



交银施罗德德国证新能源指数分级 证券投资基金基金合同

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二零一九年十二月

目 录

第一部分	前言.....	2
第二部分	释义.....	4
第三部分	基金的基本情况.....	11
第四部分	基金份额的分级与净值计算规则.....	13
第五部分	基金份额的发售.....	17
第六部分	基金备案.....	19
第七部分	交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的上市交易.....	21
第八部分	交银新能源份额的申购与赎回.....	23
第九部分	基金的非交易过户、转托管等其他业务.....	32
第十部分	场内份额的配对转换.....	35
第十一部分	基金合同当事人及权利义务.....	38
第十二部分	基金份额持有人大会.....	46
第十三部分	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	55
第十四部分	基金的托管.....	58
第十五部分	基金份额的登记.....	59
第十六部分	基金的投资.....	61
第十七部分	基金的财产.....	67
第十八部分	基金资产估值.....	68
第十九部分	基金费用与税收.....	74
第二十部分	基金的收益与分配.....	77
第二十一部分	基金份额折算.....	78
第二十二部分	基金合同的会计与审计.....	87
第二十三部分	基金的信息披露.....	88
第二十四部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	95
第二十五部分	违约责任.....	97
第二十六部分	争议的处理和适用的法律.....	98
第二十七部分	基金合同的效力.....	99
第二十八部分	其他事项.....	100
第二十九部分	基金合同内容摘要.....	101

第一部分 前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性规定》”)和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

三、交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其

内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金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。

六、本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

第二部分 释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指交银施罗德基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或《招募说明书》：指《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金之新能源 A 与新能源 B 上市交易公告书》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、基金产品资料概要：指《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及其后颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、投资人或投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指交银施罗德基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

26、会员单位：指具有基金销售业务资格，经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深圳证券交易所会员单位

27、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统，而通过直销机构和其它场外销售机构的柜台系统或其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

28、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场内认购、场内申购和场内赎回

29、标的指数：指国证新能源指数

30、交银新能源份额：指本基金的基础份额。投资者在场外认/申购的交银新能源份额不进行基金份额自动分离，也不可以选择基金份额分拆；投资者在场内认购的交银新能源份额将在基金合同生效后自动进行基金份额分离；投资者在场内申购的交银新能源份额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆

31、交银新能源 A 份额：指交银新能源份额按基金合同约定规则自动分离或投资者选择分拆所得到的稳健收益类基金份额

32、交银新能源 B 份额：指交银新能源份额按基金合同约定规则自动分离或投资者选择分拆所得到的积极收益类基金份额

33、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外认购、申购的交银新能源份额登记在注册登记系统

34、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内认购、申购的交银新能源份额和上市交易的交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额登记在证券登记结算系统

35、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

36、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

37、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括

投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务和基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

38、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为交银施罗德基金管理有限公司或接受交银施罗德基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

39、**开放式基金账户**：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的注册登记系统

40、**深圳证券账户**：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的证券登记结算系统

41、**基金交易账户**：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、交易、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

42、**基金合同生效日**：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

43、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

44、**基金募集期**：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

45、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

46、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

47、**T日**：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

- 48、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 49、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 50、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 51、《业务规则》：指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订
- 52、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 53、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 54、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 55、上市交易：指基金合同生效后，投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的行为
- 56、自动分离：指基金合同生效后，投资人在场内认购的每 2 份交银新能源份额按照 1:1 的比例自动转换为 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额
- 57、分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份交银新能源份额的场内份额申请转换成 1 份交银新能源 A 份额与 1 份交银新能源 B 份额的行为
- 58、合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份交银新能源 A 份额与 1 份交银新能源 B 份额申请转换成 2 份交银新能源份额的场内份额的行为
- 59、配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的场内交银新能源份额与交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并
- 60、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
- 61、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所

持基金份额销售机构的操作

62、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

63、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

64、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构在投资人指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日受理基金申购申请的一种投资方式

65、巨额赎回：指本基金单个开放日，交银新能源份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）的 10% 的情形

66、元：指人民币元

67、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

68、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

69、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

70、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

71、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额（参考）净值的过程

72、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

73、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露

网站)等媒介

74、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金的基本情况

一、基金名称

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

二、基金的类别

股票型证券投资基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

四、基金的投资目标

本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不得超过 4%。

五、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

六、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。

七、基金存续期限

不定期

八、标的指数

本基金的标的指数为国证新能源指数。

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止国证新能源

指数的编制、发布或授权，或国证新能源指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致国证新能源指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称等。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

九、基金份额的上市交易

基金合同生效后，场内的交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额将同时申请在深圳证券交易所上市交易。

第四部分 基金份额的分级与净值计算规则

一、基金份额结构

本基金的基金份额包括本基金之基础份额（即“交银新能源份额”）、稳健收益类份额（即“交银新能源 A 份额”）与积极收益类份额（即“交银新能源 B 份额”）。其中，交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

