

上海华证指数信息服务有限公司

指数研究与发布管理办法

V 1.0

2022年06月

生效日期	版本号	版本说明
2022. 03.	V1. 0	制定指数研究与发布管理办法
2022. 06.	V1. 1	文字修订

第一章 总则

第一条 为规范上海华证指数信息服务有限公司（以下简称“华证指数”或“公司”）指数研究与发布的流程，特制定本办法。

第二条 本办法适用于公司管理的股票指数、债券指数等指数。

第二章 指数构建目标与原则

第三条 指数旨在准确、客观、科学地反映特定市场、板块、行业、主题或策略等方面的表现。

第四条 指数依据代表性、可投资性、稳定性等目标进行构建。

第五条 指数基于透明的、基于规则的方法构建，指数编制方案应明确描述指数覆盖的市场，以及指数样本的选取标准、指数的计算方法等。

第三章 指数研究开发

第六条 结合指数开发计划以及外部机构提出的指数开发需求等情形，研究开发部对指数进行研究和开发，形成指数方案，指数方案原则上包括样本空间、选样方法、指数计算方法等。

第七条 依照指数项目评审流程，研究开发部将指数方案和研究报告同时提交指数评审工作委员会评审和审批。

第八条 经评审认为具有重大影响力的市场基准指数，指数方案提交指数专家委员会评议后，提交指数评审工作委员会审批。

第四章 指数公告发布

第九条 研究开发部将编制方案、公告新闻、样本股名等需要在网站披露的指数发布用文件提交总经理审批。

第十条 指数公告经总经理审批后，由市场推广部品牌宣传负责人于公司官网进行披露，公告内容原则上包括指数名称、指数代码、指数简介、指数上线时间等。

第十一条 指数公告后，指数编制方案、指数行情等按照指数上线时间通过公司发布平台对外发布。

第五章 记录与存档

第十二条 指数进入发布流程后，研究开发部对指数发布情况进行记录，记录内容包括但不限于：指数代码、指数名称、公告时间、行情发布时间等。

第十三条 研究开发部根据公司档案管理规定完成档案保存工作。

第六章 附则

第十四条 本办法由总办会负责监督相关施行情况，一旦发现未遵照施行的情况，总办会有权根据情况对相关人员进行处罚。

第十五条 本办法由研究开发部负责解释。

第十六条 本办法经总办会审议通过后生效，修订时亦同。

免责声明

任何用户在使用本材料之前，均应仔细阅读本声明，用户可选择不使用本材料，一旦使用，即被视为对本声明全部内容的认可和接受。

本材料仅供参考，不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议。上海华证指数信息服务有限公司不保证其准确性或完整性。对任何因直接或间接使用本文件或其中任何内容而造成的损失，本公司不承担任何法律责任。

本文件著作权归属于上海华证指数信息服务有限公司。上海华证指数信息服务有限公司有权不经通知，随时对其内容进行修订。未经本公司事先书面同意，任何人不得复制、转载、引用或将本文件的任何内容对外公布。