

2020-托管部-34341-N

关于蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同 变更的意见征询函（202001）

招商证券股份有限公司：

北京蜂雀投资管理有限公司（以下简称“我公司”）在贵司托管的蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资理财服务，我公司拟根据《蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同》的约定对该基金相关条款进行变更。

我公司特向贵司征询关于蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同相关条款变更的意见。

《蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同》条款具体修改如下：

一、蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同修改对照明细表

序号 1

七、基金的申购、赎回与转让

原条款：	现条款：
本基金开放日为每个自然年度 6 月 2 日和 12 月 2 日（遇节假日则顺延至下一个工作日）。管理人可根据实际情况增设临时开放日（每个自然年度原则上不超过 8 个工作日，且临时开放日的设置原则上不得使基金出现连续 2 个工作日开放，管理人有权在基金运营及技术条件支持等情况下进行调整），具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出申购和/或赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时通	本基金开放日为每个自然月 2 号（遇节假日则顺延至下一个工作日）。管理人可根据实际情况增设临时开放日（每个自然年度原则上不超过 8 个工作日，且临时开放日的设置原则上不得使基金出现连续 2 个工作日开放，管理人有权在基金运营及技术条件支持等情况下进行调整），具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出申购和/或赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时通知基金投资者临时开

知基金投资者临时开放日导致的损失，托管人不承担责任)。	放日导致的损失，托管人不承担责任)。
原条款：	现条款：
<p>3、在如下情形下，基金管理人可以暂停基金份额持有人的赎回：</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>3、在如下情形下，基金管理人可以暂停基金份额持有人的赎回：</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p>
原条款：	现条款：
<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>如开放日提出的赎回申请构成巨额赎回，基金管理人对于巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过30个工作日（在未完成基金份额持有人赎回款项的支付之前，基金管理人不得将托管资金账户的资金用于新增投资）。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。</p> <p>3、巨额赎回延迟支付的通知：当发生巨额赎回并且基金管理人决定延期支付赎回款项时，基金管理人应当通知基金份额持有人。</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金的资产组合状况决定采取以下处理方式：</p> <p>(1)如开放日提出的赎回申请构成巨额赎回，基金管理人对于巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过 30 个工作日（在未完成基金份额持有人赎回款项的支付之前，基金管理人不得将托管资金账户的资金用于新增投资）。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。</p> <p>(2)连续巨额赎回：若本基金连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额赎回导致本基金的赎回款支付出现困难的，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请，已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，并应当通知基金份额持有人；管理人应当在下一个开放日前尽量调节本基金流</p>

	<p>动性以满足基金份额持有人在开放日的赎回需求。在本基金流动性允许的情形下，原则上管理人应在触发暂停赎回后的下个开放日恢复办理赎回，具体以管理人的通知为准。</p> <p>3、巨额赎回的通知</p> <p>当发生巨额赎回并且基金管理人决定采取延期支付赎回款项的处理方式时，基金管理人应当在基金份额确认日之后的 2 个工作日内按照本合同约定的方式通知申请赎回的基金份额持有人及基金托管人。</p>
--	--

序号 2

八、当事人及权利义务

原条款:	现条款:
<p>(二) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人概况</p> <p>名称: 北京蜂雀投资管理有限公司</p> <p>住所: 北京市朝阳区东三环南路 19 号院 1 号楼-2 至 15 层 101 内八层 B805、B806、B807</p> <p>通讯地址: 北京市朝阳区东三环南路 19 号院联合国际大厦乙段 B807 号</p> <p>法定代表人: 伍项舟</p> <p>联系人: 伍项舟</p> <p>联系电话: 010-68133888</p> <p>传真: 010-68133888</p> <p>网址: www.bjfqtz.com</p>	<p>(二) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人概况</p> <p>名称: 北京蜂雀投资管理有限公司</p> <p>住所: 北京市朝阳区农光里 117 号楼 1-6 内 5 层 520 室</p> <p>通讯地址: 北京市朝阳区农光里 117 号劲松大厦 A 座 520 室</p> <p>法定代表人: 贾凯</p> <p>联系人: 伍项舟</p> <p>联系电话: 010-68133888</p> <p>传真: 010-68133888</p> <p>网址: www.bjfqtz.com</p>

序号 3

十七、基金的费用与税收

原条款:	现条款:
1、管理费	1、管理费

<p>基金的年管理费率为 2%。计算方法如下： $H = E \times 2\% \div N$</p> <p>H：每日应计提的管理费 E：前一日的基金资产净值 N：当年天数</p> <p>本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按月支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然月度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。</p>	<p>基金的年管理费率为 1%。计算方法如下： $H = E \times 1\% \div N$</p> <p>H：每日应计提的管理费 E：前一日的基金资产净值 N：当年天数</p> <p>本基金的管理费每日计提，按月支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然月度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>4、基金管理人的业绩报酬</p> <p>业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。</p> <p>当基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期收益的 50%作为业绩报酬。</p> <p>业绩报酬的计提方法如下：</p> <p>当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的收益率(R)提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎</p>	<p>4、基金管理人的业绩报酬</p> <p>业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。</p> <p>当基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期收益的 20%作为业绩报酬。</p> <p>业绩报酬的计提方法如下：</p> <p>当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的收益率(R)提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎</p>

回基金资金清算款中或分红款项中以现金支付。

其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=赎回日、分红除权日或基金终止日基金累计份额净值；

C=上一个业绩报酬提取日基金累计份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 C 为该份额申购开放日基金累计份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日基金份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

$$\text{收益率} R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$$

业绩报酬计提标准为：

当 $R > 0\%$ 时，对超过 0% 的收益部分提取 50% 的业绩报酬，即 $E = F \times (A - C) \times 50\%$ ；

如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。

回基金资金清算款中或分红款项中以现金支付。

其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=赎回日、分红除权日或基金终止日基金累计份额净值；

C=上一个业绩报酬提取日基金累计份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 C 为该份额申购开放日基金累计份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日基金份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

$$\text{收益率} R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$$

业绩报酬计提标准为：

当 $R > 0\%$ 时，对超过 0% 的收益部分提取 20% 的业绩报酬，即 $E = F \times (A - C) \times 20\%$ ；

如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。

<p>业绩报酬在基金份额持有人分红、赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算，基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金、分红款或清算资金中扣除后支付，由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令，基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。</p>	<p>业绩报酬在基金份额持有人分红、赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算，基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金、分红款或清算资金中扣除后支付，由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令，基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。</p>
--	--

二、变更流程

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的《复函》后，我司将按照基金合同的约定向基金份额持有人披露基金合同变更事宜，征询基金份额持有人合同变更意见。合同变更生效后按监管规定及时向监管机构报备。

若由于基金管理人未及时将向基金份额持有人发送的变更意见征询函中指定的具体回复期限告知基金托管人而导致托管人无法确定变更生效时间，由此造成的任何形式的纠纷与托管人无关，由管理人承担由此造成的法律后果。在无充分文件证明变更生效时间前，托管人将严格按照原协议履行其托管职责。以上事宜，请贵司确认。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。

北京蜂雀投资管理有限公司

2020年11月5日



复 函

北京蜂雀投资管理有限公司：

贵司发来的《关于蜂雀量化市场中性 2 号私募证券投资基金基金合同变更的意见征询函（202001）》收悉，经研究，对贵司在来函中所述的合同条款变更内容不持异议。

本确认函一式两份，双方各执一份。

招商证券股份有限公司托管部（盖章）



签署日：

2020 年 11 月 13 日

Handwritten scribble or signature.

Handwritten scribble or signature.

Handwritten scribble or signature.