

AEX Covered Call index



Specifications

Full name : AEX Covered Call
Underlying index : AEX Total Return
underlying index option : AEX index options (AEX)
Roller over : monthly (3r Friday of expiry month)
Calculation : Continuous (30 seconds)
Mnemonic : AEXCC
ISIN : QS0011054325
Codes vendors : Reuters (.AEXCC); Bloomberg (AEXCC Index<GO>)

Historical

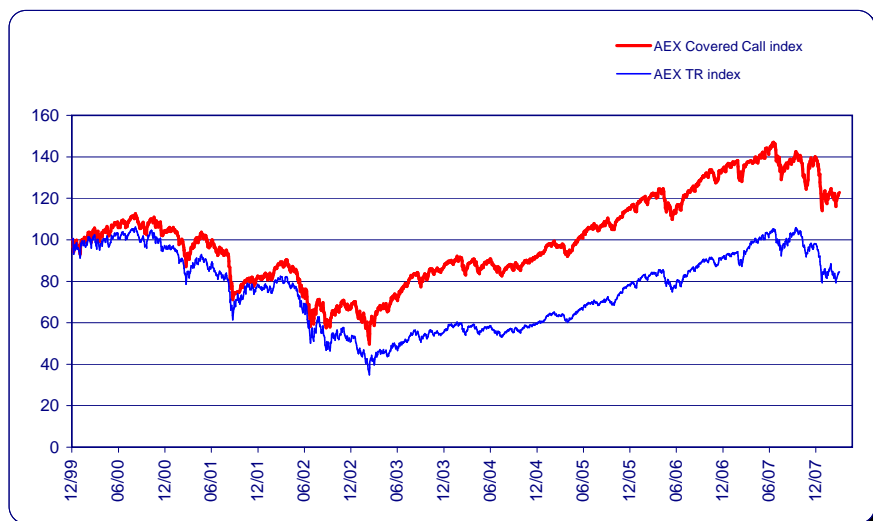
Base date : 30/12/1999 (base value = 100)
Available since : 30/12/1999
Launching date : 19/06/2007

Statistics * as 31/03/2008

Closing * : 122,83
Live high : 147,02
Live low : 49,61
Correlation (with AEX) :** 0,95
Tracking error ** (with AEX) : 0,07

*** Correlation and tracking error are based on the index variations*

AEX Covered Call index and AEX TR index



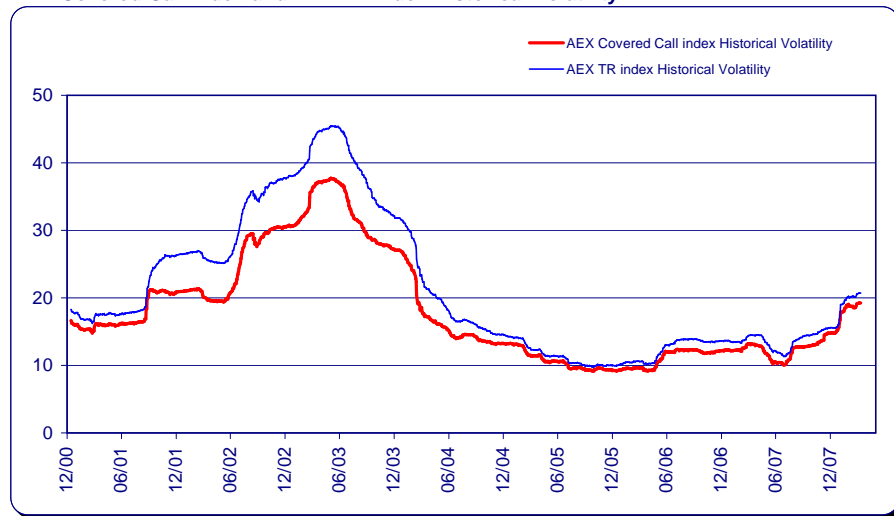
AEXCC * as 31/03/2008

Year	AEXCC			AEX® TR				Sup-perform%
	Index level	%Perf.	Volatility	Underl. index	%Perf.	Volatility	Correlation**	
30/12/1999	100,00			1198,09				
29/12/2000	103,97	3,97%	17,05	1158,01	-3,35%	19,04	0,99	7,32%
28/12/2001	82,55	-20,60%	20,80	941,33	-18,71%	26,25	0,88	-1,89%
31/12/2002	67,44	-18,30%	30,37	616,65	-34,49%	37,54	0,97	16,19%
31/12/2003	87,31	29,46%	26,94	668,67	8,44%	31,83	0,98	21,03%
31/12/2004	91,90	5,26%	13,06	713,89	6,76%	14,36	0,98	-1,51%
30/12/2005	114,59	24,69%	9,26	932,04	30,56%	10,00	0,98	-5,87%
29/12/2006	133,46	16,47%	12,19	1092,25	17,19%	13,61	0,99	-0,72%
31/12/2007	139,47	4,50%	14,74	1174,29	7,51%	15,48	0,86	-3,01%
All period		39,47%	19,65		-1,99%	23,43	0,95	41,46%

