



指数产品动态 (2012 年 1 月)

2012 年第 1 期 总第 24 期

■ 深圳证券信息有限公司指数事业部

→ 业内动态

❖ 首批 RQFII 产品在港发行

1 月 11 日, 首批 RQFII 产品在香港发售。海通人民币收益基金和汇添富人民币债券基金, 成为最早发售的两只 RQFII 产品。

汇添富债券基金, 其资产投资于债券比例不低于 80%, 股票投资比例不超过 20%; 个人客户可认购 A 类份额, 初次认购金额为人民币 1 万元, 机构客户可认购 I 类份额, 初次认购金额为人民币 300 万元。海通国际方面, 将用超过 80% 的资产配置于固定收益产品, 而其机构入场费为 1 千万元人民币, 散户入场费为 1 万元人民币。

❖ 证监会将放宽企业境外上市门槛 扩大 RQFII 额度

1 月 16 日, 中国证监会副主席姚刚出席在香港举行的“亚洲金融论坛”时表示, 今年证监会将全面修订企业境外上市法规, 适当放宽准入标准, 为中小企业、民营企业到我国香港地区等境外市场直接上市创造条件。

此外, 证监会将会尽快扩大 RQFII 额度, 推出以内地 A 股指数为标的、以人民币计价的 ETF 产品, 并把 RQFII 额度优先运用于 A 股 ETF, 促进离岸人民币合理回流境内市场。

❖ 证监会下发分级基金产品审核指引 提高投资门槛

证监会基金监管部日前下发《分级基金产品审核指引》, 对分级基金的认购、申购门槛、杠杆上限等作出了规定: 提高客户准入门槛, 最低认购额 5 万元; 增加了风险提示内容; 强调了销售适应性原则; 对杠杆比例做了定量规定。

据业内人士表示, 分级基金本身属于专业级的投资工具, 提高认购门槛, 首先是希望让更有投资经验和风险承受能力的投资人参与。其次, 强调销售适应性原则,



就是要将合适的产品卖给合适的人。再次，对杠杆比例的规定，也是为了降低分级基金的波动风险。

❖ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

➤ 新上市

长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金于 1 月 12 日上市。

➤ 新成立

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金于 1 月 30 日成立，首募 9.66 亿。

工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金于 1 月 31 日成立，首募 3.41 亿。

信诚沪深 300 指数分级基金于 2 月 1 日成立，首募 3.90 亿。

➤ 新发行

国泰中小板 300 成长指数证券投资基金及其联接基金于 1 月 30 日起发行。

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF) 于 2 月 6 日起发行。

中海上证 380 指数证券投资基金于 2 月 6 日起发行。

民生加银中证内地资源主题指数基金于 2 月 6 日起发行。

➤ 新获批

嘉实中创 400 交易型开放式指数基金及其联接基金于 1 月 6 日获批。

浙商沪深 300 指数分级基金于 1 月 18 日获批。

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数基金及联接基金于 1 月 21 日获批。

长安基金沪深 300 非周期行业指数基金于 1 月 30 日获批。

➤ 新申报

长盛基金于 1 月 19 日申报同辉深证 100 等权重指数分级基金。

大成基金于 1 月 19 日申报中证 500 沪市交易型开放式指数基金及其联接基金。



→ 市场要点

本地 ETF：本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 752 亿元增加至本期的 806.39 亿元。从基金份额和净值来看，本期深证 100ETF 基金份额增量和净值增量均最多，分别为 10.86 亿份和 15.82 亿元。而从申购赎回情况看，深证 100ETF 净申购金额最高，为 6.36 亿元；从跟踪误差情况看，本期最低的两只 ETF 分别为工银瑞信深证红利 ETF 和南方深成 ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额仍以上证 50ETF 和深 100ETF 领先，分别为 7.85 亿元和 5.83 亿元。

LOF：截止 2011 年 12 月 31 日，LOF 指数基金总资产净值为 504.15 亿元，较上季度减少 35.53 亿元。其中，嘉实 300 基金份额增量最多，为 12.34 亿份，嘉实 50 基金净值增量最多，为 3.08 亿元。2012 年 1 月，LOF 指数基金的场内规模为 51.62 亿份，较上月减少 0.64 亿份；场内资产净值为 34.92 亿元，较上月减少 1.01 亿元。

创新型指数基金：本期创新型指数基金四季报全部披露完毕，截止 2011 年 12 月 31 日，创新型指数基金总资产净值为 179.44 亿元，较上季度减少 26.34 亿元。其中，银华深证 100 指数分级的基金份额和基金净值增量最多，母子基金合计增加份额 20.36 亿份，基金净值合计增加 8.11 亿元。2012 年 1 月，创新型指数基金的场内规模为 182.97 亿份，较上月增加 12.91 亿份；场内资产净值为 147.88 亿元，较上月增加 11.50 亿元。

境外 ETF：24 只 ETF 本期末资产规模为 602 亿港币，较上期增长 8.27%。在本期市场普涨的背景下，只有安硕 A 股主要消费 ETF 和沪深 300 医药卫生 ETF 本期收盘价为负增长，分别下降 3.9% 和 5.04%，沪深 300 原材料 ETF 本期收盘价及净值升幅最大，分别为 12.73% 和 10.97%。从溢价率情况看，本期标智沪深 300ETF 日均溢价率最高，达到 9.39%。从活跃程度看，安硕 A50ETF 日均成交金额最大，为 11 亿港币，沪深 300 工业 ETF 本期日均换手率最高，达到 7.09%。

股指期货：12 月份沪深 300 指数收报于 2464.26，涨幅为 5.05%。而同期可比股指期货合约 IF1202、IF1203、IF1206 涨幅分别为 4.55%、4.51%、4.41%。从成交情况看，五份合约累计成交量 5541616 手，较上月下降 12.6%，累计成交金额 40285.42 亿，较上月下降 12.56%。



→ 统计数据

❖ A 股市场指数基金

表 1: A 股市场指数基金净值增长统计

序号	代码	基金名称	成立日期	本期净值增幅	备注
1	159901	易方达深证 100ETF	2006-3-24	3.74%	ETF
2	159902	华夏中小板 ETF	2006-6-8	-2.88%	ETF
3	159903	南方深成 ETF	2009-12-4	4.26%	ETF
4	159905	工银瑞信深证红利 ETF	2010-11-5	3.86%	ETF
5	159906	大成深证成长 40ETF	2010-12-21	-2.35%	ETF
6	159907	广发中小板 300ETF	2011-6-3	-3.12%	ETF
7	159908	博时深证基本面 200ETF	2011-6-10	3.17%	ETF
8	159909	招商深证 TMT50ETF	2011-6-27	-1.93%	ETF
9	159910	嘉实深证基本面 120ETF	2011-8-1	3.29%	ETF
10	159911	鹏华深证民营 ETF	2011-9-2	-0.97%	ETF
11	159912	汇添富深证 300ETF	2011-9-16	2.05%	ETF
12	159913	交银深证 300 价值 ETF	2011-9-22	4.06%	ETF
13	159915	易方达创业板 ETF	2011-9-20	-10.96%	ETF
14	159916	建信深证基本面 60ETF	2011-9-8	4.25%	ETF
15	510010	交银 180 治理 ETF	2009-9-25	6.33%	ETF
16	510020	博时超大盘 ETF	2009-12-29	8.92%	ETF
17	510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	2010-4-23	6.62%	ETF
18	510050	华夏上证 50ETF	2004-12-30	7.90%	ETF
19	510060	工银上证央企 50ETF	2009-8-26	5.27%	ETF
20	510070	鹏华上证民企 50ETF	2010-8-5	3.36%	ETF
21	510090	建信上证社会责任 ETF	2010-5-28	5.99%	ETF
22	510110	海富通上证周期 ETF	2010-9-19	7.82%	ETF
23	510120	海富通上证非周期 ETF	2011-4-22	1.46%	ETF
24	510130	易方达上证中盘 ETF	2010-3-29	3.12%	ETF
25	510150	招商上证消费 80ETF	2010-12-8	-1.74%	ETF
26	510160	南方小康产业 ETF	2010-8-27	5.17%	ETF
27	510170	国联安上证商品 ETF	2010-11-26	12.45%	ETF
28	510180	华安上证 180ETF	2006-4-13	6.15%	ETF
29	510190	华安上证龙头 ETF	2010-11-18	5.60%	ETF
30	510210	富国上证综指 ETF	2011-1-30	4.41%	ETF
31	510220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	2011-1-26	1.82%	ETF
32	510230	国泰上证 180 金融 ETF	2011-3-31	7.68%	ETF
33	510260	诺安上证新兴产业 ETF	2011-4-7	3.23%	ETF



