

# 国际指数动态

(2015年2月)



## 国际指数动态（201502）

一、 指数动态及综述 .....	2
1. 红利指数发展引关注 .....	2
A) S&P DJI 发布中盘 400 红利贵族指数 .....	2
B) S&P DJI 发布全球红利稳定低波动指数 .....	2
C) Russell 授权红利增长指数于 ProShares 开发 ETF .....	2
2. 其他动态及规则变更 .....	3
A) 恒生指数授权期货指数系列于 SAMSUNG 开发 ETF .....	3
B) FTSE 发布两条新核心基建指数 .....	3
C) FTSE 发布新兴市场 GDP 加权指数（含中国） .....	3
D) FTSE 发布英国年金指数系列 .....	4
E) STOXX 发布夏普比率指数系列 .....	4
二、 指数衍生品动态及综述 .....	4
1. 美国市场 2 月新发行 ETF、ETN 及 ETC 情况 .....	4
A) 国别类 ETF .....	4
B) 主题类 ETF .....	4
C) 策略类 ETF .....	5
D) 固定收益类 ETF .....	5
E) 衍生品类 ETF .....	5
F) ETN 与 ETC .....	5
2. 美国市场 2 月拟成立 ETF、ETN 及 ETC 情况 .....	5
A) 国别类 ETF .....	5
B) 主题类 ETF .....	5
C) 策略类 ETF .....	6
D) 固定收益类 ETF .....	6
E) 衍生品类 ETF .....	6
F) ETN 与 ETC .....	6
3. DEUTSCHE BÖRSE XETRA 2 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单 .....	6
4. NYSE 与 NASDAQ 2 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单 .....	7
附 1:2014 年 1 月份各交易所股指衍生品成交量 .....	9
附 2:2014 年 1 月份各交易所 ETF 交易量 .....	10

## 一、指数动态及综述

### 1. 红利指数发展引关注

2008 年金融危机以来，为刺激经济的重新复苏，全球大部分国家开始执行低利率政策，持续的低利率环境促使稳健型投资者需要通过更多元化的资产配置获得高收益率。红利指数不仅可为投资者带来较为稳定且相对更高的股利分红，而且成份股也多分布在较为成熟的行业，风险相对较低，受到全球稳健型投资者的广泛关注。

面对投资者需求日益多样化，红利指数也在不断创新发展。在衡量公司红利能力方面，更加注重分红的稳定性与成长性，如 S&P DJI 发布的红利贵族指数系列、Russell 发布的红利增长指数系列；在指数风险暴露方面，引入低波动、质量、价值等因子进行混合因子指数构造，可使投资者在获取稳定红利收入的基础上，实现对特定风险因子的暴露，如红利低波动指数、红利价值指数、红利质量指数等。

#### A) S&P DJI 发布中盘 400 红利贵族指数

2015 年 2 月 5 日，S&P DJI 宣布发布 S&P MidCap 400 Dividend Aristocrats Index，该指数选取 S&P MidCap 400 中具有至少 15 年红利稳定增长承诺的公司作为成份股，为投资者提供获取资本增值和红利回报新工具。该指数已授权 ProShares 用于 ETF 产品开发。

#### B) S&P DJI 发布全球红利稳定低波动指数

2015 年 2 月 12 日，S&P DJI 宣布发布

2015年2月5日，Russell 宣布授权 Russell 2000 Dividend Growth Index 于 ProShares，后者将基于此指数开发 ETF 产品。该指数选取十年间红利不断增长的上市公司作为成份股，并采用等权重加权方式，且保证每个行业权重不超过 30%，以反映红利稳定增长公司整体表现。

## 2. 其他动态及规则变更

### A) 恒生指数授权期货指数系列于SAMSUNG开发ETF

2015年2月12日，恒生指数宣布授权恒生期货指数（HSFI）与恒生期货人民币外汇指数(HSFRFI)于三星资产管理有限公司，三星资产将基于这两条指数开发 ETF 产品。恒生期货指数反映香港期货交易所上市的恒生指数即月合约价格变化及每月移仓所产生的收益与亏损，而恒生期货人民币外汇指数额外包括离岸人民币兑港元的价值变动。

### B) FTSE发布两条新核心基建指数

2015年2月5日，FTSE 宣布发布两条新基建指数，分别是 FTSE Global Core Infrastructure 50/50 Index 与 FTSE Developed Core Infrastructure 50/50 Index。相对于之前的核心基建指数，这两条指数在覆盖子行业上有所调整，最新覆盖行业如下：

