

2012 年 12 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

➤ 分级基金快速扩容 深市指数规模更胜一筹

据统计,截止 12 月底,国内分级指基数量由去年末的 9 只增至目前的 30 只,增幅高达 233%。其中,分级指基跟踪的标的指数中,跟踪深证指数规模占比超过 60%。

分析人士表示,2012 年成为分级指基的快速扩容年,投资者希望借助分级基金的杠杆优势,博取高收益,而深证指数兼具“高收益与高波动”的特色是深证指数分级产品规模增长的重要原因。另外,银华深证 100、申万深证成指等分级指基成立时间早,因为市场认可也促进了规模的增长。

据了解,目前 30 只分级指基跟踪单一指数中,以深证 100 指数为标的的分级基金约占指数分级基金总规模的 43%,远高于市场其他指数,堪称分级基金中的王牌标的。

➤ 三大创新型 ETF 有望突破

从 2013 年 1 月 1 日起,基金产品审核正式告别通道制,这意味着过去简单以发行冲规模的模式已经成为历史,而 2012 年种种巨大创新带来的规模红利,比如沪深 300ETF、短期理财基金等,已经使得创新成为各家基金公司必争之地。据证监会网站显示,12 月份,包括债券 ETF、黄金 ETF 和跨国 ETF 等集中上报。

首先是债券型 ETF,分别从企债和国债破题;在黄金 ETF 方面,目前国泰与华安已经上报,其中华安易富黄金 ETF 将主要投资于金交所场内的黄金投资品种,以追踪我国国内黄金现货价格的走势;跨国 ETF 在 2012 年底的到来,则为 12 月的创新大战再添一个重量级产品。事实上,此前在研究恒指等跨境 ETF 时,纳指等为代表的美国指数就曾在讨论范围中。但由于监管合作与交易时差等关系,最终选择了从香港市场指数先行破题跨境 ETF。

➤ 新基金法修订通过 私募纳入监管

12 月 28 日,第十一届全国人大常委会第三十次会议审议通过了修订后的《中华人民共和国证券投资基金法》,新基金法将于 2013 年 6 月 1 日正式实施。

据了解,新《基金法》将私募基金纳入了调整范围,同时多方面放松公募基金管制,包括基金产品的注册、备案制度,降低公募基金股东的准入门槛等。

➤ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

新上市

本期无新上市的指数基金。

新成立

诺安中小板等权 ETF 及联接基金于 12 月 10 日成立，首募 2.53 亿和 4.09 亿。

银华中证中票 50 指数债券型基金(LOF)于 12 月 13 日成立，首募 33.86 亿。

东方央视财经 50 指数增强型基金于 12 月 19 日成立，首募 5.46 亿。

华夏沪深 300ETF 于 12 月 27 日成立，首募 6.03 亿。

新发行

本期无新发行的指数基金。

新获批

融通标普中国可转债指数增强型基金于 12 月 5 日获批。

中欧中证大宗商品股票指数分级基金于 12 月 5 日获批。

上投摩根上证 180 高贝塔 ETF 于 12 月 5 日获批。

建信央视财经 50 指数分级发起式基金于 12 月 10 日获批。

国泰国证房地产行业指数分级基金于 12 月 10 日获批。

嘉实中证中期企业债指数基金于 12 月 13 日获批。

大成中证 100 ETF 于 12 月 19 日获批。

新申报

国泰基金于 12 月 3 日申报上证 5 年期国债 ETF 及其联接基金。

博时基金于 12 月 3 日申报上证企债 30 ETF 及其联接基金。

国泰基金于 12 月 11 日申报纳斯达克 100 ETF。

嘉实基金于 12 月 12 日申报中证金边中期国债 ETF 及其联接基金。

广发基金于 12 月 18 日申报中证 500 ETF。

长盛基金于 12 月 18 日申报上证市值百强 ETF 及其联接基金。

国联安于 12 月 18 日申报中证股债动态策略指数基金。

市场要点

➤ 国内 ETF

2012 年 12 月，沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1228.34 亿元增加至本期的 1450.42 亿元。其中，深市 ETF 占据 50.89% 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 411.02 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的 ETF 为南方深证成份 ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额以华泰柏瑞沪深 300ETF 和华夏上证 50ETF 领先，分别为 10.87 亿元和 6.30 亿元。

➤ LOF

2012 年 12 月，LOF 指数基金的场内规模为 41.41 亿份，较上月减少 1.61 亿份；场内资产净值为 28.98 亿元，较上月增加 3.2 亿元。

➤ 创新型指数基金

2012 年 12 月，创新型指数基金的场内规模为 445.41 亿份，较上月增加 5.71 亿份；场内资产净值为 367.15 亿元，较上月增加 54.15 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末，27 只 ETF 资产规模为 1279.96 亿港币。12 月市场普涨，以沪深 300 金融指数 ETF 的净值涨幅最大，达到 24.21%；从活跃程度看，安硕富时 A50ETF 日均成交金额最大，达到 22.88 亿港币，其日均换手率也最高，达到 3.85%。

