（上接B10版）

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；

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）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，根据七例进行投资。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）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。

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）向其他金融机构、控股股东、实际控制人及其控股公司投资；

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恰当实地反映本基金的风险收益特征。

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B份额。

3、基金份额定期折算频率

每个会计年度进行1次（何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的份额。

3）折算前的交银新能源B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

$$\text{交银新能源A份额} = \text{交银新能源A份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

2）交银新能源B份额

$$\text{交银新能源B份额} = \text{交银新能源B份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

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。

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；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B份额。

3、基金份额定期折算频率

每个会计年度进行1次（何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参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的份额。

3）折算前的交银新能源B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

$$\text{交银新能源A份额} = \text{交银新能源A份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

2）交银新能源B份额

$$\text{交银新能源B份额} = \text{交银新能源B份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

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共保留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果出炉后，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的份额。

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的份额。

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、基金份额折算公式

1）交银新能源A份额

$$\text{交银新能源A份额} = \text{交银新能源A份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

2）交银新能源B份额

$$\text{交银新能源B份额} = \text{交银新能源B份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

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共保留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果出炉后，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）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的份额。

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的份额。

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。

6、基金份额折算公式

1）交银新能源A份额

$$\text{交银新能源A份额} = \text{交银新能源A份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

2）交银新能源B份额

$$\text{交银新能源B份额} = \text{交银新能源B份额} \times \frac{\text{基金份额参考净值}}{1.000}$$

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共保留基金管理人届时发布的相关公告。

7、折算份额数的处理方式

上述定期或不定期折算后，场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所形成的资产计入基金财产；场内份额的份额数取整计算（最小单位为1份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所形成的资产计入基金财产。

8、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。

9、基金份额不定期折算结果的公告

基金份额不定期折算结果出炉后，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。

（四）触发情况的处理

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。

十九、基金的会计与审计

（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从业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在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

二十、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《信息披露办法》、《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、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应于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”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“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、法人或者其他组织的祝贺性、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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，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：

1、基招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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真实反映应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，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书编写提要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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。

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。

2、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。

3、《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。

4、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。

5、基金资产净值、基金份额（参考）净值

《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公告一次基金资产净值、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。

在开始办理交银新能源份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，按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。

基金管理人应当公告半度和年度最后一个市场交易日《收益性日》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。基金管理人应当在前款规定的市场交易日《收益性日》的次日，将基金资产净值、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登载在指定报刊和网站上。

6、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份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

《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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，报备应当采用电子文本或书面报告方式。

8、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个工作日内编制临时报告书、予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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；

2）终止《基金合同》；

3）转换基金运作方式；

4）更换基金管理人、基金托管人；

5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7）基金募集期延长；

8）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

9）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；

10）基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年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、基金托管人受到监管部门的调查；

13）基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

14）重大关联交易事项；

15）基金收益分配事项；

16）管理费、托管费、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；

17）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18）基金改聘会计师事务所；

19）变更基金销售机构；

20）更换基金登记机构；

21）交银新能源份额开始办理申购、赎回；

22）交银新能源份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23）交银新能源份额发生巨额赎回并延期办理；

24）交银新能源份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25）交银新能源份额暂停接受申购、赎回申请；

26）交银新能源份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

27）本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；

28）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；

29）本基金实施基金份额折算（包括定期折算、不定期折算）；

30）交银新能源A份额、交银新能源B份额上市交易；

31）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；

32）交银新能源A份额约定年基准收益率的设定及其调整；

33）中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

9、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。

10、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。

11、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、半年度报告、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。

12、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，指定专人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的规定。

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、交银新能源份额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、基金定期报告和招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，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报刊和网站披露信息，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》终止后十年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公告后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

二十一、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额享受基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日交银新能源份额的净赎回申请（份额已申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数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）的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应，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。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以1元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值以下时，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金管理人将通过分散投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金位应赎金的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

（四）启用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

（五）基金投资策略所特有的指数化投资风险

1、标的指数风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

（六）基金运作的特定风险

1、上市交易风险

基金合同生效后，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上市，由于上市期间可能因发生停牌情形导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖对应上市交易份额，从而产生不能买卖基金份额的风险；同时，可能因上市后交易对于不足而产生流动性风险；另外，当基金在续期与不满足深圳证券交易所规定的上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

2、杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。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份额具有较高预期风险、高预期收益的特征。

由于交银新能源B份额内含杠杆机制的设计，交银新能源B份额的份额参考净值变动幅度将大于交银新能源份额的份额净值和交银新能源A份额的份额参考净值的变动幅度。

3、基金份额的折溢价风险

交银新能源A份额和交银新能源B份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，两类基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能发生偏离，其偏离程度将取决于基金份额参考净值、基金份额的风险收益特征、以及市场供求状况等因素。投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以1元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值以下时，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金管理人将通过分散投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的赎回。如果基金资