

## 指数编制方案

纳斯达克 100 科技指数编制方案的中文版仅供参考和方便之用，有可能无法反映纳斯达克 100 科技指数编制方案的最新版本。官方文本是纳斯达克 100 科技指数编制方案的英文版 ([https://indexes.nasdaq.com/docs/methodology\\_NDXT.pdf](https://indexes.nasdaq.com/docs/methodology_NDXT.pdf))，任何由于翻译造成之差异或分歧均不具约束力及对合规或执法也无法律效力。若对本译本所提供信息有任何疑问，请参考编制方案官方版本。

# 纳斯达克 100 科技指数 (NDXT)

## 指数介绍

纳斯达克 100 科技指数旨在衡量纳斯达克 100 指数(NDX)中科技公司的表现。

## 证券合格标准

### 母指数

证券须为纳斯达克 100 指数的成分股。除下文所注明的情况外，本指数遵循纳斯达克 100 指数采用的同一证券合格标准。更多详情请参阅该指数编制方案。

### 行业或领域资格

采用富时国际有限公司授权使用的行业分类基准(ICB)，证券必须属于科技类公司(即归类为科技行业的公司)。

## 指数日程表

### 成分股及权重调整

纳斯达克 100 科技指数的成分股及权重调整时间与纳斯达克 100 指数的相同。

## 权重调整基准日

权重调整采用 3 月、6 月、9 月和 12 月的第三个星期五收市时的最后出售价。

## 成分股选取

### 成分股选取的流程

所有符合适用证券资格标准的证券均会被纳入指数中。

## 成分股加权

### 成分股加权方案

本指数为等权重指数。

### 成分股加权流程

指数每季度进行权重调整，以使指数内的所有发行人的指数市值均等。由多个证券代表的发行人，该发行人的指数市值将平均分配给其各个证券。

指数股份由各成分股的最终指数市值除以其最后出售价得出。

有关指数权重的更多信息，请参阅 **Nasdaq Standard Index Weight Adjustment Guidelines**。

## 指数维护

### 剔除政策

如果纳斯达克 100 科技指数的成分股因任何原因从纳斯达克 100 指数中剔除，其成分股也将同时从纳斯达克 100 科技指数中剔除。

### 替代政策

当纳斯达克 100 指数中根据 ICB 归类为科技类别的成分股被剔除时，其也将从纳斯达克 100 科技指数中剔除。因此，如果加入纳斯达克 100 指数的替代成分股根据 ICB 归类为科技类别，那么该替代成分股也将被纳入纳斯达克 100 科技指数，并在生效日承接被剔除成分股的权重。

当纳斯达克 100 指数中根据 ICB 归类为非科技类别的成分股被剔除时，而替代成分股被 ICB 归类为科技类别，该替代成分股会在下季度调整时纳入纳斯达克 100 科技指数。

当纳斯达克 100 指数中根据 ICB 归类为科技类别的成分股被剔除时，而替代成分股被 ICB 归类为非科技类别，那么该成分股会从纳斯达克 100 科技指数中被剔除，纳斯达克 100 科技指数的除数会作调整，以确保指数的完整性。

## 新增政策

倘若证券因任何原因被纳入纳斯达克 100 指数，则该证券可同时被纳入纳斯达克 100 科技指数。

## 企业行为

在已定的成分股调整与权重调整期间，个别成分股可能会受到各种企业行为和事件的影响，从而需要进行指数的维护和调整。各类型企业行为或事件的具体处理方式请参照 **Nasdaq Corporate Actions and Events Manual – Equities**，该文件经引述而纳入本文件中。

在某些情况下，企业行为和事件的处理将参照加权方案或其他指数构建技术。无论所述哪种方法，指数都将遵循“非市值企业行为法”。

## 企业行为例外情况

### 分拆

- 若母公司为指数成分股，且分拆后形成的公司拥有预发行制度，那么母公司的价格将根据分拆公司的价值向下调整。分拆公司的价值按分拆比率乘以分拆公司预发行制度的最后出售价 (“LSP”) 计算而得。母公司的指数股份不进行调整。这将导致除数调整。分拆公司不会纳入指数中。
- 若分拆公司没有预发行制度，指数成分股不会进行价格或指数股份的调整。分拆公司不会被纳入指数中。