➤ 股指期货

12 月份沪深 300 指数收报于 2522.95，较上月涨幅为 17.91%。而同期可比股指期货合约 IF1301、IF1303、IF1306 涨幅分别为 18.24%、18.58% 和 18.33%。从成交情况看，五份合约累计成交量 14852949 手，较上月增加 25.67%，累计成交金额 104035.64 亿，较上月增加 32.22%。

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	47	2	0	2	8
LOF	26	1	0	0	0
创新型基金	29	0	0	4	1
其他指数基金	115	2	0	1	2
总计	217	5	0	7	11

注: 统计期间为 2012.12.1-2012.12.31

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	55	2	0	0	0
上证指数	54	0	0	1	6
巨潮指数	5	1	0	2	0
中证指数	80	2	0	3	4
其他机构	23	0	0	1	1
总计	217	5	0	7	11

注: 统计期间为 2012.12.1-2012.12.31。

表 3: 国内指数基金净值表现前五名/后五名

基金代码	基金名称	管理人	标的指数	本期净值增幅
510230	上证 180 金融 ETF	国泰	180 金融 (000018)	25.04%
510090	上证社会责任 ETF	建信	责任指数 (000048)	23.46%
161211	沪深 300 金融地产 (LOF)	国投瑞银	300 金融 (000914)	22.95%
020021	上证 180 金融联接基金	国泰	180 金融 (000018)	22.45%
530010	上证社会责任联接基金	建信	责任指数 (000048)	22.20%
090020	中证 500 联接基金	大成	中证 500 (000905)	0.10%
150108	深证 100 等权重指数分级	长盛	深证 100 等权 (399632)	0.59%
162907	中证锐联基本面 400 指数分级	泰信	基本面 400 (000966)	8.08%
180033	上证 50 等权重联接基金	银华	上证 50 等权 (000016)	9.61%
090016	中证内地消费主题指数基金	大成	内地消费 (000942)	9.83%

注: 统计期间为 2012.12.1-2012.12.31。

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	738.05	50.89%
沪市	29	0	712.37	49.11%
总计	47	0	1450.42	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.12.31；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	312.25	21.53%
上证指数	26	0	460.69	31.76%
中证指数	3	0	651.53	44.92%
其他指数	2	0	25.93	1.79%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.12.31；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	418.51	28.85%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	254.15	17.52%
华夏基金管理有限公司	3	0	241.08	16.62%
易方达基金管理有限公司	4	0	226.28	15.60%
华安基金管理有限公司	2	0	96.18	6.63%

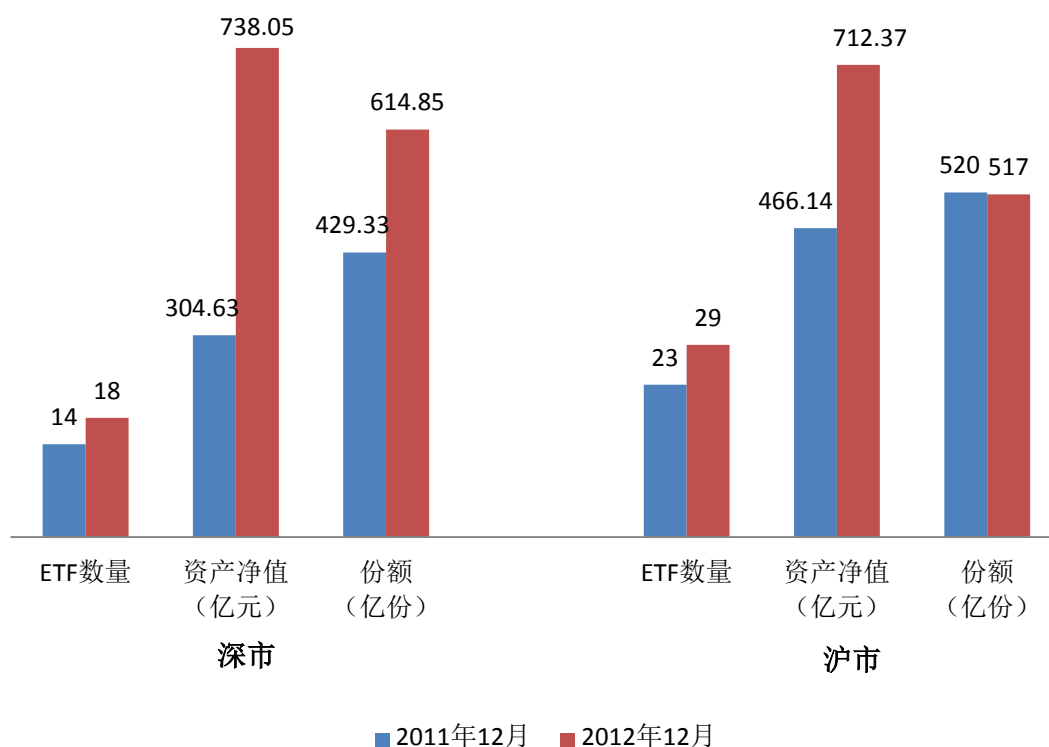
数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.12.31。

