

2011年市場統計數據

	頁
1. 2011年市場創新紀錄	1
2. 證券市場統計數據	2 - 11
3. 在香港上市的內地股份統計數據	12 - 16
4. 衍生產品市場統計數據	17 - 19
5. 中央結算系統統計數據	20 - 21
6. 參與者統計數據	22

2011年市場創新紀錄

證券市場

(港元)	計至2011年12月31日	2011年之前最高紀錄
股份成交總數	399,073 億股	349,912 億股 (2010年)
交易宗數	2.149 億	1.939 億 (2010年)
牛熊證成交金額	18,521 億元	16,761 億元 (2009年)
牛熊證單日成交金額	158 億元 (2011年10月11日)	140 億元 (2010年11月12日)
房地產投資信託基金成交金額	555 億元	515 億元 (2007年)

衍生產品市場

成交量	計至2011年12月31日 (合約張數)	2011年之前最高紀錄 (合約張數)
所有期貨及期權	140,493,472	116,054,377 (2010年)
期貨及期權單日成交總數	1,256,038 (2011年9月28日)	1,180,005 (2008年3月26日)
所有期貨	50,741,995	44,721,743 (2008年)
所有期權	89,751,477	73,047,854 (2010年)
恒生指數期貨	23,085,833	21,716,508 (2008年)
小型恒生指數期貨	10,294,537	9,279,877 (2009年)
H股指數期貨	15,003,870	14,440,965 (2008年)
小型H股指數期貨	1,845,116	992,224 (2010年)
股票期貨	444,014	351,514 (2007年)
恒生指數期權	10,667,426	8,515,049 (2010年)
小型恒生指數期權	954,414	482,691 (2010年)
H股指數期權	3,771,799	2,910,713 (2010年)
股票期權	74,325,068	61,125,647 (2010年)
未平倉合約		
H股指數期貨	177,892 (2011年9月28日)	162,527 (2010年10月27日)
小型H股指數期貨	6,030 (2011年6月17日)	2,728 (2010年12月28日)
小型恒生指數期貨	21,682 (2011年6月17日)	11,148 (2009年7月29日)
股票期貨	26,482 (2011年8月25日)	25,956 (2007年3月14日)
H股指數期權	380,344 (2011年12月28日)	344,647 (2009年12月29日)
恒生指數期權	483,835 (2011年9月28日)	477,129 (2010年12月29日)
小型恒生指數期權	22,086 (2011年8月29日)	15,016 (2010年10月27日)
股票期權	9,218,955 (2011年11月28日)	8,825,259 (2010年11月26日)

證券市場

市場表現

	主板 截至			創業板 截至		
	2011年底	2010年底	% 變幅	2011年底	2010年底	% 變幅
市值 (億港元) [◇]	174,527	209,423	-16.66	846	1,347	-37.19
上市公司數目*	1,326	1,244 [#]	6.59	170	169	0.59
全年新上市公司數目*	88 ^{**}	106 ^{^#}	-16.98	13	7	85.71
除牌公司數目	6	7	-14.29	12 ^{**}	12 [^]	0.00
上市證券數目	6,551	7,730	-15.25	172	170	1.18
- 股份	1,330	1,248 [#]	6.57	170	169	0.59
- 認股權證						
▪ 股本權證	13	22	-40.91	2	1	100.00
▪ 衍生權證	4,027	5,148	-21.78	不適用	不適用	
- 牛熊證	901	1,064	-15.32	不適用	不適用	
- 債券	192	169	13.61	不適用	不適用	
- 單位信託基金及互惠基金						
▪ 交易所買賣基金 ⁺	77	69	11.59	不適用	不適用	
▪ 房地產投資信託基金 [△]	9	8	12.50	不適用	不適用	
▪ 其他	2	2	0.00	不適用	不適用	

[◇] 數字代表所有股本證券總市值，當中並不包括其他上市證券例如房地產投資信託基金及債券的市值。數字亦不包括外國公司所發行的上市證券(除非有關證券僅在香港上市)以及試驗計劃下非上市可交易的股份。外國公司是指那些在海外註冊及大部分業務均在香港及中國內地以外的公司。