二、基金运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金合同生效后，投资者场外认购所得的份额，将被确认为场外交银新能源份额；投资者场内认购所得的全部份额将按 1：1 的基金份额配比自动分离为交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额，场内认购份额的自动分离由基金管理人委托登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

2、基金合同生效后，交银新能源份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，暂不上市交易。在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额可在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同，但不可进行申购或赎回。

3、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额与交银新能源份额的资产合并投资运作。

4、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的交银新能源份额与交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额之间的场内份额配对转换业务（有关本基金场内份额配对转换业务的内容详见基金合同第十部分“场内份额的配对转换”），即：基金份额持有人可将其持有的每 2 份场内交银新能源份额，按 1：1 的基金份额配比，申请分拆为 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额；或基金份额持有人可将其持有的每 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额，申请合并为 2 份交银新能源份额的场内份额。场外的交银新能源份额不进行分拆，也不进行自动分离。场外的交银新能源份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的交银新能源份额配对转换规则进行操作。

5、基金合同生效后，基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算基准日

对基金份额进行折算(有关本基金基金份额折算的内容详见基金合同第二十一部分“基金份额折算”),折算后交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额配比保持 1:1 不变。经定期份额折算或不定期份额折算所产生的场内交银新能源份额不进行自动分离,基金份额持有人可选择将定期份额折算或不定期份额折算产生的每 2 份场内交银新能源份额按 1:1 的基金份额配比申请分拆为 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额。

6、自动分离或配对转换后的份额采用截位的方式,保留到整数位,整数位后的小数份额的处理方式以登记机构的处理规则为准,交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额最终的计算结果以登记机构的记录为准。

三、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值计算规则

根据交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的风险和收益特性不同,本基金份额所自动分离或分拆的两类基金份额交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额具有不同的基金份额参考净值计算规则。

在本基金的存续期内,本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额分别进行基金份额参考净值计算,交银新能源 A 份额为低预期风险且预期收益相对稳定的基金份额,本基金净资产优先确保交银新能源 A 份额的本金及交银新能源 A 份额累计约定应得收益;交银新能源 B 份额为高预期风险且预期收益相对较高的基金份额,本基金在优先确保交银新能源 A 份额的本金及累计约定应得收益后,将剩余净资产计为交银新能源 B 份额的净资产。

在本基金存续期内,交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值计算规则如下:

1、交银新能源 A 份额约定年基准收益率为“同期中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款利率(税后)+3%”,同期中国人民银行公布的金融机构人民币一年期定期存款利率(税后)以最近一次定期份额折算基准日次日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)为准。基金合同生效日所在年度交银新能源 A 份额的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)+3%”。年基准收益均以 1.00 元为基准进行计算;

2、本基金每个工作日对交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额进行基金份

额参考净值计算。在进行交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金份额参考净值计算时，本基金资产净值优先确保交银新能源 A 份额的本金及累计约定应得收益，之后的剩余资产净值计为交银新能源 B 份额的净资产。交银新能源 A 份额累计约定应得收益按依据交银新能源 A 份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日交银新能源 A 份额应计收益的天数确定；

3、每 2 份交银新能源份额的资产净值等于 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额的资产净值之和；

4、在本基金的基金合同生效日至基金份额参考净值计算日，若未发生基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则交银新能源 A 份额在基金份额参考净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的定期份额折算或不定期份额折算，则交银新能源 A 份额在基金份额参考净值计算日应计收益的天数应按照最近一次基金份额折算基准日次日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证交银新能源 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，在本基金资产出现极端损失情况下，交银新能源 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

四、本基金基金份额（参考）净值的计算

本基金作为分级基金，按照交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值计算规则，并依据以下公式分别计算并公告 T 日交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值：

1、交银新能源份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$$T \text{ 日交银新能源份额的基金份额净值} = T \text{ 日闭市后本基金基金资产净值} / T \text{ 日本基金的基金份额总数}$$

其中，T 日闭市后本基金基金资产净值指 T 日本基金基金资产总值减去基金负债后的价值，T 日本基金的基金份额总数为 T 日交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的份额数之和。

2、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_A = (1 + R)^{t/N}$$

$$NAV_B = \frac{NAV - 0.5 \times NAV_A}{0.5}$$

假设：

T 日为基金份额参考净值计算日；

N 为当年实际天数；

$t = \min\{\text{自基金合同生效日至 T 日, 自最近一次基金份额折算基准日次日至 T 日}\}$ ；

NAV 为 T 日交银新能源份额的基金份额净值；

NAV_A 为 T 日交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

NAV_B 为 T 日交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

R 为交银新能源 A 份额的约定年基准收益率。

交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值的计算均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

在基金份额折算基准日（包括定期折算基准日和不定期折算基准日），按照上述原则计算出来的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值均为折算基准日折算前各类份额的基金份额（参考）净值。

