

附件

# 深圳证券交易所证券投资基金业务指南

## 第 1 号——相关业务办理

(2024 年 6 月修订)

2024 年 6 月

## 关于本文档

修订时间	主要修订内容说明
2021年3月	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 进一步明确基金简称命名规范；</li> <li>2. 上市申请材料中取消《ETF业务数据交换工作备忘》，但要求基金管理人在基金上市前完成测试；</li> <li>3. 调整基金发行、上市流程提交材料的时间要求，进一步提高办事效率；</li> <li>4. 增加“ETF份额折算”章节，明确ETF份额折算的业务办理流程；</li> <li>5. 删除分级基金的相关业务办理流程与表述。</li> </ol>
2022年7月	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 完善基金简称编制规范；</li> <li>2. 增加“ETF集合申购业务”章节，明确ETF集合申购的业务办理流程；</li> <li>3. 取消发售期间每日上传认购数据的要求；</li> <li>4. 调整流动性服务商新增和终止业务提交</li> </ol>

	<p>时间要求；</p> <p>5. 基金份额持有人大会流程增加网络投票相关内容。</p>
2022年12月	<p>1. 基金扩位简称长度扩至15个汉字；</p> <p>2. 精简部分业务材料。</p>
2023年6月	进一步规范基金简称编制要求
2023年9月	<p>1. 简化“开通ETF申购赎回业务权限”办理流程，取消会员申请环节，由基金管理人代为办理。</p> <p>2. 增加“港股ETF批量暂停申赎业务”办理流程，根据基金管理人的事前申请批量办理港股ETF的临时暂停申赎。</p>
2023年12月	<p>1. 新增“指定主流流动性服务商”业务流程；</p> <p>2. 新增“调整为一般流动性服务商”业务流程。</p>
2024年5月	<p>1. 明确“上市业务”中基金参考净值报送时点；</p> <p>2. 调整“ETF暂停恢复申购赎回”的业务流程；</p>

	<p>3. 增加“基金交易价格溢价风险提示”信息披露流程；</p> <p>4. 完善ETF股票认购检查注意事项。</p>
2024年6月	新增“产品开发与变更”业务流程

# 目 录

关于本文档.....	2
目 录.....	5
重要提示.....	1
第一章 新基金管理人入场.....	3
第二章 产品开发与变更.....	5
第三章 基金代码、简称申请.....	5
第四章 基金发售.....	12
第五章 基金上市.....	18
第六章 基金申购、赎回.....	24
第七章 ETF 集合申购业务.....	29
第八章 基金收益分配.....	31
第九章 ETF 份额折算.....	32
第十章 基金终止上市和申购赎回.....	34
第十一章 基金应急处理.....	36
第十二章 基金份额持有人大会.....	46
第十三章 基金产品变更.....	49
第十四章 基金清盘.....	52
第十五章 基金认购、申购赎回业务权限办理.....	54
第十六章 基金名称、简称变更.....	57
第十七章 基金流动性服务业务.....	58
第十八章 基金信息披露.....	63

## 重要提示

一、《深圳证券交易所证券投资基金业务指南第1号——相关业务办理》（以下简称“本指南”）仅为方便基金管理人办理深圳证券交易所（以下简称“本所”或“深交所”）相关基金业务之用，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、本所将根据业务需要不定期对本指南作出修订，并保留对本指南的最终解释权；基金管理人应当按照最新指南办理业务。

三、基金管理人应当指定1名信息披露负责人及2-4名信息披露授权代表负责办理基金信息披露及相关业务，上述人员如有变更，应及时告知本所并在基金业务专区更新相关信息。基金管理人的每项基金信息披露及相关业务的业务经办人在基金业务专区办理业务时，每单业务按照实际经办人填写联系人信息。

四、信息披露授权代表应及时在基金业务专区中维护基金管理人、基金管理人高管人员、基金管理人股东、基金以及基金经理等基础资料，并通过基金业务专区办理业务。

五、本指南要求基金管理人提供的相关材料在基金业务专区相应业务表单中有明确列示，部分材料在报送说明中附有模板，基金管理人应当按照基金业务专区中最新模板（注：红色“\*”标注的为必须提交材料）提交材料。

六、公告文件及相关申请材料中涉及基金简称的内容，应当包含场内基金简称。

七、除特别注明外，本指南中所称“日”均为交易日。

八、基金管理人办理业务和信息披露原则上须在公告日前一交易日16:00以前通过基金业务专区提交申请，指南中另有规定的除外。基金管理人应对所申请办理的业务保持跟进，确保在规定时间内成功办结。

九、基金管理人应确保向本所提交的业务申请和基金公告内容一致，提供给媒体的基金公告内容和提供给本所的一致。

十、本所以对基金公开披露的信息进行事前核对或者事前登记、事后核对，对其内容的真实性 and 准确性不承担责任。

十一、本所以对公开募集基础设施证券投资基金业务办理另有规定的，从其规定。

十二、基金管理人除按照本指南规定办理相关业务外，还应当按照中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）及中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“深圳结算”）的规定办理相关业务。

# 第一章 新基金管理人入场

## 一、办理数字证书

新基金管理人拟开发在深交所发行、上市基金产品的，应于首次业务发起前至少10个工作日通过现场或邮寄方式办理深圳证券数字证书。具体业务办理说明、联系方式等可通过深交所官网中的“市场服务—>信息服务—>CA服务”查阅。

## 二、产品开发申请

基金管理人按《深圳证券交易所基金产品开发与创新服务指引》及《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》及本指南的要求准备相关材料，并通过数字证书登录深交所基金业务专区提交产品开发申请材料。

## 三、净值传输测试

基金管理人获得深交所产品开发的无异议函后，通过数字证书登录深交所基金业务专区，下载《深圳证券交易所与基金管理人相关技术测试指南》，按指南要求联系深交所信息科技三部，进行基金净值传输测试，并于产品上市前完成测试。

## 四、ETF技术测试

基金管理人开发的产品为ETF的，除进行净值传输测试外，还应在上市前进行ETF的相关技术测试。

（一）基金管理人通过数字证书登录深交所基金业务专区下载《深圳证券交易所与基金管理人相关技术测试指南》，按指南要求联系深交所信息科技三部，开展ETF交易及申购赎回测试、

文件传输连通性测试等技术测试，并于产品上市前完成。

（二）基金管理人开通跨市场ETF场外实物申赎业务的，还应联系中国结算基金业务部进行申购赎回测试。

## **五、做好ETF风险管理准备工作**

首次开发ETF的基金管理人应按照《深圳证券交易所交易型开放式指数基金风险管理指引》的要求做好人员、系统与制度等风险管理准备工作，本所将在产品上市前进行现场交流督导。

## 第二章 产品开发与变更

### 一、产品开发

基金管理人申请开发本所上市基金产品的，应当按照《深圳证券交易所基金产品开发与创新服务指引》相关要求，通过本所基金业务专区中的“业务办理—>基金产品申报”提交基金产品开发申请。拟开发指数产品的，在指数公告发布后可以向本所提交产品开发申请。

#### （一）需要提交的申请材料

1. 产品开发申请（加盖公司公章）；
2. 基金合同（草案）；
3. 基金招募说明书（草案）；
4. 标的指数编制方案（指数产品需要）；
5. 关于标的指数符合要求的说明及承诺（指数产品需要，加盖公司公章）；
6. 本所要求的其他材料。

基金管理人申请开发创新产品的，除提供前述材料外，还应当在本所提交产品方案和风险评估报告。

#### （二）出具无异议函

基金管理人申请开发基金产品，符合本所规定要求的，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请示或者报告的产品除外。

多家基金管理人同时申请开发同一标的指数首批产品，且申请数量超过首批授权数量的，本所将对相关申请进行综合评估并考虑下列情况制定详细具体的评估方案：

- (1) 基金管理人资产管理规模、上市基金管理规模等情况；
- (2) 基金管理人参与ETF标的指数研发、上市基金产品业务创新研究、培育活动等情况；
- (3) 基金管理人上市基金产品合规运作和风险管理情况；
- (4) 基金管理人商品期货ETF等特殊产品底层资产的交易等情况；
- (5) 创新产品方案完备性、可行性、风控制度及开发进度安排等情况；
- (6) 本所认定的其他情况。

本所综合评估的具体流程如下：

1. 详细评估指数产品特点、开发过程、未来发展规划等情况，制定含具体细化标准的评选方案。
2. 评选方案报本所产品与参与人管理委员会审议后，通过基金业务专区向相关基金管理人发送。
3. 根据评选方案对相关申请进行综合评估，并将评估结果报本所产品与参与人管理委员会审议后，向相关申请人出具无异议函。

### (三) 注意事项

本所出具无异议函后，基金管理人修改申请材料的，应当提前告知本所；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，应当重新向本所提交开发申请。

## 二、产品变更

基金获准注册后，产品方案进行调整应当向中国证监会申请

变更注册的，基金管理人应当通过本所基金业务专区中的“业务办理—>基金产品变更”向本所提交基金产品变更业务申请。

**（一）需要提交的申请材料**

1. 产品变更申请（加盖公司公章）；
2. 产品变更方案；
3. 变更后基金合同（草案）；
4. 变更后基金招募说明书（草案）；
5. 标的指数编制方案（指数产品需要）；
6. 关于标的指数符合要求的说明及承诺（指数产品需要，加盖公司公章）
7. 本所要求的其他材料。

**（二）出具无异议函**

变更后的产品符合本所规定要求的，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请示或者报告的产品除外。

