

国际指数动态

(2016年2月)

国际指数动态（201602）

一、 指数动态.....	2
1. STOXX 发布全球质量指数系列.....	2
2. STOXX 发布低碳指数家族.....	2
二、 指数衍生品动态.....	4
1. 国际市场 2 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况.....	4
A) 国别类 ETF	4
B) 主题类 ETF	4
C) 策略类 ETF	4
D) 固定收益类 ETF	5
E) 衍生品类 ETF	5
F) ETN 与 ETC.....	5
2. 国际市场衍生品交易量	6
A) 2016 年 1 月份各交易所股指衍生品成交量.....	6
B) 2016 年 1 月份各交易所 ETF 成交量.....	7
C) 2016 年 1 月份各交易所 ETF 衍生品成交量.....	8

一、指数动态

1. STOXX 发布全球质量指数系列

2016年2月1日,STOXX 宣布发布 iSTOXX MUTB Global Quality Indices,旨在捕捉全球范围内具有高盈利、低杠杆、稳定现金流特征公司的整体表现,该指数现已授权三菱东京 UFJ 银行开发相应产品。

STOXX 和三菱东京 UFJ 银行在 2015 年签署合作备忘录,并于当年 8 月发行一条 iSTOXX MUTB Japan Quality 150 Index。而这次发行的 iSTOXX MUTB Global Quality Indices 可以视为前一条指数的全球版本,为日本投资者提供了参与全球市场的投资工具,同时也使得 STOXX 的 Smart-Beta 指数系列在日本市场得到进一步的推广。

该指数系列包括三条指数: iSTOXX MUTB Global Quality 150 Index、iSTOXX MUTB Global ex Japan Quality 150 Index、iSTOXX MUTB Global ex Australia Quality 150 indices。这三条指数分别以 STOXX Global 1800 Index and STOXX Global 1800 ex Japan Index and STOXX Global 1800 ex Australia Index 作为样本空间,每个样本空间又可以分为三个市场:北美、欧洲、亚太。然后根据四个基本面指标综合得分进行选股,四个指标分别为:ROE、资产负债率、现金流水平、业务稳定性。选取综合得分最高的 150 只股票作为样本股,并设置 5%的缓冲区。该指数系列采用自由流通市值加权,对单个样本股设置 2%的权重上限。

2. STOXX 发布低碳指数家族

2016年2月4日,STOXX 宣布发布 STOXX Low Carbon index family,该指数家族包含四个指数系列,旨在成为不同类型低碳主题的 ETF、指数基金、结构化产品及其他金融衍生品的基准。具体来看,四个指数系列为:

STOXX Low Carbon Indices: 选取降低碳排放量的公司作为样本股。

STOXX Reported Low Carbon Indices: 选取公开承诺公布其碳排放量水平的公司作为样本股。

STOXX Industry Leaders Indices: 选取各个行业排放量最低的股票作为样本股。

STOXX Low Carbon Footprint Indices: 按照 GICS 的行业分类，在除化工、公用事业、石油、建筑材料、旅游休闲、食品饮料和基础资源以外其他二级行业部门中，选取碳排放量最低的公司作为样本股。

四个指数系列均以 **STOXX Global 1800 Index** 作为样本空间，采用自由流通市值和碳排放因子得分的乘积进行加权(除 **STOXX Industry Leaders Indices** 外，该指数系列采用等权方式)，并设置 5% 的权重上限。该指数系列中用到的上市公司碳排放数据，主要来自于全球知名的碳减排倡导者---非盈利性组织 **CDP Europe** (Carbon Disclosure Project, 碳信息披露项目)。碳排放量低的公司赋予较高的权重，碳排放量高的公司则赋予较低的权重。

四个指数系列中包含的具体指数如下：

STOXX Low Carbon Indices	STOXX Reported Low Carbon Indices	STOXX Industry Leaders Indices	STOXX Low Carbon Footprint Indices
STOXX Global 1800 Low Carbon	STOXX Global Reported Low Carbon	STOXX Global Low Carbon 100	STOXX Global Low Carbon Footprint
STOXX Global 1800 Ex USA Low Carbon	STOXX Europe Reported Low Carbon	STOXX Global Low Carbon 100 Equal Weight	STOXX Europe Low Carbon Footprint
STOXX Global 1800 Ex Japan Low Carbon	EURO STOXX Reported Low Carbon	STOXX Global Low Carbon 400	
STOXX Global 1800 Ex Australia Low Carbon	STOXX USA Reported Low Carbon	STOXX Global Low Carbon 400 Equal Weight	
STOXX Global 1800 Ex Europe Low Carbon		STOXX Europe Low Carbon 50	
STOXX Europe 600 Low Carbon		STOXX Europe Low Carbon 50 Equal Weight	

EURO STOXX 50 Low Carbon		STOXX Europe Low Carbon 100	
EURO STOXX Low Carbon		STOXX Europe Low Carbon 100 Equal Weight	
STOXX USA Low Carbon		STOXX USA Low Carbon 50	
STOXX Japan Low Carbon		STOXX USA Low Carbon 50 Equal Weight	

