

国际指数动态 (200811)

国际指数动态 (200811)	1
一、 指数动态	1
1、 DOW JONES推出东盟国家伊斯兰市场指数(ISLAMIC MARKET INDEX FOR ASEAN COUNTRIES)	1
2、 DOW JONES推出道琼斯全球指数 (THE GLOBAL DOW)	2
3、 DOW JONES世界伊斯兰市场指数扩充了 12 个国家	3
4、 FTSE扩充其环境机会指数系列 (ENVIRONMENTAL OPPORTUNITIES INDEX SERIES)	3
5、 MSCI BARRA扩充MSCI全球伊斯兰指数系列 (MSCI GLOBAL ISLAMIC INDICES FAMILY) ...	4
6、 MSCI BARRA推出MSCI全秘鲁指数 (MSCI ALL PERU INDEX)	5
7、 MSCI BARRA扩充MSCI亚洲APEX可交易指数系列 (TRADABLE MSCI ASIA APEX INDICES)	5
8、 S&P 推出联合产权公寓指数系列(CONDO INDICES), 发布经季度调整的S&P/CASE-SHILLER住房价格指数 (S&P/CASE-SHILLER HOME PRICES INDICES) 历史数据	5
9、 S&P 推出新的风险控制指数系列 (NEW RANGE OF RISK CONTROL INDICES)	6
二、 指数衍生品动态	8
1、 DEUTSCHE BÖRSE XETRA平台上市多只ETF	8
2、 SGX上市由LYXOR推出的 5 只ETF	8
3、 NYSE ARCA平台上市多只ETF	8
附 1: 08 年 10 月份各交易所股指衍生品成交量	10
附 2: 08 年 10 月份各交易所ETF交易量	11

一、 指数动态

1、 Dow Jones推出东盟国家伊斯兰市场指数(ISLAMIC MARKET INDEX FOR ASEAN COUNTRIES)

2008 年 11 月 17 日, Dow Jones 推出道琼斯东盟国家伊斯兰市场指数(Dow Jones Islamic Market (DJIM) ASEAN Index) 。

DJIM ASEAN 指数是第一个包括东南亚国家联盟国家中 6 个国家的伊斯兰宗教指数, 目前这一指数包括印度尼西亚、马来西亚、菲律宾、新加坡、泰国和

越南 6 个国家。指数旨在为投资这一市场的共同基金提供基准，也可用来开发金融产品。

道琼斯指数主席 Mike A. Petronella 表示“东南亚市场联盟是亚洲增长最快的新兴市场，DJIM ASEAN 指数为投资者提供了投资东南亚地区符合伊斯兰教教义（Shari’ah-compliant）的股票组合。”

指数计算方面，DJIM ASEAN 指数采用自由流通市值加权。截至 2008 年 11 月 12 日，指数包含 284 只成份股；成份股中占比最大的 5 只个股为 PTT PCL (泰国，石油与天然气)， Sime Darby (马来西亚，工业商品与服务)， Singapore Airlines (新加坡，旅游、休闲)， Singapore Telecommunications (新加坡，电信) 以及 Telekomunikasi Indonesia (印尼，电信)。指数基期为 1995 年 12 月 31 日，指数以美元计算，每季度定期审核。

2、Dow Jones 推出道琼斯全球指数（THE GLOBAL DOW）

2008 年 11 月 11 日，道琼斯宣布推出道琼斯全球指数 GLOBAL DOW——一个代表全球领先企业的国际化指数。指数成份股由《华尔街日报》和道琼斯指数公司的专家们共同选定。指数旨在衡量 150 家在当前和未来都具备全球领导力企业的业绩表现。

道琼斯全球指数的样本空间包括所有对外国投资者开放的公开上市的有价证券。道琼斯的编辑利用他们的编辑经验和专业判断来选择成份股，所考虑的指标主要有公司规模、声誉以及在世界经济中的重要性。股票既涵盖发达国家和新兴市场，也包括一些新成立的国家或地区。

指数采用等权重计算，并且每月 9 月重新审核一次。考虑到连贯性，成份股的变换必须是公司并购或者公司主营业务发生变化。指数中自由流通市值最大的三只成份股为 Exxon Mobil Corp. (美国，石油天然气)， Procter & Gamble Co. (美国，消费品) 和 General Electric Co. (美国，工业)；自由流通市值最小的三只成份股为 General Motors Corp. (美国，消费品)， Renewable Energy Corp.

