附件

深圳證券交易所證券投資基金業務指引第 1 號

——指數基金開發

**第一條** 為規範深圳證券交易所（以下簡稱本所）公開募集指數證券投資基金（以下簡稱指數基金）相關業務活動，保護投 資者合法權益，根據《證券投資基金法》《公開募集證券投資基金

運作指引第 3 號——指數基金指引》（以下簡稱《指數基金指引》） 以及《深圳證券交易所證券投資基金上市規則》（以下簡稱《基金上市規則》）等規定，制定本指引。

**第二條** 本指引所稱指數基金，是指符合《指數基金指引》

規定並在本所上市交易的指數基金，包括交易型開放式指數基金 和上市開放式指數基金。

指數基金在本所的產品開發等業務活動，適用本指引；本指 引沒有規定的，適用《基金上市規則》《深圳證券交易所基金產品 開發與創新服務指引》（以下簡稱《基金產品開發指引》）等相關 規定。

**第三條** 基金管理人申請開發指數基金，應當做好人員配置、

業務制度及技術系統方面的準備工作。

**第四條** 基金管理人申請開發股票指數基金，其標的指數為

— 1 —

非寬基股票指數的，應當符合下列要求：

（一）成份證券數量不低於 30 只；

（二）單一成份證券權重不超過 15%且前 5 大成份證券權重合計占比不超過 60%；

（三）發佈時間不短於 6 個月，中國證監會認可的指數基金， 其標的指數發佈時間要求可適當放寬；

（四）權重合計占比 90%以上的成份證券最近 1 年日均成交金額位於其所在證券交易所全部上市股票的前 80%。

前款所述寬基股票指數，是指選樣範圍不限於特定行業或投 資主題，反映某個市場或某種規模股票表現的指數。寬基股票指 數不受上述限制，但單一標的指數成份證券權重原則上不超過30%。

基金管理人申請開發債券指數基金，其標的指數應當符合本 條第一款第（一）至（三）項要求，利率債（含國債、地方政府 債、政策性金融債）指數基金不受上述限制。

本指引施行前已經中國證監會核准或註冊的股票指數基金、 債券指數基金等不受上述限制。

**第五條** 基金管理人申請開發股票指數基金或債券指數基

金，應當向本所提交以下材料：

（一）《基金產品開發指引》要求的申請材料；

（二）標的指數編制方案；

（三）標的指數符合本指引第四條相關要求的說明及承諾。

— 2 —

標的指數或其編制方案在申請日符合本指引第四條的要求， 且相關申請符合《基金產品開發指引》規定的，本所向基金管理 人出具無異議函。

**第六條** 指數基金在本所上市交易前，基金管理人應當使基

金的投資組合比例符合有關法律法規、部門規章、規範性檔的 規定和基金合同的有關約定。

**第七條** 基金管理人違反本指引的，本所可以依據《基金上

市規則》等相關規定，對其採取自律監管措施或者紀律處分。 **第八條** 本指引由本所負責解釋。

**第九條** 本指引自 2021 年 2 月 1 日起施行。

— 3 —