

## 国际指数动态（200702）

一、指数动态.....	2
1、DJ对Dow Jones-AIG商品指数监督委员会的结构进行调整.....	2
2、DJ授权 11 只指数用来做杠杆和反转ETFs产品.....	2
3、Macquarie美国基础设施指数发布.....	2
4、富时马来西亚交易所EMAS Shariah指数将成为新的基准.....	2
5、富时集团为其FTSE4Good系列指数引入新的气候变化标准.....	3
6、S&P出售共同基金数据业务，将专注于其全球基金行业的核心分析服务.....	3
8、香港正研究推出A+H 新型指数.....	4
三、指数衍生品动态.....	5
1、BGI增加在墨西哥Bolsa Mexicana Valores平球平台交易的新兴市场ETFs产品.....	5
2、香港交易所网站提供H股指数及更多衍生产品市场数据.....	5
附 1：07 年 1 月份各交易所股指衍生品成交量.....	7
附 2：06 年 12-07 年 1 月份各交易所ETF交易量.....	8

## 一、指数动态

### 1、DJ 对 Dow Jones-AIG 商品指数监督委员会的结构进行调整

纽约，2007-2-21，道琼斯指数公司对服务于 Dow Jones-AIG 商品指数（DJ-AIGCISM）的监督委员会的规则进行修改。

一个由“管理委员会”和“咨询委员会”组成的双层结构，替代了原来单个的监督委员会。这样安排的目的旨在扩大决策过程中考虑因素的宽度，同时也提供了为在发生任何市场破坏或者极端变化时的一个迅速反应机制。

### 2、DJ 授权 11

投资的透明的指数。

## 5、富时集团为其 FTSE4Good 系列指数引入新的气候变化标准

伦敦，2007-2-7，富时集团为其 FTSE4Good 指数系列发布了一套新的标准来弥补气候变化的影响，这标志着富时集团在企业社会责任基准方面又迈出了新的一步。投资者使用 FTSE4Good 指数来识别在企业社会责任（CSR）上具有正面记录的公司，上市公司也利用它作为衡量企业自身表现的框架。FTSE4Good 气候变化标准的引入使得指数与企业 and 投资者主要关注的一方面保持一致。这些标准的实施是正在改进的领先企业社会投资指数（leading SRI index）的一个里程碑，得到了行业专家、政府及非政府组织的广泛支持。

FTSE4Good 是一个用来反应社会责任实体表现的创新型实时指数。该指数由富时集团开发，覆盖五个市场：英国、欧洲、日本、美国及全球。四个可交易的指数及 5 个基准指数构成了 FTSE4Good 指数系列。社会责任投资（SRI）和企业社会责任（CSR）的独立委员会负责对指数进行审核，以确保指数精确地反映当前最优的 CSR 行为。

## 6、S&P 出售共同基金数据业务，将专注于其全球基金行业的核心分析服务

纽约，2007-2-22，为了将资源专注于其全球基金行业的核心分析服务，S&P 今天公告称将出售其共同基金数据服务给晨星公司（Nasdaq: MORN）。

本次晨星与标准普尔协议确定，以 5500 万美元现金收购后者的全球基金数据业务。标准普尔的全球基金数据业务涵盖超过 135,000 个投资管理产品，包括共同基金、交易所基金（ETF）、对冲基金和离岸基金等。根据协议，收购完成后标准普尔将从晨星获得使用基金数据的授权。双方计划在 3 月份完成本次收购。

## 7、恒指服务公司推出 REITs 指数

香港，2007-2-14，恒指服务公司董事兼总经理关永盛昨日表示，该公司已

经为推出房地产投资信托基金(REITs)做好了技术上的准备,只要有足够数目的 REITs 在香港市场上市,便可以推出 REITs 指数。

关永盛表示,推出 REITs 指数的技术问题并不难解,只是要等到市场上有最少 8 只 REITs,该指数才具代表性。

此外,关永盛还表示,纳入更多恒指成份股将令该指数更具代表性,也有助于市场发展更多相关的衍生工具产品,不过不需要制定时间表去限制纳入成份股的时间,反而应该着重选择合适的股份。他补充道,目前国企股数目约占香港整体市场的两成半,即使未来国企股在恒指内的比重不断上升,都不会取代国企指数。

## 8、香港正研究推出 A+H 新型指数

香港,2007-2-26,随着更多内地企业同时在内地及香港两地证券交易所上市,香港正研究推出 A+H 新型指数。香港恒指服务公司董事兼总经理关永盛 13 日表示,恒指服务公司已经注意到市场存在对 A+H 指数的需求,公司正着手研究,但暂时还没有确切推出该指数的时间表。

