



2012 年 11 月 指数产品动态

深圳证券信息有限公司指数事业部

业内动态

➤ 证监会：进一步放宽 QFII 和 RQFII 额度

11 月 28 日，中国证监会国际合作部主任童道驰在香港出席第三届泛亚监管峰会时表示，未来将会进一步放宽合格境外机构投资者(QFII)和人民币合格境外机构投资者(RQFII)的额度，鼓励海外资金投资内地，并欢迎香港强积金资产投资内地 A 股市场。

另据中登公司最新披露的数据显示，基金开户数创出近 5 个月来的新高。有业内人士指出，从近期 QFII 加速入市等信息看，基金开户数的骤升可能表明长期资金入市的步伐在加快。

➤ 首只企业债 ETF 上报

据证监会网站显示，11 月 29 日，博时基金正式向证监会有关部门递交企业债 ETF 的申报材料，成为国内第一家上报企业债 ETF 的基金公司。

据了解，企业债 ETF 包含了一篮子债券，在某种程度上能够起到信用增强的作用。此外，一旦 ETF 份额可进行交易所质押回购，也为投资者交易所杠杆融资提供了流动性佳的新型工具，这对于券商等机构来说更是一大利好。

业内人士认为，企业债 ETF 的推出意义重大，将进一步增强交易所债券市场的流动性以及价格透明度，提高市场效率。

➤ 证监会鼓励产品创新 降低门槛弱化审批

12 月 2 日，在第十一届中国证券投资基金国际论坛上，证监会基金监管部主任王林表示，将大力推进产品创新，稳定发展跨市场、跨境 ETF 和场内货币市场基金，尽快推出黄金 ETF 和债券 ETF，积极研究推出 REITS 产品，拓展基金的投资范围。

在同一论坛上，证监会主席助理张育军亦表示，在公募基金领域，要不断拓宽基金公司业务范围，松绑投资运作限制，另外，无论机构准入还是产品创新，都要尽量降低门槛、弱化审批。



➤ **本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况**

新上市

工银瑞信睿智深证 100 指数分级基金于 11 月 5 日上市。

新成立

交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数基金 11 月 7 日成立，首募 3.00 亿。

易方达中债新综合债券指数发起式基金(LOF)11 月 8 日成立，首募 13.83 亿。

新发行

银华中证中票 50 指数债券型基金(LOF)于 11 月 5 日发行。

诺安中小板 ETF 及其联接基金于 11 月 5 日发行。

东方央视财经 50 指数增强型基金于 11 月 19 日发行。

新获批

中债信用债指数增强型发起式基金于 11 月 2 日获批。

景顺长城沪深 300 等权重 ETF 于 11 月 19 日获批。

嘉实中证 500ETF 及其联接基金于 11 月 27 日获批。

银河沪深 300 成长增强指数分级基金于 11 月 28 日获批。

新申报

国泰基金于 11 月 19 日申报国证医药卫生行业指数分级基金。

易方达基金于 11 月 20 日申报沪深 300ETF 发起式基金。

华夏基金于 11 月 20 日申报沪深 300ETF。

富国基金于 11 月 27 日申报创业板指数分级基金。



市场要点

➤ 国内 ETF

由于市场持续下跌等原因，本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1312.09 亿元下降至本期的 1228.34 亿元。深市 ETF 资产规模小幅超越沪市，占据 51.44% 的市场份额。从产品规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，资产净值达到 343.84 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的 ETF 为南方上证 380ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额以华泰柏瑞沪深 300ETF 和上证 50ETF 领先，分别为 7.83 亿元和 2.81 亿元。

➤ LOF

2012 年 11 月，LOF 指数基金的场内规模为 43.02 亿份，较上月减少 0.22 亿份；场内资产净值为 25.78 亿元，较上月减少 1.57 亿元。

➤ 创新型指数基金

2012 年 11 月，创新型指数基金的场内规模为 439.70 亿份，较上月增加 24.84 亿份；场内资产净值为 313.01 亿元，较上月减少 10.59 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末，25 只 ETF 资产规模为 738.30 亿港币。11 月市场普跌，以安硕 A 股主要消费 ETF 的净值跌幅最大，达到 13.05%；从活跃程度看，安硕 A50ETF 日均成交金额最大，达到 13.20 亿港币，其日均换手率也最高，达到 2.40%。

➤ 股指期货

11 月份沪深 300 指数收报于 2139.66，较上月跌幅为 5.11%。而同期可比股指期货合约 IF1212、IF1303、IF1306 跌幅分别为 5.72%、5.94% 和 6.07%。从成交情况看，五份合约累计成交量 11819406 手，较上月增加 23.47%，累计成交金额 78685.41 亿，较上月增加 18.73%。



统计数据

国内指数基金概况

表 1: 指数基金分布情况 (按基金类别统计)

