****

**上海证券交易所**

**基金业务指南第3号**

**--基金通平台业务办理**

**上海证券交易所创新产品部**

**2022年1月**

# 版本说明

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **版本号** | **发起部门** | **操作** | **日期** | **说明** |
| V1.0 | 创新产品部 | 创建 | 2022年1月 | 根据基金法律法规及上交所基金业务规则，基金通平台做市转让业务指引等材料汇编。 |

# 上海证券交易所基金通平台业务分布及主办部门

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **部门** | **具体服务内容** | | | **服务对象** |
| 创新产品部 | 日常运行 | 常规业务 | 数字证书申请 | 基金管理人、基金销售机构和做市商 |
| 基金信息披露 |
| 基金通平台 | 基金通平台产品相关业务受理 |
| 基金通平台销售业务受理 |
| 基金通平台做市业务受理 |
| 技术公司 | 日常运行 | 基金通平台 | 基金通应急联系 |
| 技术测试 | 基金业务 | 技术实验室测试 |
| 信息公司 | 日常运行 | 基金通平台 | 基金通网站服务及网站应急 |
| 公告发布 | 完成本所网站公告发布 |

**注：相关业务联系人信息见本所网站衍生品与基金专区首页（http://biz.sse.com.cn/fund）**

**目录**

[版本说明 2](#_Toc94186715)

[上海证券交易所基金通平台业务分布及主办部门 3](#_Toc94186716)

[第一章 总则 6](#_Toc94186717)

[第二章 常规业务 7](#_Toc94186718)

[一、 数字证书申请 7](#_Toc94186719)

[二、 办理综合业务交换平台接入 9](#_Toc94186720)

[三、 进行技术测试 9](#_Toc94186721)

[四、 信息披露 9](#_Toc94186722)

[第三章 基金管理人 11](#_Toc94186723)

[一、 首次开通产品平台转让功能 11](#_Toc94186724)

[二、 常规关闭（开通）平台转让功能 12](#_Toc94186725)

[三、 紧急关闭平台转让功能 12](#_Toc94186726)

[四、 产品与基金销售机构关系维护 13](#_Toc94186727)

[第四章 基金销售机构 14](#_Toc94186728)

[一、 申请接入平台 14](#_Toc94186729)

[二、 常规额度调整 15](#_Toc94186730)

[三、 紧急额度调整 16](#_Toc94186731)

[四、 终止开展平台销售业务 16](#_Toc94186732)

[五、 前端控制 16](#_Toc94186733)

[第五章 做市商 18](#_Toc94186734)

[第一节 业务申请与受理 18](#_Toc94186735)

[一、 申请接入平台 18](#_Toc94186736)

[二、 做市账户报备 19](#_Toc94186737)

[三、 做市商申请为基金产品做市 20](#_Toc94186738)

[四、 主动申请终止做市服务 21](#_Toc94186739)

[五、 常规调整业务额度 21](#_Toc94186740)

[六、 紧急业务额度调整 22](#_Toc94186741)

[第二节 义务与评价 22](#_Toc94186742)

[一、 做市义务 22](#_Toc94186743)

[二、 月度评价 25](#_Toc94186744)

[三、 年度综合评价 25](#_Toc94186745)

[四、 评价调整 26](#_Toc94186746)

[五、 评价公告 27](#_Toc94186747)

[第三节 权利、激励与监督管理 27](#_Toc94186748)

[一、 做市评价豁免 27](#_Toc94186749)

[二、 做市激励与监督 27](#_Toc94186750)

[三、 终止为特定标的做市服务 27](#_Toc94186751)

[四、 终止开展做市业务 28](#_Toc94186752)

[第六章 附件 29](#_Toc94186753)

[附件1：基金管理人申请开通产品基金通平台转让功能的函 29](#_Toc94186754)

[附件2：基金管理人常规关闭（开通）转让申请表 30](#_Toc94186755)

[附件3：基金管理人紧急关闭转让申请表 31](#_Toc94186756)

[附件4：基金销售机构开展基金通平台业务的申请函 32](#_Toc94186757)

[附件5：申请机构人员情况表 33](#_Toc94186758)

[附件6：基金通平台业务测试情况反馈表 35](#_Toc94186759)

[附件7：关于调整基金通平台净买入额度的申请函 37](#_Toc94186760)

[附件8：关于申请开展基金通平台做市业务的函 39](#_Toc94186761)

[附件9：做市商基金通平台特定标的做市账户变更申请表 40](#_Toc94186762)

[附件10：做市商在基金通平台为特定基金做市申请书 41](#_Toc94186763)

[附件11：基金管理人认可函 42](#_Toc94186764)

[附件12：做市商信息报备表 43](#_Toc94186765)

