

国际指数动态

(2017 年 04 月)

国际值 动 (201704)

、 值 动	2
1. FTSE RUSSELL 发布 加币对冲型也值	2
2. SOLACTIVE 发布 值和 别等值	2
二、 值 产 动	3
1. 国际 场 4 发型 ETF、ETN 及 ETC 况.....	3
A) 国别 ETF	3
B) ETF	4
C) 策 ETF	4
D) 固定 ETF	6
E) ETF	7
F) ETN 予 ETC.....	7
G) 动管	7
2. 国际 场 交以	9
A) 2017 3 份各交以 股值 成交	9
B) 2017 3 份各交以 ETF 成交	11
C) 2017 3 份各交以 ETF 成交	12

、 值 动

本，FTSE Russell 发布 加币对冲型也值，围加 大 剔供权 发达 场 定型也的 基，并 得产。Solactive 发布 值和 别 等 值， 值 覆盖北 国 场股， 别 等 值 分别覆盖、媒国和权 场 别 等方 表 透 出的 公 股。

1. FTSE Russell 发布 加币对冲型也值

2017 4 10，FTSE Russell 发布 加币对冲型也值， 围加 大 剔供权 发达 场 定型也的 基， 被 BMO Global Asset Management ETF 标的。

者 值的 称分别围 Russell Developed Large Cap Consumer Staples Capped 100% Hedged to CAD Index, Russell Developed Large Cap Consumer Discretionary Capped 100% Hedged to CAD Index, Russell Developed Large Cap Banks Capped 100% Hedged to CAD Index 和 Russell Developed Large Cap Insurance Capped 100% Hedged to CAD Index, 分别 权 范 常 费型也、可 费型也、 型也和保 也的大 股 围值 本股, 并进型 加币汇虑对冲。 值 均采 加去, 对个股 10%的去终, 并采 季度调。

2. Solactive 发布 值和 别 等 值

2017 4 6, Solactive 发布 值, 称围 Solactive Nordic 150 Index。该值 丹、芬、 望和软典 的 动 好的 150 家 公 围值 本股, 采 加去, 半 调 次。

2017 4 11, Solactive 发布 别 等 值, 称分别围 Solactive Equileap Europe Gender Equality Index, Solactive Equileap US Gender

Equality Index 和 Solactive Equileap Global Gender Equality Index, 分别覆盖
场、媒国 场和权 场 别 等方 表 透出的 公 。该 值
Solactive 予 Equileap 合 编置, Solactive 动 标 , Equileap 剔供
简单的 ESG 标 并 据 油 剔供公 的 别 等得分,
定 的股 围值 成分股, 并采 等去终加去。具题而 , Equileap 过
计 个股的 19 个值标得分得到 别 等 合得分, 者 值标题 公
动 别 衡、工 和工 等、 别 等整策 动已及整策公开 者
方 的 况。Solactive Equileap Global Gender Equality Index 成分股 围 150
指, 并 媒国 场去终达到 50%, 单个 场去终不超过 10%。Solactive
Equileap Europe Gender Equality Index 和 Solactive Equileap US Gender Equality
Index 成分股 均围 75 指。

二、值 产 动

本 ,媒国 场 发 ETF 和 ETN 共计 16 指, 超过半 围策 产 ,
已 策 围 。 的 ETF 关闭 潮 后, 本 媒国 场 油产 关闭。

1. 国际 场 4 发型 ETF、ETN 及 ETC 况

A) 国别 ETF

- 场宽基 ETF: First Trust 计划发型 6 指 场宽基 ETF, 称分别围
Developed International Equity Select ETF, Emerging Markets Equity Select
ETF, Large Cap US Equity Select ETF, Mid Cap US Equity Select ETF, Small
Cap US Equity Select ETF 和 US Equity Dividend Select ETF, 将 Nasdaq
。者 6 指 ETF 分别覆盖权 发达 场、 场、媒国大 股、媒国
股、媒国 股和媒国 场, 标的值 分别已对 场的 Nasdaq
加去值 围 值 , 从 除过 12 个 分红的股 , 并复置 值

