

# 国际指数动态

(2019年8月)

## 国际指数动态（201908）

一、 指数动态 .....	2
1. 恒生指数发布 1 条国企策略指数与 2 条汇率对冲指数 .....	2
2. STOXX 发布 1 条 ESG 指数 .....	2
3. SOLACTIVE 发布 1 条塑料环保主题指数 .....	3
二、 指数衍生品动态 .....	3
1. 国际市场 8 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况 .....	3
A) 国别类 ETF .....	3
B) 规模类 ETF .....	3
C) 主题类 ETF .....	3
D) 策略类 ETF .....	3
E) 固定收益类 ETF .....	4
F) 衍生品类 ETF .....	4
H) 主动管理类 ETF .....	4
2. 国际市场衍生品交易量 .....	4
A) 2019 年 7 月份各交易所股指衍生品成交量 .....	4
B) 2019 年 7 月份各交易所 ETF 成交量 .....	6
C) 2019 年 7 月份各交易所 ETF 衍生品成交量 .....	7

## 一、指数动态

本月，恒生指数发布 1 条国企策略指数，以恒生综合指数样本股中的国有上市公司股票为样本空间，使用财务治理、分红能力、波动性指标选取 150 只股票作为成份股。恒生指数还发布 2 条汇率对冲指数，为使用欧元投资港股的投资者对冲港币汇率波动风险。STOXX 基于 EURO STOXX 50 Index 发布 1 条 ESG 指数。Solactive 发布 1 条塑料环保主题指数，选取从事塑料处理，可回收塑料替代品等业务的公司作为成份股。

### 1. 恒生指数发布 1 条国企策略指数与 2 条汇率对冲指数

2019 年 8 月 5 日，恒生指数发布 1 条国企策略指数，名称为 Hang Seng China State-holding Enterprises Index。该指数以 Hang Seng Composite Index (HSCI) 样本股中最大股东为中国政府或其控制实体的股票为样本空间，剔除上市时间不足 12 个月或过去 12 个月日均成交额不足 500 万港币的股票。计算剩余股票的 ROE、现金负债比率、股息率和波动率，并使用这四个因子计算综合因子。选取综合因子得分排名前 150 名的股票作为最终样本股，使用自由流通市值平方根加权，并设置 10% 的个股权重上限。

2019 年 8 月 5 日，恒生指数发布 2 条汇率对冲指数，名称分别为 HSI EUR Daily Hedged Index (HSIEURD) 和 HSCEI EUR Daily Hedged Index (HSCEEURD)。这两条指数为使用欧元投资 Hang Seng Index 和 Hang Seng China Enterprises Index 的投资者对冲港币汇率波动风险。

### 2. STOXX 发布 1 条 ESG 指数

2019 年 8 月 6 日，STOXX 发布 1 条 ESG 指数，名称为 EURO STOXX 50 ESG-X Index，指数使用的 ESG 评分来自数据提供商 Sustainalytics。该指数以 EURO STOXX 50 Index 样本股为样本空间，剔除不符合联合国全球契约原则或参与武器、烟草、煤炭等业务的公司。该指数改善 EURO STOXX 50 Index 的 ESG 表现，并提供类似的风险与回报。

### 3. Solactive 发布 1 条塑料环保主题指数

2019 年 8 月 28 日, Solactive 与 ISS ESG 合作发布 1 条塑料环保主题指数, 名称为 Solactive ISS ESG Beyond Plastic Waste Index。该指数选取从事塑料废品处理、循环再利用、可回收塑料产品替代品等业务的公司作为样本股。最新一期样本股有 Brambles Ltd. (一家提供可重复使用托盘、板条箱的公司)、BillerudKorsnäs AB (一家提供可再生纸浆和纸张制造的公司) 等。

## 二、指数衍生品动态

2019 年 8 月, 美国市场新发或即将发行 ETF 共 5 只, 为近两年来单月 ETF 发行量最少月份, 但仍有约 30 份 ETF 申请正在 SEC (美国证监会) 审核。5 只 ETF 分别为 Innovator 发行的 3 只下行保护 ETF, First Trust 发行的 1 只低碳主题 ETF, 及 AdvisorShares 发行的 1 只大麻 ETF。

