

# 国际指数动态

( 2014 年 11 月 )

## 国际指数动态（201411）

一、 指数动态及综述 .....	2
1. 绿色投资逐渐兴起 .....	2
A) Barclays 与 MSCI 发布绿色债券指数系列 .....	2
B) Stoxx 授权欧洲 ESG 优选 30 指数于 JP MORGAN .....	2
2. 其他动态及规则变更 .....	3
A) S&P DJI 发布巴西行业 GDP 加权指数 .....	3
B) S&P DJI 授权新兴市场低波动优选指数于 Commerzbank .....	3
C) S&P DJI 与 KRX 签署关于韩国指数开发与授权协议 .....	3
D) 恒生与中证发布 AH 精明指数 .....	4
二、 指数衍生品动态及综述 .....	4
1. 美国市场 11 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) 衍生品类 ETF .....	5
F) ETN 与 ETC .....	5
2. 美国市场 11 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) 衍生品类 ETF .....	6
F) ETN 与 ETC .....	6
3. DEUTSCHE BÖRSE XETRA 11 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单 .....	6
4. NYSE 与 NASDAQ 11 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单 .....	6
附 1:2014 年 10 月份各交易所股指衍生品成交量 .....	8
附 2:2014 年 10 月份各交易所 ETF 交易量 .....	9

## 一、指数动态及综述

### 1. 绿色投资逐渐兴起

人口与环境不断增长的压力推动绿色投资快速发展。据联合国人口司估计，截止到 2050 年，世界人口将超过 90 亿，发展中国家城镇化率与生活水平的提升将带动对能源、交通、饮用水需求不断增长。若按照现有情况估算，至 2050 年，能源需求较现在将增长 85%，带来 4-6℃ 的全球平均气温变化，负面影响不可估计，绿色发展势在必行。

绿色投资规模不断上升，绿色基金加速发展。清洁能源投资 2011 年达到 2570 亿美元，为 2004 年的六倍，用于森林保护和再生的投资每年超过 640 亿美元。绿色投资基金最早出现于十九世纪八十年代，初期规模较小，直至 2000 年才开始快速发展。据 SRI 统计，2007 年至 2010 年，美国 ESG 基金数量从 263 只增加到 493 只，资产管理规模由 2020 亿美元增长至 5690 亿美元。

绿色投资指数相继推出，种类不断完善。MSCI 关注温室气体排放，虽大部分国家暂未对温室气体排放做出硬性规定，但持续增长的环境压力可能迫使出台相关限制。MSCI 相继发布低碳指数与非化石燃料指数，为投资者规避“碳排放”风险提供工具。MSCI 与 Barclays 合作推出绿色债券指数系列，进一步丰富投资者选择。FTSE 关注环境保护技术的应用，发布环境市场指数系列，依据环境技术业务占比不同，分为环境技术指数和环境机遇指数，提供不同暴露水平选择。

#### A) Barclays 与 MSCI 发布绿色债券指数系列

2014 年 11 月 13 日，Barclays 与 MSCI 联合发布绿色债券指数系列，衡量全球直接依赖环境相关收益的债券表现。绿色债券所融资金投资于以下领域：替代能源、能效改进、污染防治、水循环、绿色建筑，具体规则由 MSCI ESG 研究团队制定。

#### B) STOXX 授权欧洲 ESG 优选 30 指数于 JP MORGAN

2014年11月27日，STOXX宣布授权iStoxx Europe ESG Select 30指数于JP Morgan。该指数以STOXX Global ESG Leaders Index为母指数，选择高红利、低波动的公司作为成分股，历史回测显示低波动对ESG公司具有显著的收益增强作用。

