

国际指数动态（200810）

一、 指数动态	1
1、 FTSE和JSE联合发布两个非洲市场指数（ ALL AFRICA INDICES）	1
2、 FTSE和ATHEX联合发布FTSE/ATHEX中盘流动性指数（ FTSE/ATHEX LIQUID MID INDEX）	2
3、 FTSE, ATHEX & CSE联合发布FTSE/ATHEX-CSE银行业指数（ FTSE/ATHEX-CSE BANKING INDEX）	2
4、 S&P 宣布推出S&P/LSTA杠杆借贷 100 指数(S&P/LSTA LEVERAGED LOAN 100 INDEX)	2
5、 恒生指数有限公司宣布推出恒生房地产基金指数（ HANGSENG REIT INDEX）	3
二、 指数衍生品动态	4
1、 EUREX上市基于DOW JONES–AIG商品指数开发的期权和期货	4
2、 NYSE ARCA 上市NORTHERN TRUST系列的 6 个ETFs产品	4
附 1: 08 年 9 月份各交易所股指衍生品成交量	5
附 2: 08 年 9 月各交易所ETF交易量	6

一、 指数动态

1、 FTSE和JSE联合发布两个非洲市场指数（ All Africa indices）

2008年10月6日,约翰内斯堡证券交易所(JSE)、南非股票交易所以及FTSE联合发布了FTSE/JSE全非洲(All Africa)40指数和FTSE/JSE全非洲(All Africa)除南非30指数。这两个指数都可用作开发指数基金、权证和ETF等金融产品。

JSE的CEO Russell Loubser表示: “为全球范围的投资者提供投资非洲大陆的渠道是JSE发展策略的重点部分, 与FTSE合作开发这两个指数的目的就是提高非洲高质量上市企业的可见性, 为投资者和交易所带来价值。”

EMEA–FTSE集团的董事总经理Imogen Dillon Hatcher表示: “不论是全球还是非洲本地的投资者, 他们对非洲股票市场的兴趣都在增加。发布这两个指数是FTSE为机构投资者提供基准并且用来开发金融创新产品的策略之一, FTSE还将继续与JSE拓展合作层面, 为投资者投资非洲提供更多的渠道。”

FTSE/JSE 全非洲40指数包括40家市值最大的上市公司, 它们分别来自埃及、科特迪瓦、肯尼亚、摩洛哥、毛里求斯、尼日利亚、南非以及突尼斯。FTSE/JSE全非洲除南非30指数将包括30家市值最大的上市公司, 它们分别来自埃及、科

特迪瓦、肯尼亚、摩洛哥、毛里求斯、尼日利亚、南非以及突尼斯。这两个指数将各自涵盖上述所有国家的资本市场，每个国家的权重上限为40%。成份股将进行季度审核。

2、 FTSE 和 ATHEX 联合发布 FTSE/ATHEX 中盘流动性指数 (FTSE/ATHEX Liquid Mid Index)

2008年10月23日，雅典证券交易所（ATHEX）与FTSE联合发布了FTSE/ATHEX中盘流动性指数。该指数将于2008年11月3日上线，基点为2000。

FTSE/ATHEX中盘流动性指数拓展了投资FTSE/ATHEX 中盘40指数中流动性最强的成份股的渠道，这将减少投资中盘股的交易成本。

ATHEX的主席Spyros Capralos表示：“我们与FTSE一直致力于开发希腊市场，新指数旨在突出FTSE/ATHEX中盘40指数中流动性较高的股票，该指数将会为机构投资者提供新的投资基准，并将用作开发金融衍生品和ETF。”

ATHEX表示将会尽快基于FTSE/ATHEX中盘流动性指数开发出可交易的金融产品。

3、 FTSE, ATHEX & CSE联合发布FTSE/ATHEX-CSE银行业指数 (FTSE/ATHEX-CSE Banking Index)