[附件13：做市商终止在基金通平台为特定基金做市申请书 44](#_Toc94186766)

# 第一章 总则

为规范上海证券交易所（以下简称本所）基金通平台（以下简称平台）相关业务办理，制定本指南。

本指南根据《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金（REITs）业务办法（试行）》《上海证券交易所基金自律监管规则适用指引第2号-上市基金做市业务》《上海证券交易所基金自律监管规则适用指引第3号-基金通平台份额转让》等业务规则制定，本指南如有内容与基金法律法规及本所业务规则不一致的,以基金法律法规及本所业务规则为准。

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、基金销售机构、做市商等机构应当按照最新指南办理业务。

本所正式受理业务申请后,基金管理人、基金销售机构和做市商应书面指定对口联络人，负责与本所沟通联络。如因特殊情况确需更换联络人，需及时告知本所。相关业务参与人办理本指南相关业务时，可参考使用附件模板。

# 第二章 常规业务

### 数字证书申请

#### 注意事项

1. 基金管理人、基金销售机构和做市商需持数字证书方能登录相关系统办理业务。
2. 基金管理人、基金销售机构和做市商通过业务系统首次办理平台业务的，应于首次业务发起前至少5个工作日完成EKey申请工作。
3. 基金管理人平台业务申请需通过专用EKey登录“本所网站-交易参与人业务系统-基金业务模块”办理相关业务。
4. 基金管理人平台信息披露需通过专用EKey登录“本所网站-基金业务管理系统”办理相关业务。
5. 基金销售机构和做市商平台业务申请需通过专用EKey登录“本所交易参与人业务系统”办理相关业务。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 申请流程

T-5日

* 基金管理人、基金销售机构和做市商应登录本所信息公司CA在线业务系统（https://cnsca.sse.com.cn/）。基金管理人选择的证书类别为“业务管理系统平台基金业务模块--基金管理人业务”；基金销售机构选择的证书类型为“业务管理系统平台交易参与人模块--销售机构业务”；做市商选择的证书类型为“业务管理系统平台交易参与人模块--做市商业务”。根据页面要求如实填写相关内容。基金管理人担任销售机构的，需按照销售机构要求申请。
* 按页面要求下载打印《申报表单文件》《CnSCA数字证书申请责任书》和授权材料，填写完成并加盖公章，将加盖公章的上述材料扫描后通过CA在线业务系统提交。通过EKey登录CA在线业务系统提交申请的，不需寄送申请材料原件。通过口令登录CA在线业务系统提交申请的，需将上述申请材料原件寄送至本所信息公司CA中心。邮寄地址如下：

上海市浦东新区张东路1387号37栋 邮编：201203

收件：上证所信息网络有限公司CA中心

T日

* 取得数字证书。

#### 申请费用

对于业务管理系统平台，暂免每家机构前5个证书的服务费。额外申请的证书服务费500元/年；如一次性支付三年服务费用的，收费优惠为400元/年。

#### 证书发放

EKey制作周期一般为5个工作日，EKey制作完成后，本所信息公司将按各家机构申请EKey时选择的方式，快递送达或通知现场领取。

EKey领取事宜咨询联系电话：021-68814725。

EKey技术支持电话：021-58654194, 021-58654154。

#### 操作指引

交易参与人业务系统需插入EKey验证后，通过网络浏览器使用账号及密码登录访问。建议使用最新chrome浏览器，系统访问地址: https://bmsp.uap.sse.com.cn，登录账号及密码将随EKey同步发放。

### 办理综合业务交换平台接入

拟开通基金通平台做市商和基金销售机构业务权限的机构，如已接入交易行情网，在完成基金通业务办理后可直接通过交易行情网参与基金通平台交易，其它机构应提前联系上交所技术有限责任公司（以下简称上交所技术）签署《综合业务交换平台协议》，办理基金通、证通云盘及相关网络接入业务。

技术接入联系方式：68607332

### 进行技术测试

拟开通基金通平台做市商和基金销售机构业务权限的机构，申请开通基金通业务权限前，应提前联系上交所创新产品部，开展技术测试。首次接入基金通平台的基金销售机构，还应提前完成全天候测试环境接入申请。

技术测试咨询电话：4009003600

### 信息披露

#### 注意事项

根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等法律法规的要求，在本所平台开展业务的基金管理人应于规定时间内在本所官网发布依法披露的信息。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务流程

T-1日（含）前

* 基金管理人通过衍生品与基金业务平台菜单“信息披露”上传公告。

T日

* 基金管理人安排公告见报（如有需要）。
* 公告发布在本所官网。
* 基金管理人核对本所网站披露内容是否符合预期。

# 第三章 基金管理人

### 首次开通产品平台转让功能

#### **注意事项**

本流程主要涉及首次开通产品平台转让功能的基金管理人。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务办理流程

