



## 深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则

2006-2-13

### 第一章 总 则

第一条 为规范交易型开放式指数基金在深圳证券交易所（以下简称本所）的业务运作，根据《证券投资基金法》及其他有关法律、行政法规、部门规章的规定，制定本细则。

第二条 本细则所称交易型开放式指数基金（以下简称交易型指数基金），是指经依法募集的，以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金，其基金份额用组合证券进行申购、赎回，并在本所上市交易。

第三条 交易型指数基金的基金份额（以下简称基金份额）在本所的发售、申购、赎回和交易，适用本细则；本细则未作规定的，适用本所其他规定。

第四条 在本所上市的基金份额，其登记、托管和结算由本所指定的证券登记结算机构（以下简称证券登记结算机构）办理。

### 第二章 基金份额的发售

第五条 基金管理人可以通过本所或其他渠道发售基金份额。通过本所发售基金份额的，基金管理人须向本所提交发售申请，并获本所确认。

第六条 基金份额通过本所发售的，投资者应当使用在证券登记结算机构开立的证券账户，按照基金合同、基金招募说明书、基金份额发售公告的规定，通过具有基金代销业务资格的本所会员进行认购申报。

第七条 基金合同和招募说明书中，应当明确基金份额各种认购方式和投资者认购基金份额所应支付的对价种类。

第八条 基金份额通过本所发售的，具有基金代销业务资格的本所会员接受投资者认购申报时，应当要求投资者按规定足额交付认购所应支付的对价种类。

投资者以证券认购基金份额的，本所按照基金合同和基金招募说明书的规定，确认其是否拥有对应的足额证券。无足额证券的，其认购申报全部无效。

投资者以现金认购基金份额的，接受认购委托的本所会员应即时冻结投资者用于认购的资金，并不得挪用。

第九条 基金份额通过本所之外的其他渠道发售的，投资者按基金合同、基金招募说明书、基金份额发售公告的规定进行认购。

### 第三章 基金份额申购、赎回、交易与权益分派

第十条 基金管理人拟通过本所办理基金份额申购、赎回的，须向本所提交办理申购、赎回业务申请。

第十一条 基金份额通过本所申购、赎回的，基金管理人应当从具有基金代销业务资格的本所会员中选择代办基金份额申购与赎回业务的证券公司（以下简称代办证券公司），报本所认可。

基金管理人应与选定的代办证券公司签订代办委托协议，明确双方权利义务。

第十二条 投资者通过本所申购、赎回基金份额的，应当通过代办证券公司进行申报。

投资者买卖在本所上市的基金份额的，应当通过本所会员进行申报。

第十三条 基金份额的申购、赎回的申报时间为《深圳证券交易所交易规则》中有关交易时间规定的连续竞价时间和收盘集合竞价时间。

第十四条 基金份额的申购、赎回，按基金合同规定的最小申购、赎回单位或其整数倍进行申报。

第十五条 基金份额应当用组合证券进行申购、赎回，基金合同和招募说明书另有规定的除外。

第十六条 通过本所申购、赎回基金份额的申报指令不得撤销，申报指令应当包括证券账号、基金代码、业务类别、买卖方向（申购为买方、赎回为卖方）、数量等内容，并按本所规定的格式传送。

第十七条 投资者申购基金份额的，应当拥有对应的足额组合证券及替代现金；投资者赎回基金份额的，应当拥有对应的足额基金份额。

第十八条 代办证券公司应向首次进行基金份额申购、赎回的投资者全面介绍相关业务规则，充分揭示可能产生的风险，并要求其签署风险揭示书。风险揭示书的格式文本由基金管理人制定。

第十九条 代办证券公司接受投资者申购、赎回委托时：

（一）应核实投资者拥有足额的组合证券、资金或基金份额；

（二）不得将投资者的资金挪作他用；

对违反前款规定的代办证券公司，基金管理人可在报本所认可后终止其基金份额申购、赎回委托业务。

第二十条 本所根据基金合同和基金招募说明书的规定，按照基金管理人提供的申购、赎回基本要素清单（以下简称申购赎回清单）和现金替代方法，对符合要求的申购、赎回申报予以确认。

经本所确认的申购、赎回结果，相关各方应当履行清算交收义务。对不履行清算交收义务的，由证券登记结算

机构按其业务规定处理。

第二十一条 在交易时间出现下列情形之一的，本所暂停接受基金份额的申购、赎回申报：

- （一）因异常情况无法进行申购、赎回；
- （二）临时停市；
- （三）基金管理人开市前未公布申购赎回清单；
- （四）基金管理人根据基金合同、基金招募说明书的约定申请暂停申购、赎回；
- （五）本所认定的其他特殊情况。