## 2. 其他动态及规则变更

### A) S&P DJI发布巴西行业GDP加权指数

2014年11月17日，S&P DJI宣布发布巴西行业GDP加权指数，选择巴西最大的100家公司，采用行业GDP进行权重配置，用于反映巴西资本市场表现。

S&P DJI全球股票指数总监Michael表示：“巴西股票市场高度集中在金融与资源行业上，若采用传统的市值加权方式，指数将难以代表巴西整体经济表现。通过采用行业GDP加权，可以更有效反映行业动态变化与增长，是对巴西经济更为有效的反映。”

### B) S&P DJI授权新兴市场低波动优选指数于Commerzbank

2014年11月24日，S&P DJI宣布发布S&P Emerging Markets Low Volatility Select Index，继续扩展现有S&P DJI低波动和因子类指数，此指数已授权给Commerzbank用于开发相关产品。

### C) S&P DJI与KRX签署关于韩国指数开发与授权协议

2014年11月3日，S&P DJI和KRX宣布签署指数合作协议，S&P DJI被授权管理已发布KRX相关指数，包括KOSPI 200指数。S&P DJI将向海外投资者推广和授权KRX相应指数。后续，S&P DJI和KRX将在围绕以下三方面扩充KRX指数：

- 发布 KOSPI 200 内在价值指数。基于 GIVI 方法开发，采用非市值加权的内在价值指数。
- 发布一系列风格指数。
- 基于 GICS 行业分类标准，发布一系列韩国本土行业指数。

## D) 恒生与中证发布AH精明指数

2014年11月17日，恒生与中证宣布联合发布AH精明指数。AH精明指数覆盖50家在两地上市，并且为沪港通标的的中国公司，为全球投资者捕捉沪港通带来的投资机会，提供有效工具。

## 二、指数衍生品动态及综述

### 1. 美国市场 11 月新发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

#### A) 国别类 ETF

- **欧洲 ETF:** ALPS 发行了 1 只欧洲市场 ETF，跟踪 STOXX 欧洲 600 指数。

#### B) 主题类 ETF

- **新股 ETF:** First Trust 发行了 1 只国际新股 ETF，投向于全球 IPO 公司。
- **低碳 ETF:** SSgA 发行了 1 只低碳 ETF，跟踪 MSCI 全球低碳目标指数。
- **互联网 ETF:** FactorShares 发行了 1 只高科技 ETF，投向于专注网络安全的股票；Big Tree Capital 发行了 1 只电子商务 ETF，主要投向新兴市场与前沿市场电子商务领域。

#### C) 策略类 ETF

- **动量 ETF:** Cambria 发行了 1 只全球动量 ETF，主要采用动量和趋势因子选择交易所品种进行投资。

#### D) 固定收益类 ETF

- **综合债 ETF:** Global X 发行了 1 只中国债券 ETF, 投向政府、机构、国企发行的人民币债券; Market Vectors 发行了 1 只中国债券 ETF, 投资于中国银行间人民币债券; FlexShares 发行了 1 只美国公司债 ETF, 投向于投资级公司债券。
- **主动管理 ETF:** First Trust 发行了 2 只主动管理型债券 ETF, 分别投向于新兴市场本地货币债券与短久期抵押债券。

## E) 衍生品类 ETF

- **商品 ETF:** PowerShares 发行了 1 只主动管理型商品 ETF, 通过开曼群岛相关单位实现期货合约的配置, 可使投资者获得与持有股票基金一样的纳税税率。

## F) ETN 与 ETC

- 暂无

## 2. 美国市场 11 月拟成立 ETF、ETN 及 ETC 情况

### A) 国别类 ETF

- 暂无

### B) 主题类 ETF

- **行业 ETF:** Fidelity 拟发行 1 只不动产行业 ETF, 跟踪 MSCI 相应指数。
- **回购 ETF:** SSgA 拟发行 1 只回购 ETF, 投资于 S&P 500 中过去一年股份回购比例最高的 100 家公司。

### C) 策略类 ETF

- 暂无

### D) 固定收益类 ETF

- 暂无

#### E) 衍生品类 ETF

- 暂无

#### F) ETN 与 ETC

- 暂无;