二、指数衍生品动态

1. 国际市场 2 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

A) 国别类 ETF

- **国别类 ETF:** ETF 供应商 WisdomTree 发行 2 只针对德国和日本市场的 ETF，分别跟踪 WisdomTree Germany Hedged Equity Index 和 WisdomTree Japan EUR Hedged Equity Index，于瑞士证券交易所上市。

B) 主题类 ETF

- 暂无

C) 策略类 ETF

- **红利 ETF:** ETF 供应商 Pacer 发行 1 只红利 ETF，名称为：Pacer Global High Dividend ETF (PGHD)，跟踪 FTSE All World Developed Large Cap Index 于 BATS 交易所上市。该指数从样本空间中选出自由现金流最大 300 只股票，然后按照股息率排名，排出股息率最大的 100 只股票作为样本股。
- **多因子 ETF:** 资产管理公司 Janus 发行 2 只多因子 ETF，名称分别为：Janus Small Cap Growth Alpha ETF (JSML) 和 Janus Small/Mid Cap Growth Alpha ETF (JSMD)。其中，二者分别跟踪 Solactive Small Cap Index 和 Solactive

Small/Mid Cap Index，均于纳斯达克交易所上市。该策略方法主要从增长、利润率、资本效率等 10 个方面的因子进行选股。

- **Smart Beta ETF:** ETF 供应商 PowerShares 发行一只 Smart Beta 策略 ETF，投资于具有高股利低波动特征的公司，名称为：PowerShares EUROSTOXX High Dividend Low Volatility UCITS ETF，跟踪 EURO iSTOXX High Dividend Low Volatility 50 Index，于瑞士证券交易所上市。

D) 固定收益类 ETF

- **高收益债 ETF:** 资产管理公司 Cambria 发行 1 只偏主动管理的高收益债券 ETF，投资于具有高股息率的债券，名称为：Cambria Sovereign High Yield Bond ETF (SOVB)，于纽交所上市。

E) 衍生品类 ETF

- 暂无

F) ETN 与 ETC

- **原油主题 ETN:** 瑞士信贷银行 Credit Suisse 和瑞士 UBS 各自发行 1 只原油主题 ETN，名称分别为：Credit Suisse X-Links WTI Crude Oil Index ETN 和 Etracs S&P GSCI Crude Oil Total Return Index ETN，均于纽交所上市。
- **能源主题 ETN:** UBS 发行 2 只能源主题 ETN，名称分别为 Etracs 2X Monthly Leveraged Long Alerian MLP Infrastructure ETN (MLPL) 和 Etracs 2x Monthly Leveraged S&P MLP Index ETN (MLPV)，于纽交所上市。
- **欧洲市场 ETN:** UBS 发行 1 只针对欧洲市场的 ETN，名称为：UBS AG FI Enhanced Europe 50 ETN，该 ETN 跟踪 STOXX Europe 50 USD (Gross Return) Index。该指数覆盖了欧洲市场 18 个国家最大的 50 只蓝筹股。
- **红利 ETN:** UBS 发行 1 只高股息率的 ETN，名称为 UBS AG FI Enhanced Global High Yield ETN (FIHD)，跟踪 MSCI World High Dividend Yield USD Gross Total Return Index，于纽交所上市。

2. 国际市场衍生品交易量

A) 2016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
Americas								
Bourse de Montreal	7334	38.6515	24260	2817.26	7334	38.6515	24260	2817.26
Buenos Aires SE	0	0	0	0	0	0	0	0
CBOE Future Exchange	NA	NA	5168403	NA	NA	NA	5168403	NA
CME Group	14154317	1800140	64417482	5920830	14154317	1800140	64417482	5920830
Colombia SE	NA	NA	38	0.323116	NA	NA	38	0.323116
ICE Futures US	2780	285	4666050	366387	2780	285	4666050	366387
International Securities Exchange	231313	NA	NA	NA	231313	NA	NA	NA
MexDer	6267	142.236	133328	1948.71	6267	142.236	133328	1948.71
NASDAQ OMX (US)	108957	NA	NA	NA	108957	NA	NA	NA
Bourse de Montreal	7334	38.6515	24260	2817.26	7334	38.6515	24260	2817.26
Asia - Pacific								
Australian Securities Exchange	997116	35531.1	832677	71629.2	997116	35531.1	832677	71629.2
BSE India	2572913	19161.1	7693	55.9263	2572913	19161.1	7693	55.9263
Bursa Malaysia Derivatives	562	NA	306092	5823.19	562	NA	306092	5823.19
China Financial Futures Exchange	NA	NA	886337	127945	NA	NA	886337	127945
Hong Kong Exchanges	3013127	223844	8732943	645792	3013127	223844	8732943	645792
Japan Exchange Group	3701714	NA	37181293	1073890	3701714	NA	37181293	1073890
Korea Exchange	41738502	4093500	3744684	366888	41738502	4093500	3744684	366888
National Stock Exchange India	78948191	648642	7151363	56004.1	78948191	648642	7151363	56004.1
New Zealand	NA	NA	6	0.415288	NA	NA	6	0.415288
Singapore Exchange	563006	NA	15373834	NA	563006	NA	15373834	NA
TAIFEX	19592910	230445	6982872	225561	19592910	230445	6982872	225561