类别	已成立只数	新成立只数	新发行只数	新获批只数	新申报只数
ETF	45	0	1	2	2
LOF	26	2	1	0	0
创新型基金	29	0	0	0	2
其他指数基金	112	0	1	2	0
总计	212	2	3	4	4

注: 统计期间为 2012.11.1-2012.11.30

表 2: 指数基金分布情况 (按跟踪标的统计)

跟踪标的	已成立只数	新成立只数	新发行只数	新获批只数	新申报只数
深证指数	53	0	1	0	1
上证指数	54	0	0	0	0
巨潮指数	4	0	1	0	1
中证指数	78	1	1	3	2
其他机构	23	1	0	1	0
总计	212	2	3	4	4

注: 统计期间为 2012.11.1-2012.11.30。

表 3: 国内指数基金净值增长/下跌前五名

基金代码	基金名称	管理人	标的指数	本期净值增幅
159918	嘉实中创 400ETF	嘉实	中创 400 (399624)	-13.77%
070030	嘉实中创 400 ETF 联接	嘉实	中创 400 (399624)	-13.04%
159907	广发中小板 300 ETF	广发	中小 300P (399008)	-12.65%
159915	易方达创业板指 ETF	易方达	创业板指 (399006)	-12.24%
162010	长城久兆中小板 300 指数分级	长城	中小 300P (399008)	-11.96%
510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	华宝兴业	180 价值 (000029)	-0.76%
240016	华宝兴业上证 180 价值联接	华宝兴业	180 价值 (000029)	-0.64%
162907	泰信中证锐联基本面 400 指数分级	泰信	基本面 400 (000966)	0.00%
660014	农银汇理深证 100 指数增强	农银汇理	深证 100 (399330)	0.11%
150108	长盛同辉深证 100 等权重指数分级	长盛	深证 100 等权 (399632)	0.59%

注: 统计期间为 2012.11.1-2012.11.30。



国内 ETF

表 4：深沪交易所上市 ETF 概况

上市地点	ETF 数量	本月新增	资产净值（亿元）	市场份额
深市	18	0	631.86	51.44%
沪市	29	0	596.48	48.56%
总计	47	0	1228.34	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.11.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 5：跟踪各系列指数 ETF 概况

跟踪标的	ETF 数量	本月新增	资产净值（亿元）	市场份额
深证指数	16	0	283.02	23.04%
上证指数	27	0	395.78	32.22%
中证指数	2	0	539.17	43.89%
其他指数	2	0	10.37	0.84%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.11.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 6：ETF 前五大指数基金管理人列表

基金公司	ETF 数量	本月新增	资产净值（亿元）	市场份额
嘉实基金管理有限公司	3	0	350.09	28.50%
华夏基金管理有限公司	3	0	213.77	17.40%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	208.56	16.98%
易方达基金管理有限公司	4	0	186.13	15.15%
华安基金管理有限公司	2	0	83.11	6.77%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.11.30。