## 第三章 基金代码、简称申请

基金管理人取得中国证监会准予基金注册的批复并确定发行档期后，通过深交所基金业务专区中的“业务办理—>基金代码简称申请”提交基金代码、简称业务申请。

### 一、表单填写注意事项

#### （一）基金业务类别的选择

1. LOF：根据是否在场内挂牌交易选择“LOF（标准）”或“LOF（申赎）”；

2. ETF：单市场ETF选择“ETF（单市场）”，通过交易所申赎的跨市场ETF选择“ETF（跨市场—交易所）”，仅通过中国结算申赎的跨市场ETF选择“ETF（跨市场—中登）”，跨境ETF选择“ETF（跨境）”。

#### （二）基金投资类别的选择

QDII基金选择“QDII基金”，货币ETF选择“货币市场基金”，黄金ETF选择“黄金基金”，商品期货基金选择“商品期货基金”；主动投资的股票型基金或债券型基金选择“股票基金（主动投资）”或“债券基金（主动投资）”，被动投资指数的股票型基金或债券型基金选择“股票基金（标准指数）”或“债券基金（指数）”，指数增强基金选择“股票基金（增强指数）”，混合基金选择“混合基金（普通）”，FOF基金选择“FOF基金”。

#### （三）重要投资参数选择

1. 是否非现金资产80%以上比例投资港股；
2. 是否沪港深ETF；

3. 是否成份股全部为创业板股票或其他实行 20%涨跌幅限制股票（指数基金适用）；

4. 是否 80%以上非现金资产投资创业板股票或其他实行 20%涨跌幅限制股票（非指数基金适用）。

#### （四）基金代码编制

1. LOF 在 160001 至 169499 区间的证券代码，第三、四位为基金管理人代码，末二位代码原则上按顺序编制；LOF 在 169500 至 169999 区间的证券代码，原则上按顺序编制。

2. ETF 证券代码前三位为 159 或 158，末三位代码原则上按顺序编制。

#### （五）基金登记结算系统的选择

LOF 及仅通过中国结算申赎的跨市场 ETF 选择“中登 TA 系统”，其他 ETF 选择“深圳登记结算系统”。

#### （六）后端基金

如果该基金为后端收费模式，在申请表单中勾选“后端基金”，基金名称与前端保持一致。

#### （七）中国证监会编码报送信息

1. 份额类别：ETF 和 LOF 选择“1=非特殊份额类别”；其他基金份额根据基金份额的名称是否含有 A/B/C 的字样选择“5=ABC 类-A 类”、“6=ABC 类-B 类”、“7=ABC 类-C 类”、“8=ABC 类-AB 类”；

2. 收费方式：根据基金份额具体的收费方式进行相应选择；

3. 币种：根据基金份额具体的币种进行相应选择；

4. 交易场所：LOF 选择“5=场内深市和场外”，ETF 选择“3=

仅场内深市”；

5. 注册登记机构编码：98；

6. 基金类别：根据基金投资标的进行选择，其中 LOF 选择“8. LOF”，ETF 选择“6. 开放型 ETF”。

## 二、需提交的申请材料

（一）中国证监会准予基金注册的批复（如延期募集，需同时提交原批复和准予延期募集的批复）；

（二）基金代码简称申请（包括基金中文简称（短）及基金中文简称，加盖公司公章）；

（三）基金业务类别记录表（加盖公司公章）；

（四）基金合同。

注：1. 基金管理人申请 ETF 代码后，应当认真阅读《深圳证券交易所与基金管理人相关技术测试指南》，并做好相关测试工作；

2. 基金管理人获得 ETF 代码后，应当向深圳结算申请开立结算帐号，并在发售前开立完成。

## 三、基金简称编制规范

（一）基金简称包括扩位简称和短简称。扩位简称不得超过 15 个汉字（30 个字符）长度，短简称不得超过 4 个汉字（8 个字符）长度。本所基金正在使用或已分配的基金简称不重复使用，但已摘牌或已更名的基金，其原简称可再次使用。

（二）基金简称原则上应取自基金名称，含义清晰、指向明确；简称中可增加对基金投资标的或投资风格的描述，相关描述应与实际投资相符、不存在歧义和误导，且基金管理人应对此提

交经督察长签字的说明文件（加盖公章），并对所申请的基金简称负责。

基金简称中增加对投资标的或投资风格的描述的，应当从指数编制方案中选词：1. 从编制方案中的行业、主题选词的，应完整体现编制方案中的行业、主题；2. 从编制方案中的样本数选词的，编制方案应当明确约定了样本数，且实际样本数与编制方案相符；3. 从编制方案中的样本空间选词，如编制方案中明确样本空间为沪深市场，简称可加入“沪深”。

（三）基金扩位简称原则上应包含基金类别信息，用于交易、申赎及行情展示。ETF扩位简称应含“ETF”，单市场ETF扩位简称原则上应添加基金管理人信息；LOF扩位简称应含“LOF”，有封闭期的基金除外；定期开放式基金扩位简称应含“定开”。基金短简称主要用于市场参与者内部系统，原则上不应包含“ETF”“LOF”和“定开”，与扩位简称一致的除外。

（四）对于基金简称申请，原则上按照申请时间顺序进行处理。如出现跟踪标的和批文日期相同，且基金管理人在获得批复函当日或次一交易日提交相同简称或代码申请的，则优先按照中国证监会产品受理日期分配（以中国证监会网站公布的产品受理通知的日期为准），如上述情况均相同则按照基金管理人在本所基金业务管理系统中提交产品申报时间顺序分配。

## 第四章 基金发售

### 一、确定发售时间

基金管理人确定发售时间（ $T_1$ 日至 $T_n$ 日）后及时告知深交所基金管理部。

### 二、维护基金基础资料

提交上网发售业务申请之前，基金管理人应通过基金业务专区中的“业务办理—>基础资料维护—>基金基础资料”维护基金资料，具体包括基金类型、净值公告频率、审计会计师事务所、托管人等，提交基金管理部核对。

### 三、签署协议（适用于首次在本所办理发行业务的基金公司）

发售时间确定后，基金管理人应与本所基金管理部联系签订《基金认购、申购和赎回服务协议》和《开放式基金场内销售代理主协议》，每家公司仅需签署一次，并于发售前将《基金认购、申购和赎回服务协议》一式四份、《开放式基金场内销售代理主协议》一式两份邮寄至本所基金管理部。

### 四、提交上网发售业务申请

发售时间确定后，基金管理人应在 $T_1-4$ 个自然日（若该日为非交易日，则为该日前一交易日）前，通过基金业务专区中的“业务办理—>基金发行”提交上网发售业务申请。

#### （一）申请表填报注意事项：

1. “基金管理人接收基金认购清算数据路径”：除ETF选择“深圳证券综合结算平台（IST系统）”外，其他基金选择“中国结算TA系统”；

2. “每笔认购份额下限”：默认为1,000份。

## （二）基金发售业务所需的文件及注意事项：

1. 中国证监会准予基金注册的批复（如延期募集，将原批复和延期批复一起提交）；
2. 基金份额发售公告（披露的场内销售机构名单应采用基金业务专区公布的最新名单）；
3. 基金招募说明书；
4. 基金合同；
5. 基金托管协议；
6. 基金上网发售申请表（加盖公司公章）；
7. 基金产品资料概要；
8. 《基金认购、申购和赎回服务协议》（首次办理发行业务时提交）；
9. 《开放式基金场内销售代理主协议》（首次办理发行业务时提交）。

## 五、发起《发售公告》信息披露流程

发售业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金募集—>发售公告”发起信息披露流程（关联“发行业务”），对外披露的文件包括：

- （一）基金份额发售公告；
- （二）基金招募说明书；
- （三）基金合同；
- （四）基金托管协议；
- （五）基金产品资料概要。

T 1-3 自然日前，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒

体上刊登。

## 六、基金网上发行数据查询

认购期间，基金管理人可通过基金业务专区“业务资料查询—>基金网上发行数据查询”查询当前实时认购数据，查询结果仅供参考，具体以日终结算数据为准。

## 七、基金变更认购期限

### （一）基金认购截止日期变更业务申请

1. 基金管理人若需提前网上认购截止日期，须于新截止日（L<sub>1</sub>日）16:00之前通过基金业务专区中的“业务办理—>基金发行—>基金认购截止日期变更”提交基金认购截止日期变更业务申请，所需文件为：

（1）《XX基金提前结束募集期的公告》

（2）《XX基金截止认购日期变更通知》（加盖公司公章）

2. 基金管理人若需延长网上认购截止日期，须于原截止日前一工作日（T<sub>N-1</sub>日）16:00之前通过基金业务专区中的“业务办理—>基金发行—>基金截止认购日期变更”提交基金截止认购日期变更业务申请，所需文件为：

（1）《XX基金延长募集期的公告》

（2）《XX基金截止认购日期变更通知》（加盖公司公章）

### （二）发起基金截止认购日期变更信息披露

基金截止认购日期变更业务经基金管理部核对后，基金管理人应通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金募集—>募集期变更”发起信息披露流程（关联“基金认购截止日期变更业务”），所需文件包括：

1. 《XX 基金提前结束募集/延长募集期的公告》
2. 《XX 基金截止认购日期变更通知》

## 八、ETF 股票认购检查

如涉及股票认购 ETF(包括所有深市股票 ETF 及沪市跨市场股票 ETF)，基金管理人在发行截止日(L 日)前应联系本所基金管理部，按要求发送相关承诺函。

L 日晚,基金管理人将以下文件发送至本所基金管理部邮箱(fund@szse.cn、yxu@szse.cn、zhanjie@szse.cn)，并抄送中国结算(其中,深市单市场 ETF 数据同时抄送深圳结算:zhangly@chinaclear.com.cn、wlliao@chinaclear.com.cn,深市跨市场 ETF 及沪市跨市场 ETF 数据同时抄送中国结算:fund\_operation2@chinaclear.com.cn、zgzi@chinaclear.com.cn、ztyuan@chinaclear.com.cn)：