34	510270	中银上证国企 ETF	2011-6-16	6.86%	ETF
35	510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF	2011-8-4	6.58%	ETF
36	510290	南方上证 380ETF	2011-9-16	0.41%	ETF
37	510880	华泰柏瑞红利 ETF	2006-11-17	5.61%	ETF
38	160119	南方中证 500	2009-9-25	0.48%	LOF
39	160415	华安深证 300	2011-9-2	2.63%	LOF
40	160615	鹏华沪深 300	2009-4-3	4.91%	LOF
41	160616	鹏华中证 500	2010-2-5	0.73%	LOF
42	160706	嘉实沪深 300	2005-8-29	4.73%	LOF
43	160716	嘉实基本面 50	2009-12-30	5.12%	LOF
44	160807	长盛沪深 300	2010-8-4	4.91%	LOF
45	161017	富国中证 500	2011-10-12	1.77%	LOF
46	161211	国投瑞银沪深 300 金融	2010-4-9	6.77%	LOF
47	161213	国投瑞银中证下游	2010-12-16	-1.80%	LOF
48	161607	融通巨潮 100	2005-5-12	6.42%	LOF
49	161811	银华沪深 300	2009-10-14	4.55%	LOF
50	161903	万家公用事业行业投资基金	2005-8-15	3.13%	LOF
51	161907	万家中证红利	2011-3-17	4.06%	LOF
52	162307	海富通中证 100	2009-10-30	6.07%	LOF
53	162711	广发中证 500	2009-11-26	0.00%	LOF
54	163001	长信中证央企 100	2010-3-26	4.25%	LOF
55	163407	兴全沪深 300	2010-11-2	5.05%	LOF
56	164205	天弘深证成指	2010-8-12	3.98%	LOF
57	165309	建信沪深 300	2009-11-5	4.73%	LOF
58	166007	中欧沪深 300	2010-6-24	4.07%	LOF
59	000051	华夏沪深 300	2009-7-10	5.03%	开放式基金
60	020011	国泰沪深 300	2007-11-11	4.58%	开放式基金
61	020021	国泰上证 180 金融 ETF 联接	2011-3-31	7.12%	开放式基金
62	040002	华安 MSCI 中国 A 股	2002-11-8	3.12%	开放式基金
63	040180	华安上证 180ETF 联接	2009-9-29	5.87%	开放式基金
64	040190	华安上证龙头 ETF 联接	2010-11-18	5.32%	开放式基金
65	050002	博时裕富沪深 300	2003-8-26	4.78%	开放式基金
66	050013	博时超大盘 ETF 联接	2009-12-29	8.46%	开放式基金
67	050021	博时深证基本面 200ETF 联接	2011-6-10	2.97%	开放式基金
68	070023	嘉实深证基本面 120ETF 联接	2011-8-1	3.10%	开放式基金
69	090010	大成中证红利	2010-2-2	4.55%	开放式基金
70	090012	大成深证成长 40ETF 联接	2010-10-21	-2.14%	开放式基金
71	090016	大成中证内地消费主题	2011-11-8	0.60%	开放式基金
72	100032	富国天鼎中证红利	2008-11-20	1.73%	开放式基金
73	100038	富国沪深 300	2009-12-16	6.00%	开放式基金
74	100053	富国上证综指 ETF 联接	2011-1-30	4.29%	开放式基金



75	110003	易方达上证 50	2004-3-22	7.37%	开放式基金
76	110019	易方达深证 100ETF 联接	2009-12-1	3.52%	开放式基金
77	110020	易方达沪深 300	2009-8-26	4.65%	开放式基金
78	110021	易方达上证中盘 ETF 联接	2010-3-31	2.93%	开放式基金
79	110026	易方达创业板 ETF 联接	2011-9-20	-6.64%	开放式基金
80	160808	长盛同瑞中证 200 分级基金	2011-12-16	1.70%	开放式基金
81	161207	国投瑞银瑞和 300	2009-10-14	6.98%	开放式基金
82	161217	国投瑞银中证上游	2011-7-21	11.79%	开放式基金
83	161604	融通深证 100	2003-9-30	3.53%	开放式基金
84	161612	融通深证成指	2010-11-15	4.10%	开放式基金
85	161812	银华深证 100	2010-5-7	6.27%	开放式基金
86	161816	银华中证等权重 90	2011-3-17	8.77%	开放式基金
87	161819	银华中证内地资源分级基金	2011-12-8	1.69%	开放式基金
88	162010	长城久兆中小板 300 指数分级	2012-1-30	/	开放式基金
89	162213	泰达宏利中证财富大盘	2010-4-23	5.23%	开放式基金
90	162216	泰达宏利中证 500	2011-12-1	2.20%	开放式基金
91	162509	国联安双禧中证 100	2010-4-16	7.72%	开放式基金
92	163109	申万菱信深证成指分级	2010-10-22	1.86%	开放式基金
93	163808	中银中证 100	2009-9-4	5.99%	开放式基金
94	164809	工银瑞信睿智中证 500 分级	2012-1-31	/	开放式基金
95	165511	信诚中证 500 分级	2011-2-11	3.36%	开放式基金
96	165515	信诚沪深 300 指数分级	2012-2-1	/	开放式基金
97	180003	银华道琼斯 88 精选	2004-8-11	2.26%	开放式基金
98	200002	长城久泰沪深 300	2004-5-21	4.64%	开放式基金
99	202015	南方沪深 300	2009-3-25	4.77%	开放式基金
100	202017	南方深成 ETF 联接	2009-12-9	4.08%	开放式基金
101	202021	南方小康产业 ETF 联接	2010-8-27	4.86%	开放式基金
102	202025	南方上证 380ETF 联接	2011-9-20	0.44%	开放式基金
103	206005	鹏华上证民企 50ETF 联接	2010-8-5	3.12%	开放式基金
104	206010	鹏华深证民营 ETF 联接	2011-9-2	-0.91%	开放式基金
105	210007	金鹰中证技术领先	2011-6-1	-2.89%	开放式基金
106	213010	宝盈中证 100	2010-2-8	4.90%	开放式基金
107	217016	招商深证 100	2010-6-22	2.47%	开放式基金
108	217017	招商上证消费 80ETF 联接	2010-12-8	-1.60%	开放式基金
109	217019	招商深证 TMT50ETF 联接	2011-6-27	-1.93%	开放式基金
110	233010	大摩深证 300	2011-11-15	1.71%	开放式基金
111	240014	华宝兴业中证 100	2009-9-29	6.05%	开放式基金
112	240016	华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接	2010-4-23	6.26%	开放式基金
113	240019	华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接	2011-8-9	6.24%	开放式基金
114	257060	国联安上证商品 ETF 联接	2010-12-1	11.86%	开放式基金



115	270010	广发沪深 300	2008-12-30	4.61%	开放式基金
116	270026	广发中小板 300ETF 联接	2011-6-9	-2.98%	开放式基金
117	290010	泰信中证 200	2011-6-9	1.28%	开放式基金
118	310398	申万菱信沪深 300 价值	2010-2-11	6.15%	开放式基金
119	320010	诺安中证 100	2009-10-27	6.21%	开放式基金
120	320014	诺安上证新兴产业 ETF 联接	2011-4-7	2.88%	开放式基金
121	399001	中海上证 50	2010-3-25	4.50%	开放式基金
122	410008	华富中证 100	2009-12-30	6.02%	开放式基金
123	410010	华富中小板指数增强型基金	2011-12-9	-0.59%	开放式基金
124	450008	国富沪深 300	2009-9-3	3.93%	开放式基金
125	460220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接	2011-1-26	1.64%	开放式基金
126	470007	汇添富上证综指	2009-7-1	4.17%	开放式基金
127	470068	汇添富深证 300ETF 联接	2011-9-28	1.82%	开放式基金
128	481009	工银瑞信沪深 300	2009-3-5	4.87%	开放式基金
129	481012	工银瑞信深证红利 ETF 联接	2010-11-9	3.67%	开放式基金
130	519027	海富通上证周期 ETF 联接	2010-9-28	7.23%	开放式基金
131	519032	海富通上证非周期 ETF 联接	2011-4-27	1.21%	开放式基金
132	519100	长盛中证 100	2006-11-22	6.20%	开放式基金
133	519116	浦银安盛沪深 300	2010-12-10	5.07%	开放式基金
134	519180	万家上证 180	2003-3-15	5.86%	开放式基金
135	519300	大成沪深 300	2006-4-6	4.79%	开放式基金
136	519671	银河沪深 300 价值	2009-12-28	6.07%	开放式基金
137	519686	交银 180 治理 ETF 联接	2009-9-29	5.99%	开放式基金
138	519706	交银深证 300 价值 ETF 联接	2011-9-28	3.74%	开放式基金
139	530010	建信上证社会责任 ETF 联接	2010-5-28	5.64%	开放式基金
140	530015	建信深证基本面 60ETF 联接	2011-9-8	4.04%	开放式基金
141	585001	东吴中证新兴产业	2011-2-1	-0.45%	开放式基金
142	590007	中邮上证 380	2011-11-22	0.90%	开放式基金
143	660008	农银汇理沪深 300	2011-4-12	4.82%	开放式基金
144	660011	农银汇理中证 500	2011-11-29	1.51%	开放式基金
145	700002	平安大华深证 300 增强型基金	2011-12-20	/	开放式基金