* 並不包括股份以外的其他上市證券，例如房地產投資信託基金及債券

[#] 包括由1家公司所發行的2隻預託證券

[^] 包括12家由創業板轉到主板上市的公司

^{**} 包括12家由創業板轉到主板上市的公司

⁺ 並未包括試驗計劃下2隻非上市可交易的 iShares

[△] 包括一隻以人民幣計價的房地產投資信託基金

變幅百分比以四捨五入後之數字計算

市場表現(續)

	主板 截至			創業板 截至		
	2011年底	2010年底	% 變幅	2011年底	2010年底	% 變幅
集資總額 (百萬港元)	1,230,194.4	1,673,962.1	-26.51	7,480.9	13,242.2	-43.51
股份集資總額 (百萬港元)	481,173.4	845,486.1	-43.09	7,472.9	13,235.0	-43.54
- 首次公開招股集資額	257,969.1	448,828.0	-42.52	1,315.1	649.3	102.54
- 上市後集資額	223,204.3	396,658.1	-43.73	6,157.8	12,585.7	-51.07
其他新上市證券的集資金額 (百萬港元)						
- 認股權證						
▪ 股本權證	28	26	7.69	8	7	14.29
▪ 衍生權證	273,296	328,115	-16.71	不適用	不適用	
- 牛熊證	310,700	360,053	-13.71	不適用	不適用	
- 債券	152,489	140,282	8.70	不適用	不適用	
- 單位信託基金及互惠基金						
▪ 交易所買賣基金*	不適用	不適用	-	不適用	不適用	
▪ 房地產投資信託基金	12,508	0	-	不適用	不適用	
▪ 其他	0	0	-	不適用	不適用	
全年成交金額 # (百萬港元)	17,091,116	17,076,412	0.09	62,958	133,666	-52.90
- 股份	12,006,009	12,277,665	-2.21	62,953	133,644	-52.90
- 認股權證						
▪ 股本權證	924	1,790	-48.48	4.1	22.1	-81.45
▪ 衍生權證	2,629,886	2,692,462	-2.32	不適用	不適用	
- 牛熊證	1,852,136	1,455,404	27.26	不適用	不適用	
- 債券	843	2	42,050.00	不適用	不適用	
- 單位信託基金及互惠基金						
▪ 交易所買賣基金	545,295	604,458	-9.79	不適用	不適用	
▪ 房地產投資信託基金	55,524	43,890	26.51	不適用	不適用	
▪ 其他	499	741	-32.66	不適用	不適用	
平均每日成交金額 (百萬港元)	69,476	68,580	1.31	256	537	-52.33
交易日數	246	249		246	249	

2011年的集資金額為暫計數字

* 並非經首次公開招股

由2010年11月29日起計入以外幣進行的交易

變幅百分比以四捨五入後之數字計算

由於以四捨五入的方法計算，數字相加後不一定等於小計或總計的數字

收市指數

	<u>2011年12月30日</u>	於 <u>2010年12月31日</u>	<u>% 變幅</u>
恒生指數	18434.39	23035.45	-19.97
恒生中國企業指數 (H股)	9936.48	12692.43	-21.71
恒生香港中資企業指數 (紅籌股)	3682.18	4170.15	-11.70
標準普爾/香港交易所大型股指數	22252.19	27392.78	-18.77
標準普爾/香港交易所創業板指數	474.80	810.52	-41.42

首次公開招股集資金額 (2011年1月至12月)

(百萬美元)

排名	交易所	首次公開招股集資金額
1	香港	33,292.3
2	紐約泛歐交易所 (美國)	28,040.3
3	深圳	27,935.0
4	倫敦	21,375.7
5	澳洲	16,205.4
6	上海	15,722.3
7	納斯達克 - OMX	10,957.8
8	西班牙 *	8,741.2
9	新加坡 #	7,630.1
10	多倫多	7,082.6

資料來源: 國際證券交易所聯會每月數據 (除倫敦證券交易所及多倫多證券交易所集團外, 不包括其他沒有提供數據的交易所。倫敦證券交易所及多倫多證券交易所集團的有關數字取自其網站, 而多倫多證券交易所集團的數字包括TSX Venture交易所的數字)

* 西班牙交易所的首次公開招股集資額是從該交易所網站查證所得, 因為來自國際證券交易所聯會的數字未能核實

新加坡交易所的數字包括新交所主板及Sesdaq的集資額

上述為暫計數字

股份集資總額 (2011年1月至12月)