- Utilities: Electricity, Gas, Water, Multi-Utilities
- Transportation: Airports, Ports, Toll Roads, Railroads, Railways
- Other sectors: Pipelines, Satellites, Telecommunications Infrastructure

### C) FTSE发布新兴市场GDP加权指数（含中国）

2015年2月17日，FTSE 宣布发布 FTSE Emerging incl. China Overseas non-R/QFII GDP Weighted Index，该指数涵盖新兴市场与中国上市公司股票（A

股、N股、S股)，采用GDP加权方式，以反映中国与新兴市场经济增速变化，并为将来A股纳入全球基准指数做准备。

## D) FTSE发布英国年金指数系列

2015年2月12日，FTSE宣布发布FTSE UK Level Annuity Index Series，该指数系列是与Legal and General Investment Management联合开发，为投资者提供透明的养老金比较基准。

## E) STOXX发布夏普比率指数系列

2015年2月18日，STOXX宣布首次发布夏普比率指数系列，该指数系列在流动性和分红筛选的基础上，选取夏普比率最高的上市公司作为成份股。STOXX已授权STOXX Europe Sharpe Ratio 50指数于JP Morgan开发ETF产品。

# 二、指数衍生品动态及综述

## 1. 美国市场2月新发行ETF、ETN及ETC情况

### A) 国别类ETF

- **新兴市场ETF:** KraneShares发行了1只新兴市场ETF，跟踪FTSE Emerging Markets Plus ETF;

### B) 主题类ETF

- **商品生产者ETF:** ProShares发行了4只黄金采掘ETF，分别为Ultra Junior Miners, UltraShort Junior Miners, Ultra Gold Miners, UltraShort Gold Miners;
- **基建ETF:** Guggenheim发行了1只基建ETF，投向于过去12个月跟踪收益较高的基建类公司;
- **行业ETF:** Fidelity发行了1只房地产行业ETF;

- **红利 ETF:** ProShares 发行了 2 只红利 ETF, 分别跟踪 S&P MidCap 400 Dividend Aristocrats Index 与 Russell 2000 Dividend Growers Index;
- **回购 ETF:** SPDR 发行了 1 只回购 ETF, 跟踪 S&P 500 Buyback Index, 投资于进行股票回购的公司;

### C) 策略类 ETF

- **因子类 ETF:** Arrow 发行了 1 只因子类 ETF, 侧重投资于质量、价值与动量因子, 并采用等权重配置;

### D) 固定收益类 ETF

- **主动管理 ETF:** iShares 发行了 1 只主动管理债券 ETF, 采用量化方法进行投资, 旨在达到信用风险与利率的最优平衡; AdvisorShares 发行了 1 只主动管理型的浮动利率债 ETF, 投资于高流动性的贷款与债券, 可抵御利率上升风险;

### E) 衍生品类 ETF

- **期货与期权 ETF:** GreenHaven 发行了 1 只煤炭 ETF, 投向于 CME 的煤炭期货合约; SIT 发行了 1 只利率上升 ETF, 投向于 2-10 年期国库券相关期货与期权;

### F) ETN 与 ETC

- 暂无

## 2. 美国市场 2 月拟成立 ETF、ETN 及 ETC 情况

### A) 国别类 ETF

- **日本 ETF:** DB 拟发行 2 只日本股票 ETF, 跟踪 MSCI 相应指数;

### B) 主题类 ETF

- 暂无

### C) 策略类 ETF

- **杠杆与反向 ETF:** Direxion 拟发行 5 只杠杆或反向 ETF, 4 只以黄金采掘指数为标的, 1 只以沪深 300 为标的指数;
- **货币对冲 ETF:** PowerShares 拟发行 4 只货币对冲 ETF, 投资于低波动股票, 并采用波动率加权配置;
- **多资产 ETF:** Principal 拟发行 1 只多资产 ETF, 依据宏观环境进行不同资产间的配置;
- **因子类 ETF:** iShares 拟发行 4 只因子类指数, 跟踪 MSCI 相应指数, 覆盖美国、美国小盘、全球以及新兴市场类别;

### D) 固定收益类 ETF

- **主动管理 ETF:** First Trust 拟发行 1 只主动管理型浮动利率 ETF, 投向于广泛的投资级浮动利率债券;

### E) 衍生品类 ETF

- 暂无

### F) ETN 与 ETC

- 暂无;

