附件：

深圳证券交易所证券投资基金

流动性服务业务指引

1. **总则**

第一条 为了规范深圳证券交易所（以下简称本所）上市证券投资基金（以下简称基金）的流动性服务业务，根据《深圳证券交易所交易规则》《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》《深圳证券交易所证券投资基金交易与申购赎回实施细则》及本所其他相关规定，制定本指引。

第二条本指引所称流动性服务，是指符合条件的本所会员及本所认可的其他专业机构（以下统称流动性服务商）按照本指引的规定，为本所基金提供持续双边报价等服务。

1. **流动性服务商管理**

第三条基金管理人选定或新增的流动性服务商，应当具备下列条件：

（一）已制定完备的流动性服务实施方案和风险控制制度；

（二）具备开展流动性服务业务所需的专业人员、技术系统和资金准备；

（三）本所规定的其他条件。

第四条 基金管理人选定或新增流动性服务商，应当向本所提交下列材料：

（一）申请函；

（二）基金流动性服务商登记表；

（三）基金流动性服务商汇总表；

（四）本所要求的其他材料。

第五条流动性服务商出现下列情形之一的，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：

（一）不再符合本指引第三条规定的条件；

（二）与基金管理人协议到期、变更或提前解除；

（三）流动性服务商因故无法为单只或多只基金正常提供流动性服务，且与基金管理人协商一致的；

（四）年度评级周期内，为特定基金提供流动性服务的季度评级结果出现两次或以上“D”；

（五）出现违法违规、谋取不正当利益或其他可能损害投资者合法权益的行为；

（六）本所认定的其他情形。

第六条 基金管理人申请终止流动性服务商为相关基金提供流动性服务，应当向本所提交申请函和终止后基金流动性服务商汇总表。

第七条 基金管理人对流动性服务商的选定、新增和终止，应当及时向市场公告。

1. **流动性服务业务规则**

第八条 流动性服务商开展流动性服务业务，应当使用专用证券账户和指定的交易单元。专用证券账户只能用于本所基金流动性服务业务，不得用于其他业务。

流动性服务商为单只基金提供流动性服务，只能使用唯一的专用证券账户。

第九条 流动性服务商开展流动性服务的业务指标，包括但不限于下列要素：

（一）最大买卖价差；

（二）最小申报金额；

（三）时间加权报价差率；

（四）连续竞价参与率；

（五）集合竞价参与率，包括开盘集合竞价参与率和收盘集合竞价参与率；

（六）平均单笔申报金额。

本所可以根据市场情况，对具体基金品种的流动性服务业务指标作出具体安排和调整。

第十条 本所建立对流动性服务商的评价制度，根据相关指标，定期对流动性服务商的服务情况进行评级，并将评级结果向市场公告。

第十一条 本所根据流动性服务商评级结果，可以对流动性服务商给予适当的激励。

第十二条 当市场出现异常情况时，本所可以根据流动性服务商的申请，对流动性服务商的流动性服务评级考核进行适度豁免。

1. **监督管理**

第十三条 流动性服务商开展流动性服务业务，应当遵守法律、行政法规、部门规章、规范性文件及本所业务规则等有关规定，建立有效的风险防范与业务隔离制度，不得进行内幕交易、市场操纵等违法违规行为，谋取不正当利益的行为，或者其他可能损害投资者合法权益的行为。

第十四条 流动性服务商应当维护基金市场秩序，积极开展基金市场推广和投资者教育活动。

第十五条 基金管理人违反本指引的，本所可以视情况采取相关自律监管措施或纪律处分。

1. **附则**

第十六条 本指引由本所负责解释。

第十七条 本指引自2019年1月1日起施行。

附表：1．基金流动性服务商汇总表

2．基金流动性服务商登记表

附表1：

基金流动性服务商汇总表

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 基金管理人 |  | | | | | | |
| 基金简称 |  | | | | | | |
| 基金代码 |  | | | | | | |
| 原有□、新增□、终止□ | | 流动性服务商 |  | 交易单元编码 |  | 账户 |  |
| 原有□、新增□、终止□ | | 流动性服务商 |  | 交易单元编码 |  | 账户 |  |
| 原有□、新增□、终止□ | | 流动性服务商 |  | 交易单元编码 |  | 账户 |  |
|  | |  |  |  |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |  |
| 基金管理人承诺：   * 保证本表中所填内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 * 保证遵守国家有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件及深圳证券交易所业务规则等相关规定，并接受深圳证券交易所的自律监管。 * 以上新增及原有流动性服务商符合《深圳证券交易所证券投资基金流动性服务业务指引》的规定。 * 如违反上述承诺，愿意承担由此引起的一切法律责任，并接受深圳证券交易所的自律监管措施或纪律处分。   基金管理人（盖章）：  年 月 日 | | | | | | | |

附表2：

基金流动性服务商登记表

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 流动性服务商全称 |  | | | | | |
| 基金简称 |  | | | | | |
| 基金代码 |  | | | | | |
| 交易单元编码 |  | | 交易单元名称 |  | | |
| 流动性服务账户 | 账户 |  | | 使用部门（自营、经纪或其他） | |  |
| 业务负责人姓名 |  | 联系电话 | |  | | |
| 手机电话 |  | 传真 | |  | | |
| 交易员（1）姓名 |  | 联系电话 | |  | | |
| 手机电话 |  | 传真 | |  | | |
| 交易员（2）姓名 |  | 联系电话 | |  | | |
| 手机电话 |  | 传真 | |  | | |
| 是否具有相关基金申购赎回业务权限 | | | | | 是（ ）否（ ） | |
| 是否已制定完备的流动性服务实施方案、内部控制制度、风险防范机制和业务隔离制度 | | | | | 是（ ）否（ ） | |
| 是否具备开展流动性服务所需的专业人员、技术系统和资金准备 | | | | | 是（ ）否（ ） | |
| 流动性服务商承诺：   * 保证本表中所填内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 * 保证遵守国家有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件及深圳证券交易所业务规则等相关规定，并接受深圳证券交易所的自律监管。 * 将按照《深圳证券交易所证券投资基金流动性服务业务指引》等相关规定，提供流动性服务。 * 如违反上述承诺，愿意承担由此引起的一切法律责任。   流动性服务商（盖章）：  年 月 日 | | | | | | |