第五部分 基金份额的发售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

通过各销售机构公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

投资人可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。基金合同生效后，投资者场外认购所得的全部份额将确认为场外交银新能源份额；投资者场内认购所得的全部份额将按 1：1 的基金份额配比自动分离为交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额。

场外发售渠道包括直销机构和其他场外销售机构；场内发售渠道为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可、通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可办理场内基金份额的发售。尚未取得基金销售业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得提前发售基金份额。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。

2、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

4、认购份额余额的处理方式

场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购的份额按整数申报，在发售结束后，全部总份额按照1:1的比例自动分离成交银新能源A份额和交银新能源B份额，利息折算的份额及自动分离的交银新能源A和交银新能源B份额计算结果均采用截位的方式，保留到整数位，余额计入基金财产。

三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资人在募集期内可多次认购，认购申请一经登记机构受理不得撤销。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。

第六部分 基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
- 2、在基金募集期限届满后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;
- 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。

基金合同生效后的存续期内,出现以下情形之一的,基金管理人应当决定本基金与基金管理人管理的同一类别其他基金合并,不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 基金份额持有人数量连续 60 个工作日不满 200 人。
- (2) 基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元。

若届时基金管理人已同时管理多只与本基金同一类别的基金的，基金管理人有权选择与本基金风险收益特征最接近的基金进行合并。

法律法规另有规定时，从其规定。

第七部分 交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的上市交易

一、上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市交易。

交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市后，登记在证券登记结算系统中的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的交银新能源份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统并申请分拆成交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额后，方可上市交易。

交银新能源份额在条件成熟后也可由基金管理人在履行相关程序后申请上市交易。若交银新能源份额上市交易，基金管理人可根据需要修改配对转换规则、对交银新能源份额进行折算并修改基金合同相关内容，且无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应当在实施前依照《信息披露办法》的规定提前公告。

二、上市交易的地点

本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的上市交易的地点为深圳证券交易所。

三、上市交易的时间

基金合同生效后六个月内具备下列条件的，可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及相关法律法规，向深圳证券交易所申请上市交易：

- 1、本基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、本基金基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、深圳证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。在确定上市交易的时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。

四、上市交易的规则

本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规

则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定，包括但不限于：

1、本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额以不同的交易代码分别上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价分别为前一交易日两类基金份额各自的基金份额参考净值；

2、本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；

3、本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额买入申报数量为 100 份或其整数倍；

4、本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；

5、本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》及相关规定。

五、上市交易的费用

本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定执行。

六、上市交易的行情揭示

本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日两类基金份额各自的基金份额参考净值。

七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规和深圳证券交易所的相关规定执行。

八、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

九、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第八部分 交银新能源份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后,投资者可通过场内或场外两种方式对交银新能源份额进行申购与赎回。本基金的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额只上市交易,不接受申购与赎回。

一、申购和赎回场所

交银新能源份额的申购与赎回将通过销售机构进行,其中销售机构包括场内销售机构和场外销售机构。场内销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位;场外销售机构包括直销机构和其他场外销售机构。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理交银新能源份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理交银新能源份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,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,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理交银新能源份额的申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理交银新能源份额的赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理交银新能源份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其交银新能源份额申购、赎回价格为下一开放日交银新能源份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的交银新能源份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，但申请经登记机构受理的不得撤销；

4、投资者办理交银新能源份额场外申购、赎回应使用开放式基金账户，办理交银新能源份额场内申购、赎回应使用深圳证券账户；

5、基金份额持有人在场外赎回交银新能源份额时，除指定赎回外，基金管理人按“先进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即登记确认日期在前的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率；

6、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理交银新能源份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的交银新能源份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购交银新能源份额时，必须全额交付申购款项，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。投资人全额交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

投资人递交赎回交银新能源份额申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人或基金管理人委托的登记机构应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额保留余额，具体规定请参见招募说明书。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、对于场内申购、赎回及持有场内交银新能源份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额和最低基金份额保留余额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、交银新能源份额基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的交银新能源份额基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日（包括该日）内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：交银新能源份额申购份额的计算详见《招募说明书》。交银新能源份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的交银新能源份额基金份额净值，有效份额单位为份，场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购份额计算结果采用截位的方式，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资人。

3、赎回金额的计算及处理方式：交银新能源份额赎回金额的计算详见《招募说明书》。交银新能源份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日交银新能源份额基金份额净值并扣除相应的费用。赎回金额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

5、赎回费用由赎回交银新能源份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

6、本基金交银新能源份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确

定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率和赎回费率。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、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现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使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，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、发生本基金合同约定的定期份额折算、不定期份额折算等基金份额折算事项，根据相关业务规则本基金须暂停接受申购申请的情形。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。出现上述情形时，基金管理人有权将上述申购申请全部或部分确认失败。
- 9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确

认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

10、基金合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生本基金合同约定的定期份额折算、不定期份额折算等基金份额折算事项，根据相关业务规则本基金须暂停接受赎回申请的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人认为继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

8、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

9、基金合同约定、法律法规规定或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接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外的赎回申请，应将可支付