Europe - Africa - Middle East								
Athens Derivatives Exchange	5373	5.03737	90286	78.2039	5373	5.03737	90286	78.2039
BME Spanish Exchanges	367796	3548.91	966019	66506.3	367796	3548.91	966019	66506.3
Borsa Istanbul	34383	100.186	4143054	12152	34383	100.186	4143054	12152
EUREX	39581132	1523480	40354951	1879200	39581132	1523480	40354951	1879200
Euronext	1182732	53570.6	4209117	239393	1182732	53570.6	4209117	239393
Johannesburg SE	226344	177.064	1211725	24637	226344	177.064	1211725	24637
Moscow Exchange	1949095	2590.43	17945544	23800.6	1949095	2590.43	17945544	23800.6
OMX Nordic Exchange	781492	11877.7	4038749	63023.8	781492	11877.7	4038749	63023.8
Oslo Børs	90888	44.9644	339026	168.01	90888	44.9644	339026	168.01
Tel Aviv SE	4846833	NA	2086	NA	4846833	NA	2086	NA

B) 2016年1月份各交易所ETF成交量

Exchange	Jan		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
Americas			
BM&FBOVESPA	# N/A	#N/A	#N/A
Bolsa de Comercio de Santiago	219	7.729	0.21
Bolsa de Valores de Colombia	17	21.34	0.11
Bolsa de Valores de Lima	32	16.71	0.1
Bolsa Mexicana de Valores	568	6318.709	95.23
Nasdaq - US	196	888899.11	40610.61
NYSE	1571	543596.88	31133.33
TMX Group	536	7152.316	1096.1
Asia - Pacific			
Australian Securities Exchange	110	937.177	#N/A
BSE India Limited	45	114.315	24.23
Bursa Malaysia	8	0.558	0.36
Hong Kong Exchanges and Clearing	134	16241.087	511.34
Indonesia Stock Exchange	#N/A	#N/A	#N/A
Japan Exchange Group - Tokyo	224	65528.811	#N/A
National Stock Exchange of India	202	17879.692	4079.71
NZX Limited	54	246.596	164.79
Shanghai Stock Exchange	23	24.599	0.45
Shenzhen Stock Exchange	73	8773.754	1017
Singapore Exchange	46	4696.009	626.96
Stock Exchange of Thailand	86	193.141	#N/A
Taiwan Stock Exchange Corp.	21	5.803	6.09

Australian Securities Exchange	39	5695.352	1468.34
Europe - Africa - Middle East			
Athens Stock Exchange	3	0.336	0.08
BME Spanish Exchanges	48	830.463	0
Borsa Istanbul	11	43.62	18.37
Deutsche Boerse	1113	19761.023	372.4
Euronext	769	18217.961	238.52
Irish Stock Exchange	185	1.3	0.04
Johannesburg Stock Exchange	47	290.635	17.95
Luxembourg Stock Exchange	141	0	0
NASDAQ OMX Nordic Exchange	33	1529.412	83.29
Nigerian Stock Exchange	7	0.029	132
Oslo Bors	4	636.968	133.26
Saudi Stock Exchange (Tadawul)	3	25.272	0.13
SIX Swiss Exchange	977	9638.725	90.21
Wiener Borse	9	0.054	0.01

C) 2016年1月份各交易所ETF衍生品成交量

Derivative Exchange	Jan				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								
Bourse de Montreal	67 597	91.6	NA	NA	67 597	91.6	NA	NA
Buenos Aires SE	0	0.0	0	0.0	0	0.0	0	0.0
International Securities Exchange	30 260 904	NA	NA	NA	30 260 904	NA	NA	NA
MexDer	0	0.0	0	0.0	0	0.0	0	0.0
NASDAQ OMX (US)	32 781 006	NA	NA	NA	32 781 006	NA	NA	NA
NYSE Liffe (US)	32 649 933	6 777.1	NA	NA	32 649 933	6 777.1	NA	NA
Asia - Pacific								
Hong Kong Exchanges	551 055	3 461.9	11 705	79.8	551 055	3 461.9	11 705	79.8
Japan Exchange Group	1 300	NA	NA	NA	1 300	NA	NA	NA
TAIFEX	27 554	201.1	272 318	2 297.2	27 554	201.1	272 318	2 297.2
Europe - Africa - Middle East								
Johannesburg SE	612 688	21.3	2 396 450	473.1	612 688	21.3	2 396 450	473.1

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