## 3. Deutsche Börse Xetra 2 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单

产品名称	标的指数
ComStage LevDAX x2 UCITS ETF	LevDAX x2 Index
ComStage MSCI Italy TRN UCITS ETF	MSCI Italy Index
ComStage MSCI Spain TRN UCITS ETF	MSCI Spain Index

ComStage ShortMDAX UCITS ETF	ShortMDAX Index
db x-trackers MSCI GCC Select Index UCITS ETF	MSCI GCC Countries ex Select Securities Index
Deka MSCI Europe ex EMU UCITS ETF	MSCI Europe ex EMU Index
iShares US Equity Buyback Achievers UCITS ETF	Nasdaq US Select Buyback Achievers Index
Ossiam Shiller Barclays Cape Europe Sector Value TR - UCITS ETF 1C (EUR)	Shiller Barclays Cape Europe Sector Value Index
SPDR MSCI Europe Small Cap Value Weighted UCITS ETF	MSCI Europe Small Cap Value Weighted Index
SPDR MSCI Europe Value Weighted UCITS ETF	MSCI Europe Value Weighted Index
SPDR MSCI USA Small Cap Value Weighted UCITS ETF	MSCI USA Small Cap Weighted Index
SPDR MSCI USA Value Weighted Index	MSCI USA Value Weighted Index
UBS ETF - MSCI EMU Hedged USD UCITS ETF (USD) A-dis	MSCI EMU 100% hedged to USD Index
UBS ETFs plc - MAP Balanced 7 SF UCITS ETF (EUR) A-acc	UBS Multi Asset Portfolio
WisdomTree Emerging Markets SmallCap Dividend UCITS ETF	WisdomTree Emerging Markets SmallCap Dividend Index
WisdomTree Europe Equity Income UCITS ETF	WisdomTree Europe Equity Income Index
WisdomTree Europe SmallCap Dividend UCITS ETF	WisdomTree Europe SmallCap Dividend Index
WisdomTree US Equity Income UCITS ETF	WisdomTree US Equity Income Index
WisdomTree US SmallCap Dividend UCITS ETF	WisdomTree US SmallCap Dividend Index

#### 4. NYSE 与 NASDAQ 2 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单

挂牌地	上市 ETF	上市日期
NYSE Arca	RevenueShares Global Growth Fund	2/2/2015
NYSE Arca	Etracs monthly Pay 2xLeveraged US Small Cap High Dividend ETN	2/2/2015
NYSE Arca	Fidelity MSCI Real Estate Index ETF	2/5/2015
NYSE Arca	ProShares S&P MidCap 400 Dividend Aristocrats ETF	2/5/2015
NYSE Arca	ProShares Russell 2000 Dividend Growers ETF	2/5/2015
NYSE Arca	SPDR S&P 500 Buyback ETF	2/5/2015
NYSE Arca	Guggenheim S&P High Income Infrastructure ETF	2/11/2015
NYSE Arca	ProShares Ultra Junior Miners	2/13/2015
NYSE Arca	ProShares UltraShort Junior Miners	2/13/2015
NYSE Arca	ProShares UltraShort Gold Miners	2/13/2015
NYSE Arca	ProShares Ultra Gold Miners	2/13/2015





**附 1:2014 年 1 月份各交易所股指衍生品成交量**

Derivative Exchange	Jan				Year-to-Date Total			
	Stock Index Options		Stock Index Futures		Stock Index Options		Stock Index Futures	
	Number of Contracts Traded	Notional Turnover	Number of Contracts Traded	Notional Turnover	Number of Contracts Traded	Notional Turnover	Number of Contracts Traded	Notional Turnover
<b>Americas</b>								
BM&FBOVESPA	191302	88395.1	8641373	148770	191302	88395.1	8641373	148770
Bourse de Montreal	25873	189	355174	56306	25873	189	355174	56306
CBOE Future Exchange	NA	NA	4573650	NA	NA	NA	4573650	NA
Chicago Board Options Exchange	31418398	NA	NA	NA	31418398	NA	NA	NA
CME Group	12208752	1633520	51594295	5098170	12208752	1633520	51594295	5098170
Colombia SE	NA	NA	21	750.01	NA	NA	21	750.01
ICE Futures US	4062	478	3322455	328746	4062	478	3322455	328746
International Securities Exchange	54939	NA	NA	NA	54939	NA	NA	NA
MexDer	4354	1833.04	97984	28832.9	4354	1833.04	97984	28832.9
NASDAQ OMX (US)	103195	NA	NA	NA	103195	NA	NA	NA
<b>Asia - Pacific</b>								
ASX Derivatives Trading	721306	38180.3	120	6.56	721306	38180.3	120	6.56
ASX SFE Derivatives Trading	21063	2833.73	571203	76045.1	21063	2833.73	571203	76045.1
BSE India	26134182	11217400	95598	40858.9	26134182	11217400	95598	40858.9
Bursa Malaysia Derivatives	407	NA	240175	20295	407	NA	240175	20295
China Financial Futures Exchange	NA	NA	31477396	33701900	NA	NA	31477396	33701900
Hong Kong Exchanges	1644280	1322650	5413179	3498420	1644280	1322650	5413179	3498420
Korea Exchange	38037141	467525000 0	3112284	383852000 0	38037141	467525000 0	3112284	38385200 0
National Stock Exchange India	181476667	41648400	15301599	4086810	181476667	41648400	15301599	4086810
New Zealand	NA	NA	0	0	NA	NA	0	0