- (一)ETF 认购组合证券第一次过户数据文件(用于结算过户)；
- (二)ETF 网下股票认购数据表(认购数据模板及注意事项见附件 3-1,用于认购检查)；
- (三)基金发行总规模(填在股票认购数据表中的 L3 及 M3 单元格)。

L+1 日上午,基金管理部将检查结果邮件反馈基金管理人。数据检查通过后,基金管理人向中国结算申请办理股票过户。

## 九、《基金合同生效公告》信息披露流程

募集结束,基金管理人将募集情况上报中国证监会备案。获取《关于 XX 基金备案确认的函》后,按照信息披露要求通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金募集—>基金合同生

效”发起信息披露流程，次日在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登。

注：1.  $T_n$  日为发行日（基金募集期内的每个交易日）， $n=1, 2, \dots, N$ ， $N \geq 1$ ， $T_1$  为网上认购开始日， $T_N$  日为计划最后截止认购日， $L_1$  为提前的认购截止日， $L_2$  日为延长的认购截止日；

2. 基金管理人还应按照中国结算的规定办理与基金发售相关的业务；

3. 合同生效后，有封闭运作期的基金则需基金管理人填报封闭期计划。

## 十、基金份额募集失败信息披露流程

募集结束，若不能满足基金合同规定的基金备案的条件，基金管理人需向本所基金管理部邮件或传真发送《基金合同不能生效的情况说明书》。情况说明书经核对无误后，基金管理人应按照信息披露要求通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金份额募集失败”发起信息披露流程，次日在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登。

注：基金管理人还应按照中国结算的规定办理与基金募集失败相关的业务。

## 十一、向深圳结算申请办理相关事项

（一）基金发售前或发售期间，基金管理人应当按深圳结算规定的时限前向深圳结算提交《基金网上发售认购资金划款申请表》。

（二）认购结束后，基金管理人应按深圳结算的规定，向深圳结算申请办理“证券投资基金网上发售末日确认比例”“证券

投资基金网上发售认购资金利息折份额”和“基金募集登记”等业务。

### 附件 3-1

#### ETF 网下股票认购检查业务数据表

202X 年 XX 月 XX 日

基金代码：

基金简称：

账户 代码	账户 名称	股票 代码	股票 简称	认购 数量	认购数 量占总 股本比	认购 市值	认购市值 占募集规 模比	指数 权重
.....								

为提高数据检查效率，请认真按基金业务专区中的附表模版填写，并注意以下事项：

1. 认购数量、认购数量占总股本比例、认购市值、认购市值占募集规模比例、指数权重等数据应转换为数字格式，非文本格式。

2. 承诺函扫描件须在认购期结束后的下一个工作日早上 8:30 前提交，承诺函落款日期为认购结束日或下一工作日。

3. 请核实业务数据表中仅出现深市股票。

4. 请明确单一账户下的单一股票认购数量为各个营业部的汇总数据。

## 第五章 基金上市

### 一、协商确定上市时间

基金合同生效后，基金管理人应根据《基金合同》的规定与本所协商确定上市时间。在确定上市时间后，应及时与中国结算、深圳结算和基金托管人沟通，确定所需的上市材料，预留充分的准备时间。

### 二、签署上市协议（适用于首只上市基金）

首只上市基金上市时间确定后，基金管理人应与本所基金管理部联系签订《基金上市协议》，并于上市前将盖章的协议一式四份邮寄至本所基金管理部，本所盖章后回寄基金管理人两份。

### 三、维护基金基础资料

提交上市申请前，基金管理人应通过基金业务专区中的“业务办理—>基础资料维护—>基金基础资料”维护基金当前规模等基础信息。

### 四、填报基金 ISIN 码申请

基金基础资料维护后，基金管理人通过基金业务专区中的“发行上市—>ISIN 码申请”提交基金 ISIN 码申请。

表单填写注意事项：

（一）“是否为非交易业务”选择“否”；（二）“是否需要人工审核”选择“需要人工审核”；（三）“证券类型”选择“股票类”；（四）“WM 公司是否分配 ISIN 编码”，不用选择；（五）“WM 公司已分配的 ISIN 编码”选择“未分配”。（六）“基金类别”优先选择可选范围中的具体基金类别，若不属于任何具

体基金类别，才可选择“其他”，并填写具体类型。

注：国际证券识别编码（ISIN 编码）是由国际标准化组织（ISO）制定的证券编码标准，并在《证券及相关金融工具—国际证券识别编码体系》（ISO6166）中正式发布。ISO6166 主要规定了 ISIN 编码的具体编码方法及执行维护机构，编码覆盖的范围包括股票、债券、期货、期权、权证等金融工具。

## 五、提交上市业务申请

上市时间（T 日为上市首日）确定后，基金管理人应在 T-5 交易日前，通过基金业务专区中的“基金上市—>基金上市”提交上市业务申请。

### （一）注意事项

1. 表单中填写的基金代码、简称、基金业务类别、基金总规模（单位：份，含所有份额）、基金规模（份）、本次流通份额（份）、上市日期等参数应确保与上市申请材料（含上市申请书、和上市交易公告书等）保持一致；

### 2. ETF 上市业务办理：

（1）通过本所办理申购赎回的 ETF，开通申购赎回日期与上市日期为同一日，申购赎回业务应当与上市业务合并办理。表单中“是否开通场内申购赎回”选择“是”，“申购赎回抄送单元”、“基金托管交易单元”、“基金股东账号”、“上传 IOPV 交易单元”等参数与《ETF 申购赎回申请表》保持一致；如果该 ETF 采用券商交易结算模式，“申购赎回抄送单元”应填写关联券商的指定交易单元。

（2）不通过本所办理申购赎回的 ETF，表单中“是否开通场

内申购赎回”选择“否”，“申购赎回抄送交易单元”填写“000000”，“是否通过交易系统发布 PCF 文件”选择“否”。

(3) 由于香港交易及结算所有限公司（以下简称港交所）因恶劣天气或者其他极端情况临时停市，需要批量办理临时暂停申赎的港股ETF(标的指数成份证券包括港交所上市交易证券的ETF)，表单中“是否纳入批量临时暂停申赎范围”选择“是”。

(4) 表单中“ETF 拟合指数代码”填写在本所挂牌的指数代码（399XXX），若本所未分配指数代码，填写 000000。

(5) 表单中“ETF 基金托管交易单元”字段，货币、黄金、跨境、商品期货、现金债券ETF 填 000000。

(6) 表单中“ETF 基金股东账号”字段，货币、黄金、跨境、商品期货、现金债券ETF，填 0000000000。

3. 上市同时开通申购赎回的LOF，基金管理人在提交上市业务后需同时提交基金开通申购赎回（挂牌及挂牌后）业务申请。

## （二）上市申请材料

1. 《上市申请书》（红头文件并加盖公司公章）；
2. 中国证监会对基金备案的确认文件；
3. 基金最近三年的财务报告（新募集基金除外）；
4. 《上市交易公告书》；

《上市交易公告书》中第四部分“持有人户数”应列明基金各类份额的合计持有人户数及各类份额的持有人户数，“持有人结构”及“前十大持有人”应列明场内份额持有人结构及前十大持有人。

5. 经中国结算盖章确认的 T-5 日基金持有人结构申报表（ETF

不需提供)；

6. 深圳结算出具的 T-5 日基金场内证券持有人名册；

7. ETF 业务联系人表（适用于 ETF）；

8. 关于 XX 基金纳入批量临时暂停申赎范围的申请（适用于表单中“是否纳入批量临时暂停申赎范围”选择“是”的港股 ETF）。

◆如果上市同时办理净值揭示(上市前已开通申购、赎回的基金可不再办理)，应同时提交以下材料：

1. 净值揭示申请；

2. 净值揭示协议书（仅适用于首只上市基金）。

◆若基金为 ETF，且通过本所办理申购赎回，应提交下列开通申购赎回申请材料：

1. ETF 申购赎回申请表；

2. ETF 申购、赎回公告文件。

◆若基金为 ETF，且不通过本所办理申购赎回，仅需提交 ETF 申购、赎回公告文件。

## 六、ETF 申购赎回权限办理

通过本所办理申购赎回的 ETF，在上市日（T 日）须有至少一家申赎代办证券公司。基金管理人与已成为 ETF 申购赎回代办证券公司的会员协商一致后，按以下流程办理：

（一）上市业务提交后（T-4 日或之前），基金管理人通过基金业务专区提交“ETF 业务权限维护”业务申请，勾选要开通的会员单位，并附下列申请材料：

1. 《ETF 业务权限维护申请》（加盖基金管理人公章）；

2. 《ETF 申购赎回代理协议》。

(二) 基金管理人应及时通过基金业务专区查询办理结果，确保业务在 T-1 日成功办结。

### **七、基金管理人提交最新披露文件和更新相关数据**

T-4 日，基金管理人补充更新《上市交易公告书》中相关数据（含《上市通知书》公文文号）并提交相关材料（T-5 日的数据），包括：经中国结算盖章确认的“基金持有人结构申报表”（ETF 不需提供）、深圳结算出具的 T-5 日基金场内证券持有人名册。

### **八、发起《基金上市交易公告书》信息披露流程**

T-4 日，上市业务经审核通过后，基金管理人通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金运作—>上市交易公告书”发起信息披露流程（关联“基金上市业务”）。