部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期确认并支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。交银新能源份额的基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回部分，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。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公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若交银新能源份额单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的交银新能源份额基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日基金总份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）20%的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于该类基金份额持有人当日超过 20%的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于该类基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，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，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，不迟于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近一个开放日交银新能源份额的基金份额净值。

十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金交银新能源份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理交银新能源份额定期定额投资计划，具体规则

由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

第九部分 基金的非交易过户、转托管等其他业务

一、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

二、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。交银新能源份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的转托管仅包括系统内转托管。

1、基金份额的登记

(1) 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购的交银新能源份额，登记在注册登记系统中基金份额持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购的交银新能源份额，以及上市交易的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额，登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

(2) 登记在证券登记结算系统中的交银新能源份额，不在深圳证券交易所上市交易，可以直接申请场内赎回，也可经跨系统转托管至注册登记系统后申请场外赎回，或经基金份额持有人申请，将每 2 份交银新能源份额按 1: 1 的份额配比分拆为 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额后，在深圳证券交易所上市交易。

(3) 登记在证券登记结算系统中的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额

在深圳证券交易所上市交易，不能直接单独申请场内赎回或跨系统转托管至场外，但经基金份额持有人申请，可将每 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额合并为 2 份场内交银新能源份额后，再申请场内赎回或跨系统转托管至注册登记系统后申请场外赎回。

(4) 登记在注册登记系统中的交银新能源份额，既可以直接申请场外赎回，也可经跨系统转托管至证券登记结算系统后，申请场内赎回或经基金份额持有人申请，将每 2 份场内交银新能源份额分拆为 1 份交银新能源 A 份额和 1 份交银新能源 B 份额，并在深圳证券交易所上市交易。

2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的交银新能源份额在注册登记系统内不同销售机构之间，或将持有的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额在证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理交银新能源份额场外赎回业务的销售机构时，需办理已持有交银新能源份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理交银新能源份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，需办理已持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的交银新能源份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

(2) 本基金交银新能源份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

三、基金份额的冻结和解冻

登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

四、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务、转让或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

第十部分 场内份额的配对转换

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的交银新能源份额与交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额之间的场内份额配对转换业务。

一、场内份额配对转换

1、场内份额配对转换：指根据基金合同约定，本基金的场内交银新能源份额与交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆与合并。

2、分拆：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份交银新能源份额的场内份额申请转换成 1 份交银新能源 A 份额与 1 份交银新能源 B 份额的行为。

3、合并：指根据基金合同约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份交银新能源 A 份额与 1 份交银新能源 B 份额申请转换成 2 份交银新能源份额的场内份额的行为。

4、场外的交银新能源份额不可以进行份额配对转换，但通过跨系统转托管至证券登记结算系统后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

二、业务办理机构

本基金场内份额配对转换业务的办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人应当在场内份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式，办理场内份额配对转换。深圳证券交易所、登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

三、业务办理时间

场内份额配对转换，自交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额上市交易后不超过 6 个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理份额配对转换日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

四、场内份额配对转换的原则

1、场内份额配对转换以份额申请。

2、如果申请场内份额的分拆，交银新能源份额的场内份额数，必须是相关业务公告规定份额的 2 份的整数倍。

3、如果申请场内份额的合并，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额必须同时配对申请，且交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍，份额配比为 1：1。

4、交银新能源份额的场外份额如需申请进行场内份额的分拆，须跨系统转托管为交银新能源份额的场内份额后方可进行。

5、场内份额配对转换，应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在指定媒介公告。

五、业务办理程序

场内份额配对转换程序，遵循深圳证券交易所、登记机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

六、暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停接受份额配对转换。

3、基金管理人根据某一类或几类基金份额数量情况，认为有必要暂停分拆或合并的。

4、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况之一的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停场内份额配对转换业务公告。

当暂停场内份额配对转换业务的情况消除，基金管理人恢复场内份额配对转换业务时，应当根据有关规定在指定媒介上刊登恢复场内份额配对转换业务公告。

七、业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，场内份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

八、深圳证券交易所、登记机构调整上述规则，本基金合同将视需要进行相应修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

第十一部分 基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号交通银行大楼二层（裙）

法定代表人：阮红

设立日期：2005 年 8 月 4 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]128 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）61055050

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理交银新能源份额申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制定和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、上市交易、份额配对转换等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 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，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算交银新能源份额的认购、申购、赎回和注

销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息、交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值，确定交银新能源基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理交银新能源份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）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；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有

人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复[2004]143 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、协助开立股指期货业务相关账户及交易编码、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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，负责基金财产托管事宜；

(3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，协助开立股指期货业务相关账户及交易编码，按照《基金合同》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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值、交银新能源份额的申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得本基金的基金份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额），即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金

合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额仅在其各自份额类别内具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法并按照基金合同和招募说明书的规定转让其持有的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额，申请赎回或转让其持有的交银新能源份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 遵守基金管理人、基金托管人、深圳证券交易所、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