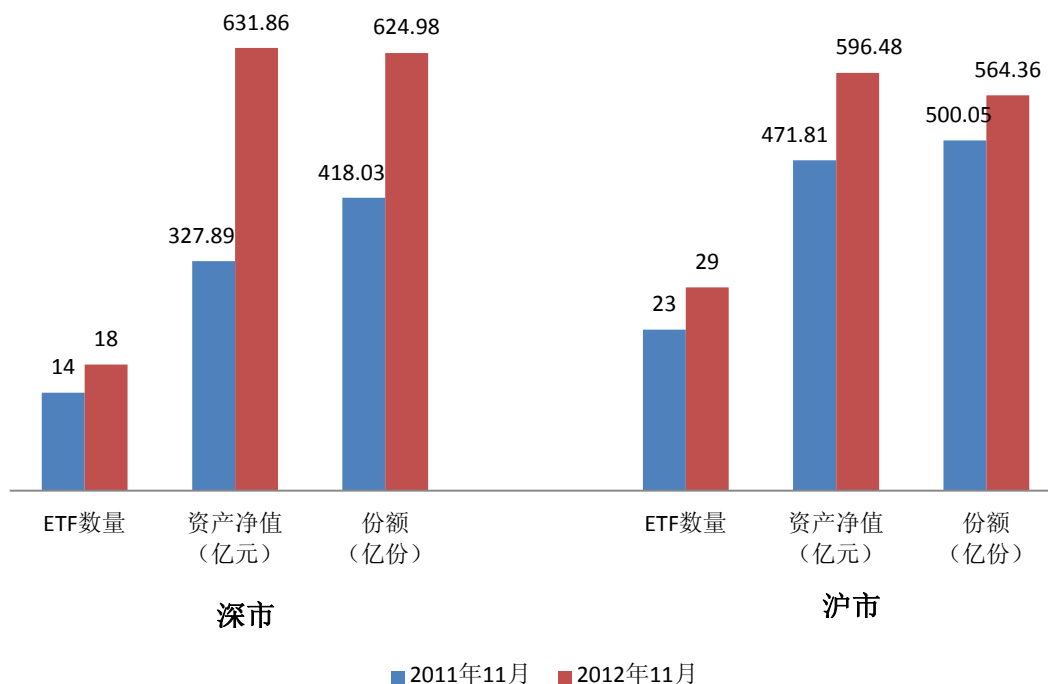
表 7：规模最大的前十只 ETF 列表

代码	简称	管理人	份额（亿份）	资产净值（亿元）	对指数覆盖率
159919	300ETF	嘉实	160.71	343.84	0.26%
510300	300ETF	华泰柏瑞	89.32	194.09	0.15%
510050	50ETF	华夏	111.46	172.43	0.23%
159901	深 100ETF	易方达	334.60	167.33	0.83%
510180	180ETF	华安	164.18	76.67	0.07%
159902	中小板 ETF	华夏	21.02	36.34	0.38%
159903	深成 ETF	南方	36.75	29.70	0.22%
510010	治理 ETF	交银施罗德	43.69	24.64	0.03%
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	8.20	13.59	0.03%
159906	深成长 ETF	大成	19.18	12.64	0.15%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.11.30。

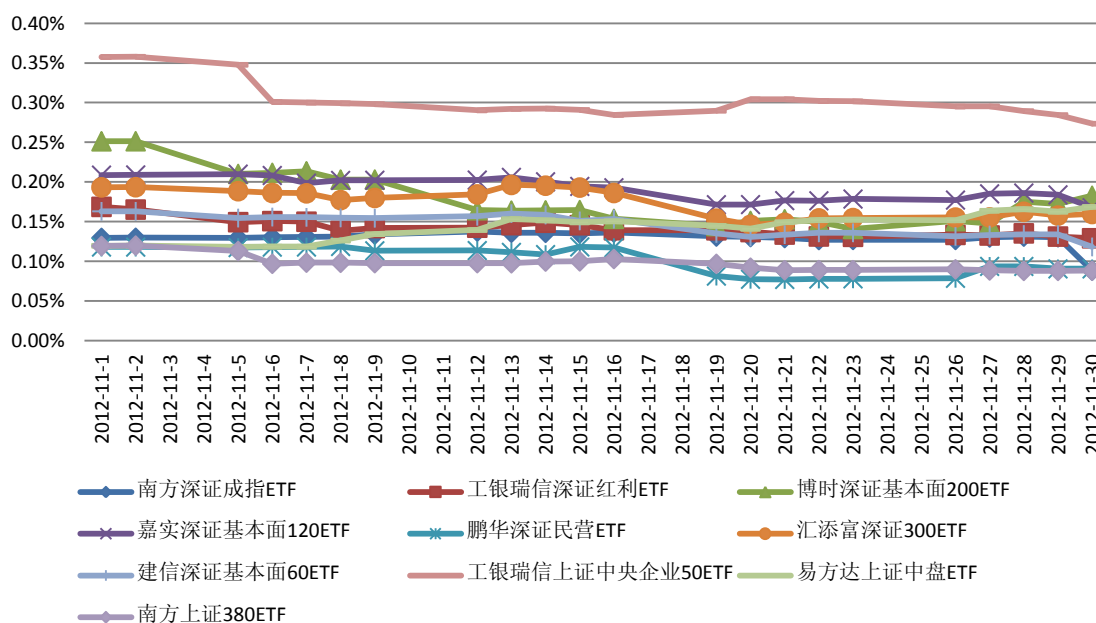


图 1：深沪交易所上市 ETF 年度变化趋势对比



数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.11.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：11 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 3：日均成交金额前 10 只 ETF（亿元）