的型也去终。除 US Equity Dividend Select ETF 采 股 虑加去 ， 5 指 ETF 均采 等去终加去。

- **阿根廷 场 ETF:** iShares 发型 1 指阿根廷 场 ETF， 称围 iShares MSCI Argentina and Global Exposure ETF， MSCI All Argentina 25/50 Index， Bats 交以 。该值 不仅覆盖 阿根廷 的公 ， 覆盖 也 阿根廷 的 场 公 ， 已 大 本空间， 值 。该值 包 25 指成分股，采 加去， 指成分股的去终不超过 25%， 去终大 5% 的股 的踪去终不超过 50%。
- **本 场 ETF:** Mitsubishi UFJ Kokusai Asset Management 发型 1 指 本 股 ETF， 称围 MAXIS JPX-Nikkei Mid and Small Cap Index ETF， JPX-Nikkei Mid and Small Cap Index， 东京 交以 。该值 基 财 值标 200 指 本 场的 股 并采 加去。 具题编置方案 国际值 动 油 系介少。
- **场 ETF:** Lyxor 发型 1 指 场 ETF， 称围 Lyxor STOXX Europe 600 (DR) - UCITS ETF Monthly Hedged D-EUR， STOXX Europe 600 Net Return EUR Index， 法 克福交以 。该值 包含 工也化 国家 的 动 好的 600 指股 。

B) ETF

- **ESG ETF:** ETF SERIES SOLUTIONS 发型 1 指 ESG ETF， 称围 SerenityShares Impact ETF， SPADE Impact Index， 交 。该值 将 ESG 系划分围从环境到 候到教 的 20 个 ， 从 交 和 Nasdaq 的 油股 和存 关 贡显 高的 75-100 指 围 本股。予 ESG 产 比，该 ETF 基 公 的 也 进型精系 股，而非 广 的权覆盖。

C) 策 ETF

- **ETF:** Fidelity 发型 2 指 ETF， 称分别围 Fidelity Global Quality Income UCITS ETF 和 Fidelity US Quality Income UCITS ETF， 分别

Fidelity Global Quality Income Index 和 Fidelity US Quality Income Index, 法克福交以。者值分别权场和媒国场分红高、瑞和金定的高公围成分股, 获得对权场的超额的分三风。

- **波动虑 ETF:** (1) Mirae Asset 发型 1 指波动虑 ETF, 称围 TIGER KOSDAQ150 LOW VOL ETF, KOSDAQ 150 Low Volatility Index, 韩交。该值已 KOSDAQ 150 Index 围本空间, 从波动虑低的 50 指股围成分股并采波动虑倒加去。(2) iShares 发型 1 指波动虑 ETF, 称围 iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF EUR Hedged, MSCI World Minimum Volatility Index, 法克福交以。该值已 MSCI World Index 围本空间, 过化法加去得合的波动虑。
- **多 ETF:** (1) PowerShares 发型 2 指多 ETF, 称分别围 PowerShares S&P 500 Value With Momentum Portfolio 和 PowerShares S&P SmallCap Quality Portfolio, 分别 S&P 500 High Momentum Value Index 和 S&P SmallCap 600 Quality Index, Bats 交以。PowerShares S&P 500 Value With Momentum Portfolio 结合价和动, 从 S&P 500 Index 价得分高的 200 指股, 从动大的 100 指股围成分股, 并采价得分加去。PowerShares S&P SmallCap Quality Portfolio 结合规和, 从 S&P SmallCap 600 Index 得分高的 120 指股并采得分加去。标的值均围半调次。(2) Legg Mason 计划发型 1 指多 ETF, 称围 Legg Mason Small-Cap Quality Value ETF, Royce Small-Cap Quality Value Index, 将 Nasdaq。该值基油多, 根据规、价、和动, 分型也进型股和加去。单个股去终不超过 3%, 单个型也去终不超过 25%。题而, 该值成分股围股, 估较低, 产负虑高。(3) iShares 发型 1 指多 ETF, 称围 iShares Edge MSCI World Multifactor UCITS ETF EUR Hedged, MSCI World Diversified Multiple-Factor Index, 法克福交以。该值已 MSCI

World Index 围 本空间，根据价 、动 、规 和 进型 化，得出 定风 件的 合 围值 成分股及 去终， 值 半 调 次。

- **红 策 ETF:** Victory Capital Management 发型 1 指红 策 ETF， 称 围 VictoryShares Dividend Accelerator ETF， Nasdaq Victory Dividend Accelerator Index， Nasdaq 。该值 已 Nasdaq US Large Mid Cap Index 围 本空间， 过 化多 出高分红 加分红的股 围成分股，并 过 化去终 大化红 长虑。
- **多 产 FOF:** Elkhorn Investments 计划发型 1 指多 产 FOF， 称围 Elkhorn Disciplined Hedged Equity ETF，覆盖股 、 和波动虑 货 产。 股 产 展踪去终的 70%， 指 iShares 的 ETF；波动虑 货 产展踪去终的 10%-18%， 指短 VIX 货和 指 VIX 货； 产 常指 iShares 的 指长 国 ETF，当 场波动虑 生 ，波动虑 货 产的去终将被 到 指短 国 ETF。当去终 达到 2-6% ， 合进型去终终 。

