



中证指数有限公司
CHINA SECURITIES INDEX CO., LTD.

中证指数有限公司
指数研究与发布管理办法
V2.1

2020 年 9 月

版本号	变更时间	变更范围
1.0	2018 年 9 月	制定指数研究与发布管理办法
2.0	2020 年 8 月	增加关于指数研发目的和原则的内容;调整关于重要指数的定义; 调整指数研发工作结项环节部分责任主体的职能
2.1	2020 年 9 月	调整关于指数评审的相关表述

第一章 总则

第一条 为规范中证指数有限公司（以下简称“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、债券指数及多资产指数。

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。

第七条 依照《中证指数有限公司指数项目评审实施办法》，研究开发部将指数方案提交指数评审工作委员会评审。

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。

第九条 指数方案经指数评审工作委员会评审通过或指数专家

委员会评议后，提交公司领导审批。

第四章 指数公告发布

第十条 指数方案经公司领导审批通过后，研究开发部将指数发布申请依次提交公司分管领导和总经理审批。

第十一条 指数公告于公司官网发布，公告内容原则上包括指数名称、行情发布时间、编制方案、样本名单等。

第十二条 指数公告后，指数行情按照公告安排通过公司发布平台对外发布。

第五章 记录与存档

第十三条 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。

第十四条 研究开发部根据公司《档案管理办法》完成档案保存工作。

第六章 附则

第十五条 本办法由总办会负责监督相关施行情况，一旦发现有未遵照施行的情况，总办会有权根据情况对相关人员进行处罚。

第十六条 本办法由研究开发部负责解释。

第十七条 本办法经总办会审议通过后生效，修订时亦同。

免责声明

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，也不得用于任何非法或未经授权的用途。中证指数有限公司（“中证指数”）将不时对其内容进行修订，但不会提供通知。中证指数力求确保本材料内容的准确性，但并不对其准确性、完整性或可靠性做任何保证。对任何因直接或间接使用本材料或其中任何内容而造成的损害或损失，或本材料内容中的任何错误或缺失，中证指数概不承担任何法律责任。