### 1. 国际市场 8 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

#### A) 国别类 ETF

#### B) 规模类 ETF

#### C) 主题类 ETF

#### D) 策略类 ETF

- **下行保护 ETF:** Innovator 发行 3 只下行保护 ETF, 名称分别为 Innovator S&P 500 Buffer ETF — August (BAUG)、Innovator S&P 500 Power Buffer ETF — August (PAUG) 和 Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF — August (UAUG), 费率均为 0.79%, 在 Cboe 交易所上市。三只 ETF 均以 2019 年 8 月 1 日至 2020 年 7 月 31 日为考察期, BAUG 保护 S&P 500 考察期内-9% 以内的损失, 但是收益上限为 13.60%; PAUG 保护 S&P 500 考察期内-15%

以内的损失，但是收益上限为 8.98%；UAUG 保护 S&P 500 考察期内-5%至-35%的损失，但是收益上限为 8.93%。

## E) 固定收益类 ETF

## F) 衍生品类 ETF

## G) ETN 与 ETC

## H) 主动管理类 ETF

- **低碳 ETF:** First Trust 发行 1 只主动管理低碳 ETF，名称为 First Trust EIP Carbon Impact ETF (ECLN)，费率为 0.95%，在纽交所上市。该 ETF 以 GICS 行业分类中公用事业和能源行业的公司为样本空间，首先剔除参与煤炭生产、原油勘探等业务的公司，之后根据碳排放量、现金流稳定性、资产负债率、业务模式可持续性指标选取股票作为样本股。最新一期样本股中占比最高的行业为电力能源，达到 70%。
- **大麻 ETF:** AdvisorShares 计划发行 1 只主动管理大麻 ETF，名称为 AdvisorShares Pure US Cannabis ETF (MJUS)，费率暂未公布，在纽交所上市。该 ETF 专注于追踪美国大麻产业公司的表现，要求成份股至少 50% 的收入来源于美国大麻产业。除持有股票外，MJUS 还可以使用衍生品以获取对无法直接购买大麻股票的暴露。

## 2. 国际市场衍生品交易量

### A) 2019年7月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	JULY				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>								
B3 - Brasil Bolsa	1168265	77991.81	NA	NA	21895140	227669.8	NA	NA

Balc ã								
Bolsa Mexicana de Valores	493	11.12	44422	974.17	7520	167.94	504384	11228.95
Bolsa de Valores de Colombia	NA	NA	378	4.58	NA	NA	3990	47.88
CME Group	11099226	2036678	51623295	6100521	87639545	15035938	387118341	49395982
Cboe Futures Exchange	NA	NA	5188902	NA	NA	NA	35491450	NA
Cboe Global Markets	38844758	NA	NA	NA	273129398	NA	NA	NA
ICE Futures US	NA	NA	2520672	129323	NA	NA	2520672	1424412
<b>Asia - Pacific</b>								
ASX Australian Securities Exchange	783310	34702.33	934997	104608.02	5901354	256140.09	9000750	974028.13
Bursa Malaysia Derivatives	1165	0.14	174543	3434.08	8997	0.98	1244396	24707.74
China Financial Futures Exchange	NA	NA	4937849	741516.56	NA	NA	31555480	4766220.48
Hong Kong Exchanges and Clearing	2639753	272183.57	8522916	966979.94	21871842	2235555.76	67325725	7595284.52
Japan Exchange Group	2458527	NA	19807428	808016.25	17258387	NA	171734467	7255598.45
Korea Exchange	61446311	3536143.85	8198755	332626.16	405714699	24037296.53	58568346	2467651.58
NZX Limited	NA	NA	0	0	NA	NA	NA	NA
National Stock Exchange of India Limited	369853578	3710581.91	6896920	73839.56	2219656291	15501259.12	45398419	472900.15
Singapore Exchange	1141887	NA	13468729	NA	6485561	NA	110994014	NA
Taiwan Futures Exchange	13598062	236432.17	5334990	236361.5	96142490	1624349.49	40205938	1722467.36
Thailand Futures Exchange	122830	NA	3061520	NA	836556	NA	22780395	NA
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Athens Stock Exchange	7911	38.53	74574	359.14	41866	187.58	321061	1429.77
BME Spanish Exchanges	301297	3097.45	617681	52554.82	2061176	21082.78	4331902	363552.87
Borsa Istanbul	18904	44.41	4892789	11359.37	129044	289.3	33229976	73215.99
Bucharest Stock	0	0	0	0	NA	NA	NA	NA