(10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第十二部分 基金份额持有人大会

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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一份基金份额在其对应的份额类别内拥有同等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认/申购、场外认/申购、上市交易、分拆合并等）而有所差异。

本基金份额持有人大会未设日常机构。

一、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) 终止《基金合同》，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人，但因涉及本基金与其他基金合并的除外；
- (4) 转换基金运作方式，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 终止交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的、以及基金合同另有约定的除外；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金

份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②指单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同；依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额持有人”或其类似表述）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整交银新能源份额的申购费率、调低赎回费率、在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更或增加收费方式；

（4）标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更标的指数许可使用费率和计费方式；

（5）因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（6）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（7）在法律法规允许的情况下基金推出新业务或服务；

（8）变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项）；

（9）基金管理人、登记机构、深圳证券交易所、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、转换、非交易过户、转托管、上市交易、份

额配对转换等业务的规则；

(10) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、基金合同生效后的存续期内，出现以下情形之一的，基金管理人应当决定本基金与基金管理人管理的同一类别其他基金合并，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 基金份额持有人数量连续 60 个工作日不满 200 人。

(2) 基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元。

若届时基金管理人已同时管理多只与本基金同一类别的基金的，基金管理人有权选择与本基金风险收益特征最接近的基金进行合并。

二、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，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，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）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和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管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和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召

开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（①含二分之一；②指有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额分别占权益登记日各自份额类别基金总份额不少于二分之一，下同）。若到会者在权益登记日代表的有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金份额少于本基金在权益登记日其各自份额类别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额应不少于在权益登记日各自份额类别基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金

管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额不小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自份额类别基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用网络、电话、短信等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权；本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人或其代理人在各自份额类别内所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人或其代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金

与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

七、计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进

行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九、本部分对基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十三部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形

（一）基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- 1、被依法取消基金管理资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

（二）基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1、被依法取消基金托管资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

（一）基金管理人的更换程序

1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

3、临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

4、备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须经中国证监会备案；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额

持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；

6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；

7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；

8、基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。

（二）基金托管人的更换程序

1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

3、临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介公告；

6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值；

7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务

所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。

第十四部分 基金的托管

基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。

订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

第十五部分 基金份额的登记

一、基金份额的登记业务

本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

二、基金登记业务办理机构

本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

三、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间和相关业务规则进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、如因登记机构的原因而造成基金管理人或者基金份额持有人损失的，依法承担相应的赔偿责任；

8、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第十六部分 基金的投资

一、投资目标

本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以国证新能源指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照国证新能源指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其

他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，其余资产可投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定），其目的是在保证基金资产流动性的前提下，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在建仓期或者出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(13) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(16) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(17) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金

额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(19) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(10)、(20)、(21) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

五、业绩比较基准

国证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

本基金的标的指数为国证新能源指数。国证新能源指数是由深圳证券信息有限公司编制，代表性和可投资性受到市场认可。

由于本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，因此本基金业绩比较基准中同时加入了5%的银行活期存款利率(税后)。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止国证新能源指数的编制、发布或授权，或国证新能源指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致国证新能源指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称等。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

除上述情形外，如果今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基

金份额持有人大会。

六、风险收益特征

本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银新能源 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银新能源 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

七、基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

八、基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的有关规定进行融资、融券。

第十七部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第十八部分 基金资产估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或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；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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；

(2) 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如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；

(3) 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如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；

(4) 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，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：

(1) 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估值方法估值；

(2) 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；

(3) 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估值方法估值；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、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，采用估值技术确定公允价值。

4、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。

5、本基金投资股指期货合约，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。

6、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。

7、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，按法律法规以及监管部门最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金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份额持有人利益时，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，按照基金管理人根据基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份

额的基金份额参考净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

五、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。当交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值小数点后第 3 位以内（含第 3 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

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，进而导致基金资产净值计算错误造成投资人或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的投资人或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

本基金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或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及

时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

(2) 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。

(3) 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。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 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。

(5) 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:

(1) 查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1) 基金份额(参考)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。

(2) 错误偏差达到交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 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。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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份额持有人的利益，决定延迟估值；

4、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金资产净值、交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额的基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值、交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值予以公布。

八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公

司及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

第十九部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金标的指数许可使用费；
- 4、基金上市初费及上市年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效日起，基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效日起，基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。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。

3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数许可使用费。本基金标的指数许可使用费年费率为 0.02%，基金合同生效之日所在季度的标的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元，若季度不足 5 万元时按照 5 万元收取。标的指数许可使用费在通常情况下按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

如果标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计费方式，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，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，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金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、基金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、《基金合同》生效前的相关费用；

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、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第二十部分 基金的收益与分配

本基金（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）存续期内不进行收益分配。

第二十一部分 基金份额折算

一、基金份额定期折算

交银新能源 A 份额、交银新能源份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的第一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金份额的定期折算。

