

附件：

# 深圳证券交易所基金产品开发与创新服务指引

## ( 2019 年修订 )

### 第一章 总 则

**第一条** 为促进深圳证券交易所(以下简称“本所”)基金市场发展,做好基金产品开发和 Innovation 工作,加强创新产品风险防范,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等规定,制定本指引。

**第二条** 基金管理人开发在本所挂牌的基金产品(以下简称“基金产品”,包括常规产品和创新产品),适用本指引。

**第三条** 本所在审慎和风险可控的前提下,鼓励基金管理人开发基金产品,支持基金管理人开展产品创新,并为基金管理人提供优质服务。

### 第二章 申请与服务

**第四条** 基金管理人申请开发基金产品的,应当符合下列要求:

(一) 具备保障基金正常运作的人员配置、技术系统以及相应的业务制度;

- (二) 最近一年未发生重大运营风险事件；
- (三) 已开发本所基金产品的，产品运营情况良好；
- (四) 本所规定的其他要求。

**第五条** 基金管理人申请开发的基金产品，应当符合下列要求：

- (一) 产品定位清晰，具有明确的市场需求；
- (二) 产品在认购、申购、赎回、交易、登记结算、估值和投资等方面不存在重大障碍；
- (三) 符合相关法律法规，产品风险可以有效监测、防范和化解；
- (四) 本所规定的其他要求。

**第六条** 基金管理人申请开发基金产品，应当向本所提交以下材料：

- (一) 产品开发申请；
- (二) 基金合同（草案）；
- (三) 招募说明书（草案）；
- (四) 本所要求的其他材料。

**第七条** 基金管理人向本所提交的产品开发申请，应当包括下列内容：

- (一) 拟通过本所办理的业务，包括上网发售、上市交易、申购赎回等；
- (二) 相关技术条件、人员配置以及业务制度等准备情况；
- (三) 首次申请开发本所基金产品的，应当简要介绍基金管理

人基本情况；已开发本所基金产品的，应当说明存量产品运营情况，包括持有人结构、场内规模以及流动性等；

(四)获本所无异议函后相关产品半年之内未向证监会申报的，应当对相关情况予以说明；

(五)对拟开发基金产品场内持有人户数和场内募集规模的预估情况；

(六)本所要求的其他内容。

**第八条** 本所原则上允许多家基金管理人开发跟踪同一标的指数的基金产品。基金管理人申请开发的基金产品，经本所认定属于重大创新或对本所基金市场发展具有战略意义的，本所可予以适当期限的保护。

**第九条** 本所收到申请材料后，可视情况向基金管理人反馈意见，基金管理人应当根据反馈意见提交书面答复或修改材料。

**第十条** 基金管理人申请开发常规产品，符合本指引第四条和第五条规定要求的，本所自收到完备申请材料之日起十个交易日内出具无异议函，但根据相关规定需要事前向中国证监会报告的产品除外。

**第十一条** 基金管理人提交产品开发申请材料后，可向本所就申请办理进度以及产品保护期限等情况进行咨询。

### **第三章 创新产品服务**

**第十二条** 本所鼓励和支持基金管理人开展产品创新，协助基

金管理人做好相关准备工作，共同推动基金行业创新发展。

**第十三条** 基金管理人申请开发创新产品，原则上应当具有一年以上本所常规产品的运作经验。

**第十四条** 基金管理人拟开发创新产品的，应当首先向本所提出创新产品开发意向。

本所根据开发意向，组织相关部门及市场参与者就创新产品运作模式、技术系统等事项，提供业务技术咨询和评估等服务，协助基金管理人完善产品方案，推动创新产品取得证监会等相关监管机构的初步认可。

提出开发意向的创新产品获本所、相关市场参与者和监管机构初步认可后，基金管理人可向本所提交创新产品申请材料。

**第十五条** 基金管理人向本所申请开发创新产品的，除提供本指引第六条规定的材料外，还应当提交产品方案和风险评估报告。

其中，产品方案应包括下列内容：

- (一) 开发意义；
- (二) 境内外类似产品发展情况；
- (三) 投资目标、范围与策略等投资事项；
- (四) 市场需求分析和销售计划；
- (五) 技术可行性分析；
- (六) 基金份额的交易、认购、申购、赎回等事项；
- (七) 本所要求的其他事项。

风险评估报告应包括以下内容：

- (一) 产品上市后的流动性、连续性、抗操纵性预估；
- (二) 信息披露要求是否明确、充分，投资者获取相关信息是否便利、及时；
- (三) 是否需要设置专门的投资者适当性安排；
- (四) 可能出现的纷争和争议，以及相应的处置机制；
- (五) 可能出现的突发事件和紧急情况，以及相应的应对措施；
- (六) 是否会引起证券市场和其他市场（衍生品市场、货币市场、外汇市场、大宗商品市场、房地产市场、全国中小企业股份转让系统及区域股权市场等）之间的风险传染，是否会引发系统性、区域性风险；
- (七) 产品是否存在潜在违法违规行为；
- (八) 本所要求的其他事项。

**第十六条** 本所以对基金管理人提交的创新产品方案予以保密。

**第十七条** 基金管理人申请开发创新产品，符合本指引第四条、第五条以及第十三条规定要求的，本所收到完备申请材料并履行风险评估等相关程序后决定是否出具无异议函。

#### **第四章 其他事项**

**第十八条** 基金管理人收到本所无异议函后，可向中国证监会申报产品，并告知本所。

**第十九条** 本所出具无异议函后，基金管理人修改申请材料的，应提前告知本所；材料修改涉及基金投资目标与范围、申购赎回模

式、运作方式以及其他重大事项调整的，应重新向本所提交开发申请。

**第二十条** 基金管理人首次开发基金产品的，应当向本所申请领取基金业务专区 E-KEY，登陆基金业务专区下载本所基金业务指南等文件。

**第二十一条** 基金产品发售前，基金管理人应当根据本所、中国证券登记结算有限公司以及深圳证券通讯有限公司等相关机构发布的业务指南要求办理相关业务，并进行相关技术系统测试；申请开发交易型开放式基金的，在产品上市前应当通过本所组织的现场检查。

**第二十二条** 基金获准注册后，产品方案进行调整应当向证监会申请变更注册的，基金管理人应向本所提交变更申请、变更方案以及本所规定的申请开发常规产品或创新产品应提交的相关材料，本所按照本指引第十条或第十七条规定决定是否出具无异议函。

**第二十三条** 创新产品上市后，基金管理人应当跟踪、监控产品上市运行情况，并向本所提交产品上市首月、首季及首年运行情况报告。当产品发生运行风险时，基金管理人应当及时向本所报告。

## **第五章 附则**

**第二十四条** 本指引下列用语的含义：

（一）常规产品，是指在基金管理人、投资者权利义务、投资范围及风险收益特征等方面与本所已上市基金不存在重大差异的

基金产品。

(二) 创新产品，是指在基金管理人、投资者权利义务、投资范围及风险收益特征等一个或多个方面与本所已上市基金存在重大差异的基金产品。

**第二十五条** 本指引由本所负责解释。

**第二十六条** 本指引自发布之日起施行。本所 2014 年 11 月 18 日发布的《深圳证券交易所基金产品开发与创新服务指引》(深证会〔2014〕126 号)同时废止。