凯基证券执行董事邝民彬表示,“内地和香港股市还是割裂的两个市场,人民币不能自由兑换使同一家公司的 A 股、H 股会出现巨大差价。推出 A+H 指数可以说是一种预先的变通方式,将成为两地股市的一座桥梁。”邝民彬认为,更多能同时代表两地股市的相关性产品可能不断地被沪深港三个交易所推出。如此,未来三地股指的走势可能更趋同,而香港方面也希望能抢先寻找合适的切入点。

有香港基金经理评价,A+H 指数在推出初期或许不会吸引业界的高度关注,但它的意义在于有望奠定 A 股、H 股套利的技术基础。“我相信它相关的衍生产品会很多,比如 A+H 指数期货,可以与 A 股指数期货相挂钩。”

### 三、指数衍生品动态

#### 1、BGI 增加在墨西哥 Bolsa Mexicana Valores 平球平台交易的新兴市场 ETFs 产品

墨西哥城，2007-2-22，巴克莱国际投资管理公司（BGI）今天公告称有 5 只新兴市场的 ETFs 产品开始在 Bolsa Mexicana de Valores 的 Mercado 全球平台交易。这次增加进一步扩展了墨西哥机构投资者的投资选择，也使得在墨西哥挂牌交易的 ETF 产品达到 44 只。5 只新的 ETF 如下所示。

ETF 名称	交易代码 1	年费率
iShares FTSE/Xinhua China 25 Index Fund	FXI	0.74%
iShares MSCI Malaysia Index Fund	EWM	0.59%
iShares MSCI Singapore Index Fund	EWS	0.59%
iShares MCSI South Africa Index Fund	EZA	0.74%

#### 2、香港交易所网站提供 H 股指数及更多衍生产品市场数据

香港，2007-2-12，香港交易及结算所有限公司（香港交易所）已于其网站首页增设图表，显示恒生中国企业指数（H 股指数）的实时指数以及即日走势，并同时提供恒生指数期货及 H 股指数期货合约的最新成交量。此外，香港交易所网站亦增设新服务，提供衍生产品市场的即日数据。

此项新服务提供在香港交易所衍生产品市场上买卖的所有期货及期权合约的即日价格图表及成交量数据（延时约 30 分钟）。增加这新项目后，投资者便可从香港交易所网站查看香港交易所旗下证券及衍生产品市场所有交易产品的当天延时交易数据。

香港交易所署理集团营运总裁葛卓豪表示：“香港交易所相信新的网上信息对投资者有用，更有助加深公众对香港交易所衍生产品市场的认识。”葛卓豪并

表示，香港交易所现正检讨其有关延时价格的政策，以期不久的将来可以将免费提供市场数据的延缓时间缩短。

(完)