1、基金份额定期折算基准日

每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）的第一个工作日。

但基金合同生效日至第 1 个定期折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期折算；定期折算基准日前 3 个月内发生过不定期折算的，则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算，基金管理人应在基金份额定期折算基准日前至少提前 2 日在指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公告。

2、基金份额定期折算的对象

基金份额定期折算基准日登记在册的交银新能源 A 份额、交银新能源份额。

3、基金份额定期折算频率

每个会计年度进行 1 次（可不进行定期折算的情形除外）。

4、基金份额定期折算方式

（1）在每个基金份额定期折算基准日，本基金将对当日登记在册的交银新能源 A 份额进行应得收益的定期份额折算，交银新能源份额的基金份额净值也相应的进行调整。在基金份额折算前与折算后，交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。

（2）折算前的交银新能源 A 份额持有人，以交银新能源 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 A 份额持有人持有的交银新能源 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额。

（3）折算前的交银新能源份额持有人，以每 2 份交银新能源份额配比 1 份交银新能源 A 份额进行份额分配，获得新增交银新能源份额。持有场外交银新

能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外交银新能源份额的分配；持有场内交银新能源份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内交银新能源份额的分配。

(4) 折算不改变交银新能源 B 份额持有人的资产净值，其持有的交银新能源 B 份额的基金份额参考净值及份额数量不变。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

5、基金份额定期折算公式

(1) 交银新能源 A 份额

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

交银新能源 A 份额持有人持有的新增场内交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV^{\text{后}}}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

$NAV^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

(2) 交银新能源 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变交银新能源 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

(3) 交银新能源份额

$$NAV^{\text{后}} = NAV^{\text{前}} - \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.000}{2}$$

折算后交银新能源份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{(NAV^{\text{前}} - NAV^{\text{后}}) \times NUM^{\text{前}}}{NAV^{\text{后}}}$$

定期份额折算后交银新能源份额的总份额数 = 定期份额折算前交银新能源的份额数 + 交银新能源份额持有人新增的交银新能源份额的份额数+ 交银新能源 A 份额持有人新增的交银新能源份额的份额数

其中：

NUM^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的份额数；

NAV^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

NAV^后：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

6、基金份额定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额定期折算期间的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的上市交易、交银新能源份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

7、基金份额定期折算结果的公告

基金份额定期折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告，并报中国证监会备案。

二、基金份额不定期折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在交银新能源份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元或交银新能源 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时进行不定期份额折算。

1、交银新能源份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时的不定期折算

(1) 基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银新能源份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元，基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

(2) 基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额、交银新能源份额。

(3) 基金份额不定期折算频率

不定期。

(4) 基金份额不定期折算方式

1) 折算前的交银新能源份额持有人，获得新增交银新能源份额的份额分配。交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元，份额数量相应折算增加；

2) 折算前的交银新能源 A 份额持有人，以交银新能源 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 A 份额持有人持有的交银新能源 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额；

3) 折算前的交银新能源 B 份额持有人，以交银新能源 B 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内交银新能源份额的份额分配。交银新能源 B 份额持有人持有的交银新能源 B 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内交银新能源份额。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5) 基金份额折算公式

1) 交银新能源 A 份额

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_A^{\text{前}} = NUM_A^{\text{后}}$$

折算后交银新能源 A 份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM_{A前} \times (NAV_{A前} - 1.000)$$

其中：

$NUM_{A前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的份额数；

$NUM_{A后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的份额数；

$NAV_{A前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_{A后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

2) 交银新能源 B 份额

$$NAV_{B后} = 1.000$$

$$NUM_{B前} = NUM_{B后}$$

折算后交银新能源 B 份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM_{B前} \times (NAV_{B前} - 1.000)$$

其中：

$NUM_{B前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的份额数；

$NUM_{B后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的份额数；

$NAV_{B前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV_{B后}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

3) 交银新能源份额

$$NAV_{后} = 1.000$$

折算后交银新能源份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$NUM_{前} \times (NAV_{前} - 1.000)$$

折算后交银新能源份额的总份额数=折算前交银新能源份额的份额数+交银新能源份额持有人新增的交银新能源份额数+交银新能源 A 份额持有人新增的场内交银新能源份额数+交银新能源 B 份额持有人新增的场内银新能源份额数

其中：

$NUM_{前}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源份额的份额数；

NAV^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

NAV^后：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值。

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

2、交银新能源 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时的不定期折算

(1) 基金份额不定期折算基准日

如果某个工作日交银新能源 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元，基金管理人可根据市场情况确定不定期折算基准日。不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

(2) 基金份额不定期折算的对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额、交银新能源份额。

(3) 基金份额不定期折算频率

不定期。

(4) 基金份额不定期折算方式

1) 交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整；

2) 交银新能源 A 份额持有人持有的交银新能源 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整，相应折算增加交银新能源份额；

3) 折算不改变交银新能源 B 份额持有人的资产净值，其持有的交银新能源 B 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整；

