

附件

深圳证券交易所证券投资基金业务指引第3号 ——基金通平台份额转让

第一章 总则

第一条 为规范证券投资基金场外份额（以下简称基金份额）在深圳证券交易所（以下简称本所）基金通平台的转让及相关业务，保护投资者合法权益，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及《深圳证券交易所公开募集基础设施证券投资基金业务办法（试行）》（以下简称《基础设施基金业务办法》）等有关规定，制定本指引。

第二条 基金通平台是本所设立的为基金份额转让提供场所及设施的基础设施服务平台。

第三条 基金份额在基金通平台转让及相关业务，适用本指引；本指引未作规定的，适用本所其他相关规定。

第四条 基金管理人可以向本所申请，为在本所上市的公开募集基础设施证券投资基金（以下简称基础设施基金）或者本所认可的其他基金份额开通基金通平台转让业务。

第五条 基金份额在基金通平台转让，不代表本所对相关基金的投资风险或者收益等做出判断或者保证，投资风险由投资者自行承担。

第六条 基金管理人、基金销售机构、做市商、投资者等主体及其相关人员在基金通平台参与份额转让及相关业务，应当遵守法律、行政法规、部门规章、规范性文件、本所有关业务规则及承诺，接受本所自律管理。

第七条 投资者及做市商参与基金通平台份额转让，应当持有本所指定的登记结算机构开立的场外开放式基金账户（以下简称基金账户）。

投资者参与基金通平台的基金份额转让，应当充分知悉基金通平台转让相关业务规则、转让流程及拟转让品种的投资风险，审慎、合规开展转让。

第二章 参与主体

第一节 基金销售机构

第八条 符合条件的基金销售机构可以申请开通基金通平台业务权限，根据本指引规定及与投资者的约定，为投资者参与基金通平台转让提供下列基金销售增值服务：

- （一）展示基金通平台转让行情信息；
- （二）代投资者提交转让申报、向投资者反馈成交确认信息；
- （三）对投资者提交的转让申报进行前端检查，确保其有足额份额或者资金用于交收；
- （四）根据成交清算结果，代为办理资金划付；
- （五）基金销售机构和投资者约定的其他服务。

第九条 基金销售机构申请开通基金通平台业务权限，应当同时符合下列条件：

- （一） 具备基金销售业务资格；
- （二） 具备开展基金通平台业务所需的技术系统；
- （三） 运作规范稳定，最近一年内没有因基金销售业务受到中国证监会的行政处罚或者证券交易所、行业自律组织的纪律处分；
- （四） 本所规定的其他条件。

本所以对基金销售机构是否符合条件进行确认，对符合条件、开通基金通平台业务权限的基金销售机构，本所将向市场公告。

第十条 基金管理人可以选定基金销售机构为其管理的特定基金提供基金通平台转让服务，并与基金销售机构签署相关协议。

第十一条 基金销售机构应当与投资者签署基金通平台转让服务协议，明确双方权利义务，坚持投资者利益优先和风险匹配原则，按照约定为投资者参与基金通平台转让提供相关服务，采取有效措施保障投资者的资金安全。

基金销售机构应当依照《基础设施基金业务办法》相关要求，要求首次买入基础设施基金的投资者签署风险揭示书。

基金销售机构接受投资者基金份额转让委托时，应当核对投资者身份及其账户有效性，对投资者的每一笔委托所涉及的资金、基金份额、价格等内容进行核查，查验资金、证券是否足额，确保投资者委托符合本所有关规定。

