

附件 1

深圳证券交易所证券投资基金业务指引 第 1 号——指数基金（2025 年修订）

第一条 为了规范深圳证券交易所（以下简称本所）公开募集指数证券投资基金（以下简称指数基金）相关业务活动，保护投资者合法权益，根据中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）以及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》（以下简称《基金上市规则》）等规定，制定本指引。

第二条 本指引适用于基金管理人开发指数基金并在本所上市交易相关事宜。

本指引所称指数基金，是指符合《指数基金指引》规定并在本所上市交易的基金，包括交易型开放式指数基金和上市开放式指数基金。

第三条 基金管理人开发指数基金并在本所上市交易，应当做好人员配置、业务制度以及技术系统方面的准备工作，并符合本所基金风险管理相关要求。

本所可以基于基金市场平稳运行的考虑，要求基金管理人充分评估开发相关基金并上市交易的合理性。

第四条 基金管理人开发股票指数基金并在本所上市交易，基金标的指数为非宽基股票指数的，应当符合下列要求：

- (一) 成份证券数量不低于 30 只；
- (二) 单一成份证券权重不超过 15% 且前 5 大成份证券权重合计占比不超过 60%；
- (三) 发布时间不少于 3 个月，但中国证监会认可的除外；
- (四) 权重合计占比 90% 以上的成份证券最近 1 年日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市股票的前 80%。

前款所称宽基股票指数，是指选样范围不限于特定行业或者投资主题，反映某个市场或者某种规模股票表现的指数。宽基股票指数不受前款限制，但单一标的指数成份证券权重原则上不超过 30%。

基金管理人开发债券指数基金并在本所上市交易，基金标的指数应当符合本条第一款第一项至第三项要求，但利率债（含国债、地方政府债、政策性金融债）指数基金除外。

第五条 基金管理人开发指数基金并在本所上市交易，应当在基金发售前向本所提交下列材料：

- (一) 基金发售业务申请；
- (二) 向中国证监会申请基金注册时提交的关于标的指数符合相关要求的材料；
- (三) 标的指数或者其编制方案与申请基金注册时有无重大变化的说明及承诺；

(四) 中国证监会准予基金注册的批复;

(五) 本所要求的其他材料。

标的指数或者其编制方案符合本指引第四条要求且材料齐备的，本所予以办理发售业务。

第六条 指数基金合同生效后，基金管理人可以向本所提交指数基金上市申请。指数基金符合上市条件的，本所向基金管理人出具同意基金上市的通知。

第七条 指数基金在本所上市交易前，基金管理人应当确保基金的投资组合比例符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的约定。

第八条 基金管理人违反本指引的，本所可以根据《基金上市规则》等有关规定，对其采取自律监管措施或者纪律处分。

第九条 本指引由本所负责解释。

第十条 本指引自发布之日起施行。本所于2023年8月10日发布的《深圳证券交易所证券投资基金业务指引第1号——指数基金开发(2023年修订)》(深证上〔2023〕730号)同时废止。