

国际指数动态

(2014年4月)

国际指数动态（201404）

一、 指数动态及综述.....	2
1. 发达市场关注度不断升温.....	2
A) STOXX 授权欧元区 50 指数.....	2
B) STOXX 授权欧元区 50 杠杆指数和 LEV DAX x3 指数.....	2
C) FTSE 宣布发布发达国家非化石燃料系列指数.....	2
2. 其他动态及规则变更.....	3
A) S&P 宣布发布六条南非系列指数.....	3
B) STOXX 宣布将调整国家划分标准.....	3
C) FTSE 宣布调整 ESG 相关指数的研究方法.....	3
二、 指数衍生品动态及综述.....	4
1. 美国市场 4 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.....	4
D) 固定收益类 ETF.....	4
E) ETN 与 ETC.....	4
2. 美国市场 4 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.....	5
D) 固定收益类 ETF.....	5
E) ETN 与 ETC.....	5
3. DEUTSCHE BÖRSE XETRA 4 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单.....	6
4. NYSE 与 NASDAQ 4 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单.....	6
附 1: 2014 年 3 月份各交易所股指衍生品成交量.....	7
附 2: 2014 年 3 月份各交易所 ETF 交易量.....	8

一、指数动态及综述

1. 发达市场关注度不断升温

近年来,在经历了金融危机和债务危机的洗礼之后,发达市场经济不断复苏,美国经济在2013年的四个季度均获得增长,并且增速不断上升,全年增长1.9%,这也带来了股票市场的良好表现,道琼斯工业指数不断创出新高,2013年涨幅超过25%,欧洲股市方面,STOXX欧元区50涨幅也超过10%,正是由于这样不俗的表现以及继续增长的预期,使得发达市场指数受到越来越多的关注。根据相关机构对投资者的调查,其中39%的投资者认为发达市场将展现投资机会,已经把其投资由新兴市场转移到了发达市场。关注度不断的提升带来了发达市场投资需求的增长,4月份在美挂牌的ETF中,除了一只中国概念的ETF之外,其他股票类ETF都与发达市场相关。指数投资作为投资发达市场重要的工具,具有高透明性,低成本的优势,受到诸多投资者青睐,所以各大指数商也加速了相应指数的研发,满足不断增长的对发达市场的投资需要。

A) STOXX授权欧元区50指数

2014年4月30日,STOXX宣布将欧元区50指数授权给Mirae Asset用于在韩交所开发ETF。这是欧元区50指数在韩国第一次被授权作为ETF标的,它包括了欧元区内12个国家中的50个代表性公司,很好的反映了欧元区市场表现。

B) STOXX授权欧元区50杠杆指数和LEV DAX x3指数

2014年4月14日,STOXX宣布将欧元区50杠杆指数和LEV DAX x3指数授权给ETF Securities用于两只ETP的开发,这两只ETP将在德交所挂牌上市。

C) FTSE宣布发布发达国家非化石燃料系列指数

2014年4月29日, FTSE 宣布发布发达国家非化石燃料系列指数, 这个创新的指数采用的是排除模型, 将与化石燃料相关的上市公司排除在指数系列之外, 利用剩下来的股票构建指数样本, 并与 BlackRock 和 NRDC 进行非公开合作。

2. 其他动态及规则变更

A) S&P宣布发布六条南非系列指数

2014年4月30日, S&P 宣布发布六条新的南非系列指数用于满足南非投资者不断增长的指数投资需要, 这六条指数包括市场基准类型和投资策略型, 他们分别是:

- S&P South Africa Composite Property
- S&P South Africa Composite Property Capped
- S&P GIVI® South Africa Composite
- S&P South Africa Domestic Shareholder Weighted(DSW) Index
- S&P South Africa DSW Capped Index
- S&P South Africa DSW 50

B) STOXX宣布将调整国家划分标准

2014年4月7日, STOXX 宣布根据最新的市场反馈和研究结果, 决定将划分到发达市场和新兴市场的可交易市值门槛由原来的100亿美元上升到150亿美元。STOXX 国家划分标准主要来自国家宏观经济数据、市场规模、市场流动性、货币自由交换程度、资本流动限制五个方面。

C) FTSE宣布调整ESG相关指数的研究方法

2014年4月10日, FTSE 宣布对 FTSE4Good Index 和 ESG 评估发展新的研究方法, 并计划发布一系列新的 ESG 指数。新的方法包含300项指标, 将公司划分到14个 ESG 主题里, FTSE 并将衍生 ESG 指数和数据分析的服务范围。