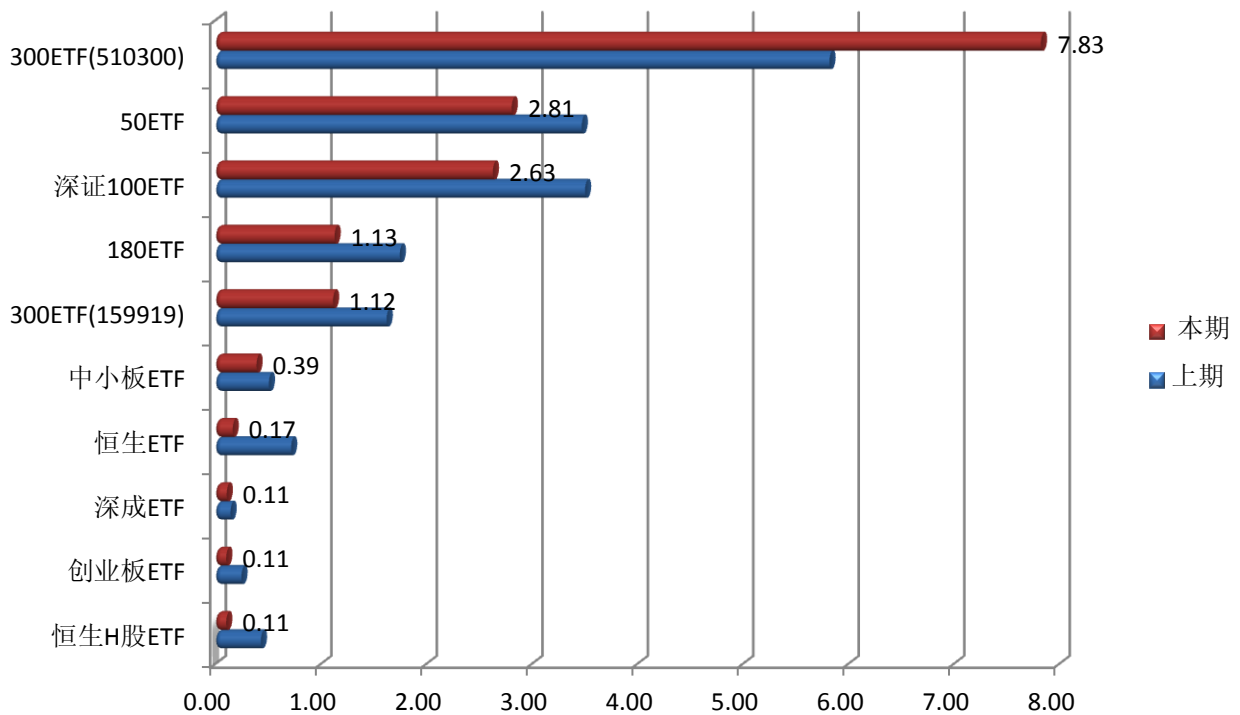
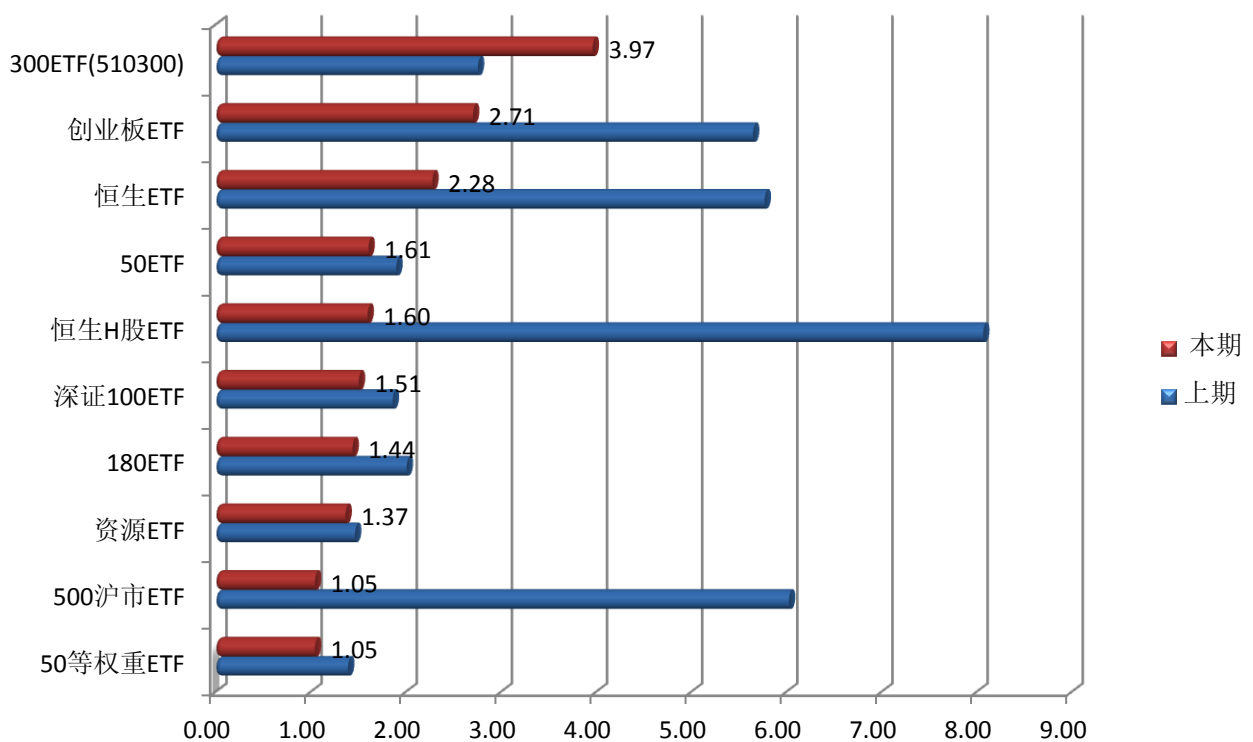