## 附 1：07 年 1 月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	January 2007				Year-to-Date Total			
	Stock Index Options		Stock Index Futures		Stock Index Options		Stock Index Futures	
	Number of Contracts Traded	Notional Turnover ml of USD	Number of Contracts Traded	Notional Turnover ml of USD	Number of Contracts Traded	Notional Turnover ml of USD	Number of Contracts Traded	Notional Turnover ml of USD
<b>Americas</b>								
American SE	671 376	786.0	NT	NT	671 376	786.0	NT	NT
Bourse de Montréal	1 666	95.4	174 156	20 016.0	1 666	95.4	174 156	20 016.0
Chicago Board Options Exchange	23 864 073	NA	NT	NT	23 864 073	NA	NT	NT
Chicago Board of Trade	22 245	NA	2 359 809	NA	22 245	NA	2 359 809	NA
Chicago Mercantile Exchange	2 518 570	568 946.1	36 728 115	2 449 205.0	2 518 570	568 946.1	36 728 115	2 449 205.0
International Securities Exchange	764 733	NA	NT	NT	764 733	NA	NT	NT
MexDer	14 684	339.5	77 409	1 911.4	14 684	339.5	77 409	1 911.4
Philadelphia SE	490 340	208.5	NT	NT	490 340	208.5	NT	NT
Santiago SE	NT	NT	0	0.0	NT	NT	0	0.0
Sao Paulo SE	32 927	6 810.9	NT	NT	32 927	6 810.9	NT	NT
<b>Asia - Pacific</b>								
Australian SE	NA	NA	NA	NA	0	NA	NA	NA
Bombay SE	0	0.0	283 781	2 251.4	0	0.0	283 781	2 251.4
Bursa Malaysia Derivatives	NT	NT	238 513	3 908.3	NT	NT	238 513	3 908.3
Hong Kong Exchanges	706 847	81 134.2	2 379 008	226 815.4	706 847	81 134.2	2 379 008	226 815.4
Korea Exchange	238 893 430	4 539 019.9	3 831 836	364 291.4	238 893 430	4 539 019.9	3 831 836	364 291.4
National Stock Exchange of India	1 641 585	15 107.2	4 716 781	43 203.4	1 641 585	15 107.2	4 716 781	43 203.4
Osaka SE	1 994 407	NA	3 995 278	297 865.5	1 994 407	NA	3 995 278	297 865.5
Singapore Exchange	20 099	1 243.0	2 542 771	135 761.4	20 099	1 243.0	2 542 771	135 761.4
Sydney Futures Exchange	33 243	3 091.0	342 446	37 373.0	33 243	3 091.0	342 446	37 373.0
TAIFEX	9 018 021	1 774.8	1 236 129	51 687.3	9 018 021	1 774.8	1 236 129	51 687.3
Thailand Futures Exchange	NT	NT	61 433	789.2	NT	NT	61 433	789.2
Tokyo SE	70	NA	826 107	116 516.9	70	NA	826 107	116 516.9
<b>Europe - Africa - Middle East</b>								
Athens Derivatives Exchange	55 322	984.6	220 538	3 818.5	55 322	984.6	220 538	3 818.5
Bolsa Española	370 869	7 003.1	814 280	122 214.9	370 869	7 003.1	814 280	122 214.9
Borsa Italiana	261 460	34 765.5	469 529	97 588.4	261 460	34 765.5	469 529	97 588.4
Budapest SE	0	NT	395 374	496.8	0	0.0	395 374	496.8
Eurex	21 545 817	1 080 588.9	22 988 330	1 846 062.8	21 545 817	1 080 588.9	22 988 330	1 846 062.8
Euronext.Liffe	4 652 230	397 236.3	6 224 243	609 942.9	4 652 230	397 236.3	6 224 243	609 942.9
ISE	946 437	877.7	919 005	23 186.0	946 437	877.7	919 005	23 186.0
Oslo Børs	116 369	105.9	163 530	239.6	116 369	105.9	163 530	239.6
Tel Aviv SE	7 285 506	160 569.0	3 193	53.9	7 285 506	160 569.0	3 193	53.9
Warsaw SE	20 279	224.5	595 960	6 578.2	20 279	224.5	595 960	6 578.2
Wiener Börse	2 687	298.8	6 760	702.3	2 687	298.8	6 760	702.3

## 附 2：06 年 12-07 年 1 月份各交易所 ETF 交易量

(in thousands)

Exchange	Number of trades		Year-to-date Total
	2006 December	2007 January	
<b>Americas</b>			
Lima SE	0,0	0,0	0,0
Mexican Exchange	2,4	4,9	4,9
NYSE	3 546,4	4 902,8	4 902,8
Sao Paulo SE	2,8	2,8	2,8
TSX Group	57,0	79,1	79,1
<b>Asia - Pacific</b>			
Bursa Malaysia	0,0	0,01	0,0
Hong Kong Exchanges	42,0	71,0	71,0
Korea Exchange	98,5	113,9	113,9
National Stock Exchange of India	1,0	1,0	1,0
New Zealand Exchange	0,4	0,4	0,4
Shanghai SE	72,4	218,9	218,9
Shenzhen SE	39,5	86,3	86,3
Taiwan SE Corp.	17,7	19,9	19,9
<b>Europe - Africa - Middle East</b>			
Borsa Italiana	68,0	125,5	125,5
Deutsche Börse	40,8	58,4	58,4
Euronext	32,7	55,2	55,2
Irish SE	0,1	0,3	0,3
Istanbul SE	17,6	19,4	19,4
JSE	2,3	3,5	3,5
Ljubljana SE	0,0	0,03	0,03
OMX	9,6	8,5	8,5
Oslo Børs	0,2	0,2	0,2
Swiss Exchange	8,7	13,4	13,4
Tel Aviv SE	163,3	169,7	169,7
Wiener Börse	0,3	0,2	0,2

## 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

中国上海市浦东南路 528 号

证券大厦南塔 13 楼

邮编：200120

电话：0086 21 6880 3988

传真：0086 21 6882 9830

电邮：[csindex@sse.com.cn](mailto:csindex@sse.com.cn)