

上海华证指数信息服务有限公司

指数业务合规管理情况概述

V1.1

2022年06月

生效日期	版本号	版本说明
2022.01.	V1.0	制定指数业务合规管理情况概述
2022.06	V1.1	调整格式，和一致性文字措辞等

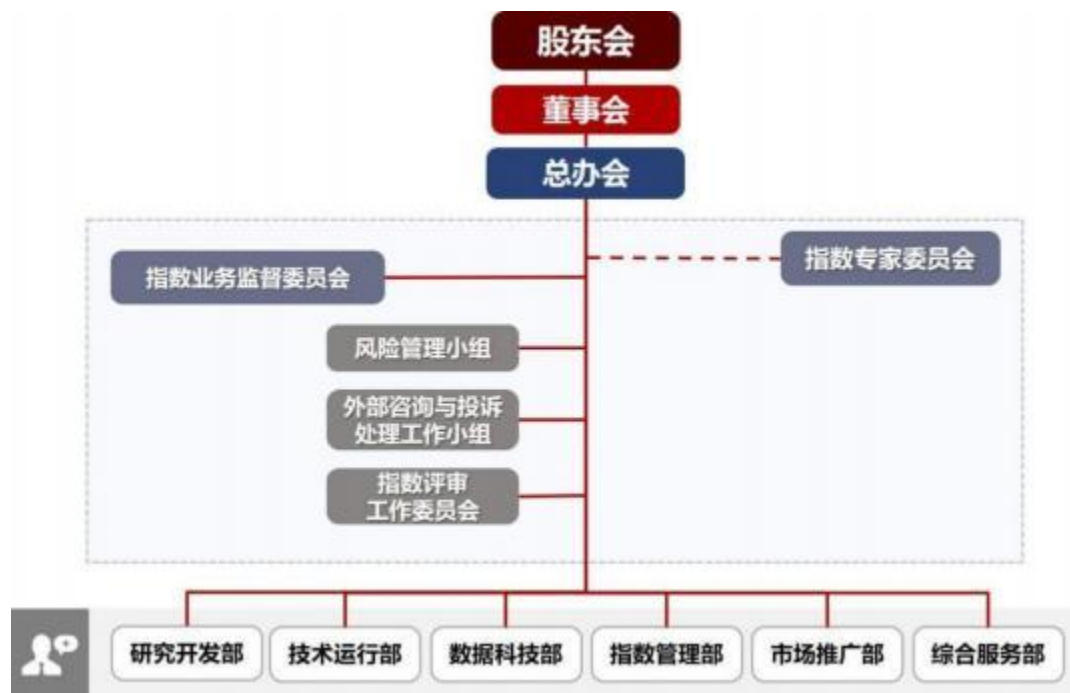
一、公司概述

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”），是一家专业从事指数与指数化投资综合服务的企业，成立于2017年9月。华证指数汇集有证券、基金、银行等领域背景的人才，拥有丰富的指数研发、指数化投资的实战经验。

华证指数面向各类资产管理机构，提供指数与指数化投资综合服务，重点围绕指数研发，提供包括研究咨询、产品授权、运作管理、营销推广、非上市股权估值以及数据信息等全产业链服务，旨在推动指数与指数化投资在我国的深入发展。