注：统计期为 2011.12.1-2011.12.31；“/”表示基金净值数据未够一个完整统计期或数据缺失



❖ 本地 ETF

表 2：深沪交易所上市 ETF 概况

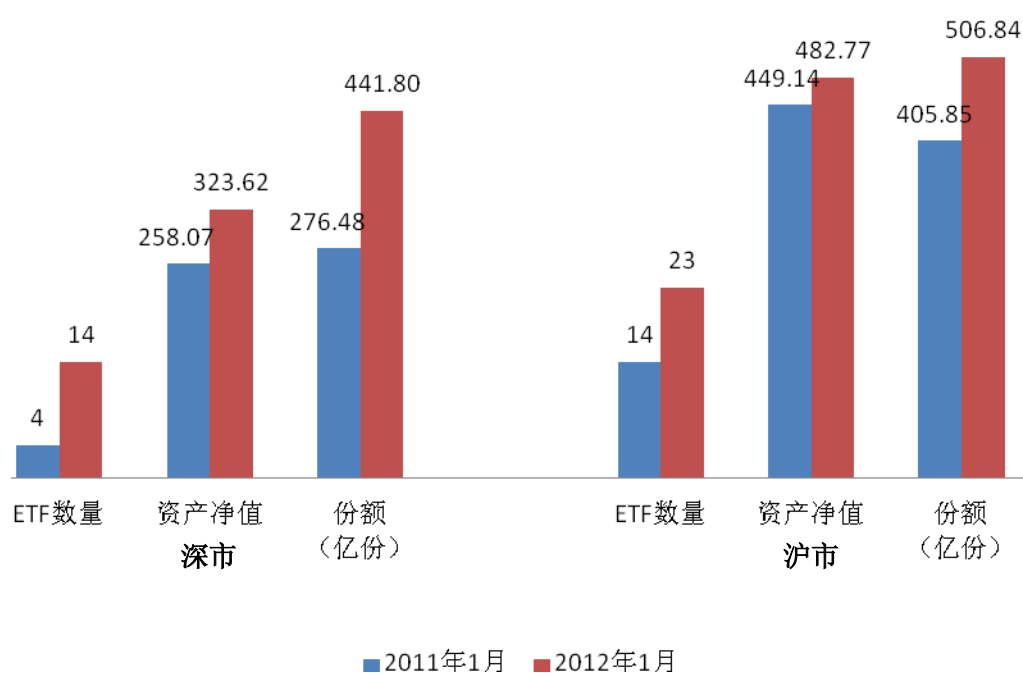
代码	简称	管理人	上市日期	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)
159901	深 100ETF	易方达	2006-04-24	319.67	191.07
159902	中小板 ETF	华夏	2006-09-05	20.99	42.44
159903	深成 ETF	南方	2010-02-02	30.53	29.26
159905	深红利 ETF	工银瑞信	2011-01-11	13.54	9.82
159906	深成长 ETF	大成	2011-02-23	20.83	15.04
159907	中小板 300ETF	广发	2011-08-10	9.87	7.87
159908	深 F200ETF	博时	2011-07-13	2.89	2.16
159909	深证 TMT50ETF	招商	2011-09-01	1.54	3.65
159910	深 F120ETF	嘉实	2011-09-27	5.36	4.53
159911	民营 ETF	鹏华	2011-10-14	1.62	4.18
159912	深 300ETF	汇添富	2011-11-24	4.91	4.28
159913	深价值	交银施罗德	2011-10-25	0.85	0.82
159915	创业板 ETF	易方达	2011-12-09	6.95	4.75
159916	深 F60	建信	2011-10-24	2.24	3.76
510010	治理 ETF	交银施罗德	2009-12-15	51.37	32.86
510020	超大 ETF	博时	2010-03-19	76.54	13.80
510030	价值 ETF	华宝兴业	2010-05-28	4.82	11.20
510050	50ETF	华夏	2005-02-23	121.30	213.90
510060	央企 ETF	工银瑞信	2009-10-27	6.12	6.85
510070	民企 ETF	鹏华	2010-10-29	3.70	3.53
510090	责任 ETF	建信	2010-08-09	3.87	3.16
510110	周期 ETF	海富通	2010-11-15	1.76	3.77
510120	非周 ETF	海富通	2011-06-08	2.06	3.59
510130	中盘 ETF	易方达	2010-06-23	4.32	9.71
510150	消费 ETF	招商	2011-02-25	5.86	13.02
510160	小康 ETF	南方	2010-11-01	11.32	3.89
510170	商品 ETF	国联安	2011-01-25	4.28	10.12
510180	180ETF	华安	2006-05-18	167.90	89.93
510190	龙头 ETF	华安	2011-01-10	5.14	10.99
510210	综指 ETF	富国	2011-03-25	1.35	3.14
510220	中小 ETF	华泰柏瑞	2011-03-28	0.52	1.29
510230	金融 ETF	国泰	2011-05-23	3.81	11.47
510260	新兴 ETF	诺安	2011-06-08	8.88	6.26
510270	国企 ETF	中银	2011-08-18	2.37	1.74



510280	成长 ETF	华宝兴业	2011-10-18	6.06	5.70
510290	380ETF	南方	2011-11-08	2.44	2.01
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	2007-01-18	11.07	20.87
合计				948.64	806.39

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.2.3；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 1：深沪交易所上市 ETF 年度变化趋势对比



数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.2.3；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 3：对指数及市场覆盖情况

代码	简称	资产净值 (亿元)	对指数覆盖率	市场份额
159901	深 100ETF	191.07	1.03%	23.69%
159902	中小板 ETF	42.44	0.60%	5.26%
159903	深成 ETF	29.26	0.24%	3.63%
159905	深红利 ETF	9.82	0.13%	1.22%
159906	深成长 ETF	15.04	0.20%	1.86%
159907	中小板 300ETF	7.87	0.07%	0.98%
159908	深 F200ETF	2.16	0.01%	0.27%



159909	深证 TMT50ETF	3.65	0.09%	0.45%
159910	深 F120ETF	4.53	0.02%	0.56%
159911	民营 ETF	4.18	0.05%	0.52%
159912	深 300ETF	4.28	0.02%	0.53%
159913	深价值	0.82	0.01%	0.10%
159915	创业板 ETF	4.75	0.33%	0.59%
159916	深 F60	3.76	0.03%	0.47%
深市合计		323.62		40.13%
510010	治理 ETF	32.86	0.04%	4.07%
510020	超大 ETF	13.80	0.03%	1.71%
510030	价值 ETF	11.20	0.01%	1.39%
510050	50ETF	213.90	0.28%	26.53%
510060	央企 ETF	6.85	0.01%	0.85%
510070	民企 ETF	3.53	0.05%	0.44%
510090	责任 ETF	3.16	0.01%	0.39%
510110	周期 ETF	3.77	0.00%	0.47%
510120	非周 ETF	3.59	0.02%	0.44%
510130	中盘 ETF	9.71	0.04%	1.20%
510150	消费 ETF	13.02	0.12%	1.61%
510160	小康 ETF	3.89	0.01%	0.48%
510170	商品 ETF	10.12	0.19%	1.26%
510180	180ETF	89.93	0.09%	11.15%
510190	龙头 ETF	10.99	0.01%	1.36%
510210	综指 ETF	3.14	0.00%	0.39%
510220	中小 ETF	1.29	0.00%	0.16%
510230	金融 ETF	11.47	0.03%	1.42%
510260	新兴 ETF	6.26	0.06%	0.78%
510270	国企 ETF	1.74	0.00%	0.22%
510280	成长 ETF	5.70	0.02%	0.71%
510290	380ETF	2.01	0.01%	0.25%
510880	红利 ETF	20.87	0.03%	2.59%
沪市合计		482.77		59.87%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.2.3，中小板 ETF 为场内场外总资产。

表 4：基金份额及资产净值变化情况

代码	简称	基金份额增量 (亿份)	增幅	资产净值增量 (亿元)	增幅
159901	深 100ETF	10.86	3.52%	15.82	9.03%
159902	中小板 ETF	1.44	7.36%	3.06	7.78%

