

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）

第一条 为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《证券投资基金法》《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，包括指数 ETF 和指数 LOF。

本指引适用于指数基金在本所的产品开发等业务活动；本指引没有规定的，适用《深圳证券交易所基金产品开发与创新服务指引》（以下简称《基金产品开发指引》）等相关规定。

第三条 基金管理人申请开发指数基金，应当做好人员配置、业务制度及技术系统方面的准备工作。

第四条 基金管理人申请开发股票指数基金，其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）发布时间不短于 3 个月，中国证监会认可的指数基金，其标的指数发布时间要求可适当放宽；

（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%。

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

基金管理人申请开发债券指数基金，其标的指数应当符合本条第一款第一至三项要求，利率债（含国债、地方政府债、政策性金融债）指数基金不受上述限制。

本指引施行前已经中国证监会核准或注册的股票指数基金、债券指数基金等不受上述限制。

第五条 基金管理人申请开发股票指数基金或债券指数基金，应当向本所提交以下材料：

- （一）《基金产品开发指引》要求的申请材料；
- （二）标的指数编制方案；
- （三）标的指数符合本指引第四条相关要求的说明及承诺。

标的指数或其编制方案在申请日符合本指引第四条的要求，且相关申请符合《基金产品开发指引》规定的，本所向基金管理人出具无异议函。

第六条 指数基金在本所上市交易前，基金管理人应当使基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关约定。

第七条 基金管理人违反本指引的，本所可以依据《基金上市规则》等相关规定，对其采取自律监管措施或者纪律处分。

第八条 本指引由本所负责解释。

第九条 本指引自 2023 年 8 月 10 日起施行。本所于 2021 年 1 月 22 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》（深证上〔2021〕78 号）同时废止。