图 4：日均换手率前 10 只 ETF





注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。

➤ LOF

表 8：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	11 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	11 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.49	0.02	1.40%	1.05	-0.11	-9.34%
160125	南方中国	0.03	0.00	9.22%	0.03	0.00	14.10%
160415	华安 S300	0.34	0.00	-0.13%	0.26	-0.02	-8.83%
160615	鹏华 300	0.40	0.00	-0.08%	0.31	-0.02	-5.12%
160616	鹏华 500	0.71	-0.01	-0.77%	0.42	-0.05	-11.50%
160706	嘉实 300	32.92	-0.23	-0.68%	18.98	-1.11	-5.52%
160716	嘉实 50	1.04	0.00	0.18%	0.62	0.00	-0.59%
160717	恒生 H 股	0.43	-0.02	-3.40%	0.32	-0.01	-3.77%
160807	长盛 300	0.09	0.00	-5.35%	0.06	-0.01	-10.11%
161017	富国 500	0.08	0.00	-0.86%	0.06	-0.01	-11.42%
161211	国投金融	1.00	0.00	-0.46%	0.71	-0.02	-2.53%
161213	国投消费	0.23	0.00	1.53%	0.17	-0.01	-7.81%
161607	融通巨潮	0.65	0.00	0.01%	0.44	-0.02	-3.40%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-0.68%	0.01	0.00	-2.35%
161811	银华 300	0.16	0.00	-0.33%	0.11	-0.01	-4.97%
161903	万家公用	0.35	0.00	-0.06%	0.17	-0.01	-6.59%
161907	万家红利	0.54	0.00	-0.37%	0.40	-0.02	-4.22%
162307	海富 100	0.20	0.00	0.57%	0.13	0.00	-2.61%
162411	华宝油气	0.02	0.00	4.57%	0.02	0.00	2.90%
162711	广发 500	1.60	0.02	1.30%	1.03	-0.11	-9.31%
163001	长信 100	0.12	0.00	-0.04%	0.09	0.00	-3.55%
163407	兴全 300	0.27	0.00	-0.62%	0.20	-0.01	-4.69%
163821	中银 300E	0.01	0.00	-11.00%	0.01	0.00	-17.47%
164205	天弘深成	0.02	-0.01	-19.29%	0.01	0.00	-24.47%
165309	建信 300	0.19	0.00	-0.64%	0.12	-0.01	-5.46%
165806	东吴 100	0.04	0.00	-1.49%	0.03	0.00	-8.48%
166007	中欧 300	0.06	0.00	0.48%	0.04	0.00	-5.15%
总计		43.02	-0.22		25.78	-1.56	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.11.1-2012.11.30。

➤ 创新型指数基金

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	11 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	11 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	34.55	-0.50	-1.43%	25.15	-5.34	-17.52%



指数产品动态 总第 34 期

150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.62	-0.28	-14.60%	1.50	-0.35	-19.15%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.62	-0.28	-14.60%	1.50	-0.35	-19.15%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	14.68	-1.73	-10.53%	16.90	-1.92	-10.22%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	22.02	-2.59	-10.53%	12.75	-2.73	-17.64%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	82.96	9.91	13.57%	87.86	10.86	14.11%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	82.96	9.91	13.57%	29.45	-4.74	-13.85%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	47.39	7.58	19.05%	48.48	6.52	15.55%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	47.39	7.58	19.05%	4.60	-1.22	-20.91%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	8.46	-0.14	-1.68%	8.92	-0.10	-1.12%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	12.69	-0.22	-1.68%	3.51	-1.65	-31.92%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	11.29	-2.56	-18.50%	11.48	-2.52	-18.02%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	11.29	-2.56	-18.50%	10.44	-3.92	-27.30%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.48	-0.14	-22.74%	0.51	-0.15	-22.37%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.48	-0.14	-22.74%	0.30	-0.15	-33.87%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.16	0.04	34.65%	0.17	0.04	35.41%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.24	0.06	34.65%	0.16	0.01	8.10%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.08	0.00	-1.31%	0.08	0.00	-0.76%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.11	0.00	-1.31%	0.07	-0.02	-21.80%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.11	-0.01	-5.68%	0.11	-0.01	-5.23%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.16	-0.01	-5.68%	0.09	-0.04	-27.45%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	3.64	0.11	3.00%	3.87	0.13	3.58%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	5.46	0.16	3.00%	3.57	-0.43	-10.78%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.06	0.00	-4.98%	0.06	0.00	-4.44%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.09	0.00	-4.98%	0.06	-0.01	-18.90%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.72	0.00	0.50%	0.75	0.01	1.07%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.72	0.00	0.50%	0.38	-0.15	-28.60%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.09	0.03	65.44%	0.09	0.04	66.39%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.13	0.05	65.44%	0.08	0.02	29.37%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.14	0.01	6.66%	0.14	0.01	7.18%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.14	0.01	6.66%	0.08	-0.01	-6.37%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.81	0.00	0.04%	0.84	0.01	0.61%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.81	0.00	0.04%	0.43	-0.10	-19.12%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	0.71	0.27	59.95%	0.74	0.28	60.88%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	0.71	0.27	59.95%	0.40	0.06	16.94%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.06	-0.01	-7.81%	0.07	-0.01	-7.30%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.06	-0.01	-7.81%	0.04	-0.01	-26.86%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.22	-0.02	-6.87%	0.22	-0.02	-6.41%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.22	-0.02	-6.87%	0.15	-0.06	-29.80%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.14	0.00	1.60%	0.14	0.00	2.11%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.14	0.00	1.60%	0.12	-0.03	-17.85%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.01	0.00	-9.55%	0.01	0.00	-9.01%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.01	0.00	-9.55%	0.01	0.00	-10.10%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	13.84	0.25	1.86%	14.35	0.34	2.45%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	20.76	0.38	1.86%	14.20	-1.56	-9.87%