## 指数股份调整

除企业行为直接导致的调整外，指数通常不会在已定的成分股调整与权重调整期间进行股份调整。

## 附加信息

### 公告

纳斯达克通过其全球指数观察(GIW)网站（网址：<http://indexes.nasdaqomx.com>）公布指数相关信息。

有关一般指数公告流程的更多资讯，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 节假日安排

指数的计算时间为周一至周五，不包括纳斯达克交易所休市日。

### 市场意外关闭

市场意外关闭的相关信息，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 计算方式

如欲了解指数计算方式种类以及指数计算的数学方式，请参阅 **Nasdaq Index Policies & Procedures: Calculation Manual – Equities & Commodities**。

### 重算政策

有关重算政策的更多资讯，请参阅 **Nasdaq Index Recalculation Policy**。

### 数据来源

有关数据来源的相关信息，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 联系方式

如遇任何与指数相关的问题，请通过 [indexservices@nasdaq.com](mailto:indexservices@nasdaq.com) 联系纳斯达克客户服务团队。

### 指数发布

指数值及权重信息可通过纳斯达克全球指数观察(GIW)网站 <https://indexes.nasdaqomx.com/>、纳斯达克全球指数 FlexFile 交付服务(GIFFD)以及全球指数发布服务(GIDS)获取。与 GIDS 所提供的服务类似，Genium Consolidated Feed (GCF)提供北欧指数的实时指数值和权重信息。

有关指数发布的更多详情载于 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

## 指数计算和发布时间

交易日内指数由最后出售价计算得出，并在美国东部时间 09:30:01 到 17:16:00 之间发布，频率为每秒一次。在美国东部时间 17:15:00 之前，指数收盘价可能会因为指数成分股最后出售价的更正而出现变动。

## 网站

如欲了解更多资讯，请访问纳斯达克 GIW 网站 <https://indexes.nasdaqomx.com/>。

## FTP 档案发布服务

指数值和权重可通过 FTP 于纳斯达克全球指数 FlexFile 交付服务(GIFFD)中获取。指数值还可通过纳斯达克全球指数发布服务(GIDS)获取。

## 治理

### 指数治理

纳斯达克指数依循同样的治理架构。有关该信息的详细列表，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 纳斯达克指数管理委员会

纳斯达克指数管理委员会负责审批新的指数编制方案。该委员会由纳斯达克全职专业成员组成。委员会定期开会并审查项目，受审项目包括但不限于：可能影响指数成分股的未决企业事件、指数构成与市场比较的统计数据、纳入指数的候选公司，以及重大市场事件。

有关指数管理委员会的详细介绍，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 指数编制方案的内部审查

有关指数编制方案内部审查的详细描述，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

### 利益相关者的沟通与咨询

利益相关者的咨询与沟通相关详情参见 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

## 指数终止

纳斯达克对终止 / 停用指数或指数系列将依照相关程序进行。

详情请参阅 **Nasdaq Index Cessation Policy**。

## 酌情调整

本指数编制方案由纳斯达克创立，旨在实现上述编制方案所管理的各指数的基本目标。纳斯达克可自行判断并决定是否偏离此编制方案，以使指数能继续实现其目标。

指数计算与定价中断、专家判断和无法预见的指数调整等有关详情，请参阅 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

## 本文件使用的术语表

详见 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

## 免责声明

纳斯达克可在其认为适当时行使合理的酌情权，以确保指数完整性，包括但不限于定量纳入标准。纳斯达克还可在重大特殊情况下实施酌情性调整，以确保和维持高质量的指数构建和计算。纳斯达克不保证任何指数准确地反映未来的市场表现。**Nasdaq, Inc.**及其任何关联公司（统称“纳斯达克”）未作出买卖任何证券的任何建议，也未作出有关任何公司财务状况的任何陈述。投资者在投资前应自己进行尽职调查并对公司进行仔细评估。本文件中的信息仅为告知目的而提供，本文件中的任何内容均不得解释为有关具体证券或整体投资策略的投资建议。**强烈建议投资者从证券专业人士处获取建议。**