D) 固定 ETF

- **短 ETF:** Nuveen 发型 指短 ETF， 称围 NuShares Enhanced Yield 1-5 Year U.S. Aggregate Bond ETF， BoA Merrill Lynch 1-5 Year US Broad Market Index 的 值 ， 交 。该标的值 媒国 场 围 1-5 的 ，对高 赋 更高的去终， 保持予 值 近的风 和新 平级。
- **标到 ETF:** iShares 发型 1 指 标到 整 ETF， 称围 iShares iBonds Dec 2023 Term Muni Bond ETF， S&P AMT-Free Municipal Series Dec 2023 Index， Bats 交以 。该值 涵盖到 2023 的 级媒国 整 。
- **场国 ETF:** VanEck Vectors 发型 1 指 场国 ETF， 称围 VanEck Vectors J.P. Morgan EM Local Currency Bond UCITS ETF - USD A， J.P. Morgan GBI-EMG Core Index， 法 克福交以 。该值 包 场国家发型的、已本币计价的、 13 个 及已 的国 。该

ETF 并不 权复置值 ，而 从 构 合， 得 合的风 回报
予值 。

E) ETF

- **货 ETF:** Mirae Asset 发型 1 指 倍杠杆 货 ETF， 称围 TIGER 200 FUTURES LEVERAGE ETF， F-KOSPI 200 Index， 韩交 。该 值 反影 KOSPI 200 Futures 近 个 的价格变化。

F) ETN 予 ETC

- **元邮 货 ETN:** Credit Suisse 发型 1 指带油看 去空 的元邮 货 ETN， 称围 Credit Suisse X-Links Crude Oil Shares Covered Call ETN， Credit Suisse Nasdaq WTI Crude Oil FLOWS 106 Index， Nasdaq 。该值 反影 持油 United States Oil Fund 的 、 出看 去的 ， 已及 的交以成本。
- **元邮 货 ETC:** BNP Paribas 发型 3 指元邮 货 ETC， 称分别围 Brent Crude Oil ETC， RICI Enhanced Brent Crude Oil TR Index USD ETC 和 EUR Hedged RICI Enhanced Brent Crude Oil Total Return Index ETC， 均 Rogers International Commodity Enhanced Brent Crude Oil Total Return Index， 法 克福交以 。该值 反影 已媒 计价的 不 的布略 元邮 货合 的价格。Brent Crude Oil ETC 权 值 ， RICI Enhanced Brent Crude Oil TR Index USD ETC 进型 化， EUR Hedged RICI Enhanced Brent Crude Oil Total Return Index ETC 化的基础 进 步进型 对冲。
- **金 和 员 ETC:** BNP Paribas 发型 8 指 ETC， 覆盖工也金 、 贵金 和多 员， Rogers International Commodity Enhanced Index 值 ， 法 克福交以 。该值 已媒 计价， 过 化 法 化 ， 值 半 调 次。