T-4日（含）17:00前

* 基金管理人首次申请开通产品平台转让功能，应通过业务管理系统平台--基金业务模块递交申请函（附件1），并以电子邮件的方式发送到上海证券交易所创新产品部收文邮箱：cpsw@sse.com.cn。

T-2日（含）17：00

* 本所将根据有关规定，对申请材料进行审核。根据本所审核情况，本所复函基金管理人，给予基金管理人同意开通产品平台转让功能或拒绝等回复。

T-1日

* 基金管理人通过衍生品与基金业务平台菜单“信息披露”及时上传平台产品相关的信息披露文件。

T日

* 基金管理人安排公告见报。
* 基金管理人核对本所网站披露内容是否符合预期。
* 平台正式开通产品转让功能。

### 常规关闭（开通）平台转让功能

#### 注意事项

常规关闭（开通）平台转让功能适用于基金在平台连续关闭转让业务的情形。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务办理流程

T-1日（含）12：00前

* 基金管理人通过业务管理系统平台基金业务模块提交申请（附件2）。

T-1日（含）前

* 基金管理人通过衍生品与基金业务平台菜单“信息披露”上传公告。

T日

* 基金管理人安排公告见报（如有需要）。
* 基金管理人核对本所网站披露内容是否符合预期。
* 平台正式关闭（开通）产品转让功能。

### 紧急关闭平台转让功能

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影响平台转让正常进行时，或基金管理人申请，可以盘中紧急关闭平台转让功能。

盘中紧急关闭平台转让功能仅限当日有效。基金管理人申请紧急关闭平台转让功能的，应立即电话通知本所应急联络人并通过业务管理系统平台基金业务模板提交关闭申请（附件3），并通过衍生品与基金业务平台菜单“信息披露”及时上传公告进行信息披露。

### 产品与基金销售机构关系维护

#### 注意事项

1. 基金管理人须确认基金销售机构已在本所开通业务权限，确保填写的销售机构代码与机构（会员）代码准确。
2. 基金管理人担任销售机构的，需维护自身代销关系。
3. 基金管理人维护的代销关系，不包括仅担任做市商的机构。
4. 销售机构终止开展平台销售业务的，基金管理人需在业务管理系统平台基金业务模块中解除产品与该销售机构的关系。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务办理流程

T-1日15：00前

* 基金管理人通过业务管理系统平台基金业务模块为产品维护基金销售机构关系。

T日

* 权限生效。

# 第四章 基金销售机构

### 申请接入平台

#### **注意事项**

1. 本流程主要涉及首次接入平台的基金销售机构。基金管理人担任销售机构的，按照销售机构流程办理。
2. 基金销售机构首次接入平台，应在接入前完成技术测试。
3. 销售机构向本所申请接入平台前，应先向中国结算申请办理相关业务。
4. 销售机构须与相关做市商签署包含资金交收义务相关内容的协议。
5. 销售机构通过业务管理系统平台销售商模块提交材料。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 申请条件

申请接入平台的基金销售机构，需符合下列条件：

1. **具备基金销售业务资格；**
2. **具备开展平台业务所需的技术系统；**
3. **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；**
4. **本所规定的其他条件。**

#### 业务办理流程

T-4日15:00前

* 基金销售机构通过业务管理系统平台销售商模块递交申请并向本所提交下列材料：

1. **申请函（附件4）；**
2. **人员情况说明（附件5）；**
3. **本所技术测试反馈表（附件6）；**
4. **业务总体性方案、风险管理制度、应急预案等有关内部管理制度、技术系统准备情况的材料（盖公司章）；**
5. **本所要求的其他申请材料。**

T 日前

* 本所将根据有关规定，对申请材料进行审核。申请机构符合条件且材料齐备的，本所通知申请人并向市场公告。本所视情况组织专项检查，专项检查不计入上述期限。

T日

* 接入平台生效。

### 常规额度调整

#### **注意事项**

1. 为控制风险，本所对基金销售机构的净买入额度实施管理。基金销售机构可根据自身业务开展情况申请额度调整。

基金销售机构对自身净买入可用余额进行管理。

净买入可用余额=净买入额度-（买入申报金额-卖出成交金额-买入申报撤单金额-买入成交低于申报金额的差额）

1. 每个交易日进行计算；
2. **所有基金通平台产品合并计算；**
3. **报价转让与询价转让（投资者二次确认时）合并计算。**
4. 本所可以根据机构交收违约情况调整净买入额度。同一销售机构连续两个交易日发生平台资金交收违约时，本所可以将该机构净买入额度调整为0。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务受理流程