Index Derivatives Report November 2012

150096	商品 A	招商	2012-7-25	1.18	0.14	13.80%	1.21	0.15	14.47%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	1.18	0.14	13.80%	0.77	-0.10	-11.16%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	0.93	-0.24	-20.81%	0.94	-0.24	-20.42%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	0.93	-0.24	-20.81%	0.66	-0.38	-36.67%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.43	-0.17	-29.07%	0.44	-0.18	-28.73%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.43	-0.17	-29.07%	0.33	-0.20	-37.91%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.44	-0.04	-8.28%	0.44	-0.04	-7.77%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.44	-0.04	-8.28%	0.33	-0.14	-29.17%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	1.50	0.07	4.74%	1.52	0.08	5.36%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	1.50	0.07	4.74%	1.20	-0.18	-13.17%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.15	-0.03	-18.14%	0.15	-0.03	-17.73%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.22	-0.05	-18.14%	0.18	-0.08	-30.45%
总计				439.70	24.84		313.01	-10.59	

注：数据来源:深交所;统计期为 2012.11.1-2012.11.30。

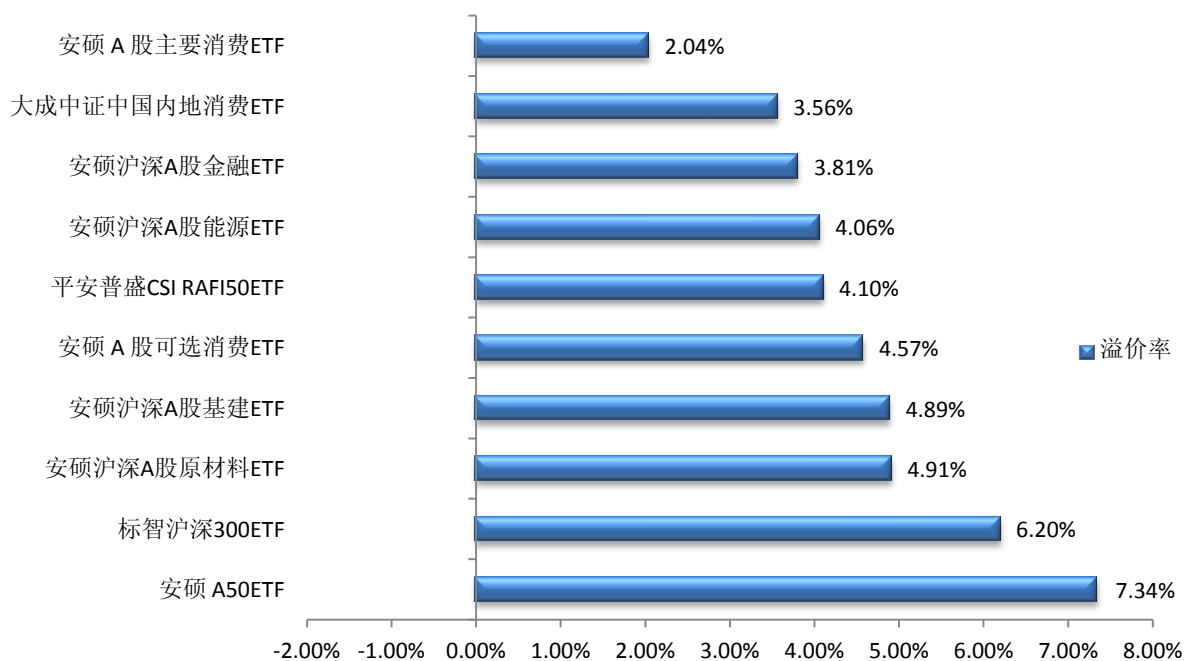
➤ 跨境 ETF

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	0.67
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.49
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	507.66
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	73.40
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.00
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.08
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.87
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	7.20
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.45
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.18
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.21
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.19
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.63
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.08
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.37
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	22.02
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.29
3052	沪深 300 公用事业 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.11
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.60
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.82
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.18
3063	沪深 300 运输 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.12
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	0.04
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments Limited	2012-10-12	18.29



图 5：溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注：统计期为 2012.11.1-2012.11.30