二、指数衍生品动态及综述

1. 美国市场 4 月新发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

A) 国别类 ETF

- **中国 ETF:** DB 发行了一只中国概念 ETF, 跟踪 MSCI All China Equity Index, 主要投资于大中盘中国股票;

B) 主题类 ETF

- **行业 ETF:** WisdomTree 发行了 5 只货币对冲型行业 ETF, 包括 TMT, 金融, 固定资产等;
- **黄金 ETF:** Direxion 发行了 2 只黄金 ETF, 主要投向黄金期货近月合约;
- **经济相关度 ETF:** Emerging Global Advisors 发行了一只 EGShares Blue Chip ETF, 跟踪 EGAI Developed Markets Blue Chip EM Access Index, 投向 30 个对新兴市场收入不断增长的发达国家蓝筹股;

C) 策略类 ETF

- 暂无

D) 固定收益类 ETF

- **FOF 债 ETF:** iShares 发行了一只债券 FOF 相关 ETF, 跟踪 Morningstar U.S. Bond Market Yield-Optimized Index, 主要投向政府债, 投资级信用债, 非投资级信用债等;

E) ETN 与 ETC

- **ETN:** Barclays Bank PLC and OFI Global Asset Management 共同发行了一系列 ETN, 跟踪 Barclays OFI SteelPath Midstream MLP Index;

2. 美国市场 4 月拟成立 ETF、ETN 及 ETC 情况

A) 国别类 ETF

- **中国 ETF:** Market Vectors 拟发行一只中国概念 ETF, 跟踪 MSCI All China Index; KraneShares 拟发行一只中国概念债 ETF, 投向投资级中国债券以及境内人民币债券, 为投资者提供中国固定收益风险暴露工具;

B) 主题类 ETF

- **红利 ETF:**

- 暂无;

3. Deutsche Börse Xetra 4 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单

产品名称	标的指数
db x-trackers II Markit iBoxx ABF Indonesia Government UCITS ETF	Markit iBoxx ABF Indonesia Government [®] Total Return Index
Amundi ETF Euro High Yield Liquid Bond iBoxx UCITS ETF	Markit iBoxx EUR Liquid High Yield 30 Ex-Financial Index
Amundi ETF Russell 2000	Russell 2000 Index

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

挂牌地	上市 ETF	上市日期
NYSE Arca	WisdomTree Japan Hedged Tech, Media and Telecom Fund	4/8/2014
NYSE Arca	WisdomTree Japan Hedged Financials Fund	4/8/2014
NYSE Arca	WisdomTree Japan Hedged Real Estate Fund	4/8/2014
NYSE Arca	WisdomTree Japan Hedged Capital Goods Fund	4/8/2014
NYSE Arca	WisdomTree Japan Hedged Health Care Fund	4/8/2014
NYSE Arca	Direxion Daily Gold Bull 3X Shares	4/10/2014
NYSE Arca	Direxion Daily Gold Bear 3X Shares	4/10/2014
NYSE Arca	EGShares Blue Chip ETF	4/23/2014
NYSE Arca	iShares Yield Optimized Bond ETF	4/24/2014
NYSE Arca	Barclays OFI SteelPath MLP ETN	4/24/2014
NYSE Arca	db X-trackers Harvest MSCI All China Equity Fund	4/30/2014

附 1: 2014 年 3 月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	Mar				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	74910	35168.9	1566535	74391.7	198938	94663.3	4509865	216942
Bourse de Montreal	24111	176	580669	82833	153230	1121	1061636	150375
CBOE Future Exchange	NA	NA	3861118	NA	NA	NA	12391734	NA
Chicago Board Options Exchange	32810423	NA	NA	NA	106689556	NA	NA	NA
CME Group	10224070	1219700	57531562	5337000	30434134	3611780	145882076	13186700
Colombia SE	NA	NA	255	10178.5	NA	NA	255	10178.5
ICE Futures US	4583	543	3650512	432447	15202	1760	8490304	987267
International Securities Exchange	70725	NA	NA	NA	310129	NA	NA	NA
MexDer	4311	1700.38	149602	58537.7	10638	4280.24	238229	94908.9
NASDAQ OMX (US)	76805	NA	NA	NA	246399	NA	NA	NA
NYSE Euronext (US)	1612670	NA	NA	NA	2965535	NA	NA	NA
Asia - Pacific								
ASX Derivatives Trading	713869	37460.1	54929	567.57	2086739	108243	78500	813.2
ASX SFE Derivatives Trading	47940	6425	1387254	177949	141446	18637.8	2504844	324658
Bombay SE	33022114	10875900	128070	42061.8	93068038	29755100	355961	113070
Bursa Malaysia Derivatives	408	NA	201102	17894	734	NA	582465	51566
China Financial Futures Exchange	NA	NA	17011928	10850500	NA	NA	41507940	27282100
Hong Kong Exchanges	1560572	1141490	4402092	2840420	4386353	3208080	12404568	8121390
Korea Exchange	36077686	457779000 0	3579620	455063000	116300024	147309000 00	10363166	1.316E+0 9