T-2日（含）15:00前

* 基金销售机构通过业务管理系统平台销售商模块向本所提交以下材料：

1. **申请书（附件7）；**
2. **本所要求的其他材料。**

T日

* 额度调整生效。

### 紧急额度调整

盘中紧急净买入额度调整仅当日有效。基金销售机构申请紧急额度调整的，应于当日14：30前立即电话通知本所并通过业务管理系统平台销售商模块提交以下材料：

1. **申请表（附件7）；**
2. **本所要求的其他申请材料。**

申请符合条件且材料齐备的，经本所确认申请后即刻生效。

### 终止开展平台销售业务

基金销售机构有下列情形之一的，本所可以终止其开展在平台的基金销售业务，并书面通知基金销售机构：

1. 基金销售机构不再符合《上海证券交易所基金自律监管规则适用指引第3号上证基金通平台份额转让》第八条第一款规定的条件；
2. 基金销售机构以本所认为合理的理由向本所书面申请终止其业务权限；
3. 本所规定的其他情况。

### 前端控制

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。投资者发起询价转让时，基金销售机构按特定价格计算投资者询价金额（特定价格介于平台当日理论跌停价与涨停价间，具体由销售机构自行决定），并对投资者资金进行前端控制。

# 第五章 做市商

## 第一节 业务申请与受理

### 申请接入平台

#### 注意事项

1. 本流程主要涉及首次在平台开展做市业务的做市商。
2. 做市商首次接入平台，应在接入前完成技术测试。
3. 做市商向本所申请接入平台业务前，应先向中国结算申请办理相关业务。
4. 做市商为特定基金做市的，其所属基金销售机构（做市商本身）应为中国结算TA系统该基金的代销机构。
5. 做市商须确认已与相关销售机构签署了包含资金交收义务相关内容的协议。
6. 做市商通过业务管理系统平台做市商模块提交材料。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 申请条件

申请开展平台做市业务的机构，需符合下列条件：

1. 具备开展平台做市业务所需的技术系统；
2. 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；
3. 本所规定的其他条件。

#### 业务受理流程

T-4日15:00前

* 机构申请开展平台做市业务，应向本所提交下列材料:

1. 申请书（附件8）；
2. 人员情况说明（附件5）；
3. 本所技术测试反馈表（附件6）；
4. 业务总体性方案、风险管理制度、应急预案等有关内部管理制度、技术系统准备情况的材料（盖公司章）；
5. 本所要求的其他材料。

T日前

* 本所将根据有关规定，对申请材料进行审核。申请机构符合条件且材料齐备的，本所通知申请人并向市场公告。本所视情况组织专项检查，专项检查不计入上述期限。

T日

* 接入平台生效。

### 做市账户报备

做市商在平台做市，应当向本所报备做市专用基金账户。报备的做市专用基金账户不得用于平台做市以外的用途。

做市商为特定基金产品做市应使用唯一的做市专用基金账户。特定做市专用基金账户可用于为多个基金产品提供做市服务。

账户信息需与在中国结算总部开立的账户信息一致，并确保其规范性，账户信息包括：投资人姓名（XX公司（全称）-做市，若有不同类型的做市团队，可列明XX公司（全称）-权益做市）、证件类型（营业执照）、证件代码（营业执照号）、开放式基金账户、销售机构代码、销售机构名称、网点号码和交易账户等。

做市商撤销上述账户的，应当确保账户已不用于平台做市，于T-2日（含）15:00前通过业务管理系统平台做市商模块向本所报备，经本所确认后撤销。

### 做市商申请为基金产品做市

#### 注意事项

1. 做市商为特定基金做市的，其所属基金销售机构（做市商本身）应为中国结算TA系统该基金的代销机构。
2. 做市商可将基金份额在本所竞价系统和平台之间进行划转，用于开展做市转让。做市商需向本所报备关联证券账户，用于基金份额在竞价系统的划转。
3. 特定基金产品应使用唯一的关联证券账户。做市商同时在竞价系统为该基金产品做市的，关联证券账户与竞价系统使用的做市账户为同一个。做市商在竞价系统不为该基金产品做市的，关联证券账户不得为该产品在竞价系统使用的做市账户。关联证券账户不得用于提供基金通做市服务以外的其他用途。关联证券账户与期权业务对应的现货账户应为不同账户。
4. 做市商变更标的账户的，应当通过业务管理系统平台做市商模块于T-1日（含）15:00向本所申请（附件9），经本所确认后实施。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务受理流程

T-2日（含）15:00前

* 做市商应通过业务管理系统平台做市商模块提交为特定基金做市的申请，申请材料如下：

1. 申请书（附件10）；
2. 基金管理人的认可函（附件11）；
3. 报备表（附件12）；
4. 本所要求的其他文件。

T日前（含）

* 申请符合条件且材料齐备的，本所予以受理，并向市场公告。

T日

* 标的做市服务起始日。做市商可以为申请的基金提供做市服务，并接受本所考评。

### 主动申请终止做市服务

做市商主动申请终止在平台为特定基金产品做市的，应不晚于T-1日（含）15:00前通过业务管理系统平台做市商模块提交主动终止做市服务的申请（附件13），经本所确认后终止。