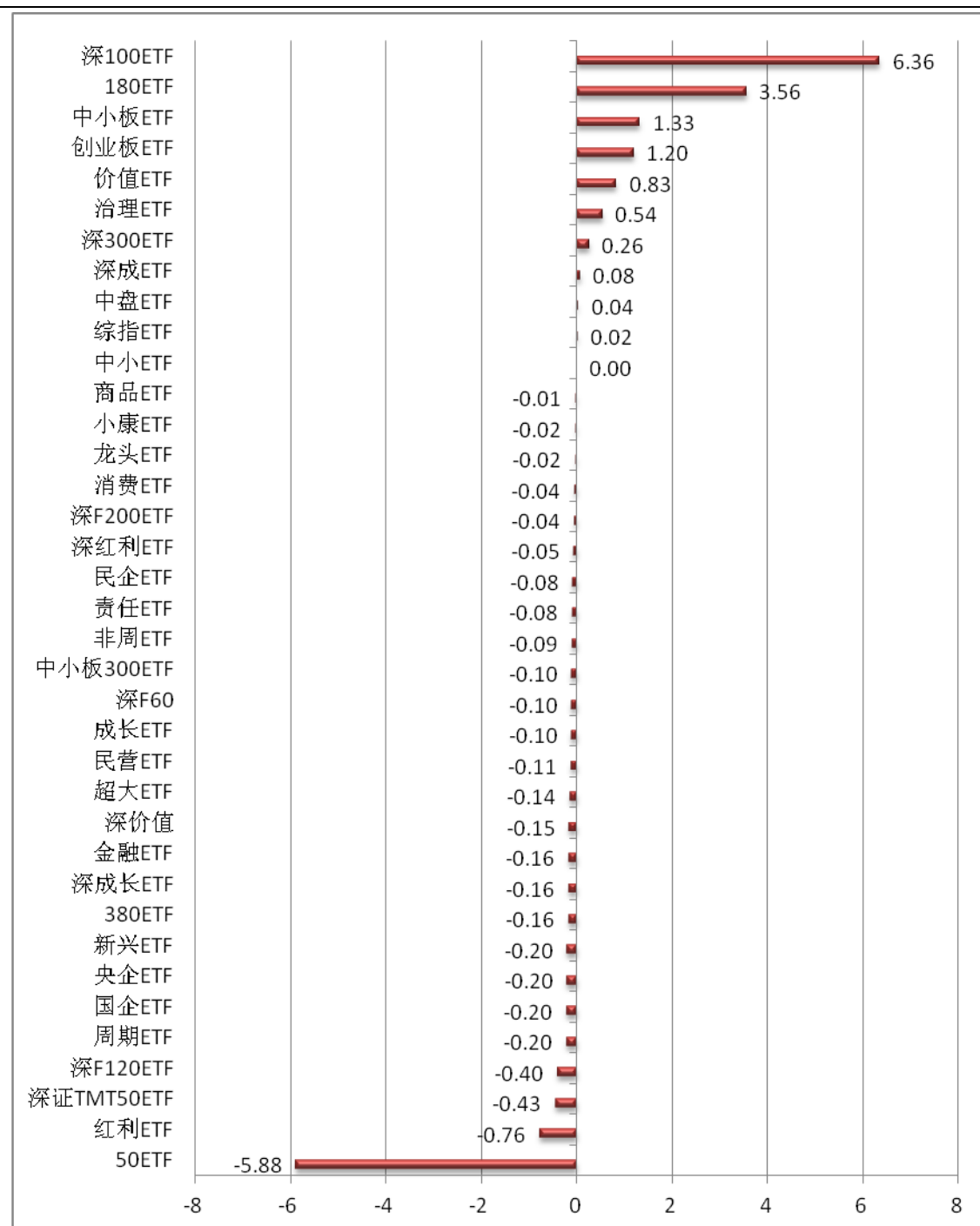


159903	深成 ETF	0.11	0.35%	1.69	6.11%
159905	深红利 ETF	-0.07	-0.55%	0.41	4.31%
159906	深成长 ETF	-0.22	-1.05%	-0.20	-1.32%
159907	中小板 300ETF	-0.12	-1.20%	-0.09	-1.10%
159908	深 F200ETF	-0.06	-2.03%	0.06	2.67%
159909	深证 TMT50ETF	-0.19	-10.84%	-0.39	-9.58%
159910	深 F120ETF	-0.49	-8.38%	-0.19	-4.04%
159911	民营 ETF	-0.04	-2.41%	-0.04	-0.86%
159912	深 300ETF	0.30	6.60%	0.42	10.94%
159913	深价值	-0.16	-15.79%	-0.10	-11.17%
159915	创业板 ETF	1.78	34.40%	0.96	25.40%
159916	深 F60	-0.06	-2.61%	0.10	2.76%
510010	治理 ETF	0.86	1.70%	2.91	9.73%
510020	超大 ETF	-0.79	-1.02%	1.10	8.63%
510030	价值 ETF	0.36	8.08%	1.61	16.81%
510050	50ETF	-3.39	-2.72%	12.58	6.25%
510060	央企 ETF	-0.18	-2.86%	0.22	3.34%
510070	民企 ETF	-0.08	-2.12%	0.08	2.22%
510090	责任 ETF	-0.11	-2.64%	0.15	4.85%
510110	周期 ETF	-0.10	-5.33%	0.12	3.26%
510120	非周 ETF	-0.05	-2.55%	0.00	0.10%
510130	中盘 ETF	0.02	0.37%	0.45	4.80%
510150	消费 ETF	-0.02	-0.27%	-0.06	-0.49%
510160	小康 ETF	-0.06	-0.53%	0.21	5.68%
510170	商品 ETF	0.00	-0.12%	1.18	13.15%
510180	180ETF	7.32	4.56%	9.89	12.36%
510190	龙头 ETF	-0.01	-0.19%	0.71	6.90%
510210	综指 ETF	0.01	0.75%	0.19	6.27%
510220	中小 ETF	0.00	0.00%	0.04	3.11%
510230	金融 ETF	-0.06	-1.55%	0.80	7.55%
510260	新兴 ETF	-0.31	-3.32%	0.03	0.53%
510270	国企 ETF	-0.28	-10.57%	-0.06	-3.39%
510280	成长 ETF	-0.11	-1.78%	0.33	6.16%
510290	380ETF	-0.20	-7.56%	-0.13	-6.00%
510880	红利 ETF	-0.40	-3.53%	0.59	2.92%
合计		15.49		54.44	

注：统计期为2012.1.4-2012.2.3。



图 2：净申购/赎回资金量（亿元）



注：根据ETF每周净申购/赎回份额与其平均净值计算；中小板ETF以场内份额计算。

表 5：绝对收益与超额收益

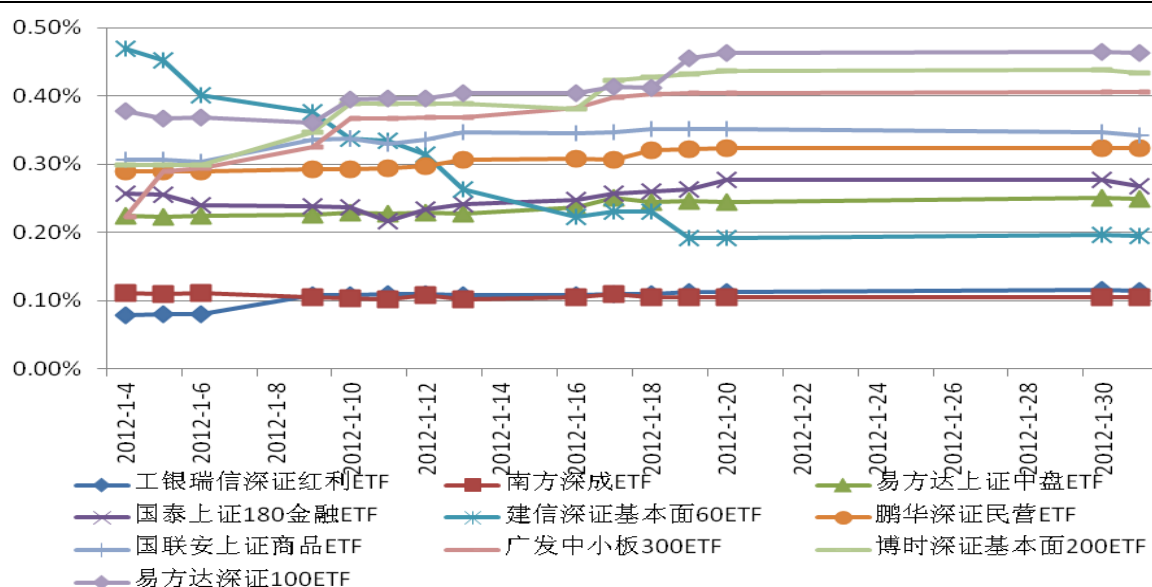
代码	简称	阶段收益	阶段超额收益	累计收益	累计超额收益
159901	深 100ETF	3.73%	-0.24%	3.73%	-0.24%
159902	中小板 ETF	-2.88%	-0.37%	-2.88%	-0.37%
159903	深成 ETF	4.26%	-0.05%	4.26%	-0.05%