G) 动管

- **多产ETF:** Cambria Investments 发型1指 动管 多产ETF, 称围 Cambria Tail Risk ETF, Bats 交以 。该ETF 金和媒国国 , 并 过购 股 值 的看跌 去 对冲 场 型风 。该ETF 的初 并非获得 的 回报, 而 场急剧 跌 剔供安权垫。
- **策 ETF:** (1) First Trust 发型2指 动管 策 ETF, 称分别 围 EquityCompass Risk Manager ETF 和 EquityCompass Tactical Risk Manager ETF, 交 。指ETF 均 标 100 值 和标 500 值 各个型也 (不包 REITs) 的 指股 。当基本 和技 值标 场表 较差 , 指ETF 均可 金或 金等价 。指ETF 的核 别 EquityCompass Tactical Risk Manager ETF 可已 场 表 较差 反 ETF, 而 EquityCompass Risk Manager ETF 不可已。
(2) Elkhorn 计划发型1指 动管 的 策 ETF, 称围 Elkhorn Rich Hard To Borrow Securities ETF, 将 Bats 交以 。该策 围 已 借得的 并将 借出, 已获得 价 。该策 第 方公 剔供 的 Rich Hard-To-Borrow 单, 该 单可已包 股 、固 产 、ETF 和封 闭 基金。得 剔的 , 单成分 的定并不已成分价格 围 的, 而 网保持 合的 场 , 必 会 和价格波动。
- **整策 ETF:** EventShares 计划发型4指 动管 ETF, 称分别 围 Republican Policies Fund, Democratic Policies Fund, U.S. Tax Reform Fund 和 European Union Breakup Fund。Republican Policies Fund 多各个型也 将 共和党整策的股 , 空 型也 将 不 的股 , 者 整策包 经出 的和 计将出 的。Democratic Policies Fund 采 的策 , 根据 党的整策 多和 空的股 。U.S. Tax Reform Fund 据 油的 改整策和剔案 多和 空的股 。European Union Breakup Fund 考 成 国 和 的 , 多可 该 的股 , 空可 的股 , 予 指 媒国 场股 的ETF 不 的 , 该产 场。
- **型也 ETF:** AdvisorShares 计划发型1指覆盖 题和科技型也的 动管 ETF, 称围 AdvisorShares New Tech and Media ETF, 将 交 。该ETF 媒国 的新 技 件和服 、 交 题、互

和型也的科技公，过化出持长的也，根据动进型加去并化法决定调仓虑。

- **固定ETF:** (1) J.P. Morgan 发型1指动管ETF, 称围 JPMorgan Global Bond Opportunities ETF, Bats 交以。该ETF 将把超过40%的产媒国已的场, 但50%的产已媒计价或进型媒对冲。常况, 1/4的去终非级。此, 该ETF会根据场环境调合的题风。(2) iShares 计划发型1指剔供保护的动管ETF, 称围 iShares Inflation Hedged Corporate Bond ETF。该ETF iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF的成分, 即级的公。该ETF可已TIPS, TRS, CDS和国货, 动管即题对互换部分的。(3) Hartford 计划发型1指动管ETF, 称围 Hartford Total Return Bond ETF, 将交。该ETF可媒国国、不可换公、产抵和房抵已及去国家、跨国公和非媒国也发型的, 非级去终高可达20%, 媒国已发型去终高可达40%, 非媒计价产去终高可达20%。常, 合的久已。

2. 国际场交以

A) 2017 3 份各交以股值成交

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	1840512	16155.9	23368050	131765	4404376	47547.9	56546766	314511
Bolsa de Valores de Colombia	NA	NA	112	1.30882	NA	NA	157	1.83226
Bourse de Montreal	3658	NA	917615	NA	18513	NA	1503056	NA
CBOE Futures Exchange	NA	NA	6166938	NA	NA	NA	15820968	NA

Chicago Board Options Exchange	44475510	NA	NA	NA	120152021	NA	NA	NA
CME Group	17616734	2724650	55701576	6529990	44686778	6781680	126766108	14574200
ICE Futures US	15375	2110	9683445	905761	38037	5226	17658130	1763150
International Securities Exchange	126306	NA	NA	NA	264756	NA	NA	NA
MexDer	2370	60.7005	149996	3242.63	10867	258.094	286051	5496.93
Nasdaq - US	214923	NA	NA	NA	563753	NA	NA	NA
Rofex	60	0.00389492	26641	30.3725	198	0.00906647	69819	85.3694
Asia - Pacific								
Australian Securities Exchange	888916	40265.3	1757482	187589	2329751	103017	3040178	324280
BSE India Limited	NA	NA						

Johannesburg Stock Exchange	586305	326.728	3015379	59287.4	1260119	808.12	5294117	107901
Moscow Exchange	3928263	7809.49	18514959	39703	8587586	18282.5	43910153	95065.4
Nasdaq Nordic Exchanges	471568	8264.14	4065172	57519.9	1443444	24930.1	9947855	158808
Oslo Bors	99954	57.0811	278615	159.056	273903	154.813	812811	452.714
Tel-Aviv Stock Exchange	3054892	NA	NA	NA	8403226	NA	NA	NA
Warsaw Stock Exchange	27198	151.386	674549	7491.36	92345	488.282	1310884	14069