T-3 日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登《基金上市交易公告书》。

若基金为 ETF，《上市交易公告书》和《ETF 开放申购、赎回公告》应同日披露。

### **九、补充基金份额净值数据**

T-1 日下午 16:30 前，基金管理人通过基金业务专区填报基金份额参考净值（小数位保留到三位），并提交加盖管理人公章的证明材料或者其他证明材料。

注：基金业务专区填写的基金份额参考净值数据应当与证明材料保持一致。

### **十、发起《基金上市交易提示性公告》信息披露流程**

T-1 日，基金管理人通过基金业务专区的“业务办理—>信息披露—>基金运作—>上市交易提示性公告”发起信息披露流程。

《基金上市交易提示性公告》中应当披露截至 T-1 日基金实际仓位的情况。

T 日，在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登《基金上市交易提示性公告》。

---

## 第六章 基金申购、赎回

### 一、LOF 申购、赎回

#### （一）开通申购、赎回

1. 基金合同生效后，基金管理人应与本所基金管理部协商确定开通申购、赎回业务的时间。

#### 2. 提交开通申购赎回业务申请

时间（T 日为开通申购赎回日）确定后，基金管理人须在 T-2 日之前，通过基金业务专区提交开通申购、赎回业务申请。

（1）上市后（或上市同时）开通申购、赎回的情形。T-2 日之前，基金管理人应通过基金业务专区中的“业务办理—>基金申购赎回—>基金开通申购赎回（挂牌及挂牌后）业务”提交申请；

（2）上市前开通申购、赎回的情形。T-2 日之前，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>基金申购赎回—>基金开通申购赎回（挂牌前）业务”提交申请；

（3）开通申购、赎回业务需提交的文件包括公告文件、申购赎回业务申请（加盖公司公章）。

上市前开通申购赎回的，应同时办理净值揭示，提交以下材料：

（1）净值揭示申请；

（2）净值揭示协议书（仅适用于首只上市基金）。

注：首次开通申购、赎回的定期开放基金，已确定或者已公告开放期具体安排的，选择“是否已明确后续的暂停恢复申赎日期”，并补充相关参数。

---

3. 发起《开放、暂停、恢复申购、赎回公告》信息披露流程

刊登公告前一交易日，开通申购、赎回业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>开放、暂停、恢复申购、赎回”发起信息披露流程（关联相关业务）。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登公告。

## （二）暂停/恢复申购赎回

### 1. 提交暂停/恢复申购赎回业务申请

基金开放申购、赎回后，需暂停/恢复申购赎回的，基金管理人在刊登《基金暂停申购、赎回公告》的前一个交易日，通过基金业务专区的“业务办理—>基金申购赎回—>暂停恢复申购赎回”提交申请，材料包括：暂停/恢复申购赎回公告、暂停/恢复申购赎回业务申请。

注：存在非连续的多个时间段需要暂停/恢复申赎的跨境基金，选择“是否已明确后续的暂停恢复申赎日期”，并补充相关参数。

### 2. 发起《暂停/恢复申购赎回公告》信息披露流程

刊登公告前一交易日，暂停/恢复申购、赎回业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>开放、暂停、恢复申购、赎回”发起信息披露流程（关联“暂停恢复申购赎回业务”）。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登公告。

## 二、ETF 申购、赎回

### （一）ETF 开通申购、赎回（与上市业务同时办理）

#### 1. 通过本所办理申购、赎回的 ETF，基金管理人应按照本指南

---

“基金上市”的相关规定和上市业务申请同时办理，并申请开通代办证券公司的申购、赎回权限。

通过中国结算等其他机构办理申购、赎回的 ETF，按照其相关规定办理。

## 2. PCF 清单传送

基金申购、赎回开放日，基金管理人应在规定的时间将申购赎回清单等文件传送至本所。

### (二) 跨市场 ETF（中登）上市后开通场内申购赎回

T 日：开通申购赎回日

#### 1. ETF 申购赎回测试

ETF 开通申购赎回前，基金管理人应按照《深圳证券交易所与基金管理人相关技术测试指南》的规定完成技术测试。

#### 2. 修改基金业务类别

T-4 日前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>基金类别变更”提交基金类别变更业务，将基金业务类别由“ETF（跨市场—中登）”修改为“ETF（跨市场—交易所）”，并提交相关申请文件（加盖公司公章）。

#### 3. 提交开通申购、赎回业务申请

T-4 日前，通过基金业务专区的“业务办理—>基金申购赎回—>基金开通申购赎回（挂牌及挂牌后）业务”提交申请，申请材料包括：基金开通申购赎回公告、ETF 挂牌后开通申购赎回业务申请表、申购赎回业务申请（红头文件加盖公司公章）、ETF 业务权限维护表。

#### 4. 开通代办证券公司的申购、赎回权限

---

通过本所办理申购赎回的 ETF，在申购赎回开通日（T 日）须有至少一家申赎代办证券公司。基金管理人与已成为 ETF 申购赎回代办证券公司的会员协商一致后，按以下流程办理：

（1）基金开通申购赎回（挂牌及挂牌后）业务提交后，T-4 日前，基金管理人通过基金业务专区提交“ETF 业务权限维护”业务申请，勾选要开通的会员单位，并附下列申请材料：

- ① 《ETF 业务权限维护申请》（加盖基金管理人公章）；
- ② 《ETF 申购赎回代理协议》。

（2）基金管理人应及时通过基金业务专区查询办理结果，确保业务成功办结。

5. 发起《开放、暂停、恢复申购、赎回公告》信息披露流程

T-1 日前，开通申购、赎回业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>开放、暂停、恢复申购、赎回”发起信息披露流程（关联“基金开通申购赎回（挂牌及挂牌后）”业务）。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### （三）ETF 暂停/恢复申购、赎回

1. 若因境外交易所休市或非港股通交易日需暂停/恢复申赎的，按以下流程办理：

（1）刊登暂停申购、赎回公告前一交易日，基金管理人通过基金业务专区中“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>ETF 暂停申购、赎回公告（节假日）”发起信息披露流程。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登公告；

（2）暂停申购、赎回前一交易日，基金管理人在 PCF 清单中

---

设置 T 日（暂停申购赎回日）禁止申购、赎回状态，并及时传至本所信息科技三部。

2. 若因其他原因需暂停/恢复申赎的，按以下流程办理：

**(1) 提交暂停/恢复申购赎回业务申请**

基金管理人在刊登《基金暂停申购、赎回公告》的前一个交易日，通过基金业务专区的“业务办理—>基金申购赎回—>暂停恢复申购赎回”提交申请，材料包括：暂停/恢复申购赎回公告、暂停/恢复申购赎回业务申请。

注：存在非连续的多个时间段需要暂停/恢复申赎的基金，选择“是否已明确后续的暂停恢复申赎日期”，并补充相关参数。

**(2) 发起《暂停申购/赎回公告》信息披露流程**

刊登公告前一交易日，暂停/恢复申购、赎回业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>ETF 暂停申购、赎回公告（非节假日）”发起信息披露流程（关联“暂停恢复申购赎回业务”）。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登公告。

**(四) ETF 临时暂停申购、赎回**

ETF 需要临时暂停申购、赎回的，按照本指南第十章“基金应急处理”相关流程办理。

---

## 第七章 ETF 集合申购业务

### 一、确定方案并进行技术改造

T-N 日前,基金管理人确定集合申购业务方案并联系基金托管人和投资者股票托管证券公司进行相应技术改造。

### 二、技术测试

T-5 日前,基金管理人联系深圳结算系统运行部(szjsb@chinaclear.com.cn)申请构造持仓数据(详见基金业务专区“开通集合申购”信息披露流程的模版),完成持仓构造后联合基金托管人及股票托管证券公司在本所交易结算独立测试系统环境进行相关集合申购技术测试。

### 三、发起《开通集合申购公告》信息披露流程

T-5 日,基金管理人通过本所基金业务专区的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>开通集合申购”发起信息披露流程,需提交的材料包括:开通集合申购公告、更新后的法律文件(招募说明书、基金合同和产品资料概要等)、开通集合申购业务申请及集合申购测试反馈表等。

T-2 日,基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### 四、签订相关协议

Tn-5 日前,基金管理人与意向投资者、投资者股票托管证券公司签订相关协议,明确各方权责。

---

## 五、开展集合申购业务

（一） $T_n-2$ 日，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>信息披露事后补充附件”（关联此前的信息披露流程）提交相关协议。

（二） $T_n-1$ 日 17 点前，基金管理人通过邮件向本所提交集合申购 PCF 清单测算底稿（EXCEL）；

（三） $T_n$ 日，基金管理人在官网披露集合申购清单。

（四）基金管理人在  $T_n+10$  日内完成调仓。

注：T 日：开通集合申购日， $T_n$ 日：开展集合申购日。

---

## 第八章 基金收益分配

### 一、拟定收益分配公告

基金管理人拟定基金收益分配公告交基金托管人复核。场内托管份额按照以下程序进行收益分配，场外托管份额的收益分配按照中国结算相关规定执行。

### 二、向深圳结算提交收益分配公告

基金管理人应按照深圳结算的相关规定向深圳结算提交收益分配公告等材料，协商确定收益分配相关事项。

### 三、发起《收益分配事项》信息披露流程

R-3 日前，基金管理人通过基金业务专区中的“基金信息披露—>基金临时报告—>基金收益分配或折算/拆分”发起信息披露流程，填写基金分红参数，确保申请表单的权益登记日、除权日和单位分红金额与公告内容、向深圳结算提交的申请一致，并填写停牌时间为公告当日开市起至当日 10:30；提交的材料包括：收益分配公告。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：1. R 日为权益登记日；

2. 不同类型基金的派息款项划拨时间不同，具体按中国结算的相关规定办理；

3. 如基金为 ETF 期权标的，基金管理人需至少提前 5 个交易日与深交所和深圳结算协商确定除权日，且期权行权日和行权日次一交易日不得作为收益分配或份额折算的除权日。

---

## 第九章 ETF 份额折算

### 一、拟定《基金份额折算公告》

R-6 日前，基金管理人拟定基金份额折算公告并提交基金托管人、深圳结算发行人业务部，公告应包含权益登记日、除权日及折算比例（若折算比例已确定）等内容，并获得托管人确认函与深圳结算发行人业务部意见。