2008年10月23日，雅典证券交易所(ATHEX)和塞浦路斯证券交易所(CSE)与FTSE合作发布了FTSE/ATHEX-CSE银行业指数，该指数将于2008年11月3日上线，基点为2000。该指数将追踪在雅典和塞浦路斯上市的银行股的表现。

ATHEX主席Spyros Capralos表示：“该指数旨在为投资者提供一个新的银行业投资基准，并将用作开发ETF等金融产品，在不久的将来，我们计划和CSE合作推出基于该指数的衍生品，以此增加投资的杠杆性和对冲性。指数能够及时编制和运行，指数产品的及时开发要归因于连接两个市场的共有交易平台。”

EMEA-FTSE的董事总经理Imogen Dillon-Hatcher表示：“FTSE/ATHEX和FTSE/CSE的合作很成功，这是近期两个市场参与方共同磋商的成果，同时也印证了FTSE在指数编制领域不断追求卓越的承诺。”

4、 S&P 宣布推出 S&P/LSTA 杠杆借贷 100 指数 (S&P/LSTA

Leveraged Loan 100 Index)

2008年10月20日，S&P宣布推出S&P/LSTA美国杠杆借贷100指数，这是该月S&P推出的第二个固定收益指数。S&P/LSTA美国杠杆借贷100指数以市值为权重，旨在衡量美国杠杆借贷市场的表现。截至2008年9月30日，指数的市价总值为2100亿美元。

S&P/LSTA美国杠杆借贷100指数衡量杠杆借贷市场上市值最大的借贷工具（Facilities）的全收益表现，指数包括从领先的广泛市场杠杆借贷指标——S&P/LSTA杠杆借贷指数中选出来的100个借贷工具，S&P/LSTA杠杆借贷指数包括1100个借贷工具，并且拥有超过4800亿美元的市值。

S&P固定收益指数部副总裁James Rieger表示：“通过构建固定收益指数系列，S&P可以给市场提供一个重要观点，就是S&P/LSTA杠杆借贷100指数是如何筛选出那些最大并且最显著的杠杆借贷工具的。S&P将与LSTA (Loan Syndications and Trading Association)一道，通过发布借贷工具的全收益、加权平均价格，以及发行总量和总市值来增加借贷市场的透明度。”LSTA临时董事总经理Bram Smith表示：“杠杆借贷市场现在比以往更加需要透明度，S&P/LSTA美国杠杆借贷100指数是用来评判市场价格非常有用的工具。”

S&P/LSTA美国杠杆借贷100指数的成份选自银团借贷领域（Universe of syndicated leveraged loans），银团借贷占杠杆借贷市场的90%。在指数计算中对借贷工具每一部分(Tranche)利用LSTA/LPC市值调整（Mark-to-Market）法计价。S&P Loan Commentary and Data是该指数的数据来源地以及代理计算机构。

5、恒生指数有限公司宣布推出恒生房地产基金指数（HangSeng REIT index）

2008年10月27日，恒生指数有限公司宣布推出恒生房地产基金指数。

房地产基金指数的编算旨在为市场提供一项指标，以反映在香港上市的房地产投资信托基金的表现。目前共有七只房地产投资信托基金在香港上市，而首只房地产投资信托基金是在2005年11月上市。

房地产基金指数在推出时包括所有七只已上市的房地产投资信托基金为成

份股。指数采用流通市值加权法计算，并为每只成份股的比重上限设定为15%。房地产基金指数的成份股审核每半年进行一次。

恒生指数公司董事总经理关永盛先生说：“除配合本地房地产投资信托基金的发展外，房地产基金指数亦补足了恒生指数系列。指数更可用作发行与房地产基金相关的基金及衍生产品的基准。”

二、 指数衍生品动态

1、 EUREX上市基于DOW JONES-AIG商品指数开发的期权和期货

2008年10月16日，Dow Jones-AIG 商品指数以及它的9个行业指数被EUREX授权开发期权和期货。EUREX计划在2009年第一季度将这些衍生品推向市场。