4) 交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的基金份额配比保持 1: 1 的比例不变。

按照上述折算方法，由于计算过程尾差处理的原因，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，该误差归入基金财产，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(5) 基金份额折算公式

1) 交银新能源 B 份额

$$NAV_B^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_B^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

$NAV_B^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 B 份额的基金份额参考净值；

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

2) 交银新能源 A 份额

$$NAV_A^{\text{后}} = 1.000$$

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

折算后交银新能源 A 份额持有人持有的新增交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ ：份额折算基准日折算前交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

$NAV_A^{\text{后}}$ ：份额折算基准日折算后交银新能源 A 份额的基金份额参考净值；

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

3) 交银新能源份额

$$NAV^{\text{后}} = 1.000$$

折算后交银新能源份额持有人持有的交银新能源份额的份额数为：

$$\frac{NUM^{\text{前}} \times NAV^{\text{前}}}{1.000}$$

折算后交银新能源份额的总份额数=交银新能源份额持有人持有的折算后的交银新能源份额的份额数+交银新能源 A 份额持有人新增的场内交银新能源份额数

其中：

NUM^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的份额数；

NAV^前：份额折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值；

NAV^后：份额折算基准日折算后交银新能源份额的基金份额净值；

上述计算过程中的尾差处理方式具体见招募说明书。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金份额不定期折算期间的基金业务办理

为保证基金份额不定期折算期间的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停交银新能源 A 份额与交银新能源 B 份额的上市交易、交银新能源份额的申购或赎回及场内份额配对转换等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

4、基金份额不定期折算结果的公告

基金份额不定期折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介上公告，并报中国证监会备案。

三、特殊情况的处理

若在某一个会计年度的定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算，具体以基金管理人届时发布的公告为准。

基金合同生效日至第 1 个定期折算基准日不足 6 个月的，则该年度可不进行定期折算。

定期折算基准日前 3 个月内发生过不定期折算的，则该年度可不进行定期折算。若基金管理人在前述情况下决定不进行定期折算，基金管理人应在基金份额定期折算基准日前至少提前 2 日在指定媒介上公告不进行定期折算的提示性公

告。

四、基金管理人、深圳证券交易所、登记机构有权调整上述规则，本基金《基金合同》将视需要进行相应修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

第二十二部分 基金合同的会计与审计

一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、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、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人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，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月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。

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

第二十三部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性规定》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- 2、对证券投资业绩进行预测;
- 3、违规承诺收益或者承担损失;
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(三) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。

(四) 上市交易公告书

交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额获准在深圳证券交易所上市交易的，

基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前,将上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(五) 基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理交银新能源份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

在开始办理交银新能源份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

(六) 交银新能源份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明交银新能源份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

(七) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情

形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

（八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管

业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费、标的指数许可使用费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、交银新能源份额开始办理申购、赎回；

18、交银新能源份额发生巨额赎回并延期办理；

19、交银新能源份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、交银新能源份额暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；

22、本基金暂停接受份额配对转换申请后恢复办理份额配对转换业务；

23、本基金实施基金份额折算（包括定期折算、不定期折算）；

24、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额上市交易；

25、交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；

26、交银新能源 A 份额约定年基准收益率的设定及其调整；

27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

28、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（九）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

（十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

(十一) 清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(十二) 本基金投资股指期货,基金管理人需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

(十三) 中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值、交银新能源份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要

在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所和基金上市交易的证券交易所网站，供社会公众查阅、复制。

八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、本基金作为被合并方与其他基金进行合并的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产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) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月，若遇基金持有的有价证券出现长期休市、停牌或其他流通受限的情形除外。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将根据基金合同终止日交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的资产净值计算并确定三类基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此对三类基金份额的持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

第二十五部分 违约责任

一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金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；

3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

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份额持有人利益的前提下，《基金合同》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投资人损失，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减轻或消除由此造成的影响。

第二十六部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

第二十七部分 基金合同的效力

《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。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅，但应以《基金合同》正本为准。

第二十八部分 其他事项

《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

第二十九部分 基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理交银新能源份额申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构

或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制定和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、上市交易、份额配对转换等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(二) 基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 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，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算交银新能源份额的认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息、交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值，确定交银新能源基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不

向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理交银新能源份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- (2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、协助开立股指期货业务相关账户及交易编码、为基金办理证券交易资金清算；
- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(四) 基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，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，负责基金财产托管事宜；
- (3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，协助开立股指期货业务相关账户及交易编码，按照《基金合同》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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额（参考）净值、交银新能源份额的申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人

利益向基金管理人追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(五) 基金份额持有人的权利

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得本基金的基金份额（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额），即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额仅在其各自份额类别内具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法并按照基金合同和招募说明书的规定转让其持有的交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额，申请赎回或转让其持有的交银新能源份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(六) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资

价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、基金托管人、深圳证券交易所、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
- (11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一份基金份额在其对应的份额类别内拥有同等的投票权，且相同类别基金份额的同等投票权不因基金份额持有人取得基金份额的方式（场内认/申购、场外认/申购、上市交易、分拆合并等）而有所差异。