注：1. R 日为权益登记日、折算基准日；

2. 如该 ETF 为通过中登申赎的跨市场 ETF，则公告需包含暂停 R 日场外申赎内容，由基金管理人通过设置场外 PCF 清单参数进行处理。

### 二、发起《基金份额折算公告》信息披露流程

R-5 日前，基金管理人通过基金业务专区中的“基金信息披露—>基金临时报告—>基金收益分配或折算/拆分”发起信息披露流程，收益分配类型选择“折算”，并填写基金折算参数，确保申请表单的权益登记日、除权日及折算比例（若折算比例已确定）等参数与公告内容、向深圳结算提交的申请一致；提交的材料包括：折算公告、深圳结算发行人业务部意见。

经基金管理部核对后，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：1. 如为 ETF 期权标的，基金管理人需至少提前 5 个交易日与深交所和深圳结算协商确定除权日，且期权行权日与行权日次一交易日不得作为份额折算的除权日；

2. 折算比例原则上应于刊登折算公告时确定，如有特殊情况未能确定，应在 R-1 日前确定，并于 R-1 日通过基金业务专区中

---

的“基金信息披露—>基金临时报告—>基金收益分配或折算/拆分”发起信息披露流程，收益分配类型选择“折算”，填写折算比例、权益登记日、除权日等参数，R日公告。

### 三、发起《基金份额折算结果公告》信息披露流程

R日，基金管理人于9:30前正式将基金份额折算比例和折算方法的申请发送深圳结算发行人业务部。

R日日终，基金管理人通过基金业务专区中的“基金信息披露—>基金临时报告—>基金折算/拆分结果公告”发起折算结果公告信息披露流程；提交的材料包括：基金折算结果公告、深圳结算发行人业务部意见。

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

---

## 第十章 基金终止上市和申购赎回

### 一、终止上市

#### （一）确定终止上市时间

基金管理人根据《基金合同》、相关规则规定或持有人大会决议，决定终止基金上市的，在确定终止上市时间后，应及时告知基金管理部。

#### （二）提交终止上市申请

基金终止上市日（T日）的五个交易日前（T-5日前），基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>基金终止上市”提交业务申请，需要提交的文件包括：

1. 终止上市申请（红头文件并加盖公司公章）；
2. 基金终止上市公告；
3. 基金合同；
4. 基金份额持有人大会决议公告（若有）；
5. 证监会批复（若有）。

注：LOF终止上市同时可选择“是否终止申购赎回”，其他基金在终止上市时会自动终止申购赎回。

#### （三）发起《基金终止上市公告》信息披露流程

T-4日前，终止上市业务申请经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金终止上市”发起信息披露流程（关联“基金终止上市业务”）。

经基金管理部核对后，T-3日或之前，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登基金终止上市公告。

#### （四）发起《基金终止上市提示性公告》信息披露流程

---

T-2日，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金终止上市”发起信息披露流程（关联“基金终止上市业务”）。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

## **二、基金终止申购赎回（适用于仅申购赎回非交易基金）**

T日：终止申购赎回日。

### **（一）确定终止申购赎回时间**

基金管理人根据《基金合同》、规则规定或持有人大会决议，决定终止申购赎回的，在确定时间后，应及时告知基金管理部。

### **（二）提交终止申购赎回业务**

T-2日前，基金管理人通过基金业务专区提交基金终止申购赎回业务申请，材料为：终止申购赎回公告和终止申购赎回业务申请。

### **（三）发起《终止申购赎回公告》信息披露流程**

T-2日前，终止申购赎回业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>开放式基金申购赎回—>基金终止申购赎回”发起信息披露流程（关联“终止申购赎回业务”）。

经基金管理部核对后，T-1日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

---

# 第十一章 基金应急处理

## 一、应急处理情形

(一) 基金管理人应当根据《深圳证券交易所交易型开放式指数基金风险管理指引》的要求制定 ETF 风险管理制度, 设立 ETF 风险管理小组。ETF 风险管理小组负责风险情形发生时临时停牌或临时暂停申购赎回等应急业务的处理。

(二) 基金发生附件 10-1 紧急情形的, 基金管理人应立即启动应急预案并电话通知本所基金管理部, 确定需要申请临时停牌或临时暂停申购赎回的, 应尽快向本所提交申请(详见本章第二部分), 本所根据基金管理人的申请进行临时停牌或临时暂停申购赎回处理, 基金管理人应对此引发的结果承担责任。

(三) 基金发生附件 10-2 异常情况的, 本所按照有关规定进行处理, 基金管理人应对此引发的结果承担责任。

## 二、临时停牌/暂停申购赎回

(一) 与基金管理部沟通后确定进行临时停牌/暂停申购赎回的, 基金管理人应立即通过基金业务专区的“业务办理-基金临时停牌/暂停申赎-基金临时停牌/暂停申赎”提交申请, 申请材料包括: 临时停牌/暂停申购赎回业务申请和公告文件。

注意事项: 基金管理人应根据当前时间选择合适的业务生效时间, 并关注系统的提示信息。业务生效日期仅为当日, 业务生效时间为开市、13:00 和盘中即时三种情形。若选择生效时间为开市或 13:00, 基金管理人应至少提前 30 分钟通过基金业务专区提交申请。

---

（二）如基金管理人无法及时通过基金业务专区提交申请，可先向本所传真书面申请或电话申请，后续可通过基金业务专区的“业务办理—>基金临时停牌/暂停申赎—>补录基金临时停牌/暂停申赎”补充相关材料。

（三）本所收到基金管理人申请后，立即启动应急处理流程，并将反馈处理结果。

（四）基金已实施临时停牌或临时暂停申购、赎回的，基金管理人应当及时在基金管理人网站刊登《基金临时停牌或暂停申购赎回公告》，公告中应说明暂停的原因及恢复时间等事项；如涉及当日信息披露错误，应通过基金业务专区的“业务办理—>信息披露—>更正公告”提交更正公告并于次日发布。

### **三、港股 ETF 批量临时暂停申购赎回**

由于港交所因恶劣天气或者其他极端情况临时宣布取消当日证券（包括沪深港通）及衍生产品市场早上交易时段、下午交易时段或者全天交易时段，确定需要批量临时暂停申购赎回的，相关港股 ETF 的基金管理人可事前向本所提交申请，本所根据基金管理人的申请进行批量暂停申购赎回处理，基金管理人应对此引发的结果承担责任。（T 日为港交所临时停市日）

（一）T 日前，基金管理人提交申请：

1. 已上市的港股 ETF：基金管理人评估确认特定情形下需临时暂停申购赎回的基金后，将申请书（附件 10-3）和基金清单邮件发送至基金管理部公共邮箱（fund@szse.cn）；

2. 新上市的港股 ETF：基金管理人评估确认特定情形下该基金需临时暂停申购赎回后，在上市业务流程中“是否纳入批量临时

暂停申赎范围”选择“是”，并提交申请书（附件 10-4）。

（二）T 日，本所基金管理部根据港交所临时停市的通知，对已纳入批量临时暂停申购赎回范围的港股 ETF 实施临时暂停申赎至当日收市。

基金管理人确认其管理的基金临时暂停申购赎回的公告在本所官网挂出后，及时在公司官网刊登《基金临时暂停申购赎回公告》，公告中应说明暂停的原因及时间等事项。

#### 附件 10-1 ETF 紧急情形

序号	应急情形	具体情形
1	ETF 申购赎回状态异常	应该暂停申购赎回的未暂停
2	出现股票赎空，且无法回补	部分股票出现赎空，且因停牌等原因无法立即买回
3	出现现金赎空	PCF 中设定了必须现金替代的股票，盘中发生大量赎回，造成组合中现金不足，可能影响资金交收
4	境外交易所、商品期货交易所或黄金交易所等临时停市	由于台风等原因，境外交易所临时停市。 由于系统故障等原因，商品期货交易所、黄金交易所等临时

		停市
5	已发布的 PCF 数据出现重大错误	因 PCF 中预估现金或股票数量等数据错误导致 IOPV 计算出现重大误差
6	申购赎回清单现金替代标志设置出现重大错误	PCF 清单中现金替代标志设置错误，严重影响基金持有人的利益
7	申购赎回清单正确，但 IOPV 计算或发布出现重大错误	由于 IOPV 计算机构问题导致 IOPV 计算或发布出现重大误差
8	本所网站上未公布申购赎回清单	因技术或操作等原因，本所网站未及时公布当日 PCF
9	基金净值披露错误	基金净值披露错误，对基金交易或申赎产生影响的
10	其他情形	基金管理人认为应该临时停牌或暂停申购赎回的其他情形

#### 附件 10-2 ETF 异常情况处理说明

序号	异常情况	处理说明
1	对于在本所进行申购赎回的 ETF，基金管理人在 T 日 6:00 前未能成功将相关	基金管理人应向本所提交当日暂停申购赎回的申请，本所停止当日相关 ETF 的申购赎回，

	ETF 的 PCF 文件发送至本所	本所网站当日不揭示相关 ETF 的 PCF 文件
2	对于不在本所进行申购赎回的 ETF，基金管理人在 T 日 6:00 前未能成功将相关 ETF 的 PCF 文件发送至本所	本所网站当日不揭示相关 ETF 的 PCF 文件
3	基金管理人在 T 日 6:00 前未能成功将相关 ETF 的 IOPV 文件发送至本所	本所停止当日相关 ETF 的 IOPV 计算