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	沪深 300ETF	嘉实	162.9	411.02	0.32%
510300	沪深 300ETF	华泰柏瑞	93.75	236.72	0.19%
510050	上证 50ETF	华夏	104.39	193.64	0.26%
159901	深证 100ETF	易方达	324.77	188.5	0.98%
510180	上证 180ETF	华安	160.55	89.11	0.09%
159902	中小板指 ETF	华夏	21.57	42.9	0.41%
159903	深证成份 ETF	南方	37.97	35.36	0.28%
510010	180 治理 ETF	交银施罗德	45.84	31.4	0.04%
510900	易方达 H 股 ETF	易方达	20.16	21.39	---
510880	上证红利 ETF	华泰柏瑞	8.67	16.56	0.03%

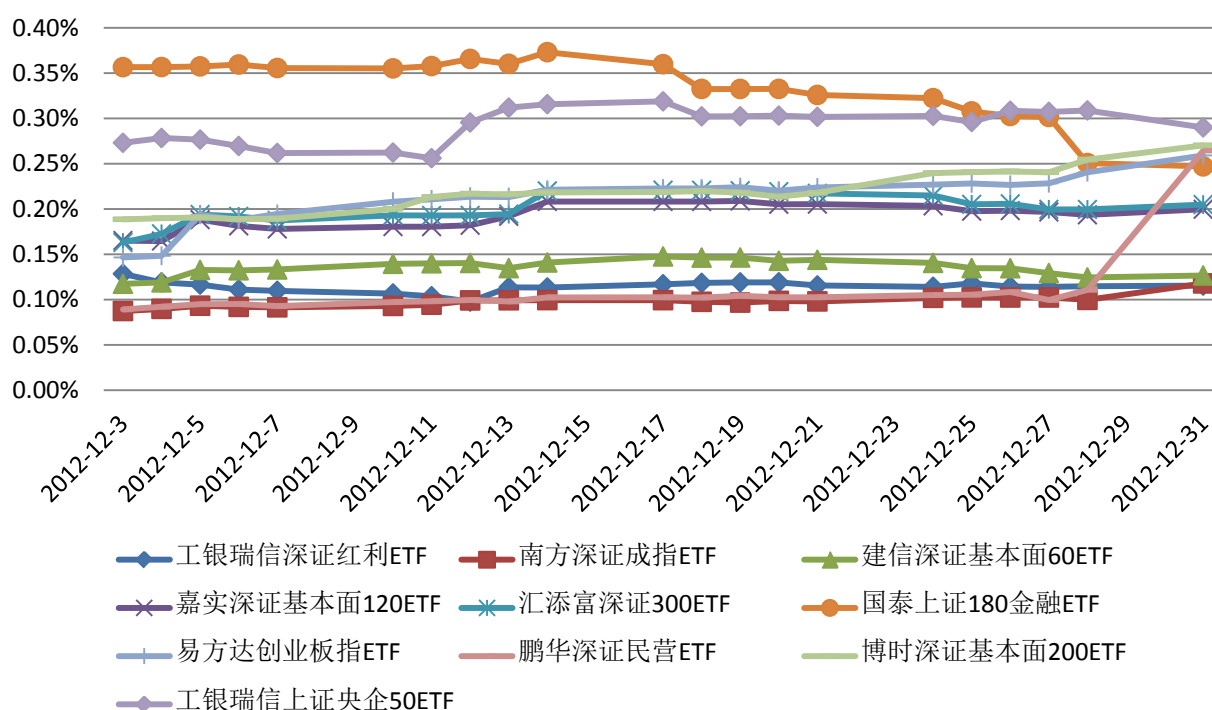
数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.12.31。

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 2012.12.31；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2: 12 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）