(百萬美元)

排名	交易所	股份集資總額
1	紐約泛歐交易所 (美國)	111,330.5
2	深圳	73,772.0
3	香港	62,774.8
4	多倫多	51,966.5
5	澳洲	51,052.6
6	上海	49,551.5
7	巴西	38,241.3
8	倫敦	37,105.5
9	西班牙 *	35,493.5
10	東京	15,354.9

資料來源: 國際證券交易所聯會每月數據 (除倫敦證券交易所及多倫多證券交易所集團外, 不包括其他沒有提供數據的交易所。倫敦證券交易所及多倫多證券交易所集團的有關數字取自其網站, 而多倫多證券交易所集團的數字包括TSX Venture交易所的數字)

* 西班牙交易所的首次公開招股集資額是從該交易所網站查證所得, 因為來自國際證券交易所聯會的數字未能核實。西班牙交易所的上市後集資額則取自國際證券交易所聯會每月數據

上述為暫計數字

各地市場上市公司股份之市值 (主板及並行市場) (於2011年12月底)

(百萬美元)

交易所	排名	2011年12月市值	排名	2010年12月市值	% 變幅
紐約泛歐交易所 (美國)	1	11,795,575.5	1	13,394,081.8	-11.9
納斯達克 - OMX	2	3,845,131.6	2	3,889,369.9	-1.1
東京	3	3,325,387.8	3	3,827,774.2	-13.1
倫敦	4	3,266,418.1	4	3,613,064.0	-9.6
紐約泛歐交易所 (歐洲)	5	2,446,767.5	5	2,930,072.4	-16.5
上海	6	2,357,423.3	6	2,716,470.2	-13.2
香港	7	2,258,035.2	7	2,711,316.2	-16.7
多倫多 *	8	1,912,121.9	8	2,170,432.7	-11.9
巴西	9	1,228,936.2	11	1,545,565.7	-20.5
澳洲	10	1,198,187.4	12	1,454,490.6	-17.6

資料來源: 國際證券交易所聯會每月數據 (不包括沒有提供數據的交易所)

投資基金不計算在市值內

* 多倫多證券交易所集團包括TSX Venture交易所的市值

變幅百分比以四捨五入後之數字計算

股份交投總值(主板及並行市場) (2011年1月至12月)

排名	交易所	股份交投總值 (百萬美元)
1	納斯達克 - OMX	28,913,477.1
2	紐約泛歐交易所(美國)	19,328,725.8
3	東京	4,355,750.4
4	倫敦	4,280,134.8
5	紐約泛歐交易所(歐洲)	3,947,075.6
6	上海	3,668,477.2
7	深圳	2,849,075.0
8	德國	2,144,542.7
9	南韓 *	2,050,663.3
10	香港	1,551,051.9

資料來源：國際證券交易所聯會每月數據（不包括沒有提供數據的交易所）

* 韓國交易所的數字包括Kosdaq的市場數據

上述數字是電子買賣盤交易、議定交易(negotiated deals)及申報交易的價值總和；由2011年起，國際證券交易所聯會的統計數字將此三類交易的數字分開呈列。基於匯報規則及計算方法不同，各家交易所的股份交投總值不能完全直接比較。

證券化衍生產品(包括權證、牛熊證)總成交金額 (2011年1月至12月)

(百萬美元)

排名	交易所	成交金額
1	香港	576,035.6
2	南韓	288,621.0
3	德國	96,562.1
4	瑞士	59,262.2
5	紐約泛歐交易所 (歐洲)	42,563.7
6	以色列	35,615.4
7	倫敦	20,196.0
8	台灣	9,719.2
9	新加坡	5,789.4
10	澳洲	3,650.0

資料來源: 國際證券交易所聯會每月數據 (不包括沒有提供數據的交易所)

因各交易所的匯報規則及計算方法有別，成交金額不能完全地作比較

數字包括衍生權證、股本權證、牛熊證及股票掛鈎票據等結構性產品的成交金額

2011年10家首次公開招股集資額最高的新上市公司
(截至2011年12月31日)

(億港元)

