性调查；根据国家法律、法规及其他有关规定和本协议的约定，委托天天基金办理基金代理销售业务及按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

(2) 要求天天基金严格按照国家法律法规、基金合同、公司章程或者合伙协议（以下统称“基金合同”）、本协议及补充协议的规定，办理基金代理销售有关事宜，并以合理的方式和时间对天天基金的代理销售业务开展情况进行监督；在必要情形下，可要求天天基金提供可证明其依法合规代销的留痕记录以保护东航私募的利益。东航私募发现天天基金有违法违规或违反本协议约定行为的，有权要求天天基金改正；对天天基金在销售代理过程中因故意或过失而给东航私募或基金投资者造成的损失，有权要求天天基金承担相应的赔偿责任。

(3) 根据自身业务需要，有权同时委托天天基金以外的其他符合条件的机构代理销售同一个基金。

(4) 根据法律法规、基金合同的规定，有权拒绝确认通过天天基金进行的某一笔或某一段时间内的认购、申购、赎回或其他业务申请，但必须在一个工作日内向天天基金和投资者书面说明事实和理由。

(5) 依照法律法规和本协议的约定，及时、准确、完整地获得天天基金代理销售的私募基金的相关信息、资料、款项和数据等。

(6) 法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他权利。

2、东航私募的义务：

(1) 东航私募应按照天天基金尽职调查的要求向天天基金提供相关资料，

包括但不限于营业执照、法人信息、关键研究人员信息、公司品牌、管理团队、高管信息、发展战略、投资策略、基金特点、流动性、杠杆情况、结构复杂性、投资方向、投资范围、过往业绩、风控措施、风险揭示以及备案私募基金的其他信息等，东航私募积极配合天天基金的尽调访谈并提供便利，东航私募保证向天天基金就产品和服务风险等级的有关情况做客观完整的陈述，东航私募保证本方、高级管理人员、基金经理的陈述和所提供的资料及信息真实、准确、完整、及时。东航私募及其人员所提供的资料及信息不存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏、不正当披露信息情形。

(2) 基于具体合作意向，向天天基金报送旗下产品或拟合作产品的每日/每周净值；净值报送方式具体由双方协商确定；因东航私募报送净值错误而造成相关损失的，由东航私募自行负责，与天天基金无关。如给天天基金造成损失的，还应当赔偿天天基金所遭受的损失。如造成投资者损失的，东航私募应当赔偿投资者所遭受的损失。

(3) 在同等条件下，东航私募优先考虑将天天基金作为其主要销售合作方，产品合作优先落地天天基金。

(4) 东航私募应依法完成基金的备案。

(5) 东航私募作为私募基金管理人应当向投资人履行受托人义务，承担基金合同的受托责任。东航私募委托天天基金代理销售基金，不得因委托销售免除东航私募作为私募基金管理人应当承担的法定责任和约定义务。

(6) 东航私募应当制作并向天天基金提供与基金代理销售业务相关的基金合同、销售计划、风险揭示文件、东航私募品牌、发展战略、投资策略、管理团队、高管信息以及由基金业协会公示的已备案私募基金的基本信息等资料。东航私募应当向天天基金并通过天天基金向投资者披露的上述信息包括推介资料，应当保证内容的合法合规性、真实性、完整性、准确性和及时性。

(7) 东航私募应当在基金合同中约定给投资者设置不少于二十四小时的投资冷静期，东航私募在投资冷静期内不得主动联系投资者（投资者为专业投资机构的，可不适用投资冷静期的规定）。冷静期内，如投资者向东航私募提出撤回交易，东航私募应当按照投资者的要求，积极协调天天基金和托管人协助交易撤回，并于T+1日15点前告知天天基金。若投资者向天天基金提出交易撤回申请，天天基金有权按投资者的申请进行交易撤回，东航私募应积极予以配合。因东航

私募原因导致未能撤回交易的，所有责任由东航私募自行承担。

东航私募应当向天天基金提供证监会《证券期货投资者适当性管理办法》第十六条、第十七条规定的划分产品或者服务风险等级时分级考虑因素、产品或者服务风险等级评估结果、需要天天基金和投资者审慎评估风险等级的真实材料。东航私募应当向天天基金就产品和服务风险等级的有关情况做客观完整的陈述，保证本方的陈述和所提供的资料及信息真实、准确、完整、及时。东航私募不提供上述规定的信息；或者提供信息违背真实准确完整及时原则，存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏、不正当披露信息情形的，天天基金有权拒绝为东航私募代销产品或提供服务，因此而产生的法律责任和经济损失应当由东航私募承担。

(8) 东航私募应审慎地对天天基金具备代销相关产品或者提供服务的资格和落实相应适当性义务要求的能力、方式等进行持续关注，并定期评估。

(9) 东航私募应当制定并告知天天基金其所委托的产品的适当性管理标准和要求，天天基金应严格执行，但法律、行政法规、中国证监会其他规章另有规定的除外。

(10) 东航私募在自行担任基金份额登记机构或委托其他机构办理基金份额登记业务期间，东航私募应采取有效手段和方式，保障基金份额登记业务的正常、高效进行，积极配合天天基金的基金代理销售工作。

(11) 东航私募采取有效手段和方式促使基金份额登记机构与天天基金的接收和传输数据的接口通畅；按照规范要求和约定时间及时、准确地向天天基金传输账户和交易确认的数据。

(13) 东航私募委托天天基金销售的私募基金系有限合伙型基金的，应当由双方另行协商确定开立私募基金募集结算资金专用账户(以下简称“募集账户”)，用于统一归集私募基金募集结算资金、向投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余基金财产等，确保资金封闭和原路返还。

(14) 按照本协议或补充协议约定的标准、方式和时间，及时足额付给天天基金销售服务费。

(15) 对天天基金在业务办理过程中提供的投资者信息、交易数据、天天基金商业秘密等资料和信息负有保密义务，不得将天天基金提供的相关投资者的资料透露给任何第三方。即使本协议终止，东航私募仍负有保密义务，但法律法规另有规定或东航私募通过其他合法途径获悉的除外。

(16) 东航私募有义务建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务，依据《披露办法》的要求向投资者披露信息，并及时向天天基金提供需由天天基金向投资者披露的信息，且应保证相关信息的真实性、准确性、完整性。

(17) 东航私募有义务建立完善的客户服务制度和流程，通过天天基金向经由天天基金认购、申购基金的客户提供持续服务。

(18) 如因东航私募金融产品设计与运营向通过天天基金认购/申购的投资者提供的信息数据错误或不及时等东航私募原因导致天天基金、投资者发生纠纷或产生损失，东航私募应负责解决纠纷并向天天基金和投资者赔偿损失，同时东航私募应当配合天天基金向投资者做好释明工作，避免天天基金声誉受损。

(19) 在天天基金向通过天天基金认购、申购基金的投资者提供持续服务过程中，东航私募向天天基金提供持续业务支持。

(20) 东航私募及私募基金运作中可能影响天天基金代理销售和服务事项的，应当在影响事项发生后一个工作日内书面通知天天基金。

(21) 不得利用天天基金提供的相关资产委托人的资料进行直接营销或用于天天基金指定用途以外的任何目的。

(22) 法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他应当由基金管理人承担的义务。