本所暂停接受基金份额的申购、赎回申报，基金管理人应当予以公告。

第一款规定的情形消除的，基金管理人应当向本所提出恢复接受基金份额申购、赎回申报的申请，本所同意恢复的，基金管理人应当予以公告。

第二十二条 买卖、申购、赎回基金份额时，应遵守下列规定：

- （一）当日申购的基金份额，同日可以卖出，但不得赎回；
- （二）当日买入的基金份额，同日可以赎回，但不得卖出；
- （三）当日赎回的证券，同日可以卖出，但不得用于申购基金份额；
- （四）当日买入的证券，同日可以用于申购基金份额；
- （五）本所规定的其他要求。

第二十三条 本所根据市场需要，可以调整基金份额申购、赎回、交易的方式、内容和时间等事项。

第二十四条 交易型指数基金发生权益分派的，在权益登记日进行除权（息）处理。

第二十五条 交易型指数基金在本所的交易费用收取标准比照封闭式基金的有关规定执行。交易型指数基金在本所的申购、赎回费用收取标准由本所另行规定。

#### 第四章 信息传递与披露

第二十六条 每日开市前基金管理人应向本所、证券登记结算机构提供基金的申购赎回清单，并通过本所指定的信息发布渠道予以公告。申购赎回清单应包括下列内容：

- （一）最小申购、赎回单位对应的各组合证券名称、证券代码及数量；
- （二）可以现金替代的各组合证券种类及现金替代保证金率；
- （三）必须用现金替代的各组合证券种类及替代金额；
- （四）最小申购、赎回单位中的预估现金部分；
- （五）前一交易日的基金份额净值；
- （六）前一交易日的现金差额；
- （七）本所要求提供的其他信息。

当日发布的申购赎回清单，当日不得修改。

第二十七条 本所于交易日通过行情发布系统揭示基金管理人提供的前一交易日基金份额净值，本所对其提供的基金份额净值的准确性不承担责任。

第二十八条 在交易时间内，本所根据基金管理人提供的基金份额参考净值计算方式或参考净值数据，即时发布基金份额参考净值。基金份额参考净值供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考，本所对基金份额参考净值的准确性不承担责任。

基金管理人规定基金份额参考净值计算方式，经本所认可后予以公告；基金管理人修改基金份额参考净值计算方式，应当经本所认可后及时公告。

第二十九条 基金管理人规定组合证券的现金替代方式，经本所认可后予以公告；基金管理人修改组合证券的现金替代方式，应当经本所认可后及时公告。

#### 第五章 罚 则

第三十条 基金管理人、基金托管人、本所会员违反本细则规定的，本所责令改正，并视情节轻重采取以下纪律处分措施：

- （一）内部批评；
- （二）公开谴责；

本所在采取前款纪律处分措施时，可同时报告中国证监会。

本所会员违反本细则规定的，本所可暂停其通过本所办理的交易型指数基金的部分或全部业务，限制其在自营或经纪业务中买入交易型指数基金。

本所会员严重违反证券登记结算机构结算规则，根据证券登记结算机构的提请，本所可暂停其通过本所办理的交易型指数基金的部分或全部业务，限制其在自营或经纪业务中买入交易型指数基金。

#### 第六章 附 则

第三十一条 本细则由本所负责解释。

第三十二条 本细则下列用语具有如下含义：

- （一）组合证券：指交易型指数基金跟踪特定证券指数所投资的一篮子证券。
- （二）现金替代：指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和基金招募说明书的规定，可以用一定数量的现金对申购赎回清单所列证券进行替代。

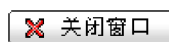
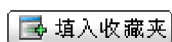
（三）现金替代保证金：指投资者申购基金份额过程中进行现金替代时，用以保证其按基金管理人规定补足被替代证券所应缴纳的现金。

（四）现金替代保证金率：指现金替代保证金金额与被替代证券市值之间的比例。被替代证券市值的计算方式由基金管理人规定并公布。

（五）预估现金部分：指由基金管理人计算并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值。

（六）异常情况：指不可抗力、意外事故、技术故障及本所不能控制的其他情况。

第三十三条 本细则自发布之日起施行。



深圳证券交易所 版权所有 Copyright ©2008 Shenzhen Stock Exchange. All Rights Reserved