排名	公司名稱	首次公開招股集資額
1	Glencore International plc (805)	777.5
2	PRADA S.p.A. (1913)	192.3
3	上海醫藥集團股份有限公司 - H股 (2607)	160.1
4	周大福珠寶集團有限公司 (1929)	159.9
5	中信証券股份有限公司 - H股 (6030)	142.5
6	美高梅中國控股有限公司 (2282)	125.7
7	新華人壽保險股份有限公司 - H股 (1336)	102.9
8	新秀麗國際有限公司 (1910)	100.9
9	高鑫零售有限公司 (6808)	94.7
10	香港電訊信託與香港電訊有限公司 - 合訂證券 (6823)	93.0

自1986年10家首次公開招股集資額最高的新上市公司
(截至2011年12月31日)

(億港元)

排名	公司名稱	首次公開招股集資額
1	友邦保險控股有限公司 (1299)	1,590.8
2	中國工商銀行股份有限公司 - H 股 (1398)	1,249.5
3	中國農業銀行股份有限公司 - H 股 (1288)	935.2
4	中國銀行股份有限公司 - H 股 (3988)	867.4
5	Glencore International plc (805)	777.5
6	中國建設銀行股份有限公司 - H 股 (939)	715.8
7	中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司 (762)	436.1
8	中信銀行股份有限公司 - H 股 (998)	329.2
9	中國移動有限公司 (941)	326.7
10	中國民生銀行股份有限公司 - H 股 (1988)	312.3

在香港上市的內地股份統計數據

內地企業指下列企業：

H股公司

「H股公司」是指在中國內地註冊成立並由內地政府機構或個人控制的公司。

紅籌公司

「紅籌公司」是指在中國內地以外地區註冊成立並由內地政府機構控制的公司。

非H股內地民營企業

「非H股內地民營企業」是指在中國內地以外地區註冊成立並由內地個人控制的公司。

主板及創業板

內地企業表現

	於		2010年12月31日	% 變幅
	2011年12月31日			
上市公司數目	640 (43%)		592 (42%)	8
全年新上市公司數目	54[#] (53%)		72 [^] (64%)	-25
市值 (億港元)	97,237.5 (55%)		119,357.7 (57%)	-19

	截至		2010年12月31日	% 變幅
	2011年12月31日			
股份每日平均成交金額 (百萬港元)	32,384.6 (66%)		33,880.0 (68%)	-4
股份集資總額 (億港元)	2,257 * (46%)		4,736 (55%)	-52
▪ 首次公開招股集資額 (億港元)	948 * (37%)		2,244 (50%)	-58
▪ 上市後集資額 (億港元)	1,309 * (57%)		2,492 (61%)	-47
1993年1月以來的股份集資總額 (億港元)	32,085 * (56%)		29,828 (57%)	8

括號內為內地企業佔股本市場的百分比

[#] 包括12家H股公司、1家紅籌公司及41家非H股內地民營企業(其中9家非H股內地民營企業由創業板轉到主板上市)

[^] 包括12家H股公司、3家紅籌公司及57家非H股內地民營企業(其中5家H股公司由創業板轉到主板上市)

* 暫計數字

變幅百分比以四捨五入後之數字計算

主板及創業板

內地企業市值

於年度結算日	H股市值 (億港元)	紅籌股市值 (億港元)	非H股內地民營企業市值 (億港元)	內地企業總市值 (億港元)	內地企業佔股本市場 總市值百分比
2002	1,316.4	8,072.4	432.1	9,820.9	27
2003	4,081.8	11,977.7	737.4	16,796.9	30
2004	4,615.3	14,100.8	1,488.4	20,204.5	30
2005	12,869.2	17,108.0	1,943.8	31,920.9	39
2006	33,787.4	29,523.7	3,833.5	67,144.6	50
2007	50,795.2	55,244.4	14,450.6	120,490.1	58
2008	27,317.4	28,759.0	5,532.7	61,609.1	60
2009	47,134.8	38,686.9	18,615.8	104,437.5	58
2010	52,304.8	43,859.7	23,193.2	119,357.7	57
2011	41,012.7	40,025.2	16,199.5	97,237.5	55