AEXCC * as 31/03/2008

Month	AEXCC			AEX® TR				Sup-perform%
	Index level	%Perf.	Volatility	Underl. index	%Perf.	Volatility	Correlation**	
31/12/2007	139,47			1174,29				
31/01/2008	120,74	-13,43%	33,98	1004,97	-14,42%	36,95	0,90	0,99%
29/02/2008	122,52	1,47%	23,77	1018,72	1,37%	27,01	0,97	0,11%
31/03/2008	122,83	0,25%	22,28	1012,34	-0,63%	25,39	0,99	0,88%
Year to date		-11,93%	19,66		-13,79%	23,22	0,95	1,86%

AEX Covered Call index and AEX TR index Historical Volatility



Indice AEX Covered Call



Caractéristiques

Nom complet : AEX Covered Call
Sous jacent : AEX Total Return
Contrat d'option : Option sur AEX (AEX)
Roulement : mensuel (3è Vendredi du mois d'échéance)
Calcul : Continu (30 secondes)
Mnémonique : AEXCC
ISIN : QS0011054325
Codes vendors : Reuters (.AEXCC); Bloomberg (AEXCC Index<GO>)

Données historiques

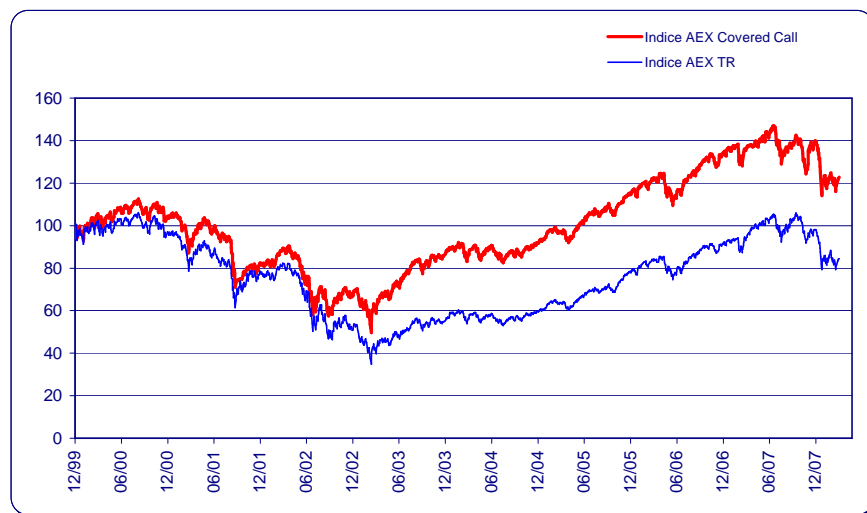
Date de base : 30/12/1999 (base value = 100)
Disponibles depuis : 30/12/1999
Date de lancement : 19/06/2007

Statistiques * au 31/03/2008

Clôture * : 122,83
Plus haut historique : 147,02
Plus bas historique : 49,61
Corrélation (avec AEX) :** 0,95
Tracking error ** (avec AEX) : 0,07

*** Corrélation et tracking error sont calculées sur les variations des indices*

Indice AEX Covered Call et Indice AEX TR



AEXCC				AEX@ TR				* au 31/03/2008	
Année	Indice	%Perf.	Volatilité	Support	%Perf.	Volatilité	Corrélation**	Sup-perform%	
30/12/1999	100,00			1198,09					
29/12/2000	103,97	3,97%	17,05	1158,01	-3,35%	19,04	0,99	7,32%	
28/12/2001	82,55	-20,60%	20,80	941,33	-18,71%	26,25	0,88	-1,89%	
31/12/2002	67,44	-18,30%	30,37	616,65	-34,49%	37,54	0,97	16,19%	
31/12/2003	87,31	29,46%	26,94	668,67	8,44%	31,83	0,98	21,03%	
31/12/2004	91,90	5,26%	13,06	713,89	6,76%	14,36	0,98	-1,51%	
30/12/2005	114,59	24,69%	9,26	932,04	30,56%	10,00	0,98	-5,87%	
29/12/2006	133,46	16,47%	12,19	1092,25	17,19%	13,61	0,99	-0,72%	
31/12/2007	139,47	4,50%	14,74	1174,29	7,51%	15,48	0,86	-3,01%	
Toute période		39,47%	19,65		-1,99%	23,43	0,95	41,46%	

AEXCC				AEX@ TR					
Mois	Indice	%Perf.	Volatilité	Support	%Perf.	Volatilité	Corrélation**	Sup-perform%	
31/12/2007	139,47			1174,29					
31/01/2008	120,74	-13,43%	33,98	1004,97	-14,42%	36,95	0,90	0,99%	
29/02/2008	122,52	1,47%	23,77	1018,72	1,37%	27,01	0,97	0,11%	
31/03/2008	122,83	0,25%	22,28	1012,34	-0,63%	25,39	0,99	0,88%	
Sur l'année		-11,93%	19,66		-13,79%	23,22	0,95	1,86%	

Indice AEX Covered Call et Indice AEX TR Volatilité historique