159905	深红利 ETF	3.86%	-0.08%	3.86%	-0.08%
159906	深成长 40ETF	-2.35%	0.28%	-2.35%	0.28%
159907	中小 300ETF	-3.12%	-0.08%	-3.12%	-0.08%
159908	深 F200	3.17%	-0.20%	3.17%	-0.20%
159909	TMT50ETF	-1.94%	-0.07%	-1.94%	-0.07%
159910	深 F120ETF	3.32%	-0.40%	3.32%	-0.40%
159911	民营 ETF	-0.96%	0.01%	-0.96%	0.01%
159912	深 300ETF	2.07%	-0.09%	2.07%	-0.09%
159913	深价值	4.18%	-0.13%	4.18%	-0.13%
159915	创业板 ETF	-10.95%	0.12%	-10.95%	0.12%
159916	深 F60	4.25%	-0.13%	4.25%	-0.13%
510010	180 治理 ETF	6.33%	-0.20%	6.33%	-0.20%
510020	超大 ETF	8.92%	-0.27%	8.92%	-0.27%
510030	180 价值 ETF	6.62%	0.14%	6.62%	0.14%
510050	50ETF	7.90%	0.04%	7.90%	0.04%
510060	央企 ETF	5.28%	-0.13%	5.28%	-0.13%
510070	民企 ETF	3.35%	0.00%	3.35%	0.00%
510090	责任 ETF	5.99%	-0.19%	5.99%	-0.19%
510110	周期 ETF	7.82%	-0.85%	7.82%	-0.85%
510120	非周期 ETF	1.51%	-0.17%	1.51%	-0.17%
510130	中盘 ETF	3.12%	-0.07%	3.12%	-0.07%
510150	消费 ETF	-1.74%	1.97%	-1.74%	1.97%
510160	小康 ETF	5.18%	-0.19%	5.18%	-0.19%
510170	商品 ETF	12.46%	-0.11%	12.46%	-0.11%
510180	180ETF	6.15%	-0.08%	6.15%	-0.08%
510190	龙头 ETF	5.60%	-0.13%	5.60%	-0.13%
510210	上证综指 ETF	4.40%	0.17%	4.40%	0.17%
510220	中小盘 ETF	1.83%	-0.16%	1.83%	-0.16%
510230	180 金融 ETF	7.67%	-0.12%	7.67%	-0.12%
510260	新兴产业 ETF	3.23%	-0.15%	3.23%	-0.15%
510270	国企 ETF	6.87%	0.01%	6.87%	0.01%
510280	成长 ETF	6.58%	-0.11%	6.58%	-0.11%
510290	380ETF	0.43%	-0.01%	0.43%	-0.01%
510880	红利 ETF	5.62%	-0.21%	5.62%	-0.21%

注：阶段=统计期；累计=年初至今。统计期为2012.1.4-2012.1.31。阶段统计期内上市的ETF，阶段收益从上市日开始计算；*表示于年内上市的ETF，累计收益从上市日开始计算

图 3：1 月年化跟踪误差最小的前 10 只 ETF



注：统计期内各个交易日对应的年化跟踪误差采用向前30个交易日为一周期计算。

图 4：日均成交金额（亿元）

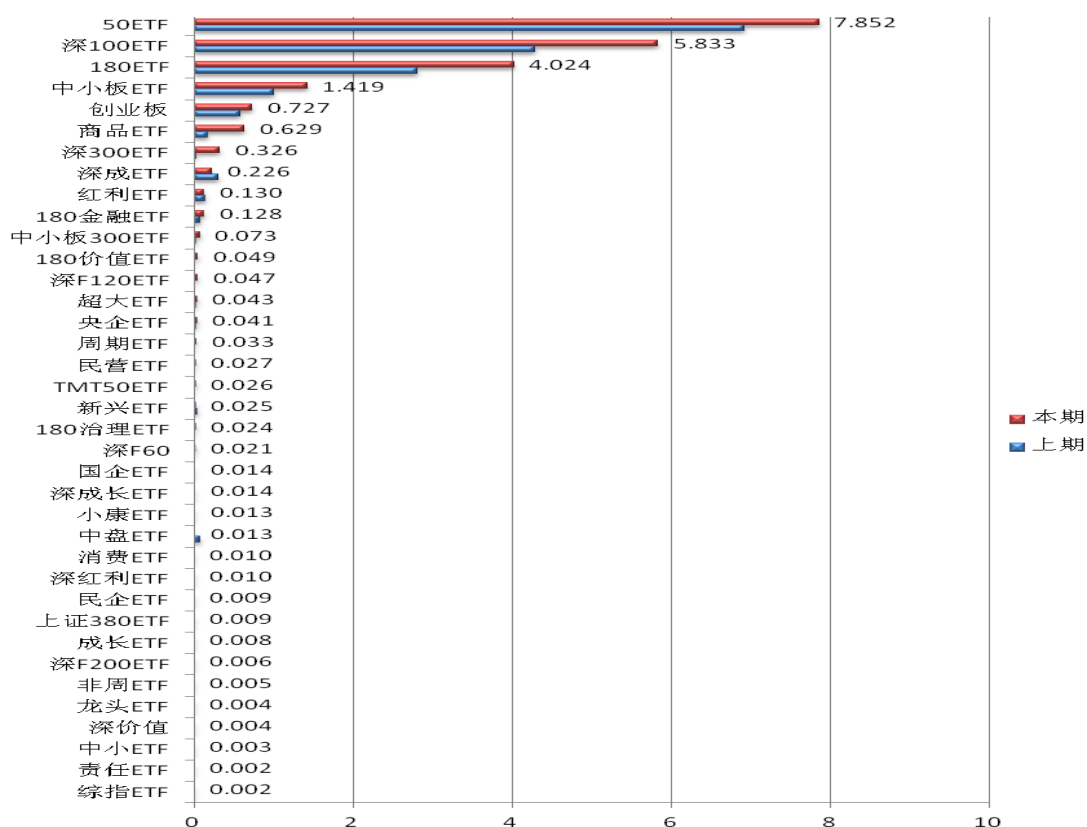
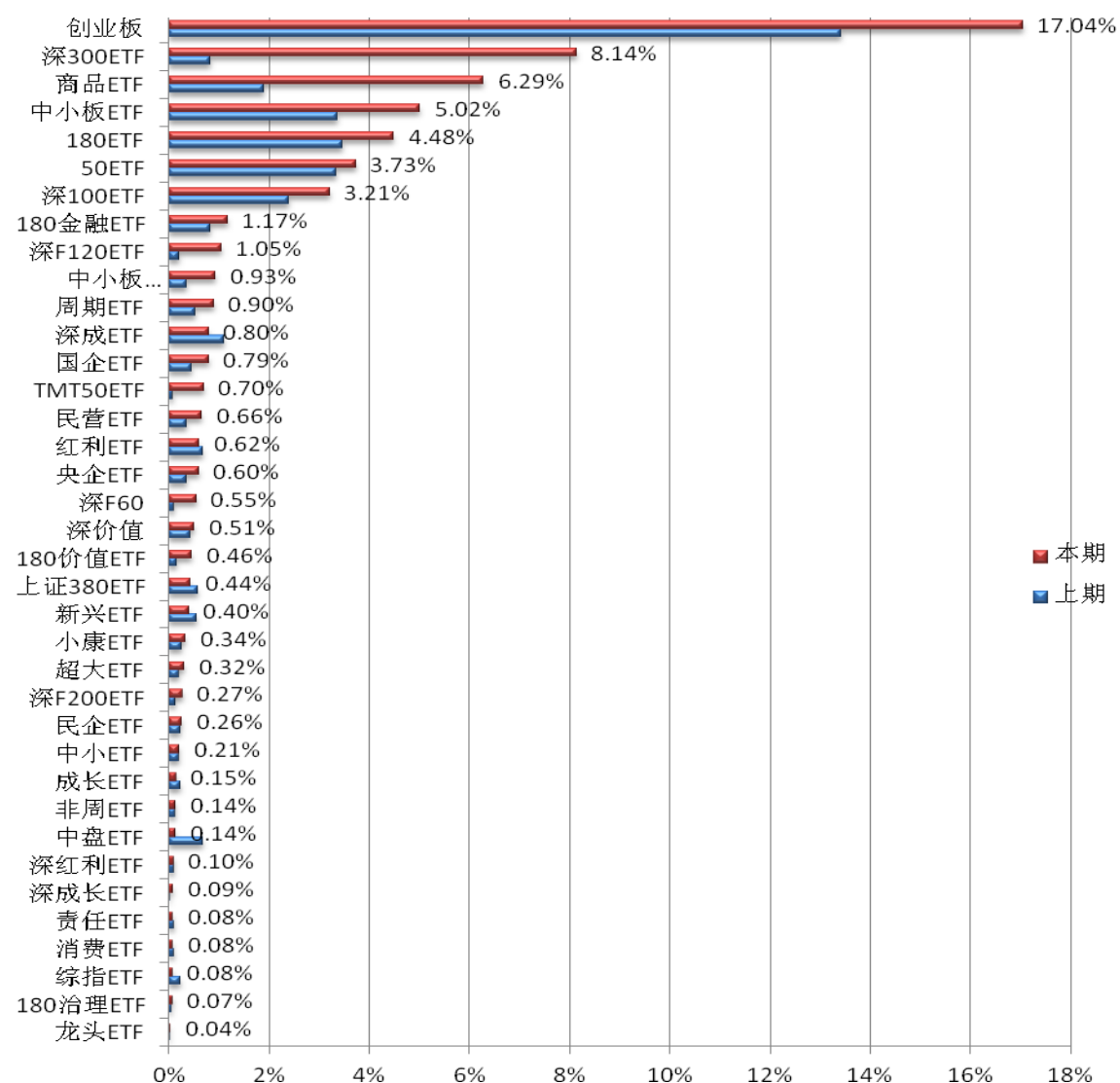