华证指数已获得上海证券交易所、深圳证券交易所和香港交易所的指数编制行情授权。

二、指数业务治理架构



股东会、董事会和总办会：

股东会和董事会在公司章程规定的范围内决定公司的战略方针与运营方向。总办会负责组织实施董事会决议及主持指数业务的经营管理工作。

公司按照专业指数机构运营模式进行组织架构和管理，下设研究开发部、技术运行部、数据科技部、指数管理部、市场推广部和综合服务部，履行相应的工作职责，具体包括：

一、研究开发部：

跟踪研究境内外资本市场和证券指数发展创新方向，编制开发满足境内外投资者观测市场和长期投资需求的证券指数，持续完善指数编制规则和细则。

二、技术运行部：

计算发布指数，确保指数安全运行，保证系统、数据稳定运行，根据业务发展以及客户需要开发新系统，为指数业务提供技术支持与服务。

三、数据科技部：

负责数据产品的战略研究、产品设计及产品体系搭建；数据产品的开发、建设、升级与维护；数据产品的投资应用研究与分析；ESG 专家委员会协调等工作。

四、指数管理部：

负责指数样本管理、事件维护以及股本的日常管理与定期审核；指数管理及维护规则研究，指数运行分析，指数信息支持；指数专家委员会的运作。

五、市场推广部：

负责公司客户的开拓、维护与服务工作；实施公司市场活动的组织和客户管理工作；承担公司品牌的建设与媒体外联工作以及市场数据和信息的分析。

六、综合服务部：

负责公司行政、人事、采购、合规风控和财务工作。

七、风险管理小组：

负责组织开展指数业务风险管理工作。

八、外部咨询与投诉处理工作小组：

负责接收外部指数业务相关的咨询与投诉，以及协调公司内部的处理工作。

九、指数评审工作委员会：

负责公司指数项目中涉及的编制方案和研究报告等评审工作。

三、指数业务监督委员会

华证指数设立指数业务监督委员会，主要负责监督和审核相关部门的记录和报告，确保公司指数编制及治理等各方面规定的贯彻执行。指数业务监督委员会每季度召开一次例会，每年就其职责内审议和监督的事项予以记录并形成一份报告提交董事会。

具体关于华证指数指数业务监督委员会的职责以及委员会名单可在华证指数官网查询。

四、指数专家委员会

华证指数设立指数专家委员会，并聘请了来自金融领域、学术院校及各大型金融机构的专业人士担任外部专家委员。指数专家委员会每年召开两次例会。专家委员对公司指数发展和指数相关业务战略、指数编制与管理的普适规则等事项提供咨询意见，从而提高华证指数编制方法的科学性和权威性。

具体关于华证指数指数专家委员会的职责以及委员会名单可在华证指数官网查询。

五、输入数据的质量管理

华证指数的指数计算基于公开市场或合格数据供应商提供的数据来源。针对数据质量管理，华证指数采取了一系列的措施与规范：

- 数据供应商的甄选：选聘国内外知名数据供应商，保障数据源头合规。
- 数据验证与处理：采取各类数据验证措施，包括数据双源核对、数据双岗人员校验等，以确保数据的准确性、完整性。
- 日常监督与定期评估：采取一系列日常监督管理措施，并定期开展数据评估方面工作。

公司指数编制过程中不存在人为经验对数据进行处理或人为剔除符合要求数据的情形。

六、应急与风险管理

华证指数就风险管理制定了一系列内部制度并采取了各类措施，规范风险管理流程，以确保指数业务的安全运营。风险管理小组定期向指数业务监督委员会提交风险评估报告，对指数运行中风险情况进行汇报。

七、指数业务流程合规管理

华证指数为了确保公司指数业务流程的合规性，基于现有公司指数管理流程和现有管理方案制定了以下指数管理制度。

1) 指数研究与发布管理

公司制定的《指数研究与发布管理办法》，规范指数研发与发布的流程。指数研发按照既定的指数研发计划开展；指数编制方案应经过指数评审工作委员会、部门负责人评审后由公司领导审批；在指数发布前华证指数会按管理办法发布指数上线公告。

《指数研究与发布管理办法》于官网公开披露。

2) 指数编制规则管理

公司制定的《股票指数计算与维护细则》，规范指数日常计算与维护的基础规则。同时，华证指数披露单个或系列指数的编制方案，描述具体指数在编制中的特定规则。

华证指数建立了指数规则审阅机制，每年对指数规则的适宜性进行评估。

华证指数对《股票指数计算与维护细则》、指数编制方案等指数规则文档每年定期审阅一次，以确保指数计算与维护符合指数编制目的。定期审阅完成后，形成年度审阅报告提交指数业务监督委员会。《股票指数计算与维护细则》和单个或系列指数编制方案于官网公开披露。

3) 指数终止

公司制定的《指数终止实施办法》，规范指数终止的审批和意见征询等流程。其中存在明确利益相关方的指数拟终止时应当进行意见征询，重要指数的终止提案应考虑提供替代指数。指数终止在正式实施前将至少提前一