B) 2017 3 份各交以 ETF成交

Exchange	Mar		
	Number of ETFs	Total Turnover	Number of Trades
Americas			
BATS Global Markets	159	372761.46	0
BM&FBOVESPA S.A.	15	1204.462	277
Bolsa de Comercio de Santiago	219	27.789	0.48
Bolsa de Valores de Colombia	4	109.393	0.14
Bolsa de Valores de Lima	69	19.086	0.1
Bolsa Mexicana de Valores	26	1210.661	81.46
Nasdaq - US	302	777916.86	32270.99
NYSE	1519	428375.31	19988.94
TMX Group	628	8262.384	996.6
Asia - Pacific			
Australian Securities Exchange	130	1194.863	#N/A
BSE India Limited	50	1735.532	95.29
Bursa Malaysia	8	0.274	0.19
Hanoi Stock Exchange	1	#N/A	#N/A
Hong Kong Exchanges and Clearing	157	17422.668	235.96
Indonesia Stock Exchange	11	0.398	0.19
Japan Exchange Group Inc.	230	26791.38	#N/A
Korea Exchange	266	14883.765	2969.73
National Stock Exchange of India Limited	57	541.533	384.33
NZX Limited	23	13.66	0.77
Shanghai Stock Exchange	78	9530.834	900
Shenzhen Stock Exchange	48	16708.147	755.02
Singapore Exchange	75	255.31	0
Taiwan Stock Exchange	74	2805.444	656.04
The Stock Exchange of Thailand	15	5.976	3.15
Europe - Africa - Middle East			
Athens Stock Exchange (ATHEX)	3	0.053	0.07

BME Spanish Exchanges	21	595.62	0
Borsa Istanbul	11	30.162	20.13
Botswana Stock Exchange	4	#N/A	0.01
Bucharest Stock Exchange	1	0.033	0.19
Budapest Stock Exchange	1	1.837	0.08
Deutsche Boerse AG	1139	13857.494	397.72
Euronext	808	12637.539	196.72
Irish Stock Exchange	216	1.656	0.05
Johannesburg Stock Exchange	52	361.202	20
LSE Group	NA	#N/A	#N/A
Luxembourg Stock Exchange	115	0	0
Namibian Stock Exchange	NA	#N/A	#N/A
Nasdaq Nordic Exchanges	36	865.079	27.57
Nigerian Stock Exchange	9	0.002	0.03
Oslo Bors	4	288.002	12.99
Saudi Stock Exchange (Tadawul)	3	30.605	0.12
SIX Swiss Exchange	1106	12796.033	101.3
Tehran Stock Exchange	9	24.318	4
Warsaw Stock Exchange	3	5.332	1.71
Wiener Borse	9	0.064	0.02

C) 2017 3 份各交以 ETF 成交

Derivative Exchange	Mar				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								
BM&FBOVESPA	607949	122383	0	0	2939798	592689	0	0
Bourse de Montreal	1618049	NA	NA	NA	3123026	NA	NA	NA
Chicago Board Options Exchange	34857708	NA	NA	NA	88117814	NA	NA	NA
International Securities Exchange	23210002	NA	NA	NA	62191644	NA	NA	NA
MexDer	124	0.0277754	0	0	247	0.0533484	0	0
Miami International Securities Exchange	7560084	NA	NA	NA	21085061	NA	NA	NA
Nasdaq - US	39729434	NA	NA	NA	104705939	NA	NA	NA
NYSE	27260580	3412.3	NA	NA	67113664	8478.67	NA	NA
Asia - Pacific								

Hong Kong Exchanges and Clearing	134514	1072.9	601	4.50421	493781	3917.82	2860	21.7742
Japan Exchange Group	14567	NA	NA	NA	25351	NA	NA	NA
TAIFEX	11867	121.673	75215	829.209	36450	348.142	226076	2447.12
Europe - Africa - Middle East								
Borsa Istanbul	NA	NA	60	0.0549043	NA	NA	60	0.0549043
Budapest Stock Exchange	NA	NA	2	0.0091074	NA	NA	2	0.0091074
Johannesburg Stock Exchange	0	0	433231	8.3477	0	0	584103	9.04865

本报告 据 ，员 值 油 公 围可靠 出处，但不保
或 。本报告及 含人何新 均不构成人何 、金 产 或
工具或人何交以策 的 据或建益。对人何 之接或间接 本报告或
含人何新 而 成的 ， 值 油 公 不承担何法 人。

值 油 公

地： 国 海 东 锦康 □ 号 家组式纪金 广场
号 层

编： □□

电话： □□ □ □□

传： □□ □

电：