图 5：日均换手率



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。



❖ LOF

表 6: LOF 指数基金份额及资产净值季度变化情况

代码	简称	管理人	上市日期	规模 (亿份)			资产 (亿元)		
				四季度末	季度增量	增幅	四季度末	季度增量	增幅
160119	南方 500	南方	2009-9-25	49.56	4.27	9.44%	40.34	-2.87	-6.65%
160125	南方中国	南方	2011-9-26	1.08	-1.92	-64.03%	1.07	-1.93	-64.27%
160415	华安 S300	华安	2011-9-2	3.99	-2.09	-34.36%	3.33	-2.55	-43.41%
160615	鹏华 300	鹏华	2009-4-3	7.40	0.29	4.03%	6.18	-0.33	-5.13%
160616	鹏华 500	鹏华	2010-2-5	13.03	-0.24	-1.83%	8.95	-1.80	-16.72%
160706	嘉实 300	嘉实	2005-8-29	420.44	12.34	3.02%	260.46	-15.86	-5.74%
160716	嘉实 50	嘉实	2009-12-30	33.28	5.40	19.38%	21.01	3.08	17.16%
160717	恒生 H 股	嘉实	2010-9-30	1.99	-0.15	-7.19%	1.38	0.04	2.85%
160807	长盛 300	长盛	2010-8-4	2.27	0.04	1.89%	1.76	-0.12	-6.40%
161017	富国 500	富国	2011-10-12	2.00	-2.56	-56.12%	1.70	-2.86	-62.76%
161211	国投金融	国投瑞银	2010-4-9	34.41	-0.18	-0.53%	24.40	-0.29	-1.17%
161213	国投消费	国投瑞银	2010-12-16	6.42	-0.64	-9.12%	5.01	-0.98	-16.40%
161607	融通巨潮	融通	2005-5-12	28.53	0.00	0.01%	20.43	-1.39	-6.35%
161714	招商金砖	招商	2011-2-11	1.60	-0.08	-5.00%	1.18	-0.01	-0.78%
161811	银华 300	银华	2009-10-14	5.34	-0.09	-1.60%	3.87	-0.44	-10.16%
161903	万家公用	万家	2005-8-15	10.02	0.16	1.61%	5.77	-0.43	-6.87%
161907	万家红利	万家	2011-3-17	7.47	2.50	50.31%	6.09	1.67	37.83%
162307	海富 100	海富通	2009-10-30	14.49	-3.39	-18.94%	9.80	-3.05	-23.72%
162711	广发 500	广发	2009-11-26	38.86	1.87	5.06%	28.72	-3.28	-10.24%
163001	长信 100	长信	2010-3-26	1.00	0.09	9.26%	0.78	0.02	3.09%
163407	兴全 300	兴业全球	2010-11-2	21.21	0.11	0.51%	16.36	-1.36	-7.67%
164205	天弘深成	天弘	2010-8-12	1.09	-0.01	-1.11%	0.76	-0.12	-13.90%
165309	建信 300	建信	2009-11-5	48.64	3.52	7.81%	32.87	-0.56	-1.68%
166007	中欧 300	中欧	2010-6-24	2.47	0.07	3.03%	1.92	-0.12	-5.74%
合计				756.60	19.31		504.14	-35.53	

注: 数据来源: 基金四季度报告; 数据统计期 2011.10.1-2011.12.31。上市未滿一季度的基金, 增量代表季末与基金成立日相比的变化水平。

表 7: LOF 指数基金 (场内部分) 份额及资产净值月度变化情况

代码	简称	规模 (亿份)			资产 (亿元)		
		1 月末	月度增量	增幅	1 月末	月度增量	增幅
160119	南方 500	1.55	0.03	2.07%	1.26	0.03	2.56%



160125	南方中国	0.03	-0.01	-26.07%	0.03	-0.01	-23.17%
160415	华安 S300	0.65	0.00	-0.39%	0.56	0.01	2.24%
160615	鹏华 300	0.44	-0.17	-28.08%	0.38	-0.12	-24.55%
160616	鹏华 500	0.77	0.00	0.64%	0.53	0.01	1.37%
160706	嘉实 300	39.02	-0.04	-0.11%	25.31	1.12	4.61%
160716	嘉实 50	1.33	-0.01	-0.54%	0.88	0.04	4.55%
160717	恒生 H 股	0.57	-0.27	-32.53%	0.44	-0.15	-25.13%
160807	长盛 300	0.13	0.00	-0.05%	0.11	0.01	4.86%
161017	富国 500	0.27	0.00	0.02%	0.24	0.00	1.79%
161211	国投金融	2.06	-0.19	-8.51%	1.56	-0.04	-2.31%
161213	国投消费	0.32	0.00	-0.13%	0.25	0.00	-1.92%
161607	融通巨潮	0.68	0.00	-0.38%	0.52	0.03	6.02%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-5.64%	0.01	0.00	4.97%
161811	银华 300	0.20	0.00	-1.09%	0.15	0.00	3.40%
161903	万家公用	0.37	0.00	0.00%	0.22	0.01	3.13%
161907	万家红利	0.59	-0.01	-1.25%	0.50	0.01	2.77%
162307	海富 100	0.21	0.00	-0.03%	0.15	0.01	6.04%
162711	广发 500	1.70	0.01	0.83%	1.26	0.01	0.83%
163001	长信 100	0.13	0.00	0.01%	0.10	0.00	4.26%
163407	兴全 300	0.31	0.03	10.14%	0.25	0.03	15.70%
164205	天弘深成	0.01	0.00	2.15%	0.01	0.00	6.22%
165309	建信 300	0.20	0.00	-0.55%	0.14	0.01	4.15%
166007	中欧 300	0.06	0.00	-0.32%	0.05	0.00	3.73%
合计		51.62	-0.64		34.92	1.01	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.1.04-2012.1.31。

❖ 创新型指数基金

表 8： 创新型指数基金份额及资产净值季度变化情况

代码	简称	管理人	上市日期	基金份额（亿份）			资产净值（亿元）		
				四季度末	季度增量	增幅	四季度末	季度增量	增幅
国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金				14.07	-5.75	-29.01%	12.54	-3.44	-21.53%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.69	-2.89	-51.74%	2.40	-2.10	-46.65%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.69	-2.89	-51.74%	2.40	-2.10	-46.65%
161207	瑞和 300	国投瑞银		8.68	0.03	0.29%	7.74	0.76	10.87%
国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金				46.39	-8.23	-15.06%	39.71	-10.08	-20.25%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	17.25	-0.51	-2.86%	18.94	-0.31	-1.60%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	25.87	-0.76	-2.86%	17.98	-3.25	-15.29%



162509	双禧 100	国联安		3.27	-6.96	-68.03%	2.80	-6.53	-69.99%
银华深证 100 指数分级证券投资基金				90.23	20.36	29.14%	74.98	8.11	12.13%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	38.12	8.95	30.69%	40.33	9.91	32.57%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	38.12	8.95	30.69%	23.02	-2.38	-9.37%
161812	银华 100	银华		14.00	2.46	21.29%	11.63	0.59	5.33%
申万菱信深证成指分级证券投资基金				33.02	7.88	31.36%	21.81	2.76	14.47%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	11.66	3.45	42.07%	12.34	3.78	44.11%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	11.66	3.45	42.07%	3.03	-0.82	-21.24%
163109	申万成指	申万菱信		9.69	0.98	11.20%	6.39	-0.20	-3.06%
信诚中证 500 指数分级证券投资基金				5.06	1.06	26.33%	3.55	0.27	8.21%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	0.90	0.36	68.13%	0.94	0.39	70.72%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	1.34	0.54	68.13%	0.62	0.09	16.36%
165511	信诚 500	信诚		2.83	0.15	5.54%	1.98	-0.21	-9.57%
银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金				31.22	1.77	6.02%	22.22	-1.21	-5.17%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	9.30	1.37	17.29%	9.77	1.57	19.10%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	9.30	1.37	17.29%	3.47	-0.95	-21.46%
161816	银华 90	银华		12.62	-0.97	-7.12%	8.99	-1.83	-16.92%
银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金				1.54	-11.48	-88.20%	1.55	-11.47	-88.10%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	0.14	-0.81	-85.01%	0.14	-0.82	-84.99%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	0.22	-1.22	-85.01%	0.22	-1.22	-84.84%
161819	银华资源	银华		1.18	-9.45	-88.92%	1.19	-9.44	-88.84%
泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金				3.14	-11.22	-78.13%	3.08	-11.28	-78.55%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.27	-0.47	-63.85%	0.27	-0.47	-63.77%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.40	-0.71	-63.85%	0.39	-0.72	-65.08%
162216	泰达 500	泰达		2.47	-10.03	-80.25%	2.42	-10.08	-80.65%
合计				224.67	-5.61		179.44	-26.34	