ASA (挪威, 石油天然气)和 Suntech Power Holdings Co. Ltd. ADS (中国, 能源)。截至 2008 年 11 月 10 日收盘, 道琼斯全球指数较年初下跌了 44.22%。

指数基期为 2000 年 12 月 31 日, 基点为 1000 点。

3、Dow Jones世界伊斯兰市场指数扩充了12个新国家

2008 年 11 月 3 日, 道琼斯宣布巴林、中国、埃及、印度、约旦、科威特、摩洛哥、阿曼、卡塔尔、斯里兰卡、土耳其和阿拉伯联合酋长国将被加入到道琼斯世界伊斯兰市场指数以及所有子指数中, 包括道琼斯伊斯兰新兴市场指数和道琼斯伊斯兰亚太市场指数。新加入的指数系列将会在 2008 年 12 月 22 日正式生效。

道琼斯指数董事总经理 Michael A. Petronella 表示: “新加入的这些国家非常有投资价值, 它们都是多样化的新兴市场。道琼斯伊斯兰市场指数设立于 1999 年, 是首选的作为伊斯兰投资组合的基准指数。”

新加入的国家使得道琼斯世界伊斯兰市场指数从 42 个增加到 54 个, 这 12 个国家将会被加入到相应的规模、行业和区域指数当中。

据悉, 截至目前, 共有超过 75 家授权用户管理的超过 70 亿美元资产追踪着道琼斯世界伊斯兰市场指数。

4、FTSE扩充其环境机会指数系列 (Environmental Opportunities Index Series)

2008 年 11 月 17 日, FTSE 指数宣布推出 9 只新指数以扩充其环境机会指数。FTSE 环境机会指数系列于 2008 年 6 月推出, 该系列源自 FTSE 全球股票指数系列, 所包含公司要满足 20%的业务来自于环境市场和技术。成份股的选取由 Impax 公司负责研究。扩展后的指数为投资者提供了更加细分的环境主题投资渠道, 包括可再生能源、能源使用效率、水、废弃物处理等。新指数包括:

- FTSE EO 100 指数
- FTSE EO 水技术 30 指数 (Water Technology 30 Index)
- FTSE EO 水技术基准指数 (Water Technology Benchmark)
- FTSE EO 可再生能源 50 指数 (Renewable Energy 50 Index)
- FTSE EO 可再生能源基准指数 (Renewable Energy Benchmark)
- FTSE EO 能源效率 50 指数 (Energy Efficiency 50 Index)
- FTSE EO 能源效率基准指数 (Energy Efficiency Benchmark)
- FTSE EO 垃圾和污染控制 30 指数 (Waste and Pollution Control 30 Index)
- FTSE EO 垃圾和污染控制基准指数 (Waste and Pollution Control Benchmark)

FTSE 集团社会责任投资负责人 Will Oulton 表示：“FTSE 环境市场指数系列追踪可从全球低碳经济转型中受益的企业，新基准指数和可交易指数系列的推出为投资者筛选了满足这些条件的优秀企业。”

5、MSCI Barra 扩充 MSCI 全球伊斯兰指数系列 (MSCI Global Islamic Indices Family)

2008 年 11 月 25 日，MSCI Barra 宣布扩充 MSCI 全球伊斯兰指数系列，扩充的指数有伊斯兰新兴市场小盘指数，以及新增 16 个边缘市场国家指数。新增的边缘市场国家使 MSCI 伊斯兰国家指数从 53 个增加到 69 个。新增的指数将会在 2008 年 12 月 2 日上线。

MSCI Barra 董事总经理 Remy Briand 表示：“由于遵从伊斯兰教的投资者在全球范围内资产配置的增加，对伊斯兰指数系列的需求持续增长。这次指数的扩充使得投资者在伊斯兰新兴市场的小盘股和边缘国家有更广泛的投资范围。”

指数计算方面，新指数将于 2008 年 11 月 26 日开始计算，于 2008 年 12 月 2 日加入到 MSCI 权益指数产品序列中。MSCI 伊斯兰新兴市场小盘指数、

MSCI 新兴市场伊斯兰可投资指数、MSCI 伊斯兰边缘市场指数的追溯起始日期为 2002 年 6 月。

6、MSCI Barra推出MSCI全秘鲁指数（MSCI All Peru Index）

2008 年 11 月 7 日，MSCI Barra 宣布推出 MSCI 全秘鲁指数。该指数反映秘鲁股票市场宽样本空间（Broad Peru Equity Universe）的投资机会，指数将会被授权用作投资组合管理和基准指数，并可用来开发指数产品。