### 3. Deutsche Börse Xetra 11 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单

产品名称	标的指数
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	无
PowerShares Global Buyback Achievers UCITS ETF	Nasdaq Global Buyback Achievers Index
SPDR BofA Merrill Lynch 0-5 Year EM USD Government Bond UCITS ETF	BofA Merrill Lynch 0-5 Year EM USD Government Bond ex-144a Index
Boost Silver 3x Leverage Daily ETP	NASDAQ Commodity Silver ER Index
Boost Gold 3x Short Daily ETP	NASDAQ Commodity Gold ER Index
Boost Natural Gas 3x Short Daily ETP	NASDAQ Commodity Natural Gas ER Index
Boost Natural Gas 3x Leverage Daily ETP	NASDAQ Commodity Natural Gas ER Index
Boost WTI Oil 3x Leverage Daily ETP	NASDAQ Commodity Crude Oil ER Index
Boost Silver 3x Short Daily ETP	NASDAQ Commodity Silver ER Index
Boost Gold 3x Leverage Daily ETP	NASDAQ Commodity Gold ER Index

### 4. NYSE 与 NASDAQ 11 月挂牌 ETF、ETC 及 ETN 名单

挂牌地	上市 ETF	上市日期
NYSE Arca	Cambria Global Momentum ETF	11/04/2014
Nasdaq	First Trust Emerging Markets Local Currency Bond ETF	11/05/2014

Nasdaq	First Trust Low Duration Mortgage Opportunities ETF	11/05/2014
Nasdaq	First Trust International IPO ETF	11/05/2014
Nasdaq	PowerShares DB Optimum Yield Diversified Commodity	11/07/2014
NYSE Arca	Market Vectors ChinaAMC China Bond ETF	11/11/2014
NYSE Arca	PureFunds ISE Cyber Security ETF	11/12/2014
NYSE Arca	Emerging Markets Internet & Ecommerce ETF	11/13/2014
Nasdaq	FlexShares Credit-Scored US Corporate Bond Index Fund	11/14/2014
NYSE Arca	Global X GF China Bond ETF	11/19/2014
NYSE Arca	SPDR MSCI ACWI Low Carbon Target ETF	11/26/2014



**附 1:2014 年 10 月份各交易所股指衍生品成交量**

Derivative Exchange	Oct				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	530891	89490.2	12989426	293965	2914708	441325	50181605	1304100
CBOE Future Exchange	NA	NA	7458697	NA	NA	NA	42951414	NA
Chicago Board Options Exchange	52860116	NA	NA	NA	346797467	NA	NA	NA
CME Group	19529275	2543470	73274891	6851780	108485105	13736600	481459582	44994600
Colombia SE	NA	NA	20	814.5	NA	NA	857	35761.7
ICE Futures US	7680	842	5167840	506312	62974	7188	34614395	3691190
International Securities Exchange	213692	NA	NA	NA	1368884	NA	NA	NA
MexDer	2926	1247.21	67798	28317.3	30969	12920.4	772780	326992
NASDAQ OMX (US)	130002	NA	NA	NA	931318	NA	NA	NA
NYSE Liffe (US)	NA	NA	NA	NA	5789328	NA	NA	NA
<b>Asia - Pacific</b>								
ASX Derivatives Trading	1222419	63378.3	4560	62.31	8049296	425660	227770	2481.66
ASX SFE Derivatives Trading	60933	8013.16	776501	102221	457626	61389.8	8113144	1072270
BSE India	53689437	21487800	79997	32168.8	389849897	145556000	1113102	399362
Bursa Malaysia Derivatives	619	NA	196081	17333	3195	NA	1761502	155863
China Financial Futures Exchange	NA	NA	15476036	11364400	NA	NA	149045413	10104300 0
Hong Kong Exchanges	1561822	1318690	4584513	3188870	13963017	10952700	39484265	26879500
Korea Exchange	43736221	539426000 0	3622379	446779000	386669045	497700000 00	31791368	40985600 00
National Stock Exchange India	78759336	30291900	7242848	2787790	743327694	269001000	81916438	29201400

