

国际指数动态

(2015年10月)

国际指数动态（201510）

一、 指数动态.....	2
1. S&P DJI 发布两条可持续发展指数、一条 VIX 指数、两条泛阿拉伯市场 SMART BETA 指数和三条气候变化指数.....	2
2. FTSE 发布一条 ESG 指数.....	3
3. STOXX 发布一系列 SMART BETA 指数和 V-VIX 指数.....	4
二、 指数衍生品动态.....	5
1. 国际市场 10 月发行 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.....	7
E) 衍生品类 ETF.....	7
F) ETN 与 ETC.....	7
2. 国际市场衍生品交易量.....	7
A) 2015 年 9 月份各交易所股指衍生品成交量.....	7
B) 2015 年 9 月份各交易所 ETF 成交量.....	9
C) 2015 年 9 月份各交易所 ETF 衍生品成交量.....	10

一、指数动态

1. S&P DJI 发布两条可持续发展指数、一条 VIX 指数、两条泛阿拉伯市场 Smart Beta 指数和三条气候变化指数

2015 年 10 月 7 日，S&P DJI 和圣地亚哥交易所联合宣布发布 Dow Jones Sustainability Chile Index，该指数是智利的首只可持续发展指数，以圣地亚哥交易所的 Blue Chip IPSA Index 作为样本空间，从 40 只股票中选出 12 只可持续发展性明显好于同行业其他公司的股票。此筛选方法的一个主要指标即为公司的总可持续发展得分，该数据从瑞士 RobecoSAM 发布的公司可持续发展评估年鉴中得到。

2015 年 10 月 8 日，S&P DJI 发布 Dow Jones Sustainability South Africa Composite Diversified Index，该指数将成为 Dow Jones Sustainability Diversified 指数系列中的一员，为南非证券市场投资者提供了一个风险收益基准。该指数以 S&P South Africa Composite Index 为样本空间，根据瑞士 RobecoSAM 公司设计的可持续发展综合得分，选取得分最好的三分之一的公司作为样本股。

2015 年 10 月 15 日，S&P DJI 和日本交易所集团以及其下属的大阪证券交易所联合宣布发布 S&P/JPX JGB VIX Index，该指数通过测算大阪交易所上市的日本国债期权的隐含波动率，反映市场投资者情绪，该指数是日本首个固定收益 VIX 指数。该指数得到芝加哥期权交易所的授权，采用其波动率指数的测算方法，也成为继 2013 年发布的 CBOE/CBOT 10-year U.S. Treasury Note Volatility Index 后，第二只采用该方法计算固定收益波动率的指数。

2015 年 10 月 20 日，S&P DJI 宣布发布两条针对中东和北非市场的 Smart Beta 指数，分别为：S&P Pan Arab Low Volatility High Dividend Index 和 S&P Pan Arab Composite Shariah Dividend Index，这两条指数继续扩充了 S&P DJI 公司的 Smart Beta 指数系列。其中：

S&P Pan Arab Low Volatility High Dividend Index，是以 S&P Pan Arab Composite Index 为样本空间，从中选出同时符合多样性、波动性和可交易性要求的公司作为备选样本，然后选出每股收益率最高的 75 只股票，并按照波动率水平排序，波动率最小的 50 只股票将成为最终的样本股。

S&P Pan Arab Composite Shariah Dividend Index，是以 S&P Pan Arab Composite Shariah Index 为样本空间，从中选出满足流动性、收益增长性和收益可持续性特征的公司作为样本股，根据样本股的股息收益加权。

2015 年 10 月 29 日，S&P DJI 和多伦多证券交易所宣布发布三条加拿大市场的气候变化指数，分别为：S&P/TSX 60 Carbon Efficient Index，S&P/TSX 60 Carbon Efficient Select Index 和 S&P/TSX 60 Fossil Fuel Free Index，这三条指数均以加拿大市场最大的基准指数 S&P/TSX 60 Index 作为样本空间。其中：

S&P/TSX 60 Carbon Efficient Index 是对 S&P/TSX 60 Index 中的低碳排放公司股票赋予更高权重，对高碳排放公司股票赋予更低权重，衡量改变权重分配后的指数表现情况。