MSCI 全秘鲁指数旨在衡量秘鲁宽样本空间股票的业绩表现，MSCI Barra 对“秘鲁股市宽样本空间”的定义为秘鲁股市中符合 MSCI 可投资市场指数计算方法的上市公司，加上公司总部及大多数业务都在秘鲁本地市场的公司。另外两个附加指数也将随着 MSCI 全秘鲁指数发布，分别是 MSCI 全秘鲁 10/40 指数和 MSCI 全秘鲁权重限制指数（The MSCI All Peru Capped Index）。

7、MSCI Barra扩充MSCI亚洲APEX可交易指数系列（Tradable MSCI Asia APEX Indices）

2008 年 11 月 3 日，MSCI Barra 宣布推出 MSCI 亚洲 APEX 中盘 50 指数和 MSCI 亚洲 APEX 小盘 200 指数。这两个指数将会被授权用作投资组合管理和业绩基准，也可用来开发金融产品。

MSCI 亚洲 APEX 指数的计算方法基于优化选股原则，新指数与原指数系列有相似的计算方法，但是在成份股的数量以及缓冲区设置方法有所不同。MSCI 亚洲 APEX 中盘 50 指数选取 MSCI AC 亚洲除日本中盘指数中 50 只市值最大及可交易性最强的个股，MSCI 亚洲 APEX 小盘 200 指数选取 MSCI AC 亚洲除日本小盘指数中 200 只市值最大及可交易性最强的个股。

8、S&P 推出联合产权公寓指数系列（Condo Indices），发布经季度调整的 S&P/Case-Shiller 住房价格指数（S&P/Case-Shiller

Home Prices Indices) 历史数据

2008年11月20日，S&P宣布推出追踪美国5个大城市包括波士顿、芝加哥、洛杉矶、纽约和旧金山的联合产权公寓（Condominium）价格指数。另外，S&P也将发布经过季度调整的S&P/Case-Shiller住房价格指数系列（Home Price Indices）的历史数据。这两组指数和数据于2008年11月25日上线。

S&P董事总经理David Blitzer表示：“联合产权公寓的价格与家居住房的价格变化并不一致，新指数补充了现有的S&P/Case-Shiller住房价格指数系列（S&P/Case-Shiller Home Price Indices）。更加细分的指数将会给产权所有者、投资者以及其他需要的人提供一个更好的渠道去了解现有的住宅市场。”

联合产权公寓指数覆盖了美国5个大城市，数据可以追溯至1995年1月。季度调整后的指数开始于1987年1月。

9、S&P 推出新的风险控制指数系列（New Range Of Risk Control Indices）

2008年11月17日，在世界金融市场波动加剧的背景下，S&P宣布推出新的风险控制指数系列（Risk Control Indices），指数旨在为投资者提供衡量及控制S&P指数系列的风险水平。S&P是目前第一家为投资者全面、独立提供风险波动指数（Volatility targeting indices）的指数机构。

S&P新的风险控制指数的计算方法将被应用至S&P新兴市场或国际主题指数系列中的四个指数——分别是S&P金砖四国40指数、S&P拉丁美洲40指数、S&P东南亚40指数和S&P国际基建指数，另外指数的计算方法也可用作现有的任何一个S&P权益类指数。

每一个风险控制指数的目标波动率是基于相关指数的历史波动率，同时波动率也将会被时刻监控以确保连续性。如果风险水平超过目标，现金流水平将会增

加以维持目标波动率，如果风险水平低于目标限制，指数将会利用杠杆去维持目标波动率。

S&P 金砖四国风险控制 18%指数、S&P 拉丁美洲风险控制 18%指数、S&P 东南亚风险控制 18%指数以及 S&P 国际基建风险控制 12%指数将会利用现有主指数的计算方法，并利用一定的数学运算法则去控制风险水平。对新兴市场一般设置 18%的历史波动率水平来控制风险，对国际基建指数采用 12%的历史波动率水平来控制风险。

10、 S&P 推出国际国债指数系列 (International Treasury Bond Index Series)

2008 年 11 月 3 日，S&P 宣布推出 S&P/Citigroup 国际国债指数系列，这一指数系列的推出将扩充 S&P 固定收益指数系列的规模。

除美国外其他一些主权国家发行的国债增长迅速，截至 2007 年 12 月末，全球共有超过 9500 万亿美元的国债规模。来自发达国家的国债占了绝大多数，占比 93%，新兴市场占剩下的 7%。

S&P/Citigroup 国际国债指数系列为机构投资者提供了一个除美国市场的国债基准指数，指数只包括由国际清算银行 (Bank of International Settlements) 定义的发达国家。

