

附件

上海证券交易所基金自律监管规则适用指引 第1号——指数基金开发

(2023年8月修订)

第一条 为了规范公开募集指数证券投资基金（以下简称指数基金）相关业务活动，保护投资者合法权益，依据《证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》（以下简称《基金上市规则》）等规定，制定本指引。

第二条 基金管理人开发指数基金并在本所上市交易的，适用本指引。本指引没有规定的，适用《基金上市规则》《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》《上海证券交易所上市开放式基金业务指引》等相关规定。

本指引所称指数基金，是指符合《指数基金指引》规定并在本所上市交易的指数基金，包括交易型开放式指数基金和上市开放式基金。

第三条 基金管理人拟开发指数基金并在本所上市交易的，应当做好人员配置、业务制度及技术系统方面的准备工作。

第四条 基金管理人拟开发指数基金并在本所上市交易，其

标的指数为非宽基股票指数的，应当符合下列要求：

（一）标的指数的成份证券数量不低于 30 只；

（二）标的指数的单一成份证券权重不超过 15%且前 5 大成份证券权重合计占比不超过 60%；

（三）标的指数发布时间不短于 3 个月，经中国证监会认可，符合国家战略和产业政策指数除外；

（四）权重占比合计 90%以上的成份证券过去 1 年的日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市股票的前 80%。

前款所述宽基股票指数，是指选样范围不限于特定行业或投资主题，反映某个市场或某种规模股票表现的指数。宽基股票指数不受上述限制，但单一标的指数成份股权重原则上不超过 30%。

基金管理人申请开发债券指数基金，其标的指数应当符合本条第一款第（一）项至第（三）项要求，利率债（含国债、地方政府债、政策性金融债）指数基金不适用前述要求。

本指引施行前已经中国证监会核准或注册的指数基金不适用本条规定。

第五条 基金管理人向中国证监会申请募集注册前，提请本所就开发指数基金并上市交易出具无异议函的，应当向本所提交以下材料：

（一）拟开发指数基金并在本所上市交易的申请；

（二）标的指数编制方案；

（三）标的指数符合本指引第四条相关要求的说明及承诺；

（四）本所规定的其他材料。

标的指数或其编制方案在申请日符合本指引规定条件及本所其他相关规则规定的，本所向基金管理人出具无异议函。

第六条 基金管理人就指数基金向中国证监会注册并完成募集后，应当向本所提交指数基金上市申请，本所以对符合上市条件的指数基金，按照《基金上市规则》的规定安排基金上市。

第七条 指数基金在本所上市交易前，基金管理人应当确保基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同等法律文件的约定。

第八条 基金管理人违反本指引的，本所可以依据《基金上市规则》等相关规定，对其采取自律监管措施或者纪律处分。

第九条 本指引由本所负责解释。

第十条 本指引自发布之日起施行。本所于 2022 年 5 月 18 日发布的《上海证券交易所基金自律监管规则适用指引第 1 号——指数基金开发（2022 年修订）》（上证发〔2022〕74 号）同时废止。