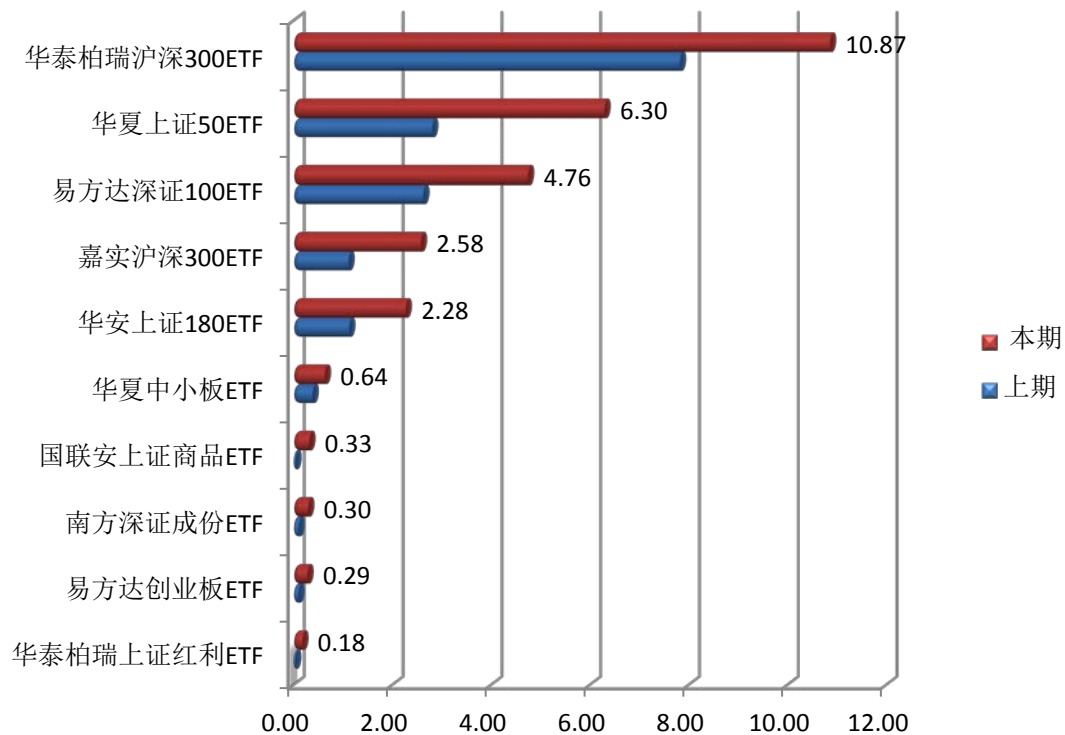
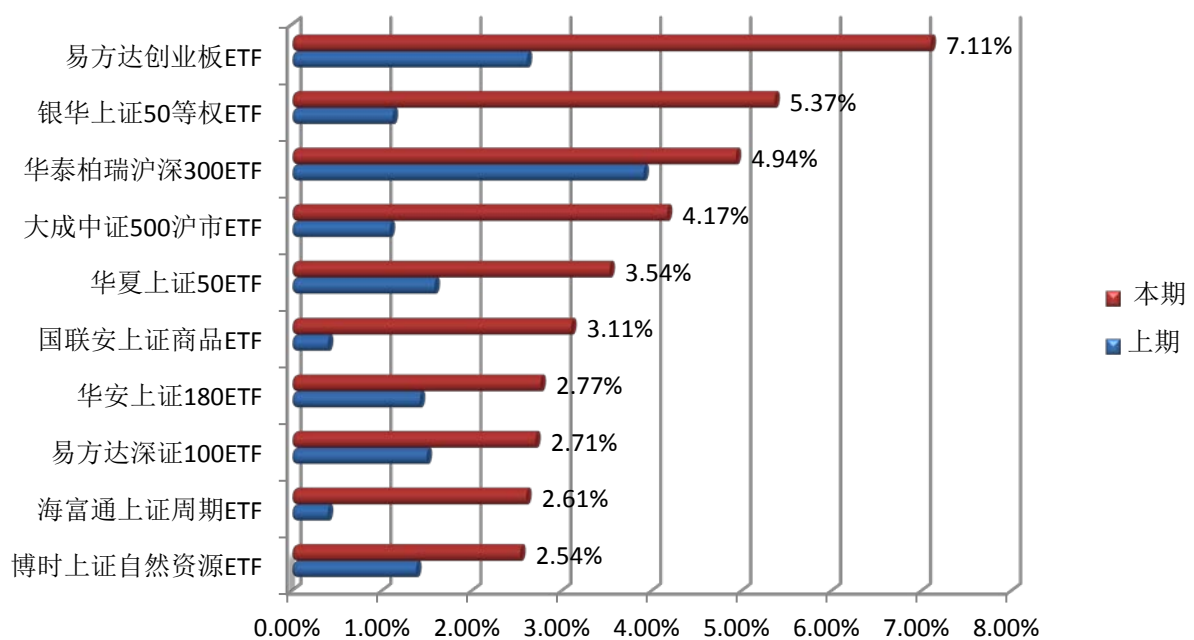


