

附件

**深圳证券交易所公开募集基础设施证券  
投资基金业务指南第 3 号——交易业务**

**2021 年 6 月**

## 目 录

<b>第一章 现券交易</b> .....	<b>1</b>
一、竞价交易机制 .....	1
二、大宗交易机制 .....	2
三、询价交易机制 .....	3
<b>第二章 回购交易</b> .....	<b>4</b>
一、限售份额回购交易管理 .....	4
二、债券质押式协议回购 .....	5
三、其他回购交易 .....	6
<b>第三章 其他</b> .....	<b>7</b>

## 重要提示

一、本指南仅用于深圳证券交易所（以下简称本所）公开募集基础设施证券投资基金（以下简称基础设施基金）现券交易、回购交易等业务，并非本所业务规则或对规则的解释。如本指南与国家法律、法规及有关业务规则发生冲突，应当以法律、法规及有关业务规则为准。

二、本所将根据实际情况，对本指南进行不定期修订并发布更新版本。

三、本所保留对本指南的最终解释权。



## 第一章 现券交易

基础设施基金可以采用竞价、大宗和询价等本所认可的交易方式进行交易。

### 一、竞价交易机制

1. 基础设施基金采用竞价交易方式的，申报时间为每个交易日 9:15 至 9:25、9:30 至 11:30、13:00 至 15:00。

每个交易日 9:20 至 9:25、14:57 至 15:00，本所交易主机不接受参与竞价交易的撤销申报；在其他接受申报的时间内，未成交申报可以撤销。

2. 基础设施基金竞价交易申报数量应当为 100 份或其整数倍，单笔申报的最大数量应当不超过 10 亿份。卖出基础设施基金时，余额不足 100 份部分，应当一次性申报卖出。

3. 基础设施基金竞价交易申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币。

4. 基础设施基金的开盘价为当日该证券的第一笔成交价格。开盘价通过集合竞价方式产生，不能通过集合竞价产生的，以连续竞价方式产生。

基础设施基金的收盘价通过集合竞价的方式产生。收盘集合竞价不能产生收盘价或未进行收盘集合竞价的，以当日该证券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易）为收盘价。

当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

基础设施基金份额上市首日，其即时行情显示的前收盘价为基础设施基金发售价格。

5. 本所对基础设施基金交易实行价格涨跌幅限制，基础设施基金上市首日涨跌幅限制比例为 30%，非上市首日涨跌幅限制比例为 10%。

涨跌幅限制价格的计算公式为：涨跌幅限制价格=前收盘价 $\times$ （1 $\pm$ 涨跌幅限制比例）。计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。涨跌幅限制价格与前收盘价之差的绝对值低于价格最小变动单位的，以前收盘价增减一个价格最小变动单位为涨跌幅限制价格。

6. 买卖基础设施基金，其有效竞价范围与涨跌幅限制范围一致，在价格涨跌幅限制以内的申报为有效申报，超过涨跌幅限制的申报为无效申报。

## 二、大宗交易机制

1. 采用协议大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。

采用盘后定价大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日 15:05 至 15:30。

当天全天停牌、处于临时停牌期间或停牌至收市的证券，本所不接受其协议大宗交易申报。

当天全天停牌或停牌至收市的证券，本所不接受其盘后定价大宗交易申报。

2. 基础设施基金大宗交易单笔申报数量应当为 1000 份或者其整数倍。

3. 基础设施基金大宗交易申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币。

4. 基础设施基金大宗交易成交价格，在该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。

5. 基础设施基金协议大宗交易在接受申报的时间内实时确认成交。

6. 大宗交易不纳入本所即时行情和指数的计算，成交量在大宗交易结束后计入当日该证券成交总量。

### 三、询价交易机制

1. 询价交易是指投资者作为询价方向被询价方发送询价请求，被询价方对询价请求进行回复，询价方选择一个或多个询价回复确认成交的交易方式。

2. 采用询价交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。

3. 基础设施基金询价交易单笔申报数量应当为 1000 份或者其整数倍。

4. 基础设施基金询价交易申报价格最小变动单位为 0.001 元。

5. 询价请求要素应当包括询价方证券账户号码、证券代码、买卖方向、数量等内容。

询价回复要素包括价格、数量、被询价方证券账户号码等内容。

6. 每个询价请求的有效期为 2 个小时，当日有效，中午休市期间不予计时。2 小时内未确认成交的，该询价请求、其对应的询价回复自动撤销。

7. 询价方选择询价回复并确认后，相关交易按照询价方确认的数量、价格成交。

8. 未成交的询价请求，询价方可以撤销，被询价方可以撤销其询价回复。询价请求被撤销后，针对该询价的回复也随之自动撤销。询价请求部分成交的，未成交部分的询价请求及询价回复自动撤销。

