

国际指数动态

(2020年12月)

国际指数动态（202012）

一、 指数动态	2
(一) INDXX 发布 4 条国家宽基指数、美国行业指数系列以及机器人与人工智能主题指数系列	2
(二) MVIS 发布 1 条氢经济主题指数	3
二、 指数衍生品动态	3
(一) 国际市场 12 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况	3
1. 主题类 ETF	3
2. 策略类 ETF	4
3. 固定收益类 ETF	4
4. 主动管理类 ETF	5
(二) 国际市场衍生品交易量	5
1. 2020 年 11 月份各交易所股指衍生品成交量	5
2. 2020 年 11 月份各交易所 ETF 成交量	7
3. 2020 年 11 月份各交易所 ETF 衍生品成交量	8

一、指数动态

本月，Indxx 发布 4 条国家宽基指数，旨在分别反映加拿大、法国、德国以及英国证券市场的整体表现。同时，Indxx 发布美国行业指数系列，分别反映美国市场 10 个行业类别上市公司的整体表现。Indxx 还发布机器人与人工智能主题指数系列，分别反映全球以及美国市场中与机器人、工业自动化以及人工智能相关的上市公司的整体表现。MVIS 发布 1 条氢经济主题指数，该指数在全球范围内选取与氢能源生产、燃料电池以及相应基础设施相关的公司作为样本，旨在反映全球市场中与氢经济主题相关的上市公司的整体表现。

(一) Indxx 发布 4 条国家宽基指数、美国行业指数系列以及机器人与人工智能主题指数系列

2020 年 12 月 11 日，Indxx 发布 4 条国家宽基指数，名称分别为 Indxx Canada Index、Indxx France Index、Indxx Germany Index、Indxx United Kingdom Index。四条指数分别选取在加拿大、法国、德国与英国上市的公司证券作为成份股，旨在反映对应国家证券市场的整体表现。

同时，Indxx 发布美国行业指数系列。指数系列从美国证券市场分别选取 10 个行业对应的证券作为成份股，旨在反映美国不同行业类别上市公司的整体表现。具体的指数名称如下：

Indxx US Basic Materials Index
Indxx US Communication Services Index
Indxx US Consumer Discretionary Index
Indxx US Consumer Staples Index
Indxx US Energy Index
Indxx US Financials Index
Indxx US Healthcare Index
Indxx US Industrials Index

Indxx US Technology Index

Indxx US Utilities Index

Indxx 还发布机器人与人工智能主题指数系列，分别选取全球及美国市场中与机器人、工业自动化以及人工智能相关的公司证券作为指数样本，旨在反映机器人与人工智能主题相关上市公司的整体表现。具体的指数名称如下：

Indxx Global Junior Robotics & AI Index

Indxx US Junior Robotics & AI Index

(二) MVIS 发布 1 条氢经济主题指数

2020 年 12 月 22 日，MVIS 发布 1 条氢经济主题指数，名称为 MVIS Global Hydrogen Economy Index。指数在全球范围内选取与氢能源生产、燃料电池以及相应基础设施相关的公司证券作为样本，旨在反映全球市场中与氢经济主题相关的上市公司的整体表现。指数采用自由流通股本加权，调样频率为季度。

二、指数衍生品动态

2020 年 12 月，美国市场新发 ETF 共 13 只。从标的资产来看，新发产品覆盖股票、债券及衍生品。主动管理类 ETF 分别新发 4 只，是主要的发行类型。

(一) 国际市场 12 月发行 ETF、ETN 及 ETC 情况

1. 主题类 ETF

- **新能源经济 ETF:** Blue Horizon 发行 1 只新能源 ETF，名称为 Blue Horizon BNE ETF (BNE)，费率为 0.87%，在纽交所上市。BNE 从美国市场中选取与电动汽车、能源储存、能源生产、高性能材料等相关的公司证券作为成份股，反映与新能源经济相关的上市公司的整体表现。

- **社会正义 ETF:** Adasina 发行 1 只社会正义 ETF, 名称为 Adasina Social Justice All Cap Global ETF (JSTC), 费率为 0.89%, 在纽交所上市。JSTC 从美国市场中选取在种族、性别、气候等社会方面评价较好的公司证券作为成份股, 反映具有良好社会正义价值观的上市公司的整体表现。
- **循环利用 ETF:** Direxion 发行 1 只循环利用 ETF, 名称为 Direxion World Without Waste ETF (WWOW), 费率为 0.50%, 在纽交所上市。WWOW 从全球市场中选取与可持续能源、资源回收、共享平台等相关的公司证券作为成份股, 反映循环利用主题相关的上市公司的整体表现。

2. 策略类 ETF

- **多因子 ETF:** Dimensional 发行 1 只多因子 ETF, 名称为 Dimensional International Core Equity Market ETF (DFAI), 费率为 0.36%, 在纽交所上市。DFAI 从全球 25 个证券市场中, 根据价值、规模以及盈利因子的综合评分, 选取多因子得分表现较好的股票作为最终持仓。
- **基本面 ETF:** Distillate 发行 1 只基本面 ETF, 名称为 Distillate International Fundamental Stability & Value ETF (DSTX), 费率为 0.55%, 在纽交所上市, DSTX 从全球市场 (除美国) 中, 根据财务负债、历史现金流波动率、自由现金流收益率等指标, 选取财务基本面表现较好的股票作为最终持仓。