Exchange								
Budapest Stock Exchange	NA	NA	14481	20.07	NA	NA	185392	265.15
Deutsche Boerse AG	33339330	1274530.01	32460795	1786998.12	249071105	9045964.5	282592031	13908047.26
Euronext	1437428	89337.76	3241054	246435.22	10141437	611744.06	22887205	1671400.5
ICE Futures Europe	1051461	994.46	359690	181975.64	6120125	994.46	25932775	181975.64
Johannesburg Stock Exchange	133664	609.94	694560	17762.16	2078991	2195	7949828.5	184912.2
Moscow Exchange	1314934	3534.42	7685650	19967.08	10266780	25338.56	58246915	137404.98
Nasdaq Nordic and Baltics	509225	8552.77	3008162	50471.32	3932522	66348.12	23492482	393886.61
Oslo Bors	24977	236.67	196327	1810.61	368485	3434.14	1519228	14038.22
Tehran Stock Exchange	NA	NA	566	0.48	NA	NA	7286	11.76
Tel-Aviv Stock Exchange	2169299	98688.21	NA	NA	14193304	615969.5	NA	NA
Warsaw Stock Exchange	12836	77.43	266931	3182.05	133835	813.58	2181426	26463.73

## B) 2019年7月份各交易所ETF成交量

Exchange	JULY		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
<b>Americas</b>			
B3 - Brasil Bolsa Balcão	18	2945.81	884
Bolsa Mexicana de Valores	21	1145.6	43.35
Bolsa Nacional de Valores	NA	0	0
Bolsa de Comercio de Santiago	265	9.83	0.18
Bolsa de Valores de Colombia	3	98.15	0.31
Bolsa de Valores de Panama	0	0	0
Cboe Global Markets	326	327912.76	NA
TMX Group	806	4567.85	564.7
<b>Asia - Pacific</b>			
ASX Australian Securities Exchange	157	1717.39	NA
Bursa Malaysia	12	10.44	0.23
Hochiminh Stock Exchange	3	16.36	1752
Hong Kong Exchanges and Clearing	138	12332.99	211.68
Indonesia Stock Exchange	30	0.3	0.76

Japan Exchange Group	258	27500.72	0
Korea Exchange	435	23162.46	6891.54
NZX Limited	31	63.91	29.86
National Stock Exchange of India Limited	73	819.99	818.21
Philippine Stock Exchange	1	0.71	1.24
Shanghai Stock Exchange	136	29710.35	3595.8
Singapore Exchange	51	137.25	NA
Taiwan Stock Exchange	119	5659.06	1207.42
The Stock Exchange of Thailand	17	11.58	9.85
<b>Europe - Africa - Middle East</b>			
Athens Stock Exchange	1	3.77	0.12
BME Spanish Exchanges	5	229.79	0
Boerse Stuttgart	1821	1134.88	27.93
Borsa Istanbul	5	181.52	25.25
Botswana Stock Exchange	3	0	1
Bucharest Stock Exchange	1	0.09	0.21
Budapest Stock Exchange	1	0	0.04
Bulgarian SE	11	0.01	0.03
CEESG - Prague	3	0	0
CEESG - Vienna	119	0.6	0.08
Deutsche Boerse AG	1445	12262.9	515.21
Euronext	1207	5343.3	222.02
Iran Fara Bourse Securities Exchange	21	270.39	37.36
Johannesburg Stock Exchange	78	294.21	21.7
Kazakhstan Stock Exchange	2	0.1	0.02
LSE Group	3145	22894.83	882.39
Luxembourg Stock Exchange	87	0	0
Moscow Exchange	28	73.45	81.01



Derivative Exchange	JULY				Year-to-Date Total			
	ETF Options		ETF Futures		ETF Options		ETF 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>								
B3 - Brasil Bolsa Balcão	3728170	951640.2	NA	NA	7915583	1911072.22	NA	NA
Bolsa Mexicana de Valores	0	0	0	0	2	NA	NA	NA
Cboe Global Markets	40005661	NA	NA	NA	229864605	NA	NA	NA
<b>Asia - Pacific</b>								
Hong Kong Exchanges and Clearing	152708	1572.82	1782	19.29	1802969	17853.09	16370	168.52
Japan Exchange Group	111520	NA	NA	NA	528985	NA	NA	NA
Taiwan Futures Exchange	13993	108.49	76866	902.83	90032	778.54	743303	8677.66
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Borsa Istanbul	NA	NA	0	NA	NA	NA	NA	NA
Budapest Stock Exchange	NA	NA	NA	0	NA	NA	NA	NA

## 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

地址：中国上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层

邮编：200127

电话：0086 21 5018 5500

传真：0086 21 5018 6368

电邮：[csindex@sse.com.cn](mailto:csindex@sse.com.cn)