

SPICE[®] IndexBuilder[™]

指数构建器

用于构建和测试指数投资观点的沙盒。

使用 SPICE IndexBuilder 指数构建器，用户可以利用标普道琼斯指数的 400 多种指数自行定制指数，涵盖所有主要股票投资主题、行业分类和地理区域。

SPICE IndexBuilder 指数构建器的主要优势：



全面定制功能

利用庞大的属性库对标普道琼斯指数现有的指数进行定制。



灵活设置选项

轻松选择各种排除条件、加权方案、收益类型、币种、选择标准和上限条件。



快速回测能力

在几分钟内生成历史表现和成分券分析。



强大分析功能

可比较和对比各种定制概念，提供深入分析，涵盖所有定期调整周期。



流程与基础设施优势

所用严格的流程和强大的基础设施与我们的旗舰指数完全相同。

无论是 ETF 发行人、结构性产品团队、交易所、财务顾问还是计划发起人，都可以利用 SPICE IndexBuilder 指数构建器来定制符合自己独特策略和目标的指数。

1. 用户根据以下要素确定基础指数：

- 关键特征
- 成分券分析
- 基本面
- 表现

2. 确定基础指数后，用户可通过以下步骤进行定制：

- 界定控制指数成分券范围和市值占比的准确参数
- 更新定期调整和指数调样规则设置
- 在草拟和完善规则过程中，按行业分类和地理区域实时筛选成分券市值占比
- 配置确定各币种、收益类型和递减策略计算方案的设置

3. 用户可使用以下方法快速深入了解定制概念的表现：

- 对指数概念进行回测
- 查看完整指数历史的详细表现、成分券分析和高级图表
- 将多个版本的标普道琼斯指数定制指数与其基础基准指数进行比较，确定最适合投资目标的版本

“由标普道琼斯指数计算” (“Calculated by S&P Dow Jones Indices”) 标志具有强大的影响力，代表定制指数客户所构建的指数是由标普道琼斯指数进行计算和/或管理。



用户可以一键订购指数，并且可在获得批准和许可后快速推出指数。要了解更多详情，请通过 index_services@spglobal.com 联系我们。对 SPICE IndexBuilder 指数构建器的使用受本使用条款约束。

关于标普道琼斯指数

标普道琼斯指数提供标志性和创新的指数解决方案，并拥有领先的资产类别专业知识。通过提高全球资本市场的透明度，让世界各地的投资者都能够做出更具确信度的投资决策。我们是全球最大的指数概念、数据及研究资源供应商，亦负责编制标普 500 指数®及道琼斯工业平均指数®等金融市场权威指标。追踪本公司指数的金融产品资产总值超过全球追踪其他任何指数的金融产品资产总值。市场公认我们的解决方案对于追踪市场表现、评估投资组合和制定投资策略至关重要。

标普道琼斯指数是标普全球（纽约证券交易所代码：SPGI）旗下公司。标普全球是全球资本、大宗商品和汽车市场信用评级、基准、分析和工作流程解决方案的领先供应商。通过我们提供的每一项服务，我们帮助全球领先的组织成功驾驭不同的经济环境，使他们能够立足当下，谋定未来。欲了解更多信息，请访问 www.spglobal.com/spdji/zh。

联系我们

美国

+1-877-325-5415

欧洲、中东和非洲

+44-20-7176-8888

阿联酋

+971(0)4-371-7131

中国

+86-10-5713-2550

印度

+91-22-2272-5312

日本

+81-3-4520-2860

澳大利亚

+61 2-9255-9802

拉丁美洲

+52 55-1037-5290

南非

+27-11214-1994

© 2025 标普道琼斯指数公司。保留所有权利。未经标普道琼斯指数有限公司书面许可，禁止全部或部分转载或复制。S&P（标普）、S&P 500（标普 500）、SPX、SPY、标普 500 (The 500™)、US 500（美股 500 指数）、US 30（美股 30 指数）、S&P 100（标普 100 指数）、S&P COMPOSITE 1500（标普综合 1500 指数）、S&P 400（标普 400 指数）、S&P MIDCAP 400（标普中盘 400 指数）、S&P 600（标普 600 指数）、S&P SMALLCAP 600（标普小盘 600 指数）、S&P GIVI（标普 GIVI）、GLOBAL TITANS（全球泰坦指数）、DIVIDEND ARISTOCRATS（红利优选指数）、DIVIDEND MONARCHS（红利特选指数）、BUYBACK ARISTOCRATS（回购优选指数）、SELECT SECTOR（精选行业指数）、S&P MAESTRO（标普 MAESTRO）、S&P PRISM（标普 PRISM）、GICS（全球行业分类标准）、SPIVA（标普指数与主动投资）、SPDR、INDEXOLOGY、iTraxx、iBoxx、ABX、ADBI、CDX、CMBX、MBX、MCDX、PRIMEX、HHPI 和 SOVX 均为标普全球有限公司（“标普全球”）或其关联公司的商标。DOW JONES（道琼斯）、DJIA（道琼斯工业指数）、THE DOW（道指）和 DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE（道琼斯工业平均指数）均为道琼斯商标控股有限责任公司（“道琼斯”）的商标；这些商标已被授权由标普道琼斯指数有限公司（或标普道琼斯指数）使用。标普道琼斯指数有限公司、道琼斯、标普全球及其各自的关联公司（统称为“标普道琼斯指数”）未就任何指数准确代表其声称代表的资产类别或市场行业分类的能力作出任何明示或默示的陈述或保证，并且标普道琼斯指数及其第三方许可方不对任何指数或其中包含的数据的任何错误、遗漏或中断承担任何责任。所有数据和信息均由标普道琼斯指数“按原样”提供。过往业绩并不预示或保证未来表现。请参阅 <https://www.spglobal.com/spdji/zh/disclaimers/#performance-disclosure> 所载的表现披露信息，详细了解与回溯和/或假设表现相关的固有限制。本文件不构成任何服务的要约。除某些定制指数计算服务外，标普道琼斯指数提供的信息均属一般性质，并非针对任何个人、实体或群体的需求量身定制。标普道琼斯指数通过将其指数许可给第三方和提供定制计算服务而获得报酬。投资者不能直接投资于指数。通过第三方提供的基于该指数的可投资工具，可以获得对指数所代表的资产类别的敞口。标普道琼斯指数未发起、认可、销售、推广或管理任何旨在根据任何指数的表现提供投资回报的投资基金或其他投资产品或工具。标普道琼斯指数有限公司并非投资顾问、大宗商品交易顾问或税务顾问。标普道琼斯指数对投资于任何此类投资基金或其他投资产品或工具的可取性不作任何陈述。标普道琼斯指数将其各业务单位的某些活动彼此分开，以保持各自活动的独立性和客观性。因此，标普道琼斯指数的某些职能部门可能掌握其他业务单位无法获得的信息。欲了解更多有关我们指数的信息，请访问 www.spglobal.com/spdji/zh

当使用 SPICE IndexBuilder 指数构建器（“工具”）构建指数时，该工具的历史数据与该指数的生产版本中使用的实际数据可能不同。这两个数据集之间的差异包括但不限于指数事件实施方法和/或时间（例如修正红利、定期调整之间的成分券替换、成分券市值占比调整参考日期等）。因此，使用该工具构建的指数的实际表现可能与回溯表现有显著差异。过往业绩并不预示或保证未来表现。

spglobal.com/spdji/zh