

附件 2

《深圳证券交易所深港通业务实施办法》 修订说明

为持续优化互联互通机制，进一步扩大深港通 ETF 标的范围，本所对《深圳证券交易所深港通业务实施办法》（以下简称《实施办法》）进行了修订。现就有关修订情况说明如下：

一、修订背景

2022 年 7 月 ETF 纳入互联互通标的以来，交易运行平稳有序，交易规模持续增长，为两地投资者跨境投资提供更多便利和机会。为进一步优化深港通机制，扩大深港通 ETF 范围，本所对《实施办法》相关内容进行修订。

二、修订内容

本次《实施办法》合计修订 6 条，主要是调整深股通、港股通 ETF 范围。

一是调整深股通 ETF 和港股通 ETF 有关规模和权重占比的调入要求。**深股通方面**，ETF 纳入规模门槛由不低于人民币 15 亿元调整为不低于人民币 5 亿元；调入比例调整为“跟踪的标的指数成份证券中，深交所和上交所上市股票权重占比不低于 60%，且深股通股票和沪股通股票权重占比不低于 60%”（第二十五条）。**港股通方面**，ETF 纳入规模门槛由不低于港币 17 亿元调整为不

低于港币 5.5 亿元；调入比例统一调整为“跟踪的标的指数成份证券中，联交所上市股票权重占比不低于 60%，且港股通股票权重占比不低于 60%”，不再以指数进行区分（第七十六条）。

二是调整深股通 ETF 和港股通 ETF 有关规模和权重占比的调出情形。**深股通方面**，ETF 调出规模由低于人民币 10 亿元调整为低于人民币 4 亿元；调出比例调整为“跟踪的标的指数成份证券中，深交所和上交所上市股票权重占比低于 55%，或深股通股票和沪股通股票权重占比低于 55%”（第二十六条）。**港股通方面**，调出规模由低于港币 12 亿元调整为低于港币 4.5 亿元；调出比例统一调整为“跟踪的标的指数成份证券中，联交所上市股票权重占比低于 55%，或港股通股票权重占比低于 55%”，不再以指数进行区分（第七十七条）。

三是调整条款序号并修订废止条款（第八十条、第一百四十七条）。

三、征求意见情况

本所于 2024 年 4 月 19 日至 5 月 5 日就修订《实施办法》向市场公开征求意见。对相关反馈意见，逐条进行研究，具有合理性和可行性的，根据实际情况予以吸收；对于调整股票权重占比的建议，尚需结合市场运行情况进一步研究评估；对于不涉及本次修订内容的其他工作建议，将结合有关业务开展情况研究考虑。