表 11：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	2.77	-43.99%	0.04%	-49.70%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	0.00	-100.00%	0.00%	-100.00%
2823	安硕 A50ETF	132039.36	4.93%	2.40%	0.94%
2827	标智沪深 300ETF	2489.45	33.46%	0.31%	35.79%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	16.45	-91.06%	0.05%	-91.09%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	140.73	479.12%	0.59%	497.94%
2844	沪深 300 金融 ETF	162.77	79.46%	2.01%	65.08%
2846	安硕沪深 300ETF	507.00	271.84%	0.66%	290.97%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	5.23	-92.81%	0.03%	-92.78%
3005	沪深 300 工业 ETF	1.95	-62.77%	0.11%	-62.79%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	10.05	87.77%	0.08%	94.75%
3017	沪深 300 能源 ETF	4.09	27.84%	0.20%	40.29%
3024	标智上证 50ETF	34.32	444.73%	0.21%	463.38%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	5.05	-67.66%	0.05%	-67.14%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	1.86	-95.20%	0.01%	-94.89%
3049	沪深 300ETF	2890.00	22.27%	1.30%	20.97%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	5.55	-94.07%	0.04%	-93.98%



3052	沪深 300 公用事业 ETF	0.18	-74.03%	0.02%	-72.73%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	34.95	-13.59%	0.54%	-11.45%
3061	沪深 300 银行 ETF	17.91	-59.16%	0.22%	-59.83%
3062	沪深 300 原材料 ETF	4.09	3.57%	0.21%	11.44%
3063	沪深 300 运输 ETF	0.32	-95.14%	0.04%	-93.52%
3071	大成中证中国内地消 ETF	0.27		0.06%	
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	1659.00	-52.86%	0.81%	-46.19%
3188	华夏沪深 300ETF	11320.68	113.21%	1.51%	64.75%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.11.1-2012.11.30；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。

➤ 股指期货

表 12：沪深 300 股指期货 11 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
IF1211	2257.40	2330.00	2166.00	2169.40	-85.80	0	-68321	2169.39	5036059	34279.27
IF1212	2270.20	2342.80	2121.00	2138.40	-129.80	79377	58343	2140.20	6630528	43392.97
IF1301	2189.00	2217.60	2129.40	2146.40	-29.60	7300	7300	2147.80	80071	522.69
IF1303	2305.60	2378.60	2150.80	2164.80	-136.80	8998	5030	2167.20	61511	413.60
IF1306	2333.20	2411.40	2170.40	2188.40	-141.40	2110	1417	2191.20	11237	76.88

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 2012.11.30

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

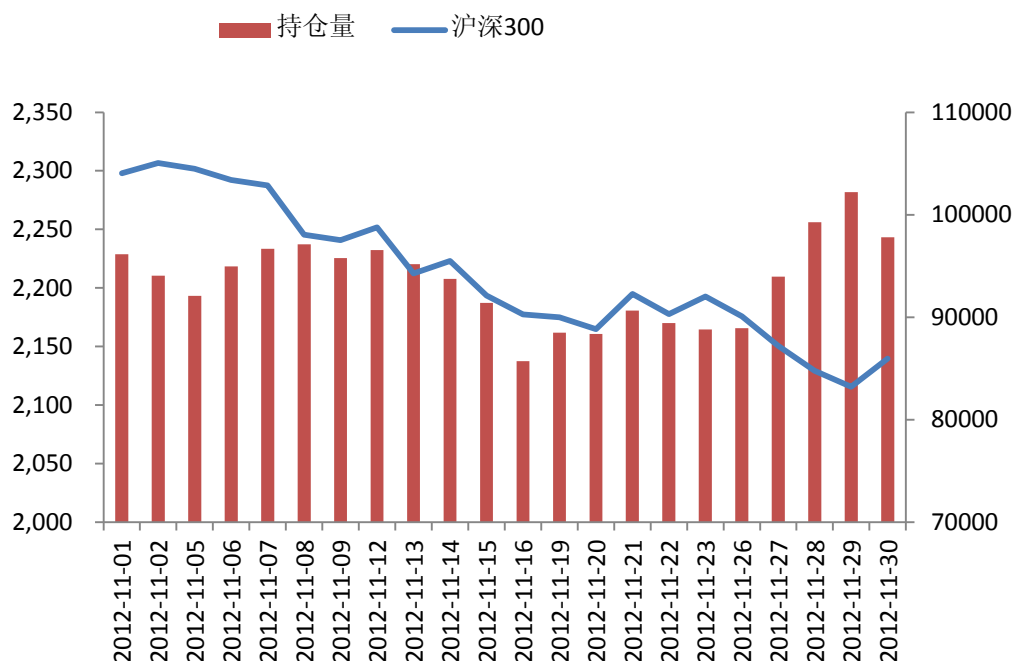
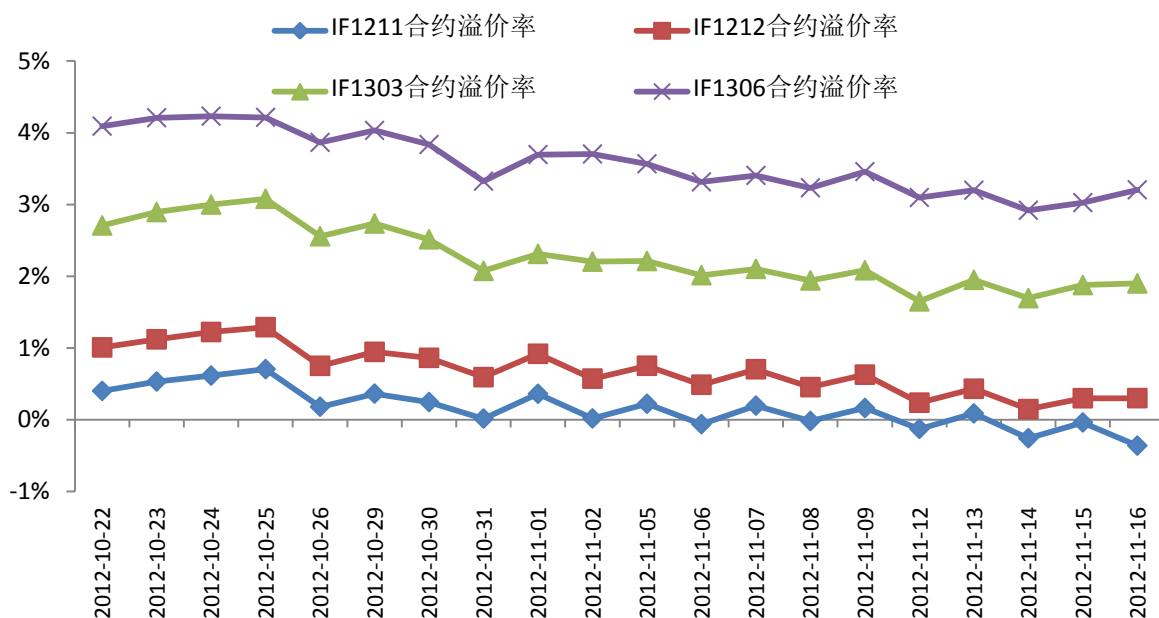