图 4：日均换手率前 10 只 ETF



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	12 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	12 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.46	-0.03	-2.11%	1.18	0.13	12.86%
160125	南方中国	0.02	0.00	-1.73%	0.03	0.00	2.59%
160415	华安 S300	0.34	-0.01	-1.45%	0.29	0.04	14.57%
160615	鹏华 300	0.39	-0.01	-1.37%	0.36	0.05	15.62%
160616	鹏华 500	0.70	-0.01	-1.64%	0.48	0.06	13.43%
160706	嘉实 300	31.58	-1.35	-4.09%	21.29	2.31	12.17%
160716	嘉实 50	0.98	-0.07	-6.33%	0.69	0.06	9.98%
160717	恒生 H 股	0.41	-0.02	-3.67%	0.33	0.01	4.17%
160807	长盛 300	0.07	-0.01	-14.06%	0.06	0.00	0.21%
161017	富国 500	0.08	0.00	0.31%	0.07	0.01	13.79%
161211	国投金融	0.99	-0.01	-1.03%	0.86	0.15	21.68%
161213	国投消费	0.23	0.00	0.04%	0.18	0.02	10.87%
161607	融通巨潮	0.64	-0.01	-1.16%	0.50	0.05	12.22%
161714	招商金砖	0.01	0.00	4.59%	0.01	0.00	10.24%
161811	银华 300	0.11	-0.05	-32.77%	0.09	-0.02	-21.52%
161903	万家公用	0.35	0.00	-0.58%	0.19	0.02	10.96%
161907	万家红利	0.53	-0.01	-1.58%	0.46	0.06	16.05%
162307	海富 100	0.19	-0.01	-3.00%	0.15	0.02	14.02%
162411	华宝油气	0.02	0.00	-6.01%	0.02	0.00	-6.31%
162711	广发 500	1.59	-0.02	-0.98%	1.17	0.15	14.31%
163001	长信 100	0.12	0.00	-1.12%	0.10	0.01	16.31%
163407	兴全 300	0.27	0.00	-0.59%	0.23	0.03	17.08%
163821	中银 300E	0.01	0.00	-2.86%	0.01	0.00	10.03%
164205	天弘深成	0.02	-0.01	-31.86%	0.01	0.00	-21.52%
165309	建信 300	0.19	0.00	-0.05%	0.14	0.02	16.84%
165806	东吴 100	0.04	0.00	-1.57%	0.04	0.00	14.23%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-2.82%	0.04	0.00	10.03%
总计		41.41	-1.61		28.98	3.20	

注：数据来源:深交所;统计期为 2012.12.1-2012.12.31。

➤ 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	12 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	12 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	34.19	-0.36	-1.04%	34.25	9.10	36.20%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.52	-0.10	-6.30%	1.73	0.23	15.27%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.52	-0.10	-6.30%	1.57	0.07	4.74%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	14.91	0.23	1.56%	17.24	0.34	2.00%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	22.36	0.34	1.56%	18.07	5.32	41.72%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	78.55	-4.41	-5.31%	83.66	-4.20	-4.78%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	78.55	-4.41	-5.31%	44.85	15.40	52.30%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	48.65	1.25	2.64%	51.81	3.32	6.85%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	48.65	1.25	2.64%	10.75	6.15	133.85%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	16.27	7.81	92.31%	17.23	8.31	93.23%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	24.40	11.71	92.31%	10.15	6.64	188.82%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	9.19	-2.11	-18.65%	9.40	-2.09	-18.17%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	9.19	-2.11	-18.65%	11.38	0.94	8.97%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	1.14	0.65	134.66%	1.20	0.69	135.78%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	1.14	0.65	134.66%	1.02	0.72	243.18%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.14	-0.02	-13.57%	0.15	-0.02	-13.08%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.21	-0.03	-13.57%	0.18	0.02	14.30%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.05	-0.02	-29.23%	0.06	-0.02	-28.88%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.08	-0.03	-29.23%	0.06	-0.01	-10.32%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.08	-0.02	-20.27%	0.09	-0.02	-19.89%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.13	-0.03	-20.27%	0.10	0.00	3.65%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	3.18	-0.46	-12.59%	3.40	-0.47	-12.10%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	4.77	-0.69	-12.59%	4.11	0.54	15.21%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.04	-0.02	-26.95%	0.05	-0.02	-26.54%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.06	-0.02	-26.95%	0.06	0.00	-4.45%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.94	0.23	31.45%	0.99	0.24	32.08%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.94	0.23	31.45%	0.71	0.33	85.75%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.06	-0.03	-28.93%	0.07	-0.03	-28.52%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.09	-0.04	-28.93%	0.08	0.00	-5.35%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.14	0.00	2.09%	0.14	0.00	2.58%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.14	0.00	2.09%	0.12	0.04	44.72%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.70	-0.11	-13.59%	0.73	-0.11	-13.10%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.70	-0.11	-13.59%	0.54	0.11	24.98%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	1.02	0.31	43.83%	1.06	0.33	44.66%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	1.02	0.31	43.83%	0.80	0.40	100.85%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.06	-0.01	-11.77%	0.06	-0.01	-11.26%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.06	-0.01	-11.77%	0.05	0.01	23.37%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.16	-0.06	-26.58%	0.16	-0.06	-26.15%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.16	-0.06	-26.58%	0.16	0.00	2.54%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.06	-0.09	-61.13%	0.06	-0.09	-60.93%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.06	-0.09	-61.13%	0.06	-0.06	-49.53%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.06	0.05	587.76%	0.06	0.05	591.82%