### 附件 10-3

#### 关于特定情形下批量办理港股 ETF 临时暂停申购赎回业务的申请 公司文号 XX 号

深圳证券交易所：

鉴于 XX 基金管理有限公司（以下简称我公司）管理的标的指数成份证券包括香港交易及结算所有限公司（以下简称港交所）上市交易证券的 ETF（以下简称港股 ETF），由于港交所因恶劣天气或者其他极端情况临时停市时，需要同步临时暂停申购赎回业务。前期，港交所临时停市时，我公司需就每只港股 ETF 单独向贵所提交基金临时暂停申购赎回业务的申请。为提高相关业务的办理效率，现请贵所按如下机制批量办理我公司管理的港股 ETF 临时暂停申购赎回业务（以下简称批量临时暂停申赎），具体情

---

况如下：

### 一、适用产品范围

我公司申请将我公司管理的港股 ETF 纳入批量临时暂停申赎范围。

首次申请以附表中所列的港股 ETF 为准；新上市的港股 ETF 如需纳入的，我公司将在其上市业务中提交相关申请。

### 二、批量临时暂停申赎的业务安排

我公司申请在港交所临时停市时，由贵所办理我公司管理的港股 ETF 的批量临时暂停申赎，当日不再另行提交单只港股 ETF 临时暂停申购赎回业务的申请流程，具体机制如下：

（一）触发情形：港交所因恶劣天气或者其他极端情况临时宣布取消当日证券（包括沪深股通）及衍生产品市场早上交易时段、下午交易时段或者全天交易时段。

（二）办理时间：贵所经港交所通知取消交易时段或者知悉港交所发布取消交易时段相关公告后，具体时间以贵所实际办理为准。

（三）暂停时长：自贵所实际办理批量临时暂停申赎至当日收市。

（四）信息披露安排：批量临时暂停申赎办理完成后，我公司将及时发布相关公告，切实做好信息披露工作。

### 三、承诺事项

为顺利办理相关业务，我公司承诺如下：

（一）附表中所列的每只 ETF 的标的指数成份证券均包括港交所上市交易证券；如我公司未及时申请或者错误申请，由此导

致的后果及全部损失由我公司承担。

（二）我公司在 ETF 日常运作中将及时关注贵所和港交所发布的临时停市相关公告，并承诺在触发上述批量临时暂停申赎业务时，及时发布基金临时暂停申购赎回的公告，切实做好信息披露工作。如我公司未能及时发布相关公告，由此导致的后果及全部损失由我公司承担。

（三）如出现 ETF 产品转型、投资范围变更或者其他不再满足批量临时暂停申赎触发情形的情况，我公司将提前告知贵所并申请将该产品从批量临时暂停申赎范围中剔除。如我公司未能及时申请，由此导致的后果及全部损失由我公司承担。

（四）我公司充分知悉和理解办理过程中可能发生不可抗力、意外事件、技术故障、人为差错等业务风险，如发生相关风险，我公司将积极采取措施予以补救，并愿意承担相关后果及损失。

特此申请。

XX 基金管理有限公司

二〇二 X 年 X 月 XX 日

附表：

序号	基金代码	场内简称	基金名称
1			
2			
3			

.....			

#### 附件 10-4

### 关于 XX 基金纳入批量临时暂停申赎范围的申请

深圳证券交易所：

XX 基金（基金代码： ，基金简称： ）拟于 202 年 月 日在贵所上市。由于该基金的标的指数成份证券包括香港交易及结算所有限公司（以下简称港交所）上市交易证券，现申请自 202 年 月 日（上市日）起将该 ETF 纳入批量临时暂停申赎范围，在港交所临时休市时由贵所批量办理临时暂停申赎。

#### 一、批量临时暂停申赎的业务安排

我公司申请在港交所临时停市时，由贵所办理该 ETF 的批量临时暂停申赎，当日不再另行提交该 ETF 临时暂停申购赎回业务的申请流程，具体机制如下：

（一）触发情形：港交所因恶劣天气或者其他极端情况临时宣布取消当日证券（包括沪深股通）及衍生产品市场早上交易时段、下午交易时段或者全天交易时段。

（二）办理时间：贵所经港交所通知取消交易时段或者知悉

---

港交所发布取消交易时段相关公告后，具体时间以贵所实际办理为准。

（三）暂停时长：自贵所实际办理批量临时暂停申赎至当日收市。

（四）信息披露安排：批量临时暂停申赎办理完成后，我公司将及时发布相关公告，切实做好信息披露工作。

## 二、承诺事项

为顺利办理相关业务，我公司承诺如下：

（一）该 ETF 的标的指数成份证券包括港交所上市交易证券；如我公司错误申请，由此导致的后果及全部损失由我公司承担。

（二）我公司在 ETF 日常运作中将及时关注贵所和港交所发布的临时停市相关公告，并承诺在触发上述批量临时暂停申赎业务时，及时发布该 ETF 临时暂停申购赎回的公告，切实做好信息披露工作。如我公司未能及时发布相关公告，由此导致的后果及全部损失由我公司承担。

（三）如出现 ETF 产品转型、投资范围变更或者其他不再满足批量临时暂停申赎触发情形的情况，我公司将提前告知贵所并申请将该产品从批量临时暂停申赎范围中剔除。如我公司未能及时申请，由此导致的后果及全部损失由我公司承担。

（四）我公司充分知悉和理解业务办理过程中可能发生不可抗力、意外事件、技术故障、人为差错等业务风险，如发生相关风险，我公司将积极采取措施予以补救，并愿意承担相关后果及损失。

---

特此申请。

XX 基金管理公司

202 年 月 日

---

## 第十二章 基金份额持有人大会

### 一、发起《基金份额持有人大会通知公告》信息披露流程

$T_1-1$ 日，基金管理人通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金份额持有人大会通知”发起《基金份额持有人大会通知公告》信息披露流程，附停牌申请，并填写相关停牌参数。提供的材料包括：

- （一）基金份额持有人大会通知公告；
- （二）停复牌申请（须申请二次停牌）。

注：需填写二次停牌参数，（1）第一次停牌时间为基金份额持有人大会通知公告日开市起至当日10:30；（2）第二次停牌时间为基金持有人大会召开之日（以现场方式召开的）或基金持有人大会计票之日（以通讯方式召开的）开市起停牌至基金持有人大会决议生效公告日10:30；（3）由于第二次复牌日期（决议生效公告日）不确定，复牌日期不填写。

经基金管理部核对后，基金管理人 $T_1$ 日在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：如需使用本所网络投票系统进行网络投票，基金管理人应当在投票起始日7日前发起《基金份额持有人大会通知公告》信息披露流程，填写网络投票参数（包括投票代码、投票简称、网络投票开始日期、网络投票截止日期、权益登记日等），并与深圳证券信息有限公司签订网络投票服务协议，按照信息公司有关要求办理网络投票业务。

### 二、发起《持有人大会提示性公告》信息披露流程

---

$T_1+N$  日（基金管理人根据基金法律文件中的具体规定），基金管理人通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金持有人大会通知”提交《持有人大会提示性公告》。次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### 三、发起《基金份额持有人大会停牌提示性公告》信息披露流程

$T_2-1$  日，基金管理人通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金持有人大会通知”发起信息披露流程

$T_2$  日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### 四、发起《基金份额持有人大会决议生效公告》信息披露流程

$T_2$  日，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金持有人大会决议”提交《基金份额持有人大会决议生效公告》并申请于公告日 10:30 恢复交易，需要的材料包括：

- （一）基金份额持有人大会决议生效公告；
- （二）停复牌申请。

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

**注：**1.  $T_1$  日为刊登《基金份额持有人大会通知公告》日，基金管理人至少应提前三十日或按基金合同规定时间刊登基金持有

---

人大会通知；

2.  $T_2$  日为基金持有人大会召开之日（以现场方式召开的）或基金持有人大会计票之日（以通讯方式召开的）。

---

## 第十三章 基金产品变更

针对基金产品变更类型，基金管理人应提前与深交所基金管理部商议确定变更方案和时间安排表。如有调整，应及时告知基金管理部。

### 一、基金变更为场外基金

#### （一）召开持有人大会

按照第十章“基金份额持有人大会”办理召开持有人大会相关业务（如适用）。

#### （二）发起《基金变更公告》信息披露流程

基金管理人根据基金合同及变更方案确定基金终止上市日为R日。R-4日前，基金管理人通过业务专区中“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金变更公告”发起信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

#### （三）办理终止上市

R-4日前，基金管理人按照第八章“基金终止上市和申购赎回”中的终止上市流程办理上市份额终止上市及终止申购赎回（如适用）。

#### （四）办理基金名称简称变更

R日前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金名称简称变更”发起信息披露流程，附基金名称或简称变更申请，申请表单中“基金更名启用日期”为R+1日。

---

### **(五) 发起《修改基金合同的公告》信息披露流程**

R 日前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>修改基金合同及托管协议”发起《修改基金合同的公告》信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：R 日为基金终止上市日

## **二、基金变更投资标的**

### **(一) 召开持有人大会**

按照“基金份额持有人大会”办理召开持有人大会相关业务。

### **(二) 发起《基金变更公告》信息披露流程**

基金管理人根据基金合同及变更方案确定新基金合同生效日为 R 日。R-4 日前，基金管理人通过业务专区中“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金变更公告”发起信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### **(三) 办理基金名称简称变更**

R 日前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金名称简称变更”发起信息披露流程，附基金名称或简称变更申请，申请表单中“基金更名启用日期”为 R 日。

### **(四) 发起《修改基金合同的公告》信息披露流程**

R 日前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>修改基金合同及托管协议”发起《修改基

---

金合同的公告》信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：1. 变更投资标的应保证基金业务类别不变；

2. 基金管理人可根据基金合同规定和业务需要暂停基金变更期间的申购赎回等业务。

---

## 第十四章 基金清盘

针对基金清盘，基金管理人应提前与深交所基金管理部商议确定清盘方案和清盘时间安排表。如有变更，应及时告知基金管理部。

### 一、基金清盘的情形

#### （一）召开持有人大会

如需召开持有人大会，按照“基金份额持有人大会”办理召开持有人大会相关业务。

#### （二）可能触发基金合同终止情形

如基金有较大可能触发基金合同终止情形，基金管理人应提前通过“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金合同终止提示性公告”发起《基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》信息披露流程。经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

