

# 上海华证指数信息服务有限公司

## 指数规则修订实施办法

**V 1.0**

2022年03月

生效日期	版本号	版本说明
2022.03.	V1.0	制定指数规则修订实施办法

## 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”）指数规则修订的流程，特制定本办法。本办法适用于公司管理的股票指数、债券指数等指数。

**第二条** 本办法所称指数规则包括：

- （一）指数业务制度，即适用于指数业务的相关内部制度；
- （二）指数计算与维护细则，即《股票指数计算与维护细则》；
- （三）行业指数分类规则，即《行业分类方法说明》；
- （四）指数编制方案，即适用于具体某条或某系列指数的编制方案。

## 第二章 规则变更情形

**第三条** 指数规则面临修订的潜在情形包括但不限于：

- （一）指数功能定位拟发生变更的情形；
- （二）指数规则无法与指数功能定位相匹配的情形；
- （三）指数规则无法适应市场环境发展变化的情形；
- （四）指数规则与相关法律法规、监管要求相抵触的情形；
- （五）指数专家委员会、定制指数的定制方、指数的使用方提出规则修改建议的情形；
- （六）公司认定的特殊情形。

**第四条** 公司每年定期对指数规则进行审阅，其中：

- （一）指数业务制度，由该制度的制定部门负责审阅，并形成审阅报告提交给指数业务监督委员会；
- （二）指数计算与维护细则及指数编制方案，由指数管理部负责审

阅，并形成审阅报告提交给指数业务监督委员会。

**第五条** 除定期审阅外，公司各部门通过审视市场环境、听取指数专家委员会建议、接受市场反馈、外部投诉等途径，发现指数规则面临修订的潜在情形时，应尽快提交经办部门评估。

**第六条** 经办部门评估指数规则修订的必要性和时机，适时提出修订提案。

### 第三章 重大变更及市场意见征询

**第七条** 指数规则的重大变更仅涉及指数编制方案或指数计算与维护细则的修订，具体是指：

（一）指数编制方案中样本空间的定义出现实质性变更，如新旧样本空间交集低于70%；

（二）指数编制方案中选样方法出现实质性变更，如新旧样本交集低于70%；

（三）指数编制方案中加权方式出现实质性变更，如市值加权法改为非市值加权法或反之；

（四）指数计算与维护细则出现实质性变更，如定期调样的实施时间、自由流通量的范围、指数修正的情形或公式发生实质性变更；

（五）其它指数业务监督委员会认为属于重大变更的情形。

上述重大变更的定义如拟发生变化，应事先征求指数业务监督委员会的同意。

**第八条** 指数规则修订涉及重大变更的，公司应事先向市场征求意见。征求意见包括公开征求意见及定向征求意见两种形式。

采用公开征求意见的，应在公司官网公告征求意见内容、时间表及意见反馈方式，征询时间原则上不超过二周。公开征求意见内容披露前应经公司分管领导和总经理审核。

采用定向征求意见的，应通过电子邮件、传真等书面形式向利益相关方征求意见，征询时间原则上不超过一周。利益相关方包括以该指数为投资标的或比较基准的相关产品管理人、定制指数的定制方。当不存在利益相关方时，可以免去征求意见流程。

本条如拟发生变化，应事先征求指数业务监督委员会的同意。

**第九条** 重要指数或指数计算与维护细则的重大变更原则上采用公开征求意见的形式。公司认定的特殊情形，经指数业务监督委员会同意的，可采用定向征求意见的形式，但征求范围应与指数的实际影响相适应。

本办法所称重要指数是指跟踪规模超过100亿元或有场内衍生品跟踪的指数等公司认为重要的指数。

重要指数界定将根据华证指数指数体系发展和市场需要不定期更新。

**第十条** 非重要指数的重大变更原则上采用定向征求意见的形式。

**第十一条** 征求意见时，公司应告知指数规则的修订背景、修订提案内容、征求意见时间安排、拟定实施时间安排等。征求意见的内容包括修订提案及拟定实施时间安排。

**第十二条** 征求意见结束后，经办部门应形成反馈意见的摘要及分析总结，依次提交分管领导和总经理审核，同时报备指数业务监督委员会。

采用公开征求意见形式的，反馈意见的摘要及分析总结应通过公司官网与相关修订公告一并进行披露。

采用定向征求意见形式的，反馈意见的摘要及分析总结应于相关修

订公告发布时，同时向反馈意见的利益相关方进行披露（除非个别征求意见对象要求对其意见保密）。

本条如拟发生变化，应事先征求指数业务监督委员会的同意。

## 第四章 规则修订流程

**第十三条** 除本办法其它章另有明确规定外，指数业务制度的修订流程以相关制度的规定为准。本章适用于指数计算与维护细则及指数编制方案的修订流程。

**第十四条** 依照华证指数项目评审流程，经办部门将指数规则的修订提案提交指数评审工作委员会评审。提案内容包括：修订的背景、修订的内容、修订对市场或产品的影响、重大变更的征求意见内容及时间表（若有）、修订拟实施时间表。

**第十五条** 涉及征求意见的修订提案在收集意见反馈后，经办部门根据征求意见形成总结，并对提案进行相应完善，提交指数评审工作委员会评审。

**第十六条** 修订提案通过经办部门审议后，交总经理审批。

涉及重要指数或指数计算与维护细则的重大变更，修订提案通过经办部门审议并经指数专家委员会评议后，依次交公司分管领导和总经理审批。

经办部门完成上述流程后，将修订提案向指数业务监督委员会报备。

**第十七条** 指数规则的修订须在正式实施前于公司官网进行公告，公告内容包括指数规则修订的背景、内容及实施时间表。

（一）涉及重要指数或指数计算与维护细则的重大变更应在正式实施前至少一个月公告。

(二) 涉及重要指数或指数计算与维护细则的非重大变更应在正式实施前至少十个交易日公告。

(三) 涉及非重要指数的变更，应在正式实施前至少三个交易日公告。

(四) 公司认定的特殊情形，经指数业务监督委员会同意的，公告后即可实施修订。

**第十八条** 在符合第十七条的前提下，指数规则修订的实施可以随指数的定期调样或定期权重再平衡一并进行。

**第十九条** 指数名称的变更应根据本办法执行。

## 第五章 记录与存档

**第二十条** 修订情况的记录内容包括但不限于：变更内容、变更影响、公司内部审批人、是否经过指数专家委员会审议、是否公告、生效时间；涉及指数编制方案、指数计算、行业分类与维护细则的修订，记录内容还包括：是否涉及重大变更、是否涉及重要指数、意见征询方式及征询范围、市场反馈意见摘要及公司回应。

**第二十一条** 经办部门在指数规则修订实施后的五个工作日内，将修订情况的记录内容发送给指数管理部。指数管理部在指数规则修订实施后的十个工作日内，将各类指数规则的修订情况进行记录，形成规则修订清单存档，并做《指数规则修订情况报告》，每季度报送一次指数业务监督委员会。

## 第六章 附则

**第二十二条** 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。

**第二十三条** 本办法由研究开发部负责解释。

**第二十四条** 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。