150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.06	0.05	587.76%	0.07	0.06	696.13%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	13.20	-0.64	-4.62%	13.77	-0.58	-4.07%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	19.80	-0.96	-4.62%	17.74	3.54	24.94%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	0.93	-0.25	-21.15%	0.96	-0.25	-20.76%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	0.93	-0.25	-21.15%	0.81	0.04	5.46%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	0.57	-0.35	-38.21%	0.58	-0.36	-37.90%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	0.57	-0.35	-38.21%	0.56	-0.09	-14.00%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.37	-0.06	-13.74%	0.38	-0.06	-13.23%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.37	-0.06	-13.74%	0.39	0.06	19.60%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.42	-0.01	-2.73%	0.43	-0.01	-2.16%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.42	-0.01	-2.73%	0.42	0.09	28.58%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	1.12	-0.38	-25.46%	1.14	-0.38	-25.02%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	1.12	-0.38	-25.46%	1.25	0.05	3.80%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.09	-0.05	-36.43%	0.10	-0.05	-36.18%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.14	-0.08	-36.43%	0.14	-0.04	-22.75%
总计				445.41	5.71		367.15	54.15	

注：数据来源:深交所;统计期为 2012.12.1-2012.12.31。

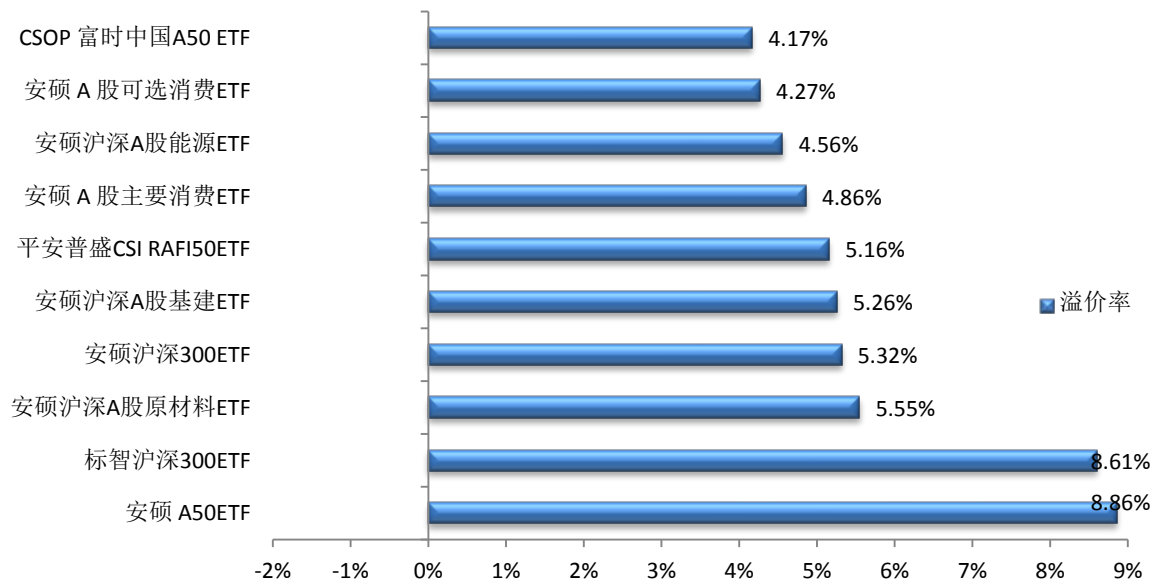
➤ 跨境 ETF

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	0.80
2818	中国平安 CSI RAFI A 股 50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.77
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50	CSOP Asset Management Limited	2012-11-8	209.01
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	589.15
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	87.87
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.09
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.17
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.08
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	6.75
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.67
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.20
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.34
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.23
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.95
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.39
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.46
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	29.58
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.48
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.12

