

ETF 納入互聯互通合資格證券的定期調整考察 (北向)¹

資格準則:

於定期調整考察時符合以下所有條件的上交所上市 ETF 及深交所上市 ETF 將成為北向交易合資格證券:

1. 有關ETF須以人民幣計價，且最近六個月日均資產規模不低於人民幣15億元；
2. 有關ETF須已上市不少於六個月；
3. 跟蹤的標的指數發布時間滿一年；
4. 跟蹤的標的指數中，上交所和深交所上市股票權重佔比不低於90%，且滬股通股票和深股通股票權重佔比不低於80%；及
5. 跟蹤的標的指數或者其編制方案須符合以下任何一組條件：
 - (a) 適用於寬基股票指數²：
 - 單一成份股權重不超過 30%。
 - (b) 適用於非寬基股票指數：
 - 成份股數量不低於 30 隻；
 - 單一成份證券權重不超過 15%且前五大成份證券權重合計佔比不超過 60%；及
 - 權重佔比合計 90%以上的成份股最近一年日均成交金額位於其所在證券交易所上市股票的前 80%。

合資格 ETF 如於其後定期調整考察時符合以下任何一項條件，其將成為只供賣出的證券並被暫停買入：

1. 有關ETF最近六個月的日均資產規模低於人民幣10億元；
2. 跟蹤的標的指數中，上交所和深交所上市股票權重佔比低於85%，或者滬股通股票和深股通股票權重佔比低於70%；或
3. 跟蹤的標的指數及其編制方案符合以下任何一項條件：
 - (a) 適用於寬基股票指數：
 - 單一成份股權重超過 30%。
 - (b) 適用於非寬基股票指數：
 - 成份股數量低於 30 隻；
 - 單一成份證券權重超過 15%，或前五大成份證券權重合計佔比超過 60%；或
 - 最近一年日均成交金額位於其所在證券交易所上市股票前 80%的成份股，其權重佔比合計低於 90%。

¹ 有待監管部門批准

² 寬基股票指數是指所挑選的成份股不限於特定行業或投資主題，而是反映某個市場或某種規模股票表現的指數

數據考察截止日，公布日及生效日：

數據考察截止日	上證180指數/深證成份指數調整生效日，即六月及十二月的第二個星期五後的第一個交易日
公布日	定期調整考察數據截止日後第四個星期五（如非港股交易日，則為前一個港股交易日）
生效日	公布日後的第二個星期一（如非CSC交易日，則為下一個CSC交易日）