### 常规调整业务额度

#### 注意事项

1. 为控制风险，本所对做市商的净买入额度实施管理。做市商可根据业务开展情况申请额度调整。
2. 做市商对自身净买入可用余额进行管理。

净买入可用余额=净买入额度-（买入申报金额-卖出成交金额-买入申报撤单金额-买入成交低于申报金额的差额）

1. 每个交易日进行计算；
2. **所有基金通平台产品合并计算；**
3. **报价转让与询价转让合并计算。**
4. 本所可以根据机构交收违约情况调整净买入额度。同一做市商连续两个交易日发生平台资金交收违约时，本所可以将该机构净买入额度调整为0。

#### 业务受理部门

创新产品部

#### 业务受理流程

T-2日（含）15:00前

做市商通过业务管理系统平台做市商模块向本所提交以下材料：

1. 申请书（附件7）；
2. 本所要求的其他材料。

T日

* 额度调整生效。

### 紧急业务额度调整

盘中紧急业务额度调整仅当日有效。做市商申请紧急额度调整的，应于当日14：30前立即电话通知本所并通过业务管理系统平台做市商模块提交以下材料：

1. **申请表（附件7）；**
2. **本所要求的其他申请材料。**

申请符合条件且材料齐备的，经本所确认申请后即刻生效。

## 第二节 义务与评价

本所根据做市指标，定期评价做市商的做市情况，分为月度评价和年度综合评价。月度评价是每个月对做市商的做市情况进行考评。每个考评月度是从上个月21日至本月20日（第一个考评月度是从上一年度12月21日至本年度1月20日）。提供做市满10个交易日的参与月度评价。年度综合评价是每年12月对做市商从上年度12月21日至本年度12月20日的做市情况进行综合考评。

### 做市义务

做市义务具体要求如表1所示。本所将根据业务的进展情况，对评价参数进行持续更新和调整。

**表1：做市义务**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 基金类型 | 最小报价金额 | 最小平均每笔报价金额 | 最低报价参与率 | 报价最大报价偏离度 | 询价最大报价偏离度 | 回应报价最长时限 | 回应报价最短保留时间 | 回应报价最小报价量 |
| REITs | 10万元 | 5万元 | 40% | 2% | 2% | 60秒 | 30秒 | 5万份 |