注：数据来源：深交所；数据统计期 2011.10.1-2011.12.31。上市未第一季度的基金，增量代表季末与基金成立日相比的变化水平。

表 9：创新型指数基金（场内部分）份额及资产净值月度变化情况

代码	简称	管理人	上市日期	基金份额（亿份）			资产净值（亿元）		
				1 月末	月度增量	增幅	1 月末	月度增量	增幅
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.65	-0.05	-1.68%	2.48	0.08	3.17%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.65	-0.05	-1.68%	2.48	0.08	3.17%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	16.20	-0.94	-5.51%	17.87	-0.96	-5.08%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	24.30	-1.42	-5.51%	18.85	0.98	5.50%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	38.62	0.40	1.05%	38.81	-1.58	-3.92%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	38.62	0.40	1.05%	25.37	2.25	9.74%



150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	12.59	0.94	8.05%	12.67	0.35	2.84%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	12.59	0.94	8.05%	3.85	0.79	25.71%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	2.56	1.67	186.45%	2.72	1.77	187.81%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	3.85	2.50	186.45%	1.82	1.19	192.02%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	13.75	4.37	46.61%	13.84	3.98	40.33%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	13.75	4.37	46.61%	6.30	2.80	80.02%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	0.14	-0.07	-34.87%	0.14	-0.07	-34.74%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	0.21	-0.11	-34.87%	0.22	-0.11	-33.32%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.19	-0.02	-9.17%	0.20	-0.02	-9.17%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.29	-0.03	-9.17%	0.28	-0.03	-10.02%
合计				182.97	12.91		147.88	11.50	

注：数据来源：深交所；统计期为2012.1.04-2012.1.31。

❖ 跨境 ETF

表 10：跟踪 A 股的主要跨境 ETF

代码	名称	标的指数	管理人	上市日期	基金资产
2816	沪深 300 地产 ETF	沪深 300 地产	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.50
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	3.91
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	468.30
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	58.28
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	7.93
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	4.32
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.72
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	10.99
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	2.53
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.43
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	2.24
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.56
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.95
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.50
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	4.62
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	26.94
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	2.65
3051	中金深证 100ETF	深证 100	CICC	2010-1-29	0.09
3052	沪深 300 公用事业 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.24
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.87
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.48



3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.58
3063	沪深 300 运输 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.23
3071	大成中证中国内地消费 ETF	中证内地消费主题	Da Cheng	2010-7-20	0.14

注：基金资产单位为“亿港元”；截止日期为2012.1.31。

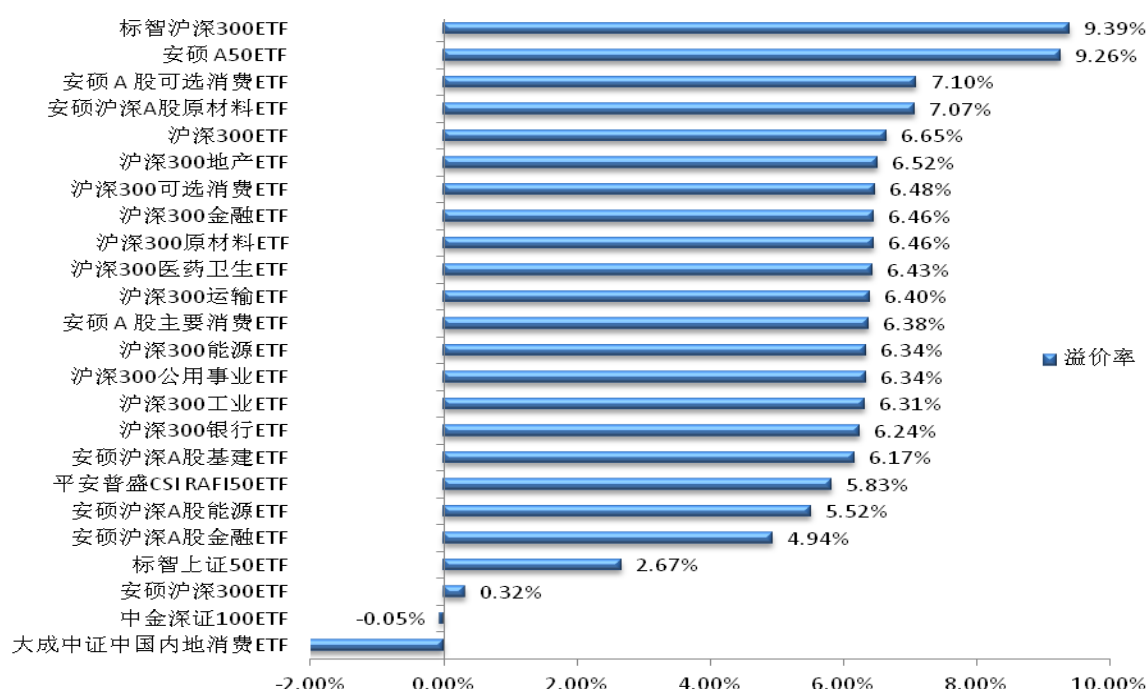
表 11：跟踪 A 股的主要跨境 ETF 净值变化

代码	名称	收盘价	增幅	单位净值	增幅
2816	沪深 300 地产 ETF	9.05	4.02%	8.44	2.40%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	26.15	7.61%	24.42	4.95%
2823	安硕 A50ETF	11.16	7.93%	10.16	5.80%
2827	标智沪深 300ETF	29.45	6.51%	26.78	4.65%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	10.54	6.79%	10.04	6.51%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	19.46	-3.90%	18.37	-4.50%
2844	沪深 300 金融 ETF	9.14	8.94%	8.47	6.09%
2846	安硕沪深 300ETF	23	8.75%	22.89	4.35%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	14.62	0.41%	13.66	2.45%
3005	沪深 300 工业 ETF	5.12	5.79%	4.76	3.85%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	10.42	2.36%	9.76	-0.06%
3017	沪深 300 能源 ETF	8.34	9.74%	7.80	8.23%
3024	标智上证 50ETF	16.72	7.46%	16.26	7.04%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	7.72	4.47%	7.21	2.67%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	11.64	10.86%	11.00	10.72%
3049	沪深 300ETF	6.54	6.17%	6.08	4.44%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	12.1	8.04%	11.50	8.10%
3051	中金深证 100ETF	25.25	4.55%	25.04	1.50%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	3.62	1.12%	3.36	-0.36%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	10.56	-5.04%	9.84	-6.79%
3061	沪深 300 银行 ETF	9.49	7.84%	8.89	6.29%
3062	沪深 300 原材料 ETF	6.11	12.73%	5.70	10.97%
3063	沪深 300 运输 ETF	2.95	4.61%	2.76	2.88%
3071	大成中证中国内地消 ETF	8.95	1.94%	9.03	-0.55%

注：收盘价、单位净值的单位为“港元”；统计期为2012.1.3-2012.1.31；“/”表示基金上期末上市或未开放申购赎回。



图 6：主要 A 股跨境 ETF 溢价率排名



注：统计期为2012.1.3-2012.1.31

表 12：主要 A 股跨境 ETF 交易情况

代码	名称	日均成交额	环比增幅	日均换手率	环比增长
2816	沪深 300 地产 ETF	205.44	-55.77%	3.98%	-55.28%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	0.56	-84.57%	0.00%	-86.44%
2823	安硕 A50ETF	110055.28	31.57%	2.24%	28.64%
2827	标智沪深 300ETF	2754.56	23.70%	0.44%	19.50%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	57.44	7.67%	0.07%	10.07%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	232.89	473.62%	0.49%	538.11%
2844	沪深 300 金融 ETF	253.94	8.25%	3.39%	3.61%
2846	安硕沪深 300ETF	344.00	-20.47%	0.32%	-21.42%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	158.56	1821.89%	0.59%	1896.78%
3005	沪深 300 工业 ETF	263.72	-10.34%	7.09%	-8.91%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	0.78	-42.39%	0.00%	-38.85%
3017	沪深 300 能源 ETF	241.78	-37.66%	4.21%	-40.60%
3024	标智上证 50ETF	6.06	45.92%	0.03%	39.79%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	251.22	-31.03%	1.61%	-31.54%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	18.89	687.04%	0.04%	675.13%
3049	沪深 300ETF	4155.44	2.23%	1.54%	3.34%