这是Dow Jones-AIG 商品行业指数第一次作为基准开发期权和期货合约。9个行业指数是Dow Jones-AIG能源、Dow Jones-AIG石油、Dow Jones-AIG牲畜、Dow Jones-AIG不含能源、Dow Jones-AIG谷类、Dow Jones-AIG工业原材料、Dow Jones-AIG贵金属、Dow Jones-AIG Softs（包括咖啡、棉花、糖）以及Dow Jones-AIG农业指数。

2、 NYSE Arca 上市Northern Trust系列的6个ETF产品

2008年10月27日，NYSE Euronext (NYX)宣布将上市来自NYSE Alternext US的6个由Northern Trust开发的 ETF产品。

6个ETFs的名称及代码如下：

DAX	NETS DAX Index Fund (Germany)
JNB	NETS FTSE/JSE Top 40 Index (South Africa)
LDN	NETS FTSE 100 Index Fund (United Kingdom)
SGT	NETS FTSE Singapore Straits Times Index Fund
ITL	NETS S&P/MIB Index Fund (Italy)
AUS	NETS S&P/ASX 200 Index Fund (Australia)

附1：08年9月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	September 2008				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								
American SE	554,729	1,433.0	0	0.0	6,237,156	17,186.5	0	0.0
Bourse de Montreal	4,833	320.9	654,564	87,024.9	30,355	2,400.5	3,281,336	511,921.8
Buenos Aires SE	0	0.0	0	0.0	0	0.0	0	0.0
Chicago Board of Trade	n/a	n/a	n/a	n/a	0	0.0	0	0.0
Chicago Board Options Exchange	69,151,024	0.0	0	0.0	435,860,762	0.0	0	0.0
Chicago Mercantile Exchange	n/a	n/a	n/a	n/a	0	0.0	0	0.0
International Securities Exchange	2,109,461	0.0	0	0.0	14,105,792	0.0	0	0.0
MexDer	7,101	169.5	111,832	2,581.1	35,219	971.2	749,408	20,727.9
Philadelphia SE	643,696	1,043.0	0	0.0	4,443,842	4,162.3	0	0.0
Sao Paulo SE	23,484	6,227.4	0	0.0	175,806	64,365.5	0	0.0
Asia - Pacific								
ASX Derivatives Trading	289,676	10,978.8	43,149	563.9	1,950,832	95,421.9	229,942	4,450.9
ASX SFE Derivatives Trading	59,938	5,766.8	1,352,621	124,727.5	337,299	40,715.5	7,204,453	843,325.0
Bombay SE	0	0.0	17,476	78.7	631	4.1	2,291,451	13,147.9
Bursa Malaysia Derivatives	0	0.0	241,610	2,827.6	0	0.0	2,254,277	41,869.4
Hong Kong Exchanges	657,892	62,662.8	4,467,559	358,535.0	4,088,098	501,849.2	32,024,311	3,293,372.0
Korea	315,379,205	0.0	6,783,914	520,615.6	2,011,059,741	35,948,107.6	41,854,517	4,263,650.4