做市指标，包括但不限于下列要素：

#### 报价

1. 报价偏离度

做市商应促使平台与竞价系统基金的价格尽量保持一致。报价偏离指标用来评估做市商平台报价与竞价系统报价的偏离情况。报价偏离度计算公式为：

其中，P0为做市商平台报价的最低买报价，P1为此时竞价系统的最新成交价。分子为绝对值。

最低买报价定义如下：将订单簿中的存量买单按报价价格从高到低进行累加，直到报价金额累加值满足最小报价金额，则该笔买单价格即为最低买报价。

若报价金额累加值不满足最小报价金额，则最低买报价为订单簿中的存量买单报价价格最低一档。

报价偏离度应不超过报价最大报价偏离度。

1. 最小报价金额

做市账户存量买单的总计金额，应不低于最小报价金额。

1. 平均每笔报价金额

考评周期内做市商报价总金额与报价笔数的比值。

1. 报价参与率

考评周期内做市商报价时间与平台转让时间的比值。其中，做市账户在某采样点对做市的基金有报价，该采样点即计入报价时间。

1. 报价有效参与率

每日报价有效参与率计算公式为：

其中，有效采样点是指做市账户在该采样点上，存量买订单报价金额不低于该基金最小报价金额，且订单满足报价偏离度要求。

采样时间为平台转让阶段，每秒进行采样。

将每日报价有效参与率进行算数平均得到月度报价有效参与率。

#### 回应报价

投资者发起询价后，第180秒询价结束，未成交的全部自动撤单。

1. 回应报价偏离度

做市商回应报价的价格不应大幅偏离竞价系统报价。回应报价偏离度计算公式为：

其中，P2为做市商回应报价，P1为此时竞价系统的最新成交价。分子为绝对值。

回应报价偏离度应不超过询价最大报价偏离度。

做市商撤单后再次报价的，P1为再次报价时竞价系统的最新成交价。

1. 回应报价最长时限

做市商在1分钟内（包括第60秒）给出回应的，视为参与此次询价。

1. 回应报价最短保留时间

回应报价保留30秒的，视为参与此次询价。

做市商撤单后再次报价的，保留时间从再次报价开始计算。

1. 回应报价最小报价量

单笔回应报价最小报价量为5万份。

1. 回应报价参与率

有效回应报价指满足回应报价最长时限、回应报价最短保留时间、回应报价最小报价量、回应报价偏离度要求的回应报价。

### 月度评价

本所根据报价有效参与率等指标，对做市商为特定基金做市情况进行月度评价，评价结果分为AA、A、B、C、D五档，D档为不合格。具体评价步骤如下：

1. 依据报价有效参与率指标情况进行评价，得到当月度做市商为特定基金做市的评价结果：

**表2：评价标准**

|  |  |
| --- | --- |
| **指标** | **评价标准** |
|  | A数值≥115%  B100%≤数值<115%  C85%≤数值<100%  D 数值<85% |

1. 在考评周期内，若做市商为特定基金做市出现下列情形之一的，则该做市商该产品的月度评价为D：
2. 未达到最小平均每笔报价金额；
3. 未达到最低报价参与率。
4. 在考评周期内，做市商参与特定基金的回应报价，回应报价参与率大于等于70%的，上调该特定基金月度评价一档（原有评价为A的上调为AA）。回应报价参与率小于30%的，下调该特定基金月度评价一档。
5. 本所可根据报价偏离度和回应报价偏离度异常情况对做市商评价结果进行调整。

### 年度综合评价

根据做市商的月度评价情况，进行年度综合评价。具体评价步骤如下：

1. 做市商为多个基金产品做市的，将各月度评价按照下表的对应关系转换为评分，进行算术平均，得到年度综合评分。

**表4：做市评价赋值**

|  |  |
| --- | --- |
| **做市服务评价** | **评分赋值** |
| AA | 4 |
| A | 3 |
| B | 2 |
| C | 1 |
| D | 0 |

1. 按照下表中的对应关系，将做市年度综合评分转换为综合评价，分为AA、A、B、C、D四档。

**表5：做市评分转换评价**

|  |  |
| --- | --- |
| **做市服务评分** | **做市服务评价** |
| [3.5,4.0] | AA |
| [2.5,3.5) | A |
| [1.5,2.5) | B |
| [1.0,1.5) | C |
| [0,1.0) | D |

### 评价调整

本所可根据有关规定对本做市商评价结果进行调整。

1. 月度评价调整。月度评价周期内因做市业务被本所采取监管措施1次的，当月所有月度评价下调一档；被本所采取监管措施2次及以上的，当月所有月度评价下调至D。
2. 年度评价调整。年度评价周期内因做市业务被本所采取监管措施3次及以上的，当年年度综合评价为D。
3. 因做市业务违规情节严重、受到中国证监会行政处罚或本所纪律处分的，当月所有月度评价及年度综合评价为D。

### 评价公告

本所向基金产品所属的基金管理人和做市商通告每月度做市评价结果，供其参考。本所向市场公告做市商年度综合评价结果。

## 第三节 权利、激励与监督管理

### 做市评价豁免

出现下列情形之一，导致做市商无法继续做市的，本所可以根据市场情况或者做市商申请，相应豁免做市商的做市义务：

1. 基金竞价系统转让价格（即最新成交价）达到涨停或跌停价格；
2. 因不可抗力、意外事件或者技术故障等导致无法继续提供做市，做市商可以暂停对部分或者全部基金产品做市，并及时向本所报告；
3. 本所规定的其他情形。

前款规定的情形消失后，做市商应当立即恢复做市。出现前款第2项规定情形，做市商应在当日17:00前向本所提交书面豁免申请并说明原因。

基金做市商月度报价义务被豁免的，该月度的考评予以取消。特定一天报价义务被豁免的，当天的考评不予统计。

### 做市激励与监督

做市商在平台特定基金月度做市评价结果达到AA的（本所支持询价转让方式前，达到A的）或本所认可的其他情形，可调高其特定标的在竞价系统的月度做市评价。

### 终止为特定标的做市服务

做市商有下列情形之一的，本所可以终止其为特定基金做市，通知做市商和产品所属基金管理人：

1. 基金管理人提供充分理由书面要求终止做市商在平台为其管理的基金做市的；
2. 做市商在考评年度内，为特定基金做市的月度评价出现六次D或更低评价的；
3. 本所规定的其他情形。