个月（涉及重要指数为三个月）于官网进行公告。

《指数终止实施办法》于官网公开披露。

4) 指数应急管理

公司制定的《指数计算应急处理规则》和一系列应急方案，规范应急处理措施，确保指数业务的安全运行。规则从制度层面规范了例如市场中断、数据缺失、重要系统瘫痪等各类应急场景的处理程序。公司定期组织应急演练、及时维护风险事件库，以提高指数业务的安全性与稳定性。

《指数计算应急处理规则》于官网公开披露。

5) 指数错误修正管理

公司制定的《指数错误修正管理办法》，规范指数计算的错误修正流程。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并形成相关处理方案。在决定修正指数错误的情况下，应拟定指数修正公告并重新发布所有数据文件，通知所有相关的信息商和基金客户。修正处理后应及时总结经验教训，并录入风险事件库。

《指数错误修正管理办法》于官网公开披露。

6) 指数规则修订

公司制定的《指数规则修订实施办法》，规范指数规则修订流程。指数规则包括上述的指数业务管理办法、指数计算与维护细则、具体单个或系列指数的编制方案以及行业指数分类规则。指数规则修订涉及重大变更的，

华证指数应事先向市场征询意见。

《指数规则修订实施办法》于官网公开披露。

八、指数业务员工管理（选聘和管理）

为确保公司参与指数业务的人员具备合格的专业、业务水平，并且能合规从事指数业务相关工作，公司进行如下措施：

- 确保按照标准流程招聘录用指数业务员工
- 确保员工进行岗位培训以及相关工作规范指导
- 确保定期展开员工考核与业务培训

华证指数要求所有员工入职时和每年度签署《员工手册》，并提供相关合规培训，以确保员工了解手册中所要求的行为规范。同时，内部设置了举报机制，员工可通过专设邮箱报告违规事项。

九、供应商管理

华证指数指数业务的第三方供应商主要为数据供应商。

华证指数对第三方供应商的选聘及管理遵循《供应商管理实施办法》。要求第三方供应商签署供应商行为准则，其中包含了对反腐败、利益冲突、雇员资质及信息披露等方面的要求。

华证指数定期对供应商进行考核与评估，并向指数业务监督委员会提交评估报告。

您可以通过外部咨询电话或邮箱联系我们索取第三方供应商清单。

十、利益冲突管理

在指数业务环节中，以下情形可能会导致利益冲突：

- 员工或其直系亲属受雇于公司的供应商、指数用户或竞争方
- 员工利用职务便利或内幕信息牟取私利或建议他人的投资行为
- 关联方同时为公司指数用户、供应商
- 关联方委托公司管理指数或委托关联方计算指数
- 外部委员来自于公司关联方、公司指数用户、供应商或指数业务竞争方
- 外部委员是公司员工的直系亲属
- 外部委员持有与拟讨论指数样本证券相关投资
- 供应商同时是公司的指数用户
- 供应商、指数用户、竞争方同时是公司所管理指数的成份样本公司
- 供应商同时是公司的竞争方

华证指数认为目前公司指数业务并不存在任何利益冲突。指数编制依照既定的规则，秉承指数开发的公正性和独立性。任何人或机构都无法通过付费或其他任何形式进入样本股名单。

十一、外部咨询与投诉

华证指数依据《指数业务外部咨询与投诉管理实施办法》规范指数业务外部咨询与投诉的处理流程，并设立了外部咨询与投诉处

理工作小组负责接收、调查及处理外部咨询与投诉。重要投诉的处理方案需提交公司总经理审批。该工作小组每季度向指数业务监督委员会汇报咨询与投诉的受理与处理情况。

《指数业务外部咨询与投诉管理实施办法》于官网公开披露。

十二、记录保存与外部审计

华证指数依据《档案管理规范》规范指数业务文档管理，确保各类文档的完整与规范。纸质文档至少保留5年。

华证指数定期聘请外部审计机构依据国际证监会组织（IOSCO）的《金融基准指数准则》进行审计。审计报告由指数业务监督委员会审阅，并监督整改。

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