

Indice CAC 40® Volatility

* au 31/03/2008

Caractéristiques

Nom complet : CAC 40 Volatility
Sous jacent : indice CAC 40
Contrat d'option : Option sur CAC 40 (PXA)
Horizon : 30 jours
Calcul : Continu (60 secondes)
Mnémonique : VCAC
ISIN : QS0011052139
Codes vendeurs : Reuters {VCAC}; Bloomberg {VCAC Index<GO>}

Historique

Disponible depuis : 03/01/2000
Date de lancement : 03/09/2007

Données

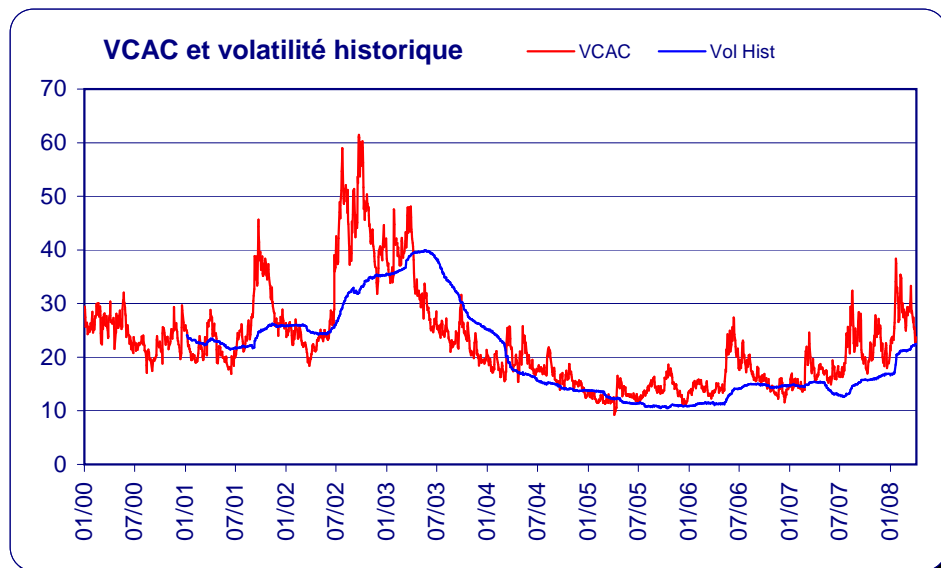
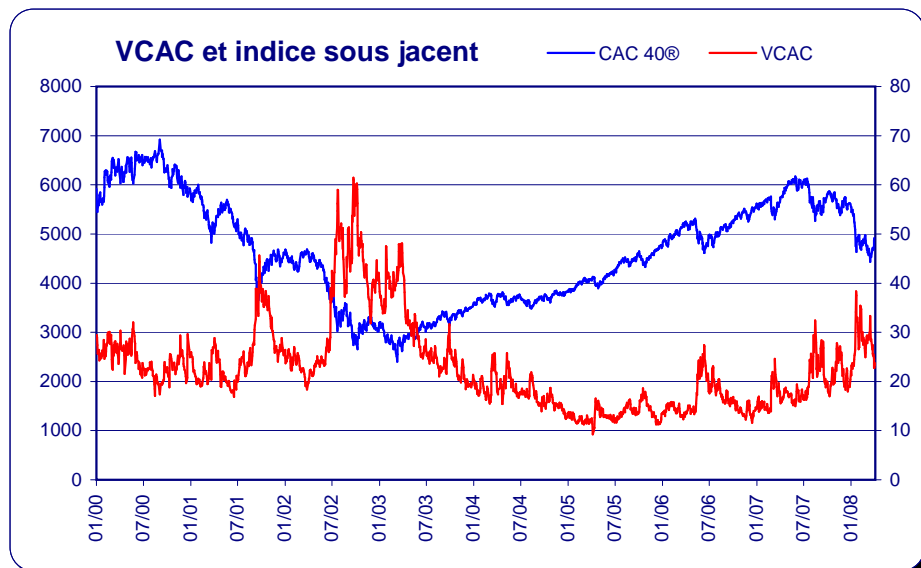
* au 31/03/2008