第十二条 基金销售机构应当建立相应的监管协同制度与流程，配合本所调查，根据本所监管要求及时、准确和完整地提供相关资料，协助本所以对投资者转让行为进行自律监管。

第十三条 基金销售机构出现以下情形之一的，本所可以调整或者终止其业务权限：

（一）基金销售机构不再符合本指引第九条第一款规定的条件；

（二）基金销售机构以本所认为合理的理由向本所申请终止其业务权限；

（三）本所认定的其他情形。

第二节 做市商

第十四条 证券公司或者本所认可的其他机构可以向本所申请成为基金通平台做市商，在基金通平台开展做市业务，向投资者提供持续报价，并对投资者询价提供回应报价。

做市商开展做市业务，应当使用向本所报备的专用基金账户，为单只基金提供做市服务应当使用唯一的专用基金账户。

第十五条 机构申请成为基金通平台做市商，应当同时符合下列条件：

（一）具备开展基金通平台做市业务所需的技术系统；

（二）运作规范稳定，最近一年内没有因自营及做市业务受到中国证监会的行政处罚或者证券交易所、行业自律组织的纪律

处分；

（三）本所规定的其他条件。

证券公司开展基金做市业务许可管理按照中国证监会有关规定执行。

本所以对机构是否符合上述条件进行确认，对符合条件、开通基金通平台业务权限的做市商，本所将向市场公告。

第十六条 经基金管理人认可，做市商可以在基金通平台为特定基金提供做市服务，并与基金管理人签署相关协议。

第十七条 本所建立对基金通平台做市商的评价制度，根据相关指标，定期对做市商的服务情况进行评价，具体评价方法由本所另行规定。

本所可以根据做市商评价结果向做市商支付适当的服务费用。

第十八条 做市商应当依法依规开展做市业务，不得进行内幕交易、市场操纵等违法违规行为，不得谋取不正当利益或者进行其他可能损害投资者合法权益的行为。

第十九条 做市商可以在基金通平台转让时间内将基金份额在本所场内交易系统（以下简称交易系统）和基金通平台之间进行转入转出，并应当遵守以下规定：

（一）使用向本所报备的做市专用基金账户及其关联证券账户；

（二）当日通过交易系统买入的基金份额，当日可以转入基

金通平台并卖出；

（三）当日从基金通平台转出至交易系统的基金份额，当日可以在交易系统卖出；当日从基金通平台净转出的单只基金份额数量不得超过该做市专用基金账户当日开市前持有的该基金可用份额数量。

做市商提交做市份额转入转出申报指令，应当包括基金代码、方向、数量及本所要求的其他内容。

第二十条 做市商和基金销售机构应当签署协议，明确双方资金交收相关权利义务及违约处理安排等事项。

第二十一条 做市商出现下列情形之一的，本所可以调整或者终止做市商业业务权限：

（一）不再符合本指引第十五条第一款规定的条件；

（二）出现严重违法违规、谋取不当利益、损害投资者利益的行为；

（三）做市商以本所认为合理的理由向本所申请终止业务权限；

（四）本所认定的其他情形。

第三章 基金转让

第二十二条 投资者可以通过基金销售机构与做市商在基金通平台进行基金份额转让。转让方式包括报价、询价及本所认可的其他方式。投资者之间不能进行转让。

第二十三条 基金通平台转让时间为每个交易日上午 9:30 至 11:30，下午 13:00 至 15:00。根据市场发展需要，本所可以调整基金通平台转让时间。

第二十四条 基金份额在基金通平台转让的，其涨跌幅限制、申报价格最小变动单位、买入卖出效率及回转买卖安排等事项，参照本所基金竞价交易的相关规定执行，本所另有规定的除外。

第二十五条 报价转让是指做市商发出报价，投资者提交转让申报并与做市商发出的报价达成成交的转让方式。

第二十六条 报价转让申报指令应当包括基金代码、转让方向、数量、价格及本所要求的其他内容。申报数量应当为 100 份或者其整数倍。卖出基金时，余额不足 100 份的部分应当一次性申报卖出。本所可以根据市场需要，调整报价转让单笔转让申报数量。

第二十七条 投资者采用报价转让方式的，本所接受普通申报及即时成交剩余撤销申报两种申报类型。普通申报未能全部成交时，未成交部分当日继续有效。即时成交剩余撤销申报未能全部成交时，未成交部分自动撤销。

做市商采用报价转让方式的，报价申报未能全部成交时，未成交部分当日继续有效。

投资者可以撤销未成交的普通申报，做市商可以撤销未成交的报价申报。

第二十八条 投资者采用报价转让方式的，对于投资者提交

的转让申报，基金通平台系统在所有做市商报价申报中按照价格优先、时间优先的原则进行成交，以做市商报价申报价格为成交价。

对于做市商提交的报价申报，基金通平台系统在所有投资者申报中按照价格优先、时间优先的原则进行成交，未成交部分在所有做市商报价申报中按照价格优先、时间优先的原则进行成交。做市商与投资者成交的，以做市商报价申报价格为成交价。做市商之间成交的，以先进入基金通平台系统的申报价格为成交价。

第二十九条 询价转让是指投资者向做市商发送询价请求，做市商进行回应报价，投资者提交指令并达成成交的转让方式。

第三十条 投资者发送询价请求，应当包括基金代码、买卖方向、询价数量以及本所要求的其他内容。

做市商对询价请求进行回应，回应报价的要素应当包括价格、数量及本所要求的其他内容。

第三十一条 本所提供点击成交和匹配成交两种询价转让成交方式。投资者选择点击成交方式的，应当点击做市商回应报价，并确认成交数量。投资者选择匹配成交方式的，应当提交可接受价格，基金通平台系统在做市商回应报价中按照价格优先、时间优先的原则进行匹配成交，成交数量不大于投资者申报数量，以做市商回应报价价格为成交价。

第三十二条 采用询价转让方式的，投资者询价请求申报数量应当不低于 10 万份，且为 100 份的整数倍。做市商回应报价申

报数量应为 100 份的整数倍。本所可以根据市场需要，调整单笔转让申报数量。

第三十三条 未成交的询价请求或者回应报价可以撤销。投资者提交的询价请求在 3 分钟内有效。超过有效时限的询价请求自动撤销的，针对该询价的回应报价随之自动撤销。

第三十四条 基金销售机构及做市商通过电子接口等向基金通平台发送转让申报指令。基金销售机构应当根据投资者委托的内容，按照接收投资者委托的时间先后顺序及时向本所申报。转让申报经本所基金通平台系统确认后方为有效。

