## 证券交易所基金投资监管工作规程

为进一步加强证券投资基金监管，规范证券投资基金的投资交易行为，促进基金行业和证券市场健康发展，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金监管职责分工协作指引》等规定，制订本工作规程。

一、证券交易所应依法对证券投资基金交易行为进行监管，建立基金交易监控体系，防范由于基金不当投资交易引发的风险。

二、证券交易所对基金交易监管的主要职能是实时监控，发现异常交易行为及时上报基金部，会同基金部建立对证券投资基金的联合监管制度。

三、鉴于基金管理公司非交易所会员，证券交易所应妥善处置发现的问题，避免监管越位，干涉基金的正常投资。

（一）对可即时认定的违法违规行为，交易所应按《证券交易所管理办法》有关规定执行；

（二）对日常监管中偶发的异常交易，交易所仅履行上报职责；

（三）对确有重大违规嫌疑的异常交易，交易所应在证监会授权范围内实施监管措施，并同时上报基金部；

（四）基金异常交易的标准应在基金部的指导下确定，并根据市场情况实时调整，动态监控。

**四、证券交易所应重点监控的基金异常交易行为：**

（一）单只基金的异常交易;

（二）同一基金管理公司不同基金或帐户间的异常交易;

（三）基金与关联方帐户间的异常交易;

（四）不同基金公司之间的异常交易;

（五）基金公司股东帐户的异常交易;

（六）基金与可疑帐户间的异常交易。

五、证券交易所应重点监控基金交易以下股票：

（一）风险股（庄股）

交易所应按照持股**集中度、交易集中度、市盈率等**客观指标及其它渠道获取的信息，综合定义出风险股票库。

（二）**问题股**

证监会稽查局、市场部、基金部将协调确定因涉嫌市场操纵等行为已被我会立案稽查的问题股票名单，交易所应在此基础上综合其它信息，建立问题股票库。

（三）异动股

交易所应根据确定期间内个股的涨跌幅度、价格振幅、交易量、基金交易比重等指标，确定异动股票标准。

六、证券交易所应对基金投资交易情况定期进行汇总分析，包括：

（一）报告期内基金整体交易金额;

（二）报告期内各基金管理公司买卖金额;

（三）报告期内各基金买卖金额；

（四）报告期内基金买卖证券的情况；

（五）报告期内基金重仓持有股票的情况；

（六）报告期内基金异常交易、买卖风险股票的情况。

七、证券交易所应建立基金交易监控数据报备体系，并按规定向证监会基金部报送。（格式见电子档案附件）

（一）临时日报  在市场涨跌超过2%或两市成交量超过200亿元的当日报送。

（二）周报  在下一交易周的第一个交易日报送。

（三）月报  在下一月的第一个交易周内报送。

八、证券交易所发现基金涉嫌违法违规的交易行为，可视不同情况进行如下处理，并同时报告基金部：

（一）电话提示，要求基金管理公司作出解释；

（二）书面警告；

（三）约见谈话；

（四）公开谴责。

九、证券交易所应根据市场实际状况，会同基金部及时更新完善基金交易监控指标，对基金涉嫌违规的交易行为实时跟踪，迅速处置。