Cloture * : 24,55
Plus haut : 61,46
Plus bas : 9,24
Corrélation (avec CAC) :** -0,56

** Les corrélation sont calculées à partir des variations des indices

Année	Indice	%	Support	%	Corrélation**
03/01/2000	28,48		5917,37		
29/12/2000	24,95	-12,40%	5926,42	0,15%	-0,59
28/12/2001	25,85	3,63%	4624,58	-21,97%	-0,35
31/12/2002	42,12	62,92%	3063,91	-33,75%	-0,58
31/12/2003	21,36	-49,30%	3557,90	16,12%	-0,57
31/12/2004	13,48	-36,90%	3821,16	7,40%	-0,79
30/12/2005	13,38	-0,74%	4715,23	23,40%	-0,75
29/12/2006	14,72	10,01%	5541,76	17,53%	-0,85
31/12/2007	20,37	38,42%	5614,08	1,31%	-0,86

Mois	Indice	%	Support	%	Corrélation**
31/12/2007	20,37		5614,08		
31/01/2008	29,17	43,20%	4869,79	-13,26%	-0,57
29/02/2008	27,82	-4,63%	4790,66	-1,62%	-0,90
31/03/2008	24,55	-11,75%	4707,07	-1,74%	-0,81



CAC 40® Volatility index

* as 31/03/2008

Specifications

Full name : CAC 40 Volatility
Underlying index : CAC 40 index
Underlying index option : CAC 40 index options (PXA)
Horizon : 30 days
Calculation : Continuous (60 seconds)
Mnemonic : VCAC
ISIN : QS0011052139
Vendors codes : Reuters {VCAC}; Bloomberg {VCAC Index<GO>}

Back history

Available since : 03/01/2000
Launch date : 03/09/2007

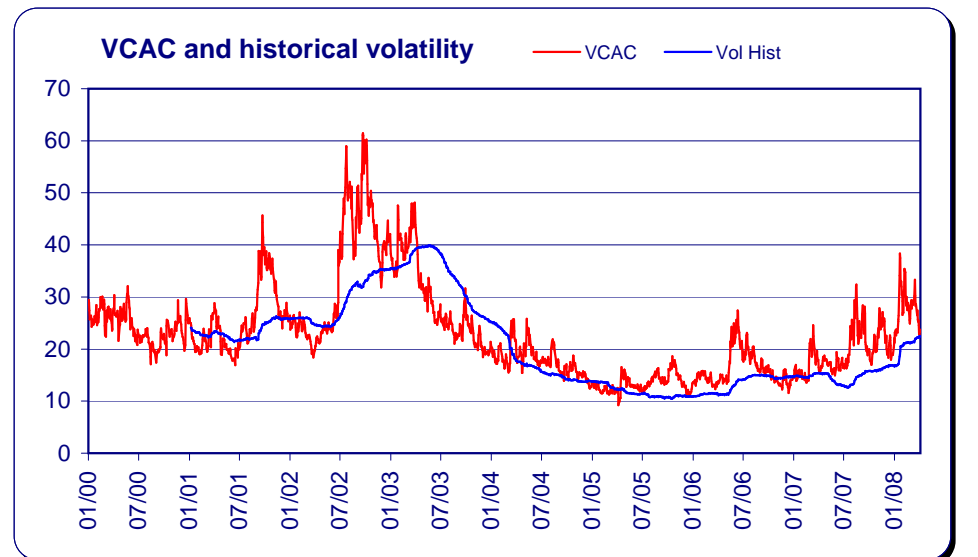
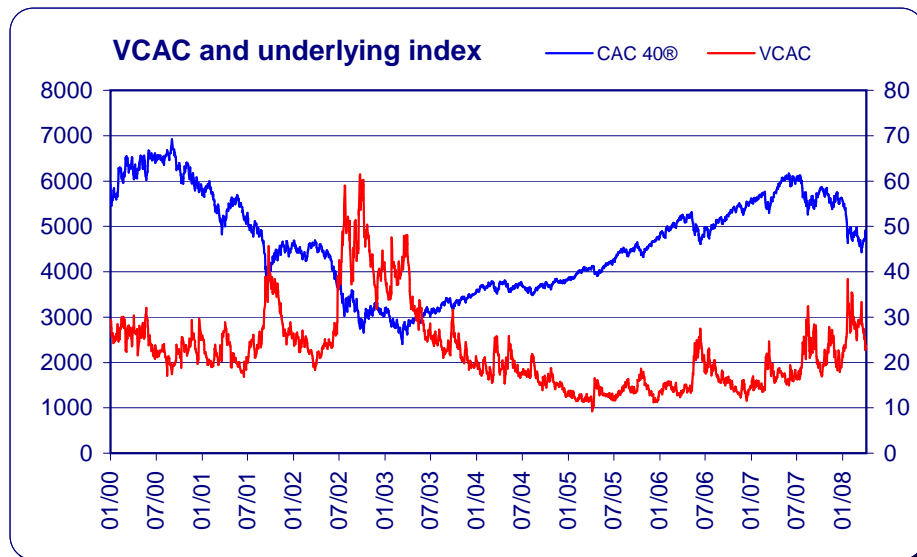
Data * as 31/03/2008