3. 固定收益类 ETF

- **高收益债 ETF:** Invesco 发行 1 只高收益债 ETF, 名称为 Invesco High Yield Bond Factor ETF (IHYP), 费率为 0.39%, 在 NASDAQ 上市。IHYP 从美国债券市场的高收益债中, 根据价值、低波、利差等因子的综合评分, 选取多因子得分表现较好的债券作为最终持仓。
- **公司债 ETF:** VanEck 发行 2 只公司债 ETF, 名称分别为 VanEck Vectors Moody s Analytics IG Corporate Bond ETF (MIG), VanEck Vectors Moody s

Analytics BBB Corporate Bond ETF (MBBB)，费率分别为 0.20%、0.25%，均在 Cboe 上市。MIG 与 MBBB 分别从美国债券市场的投资级公司债与 BBB 级公司债中，基于 Moody s Analytics 的前瞻信用风险评价模型，选取信用评价较好的债券作为最终持仓。

- **市政债 ETF:** Avantis 发行 1 只市政债 ETF，名称为 Avantis Core Municipal Fixed Income ETF (AVMU)，费率为 0.15%，在纽交所上市。AVMU 从全球债券市场的市政债中，根据国家、行业类别、信用评级、债券久期等因素进行评价，选取综合评价较好的债券作为最终持仓。

4. 主动管理类 ETF

- **下行保护 ETF:** TrueMark 发行 1 只下行保护 ETF，名称为 TrueShares Structured Outcome (December) ETF (DECZ)，费率为 0.79%，在 Cboe 上市。NVMZ 以 2020 年 12 月 1 日至 2021 年 11 月 30 日为考察期，保护 S&P 500 Index 考察期内-8%至-12%范围内的损失，且收益不设上限。
- **风险管理 ETF:** TrimTabs 发行 2 只风险管理 ETF，名称为 TrimTabs Donoghue Forlines Risk Managed Innovation ETF (DFNV)，费率为 0.69%，在 Cboe 上市。DFNV 从美国权益市场中选取研发支出较高的股票，并加入部分固定收益的持仓降低风险，从而达到对持仓组合整体风险进行管理的目标。
- **动态对冲 ETF:** Swan 发行 1 只动态对冲 ETF，名称为 Swan Hedged Equity US Large Cap ETF (HEGD)，费率为 0.87%，在 Cboe 上市。HEGD 主要持有跟踪 S&P 500 的 ETF，同时使用 10%-15%的资产投资于以 S&P 500 为标的的期权，通过买入看跌期权对冲下行风险或卖出看涨期权增强收益。

(二) 国际市场衍生品交易量

1. 2020年11月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	November				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								
B3 - Brasil Bolsa Balcão	5407463	44434.17	288867931	1188383.59	59870868	361435.49	2657165807	11645465.22
Bolsa Mexicana de Valores	178	3.44	30995	618.4	7280	135.6	534038	9245.06
Bolsa de Valores de Colombia	NA	NA	2525	2.15	NA	NA	72522	58.84
Bourse de Montreal	0	NA	385373	NA	30816	NA	7170243	NA
CME Group	11588306	2205570.55	95784515	9978300.9	168978833	28990544.08	1157224154	121331678.3
Cboe Futures Exchange	NA	NA	3503081	NA	NA	NA	47382847	NA
Cboe Global Markets	33250021	NA	NA	NA	425378074	NA	NA	NA
ICE Futures US	NA	NA	3310806	252461	NA	NA	54399323	3234518
MIAX Exchange Group	0	0	NA	NA	266790	585.92	NA	NA
Matba Rofex	530	0.02	127708	111.65	8649	0.37	2296836	1941.67
Nasdaq - US	233931	NA	NA	NA	3126801	NA	NA	NA
Asia - Pacific								
ASX Australian Securities Exchange	403108	18488.41	1036511	120396.55	7687134	315631.89	16909023	1661784.98
Bursa Malaysia Derivatives	885	0.1	294771	5669.12	8126	0.8	3246188	56816.02
Hong Kong Exchanges and Clearing	2778185	179393.58	8506658	800445.05	33813547	2273247.86	104749133	9318965.45
India International Exchange	10198284	NA	738763	NA	22900322	NA	2608655	NA
Japan Exchange Group	2724125	NA	27670671	1334521.26	21374320	NA	306188151	12481031.76
Korea Exchange	65364504	4841496.53	11746091	542407.58	663241720	40147319.54	138343847	5531598.48
National Stock Exchange of India	661486860	7053430.58	10516563	111667.65	5936650611	51770868.19	123017489	1050432.71
Singapore Exchange	682906	NA	14154856	NA	8011683	NA	172054099	NA
Taiwan Futures Exchange	16860547	395651.68	8269191	431313.28	182909126	3650839.47	103072916	4574975.23
Thailand Futures Exchange	270639	NA	6621005	NA	1507052	NA	51703123	NA
Europe - Africa - Middle East								
Athens Stock Exchange	3300	12.08	41126	155.16	33381	130.79	379298	1454.6
BME Spanish Exchanges	265034	2391.41	623261	46715.99	2123749	19167.54	7063795	491059.91
Borsa Istanbul	23498	40.47	8710061	15695.85	329835	654.28	94175640	172457.3
Budapest Stock Exchange	0	0	73663	89.62	NA	NA	683828	815.49
Deutsche Boerse AG	43178244	1466193.44	39696618	1892108.11	411744323	14425250.06	543149490	24444479.22
Johannesburg Stock Exchange	1014146	2025.06	1176662	222830.55	9100337	21641.96	9732836	2730499.63
Moscow Exchange	168189	1906.12	741540	17833.84	3434041	30996.88	12618370	239203.3
Nasdaq Nordic and Baltics	1453460	3507.63	13990671	33647.43	17002047	42106.53	157765198	367723.59
Tel-Aviv Stock Exchange	2532078	109312.16	NA	NA	25733432	1876154.92	NA	NA
Warsaw Stock Exchange	37192	173.78	568822	5220.92	345021	1549.5	5662839	49717.84

