

# 国际指数动态

(2020年4月)

## 国际指数动态（202004）

一、 指数动态 .....	2
1. FTSE RUSSELL 发布债券指数系列 .....	2
2. S&P DOW JONES 发布 RISKCASTING 指数系列 .....	2
3. STOXX 发布 1 条电子游戏和 1 条医疗保健主题指数 .....	3
二、 指数衍生品动态 .....	3
1. 国际市场 4 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况 .....	3
A) 国别类 ETF .....	3
B) 规模类 ETF .....	4
C) 策略类 ETF .....	4
D) 固定收益类 ETF .....	4
E) 主动管理类 ETF .....	5
2. 国际市场衍生品交易量 .....	6
A) 2020 年 3 月份各交易所股指衍生品成交量 .....	6
B) 2020 年 3 月份各交易所 ETF 成交量 .....	7
C) 2020 年 3 月份各交易所 ETF 衍生品成交量 .....	9



### 3. STOXX 发布 1 条电子游戏和 1 条医疗保健主题指数

2020 年 4 月 8 日，STOXX 发布 1 条电子游戏主题指数，名称为 STOXX Video Gaming & eSports Index。该指数以 STOXX Developed and Emerging Markets Total Market Index 成份股和特定中国市场股票为样本空间，选择从事电子游戏、电子竞技相关领域的上市公司股票构建指数。

2020 年 4 月 8 日，STOXX 发布 1 条医疗保健主题指数，名称为 STOXX Health & Weight Loss Index。该指数以 STOXX Developed and Emerging Markets Total Market Index 成份股和特定中国市场股票为样本空间，选择从事运动减肥相关领域的上市公司股票构建指数。

## 二、指数衍生品动态

2020 年 4 月，美国市场新发 ETF 共 14 只。从标的资产来看，新发产品覆盖股票、债券；从策略类型来看，除主流的多因子策略、波动率策略外，还有下行保护策略 ETF。此外，低费率 ETF 持续发行，本月 The Bank of New York Mellon 发行 8 只产品均为低费率 ETF，其中两只产品均为零费率。

### 1. 国际市场 4 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

#### A) 国别类 ETF

- **发达市场 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 1 只除美国市场外的发达市场 ETF，名称为 BNY Mellon International Equity ETF (BKIE)，费率为 0.04%，在纽交所上市。BKIE 选取除美国市场外的发达市场的大市值股票构建投资组合，其跟踪指数为 Morningstar Developed Markets ex-US Large Cap Index，采用市值加权，调仓频率为季度调样。
- **新兴市场 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 1 只新兴市场 ETF，名称为 BNY Mellon Emerging Markets Equity ETF (BKEM)，费率为 0.11%，

在纽交所上市。BKEM 选取 26 个新兴市场的大市值股票构建投资组合，其跟踪指数为 Morningstar Emerging Markets Large Cap Index，采用市值加权，调仓频率为季度调样。

## B) 规模类 ETF

- **宽基 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 3 只宽基 ETF，名称分别为 BNY Mellon US Large Cap Core Equity ETF (BKLC)、BNY Mellon US Mid Cap Core Equity ETF (BKMC) 与 BNY Mellon US Small Cap Core Equity ETF (BKSE)，费率分别为 0.00%、0.04% 与 0.04%，均在纽交所上市。其中 BKLC、BKMC、BKSE 分别跟踪代表美国大盘、中盘和小盘的宽基指数，指数名称为 Morningstar U.S. Large Cap Index、Morningstar U.S. Mid Cap Index 和 Morningstar US Small Cap Index。三只 ETF 均采用市值加权，调仓频率为季度调样。

## C) 策略类 ETF

- **多因子 ETF:** Blackrock 发行 3 只多因子 ETF，名称分别为 iShares Factors U.S. Blend Style ETF (STLC)、iShares Factors U.S. Mid Blend Style ETF (STMB)、iShares Factors U.S. Small Blend Style ETF (STSB)，费率分别为 0.25%、0.30% 与 0.35%，均在 Cboe 交易所上市。其中 STLC、STMB 与 STSB 分别以 Russell 1000、Russell Midcap 与 Russell 2000 指数成份股为样本空间，结合动量、质量、价值、规模、低波动五个因子构建股票组合，加权方式为因子得分加权，调仓频率为月度调样。

## D) 固定收益类 ETF

- **投资级债券 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 1 只投资级债券 ETF，名称为 BNY Mellon Core Bond ETF (BKAG)，费率为 0.00%，在纽交所上市。BKAG 主要投资于美国投资级债券，包括国债、CMBS、ABS

和企业债，其跟踪指数为 Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Bond Index，采用市值加权，调仓频率为月度调样。