### 二、办理终止上市及终止申购赎回

基金召开持有人大会决定基金清盘或者基金触发基金合同终止情形的，基金管理人根据持有人大会决议或基金合同确定终止上市日及终止申购赎回日（R日），R-5日前，基金管理人按照“基金终止上市和申购赎回”办理上市份额终止上市及终止申购赎回业务。

### 三、发起《基金清算公告》信息披露业务流程

基金进入清算程序前，基金管理人通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金合同终止”发起《基金

---

清算公告》信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注：《基金清算公告》可合并至《持有人大会决议公告》。

#### **四、办理基金清算相关事宜**

1. 基金进入清算程序后，基金管理人制作《基金清算报告》，并报中国证监会备案。

收到证监会备案回复后，通过基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金合同清算”发起《基金清算报告》信息披露流程。

经基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

2. 基金管理人按照中国结算和深圳结算相关规定办理清算资金发放并及时履行信息披露义务。

#### **五、发布相关提示公告**

若基金管理人决定自持有人大会决议生效日次一交易日或者基金触发基金合同终止情形后次一交易日开始停牌及暂停申购、赎回，且不再恢复的，请基金管理人提前发布公告充分提示信息。

---

## 第十五章 基金认购、申购赎回业务权限办理

### 一、开通 LOF 认购或申购赎回业务权限

T-N 日前，会员通过会员业务专区的“LOF/ETF 权限变更”业务提交开通 LOF 认购或申购赎回权限的申请，申请材料包括：开通 LOF 认购或申购赎回权限的申请书、证监会关于基金销售业务资格的核准文件（首次办理业务时提交）、深圳证券交易所开放式基金场内销售代理主协议（首次办理业务时提交）等材料的电子扫描版。

特殊机构投资者通过会员业务专区的“LOF/ETF 权限变更”业务提交开通 LOF 认购权限的申请，申请材料包括：开通 LOF 认购权限的申请书等材料的电子扫描版。

T-1 日，会员或特殊机构投资者可通过会员业务专区查询开通结果。

### 二、取消 LOF 认购或申购赎回业务权限

T-2 日前，会员或特殊机构投资者通过会员业务专区的“LOF/ETF 权限变更”业务提交取消 LOF 认购或申购赎回权限的申请，并附申请书。

T-1 日，会员可通过会员业务专区查询取消结果。

### 三、开通 ETF 申购赎回业务权限

（一）会员办理 ETF 申购赎回业务，应先按以下流程向本所申请成为 ETF 申购赎回代办证券公司：

1. 会员通过会员业务专区提交“ETF 代办证券公司资格开通”业务申请，并附申请书和证监会关于基金销售业务资格的核准文

---

件等材料。

2. 会员可通过会员业务专区查询开通结果。

(二) ETF 上市后开通申购赎回业务权限的, 基金管理人与已成为 ETF 申购赎回代办证券公司的会员或特殊机构投资者协商一致后, 按以下流程办理:

1. T-1 日前, 基金管理人申请会员、ETF 联接基金或特殊机构投资者开通该 ETF 申购赎回业务权限的, 通过基金业务专区提交“ETF 业务权限维护”业务申请, 勾选要开通的会员单位、基金管理人或特殊机构投资者, 并附下列申请材料:

(1) 《ETF 业务权限维护申请》(加盖基金管理人公章);

(2) 《ETF 申购赎回代理协议》(为会员开通需提供);

(3) 机构投资者出具的《权限使用承诺函》(为 ETF 联接基金管理人或特殊机构投资者开通需提供, 应承诺 ETF 申购赎回权限仅限于自身投资行为使用、不用于销售代理行为, 加盖机构公章。)

2. 基金管理人可通过基金业务专区查询办理结果。业务成功办结后, 方可提交相关信息披露流程。

#### **四、取消 ETF 申购赎回业务权限**

基金管理人取消会员、ETF 联接基金或特殊机构投资者对于某 ETF 申购赎回权限的, 通过基金业务专区提交“ETF 业务权限维护”业务申请, 选择拟取消权限的对象, 并附《ETF 业务权限维护申请》(加盖基金管理人公章)。

基金管理人可通过基金业务专区查询办理结果。业务成功办结后, 方可提交相关信息披露流程。

---

## 五、ETF 申购赎回业务权限查询

基金管理人可通过基金业务专区“业务资料查询-ETF 申赎权限查询”查询 ETF 申赎会员名单。

会员可通过会员业务专区“业务办理-认购/申购/赎回权限开通”查询 ETF 申赎权限情况。

注：1. T 日指业务权限生效日；

2. 特殊机构投资者指拥有或租用本所会员交易单元的机构投资者。

---

## 第十六章 基金名称、简称变更

### 一、发起基金更名信息披露流程

公告日前，基金管理人通过本所基金业务专区“业务办理—>信息披露—>基金临时报告—>基金名称、简称变更”发起信息披露流程。勾选需要变更的基金名称（或简称），填写更改后的内容及基金更名启用日期、恢复日期（如有）。拟披露日期应小于等于基金更名启用日期。提供的材料包括：

- （一）更名公告；
- （二）基金名称、简称变更申请（加盖公司公章）；
- （三）基金合同；
- （四）主管机构相关批复文件（如有）；
- （五）持有人大会决议（如有）。

注：更改后的基金简称需符合本指南第二章基金简称编制规范。

### 二、刊登《基金名称简称变更公告》

经本所基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上披露该公告。

---

## 第十七章 基金流动性服务业务

### 一、流动性服务商新增

#### (一) 提交基金流动性服务商新增业务申请

开始服务日（T日）的两个交易日（T-2日）前，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>基金流动性服务商维护—>基金流动性服务商新增”，选择基金、流动性服务商、公告日，填写流动性服务商对应的交易单元编码、证券账户及开始服务时间等表单内容，并提交相关申请材料。

#### 1. 表单填写注意事项：

(1) 选择的基金仅限于：已上市的ETF、指数型LOF、商品期货LOF和公募REITs；

(2) 基金管理人为每个流动性服务商报备的交易单元、证券账户，必须为该会员所拥有且自营使用，交易单元类别为A股交易单元（自营）。

#### 2. 需提交的材料包括：

(1) 申请书（加盖公司公章）；

(2) 新增流动性服务商公告文件；

(3) 基金流动性服务商登记表（加盖证券公司公章）。

#### 3. 其他注意事项：

每只基金可以有多个流动性服务商，每个流动性服务商需填写用于流动性服务的一个交易单元和一个证券账户信息。

#### (二) 发起《新增流动性服务商公告》信息披露流程

T-1日前，流动性服务商新增业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>流动性

---

服务商”发起信息披露流程（关联“流动性服务商新增业务”）。

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

## 二、流动性服务商终止

### （一）提交基金流动性服务商终止申请

基金管理人确定流动性服务商终止日（T日）的两个交易日（T-2日）前，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>基金流动性服务商维护—>基金流动性服务商终止”，选择基金、流动性服务商，填写公告日期和终止服务日期，并提交相关材料。

#### 1. 需提交的材料包括：

- （1）申请书（加盖公司公章）；
- （2）终止流动性服务商公告文件。

#### 2. 注意事项：

- （1）每只基金可以选择终止多家流动性服务商；
- （2）基金终止上市，评级系统会自动终止对流动性服务商的评级及激励计算，基金管理人无需办理终止流动性服务商流程；
- （3）基金转型，如原基金先办理终止上市，则无需办理终止流动性服务商流程；如转型过程中不涉及终止上市，则应对原基金流动性服务商办理终止流程。上述两种情况转型后如拟对新基金开展流动性服务，应重新办理新增流动性服务商流程；
- （4）流动性服务商出现《深圳证券交易所证券投资基金流动性服务业务指引》终止情形，基金管理人应当向本所申请终止流动性服务商为相关基金提供流动性服务。

---

## （二）发起《终止流动性服务商公告》信息披露流程

T-1 日前，流动性服务商终止业务经基金管理部核对后，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>流动性服务商”发起信息披露流程（关联“流动性服务商终止业务”）。

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

## 三、指定主流流动性服务商

### （一）提交基金指定主流流动性服务商业务申请

主流流动性服务商生效日（T 日）的两个交易日（T-2 日）前，基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>基金流动性服务商维护—>基金指定主流流动性服务商”，选择基金、主流流动性服务商、公告日，填写流动性服务商对应的主流流动性服务生效日期等内容，并提交相关申请材料。

#### 1. 需提交的材料包括：

- （1）业务申请；
- （2）公告文件。

#### 2. 注意事项：

（1）月度评价结果和评价指标数据发布至基金业务专区后（会通过基金业务专区业务通知及短信提醒基金管理人），基金管理人可以开始办理本月的指定主流流动性服务商业务。

（2）基金管理人可以对多只基金一起办理指定主流流动性服务商业务。在办理页面（“业务办理—>基金流动性服务商维护—>基金指定主流流动性服务商”），通过“选择基金”选择特定基金后，点击“选择会员”，弹出的流动性服务商当前均符合主流动

---

性服务商条件。

(3) 基金管理人可以通过“基金流动性服务—>可指定为主流动性服务商清单”查看本月当前可指定为特定基金主流动性服务商的流动性服务商清单。

#### (二) 发起《指定主流动性服务商公告》信息披露流程

T-1 日前,基金指定主流动性服务商业务经基金管理部核对后,基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>指定主流动性服务商”发起信息披露流程(关联“基金指定主流动性服务商”业务)。