主板及創業板

內地發行人數目

於年度結算日	H股發行人數目	紅籌股發行人數目	非H股內地民營企業 發行人數目	內地企業發行人總數	內地企業佔股本證券市場 上市公司數目百分比
2002	74	72	68	214	22
2003	92	72	85	249	24
2004	109	84	111	304	28
2005	120	89	126	335	30
2006	141	90	136	367	31
2007	146	93	200	439	35
2008	150	93	222	465	37
2009	156	97	271	524	40
2010	163	102	327	592	42
2011	168	107	365	640	43

主板及創業板

內地企業全年總成交金額

年份	H股全年總成交金額 (億港元)	紅籌股全年總成交金額 (億港元)	非H股內地民營企業 全年總成交金額 (億港元)	內地企業 全年總成交金額 (億港元)	內地企業佔股本市場 總成交金額百分比
2002	1,436.1	3,098.6	452.4	4,987.1	33
2003	5,061.5	4,943.3	513.8	10,518.6	46
2004	9,410.6	6,147.6	1,093.1	16,651.3	49
2005	9,533.1	6,040.6	994.0	16,567.7	46
2006	25,366.2	11,011.4	2,415.9	38,793.6	60
2007	77,725.3	27,364.4	10,404.3	115,494.1	69
2008	61,384.5	22,850.7	5,537.7	89,773.0	71
2009	51,683.1	19,380.5	12,302.0	83,365.5	72
2010	47,177.8	19,310.3	17,873.2	84,361.3	68
2011	46,668.6	17,001.5	15,996.1	79,666.2	66

衍生產品市場

衍生產品市場統計數據

	截至 2011年12月31日		截至 2010年12月31日	
	成交量 (合約張數)	期末 未平倉合約張數	成交量 (合約張數)	期末 未平倉合約張數
所有期貨	50,741,995	249,391	43,006,523	207,050
恒生指數期貨	23,085,833	86,409	21,031,085	88,816
小型恒生指數期貨	10,294,537	5,129	8,300,654	7,359
H股指數期貨	15,003,870	106,277	12,429,800	94,734
小型H股指數期貨	1,845,116	1,520	992,224	1,867
恒指股息點指數期貨 ¹	11,196	4,460	2,123	1,270
恒生國企股息點指數期貨 ²	53,054	34,270	4,667	1,138
股票期貨	444,014	11,277	239,259	11,514
一個月港元利率期貨	245	25	14	-
三個月港元利率期貨	414	24	1,055	267
黃金期貨	3,716	-	5,642	85
所有期權	89,751,477	5,687,407	73,047,854	5,679,352
恒生指數期權	10,667,426	184,402	8,515,049	187,784
小型恒生指數期權	954,414	3,873	482,691	4,859
自訂條款恒生指數期權 ³	9,260	7,510	11,222	500
H股指數期權	3,771,799	158,628	2,910,713	104,994
自訂條款H股指數期權 ⁴	23,510	3,500	2,532	-
股票期權	74,325,068	5,329,494	61,125,647	5,381,215
所有期貨及期權	140,493,472	5,936,798	116,054,377	5,886,402

¹ 恒指股息點指數期貨於2010年11月1日開始買賣

² 恒生國企股息點指數期貨於2010年11月1日開始買賣

³ 自訂條款恒生指數期權於2010年2月8日開始買賣

⁴ 自訂條款H股指數期權於2010年2月8日開始買賣

衍生產品市場成交合約張數 (2011年1月至12月)

排名	交易所	成交合約張數 (百萬)
1	南韓	3,856.5
2	芝加哥商業交易所集團 (CME Group)	2,313.4
3	EUREX	2,034.7
4	巴西	1,251.9
5	印度	1,220.9
6	NYSE. Liffe Europe	1,094.1
7	芝加哥期權交易所	836.5
8	NASDAQ OMX (美國)	706.5
9	紐約泛歐交易所 (美國)	651.4
10	國際證券交易所	461.6
⋮	⋮	⋮
⋮	⋮	⋮
13	香港	139.4

資料來源：國際證券交易所聯會每月數據 (不包括沒有提供數據的交易所)

數字包括股票期權、單一股票期貨、股票指數期權及期貨以及債券期權及期貨

注意：每張合約金額不盡相同

上述為暫計數字

衍生產品市場名義成交額 (2011年1月至12月)