3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	6.56	72.51%	0.02%	60.44%
3051	中金深证 100ETF	0.06	-99.05%	0.01%	-98.89%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	80.78	-21.08%	4.02%	-21.47%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	77.61	-76.71%	0.82%	-74.02%
3061	沪深 300 银行 ETF	336.94	-35.40%	2.21%	-31.78%
3062	沪深 300 原材料 ETF	355.39	33.53%	6.61%	43.64%
3063	沪深 300 运输 ETF	136.83	-37.50%	6.86%	-30.70%
3071	大成中证中国内地消 ETF	2.33	-80.56%	0.07%	-77.52%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.1.3-2012.1.31；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。



❖ 股指期货

表 13: 沪深 300 股指期货 1 月份数据统计

合约代码	月开盘价	月最高价	月最低价	月收盘价	涨跌	持仓量	持仓变化	月末结算价	成交量	成交金额
IF1201	2381.00	2499.40	2273.00	2498.20	141.20	0	-37515	2497.92	3356584	24024.89
IF1202	2389.00	2530.80	2282.40	2476.00	107.80	38889	36130	2468.80	2067508	15339.01
IF1203	2407.00	2544.20	2297.40	2490.20	107.40	9940	4322	2483.40	100707	741.61
IF1206	2410.80	2563.60	2318.00	2510.80	106.00	3195	644	2505.60	16014	118.72
IF1209	2577.00	2578.40	2519.60	2532.60	-20.60	367	367	2525.20	803	61.20

说明: (1) 价格: 300/点 (2) 成交量、持仓量: 手 (按单边计算) (3) 成交额: 亿元 (按单边计算)

数据来源: 中金所网站; 截止日期2012.1.31

图 7: 沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

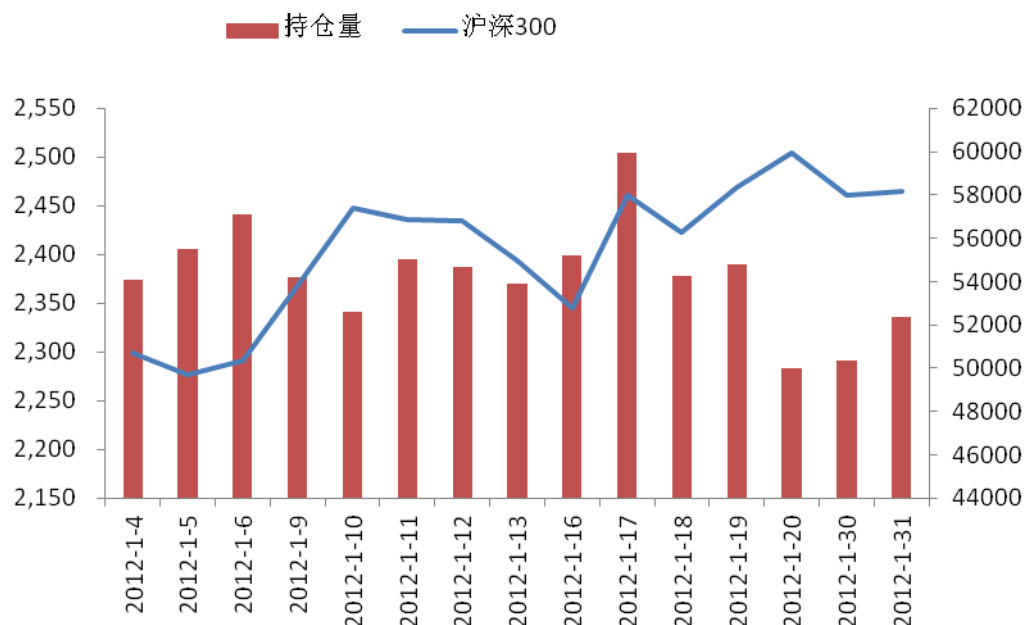
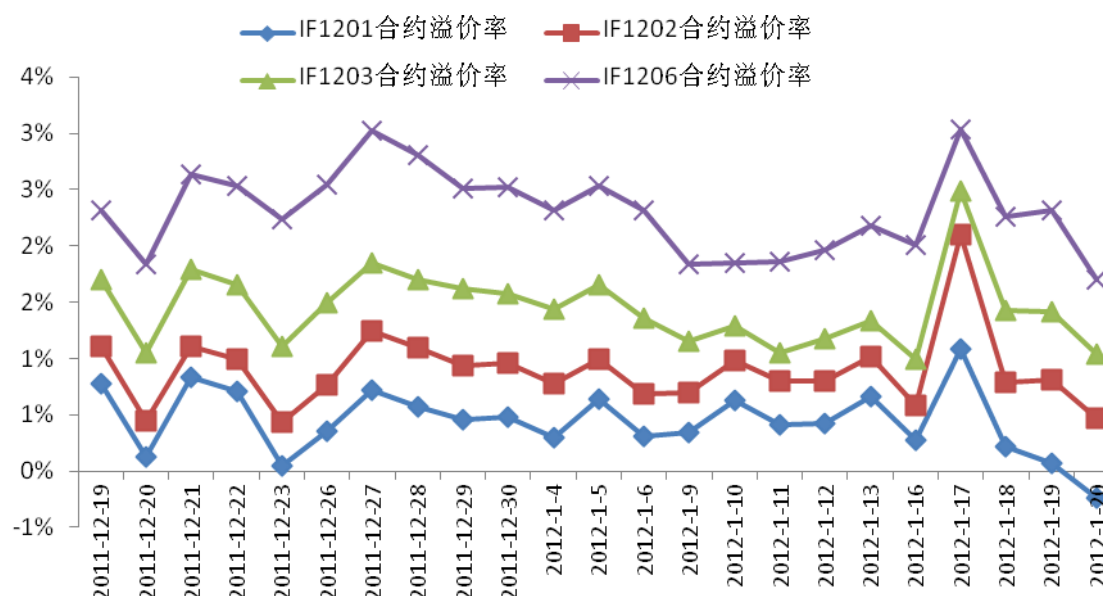
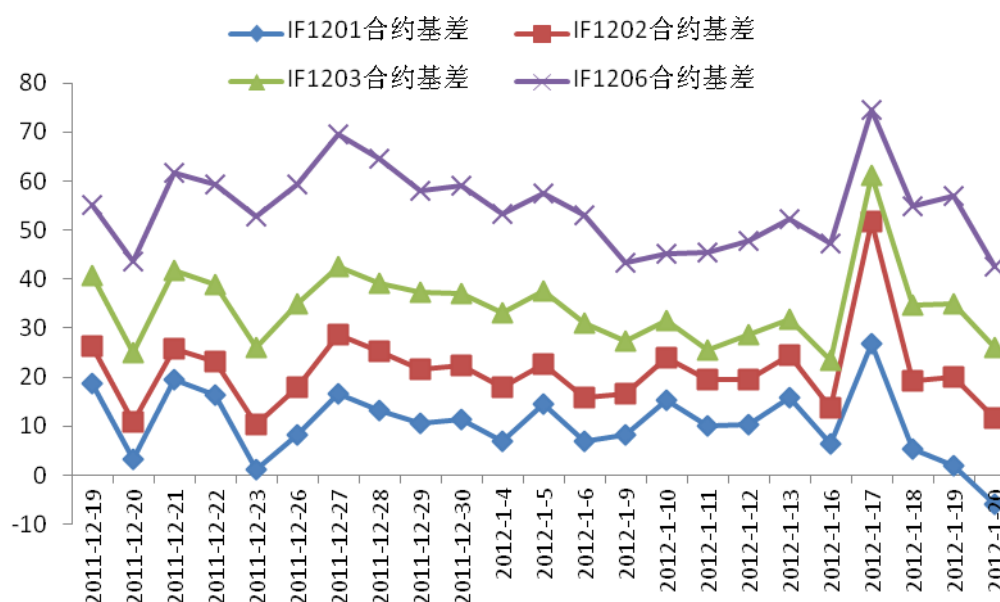


图 8: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注: 合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1; 统计期为 2011.12.19-2012.1.20

图 9: 沪深 300 股指期货合约基差走势比较



注: 基差=期指收盘价-股指收盘价; 统计期为 2011.12.19-2012.1.20



免责声明

本报告基于已公开的数据和文字资料，我公司力求但不保证相关资料的准确性及完整性。

报告中的信息或观点仅供参考，均不构成对任何投资工具的买卖建议或投资策略的行为依据。

我公司保留报告所有版权，未经书面许可任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。

深圳证券信息公司指数事业部

地址：广东省深圳市福田区红荔西路上步工业区 10 栋

邮编：518028

电话：0755-83241251、83243717

传真：0755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://index.cninfo.com.cn>