

附件 1

关于完善上市开放式基金相关安排的通知 (征求意见稿)

为了促进深圳证券交易所(以下简称本所)上市开放式基金(以下简称 LOF)规范发展,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《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,现就完善 LOF 相关安排通知如下:

一、下列情形属于《基金上市规则》第二十三条第五项规定的“本所认为应当终止上市的其它情形”:

(一)商品期货 LOF、合格境内机构投资者(以下简称 QDII) LOF。

商品期货 LOF,是指以持有经中国证券监督管理委员会依法批准设立的商品期货交易所挂牌交易的商品期货合约为主要策略,以跟踪商品期货价格或者价格指数为目标的 LOF。

QDII LOF,是指依据《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等相关规定募集设立,运用部分或者全部基金财产投资于境外证券市场的 LOF。

(二) LOF 连续六十个交易日每日场内资产净值均低于一千万万元。

本条第二项规定的终止上市情形，自本通知施行之日起算相应期限。

二、商品期货 LOF、QDII LOF 应当最晚于 2027 年 12 月 31 日终止上市，自本通知施行之日起至终止上市前，基金场内简称前冠以“*”字样。

相关基金管理人应当在本通知施行之日开市前披露公告，提示 LOF 将终止上市的风险，提醒基金份额持有人可以选择将场内份额进行赎回、卖出或者跨系统转托管至场外等，并做好终止上市相关安排。

终止上市相关安排确定后，基金管理人应当最晚于 2027 年 11 月 12 日向本所提交终止上市相关文件并公告，未按照有关规定提交文件的，本所按照规定对 LOF 终止上市。

三、LOF 连续四十个交易日每日场内资产净值均低于一千万元的，基金管理人应当向本所报告并在次一交易日开市前披露基金可能被终止上市的风险提示公告，其后每个交易日披露一次，直至基金当日场内资产净值低于一千万元的情形消除或者出现终止上市情形之日止（以在先者为准）。

LOF 出现本通知第一条第二项规定情形的，基金管理人应当向本所报告并在次一交易日开市前公告，LOF 自公告之日起停牌。

基金管理人应当自公告之日起二个交易日内向本所提交终止上市相关文件。

四、本所收到终止上市相关文件后十个交易日内，作出终止

基金上市的决定，并自决定之日起二个交易日内通知基金管理人并公告。

基金管理人应当在收到本所终止基金上市的决定后二个交易日内披露基金终止上市公告。基金终止上市公告内容包括终止上市基金的种类、场内简称、证券代码、终止上市的日期、原因及终止上市相关安排等。

商品期货 LOF、QDII LOF 基金管理人应当自本所公告终止上市决定之日起连续二十个交易日内，每个交易日披露一次终止上市公告，LOF 于二十个交易日届满后次一交易日终止上市。

LOF 被本所根据本通知第一条第二项的规定作出终止上市决定的，于作出终止上市决定后五个交易日内终止上市。

五、LOF 同时出现本通知第一条第一项和第二项规定的终止上市情形的，本所按照先触及先适用的原则终止其上市。

本通知第一条第一项规定的触及时点，以基金管理人公告提交终止上市相关文件时间为准。

六、基金管理人应当在终止上市相关公告中提示 LOF 终止上市后场内份额仍可赎回等内容。

本所会员应当将按照本通知规定发布终止上市相关公告的 LOF 纳入重点监控名单，通过公司网站、网上交易系统、行情系统等多种渠道，向客户进行风险提示，引导客户合法合规、理性审慎参与交易。

七、基金管理人应当做好相关业务和技术准备工作，包括制

定终止上市业务流程，建立 LOF 场内资产净值的监控、预警系统等。

八、本通知规定的“低于”不包含本数。本通知规定的连续交易日包含基金全天停牌日。

九、本通知自 202X 年 X 月 X 日起施行。