S&P/TSX 60 Carbon Efficient Select Index 是在 S&P/TSX 60 Index 中精选具有碳效率特征的公司，即剔除在采购、生产、加工等等环节具有高碳足迹的公司。所谓碳足迹，是一家专业评估企业环境表现的公司 Trucost Plc 测算得出的公司温室气体排放量水平。

S&P/TSX 60 Fossil Fuel Free Index 则是在 S&P/TSX 60 Index 中选取没有化石燃料储备的公司作为样本股。

2. FTSE 发布一条 ESG 指数

2015 年 10 月 12 日，FTSE 和约翰内斯堡证券交易所联合宣布发布新的 ESG 指数：FTSE/JSE Responsible Investment Series。FTSE 和约翰内斯堡证券交易所在一两年前达成合作伙伴关系，他们发现越来越多的机构投资者尝试在他们的投

资策略中增加 ESG 的配置。因此，通过合作开发一系列指数，能够为投资者提供一个整合 ESG 的工具。

该指数是在 FTSE/JSE Africa Index Series 的基准上构建，同时组合 FTSE/JSE Responsible Investment Benchmark 和 30 只 ESG 得分最高的公司。ESG 得分是由 FTSE 从环境(Environment)、社会(Social)和企业管治(Governance)三个角度出发，考量详细指标综合计算得出。

3. STOXX 发布一系列 Smart Beta 指数和 V-VIX 指数

2015 年 10 月 20 日，STOXX 宣布发布 STOXX Select Index 系列和 STOXX Diversification Select Index 系列，旨在衡量具有低波动率、高股息率、低相关性特征的公司的市场表现，并为

二、指数衍生品动态

1. 国际市场 10 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

A) 国别类 ETF

- **欧洲 ETF:** 台湾 ETF 供应商永丰投信发行 1 只针对欧洲市场的 ETF，跟踪 EURO STOXX 50 Index，将于下个月上市。
- **日本 ETF:** 日本三菱信托和贝莱德集团分别发行一只日本市场 ETF。前者跟踪 iSTOXX MUTB Japan Quality 150 Index，将于下个月上市。后者跟踪 Tokyo stock Price Index，于东交所上市。
- **香港 ETF:** 华夏基金（香港）有限公司发行 1 只香港市场 ETF，名称为：华夏恒生小型股指数 ETF，于 2015 年 10 月 26 日于香港交易所上市。
- **中国 ETF:** 道富环球投资管理发行 1 只中国市场 ETF，名称为 SPDR MSCI China A Shares IMI ETF，跟踪 MSCI China A International IMI Index 的表现，包括在上海和深圳交易的大中小盘股，于纽交所上市。

B) 主题类 ETF

- **房地产信托 ETF:** 贝莱德集团发行 1 只针对日本市场的房地产信托 ETF，

饮类股票,同时需要满足一定的市值和流动性要求。该ETF发行规模为250万美元,费率0.75%,于纳斯达克交易所上市。

- **其他主题类ETF:** 道富环球投资管理发行多只行业和主题类ETF,涉及主题和行业包括基础实施、必需消费品、非必需消费品、能源、金融、医疗、工业、材料、公用事业等,该系列ETF均跟踪S&P相关指数。

C) 策略类ETF

- **货币对冲ETF:** 南方东英资产管理公司发行1只针对中国市场的货币对冲ETF,名称分别为:CSOP MSCI China A International Hedged ETF,采用100%人民币对冲美元,于港交所上市。ETF供应商iShares发行1只针对日本市场的货币对冲ETF,名称为:iShares Currency Hedged JPX-Nikkei 400 ETF,于纽交所上市。德银发行1只针对中国市场沪深300指数的货币对冲ETF,名称为Deutsche X-trackers CSI 300 China A-Shares Hedged Equity ETF,于纽交所上市。
- **最小波动ETF:** 贝莱德集团发行1只针对日本市场的最小波动ETF,名称为:iShares MSCI Japan Minimum Volatility (ex-REITs) ETF,于东交所上市。UBS发行2只低波动率ETF,分别针对东亚同盟和美国市场,名称分别为UBS ETF - Factor MSCI EMU Low Volatili UCITS ETF和UBS ETF - Factor MSCI USA Low Volatili UCITS ETF。
- **股息收益ETF:** 贝莱德集团发行1只针对日本市场的股息收益ETF,名称为:iShares MSCI Japan High Dividend Yield ETF,于东交所上市。UBS发行2只股东总收益ETF,分别针对东亚同盟和美国市场,名称分别为UBS ETF - Factor MSCI EMU TS Yield UCITS ETF和UBS ETF - Factor MSCI USA TS Yield UCITS ETF。
- **A/H溢价ETF:** 南方东英资产管理公司发行1只追踪中国内地股票A/H溢价ETF,名称为:China CSI 300 A-H Dynamic ETF,于纽交所上市。通过从在香港和内地上市的公司中挑选价格较低的股票,可以从香港和上海两地上市股票之间高达近30%的价差中获利。
- **多因子ETF:** ETF供应商iShares发行3只多因子ETF,分别涉及美国、欧洲和全球市场,名称分别为:iShares FactorSelect MSCI USA UCITS ETF,