Osaka SE	2918687	NA	25539402	91343100	2918687	NA	25539402	91343100
Singapore Exchange	691505	NA	13098269	NA	691505	NA	13098269	NA
TAIFEX	15657044	7238030	3983099	5343910	15657044	7238030	3983099	5343910
Thailand Futures Exchange	13381	NA	1870075	NA	13381	NA	1870075	NA
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Athens Derivatives Exchange	13203	17.25	315493	389.86	13203	17.25	315493	389.86
BME Spanish Exchanges	364137	3714	1116637	77604	364137	3714	1116637	77604
Borsa Istanbul	936	150.09	502001	30317.6	936	150.09	502001	30317.6
Budapest SE	0	0	27776	4572.14	0	0	27776	4572.14
EUREX	40009338	1503600	36577548	1805810	40009338	1503600	36577548	1805810
Euronext	1507272	65219	4758598	251728	1507272	65219	4758598	251728
ICE Futures Europe	0	0	0	0	0	0	0	0
Johannesburg SE	186919	1555.27	1028811	348331	186919	1555.27	1028811	348331
Moscow Exchange	948413	92556.8	10962319	1093200	948413	92556.8	10962319	1093200
OMX Nordic Exchange	3085943	18234.4	3465983	54835.8	3085943	18234.4	3465983	54835.8
Oslo Børs	63796	367.92	255550	1474.31	63796	367.92	255550	1474.31
Tel Aviv SE	3743186	NA	3279	NA	3743186	NA	3279	NA

## 附 2:2014 年 1 月份各交易所 ETF 交易量

Exchange	Jan		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
<b>Americas</b>			
BM&FBOVESPA	16	2489.57	184.35
Colombia SE	18	108608.62	0.13
Lima SE	3	5.59	0.02
Mexican Exchange	502	119860	74.07
NASDAQ OMX	151	776725.36	30771.49
NYSE	1470	505801.3	22731.18
Santiago SE	102	22824	0.32
TMX Group	495	9961.5	1074.1
<b>Asia - Pacific</b>			
Australian SE	85	1078.5	NA
BSE India	37	1010.4	65.1
Bursa Malaysia	6	5.05	0.41

Hong Kong Exchanges	124	248219.53	739.53
Indonesia SE	8	332.94	3.53
Japan Exchange Group - Osaka	NA	NA	NA
Japan Exchange Group - Tokyo	195	3959951.87	NA
Korea Exchange	174	15951756	2642.55
National Stock Exchange India	42	8506.4	190.65
New Zealand Exchange	7	5.87	0.34
Shanghai SE	63	274703.28	2167
Shenzhen SE	39	86202.01	786.78
Singapore Exchange	89	269.66	NA
Taiwan SE Corp.	25	116815.78	681.82
The Stock Exchange of Thailand	21	539.86	8.32
<b>Europe - Africa - Middle East</b>			
Athens Exchange	3	0.61	0.15
BME Spanish Exchanges	72	937.56	0

## 免责声明

本报告所载数据资料，源自中证指数有限公司认为可靠之出处，但不保证其准确性或完整性。本报告及其所含任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议。对任何因直接或间接使用本报告或其所含任何信息而造成的损失，中证指数有限公司不承担任何法律责任。

**中证指数有限公司**

中国上海市迎春路 555 号 B 楼 5 楼

邮编:200135

电话:0086 21 5018 5500

传真:0086 21 5018 6368

电邮:csindex@sse.com.cn