- **投资级企业债 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 1 只投资级企业债 ETF，名称为 BNY Mellon Short Duration Corporate Bond ETF (BKSB)，费率为 0.06%，在纽交所上市。BKSB 主要投资于美元计价且剩余到期期限在 1 至 5 年内的投资级企业债，其跟踪指数为 Bloomberg Barclays U.S. Corporate BBB 1-5 Year Index，采用市值加权，调仓频率为月度调样。
- **高收益企业债 ETF:** The Bank of New York Mellon 发行 1 只高收益企业债 ETF，名称为 BNY Mellon High Yield Beta ETF (BKHY)，费率为 0.22%，在纽交所上市。BKSB 主要投资于美元计价的高收益企业债，其跟踪指数为 Bloomberg Barclays US Corporate High Yield Index，采用市值加权，调仓频率为月度调样。

## E) 主动管理类 ETF

- **下行保护 ETF:** Innovator 发行 2 只下行保护 ETF，名称分别为 Innovator Nasdaq-100 Power Buffer ETF April (NAPR)和 Innovator Russell 2000 Power Buffer ETF April (KAPR)，费率均为 0.79%，均在 Cboe 交易所上市。两只 ETF 均以 2020 年 4 月 1 日至 2021 年 3 月 31 日为考察期，NAPR 保护 Nasdaq 100 Index 考察期内-15%以内的损失，收益上限为 15.06%；KAPR 保护 Russell 2000 Index 考察期内-15%以内的损失，收益上限为 17.95%。
- **波动率预测 ETF:** First Trust 发行 1 只波动率预测 ETF，名称为 First Trust Horizon Managed Volatility Small/Mid ETF (HSMV)，费率为 0.80%，在纽交所上市。HSMV 以在纽交所上市的中小盘股票为样本空间，通过量化模型预测股票未来波动率，并依据预测的股票未来波动率进行股票筛选，加权方式为波动率加权。

## 2. 国际市场衍生品交易量

### A) 2020年3月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	March				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 Balcão	6762328	39183.35	203801372	750121.13	18509744	142616.41	618958294	3106453.6
Bolsa Mexicana de Valores	551	9.23	127880	2005.95	2536	55.6	194044	3531.75
Bolsa de Valores de Colombia	NA	NA	13477	9.23	NA	NA	23649	21.08
Bourse de Montreal	2440	NA	1844475	NA	4836	NA	2919362	NA
CME Group	26336965	3789005.33	168391801	15861277.6	62344920	10506941.7	340547385	37781850.6
Cboe Futures Exchange	NA	NA	7545486	NA	NA	NA	20514187	NA
Cboe Global Markets	71692322	NA	NA	NA	165079841	NA	NA	NA
MIAX Exchange Group	22068	51.85	NA	NA	266586	585.02	NA	NA
Matba Rofex	331	0.06	230606	139.33	2325	0.13	813548	719.01
Nasdaq - US	355487	NA	NA	NA	1001581	NA	NA	NA
<b>Asia - Pacific</b>								
ASX Australian Securities Exchange	1473002	52263	3854993	310684.5	3703911	151877.06	6277051	583107.99
Bursa Malaysia Derivatives	289	0.03	455535	7008.8	1577	0.16	949543	15974.83
China Financial Futures Exchange	1188744	1524.53	8529377	1269364.17	2537659	3082.34	18489412	2852402.94
Hong Kong Exchanges and Clearing	4691085	253071.35	15747296	1256417.24	11616057	932049.3	34533571	3132918.34

Japan Exchange Group	3920436	NA	77657769	2888705.19	10299890	NA	142977927	5516124.3
Korea Exchange	74404601	3823114.08	25869721	906868.63	239432732	13703668.7	47726519	1836158.36
National Stock Exchange of India	360803570	2909071.06	15656129	122299.55	1308314213	12206683.3	30062388	272574.31
Singapore Exchange	1261481	NA	25200446	NA	3042853	NA	57294198	NA
Taiwan Futures Exchange	24435489	412744.86	19629427	719383.78	57693787	1057875.36	33355625	1370392.9
Thailand Futures Exchange	169205	NA	8988952	NA	490335	NA	18164084	NA
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Athens Stock Exchange	2703	9.55	48576	156.17	11880	54.85	140987	614.07
BME Spanish Exchanges	135182	1248.07	1231023	71501.65	706913	7180.88	2622399	192701.39
Borsa Istanbul	28277	55.99	13382893	22992.71	150246	341.82	30188177	62216.01
Budapest Stock Exchange	NA	NA	167391	185.51	NA	NA	312749	393.96
Deutsche Boerse AG	68804103	2213532.52	120242745	4215726.57	160480659	5915874.66	211907174	9184232.03
Euronext	2284058	112100.33	6867900	395788.31	6652385	384947.61	15095373	1037087.84
Johannesburg Stock Exchange	1186451	8206.02	2528372	35835.83	1495719	12691.87	3903735	70124.4
Moscow Exchange	1730770	3578.21	24672402	46915.96	5917898	16072.42	47723803	113105
Nasdaq Nordic and Baltics	1011815	15153.4	7983511	116435.06	3095288	54311.22	15919288	264756.78
Tehran Stock Exchange	0	0	76	0.04	NA	NA	316	0.13
Tel-Aviv Stock Exchange	2796168	106105.19	NA	NA	7692427	346458.35	NA	NA
Warsaw Stock Exchange	56297	220.63	1147399	8614.48	108575	497.23	1855134	16187.42