National Stock Exchange India	71190421	23070000	7974099	2554640	208073032	65077800	22961545	7003640
New Zealand	NA	NA	0	0	NA	NA	0	0
Osaka SE	3690213	NA	21973087	96776700	11821946	NA	62222670	21590000 0
Singapore Exchange	734077	NA	8405835	NA	2208157	NA	23395126	NA
TAIFEX	9691396	4204610	2957114	3715730	24397916	10461500	7824913	9766730
Thailand Futures Exchange	5837	NA	361904	NA	13210	NA	1155075	NA
Tokyo SE Group	NA	NA	NA	NA	47987	NA	3313230	35271300
Europe - Africa - Middle East								
Athens Derivatives Exchange	19938	40.45	274561	598.29	52479	106.5	822335	1722.65
BME Spanish Exchanges	488868	5055.14	803568	60232.7	1871991	18883.7	2371624	178594
Borsa Istanbul	322	104.17	537336	27296.3	562	118.04	1831357	87846.8
Budapest SE	0	0	47777	8167.8	0	0	107560	19448.6
EUREX	29894582	1118180	39547949	1802290	89364380	3208940	89134793	4247120
ICE Futures Europe								
Johannesburg SE	305766	2076.33	2352815	740098	874473	6238.98	4485318	1457090
Moscow Exchange	3962012	329022	28312610	2294900	13329867	1199790	67548405	5956820
NYSE.Liffe Europe								
OMX Nordic Exchange	2037651	10354.9	2690911	38559.6	5131602	31073.1	7889845	116429
Oslo Børs	72170	274.89	250936	955.1	217636	787.26	811857	2974.94
Tel Aviv SE	4041404	NA	4548	NA	12399956	NA	11968	NA
Wiener Börse	110	0.1	51681	2343.5	2164	1.04	59209	2709.56

附 2: 2014 年 3 月份各交易所 ETF 交易量

Exchange	Feb		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
Americas			
BM&FBOVESPA	15	1655.3	126.08
Colombia SE	5	83773.44	0.18
Lima SE	3	30.6	0.02
Mexican Exchange	471	86498	99406
NASDAQ OMX	129	633449.65	24231.79

NYSE Euronext (US)	1424	387079.78	15849.88
Santiago SE	105	3460	0.39
TMX Group	435	6083.67	477.68
Asia - Pacific			
Australian SE	75	718.83	NA
BSE India	35	1263.62	46.44
Bursa Malaysia	6	1.7	0.2
Hong Kong Exchanges	119	55722.37	209.22
Indonesia SE	6	520.04	4.84
Japan Exchange Group - Osaka	NA	NA	NA
Japan Exchange Group - Tokyo	178	2616878.58	NA
Korea Exchange	149	14491659	2259.51
National Stock Exchange India	36	10913.05	204.93
New Zealand Exchange	5	3.97	0.39
Shanghai SE	51	35148.33	512
Shenzhen SE	33	17773.15	248.22
Singapore Exchange	89	156.7	NA
Taiwan SE Corp.	21	23355.51	126.78
The Stock Exchange of Thailand	17	358.08	5.25
Europe - Africa - Middle East			
Athens Exchange	3	1.47	0.2
BME Spanish Exchanges	72	723.08	0
Borsa Istanbul	17	324.73	24.28
Budapest SE	1	61.41	0.05
Deutsche Börse	1009	10977.1	209.95
Irish SE	1	0.81	0.06
Johannesburg SE	41	4438.67	11.79
Ljubljana SE	0	0	0
London SE Group	NA	NA	NA
Luxembourg SE	136	1	0
NASDAQ OMX Nordic Exchange	55	1086.4	41.45
NYSE Euronext (Europe)	NA	NA	NA
Oslo Børs	67	2833.12	15.79
Saudi Stock Exchange - Tadawul	3	1.43	0.11
SIX Swiss Exchange	790	6993.69	79.44
Warsaw SE	NA	NA	NA
Wiener Börse	20	0.6	0.05

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