Exchange								
National Stock Exchange								
India	21,398,430	98,050.7	19,332,343	80,755.7	89,099,694	476,595.4	141,261,516	755,371.8
Osaka SE	3,527,885	0.0	12,526,233	506,572.8	23,776,476	0.0	90,965,674	3,988,713.7
Singapore Exchange	15,621	0.0	6,320,319	0.0	199,377	0.0	45,256,382	0.0
TAIFEX	8,985,476	1,318.8	2,723,148	79,274.4	77,154,336	11,700.5	21,113,729	811,040.4
Thailand Futures Exchange	2,850	0.3	207,386	2,637.4	36,251	4.9	1,294,006	21,014.2
Tokyo SE Group	4,282	0.0	2,329,766	237,622.4	38,892	0.0	23,869,114	1,646,088.1
Europe - Africa - Middle East								
Athens Derivatives Exchange	62,214	756.5	344,863	4,002.3	371,261	5,767.2	2,143,257	33,305.5
BME Spanish Exchanges	934,139	14,172.7	1,073,948	117,048.8	6,247,432	117,521.0	8,044,510	1,114,946.3
Borsa Italiana	362,493	34,641.9	874,564	118,767.5	2,855,966	341,336.7	5,589,782	944,643.6
Budapest SE	0	0.0	340,336	372.8	0	0.0	2,572,893	3,580.7
EUREX	55,841,437	2,434,865.4	66,422,583	3,804,499.7	371,155,699	19,648,990.4	371,504,525	27,080,327.7
Euronext.liffe	6,871,239	482,827.9	12,112,749	939,179.8	48,507,318	4,205,996.8	76,525,955	7,184,526.6
JSE	1,859,674	1,863.1	2,392,478	56,751.9	9,910,720	14,998.8	13,763,009	416,183.3
OMX Nordic Exchange	1,991,051	23,128.8	4,362,682	49,888.7	15,916,323	235,637.1	28,421,173	411,663.3
Oslo Børs	228,722	256.3	814,701	913.0	1,249,790	1,652.6	6,413,269	8,601.9
Tel Aviv SE	8,671,701	213,981.6	1,927	132.2	62,634,364	1,865,866.1	20,663	663.4
Warsaw SE	34,253	318.2	1,127,321	11,173.0	263,973	3,030.6	8,657,858	107,794.5
Wiener Börse	4,552	425.4	40,351	3,116.8	24,935	2,754.0	186,083	17,535.4

附2: 08年9月各交易所ETF交易量

Exchange	September, 2008		Year-to-date Total
	Number of ETFs	Total Turnover	
Americas			
American SE	383	35599.4	242044.4
Lima SE	4	0.3	11.8
Mexican Exchange	143	4888.6	32575.9

Nasdaq	46	220242.8	1461748.2
NYSE Group	399	765574.7	5007546.2
Sao Paulo SE	1	53.1	724.4
TSX Group	92	15520.3	100997.9
Asia - Pacific			
Australian SE	19	411.2	2922.2
Bombay SE	2	0.2	10.3
Bursa Malaysia	3	0.5	47.4
Hong Kong Exchanges	24	5816.1	41182.9
Indonesia SE	2	0.4	7.0
Korea Exchange	35	3567.1	16394.4
National Stock Exchange India	14	103.3	703.0
New Zealand Exchange	6	57.8	84.8
Osaka SE	10	1571.7	17120.2
Shanghai SE	3	3298.3	28574.0
Shenzhen SE	2	243.1	5066.6
Singapore Exchange	19	213.0	1502.9
Taiwan SE Corp.	11	856.9	5933.0
The Stock Exchange of Thailand	2	19.2	305.8
Tokyo SE	56	1801.9	17100.7
Europe - Africa - Middle East			
Athens Exchange	1	14.6	65.7
BME Spanish Exchanges	29	355.5	8013.8
Borsa Italiana	316	6487.0	53192.4
Budapest SE	1	0.5	11.6
Deutsche Börse	364	19948.9	153696.5
Euronext	370	14859.2	113740.6
Irish SE	14	23.2	135.5
Istanbul SE	9	607.2	5835.7
JSE	17	354.9	2717.1
Ljubljana SE	3	0.1	0.4
London SE	391	10185.3	77538.5
OMX Nordic Exchange	10	3516.6	21262.7
Oslo Børs	6	1320.6	6011.8
Swiss Exchange	135	3225.3	21151.8
Tel Aviv SE	338	4458.8	30912.6
Wiener Börse	22	14.7	320.5

528

13

: 200120

: 0086 21 6880 3988

: 0086 21 6882 9830

: csindex@sse.com