排名	交易所	名義成交額 (百萬美元)
1	芝加哥商業交易所集團 (CME Group)	973,914,610.0
2	NYSE.Liffe Europe	567,399,983.0
3	EUREX	150,552,640.0
4	南韓	100,710,773.3
5	巴西	86,268,318.0
6	印度	6,871,258.9
7	香港	6,540,240.1
8	OMX Nordic Exchange	6,017,319.7
9	臺灣期貨交易所	3,788,155.4
10	大阪	3,665,730.0

資料來源：國際證券交易所聯會每月數據 (不包括沒有提供數據的交易所)

部份交易所只提供有關成交合約張數的數據，而未有提供相應的名義成交金額的數據。讀者比較各交易所表現時宜特別留意

數字包括股票期權、單一股票期貨、股票指數期權及期貨以及債券期權及期貨

衍生產品的名義價值指成交合約張數乘以合約的相關價值；合約的相關價值則指將每份合約的相關資產的市價乘以該合約的合約乘數。
名義價值可大致衡量成交合約的相關價值

上述為暫計數字

中央結算系統統計資料

計至年底

2011

2010

經中央結算系統處理之聯交所交易 (每日平均數)

- 交易宗數	872,796	778,854
- 交易金額	697億元	691億元
- 涉及股數	1,622億	1,405億

經中央結算系統處理的交收指示 (每日平均數)

- 交收指示數目	83,760	80,149
- 交收指示涉及金額	2,107億元	1,879億元
- 涉及股數	477億	472億

經中央結算系統處理的投資者交收指示 (每日平均數)

- 投資者交收指示數目	468	574
- 投資者交收指示涉及金額	2.6億元	2.7億元
- 涉及股數	1.2億	1.2億

不包括以美元進行的證券交易

中央結算系統統計資料

	計至年底	
	2011	2010
以「持續淨額交收」的交易於到期交收日(T+2)的交收效率(每日平均數)	99.88%	99.88%
以「持續淨額交收」的交易於到期交收翌日(T+3)的交收效率(每日平均數)	99.99%	99.99%
在T+3日進行補購(每日平均數)		
- 涉及經紀數目	6	8
- 補購宗數	7	9
- 補購涉及金額	240萬元	310萬元
存放在中央結算系統證券存管處的股份		
- 股數	36,942億	38,341億
- 獲納入系統的證券佔已發行股本總數的百分比	70.17%	71.80%
- 股份價值	95,999億元	112,945億元
- 獲納入系統的證券佔總市值的百分比	50.23%	49.57%

不包括以美元進行的證券交易

參與者統計數據

	聯交所 於年底		期交所 於年底	
	2011	2010	2011	2010
交易所參與者	534	516	182	179
開業	498	485	182	179
非開業	36	31	不適用	不適用

結算所參與者

中央結算系統	2011年底	2010年底
直接結算參與者	482	468
全面結算參與者	8	7
結算機構參與者	1	1
託管商參與者	41	38
股份承押人參與者	5	5

期貨結算公司

結算參與者	156	153
全面結算參與者	10	9

聯交所期權結算所

直接結算參與者	59	56
全面結算參與者	7	6

註：

中央結算系統

直接結算參與者必須為聯交所的交易所參與者

全面結算參與者可為本身完成的證券交易進行結算(如適用)，及可為與其訂有結算協議的非結算參與者進行結算

結算機構參與者必須為營運中央證券結算及交收系統或中央證券存管系統的機構。現時唯一的結算機構參與者為聯交所期權結算所

託管商參與者必須屬《銀行業條例》所指的認可機構、《受託人條例》所指的信託公司或《證券及期貨條例》所指的持牌法團

股份承押人參與者必須屬《銀行業條例》所指的認可機構或根據《放債人條例》領有牌照的放債人

期貨結算公司

結算參與者及全面結算參與者必須為期交所的交易所參與者

結算參與者可為本身完成的期貨合約及/或期權合約進行結算

全面結算參與者可為本身完成的期貨合約及/或期權合約進行結算，及可為與其訂有結算協議的非結算參與者的期貨合約及/或期權合約進行結算

聯交所期權結算所

直接結算參與者及全面結算參與者必須為聯交所的期權買賣交易所參與者

直接結算參與者可為本身完成的股票期權合約進行結算

全面結算參與者可為本身完成的股票期權合約進行結算，及可為與其訂有結算協議的非結算參與者的股票期權合約進行結算