### 终止开展做市业务

做市商有下列情形之一的，本所可以终止其开展在平台的做市业务，并书面通知做市商：

1. 不再符合开展平台做市业务的条件；
2. 出现严重违法违规、谋取不当利益、损害客户或基金份额持有人利益的行为；
3. 本所规定的其他情形。

# 第六章 附件

### 附件1：基金管理人申请开通产品基金通平台转让功能的函

**关于申请开通XX产品基金通平台转让功能的函**

**（函号）**

上海证券交易所：

XX基金管理有限公司（以下简称我公司）向贵所申请开通XX（基金代码：XX;基金扩位简称:XX；以下简称XXX）基金通平台转让功能。现将有关情况汇报如下：

一、论述公司符合申请条件

二、关于开通日期

综上所述，我公司具备开通XX基金通平台转让功能的条件，且已做好准备。现特向贵所为我公司该产品开通基金通平台转让功能提供相应协调和准备工作。

特此致函。

XX基金管理有限公司（加盖公章）

XX年XX月XX日

### 附件2：基金管理人常规关闭（开通）转让申请表

上海证券交易所：

XX基金管理有限公司（以下简称我公司）现申请关闭（开通）我公司管理的XXXXX产品基金通平台转让功能，具体关闭（开通）时间及原因如下表：

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **证券代码** | **证券简称** | **扩位证券简称** | **关闭起始日** | **关闭终止日** | **原因** |
| 1 |  |  |  | YYYY年MM月DD日 | YYYY年MM月DD日 |  |
| 2 |  |  |  | YYYY年MM月DD日 | YYYY年MM月DD日 |  |

说明：1.关闭起始日、关闭终止日可为空。关闭起始日填入日期、关闭终止日为空时，为连续关闭；关闭起始日为空、关闭终止日填入日期时，为开通。

2.关闭终止日的次一交易日为开通起始日。

经办人：XX手机号：XX

XX基金管理有限公司（加盖公章）

XX年XX月XX日

### 附件3：基金管理人紧急关闭转让申请表

上海证券交易所：

XX基金管理有限公司（以下简称我公司）现申请紧急关闭我公司管理的XXXXX产品基金通平台转让功能，具体关闭时间及原因如下表：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **证券代码** | **扩位证券简称** | **生效日** | **生效时间** | **原因** |
| 1 |  |  | YYYY年MM月DD日 | □生效至13:00  □生效至15:00 |  |
| 2 |  |  | YYYY年MM月DD日 | □生效至13:00  □生效至15:00 |  |

说明：1.紧急关闭基金通平台转让功能仅当日有效；

2.生效至13:00为上午半天停牌；

经办人：XX手机号：XX

XX基金管理有限公司（加盖公章）

XX年XX月XX日

### 附件4：基金销售机构开展基金通平台业务的申请函

**关于申请开展基金通平台业务的函**

**（函号）**

上海证券交易所：

我司向贵所申请开展基金通平台业务。现将有关情况汇报如下：

（论述公司符合申请条件）

此外，我司已向中国结算总部提交相关申请材料，销售商代码为X。

我司拟申请基金通平台净买入额度为XX元。理由如下：

（从额度是否满足业务开展需求、风险是否可控等角度论述。）

综上所述，我司具备开展基金通平台销售业务的条件，且已做好准备。我司承诺，提交的申请材料内容真实、准确、完整，如存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担相关法律责任。

特此致函。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件5：申请机构人员情况表

**人员情况表**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 公司名称 |  | | | | | |
| 业务负责人 | 姓名 |  | | | | |
| 部门 |  | | | | |
| 电话 |  | | 邮件地址 | |  |
| 业务联络人 | 姓名 |  | | | | |
| 部门 |  | | | | |
| 电话 |  | | 邮件地址 | |  |
| **部门与岗位设置** | | | | | | |
| （部门名称1）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述（标明人员为主岗或备岗） | 联系方式 | | 教育背景与工作履历 | |
| （部门负责人） |  |  | （座机）  （手机）  （邮件） | | 教育背景：  （从本科写到最高学历：年份-毕业学校-专业-学位）  工作履历：  （年份-单位-职责） | |
|  |  |  |  | |  | |
|  |  |  |  | |  | |
| （部门名称2）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述 | 联系方式 | | 工作履历 | |
|  |  |  |  | |  | |
|  |  |  |  | |  | |
| （部门名称3）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述 | 联系方式 | | 工作履历 | |
|  |  |  |  | |  | |
|  |  |  |  | |  | |