基金销售机构、做市商应当对其向本所发出的转让申报指令的合法性、真实性、准确性及完整性负责并承担相应的法律责任。

第三十五条 转让申报经基金通平台系统达成成交后，转让即告成立。符合本指引规定达成的转让于成立时生效，转让双方应承认成交结果，履行清算交收义务。本所另有规定的除外。

第三十六条 出现暂无基金销售机构或者做市商为该基金提供服务、基金份额竞价交易停牌或者本所认定的其他情形的，基金管理人应当向本所申请暂停相关基金份额在基金通平台的转让。上述情形消除后，基金管理人应当向本所申请恢复转让。

基金份额竞价交易停牌的，本所同时暂停该基金份额在基金通平台的转让。本所可以基于维护市场平稳运行、保护基金投资者权益的需要，对基金实施暂停转让。

第三十七条 基金管理人可以以本所认为合理的理由向本所

申请基金份额在基金通平台终止转让。基金管理人向本所申请基金份额终止上市的，应当同时申请基金份额在基金通平台终止转让。

第三十八条 因不可抗力、意外事件、重大技术故障、重大人为差错等突发性事件而导致基金通平台部分或者全部转让不能正常进行的，本所可以决定采取暂停转让等措施。

因前款规定的突发性事件导致基金份额转让结果出现重大异常，按转让结果进行交收将对基金份额转让秩序和市场公平造成重大影响的，本所可以采取取消转让、通知登记结算机构暂缓交收等措施。

因突发性事件及本所采取相应措施造成的损失，本所不承担民事赔偿责任，但存在重大过错的除外。

第三十九条 本所每个交易日通过基金通平台或者交易所网站发布基金通平台报价转让的申报信息、报价转让及询价转让的成交信息等信息。

第四十条 基金通平台行情信息归本所所有。未经许可，任何机构及个人不得发布、使用和传播。

经本所许可使用基金通平台相关信息的机构和个人，未经同意，不得将信息提供给其他机构和个人使用或者予以传播。

第四十一条 基金通平台不单独计算开盘价及收盘价，基金通平台基金份额前收盘价为该基金在交易系统即时行情显示的前收盘价。

第四章 监督管理

第四十二条 本所以对基金通平台基金份额转让过程中的下列事项，予以重点监控：

- （一）涉嫌内幕交易、操纵市场等违法违规行为；
- （二）可能影响基金转让价格或者成交量的异常转让行为；
- （三）基金转让价格或者成交量明显异常的情形；
- （四）本所认为需要重点监控的其他事项。

第四十三条 本所以对基金销售机构和做市商全天净买入申报金额总量实施额度管理。本所可以根据机构交收违约等情况调整净买入申报额度。具体额度管理方式由本所另行规定。

第四十四条 基金销售机构、做市商在基金通平台开展业务，应当配备业务所需的专业人员，制定完备的内部管理制度及风险控制制度。

第四十五条 基金销售机构和做市商应当妥善保存投资者相关资料，委托、申报和成交记录，清算文件及业务纠纷处理记录等文件资料，保存期限不得少于二十年，任何机构和个人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。本所根据监管需要，可以要求基金销售机构和做市商提供前述文件资料。

第四十六条 基金销售机构及做市商的基金通平台份额转让及相关系统与本所接口部分的建设、运行、维护，应当符合本所或者本所设立、授权机构规定或者认可的技术管理规范。

第四十七条 本所可以根据本指引及本所其他相关规定和监

管需要，对基金管理人、基金销售机构及做市商等参与机构进行现场和非现场监督检查，检查对象应当积极配合，按要求提供相关资料，如实回复本所问询，并督促其相关方积极配合。

第四十八条 基金通平台基金管理人、基金销售机构、做市商、投资者等主体及其相关人员违反本指引、本所其他相关规定或者其作出的承诺，或者出现第四十二条重点监控事项中情节严重的行为的，本所可以视情节轻重，对其采取口头警示、书面警示、约见谈话、通报批评、公开谴责、暂停或者限制业务权限、取消业务权限等自律监管措施或者纪律处分。

在公开谴责、暂停或者限制业务权限、取消业务权限等纪律处分决定作出前，当事人可以申请听证。对公开谴责、暂停或者限制业务权限、取消业务权限等纪律处分有异议的，当事人可以申请复核。听证、复核的程序及其他事宜，适用本所相关规定。

第四十九条 基金销售机构、做市商违反登记结算机构相关规定的，根据登记结算机构的提请，本所可以限制其参与基金通平台相关业务。

第五章 附则

第五十条 基金通平台业务的登记结算由本所指定的登记结算机构负责办理。

发生资金交收违约情形的，资金交收各方应当自行协商解决，本所不承担相关法律责任。

第五十一条 本指引由本所负责解释。

第五十二条 本指引自发布之日起施行。