次日,基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

#### 四、调整为一般流动性服务商

基金管理人可以在每个月度评级周期结束后,通过基金业务专区“基金流动性服务—>调整为一般流动性服务商信息”查看本月度应调整为一般流动性服务商的清单数据。“调整为一般流动性服务商信息”清单生成后,基金管理人需在2个交易日内发起《调整为一般流动性服务商公告》信息披露流程,并提交相关公告材料。

基金管理人通过基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>调整为一般流动性服务商”发起信息披露流程。次日,基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

注意事项:

1. “调整为一般流动性服务商信息”清单生成后(会通过基金业务专区业务通知及短信提醒基金管理人),基金管理人应在2

---

个交易日内办理调整为一般流动性服务商的公告。

2. 公告文件中调整主流流动性服务商的情况应与“调整为一般流动性服务商信息”清单内容完全一致，即调整内容包含清单中全部基金和对应的主流流动性服务商。

3. 公告文件中的一般流动性服务商生效日期应与公告办理页面“本期主流流动性服务商调整为一般的生效日期”保持一致。

---

## 第十八章 基金信息披露

本所以对公开披露的基金信息进行事前核对或者事前登记、事后核对，对其内容的真实性、准确性和完整性不承担责任。

### 一、基金定期报告

#### （一）发起信息披露流程

基金管理人应当至少在公告日前一个交易日通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>基金运作—>（半）年度报告（或季度报告）”发起定期报告信息披露流程。

#### （二）刊登《（半）年度报告（或季度报告）》

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登定期报告。

注：定期报告披露日应符合《证券投资基金信息披露管理办法》对披露截止日的规定，并应遵守中证信息技术服务有限责任公司发布的《关于基金定期报告披露日期安排的通知》的规定。

### 二、基金临时公告

#### （一）发起信息披露流程

基金管理人应在公告日前一个交易日(或之前)通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>临时报告”发起信息披露流程，如需停复牌须填写停复牌参数并附停复牌申请。同时，根据不同公告类别，提交相关材料（详见基金业务专区中相应业务表单）。

#### （二）刊登《临时公告》

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登

---

定期报告。

### 三、基金交易价格溢价风险提示

基金出现二级市场交易价格明显高于基金份额净值情形的，原则上按以下要求提交溢价风险提示公告或停牌及溢价风险提示公告，包括但不限于对基金运作是否规范稳健、是否存在应当披露而未披露的重大信息、对基金份额持有人权益的影响等事项进行风险提示。

#### （一）溢价风险提示公告

收盘时，ETF 当日收盘价与收盘 IOPV 相比的溢价率大于等于 5%小于 10%的，LOF 当日收盘价与最新公告的基金份额净值相比的溢价率大于等于 10%小于 20%的，基金管理人在当日收盘后，通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>临时报告—>交易价格波动风险提示”发起信息披露流程，并提交相关溢价风险提示公告。

次日，基金管理人在符合中国证监会规定条件的媒体上刊登该公告。

#### （二）停牌及溢价风险提示公告

收盘时，ETF 当日收盘价与收盘 IOPV 相比的溢价率大于等于 10%的，LOF 当日收盘价与最新公告的基金份额净值相比的溢价率大于等于 20%的，基金管理人在当日收盘后，通过本所基金业务专区中的“业务办理—>信息披露—>临时报告—>停复牌公告”发起信息披露流程，并提交停复牌公告和停复牌申请，并在页面填写停复牌参数，停牌时间为次一交易日开市起至 10:30 分。

经本所基金管理部核对后，次日，基金管理人在符合中国证

监会规定条件的媒体上披露该公告。

#### 四、注意事项

(一) 如信息披露涉及基金停复牌，基金管理人应与本所提前沟通，原则上须在公告日前一交易日 16:00 以前通过基金业务专区提交申请；

(二) 基金管理人在基金业务专区办理完成信息披露业务后，应跟进巨潮资讯网刊登情况，如超过 1 个小时未查询到刊登情况（15 点前提提交的公告 16 点未查询到），应与巨潮资讯网（0755-83991101）联系确认；

(三) 对于 20:30 以后提交的信息披露，基金管理人应在信息披露通过后及时联系巨潮资讯网，避免出现公告刊登不及时的情况。

#### 五、信息披露类别列表

信息披露类别及公告内容见下表：

序号	一级公告类别	二级公告类别	公告内容	事前/事后核对
1	发售上市	发售公告	基金发售业务时提交发售公告等文件	事前
2		基金份额募集失败	基金募集失败公告	事前
3		募集期变更	募集期变更公告	事前
4		募集情况	份额认购申请确认比例公告及募集期中的提示性事项	事后
5		基金合同生效	基金合同生效公告	事后
6		募集份额折算事项	基金募集成立后上市之前进行基金份额折算的公告以及折算结果公告	事后

7		上市交易公告书	上市交易公告书	事前
8		上市交易提示性公告	上市交易提示性公告	事后
9	定期报告	年度报告	年度报告	事后
10		半年度报告	半年度报告	事后
11		第一季度报告	第一季度报告	事后
12		第二季度报告	第二季度报告	事后
13		第三季度报告	第三季度报告	事后
14		第四季度报告	第四季度报告	事后
15		开放式基金申购赎回	开放、暂停、恢复申购、赎回	开放、暂停、恢复申购/赎回公告
16	ETF 暂停申购赎回公告（非节假日）		ETF 非节假日办理开放、暂停、恢复申购/赎回业务的公告	事前
17	基金终止申购赎回		基金终止申购赎回公告	事前
18	巨额赎回		基金发生巨额赎回的公告	事前
19	开通集合申购		开通集合申购公告	事前
20	ETF 暂停申购赎回公告（节假日）		ETF 因境外交易所休市或非港股通交易日等事项需暂停/恢复申购的公告	事后
21	申购、赎回及其费率、收费方式变更		申购、赎回及其费率、收费方式变更公告	事后
22	定期定额申购、投资		基金调整场外单笔申购和定投最低金额、开通定投业务及参加费率优惠活动、定投起点金额等与定投有关事项等	事后
23	条件申购		大额申购的提示性公告、基金最低赎回份额和最低保留份额的公告等	事后
24	份额转换事项		调整基金转换业务规则及跨TA 转换（非配对）业务等	事后

25		其它申购赎回公告	境外主要市场节假日申购赎回安排的公告(一般年初公告一次)、申购赎回清单新增申赎数量限制指标的公告等	事后
26	基金 临时报 告	基金终止上市	基金终止上市公告及提示性公告	事前
27		基金持有人大会通知	基金持有人大会公告、基金持有人大会提示性公告、基金持有人大会停牌提示性公告	事前
28		基金持有人大会决议	基金持有人大会决议公告	事前
29		基金名称、简称变更	基金名称、简称变更公告	事前
30		基金收益分配或折算/拆分	基金收益分配公告, LOF 及 ETF 份额折算公告、折算比例公告	事前
31		基金变更公告	基金变更公告	事前
32		基金折算/拆分结果公告	LOF 及 ETF 份额折算结果公告	事后
33		停复牌公告	特殊停复牌事项公告	事前
34		澄清公告	澄清公告	事后
35		流动性服务商新增公告	流动性服务商新增公告	事前
36		流动性服务商终止公告	流动性服务商终止公告	事前
37		基金合同终止	触发基金合同终止情形公告	事前
38		基金质押式回购公告	基金可进行质押式回购交易的公告	事前
39		修改基金合同及托管协议	修改基金合同公告, 合同期限变更公告, 修改托管协议	事后
40		修改、更新招募说明	修改、更新招募说明书公告	事后

	书		
41	交易价格波动风险提示	二级市场交易价格波动较大且折溢价水平较高的风险提示公告	事后
42	跨系统转托管	基金开通跨系统转托管以及暂停跨系统转托管的公告	事后
43	基金份额净值计价错误	基金份额净值计价错误	事后
44	管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率	管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率变更相关事项的公告	事后
45	基金投资事项	比较基准指数及其更名，收益率及其变更，业绩报酬、业绩补偿有关事项，跟踪指数成份股及其调整，投资非公开上市股票事项等	事后
46	基金营销活动有关事项	基金营销活动有关事项，新增、变更基金发售机构	事后
47	更换基金经理或基金经理情况变更	更换、新增、减少基金经理或基金经理情况变更	事后
48	基金改聘会计师事务所、更换基金托管人或基金托管人情况变更	更换基金托管人或基金托管部负责人等情况变更，基金改聘会计师事务所	事后
49	基金及相关主体、相关人员受到监管部门调查、诉讼、处罚等事项	基金托管人或基金管理人或基金经理受到监管部门的调查或严重行政处罚，以及涉及基金财产、基金托管业务的调查、诉讼等	事后

50		重大关联交易事项	基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会规定的情形除外	事后
51		其他重大事项		事后
52		其它基金运作公告		事后
53		更正公告	更正公告	事后
54		基金份额转换结果公告	基金份额转换结果的公告	事后
55		修改、更新基金产品资料概要	基金产品资料概要	事后
56		基金合同终止提示性公告	可能触发基金合同终止情形的提示性公告	事后
57		基金合同清算	基金合同清算相关事项公告	事后
58	基金管理人公告	基金管理人情况发生变更	基金管理人名称、住所发生变更，高级管理人员离任、变更、兼职，设立分公司或分公司成立，董事会换届，公司地址及电话号码变更，督察长变更等，基金管理人股东及出资情况变更、基金管理人章程	事后
59		基金估值方法变更	基金估值方法变更	事后
60		基金管理人投资有关事项	基金管理人投资有关事项含基金管理人赎回旗下基金份额	事后
61		基金管理人其它公告	基金管理人其它公告	事后

62		投资者服务	投资者身份证明相关事项，网站、网上交易及客服系统相关事项，对账单服务，提醒投资者事项等	事后
63	基金净值	封闭式基金净值	基金净值	事后
64		开放式基金净值揭示	开放式基金净值	事后