iShares FactorSelect MSCI Europe UCITS ETF 和 iShares FactorSelect MSCI World UCITS ETF。

D) 固定收益类 ETF

- **公司债 ETF:** ETF 供应商 Guggenheim BulletShares 发行 2 只公司债 ETF, 分别名为: Guggenheim BulletShares 2023 High Yield Corporate Bond ETF 和 Guggenheim BulletShares 2025 Corporate Bond ETF, 于纽交所上市。

E) 衍生品类 ETF

- 暂无

F) ETN 与 ETC

- **主题及策略类 ETN:** 瑞士信贷集团发行多只主题及策略类 ETN, 主题涉及基础设施、抵押型房地产信托和企业发展等, 策略涉及总回报、两倍杠杆等, 名称分别为: Etracs Alerian MLP Infrastructure Index ETN, Etracs Alerian MLP Index ETN, Etracs Monthly Pay 2xLeveraged Mortgage REIT ETN, Etracs CMCI Total Return ETN, Etracs Wells Fargo Business Development Company Index ETN 和 Etracs 2xLeveraged Long Wells Fargo Business Development Company Index ETN, 均于纽交所上市。

2. 国际市场衍生品交易量

A) 2015年9月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	Sep				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
Americas								
BM&FBOVESPA	201307	21579.2	10852030	42980.9	1639792	251687	80250152	439233

CBOE Future Exchange	NA	NA	5278891	NA	NA	NA	39662224	NA
Chicago Board Options Exchange	42342335	NA	NA	NA	309246048	NA	NA	NA
CME Group	12477225	1557670	64268219	6229440	105697515	14430400	424225233	42979400
Colombia SE	NA	NA	21	0.213028	NA	NA	506	6.1804
ICE Futures US	1331	152	6343381	504206	24368	2974	34979364	3231590
International Securities Exchange	264268	NA	NA	NA	1436795	NA	NA	NA
MexDer	6715	166.389	175560	3613.38	80241	2209.97	1157028	25183
Asia - Pacific								
ASX Derivatives Trading	1125668	39139.5	4892	173.254	8537609	348877	8681	154.276
ASX SFE Derivatives Trading	37932	3335.7	1613469	135248	230119	23721.9	8489876	714490
BSE India	5845277	33908.9	20747	120.752	160364082	1072980	461691	2966.47
Bursa Malaysia Derivatives	271	NA	350160	6075.53	3686	NA	2274745	42701.2
China Financial Futures Exchange	NA	NA	2674404	376410	NA	NA	332578444	65881800
Hong Kong Exchanges	2583981	197327	6380120	456249	18074614	1831520	53072755	4085810
Korea Exchange	45357192	44355600	4149565	404212	385178108	12034400 0	30525171	6647670
National Stock Exchange India	174202738	572165	18492427	69289	1646894021	5887110	142965647	518151
New Zealand	NA	NA	1	0.063347 3	NA	NA	46	3.17728
Osaka SE	3434709	NA	32560220	1272340	29721864	NA	241709423	7435210
Singapore Exchange	406921	NA	12122358	NA	4402660	NA	130961216	NA
TAIFEX	15483009	191652	5572689	188796	142876319	2065290	40605341	1472060
Thailand Futures Exchange	29252	NA	3593170	NA	237469	NA	20054502	NA
Europe - Africa - Middle East								
Athens Derivatives Exchange	6688	7.30912	58817	65.6246	71568	95.8718	1917738	2536.8
BME Spanish Exchanges	430079	4797.03	926126	75204.1	4289329	51716.9	8124186	705146
Borsa Istanbul	1548	75.5232	534701	9789.07	10739	694.627	5586044	124933
Budapest SE	0	0	13085	9.86324	0	0	154557	90.2573
EUREX	38932212	1569250	51633844	2507690	316574372	13733400	324409013	18257400
Euronext	1159770	56309.5	4276433	261725	11121216	581187	36449300	2340760
ICE Futures Europe	NA	NA	NA	NA	8850287	11367.6	15326144	1613700