**B) 2020年3月份各交易所ETF成交量**

Exchange	March		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
<b>Americas</b>			



B3 - Brasil Bolsa Balcão	22	10120.59	3942.15
Barbados Stock Exchange	0	0	0
Bolsa Mexicana de Valores	21	1187.5	60.45
Bolsa de Comercio de Santiago	265	24.97	0.33
Bolsa de Valores de Colombia	2	44.43	0.35
Bolsa de Valores de Lima	80	40.57	0.57
Bolsa de Valores de Panama	0	0	0
Cboe Global Markets	351	1179945.48	99661.17
Nasdaq - US	402	2499221.95	130159.28
TMX Group	885	25217.64	2781
<b>Asia - Pacific</b>			
ASX Australian Securities Exchange	167	5883.72	NA
Bursa Malaysia	18	3.86	1.05
Hochiminh Stock Exchange	3	59.18	5120
Hong Kong Exchanges and Clearing	131	24088.49	975.14
Japan Exchange Group	245	131161.83	NA
Korea Exchange	451	123776.85	38392.92
NZX Limited	31	264.79	103.66
National Stock Exchange of India	79	862.5	3268.88
Philippine Stock Exchange	1	4.57	10.63
Shanghai Stock Exchange	189	81421.04	19233.53
Shenzhen Stock Exchange	88	35035.98	8942.09
Taipei Exchange	101	2499.52	65.55
Taiwan Stock Exchange	120	17990.34	5584.78
The Stock Exchange of Thailand	17	27.76	25.34
<b>Europe - Africa - Middle East</b>			
Astana International Exchange	7	0	0
Athens Stock Exchange	1	1.54	0.16
BME Spanish Exchanges	5	504.75	0
Beirut Stock Exchange	0	0	0
Boerse Stuttgart	1740	4059.57	116.43
Borsa Istanbul	7	168.4	72.92
Botswana Stock Exchange	3	2.41	8
Bucharest Stock Exchange	1	0.47	0.82
Budapest Stock Exchange	1	0.39	0.28
Bulgarian SE	12	0.51	0.26
CEESG - Prague	3	0.02	0
CEESG - Vienna	119	16.33	1.55
Deutsche Boerse AG	1500	40933.41	1947.23
Euronext	1252	17558.99	886.1
Iran Fara Bourse Securities Exchange	23	762.79	94.38
Johannesburg Stock Exchange	73	1352.42	76.01

Kazakhstan Stock Exchange	3	0.21	0.06
LSE Group	2941	56226.13	2520.13
Luxembourg Stock Exchange	78	0	0
Moscow Exchange	36	283.48	554.01
Namibian Stock Exchange	9	21.98	0.03
Nasdaq Nordic and Baltics	14	2360.44	234.9
Nigerian Stock Exchange	10	1.56	0.03
SIX Swiss Exchange	1449	21939.06	262.79
Saudi Stock Exchange (Tadawul)	5	22.62	2.24
Stock Exchange of Mauritius	4	2.52	0.01
Tehran Stock Exchange	17	1235.67	150
Tel-Aviv Stock Exchange	571	6692.05	544.85
The Egyptian Exchange	1	0	10
Warsaw Stock Exchange	7	36.18	24.24

### C 2020年3月份各交易所ETF衍生品成交量

Derivative Exchange	March				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	15013975	2308772.56	0	0	43649949	8865902.58	NA	NA
Bolsa Mexicana de Valores	0	0	0	0	NA	NA	NA	NA
Bourse de Montreal	1207816	NA	0	NA	2466860	NA	NA	NA
Cboe Global Markets	97721446	NA	NA	NA	218887438	NA	NA	NA
MIAX Exchange Group	35210582	657912.8	NA	NA	75625928	1540217.66	NA	NA
Nasdaq - US	102365335	NA	NA	NA	242404741	NA	NA	NA
<b>Asia - Pacific</b>								
Hong Kong Exchanges and Clearing	172721	1491.29	3185	30.45	559190	5196.96	8356	82.89

Japan Exchange Group	74246	NA	NA	NA	263486	NA	NA	NA
Taiwan Futures Exchange	15242	148.52	129769	2053.16	38290	361.38	274407	4116.66
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Borsa Istanbul	NA	NA	0	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      号陆家嘴世纪金融广  
场    号楼    层

邮编：

电话：

传真：

电邮：