3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.71
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.16
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.20
3063	沪深 300 运输指数 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.13
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
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management	2012-11-9	131.43
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments Limited	2012-10-12	29.12
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management	2012-10-26	175.89

图 5：溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注：统计期为 2012.12.1-2012.12.31

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	61.42	2115.19%	0.85%	2132.63%
2818	中国平安 CSI RAFI A 股 50ETF	1.84	/	0.01%	/
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	77427.89	254.30%	4.58%	160.32%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	228762.58	73.25%	3.85%	60.24%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	8579.00	244.61%	0.96%	205.78%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	23.79	44.58%	0.08%	45.53%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	33.47	-76.21%	0.15%	-73.86%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	311.11	91.13%	3.19%	58.71%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	455.68	-10.12%	0.62%	-5.46%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	8.21	57.07%	0.05%	46.34%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	4.16	112.73%	0.21%	103.37%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	16.95	68.71%	0.13%	56.82%

3017	沪深 300 能源指数 ETF	18.95	363.16%	0.91%	343.92%
3024	标智上证 50 中国指数基金	17.95	-47.70%	0.10%	-51.18%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	93.84	1759.93%	0.74%	1537.24%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	8.42	351.86%	0.06%	350.74%
3049	沪深 300 指数 ETF	4621.47	59.91%	1.81%	39.11%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	3.42	-38.31%	0.02%	-38.95%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	0.32	73.68%	0.03%	40.35%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	28.95	-17.19%	0.45%	-18.04%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	110.95	519.50%	1.09%	406.49%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	13.74	235.79%	0.73%	240.39%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	9.42	2860.90%	0.73%	1952.63%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.63	131.58%	0.14%	115.04%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	9261.32	739.46%	1.14%	258.80%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	2791.16	68.24%	1.20%	49.19%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	42702.74	277.21%	3.21%	113.38%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.12.1-2012.12.31；“/”表示基金上期末上市或未开放申购赎回。

➤ 股指期货

表 12：沪深 300 股指期货 12 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
IF1212	2139.60	2414.60	2111.80	2378.00	239.60	0	-79377	2377.75	7360162	49643.14
IF1301	2147.20	2544.00	2119.20	2538.00	391.60	84272	76972	2537.40	7216724	52391.19
IF1302	2395.80	2557.00	2393.40	2552.00	162.00	3350	3350	2551.20	44292	329.20
IF1303	2166.80	2570.40	2140.60	2567.00	402.20	17925	8927	2565.80	190909	1376.18
IF1306	2195.00	2592.40	2167.60	2589.60	401.20	4839	2729	2588.20	40862	295.91