New Zealand	NA	NA	40	3.95	NA	NA	116	11.53
Osaka SE	4984130	NA	31874604	106114000	36027239	NA	195417490	71847600 0
Singapore Exchange	438522	NA	9651357	NA	6445384	NA	81125582	NA
TAIFEX	17670268	7778090	4700788	6038640	119735449	53905900	32199555	42550100
Thailand Futures Exchange	14429	NA	1777421	NA	76094	NA	10533891	NA
Tokyo SE Group	NA	NA	NA	NA	47987	NA	3313230	35271300
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Athens Derivatives Exchange	26625	42.47	384239	596.73	193690	449.5	3006365	5752.77
BME Spanish Exchanges	766910	8053	1294541	88434	6247353	65382	8225518	623707
Borsa Istanbul	316	104.16	609790	37184.8	2171	645.13	5422658	309724
Budapest SE	0	0	25963	4546.41	0	0	276979	50125
EUREX	43295890	1486230	43109436	1936930	278871988	9987080	299225193	14130800
ICE Futures Europe	5770511	458248	2702567	4602	10039882	792965	6513952	15266
Johannesburg SE	232208	1767.09	1469825	486987	2561254	14494.5	13769061	4587660
Moscow Exchange	3118228	275132	22081842	1939700	35951171	3161130	205680713	18081900
OMX Nordic Exchange	2464335	18507	4256694	60647.6	16082915	112718	27120740	401857
Oslo Børs	159782	773.27	386334	1869.58	775830	3358.05	2761675	11879.2
Tel Aviv SE	4326613	NA	2825	NA	38637950	NA	46446	NA

## 附 2:2014 年 10 月份各交易所 ETF 交易量

Exchange	Oct		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
<b>Americas</b>			
BM&FBOVESPA	16	4397.78	216984
Colombia SE	19	89364.89	0.19
Lima SE	3	11.5	0.02
Mexican Exchange	484	100739	100739
NASDAQ OMX	148	934822.93	35262.11
NYSE	1478	622666.98	26909.67
Santiago SE	105	13148	0.42
TMX Group	465	10120.9	816.88
<b>Asia - Pacific</b>			

Australian SE	79	1101	NA
BSE India	37	660	67
Bursa Malaysia	6	0.83	0.12
Hong Kong Exchanges	121	91232.9	268.7
Indonesia SE	7	3295.74	3.18
Japan Exchange Group - Osaka	NA	NA	NA
Japan Exchange Group - Tokyo	181	4006232.13	NA
Korea Exchange	166	1586458	2875.52
National Stock Exchange India	40	8711.16	211.87
New Zealand Exchange	5	8.24	0.45
Shanghai SE	59	65934.53	582
Shenzhen SE	37	28770.98	213.27
Singapore Exchange	89	207.44	NA
Taiwan SE Corp.	23	37069.17	203.63
The Stock Exchange of Thailand	17	763.45	5.16
<b>Europe - Africa - Middle East</b>			
Athens Exchange	3	2.95	0.17
BME Spanish Exchanges	72	1011.27	0
Borsa Istanbul	15	270.5	19.56
Budapest SE	1	0	0.01
Deutsche Börse	1031	18883.9	309.55
Euronext	621	12890	213.1
Irish SE	1	0.58	0.03
Johannesburg SE	44	7057.55	17.82
Ljubljana SE	NA	NA	NA
Luxembourg SE	147	0	0
NASDAQ OMX Nordic Exchange	43	1935.6	78.28
Oslo Børs	46	6691.48	37.77
Saudi Stock Exchange - Tadawul	3	10.28	0.1
SIX Swiss Exchange	827	9055.24	88.13
Wiener Börse	20	0.16	0.04

## 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