



指数编制方案

纳斯达克A股全球市场领导者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A股全球市场领导者指数编制方案的最新版本。官方文本是纳斯达克A股全球市场领导者指数编制方案的英文版：

https://indexes.nasdaqomx.com/docs/Methodology_CAGR.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A股全球市场领导者指数

指数介绍

纳斯达克A股全球市场领导者指数旨在追踪已拓展海外市场并产生强劲收益的中国A股公司之表现。

证券合资格标准

证券须达以下截至成分股调整参考日仍然适用的证券合资格标准，方符合纳入指数的资格。

证券种类

证券必须为普通股。

多类别证券

每家公司只限一项证券。如果一家公司拥有多项其他合资格证券，而其中一项是截至成分股调整参考日的指数证券，则只有该证券可能合资格；否则只有三个月日均成交价值（ADVT）最高的证券方合资格。

上市交易所

证券必须在上海证券交易所或深圳证券交易所上市。

流动性

就12个月的日均成交价值而言，所有排名在最低第10个百分位的证券均被排除在外。若证券的交易历史少于12个月，则考虑其可用交易历史。

其他资格标准

公司的基本数据均从其年度报告中收集，且必须符合以下标准：

- 公司的年度海外收入必须至少达到2亿元人民币
- 公司的年度净利润必须为正数
- 公司的海外收入必须至少占其总收入的50%
- 公司的海外收入同比增长必须超过0%
- 公司的海外收入份额同比增长必须至少为0%。海外收入份额按公司海外收入除以公司总收入计算。
- 公司证券不得处于“特别处理”(ST)状态

在进行成分股调整时，如纳斯达克发现某个发行人或证券即将发生重要变化而不再符合资格，则通常会将该证券从考虑范围中剔除。其中包括达成最终并购协议或其他未决安排使其失去被纳入指数的资格，或向债权人申请破产或类似保护，或Corporate Actions and Events Manual – Equities第3节所描述的其他事件。

成份股选取流程

成分股调整每年进行一次，届时天风证券研究所会为合资格公司评定其全球化分数。

合资格证券会按其公司全球化分数进行排名，而指数将选取得分最高的前50名证券。如有全球化分数相同的合资格证券，出现排名一样的情况，则以截至成分股调整参考日的市值作为依据。

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

指数采用等权重加权方式，即所有指数证券的指数市值均等。有关指数权重的更多信息，请参阅 Nasdaq Index Weight Calculations。

指数日程表

成分股调整和权重调整安排

| 成分股调整频率 | 每年一次 |
|-----------|--------------------|
| 权重调整频率 | 每年一次 |
| 成分股调整参考日 | 4月最后一个交易日 |
| 成分股调整公告日期 | 6月第二个星期五收市后 |
| 成分股调整生效日期 | 6月第三个星期五后的首个交易日开市时 |
| 权重调整参考日 | 5月最后一个交易日 |
| 权重调整公告日期 | 6月第二个星期五收市后 |
| 权重调整生效日期 | 6月第三个星期五后的首个交易日开市时 |

节假日安排

指数属于全球指数，计算时间为周一至周五。

指数计算和发布時間

指数价值每周计算五(5)天，分别为周一至周五，由日本标准时间09:30:00开市起计，直至格林威治标准时间17:00:00收市，频率为每秒一次。

指数维护

剔除政策

每天

在成分股调整以外任何时段内，如果纳斯达克判断某指数证券已经或将会出现重要变化，因而不再具备被纳入指数的资格，该指数证券将在可行的情况下尽快被剔除。此类变化可能包括合并、收购或其他可能对指数完整性产生不利影响的重大企业行为。

每月

在每个月底，如果某指数证券被指定为“特别处理”(ST)状态，该指数证券将在翌月第三个星期五后的首个交易日开市时被指数剔除。

替代政策

除成分股调整外，年内任何时间被剔除的指数证券均不会被替代。

企业行为

在已计划的成分股调整与权重调整事件期间，个别指数证券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”。

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.nasdaq.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。

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 and Commodities。

重算和重述政策

有关重算和重述政策的资讯, 请参阅 Nasdaq Index Recalculation Policy。

数据来源

如欲了解数据来源和股息分类及其相关税率的有关信息, 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 联系纳斯达克指数客户服务团队。

指数发布

指数值及权重信息通过纳斯达克全球指数观察(GIW) 网站 <https://indexes.nasdaq.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)发布。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。

网站

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

所有纳斯达克指数均采用治理委员会的架构进行管理，并在指数确定过程中实行透明的治理、监督和问责程序。有关指数编制方法和治理覆盖范围的进一步详情，请参阅Nasdaq Index Methodology Guide。

本文件使用的术语表

有关主要术语表，请参阅 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。