新指数包括两个子指数—S&P/Citigroup 国际除美国国债指数，它所包括的国债到期期限都大于一年，另一个是 S&P/Citigroup 国际除美国国债 1-3 年指数，它包括到期期限在 1 到 3 年之间的国债。指数在每月末定期审核。经过回溯测试，指数的收益率自 2001 年 4 月来一般都在 2%到 4%之间。

指数成份方面，截至 2008 年 9 月 30 日，指数中最大的三个主权发行人为日本 (24.95%)、德国 (9.28%) 和意大利 (8.74%)。指数没有固定成份国家的数量，主要基于每次审核时符合条件的主权发行人，每一国家的权重上限为 24.95%。

二、 指数衍生品动态

1、 Deutsche Börse Xetra 平台上市多只 ETF

2008 年 11 月 5 日，Xetra 平台上市追踪 MSCI ASIA APEX 50 价格全收益指数的 Lyxor ETF MSCI ASIA APEX 50 (ISIN: FR0010652867)。

2008 年 11 月 3 日，四只由 db x-trackers II 发行的信贷衍生品 ETF 开始在德交所的泛欧 Xetra 平台上市交易。db x-trackers II iTraxx Europe Subordinated Financials 5-year TRI ETF (ISIN: LU0378819378)和 db x-trackers II iTraxx Europe Subordinated Financials 5-year Short TRI ETF (ISIN: LU0378819881) 追踪 iTraxx Europe Subordinated Financials 5-year 全收益指数。两只 ETF 的管理费为 0.21%。db x-trackers II iTraxx Europe Senior Financials 5-year TRI ETF (ISIN: LU0378819295) 和 db x-trackers II iTraxx Europe Senior Financials 5-year Short TRI ETF (ISIN: LU0378819709) 追踪 iTraxx Europe Senior Financials 5-year 全收益指数。两只 ETF 的管理费为 0.18%。

2、 SGX上市由LYXOR推出的5只ETF

2008 年 11 月 5 日，LYXOR 推出的 5 个 ETF 在新加坡交易所上市，自此 LYXOR 的 ETF 数量也将增加至 13 只。5 只 ETF 分别是：

- Lyxor ETF MSCI Asia APEX 50
- Lyxor ETF MSCI Thailand
- Lyxor ETF MSCI Malaysia
- Lyxor ETF MSCI India
- Lyxor ETF Commodities CRB Non-Energy (Reuters/Jefferies CRB Non-Energy Index)

3、 NYSE Arca平台上市多只ETF

2008 年 11 月，NYSE Arca 平台上市多只 ETF。分别是：

25-Nov-08	GreenHaven Fund Lists on NYSE Arca
25-Nov-08	11 PowerShares DB Funds List on NYSE Arca
25-Nov-08	Eight ProShares Funds List on NYSE Arca
25-Nov-08	Five United States Commodity Funds List on NYSE Arca
24-Nov-08	Seventeen HOLDERS ETFs List on NYSE Arca
24-Nov-08	Six ELEMENTS ETNs List on NYSE Arca

附1: 08年10月份各交易所股指衍生品成交量

Derivative Exchange	October 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	574,033	1,820.0	0	0.0	6,811,189	19,006.5	0	0.0
BM&FBOVESPA	13,372	2,708.1	0	0.0	189,178	67,073.6	0	0.0
Bourse de Montreal	3,295	162.0	483,540	47.4	33,650	2,562.5	3,764,876	511,969.3
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	35,484,541	0.0	0	0.0	223,547,176	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	n/a	n/a	n/a	n/a	14,105,792	0.0	0	0.0
MexDer	5,488	116.6	102,121	1,684.3	40,707	1,087.8	851,529	22,412.2
Philadelphia SE	522,200	1,046.6	0	0.0	4,966,042	5,209.0	0	0.0
Asia - Pacific								
ASX Derivatives Trading	371,076	10,788.5	17,490	287.8	2,321,908	106,210.3	247,432	4,738.7
ASX SFE Derivatives Trading	63,330	4,489.0	981,445	68,423.3	400,629	45,204.6	8,185,898	911,748.3
Bombay SE	0	0.0	11,690	36.9	631	4.1	2,303,141	13,184.8
Bursa Malaysia Derivatives	0	0.0	278,126	2,717.5	0	0.0	2,532,403	44,586.9
Hong Kong Exchanges	546,812	40,704.7	5,020,981	301,629.7	4,634,910	542,553.9	37,045,292	3,595,001.7
Korea Exchange	257,860,732	3,192,092.0	8,548,573	517,039.3	2,268,920,473	39,140,199.6	50,403,090	4,780,689.8
National Stock Exchange India	20,737,381	73,712.8	21,649,445	65,715.2	109,837,075	550,308.2	162,910,961	821,087.0