Closing * : 24,55
Live high : 61,46
Live low : 9,24
Correlation (with CAC 40) :** -0,56

** Correlation is based on the index variations

Year	Index level	%	Underlying	%	Correlation**
03/01/2000	28,48		5917,37		
29/12/2000	24,95	-12,40%	5926,42	0,15%	-0,59
28/12/2001	25,85	3,63%	4624,58	-21,97%	-0,35
31/12/2002	42,12	62,92%	3063,91	-33,75%	-0,58
31/12/2003	21,36	-49,30%	3557,90	16,12%	-0,57
31/12/2004	13,48	-36,90%	3821,16	7,40%	-0,79
30/12/2005	13,38	-0,74%	4715,23	23,40%	-0,75
29/12/2006	14,72	10,01%	5541,76	17,53%	-0,85
31/12/2007	20,37	38,42%	5614,08	1,31%	-0,86

Month	Index level	%	Underlying	%	Correlation**
31/12/2007	20,37		5614,08		
31/01/2008	29,17	43,20%	4869,79	-13,26%	-0,57
29/02/2008	27,82	-4,63%	4790,66	-1,62%	-0,90
31/03/2008	24,55	-11,75%	4707,07	-1,74%	-0,81



CAC 40® Volatility index

Karakteristieken

Volledige naam : CAC 40 Volatility
Onderliggende index : CAC 40 index
Optie klasse : CAC 40 index opties (PXA)
Horizon : 30 Dagen
Calculatie frequentie : Continu (elke 60 seconden)
Symbol : VCAC
ISIN : QS0011052139
Vendor codes : Reuters {VCAC}; Bloomberg {VCAC Index<GO>}

Historie

Beschikbaar sinds : 03/01/2000
Lanceerdatum : 03/09/2007

Data

* per 31/03/2008

Slot * : 24,55
Hoog : 61,46
Laag : 9,24
Correlatie (met CAC 40) :** -0,56

** De correlatie is gebaseerd op de index variaties

* per 31/03/2008

Jaar	Index	%	Onderliggend	%	Correlatie**
03/01/2000	28,48		5917,37		
29/12/2000	24,95	-12,40%	5926,42	0,15%	-0,59
28/12/2001	25,85	3,63%	4624,58	-21,97%	-0,35
31/12/2002	42,12	62,92%	3063,91	-33,75%	-0,58
31/12/2003	21,36	-49,30%	3557,90	16,12%	-0,57
31/12/2004	13,48	-36,90%	3821,16	7,40%	-0,79
30/12/2005	13,38	-0,74%	4715,23	23,40%	-0,75
29/12/2006	14,72	10,01%	5541,76	17,53%	-0,85
31/12/2007	20,37	38,42%	5614,08	1,31%	-0,86

Maand	Index	%	Onderliggend	%	Correlatie**
31/12/2007	20,37		5614,08		
31/01/2008	29,17	43,20%	4869,79	-13,26%	-0,57
29/02/2008	27,82	-4,63%	4790,66	-1,62%	-0,90
31/03/2008	24,55	-11,75%	4707,07	-1,74%	-0,81

