附件2

《深圳证券交易所深港通业务实施办法》

修订说明

为持续优化互联互通机制，进一步扩大深港通标的范围，本所拟对《深圳证券交易所深港通业务实施办法》（以下简称《实施办法》）进行修订。现就有关修订情况说明如下：

一、修订背景

2022年7月ETF纳入互联互通标的以来，交易运行平稳有序，交易规模持续增长，为两地投资者跨境投资提供更多便利和机会。为进一步优化深港通机制，扩大深港通ETF范围，本所拟对《实施办法》相关内容进行修订。

二、修订内容

本次拟修订《实施办法》6条内容，主要是修改深股通、港股通ETF范围。

**一是**修改第二十五条、第七十六条，明确深股通ETF和港股通ETF有关规模和权重占比的调入要求。**深股通方面，**ETF纳入规模门槛由不低于人民币15亿元调整为不低于人民币5亿元；调入比例调整为“跟踪的标的指数成份证券中，深交所和上交所上市股票权重占比不低于60%，且深股通股票和沪股通股票权重占比不低于60%”。**港股通方面，**ETF纳入规模门槛由不低于港币17亿元调整为不低于港币5.5亿元；调入比例统一调整为“跟踪的标的指数成份证券中，联交所上市股票权重占比不低于60%，且港股通股票权重占比不低于60%”，不再以指数进行区分。

**二是**修改第二十六条、第七十七条，明确深股通ETF和港股通ETF有关规模和权重占比的调出情形。**深股通方面，**ETF调出规模由低于人民币10亿元调整为低于人民币4亿元；调出比例调整为“跟踪的标的指数成份证券中，深交所和上交所上市股票权重占比低于55%，或深股通股票和沪股通股票权重占比低于55%”。**港股通方面，**调出规模由低于港币12亿元调整为低于港币4.5亿元；调出比例统一调整为“跟踪的标的指数成份证券中，联交所上市股票权重占比低于55%，或港股通股票权重占比低于55%”，不再以指数进行区分。

**三是**修改第八十条、第一百四十七条，涉及条款序号调整及废止条款修订。