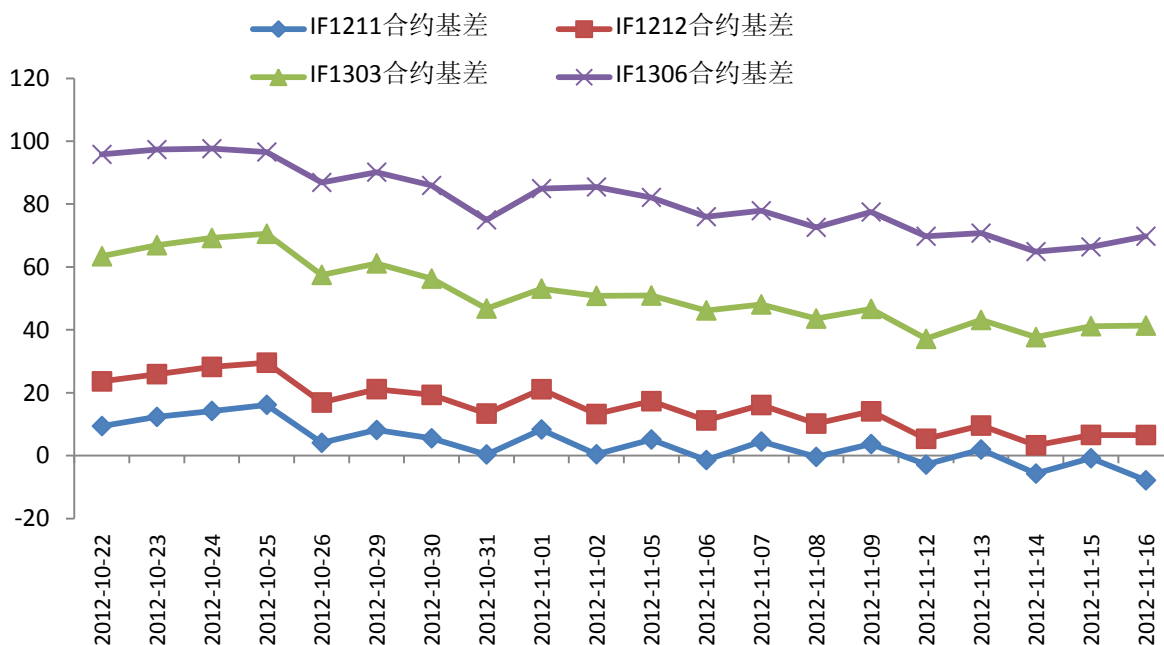


图 7: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2012.10.22-2012.11.16

图 8: 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 2012.10.22-2012.11.16



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：（+86）755-83241251

传真：（+86）755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://index.cninfo.com.cn>