



## 指数编制方案

费城半导体指数编制方案的中文版仅供参考和方便之用，有可能无法反映费城半导体指数编制方案的最新版本。官方文本是费城半导体指数编制方案的英文版 ([https://indexes.nasdaqomx.com/docs/Methodology\\_SOX.pdf](https://indexes.nasdaqomx.com/docs/Methodology_SOX.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。

# 费城半导体指数™ (SOX)

## 指数介绍

费城半导体指数旨在衡量在美国上市的 30 家最大的半导体公司的表现。

## 证券合格标准

### 合格的证券种类

合格的证券种类通常包括普通股、美国存托凭证(ADR)、实益权益和有限合伙权益股份。

### 多类别证券

允许每名发行人一只证券。如果发行人已上市多类别证券，则考虑市值最大的证券可候选纳入指数。

### 合格交易所

证券必须在纳斯达克股票市场、纽约证券交易所、美国纽交所或芝加哥期权交易所上市。

### 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)，证券必须属于半导体或生产技术设备类别。

### 市值资格

各证券最低市值须达 1 亿美元。

## 流动量资格标准

在截至（包括）参考日所在月份的六个日历月内，该证券每月交易至少 150 万股。

## 上市时间资格

该证券必须在合格交易所拥有至少三个月完整日历月的成交记录，且不包括首次上市月份。

## 其他资格标准

该证券必须在已注册的美国期权市场拥有上市期权，或有资格在已注册的美国期权市场上期权交易。

该证券不可由目前进行破产程序的发行人发行。

如果在成分股调整时，纳斯达克知悉某发行人或证券即将发生根本改变，而导致其不符合资格，则纳斯达克将把该证券移出考虑范围。根本改变包括签订最终合并或收购协议或其他未决协议使其不符合纳入指数资格，或向债权人申请破产或类似保护。

## 指数日程表

### 成分股调整

纳斯达克每年 9 月进行一次成分股选取。

### 成分股调整参考日

证券资格审核采用截至 7 月底的市场数据。

### 成分股调整公告日期

指数成分股调整于 9 月初公告。

### 成分股调整生效日期

指数成分股调整在 9 月第三个星期五收市后生效。

### 权重调整

指数分别在 3 月、6 月、9 月和 12 月进行季度调整。

## 权重调整参考日

权重调整使用截至上月底（分别为 2 月、5 月、8 月和 11 月）之所有指数证券的已发行股份总数(“TSO”)及最后出售价(“LSP”)。

## 权重调整公告日期

权重调整公告日期为 3 月、6 月、9 月和 12 月初。

## 权重调整生效日期

权重调整在 3 月、6 月、9 月和 12 月第三个星期五收市后生效。

## 成分股选取

### 成分股选取的流程

该指数选取在美国上市市值最大的前 30 家合格的半导体公司。

## 成分股加权

### 成分股加权方案

指数为修正后的市值加权指数。

### 成分股加权流程

费城半导体指数采用两段式权重调整方案。

指数证券的初始权重是由各成分股的市值除以所有成分股的总市值计算得出。

#### 阶段 1:

阶段 1 权重由初始权重根据以下阶段 1 的限制调整得出：

- 成分股权重不得超过 8%。

#### 阶段 2:

最终权重由阶段 1 权重根据以下阶段 2 的限制调整得出：

- 市值最大的前 5 只指数成分股的阶段 1 权重保持不变。
- 其他成分股的权重不得超过 4%。

最终权重须满足以下限制条件：

- 任何成分股的权重均不得超过指数的 8%；其中仅有 5 只成分股权重可超过 4%。

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

在成分股调整外的任何时段内，如果纳斯达克判断某成分股正进行或将要发生根本改变，并导致其资格不符合被纳入指数，则纳斯达克会尽快剔除该成分股。此类改变可能包括合并、收购或其他可能对指数完整性构成不利影响的重大企业事件。

### 替代政策

当有剔除事件时，证券可能会在成分股调整外加入指数。市值最高并符合所有资格标准但未列入指数中的发行人将替换被剔除的成分股。

### 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**。

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“市值企业行动法”。

### 指数股份调整

如果其他企业事件导致已发行股份总数 TSO 变动（定义见 **Nasdaq Corporate Actions and Events Manual - Equities**）大于或等于 10%，则应尽快进行指数股份调整。如果已发行股份总数 TSO 变动小于 10%，则所有调整将积累至季度性权重调整，分别在 3 月、6 月、9 月和 12 月的第三个星期五收市后生效。

将按照已发行股份总数变动的相同百分比进行指数股份调整。

## 附加信息

## 公告

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

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

有关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 **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

如欲了解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，请访问 [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

指数在交易日内进行计算，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

所有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

关键术语表详见 **Nasdaq Index Methodology Guide**。

## 免责声明

Nasdaq may, from time to time, exercise reasonable discretion as it deems appropriate in order to ensure Index integrity, including but not limited to, quantitative inclusion criteria. Nasdaq may also, due to special circumstances, if deemed essential, apply discretionary adjustments to ensure and maintain the high quality of the index construction and calculation. Nasdaq does not guarantee that any Index accurately reflects future market performance. Neither Nasdaq, Inc. nor any of its affiliates (collectively "Nasdaq") makes any recommendation to buy or sell any security or any representation about the financial condition of any company. Investors should undertake their own due diligence and carefully evaluate companies before investing. The information contained herein is provided for informational and educational purposes only, and nothing contained herein should be construed as investment advice, either on behalf of a particular security or an overall investment strategy. **ADVICE FROM A SECURITIES PROFESSIONAL IS STRONGLY ADVISED.** © 2021.

Nasdaq, Inc. All Rights Reserved.