

NYSE Euronext et FTSE lancent l'indice FTSE 100 Volatility Index

Le 12 juin 2008 - NYSE Euronext et FTSE Group annoncent la création d'un nouvel indice de volatilité, le FTSE 100[®] Volatility Index. Mis en place à partir du 23 juin 2008, cet indice permettra de mesurer en temps réel la volatilité implicite du prix des options sur l'indice FTSE 100 disponibles sur Liffe, le marché européen des produits dérivés du groupe NYSE Euronext,

Fruit de la réunion des compétences de NYSE Euronext et du FTSE Group, le FTSE 100[®] Volatility Index (VFTSE) sera calculé d'une manière transparente à partir des prix d'exercice hors de la monnaie des options d'achat et de vente du FTSE 100. Exprimé en points de pourcentage, il reflètera, sur une base annualisée, la variation attendue de l'indice sous-jacent durant les 30 jours suivants.

Les intervenants de marché peuvent utiliser les indices de volatilité comme de véritables baromètres : un niveau élevé traduit des anticipations de fluctuations plus importantes de l'indice sous-jacent, et inversement.

Imogen Dillon-Hatcher, Managing Director, FTSE Europe Middle East and Africa, déclare : « FTSE Group collabore régulièrement avec ses partenaires afin de produire de nouveaux indices innovants. Grace à l'association de l'expertise en matière d'indices et de la connaissance des besoins du marché de FTSE et NYSE Euronext, le FTSE 100[®] Volatility Index permettra aux investisseurs d'analyser plus en profondeur ce marché complexe. »

Jonathan Seymour, Directeur des dérivés sur actions au Liffe, ajoute : « Le VFTSE fournira une mesure instantanée de la volatilité implicite à court terme des options sur l'indice FTSE 100. Il constituera ainsi un indicateur du facteur plus connu sous le nom de 'fear factor' ».

Informations complémentaires :

L'indice FTSE 100[®] Volatility Index est calculé par NYSE Euronext à partir de la méthodologie VIX[®], un indicateur financier pour le marché américain basé sur le prix des options sur l'indice S&P500 cotées sur le CBOE.

ISIN	Mnémonique	Nom complet	Indice sous-jacent
QS0011052162	VFTSE	FTSE 100 Volatility Index	FTSE 100

Pour plus d'information :

NYSE Euronext :

www.euronext.com

<http://volatility.euronext.com>

Indices FTSE :

www.ftse.com

www.ftseurofirst.com

Contacts presse :

NYSE Euronext :

Amsterdam +31 20 550 4488

Brussels +32 2 509 1392

Lisbon +351 217 900 029

London +44 20 7379 2789

Paris +33 1 49 27 11 33

FTSE :

Sabrina Bhangoo

+44 (0)20 7866 1821

A propos de FTSE Group

FTSE Group est l'un des leaders mondiaux en matière de création et de gestion d'indices. Avec des bureaux à Londres, Francfort, Hong Kong, Madrid, Paris, New York, San Francisco et Tokyo, FTSE Group sert ses clients dans 77 pays. Il calcule et gère la gamme d'indices FTSE Global Equity, incluant des indices reconnus mondialement : l'indice FTSE All-World, la gamme des indices FTSE4Good, la gamme des indices FTSEurofirst et des indices domestiques tels que le prestigieux FTSE 100.

A propos de NYSE Euronext

NYSE Euronext (NYX), le groupe boursier le plus important et le plus liquide au monde, a pour mission d'offrir les plus hauts niveaux de qualité, un vaste choix à ses clients et une innovation permanente. Les marchés boursiers qu'il regroupe, basés dans 6 pays, incluent le New York Stock Exchange, le plus grand marché d'actions au monde ; Euronext, le plus grand marché d'actions de la zone Euro ; Liffe, le premier marché dérivés en Europe en valeur des échanges ; et NYSE Arca Options, l'une des plateformes de négociation d'options enregistrant la plus forte croissance aux Etats-Unis. NYSE Euronext offre une gamme diversifiée de produits et de services financiers pour les investisseurs, les émetteurs et les institutions financières : actions, contrats à terme et options, ETF, obligations, données de marché et solutions technologiques.

Près de 4.000 sociétés sont cotées sur les marchés de NYSE Euronext, représentant une capitalisation boursière globale de 19.800 milliards d'euros /30.900 milliards de dollars (au 30 avril 2008), soit plus de 4 fois la capitalisation boursière de tout autre groupe boursier. Les marchés au comptant de NYSE Euronext enregistrent une valeur moyenne d'échanges d'approximativement 106,9 milliards d'euros / 161,9 milliards de dollars par jour (au 30 avril 2008), soit plus d'un tiers des échanges mondiaux sur les marchés cash. NYSE Euronext fait partie de l'indice S&P 500 et est le seul opérateur boursier appartenant à l'indice S&P 100. Pour plus d'informations : www.nyx.com

A propos de Liffe

Liffe est marché européen des produits dérivés du groupe NYSE Euronext. Liffe offre une gamme de produits dérivés, futures et options, disponibles via sa plate-forme électronique de négociation LIFFE CONNECT[®]. Plus de €2.300 milliards sont négociés sur Liffe chaque jour, ce qui en fait la deuxième plus importante bourse de produits dérivés au monde, par la valeur.

VIX[®] est une marque déposée de CBOE.