Johannesburg SE	294214	182.362	2884390	62367.2	2008152	1240.89	14547357	382802
Moscow Exchange	1886137	2859.16	20202472	31446.2	13300175	23110.2	134585306	236504
OMX Nordic Exchange	911870	15748.9	3819496	66325.7	10489615	138622	29924899	560349
Oslo Børs	72758	30.8127	253864	107.801	517606	269.86	2159500	1116.04
Tel Aviv SE	3266049	NA	1926	NA	36785448	NA	25157	NA

B) 2015年9月份各交易所ETF成交量

Exchange	Sep		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
Americas			
BM&FBOVESPA	17	766.335	197.11
Bolsa de Comercio de Santiago	201	5.44	0.18
Bolsa de Valores de Colombia	17	21.831	0.1
Bolsa de Valores de Lima	21	5.486	0.03
Bolsa Mexicana de Valores	563	4129.338	83
Nasdaq - US	176	782909.43	31421.29
NYSE	1561	445998.16	23079.43
TMX Group	523	5527.109	606.5
Asia - Pacific			
Australian Securities Exchange	103	943.87	#N/A
BSE India Limited	41	115.461	42.38
Bursa Malaysia	7	0.247	0.12
Hong Kong Exchanges and Clearing	131	14368.668	367.6
Indonesia Stock Exchange	8	0.042	0.3
Japan Exchange Group	219	59382.101	#N/A
Japan Exchange Group - Osaka	NA	NA	#N/A
Korea Exchange	191	12760.352	2702.1
National Stock Exchange of India	48	251.537	223.13
NZX Limited	19	14.126	0.46
Shanghai Stock Exchange	73	14957.981	1078
Shenzhen Stock Exchange	46	7083.265	746.1
Singapore Exchange	87	158.501	#N/A
Stock Exchange of Thailand	21	6.763	5.6
Taiwan Stock Exchange Corp.	33	4371.457	998.03
Europe - Africa - Middle East			
Athens Stock Exchange	3	0.09	0.08
BME Spanish Exchanges	71	1003.137	0
Borsa Istanbul	13	67.106	11.74
Budapest Stock Exchange	1	0.224	0.01
Deutsche Boerse	1085	15872.372	268.74
Euronext	688	15473.968	188.88

Irish Stock Exchange	1	0.63	0.03
Johannesburg Stock Exchange	46	514.381	17.59
Luxembourg Stock Exchange	156	0	0
NASDAQ OMX Nordic Exchange	41	1655.01	84.29
Nigerian Stock Exchange	4	0.044	89
Oslo Bors	4	644.129	25.98
Saudi Stock Exchange (Tadawul)	3	35.73	0.11
SIX Swiss Exchange	935	6026.026	71.68
Wiener Borse	18	0.135	0.02

C) 2015年9月份各交易所ETF衍生品成交量

Derivative Exchange	Sep				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
Americas								
BM&FBOVESPA	266 546	29 160.3	0	0.0	2 838 198	455 739.0	0	0.0
Chicago Board Options Exchange	29 085 246	NA	NA	NA	252 226 643	NA	NA	NA
International Securities Exchange	28 958 251	NA	NA	NA	190 196 725	NA	NA	NA
MexDer	52	0.0	0	0.0	13 337	3.8	0	0.0
NYSE Liffe (US)	31 651 552	6 918.6	NA	NA	215 506 961	36 905.9	NA	NA
Asia - Pacific								
Hong Kong Exchanges	507 944	3 590.1	19 154	145.9	6 877 770	69 818.2	203 602	1 955.4
Osaka SE	75	NA	NA	NA	7 504	NA	NA	NA
TAIFEX	NA	NA	216 619	1 864.4	NA	NA	796 513	7 477.8
Europe - Africa - Middle East								
Johannesburg SE	12 100	0.2	182 840	15.1	21 778	1.0	587 720	52.6

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