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 2012.12.31

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

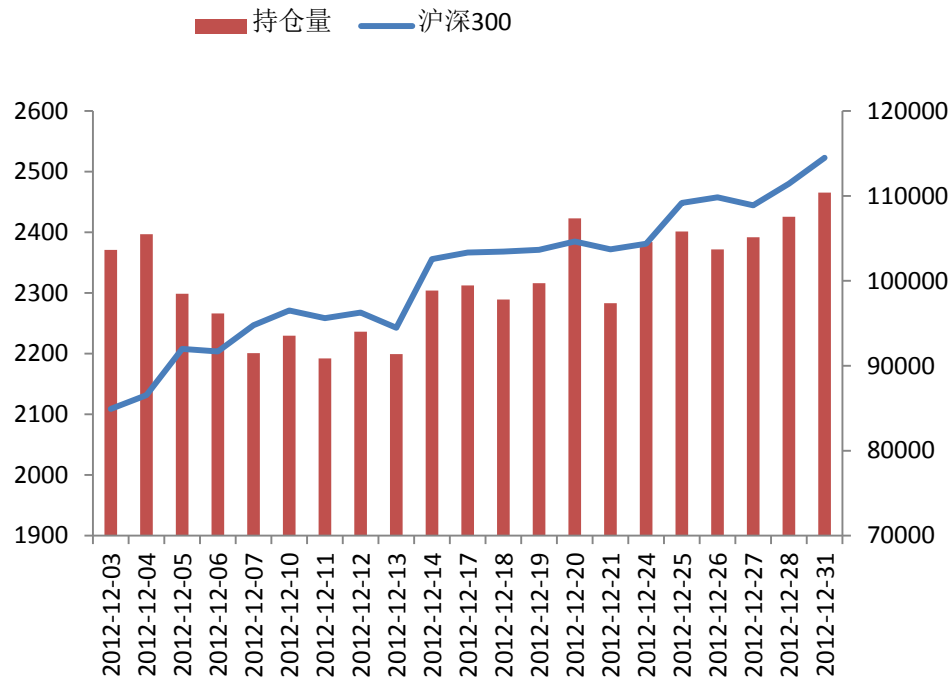
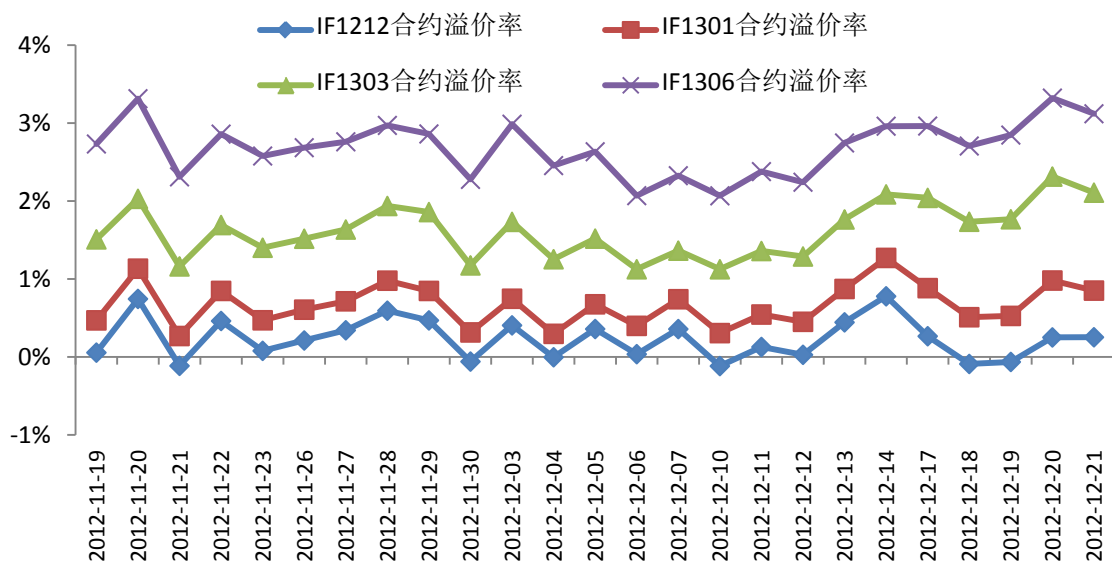
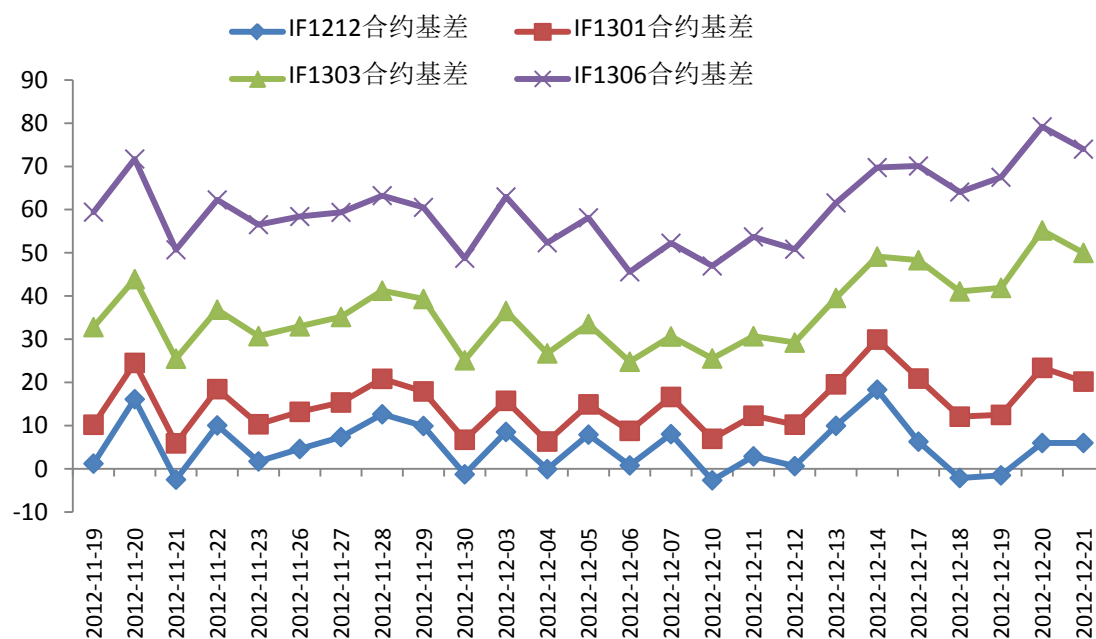


图 7：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2012.11.19-2012.12.21

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 2012.11.19-2012.12.21

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://www.cnindex.com.cn>