Osaka SE	4,169,640	0.0	18,768,788	582,999.2	27,946,116	0.0	109,734,462	4,571,712.9
Singapore Exchange	19,663	0.0	6,768,786	0.0	219,040	0.0	52,025,168	0.0
TAIFEX	7,304,100	1,328.7	3,206,199	71,460.7	84,458,436	13,029.2	24,319,928	882,501.1
Thailand Futures Exchange	3,790	0.6	308,602	2,836.3	40,041	5.5	1,602,608	23,850.5
Tokyo SE Group	5,162	0.0	1,988,383	177,498.6	44,054	0.0	25,857,497	1,823,586.6
Europe - Africa - Middle East								
Athens Derivatives Exchange	36,382	322.6	303,880	2,412.4	407,643	6,089.7	2,447,137	35,717.9
BME Spanish Exchanges	604,796	6,991.3	1,125,901	88,459.5	6,852,228	124,512.3	9,170,411	1,203,405.8
Borsa Italiana	429,237	32,454.2	980,189	89,546.9	3,285,203	373,791.0	6,569,971	1,034,190.5
Budapest SE	0	0.0	520,497	390.8	0	0.0	3,093,390	3,971.5
EUREX	74,467,802	2,530,017.1	65,497,555	2,933,410.3	445,623,501	22,179,007.5	437,002,080	30,013,738.1
Euronext.liffe	8,840,224	461,505.2	12,816,237	728,458.0	57,347,542	4,667,502.0	89,342,192	7,912,984.6
JSE	1,820,003	1,227.0	1,567,704	25,687.6	11,730,723	16,225.8	15,330,713	441,870.9
OMX Nordic Exchange	1,465,249	12,451.6	4,527,781	38,177.3	17,381,572	248,088.6	32,948,954	449,840.6
Oslo Børs	136,348	89.3	1,037,111	679.4	1,319,678	1,741.9	7,450,380	9,281.4
Tel Aviv SE	5,749,273	118,352.3	549	11.1	68,383,637	1,984,218.4	21,212	674.5
Warsaw SE	44,370	254.3	1,429,916	10,139.6	308,343	3,285.1	10,087,774	117,934.2
Wiener Börse	460	36.1	8,574	414.9	25,395	2,790.1	194,657	17,950.3

附2: 08年10月份各交易所ETF交易量

Exchange	October 2008		Year-to-date Total
	Number of ETFs	Total Turnover	
Americas			
American SE	n/a	n/a	242044.4
BM&FBOVESPA	1	60.1	784.5
Lima SE	4	0.2	12.0
Mexican Exchange	155	6425.9	39001.7
Nasdaq	46	238919.4	1700667.6
NYSE Group	449	803646.1	5811192.3
TSX Group	92	16238.8	117236.7
Asia - Pacific			
Australian SE	19	291.3	3213.5

Bombay SE	2	0.1	10.4
Bursa Malaysia	3	0.8	48.2
Hong Kong Exchanges	24	5374.0	46556.9
Indonesia SE	2	0.1	10.8
Korea Exchange	36	2079.1	18473.5
National Stock Exchange India	14	109.5	812.5
New Zealand Exchange	6	4.6	89.4
Osaka SE	10	3394.0	20514.3
Shanghai SE	3	3176.1	31750.1
Shenzhen SE	2	210.5	5277.1
Singapore Exchange	19	201.0	1703.9
Taiwan SE Corp.	11	562.3	6495.3
The Stock Exchange of Thailand	2	30.7	336.5
Tokyo SE	58	3174.1	20274.8
Europe - Africa - Middle East			
Athens Exchange	1	16.1	81.8
BME Spanish Exchanges	29	1512.5	9526.3
Borsa Italiana	321	6680.7	59873.1
Budapest SE	1	1.6	13.2
Deutsche Börse	368	25050.3	178746.8
Euronext	373	13843.9	127584.5
Irish SE	14	14.9	150.4
Istanbul SE	9	492.3	6328.0
JSE	20	369.7	3086.7
Ljubljana SE	3	0.0	0.5
London SE	393	11591.3	89129.8
OMX Nordic Exchange	10	3372.3	24635.0
Oslo Børs	6	1428.4	7440.2
Swiss Exchange	142	5922.4	27074.2
Tel Aviv SE	338	2702.5	33615.1
Wiener Börse	22	18.5	339.0

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

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