本基金份额持有人大会未设日常机构。

（一）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) 终止《基金合同》，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
 - (2) 更换基金管理人；
 - (3) 更换基金托管人，但因涉及本基金与其他基金合并的除外；
 - (4) 转换基金运作方式，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；
 - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等

报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(9) 变更基金份额持有人大会程序，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 终止交银新能源 A 份额、交银新能源 B 份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的、以及基金合同另有约定的除外；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（①以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同；②指单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人，下同；依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金总份额 10%以上基金份额持有人”或其类似表述）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整交银新能源份额的申购费率、调低赎回费率、在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更或增加收费方式；

(4) 标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更标的指数许可使用费费率和计费方式;

(5) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

(7) 在法律法规允许的情况下基金推出新业务或服务;

(8) 变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项);

(9) 基金管理人、登记机构、深圳证券交易所、销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、转换、非交易过户、转托管、上市交易、份额配对转换等业务的规则;

(10) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

3、基金合同生效后的存续期内,出现以下情形之一的,基金管理人应当决定本基金与基金管理人管理的同一类别其他基金合并,不需召开基金份额持有人大会:

(1) 基金份额持有人数量连续 60 个工作日不满 200 人。

(2) 基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元。

若届时基金管理人已同时管理多只与本基金同一类别的基金的,基金管理人有权选择与本基金风险收益特征最接近的基金进行合并。

(二) 召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,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,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当

由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）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和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管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和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（①含二分之一；②指有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额分别占权益登记日各自份额类别基金总份额不少于二分之一，下同）。若到会者在权益登记日代表的有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自的基金份额少于本基金在权益登记日其各自份额类别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的交银新能源份额、交银新能源 A 份

额和交银新能源 B 份额应不少于在权益登记日各自份额类别基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额不小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额小于在权益登记日各自份额类别基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额各自份额类别基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用网络、电话、短信等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权；

本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证

机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人或其代理人在各自份额类别内所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额基金份额持有人或其代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名基金份额持有人代表

担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分对基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括交银新能源份额、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额）存续期内不进行收益分配。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金标的指数许可使用费；
- 4、基金上市初费及上市年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券、期货交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效日起，基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效日起，基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。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。

3、标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付标的指数许可使用费。本基金标的指数许可使用费年费率为 0.02%，基金合同生效之日所在季度的标的指数许可使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元，若季度不足 5 万元时按照 5 万元收取。标的指数许可使用费在通常情况下按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

自基金合同生效日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

如果标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计费方式，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，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,由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金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、基金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、《基金合同》生效前的相关费用;
- 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) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一) 投资目标

本基金采用指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。

(二) 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,以国证新能源指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照国证新能源指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%，其余资产可投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定），其目的是在保证基金资产流动性的前提下，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在建仓期或者出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。本基金力争利用股指期

货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

（四）投资限制

1、组合限制

（1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，本基金投资于国证新能源指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（8）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（10）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

(13) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;

(14) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%。其中, 有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等;

(15) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

(16) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(17) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(19) 本基金投资流通受限证券, 基金管理人应事先根据中国证监会相关规定, 与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例, 根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(20) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（20）、（21）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

（五）业绩比较基准

国证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

本基金的标的指数为国证新能源指数。国证新能源指数是由深圳证券信息有限公司编制，代表性和可投资性受到市场认可。

由于本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金业绩比较基准中同时加入了 5% 的银行活期存款利率(税后)。本基金管理人

认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止国证新能源指数的编制、发布或授权，或国证新能源指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致国证新能源指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称等。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

除上述情形外，如果今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或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；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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；

（2）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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如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；

(3) 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如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；

(4) 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，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：

(1) 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估值方法估值；

(2) 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；

(3) 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估值方法估值；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、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，采用估值技术确定公允价值。

4、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。

5、本基金投资股指期货合约，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。

6、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。

7、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，

按法律法规以及监管部门最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金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份额持有人利益时，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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（二）估值程序

1、交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将交银新能源份额的基金份额净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

（三）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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份额持有人的利益，决定延迟估值；

4、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（四）基金净值信息的公告

《基金合同》生效后，在开始办理交银新能源份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

在开始办理交银新能源份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的交银新能源份额的基金份额净值和基金份额累计净值、交银新能源 A 份额和交银新能源 B 份额的基金份额参考净值。

七、基金合同变更、解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并自决议生效后依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、本基金作为被合并方与其他基金进行合并的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产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)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7)对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，若遇基金持有的有价证券出现长期休市、停牌或其他流通受限的情形除外。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅，但应以《基金合同》正本为准。

本页无正文，为《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》的签字盖章页。

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司（公章）

法定代表人或授权代理人：

基金托管人：中国建设银行股份有限公司（公章）

法定代表人或授权代理人：

签订地点：北京

签订日：二〇一 年 月 日