年 月 日

（加盖单位公章）

### 附件6：基金通平台业务测试情况反馈表

**基金通平台业务测试情况反馈表**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 机构基本情况 | 机构名称 |  | | | |
| 参与机构  所属类别 | □证券公司 □基金公司 □期货公司 □保险公司 □托管银行□其他 | | | |
| 联系人 | 姓名 |  | | 电话 |  |
| 手机 |  | | 电子邮件 |  |
| 反馈项目 | | | 答案 | | |
| 1. 柜台系统是否必须升级（必填） | | | 必须□ 非必须□ 无此业务□ | | |
| 1. 技术系统改造就绪情况 （必填） | | | 完成□ 未完成□ 无需改造□ | | |
| 1. 若未就绪，改造完成时间（必填） | | | 一周□ 一月□ 更长时间□ 不适用□ | | |
| 1. 测试完成情况（必填） | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 1. 做市商验证完成情况 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 1）接收基金通盘前公告文件验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 2）接收基金通行情文件验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 3）基金通买入申报及撤单验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 4）基金通转入转出申报验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 5）基金通盘后过户报表验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 1. 销售机构验证完成情况 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 1）接收基金通盘前公告文件验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 2）接收基金通行情信息验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 3）基金通卖出申报及撤单验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 4）开通基金通账户申报验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 5）基金通盘后过户报表验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 6）基金通盘后账户申请对账文件验证 | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 1. 行情接收展示(UT、API网关等) | | | 通过□ 部分通过□ 失败□ 未测□ 无此业务□ | | |
| 备注   1. 测试发现的异常 2. 其它反馈信息 3. 上表中如选未测，请填写原因 | | |  | | |

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件7：关于调整基金通平台净买入额度的申请函

**关于调整基金通平台净买入额度的申请**

**（函号）**

上海证券交易所：

我司拟申请调整基金通平台净买入额度。

我司最近1个月额度使用情况：

我司拟提高额度，具体用途为：

最近3个月，我司开展基金通平台相关业务未发生交收违约事件。

我司承诺，提交的申请材料内容真实、准确、完整，如存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担相关法律责任。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

**净买入额度调整申请表**

|  |  |
| --- | --- |
| 公司名称 |  |
| 目前额度 |  |
| 拟申请额度 |  |
| 拟开始使用新额度日期 |  |

年 月 日

（加盖单位公章）

### 附件8：关于申请开展基金通平台做市业务的函

**关于申请开展基金通平台做市业务的函**

**（函号）**

上海证券交易所：

我司向贵所申请开展基金通平台做市业务。现将有关情况汇报如下：

（论述公司符合申请条件）

此外，我司已向中国结算总部提交相关申请材料，销售商代码为X、销售商接入类型包含对接做市商。

我司拟申请基金通平台净买入额度为XX元。理由如下：

（从额度是否满足业务开展需求、风险是否可控等角度论述）

综上所述，我司具备开展基金通平台做市业务的条件，且已做好准备。我司承诺，提交的申请材料内容真实、准确、完整，如存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担相关法律责任。

特此致函。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件9：做市商基金通平台特定标的做市账户变更申请表

**关于基金通平台特定标的做市账户变更申请表**

上海证券交易所：

我司向贵所申请变更基金通平台特定标的做市账户。

拟于XXXX年XX月XX日，开始使用新账户，信息如下表所示：

|  |  |
| --- | --- |
| **基金产品 （全称及代码）** |  |
| **开放式基金账户** |  |
| **销售机构代码** |  |
| **网点号码** |  |
| **交易账户** |  |
| **关联证券账户** |  |

特此申请。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件10：做市商在基金通平台为特定基金做市申请书

**关于在基金通平台为XX基金（等X只基金）做市的申请**

上海证券交易所：

我司向贵所申请在基金通平台为XX基金（基金扩位简称：XX，基金代码：XX）做市。我司具备开展业务所需的技术系统、人员和业务经验，有能力为上述基金产品做市。我司所属基金销售机构为中国结算TA系统该基金的代销机构，已与相关销售机构签署了包含资金交收义务相关内容的协议，并已取得基金管理人书面认可。

特此申请。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件11：基金管理人认可函

**关于XX基金基金通平台做市商的认可函**

为促进XX基金（基金扩位简称：XX，基金代码：XX）的市场流动性和平稳运行，我司委托XX公司在基金通平台，为该基金提供做市服务。我司确认XX公司所属基金销售机构为中国结算TA系统有基金的代销机构, 做市商与相关销售机构签署了包含资金交收义务相关内容的协议。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日

### 附件12：做市商信息报备表

**信息报备表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **公司名称** |  | |
| **申请做市基金产品 （全称及代码）** |  | |
| **开放式基金账户** |  | |
| **销售机构代码** |  | |
| **网点号码** |  | |
| **交易账户** |  | |
| **关联证券账户** |  | |
| **做市业务联络人** | **姓名** |  |
| **电话** |  |
| **邮件** |  |
| **拟开始做市日期** |  | |

年 月 日

（加盖单位公章）

### 附件13：做市商终止在基金通平台为特定基金做市申请书

**关于终止在基金通平台为XX基金做市申请书**

上海证券交易所：

我司向贵所申请终止在基金通平台为XX基金（基金扩位简称：XX，基金代码：XX）做市。我司已与XX基金管理公司协商一致，拟自XXXX年XX月XX日起终止为上述基金做市。

特此申请。

XX公司（盖章）

XX年XX月XX日