

上海华证指数信息服务有限公司

指数错误修正管理办法

V 1.0

2022年03月

生效日期	版本号	版本说明
2022.03.	V1.0	制定指数错误修正管理办法

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”）指数错误修正（以下简称“指数修正”）的流程，制订修正管理办法。

第二条 本细则适用于公司管理的股票指数等相关指数。

第二章 指数错误类型

第三条 指数错误包括但不限于行情价格错误、公司事件错误或遗漏、样本错误、股本错误、计算错误、发布错误等。

第四条 行情价格错误包括单个或多个样本收盘价错误或者遗漏、市场整体收盘价错误等。

第五条 公司事件错误或遗漏情形包括配股除权、派息、转赠送股等公司行为公告错误或者遗漏。

第六条 样本错误包括调入不合适的证券、权重错误、没有调入应进样本。

第七条 股本错误包括供应商提供的股本数据错误、股本数据和自由流通量数据维护错误。

第八条 计算错误包括在交易日指数未正常计算、使用错误的样本计算、使用错误的股本计算等。

第九条 指数发布错误包括发布中断、发布数据错误等情形。

第三章 指数错误修正流程

第十条 当发现指数计算错误，应及时通知指数管理部负责人，确

认错误原因，由指数管理部测算指数点位偏差情况。测算完毕后，形成相关处理方案，其中处理方案应包含错误发生时间、错误类型、错误偏差情况、错误影响、处理建议。

第十一条 指数错误可能需要修正的情形包括如下：

（一）指数日均偏差超过3%；

（二）指数日均偏差不超过3%，但如未及时修正会持续影响指数计算的情形，如指数样本错误；

（三）公司认定的其他情形。

第十二条 非重要指数的错误，应在发现后由指数管理部样本管理岗拟定处理方案，并报指数管理部负责人，由指数管理部负责人确定处理方案并在总经理审批后实施。

第十三条 重要指数的错误，应在发现后由指数管理部负责人拟定方案后，报送总办会审批通过后由指数管理部和技术运行部协同实施。

本制度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。

第十四条 如发生上述未提及的更为复杂情况导致的指数计算错误情形，应及时报总办会领导，由总办会决定解决方案，必要时可征询公司领导、指数业务监督委员会和（或）指数专家委员会的意见。

第十五条 对于重要指数计算错误决定予以修正的情形，应最迟于错误发生后二个交易日内修正指数点位；非重要指数计算错误决定予以修正的情形，应在有效时间内收到更正信息后三个交易日内，修正指数收盘点位。

第十六条 因公司内部导致的错误，对于指数实时点位错误或发生超过12月以上的错误，原则上不予处理。若经内部讨论、指数专家委员

会或指数业务监督委员会认为应修正的情形，由总办会决定处理。

因外部导致的错误，对于超过6个月以上的错误，原则上不予处理。若相关指数用户要求修改，按最终协商一致的方案予以处理。

第十七条 在决定修正指数错误的情况下，应拟定指数修正公告，所有受影响的指数都应向前回溯重新计算，所有数据文件都应重新发布，并通知所有相关的信息商和基金客户。

第十八条 上述指数错误事件修正处理后应及时总结经验教训，并由相关责任人或错误处理人录入风险事件库。

第四章 附则

第十九条 本细则由指数管理部负责修订和解释，每年至少进行一次审阅。

第二十条 本细则的制定（含修订）经公司总办会审议通过后生效。

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。

本作品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。