9. 基础设施基金询价交易的成交价格，在该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。

## 第二章 回购交易

基础设施基金可作为质押券按照本所《公开募集基础设施证券投资基金业务办法（试行）》的规定参与质押式协议回购、质押式三方回购等业务。

### 一、限售份额回购交易管理

1. 原始权益人或其同一控制下的关联方参与战略配售的基础设施基金份额在限售期内不允许质押；其他专业机构投资者战略配售份额在限售期内允许质押。

2. 原始权益人或其同一控制下的关联方在限售届满后



参与质押式协议回购、质押式三方回购等业务的，质押的战略配售取得的基础设施基金份额累计不得超过其所持全部该类份额的 50%。

## 二、债券质押式协议回购

1. 基础设施基金作为质押券进行债券质押式协议回购交易的，应当按照《深圳证券交易所债券质押式协议回购交易业务办法》《深圳证券交易所债券交易业务指南第 2 号——债券质押式协议回购》等规定参与债券质押式协议回购业务。

2. 本所接受债券质押式协议回购申报的时间为每个交易日的 9:15 至 11:30，13:00 至 15:30。本所可以根据市场需要调整债券质押式协议回购的申报时间。

3. 债券质押式协议回购的期限不得超过 365 天，且不得超过质押券的存续期间。

4. 债券质押式协议回购交易申报类型包括初始交易申报、质押券变更申报、到期续做申报、购回交易申报四类，其中购回交易申报包含到期购回申报和提前购回申报。

5. 基础设施基金份额性质包含无限售流通份额、首发后限售份额两类，正回购方在发起初始交易申报、质押券变更申报时，需明确质押券份额性质为无限售流通份额或首发后限售份额，逆回购方需对质押券份额性质进行确认。

6. 初始交易申报时，单笔交易仅能选择单一份额性质

的质押券，若质押券涉及两种份额性质，需按照不同份额性质逐笔申报。

7. 基础设施基金作为质押券的，质押券数量单位为份，成交金额不得超过基础设施基金质押份数与基础设施基金前收盘价或面值（取较大）的乘积。

8. 债券质押式协议回购发生违约的，经回购双方协商一致，可向本所申请办理协议回购质押券处置过户。基础设施基金作为债券质押式协议回购质押券的，若违约发生时质押的基础设施基金份额尚未解除限售，则对于限售部分的基础设施基金份额，需待解除限售后才可办理处置过户。

9. 基础设施基金在质押期间发生分红，依据《深圳证券交易所债券质押式协议回购交易主协议（2021年版）》约定，相关资金作为质押财产，除双方另有约定外，待基础设施基金解除质押登记后方可提取。回购双方在确保担保品价值足额的前提下，经协商一致，可提交质押券变更申报换出上述现金质押物。

### **三、其他回购交易**

1. 基础设施基金可以作为质押券按照本所相关规定参与债券质押式三方回购业务，具体实施时间由本所另行通知。

2. 本所上市的基础设施基金份额战略配售限售份额及无限售流通份额可以作为股票质押式回购补充质押标的证券。

### 第三章 其他

1. 本所上市的基础设施基金无限售流通份额可以作为融资融券的可充抵保证金证券，折算率上限按照《深圳证券交易所融资融券交易实施细则》规定的其他上市证券投资基金执行。

2. 本所上市的基础设施基金无限售流通份额可以作为约定购回标的证券。

3. 本所会员应做好交易前端的检查控制，不得将基础设施基金限售份额（包括原始权益人或其同一控制下的关联方战略配售限售份额、其他专业机构投资者战略配售限售份额）作为融资融券可充抵保证金证券及约定购回标的证券，不得将基础设施基金份额作为股票质押式回购初始交易质押标的证券，不得将基础设施基金原始权益人或其同一控制下的关联方限售份额作为股票质押式回购补充质押标的证券。如因操作不当导致相关交易完成的，会员应及时要求投资者恢复原状，本所将根据业务规则对相关会员采取自律监管措施或纪律处分。