2. 2020年11月份各交易所ETF成交量

Exchange	November		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
Americas			
B3 - Brasil Bolsa Balcão	29	5587.98	4116.62
Barbados Stock Exchange	0	0	0
Bolsa Mexicana de Valores	NA	661.03	34.55
Bolsa de Comercio de Santiago	265	31.78	0.69
Bolsa de Valores de Colombia	2	33.07	0.21
Bolsa de Valores de Lima	98	25.52	0.36
Bolsa de Valores de Panama	0	0	0
Cboe Global Markets	412	494594.73	36836.63
Jamaica Stock Exchange	0	0	0
Nasdaq US	407	1605183.28	70895.87
TMX Group	957	8900	1062.6
Asia - Pacific			
ASX Australian Securities Exchange	169	3237.5	0
Bursa Malaysia	20	6.4	1.47
Hochiminh Stock Exchange	6	57.66	4261
Hong Kong Exchanges and Clearing	144	16079.52	603.15
Japan Exchange Group	259	58165.73	NA
Korea Exchange	463	78941.17	18353.4
NZX Limited	35	138.79	76.96
National Stock Exchange of India	1	1.41	3.23
Philippine Stock Exchange	235	69302.54	15490.39
Shanghai Stock Exchange	110	30904.53	6306.41
Shenzhen Stock Exchange	31	340.87	NA
Taipei Exchange	99	1244.14	61
Taiwan Stock Exchange	117	6729.93	1785.2
The Stock Exchange of Thailand	12	21.25	16.86
Europe - Africa - Middle East			
Athens Stock Exchange	1	0.38	0.06
BME Spanish Exchanges	5	342.72	0
Boerse Stuttgart	3508	2304.32	56.45
Borsa Istanbul	13	386.36	290.65
Bucharest Stock Exchange	1	0.16	0.36
Budapest Stock Exchange	1	0.22	0.14

Bulgarian SE	12	0.03	0.04
Deutsche Boerse AG	1572	26166.23	1213.67
Euronext	1284	12866.35	541.62
Iran Fara Bourse Securities Exchange	30	2274.79	328.29
Johannesburg Stock Exchange	78	713.77	49.68
Kazakhstan Stock Exchange	4	0.31	0.15
LSE Group	2999	40476.99	1810.2
Luxembourg Stock Exchange	80	0	0
Moscow Exchange	50	520.56	7614.1
Nigerian Stock Exchange	12	30.26	0.18
Prague Stock Exchange	3	0	0
SIX Swiss Exchange	1499	14376.53	151.5
Saudi Stock Exchange (Tadawul)	6	75.18	9.48
Stock Exchange of Mauritius	4	0.79	0.05
Tehran Stock Exchange	22	5676.76	1756
Tel-Aviv Stock Exchange	555	3124.62	246.34
The Egyptian Exchange	1	0.14	28
Warsaw Stock Exchange	7	18.95	8.59

3. 2020年11月份各交易所ETF衍生品成交量

Derivative Exchange	November				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								
B3 - Brasil Bolsa Balcão	48207341	NA	NA	NA	340039236	NA	NA	NA
Bolsa Mexicana de Valores	0	0	NA	0	NA	0	NA	0
Cboe Global Markets	59900372	NA	NA	NA	755318242	NA	NA	NA
MIAX Exchange Group	19785943	NA	NA	NA	299736817	NA	NA	NA
Nasdaq - US	63334891	NA	NA	NA	806668512	NA	NA	NA
Asia - Pacific								
Hong Kong Exchanges and Clearing	85887	NA	1122	15.48	1355130	NA	17603	195.91
Japan Exchange Group	158631	NA	NA	NA	903401	NA	NA	NA
Taiwan Futures Exchange	8768	NA	71935	2077.39	121834	NA	836604	16473.68
Europe - Africa - Middle East								
Borsa Istanbul	NA	0	0	NA	NA	NA	NA	0

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