

2013 年 2 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

➤ 首只多空分级产品上报 分级基金加大创新力度

据证监会网站显示，2 月初，中欧基金上报跟踪指数的多空分级基金，国内首只多空分级指数基金将面世。

据了解，该多空分级基金在现有分级基金只能做多的基础上引入做空机制。业内人士表示，多空分级基金引入做空机制后，对 A 类约定收益份额的性质做了变更。A 类被改为做空工具，即对 A 类份额做空，对 B 类份额做多，A 类的风险相对变大了。多空杠杆意味着双向都可以操作，基金面临的机会和风险都更大。多空分级基金的推出将为投资者提供较低门槛的做空对冲投资工具。

➤ 公募基金业务准入门槛降低

2 月 18 日，证监会公布了《资产管理机构开展公募证券投资基金管理业务暂行规定》，该规定降低了证券公司、保险资产管理公司、私募证券投资基金管理机构三类机构直接开展公募基金管理业务的门槛，据悉，这些机构可于 6 月 1 日《证券投资基金法》实施后向证监会提交申请。

据了解，《暂行规定》降低了以上三类资产管理机构直接开展公募基金管理业务的门槛，增加了符合条件的股权投资管理机构、创业投资管理机构等其他资产管理机构也可以申请开展基金管理业务的规定。

➤ 证监会：RQFII 试点扩容投资范围扩大

3 月 6 日，证监会发布《人民币合格境外机构投资者（RQFII）境内证券投资试点办法》及《关于实施〈人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法〉的规定》（下称《试点办法》），修改了 RQFII 相关法规，主要内容包括：扩大试点机构类型，放宽投资范围限制，以及明确 RQFII 投资范围和持股比例等相关要求等。

分析人士指出，RQFII 法规修订后，将根据资本市场对外开放和人民币国际化的需要，不断扩大试点规模，吸引更多境外长期资金，促进资本市场改革开放和稳定发展。

► 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

新上市

本期无新上市指数基金。

新成立

招商央视财经 50 指数于 2 月 5 日成立, 首募 13.19 亿。

嘉实中证中期企业债指数基金 (LOF) 于 2 月 5 日成立, 首募 43.85 亿。

嘉实中证 500ETF 于 2 月 6 日成立, 首募 31.09 亿。

国泰国证房地产行业指数分级基金于 2 月 6 日成立, 首募 3.21 亿。

南方中证 500ETF 于 2 月 6 日成立, 首募 11.48 亿。

大成中证 100ETF 于 2 月 7 日成立, 首募 3.99 亿。

新发行

易方达沪深 300ETF 于 2 月 18 日发行。

上证 5 年国债 ETF 及联接基金于 2 月 18 日发行。

中证财通 ESG100 指数基金于 2 月 19 日发行。

嘉实中证 500ETF 联接基金于 2 月 21 日发行。

中银标普全球资源(QDII) 于 2 月 25 日发行。

南方开元沪深 300ETF 于 2 月 25 日发行。

银河沪深 300 成长增强指数分级基金于 2 月 25 日发行。

建信央视财经 50 指数分级基金于 2 月 25 日发行。

华夏上证能源 ETF 于 2 月 25 日发行。

华夏上证原材料 ETF 于 2 月 25 日发行。

华夏上证主要消费 ETF 于 2 月 25 日发行。

华夏上证金融地产 ETF 于 2 月 25 日发行。

华夏上证医药卫生 ETF 于 2 月 25 日发行。

新获批

长盛上证市值百强交易型 ETF 及其联接基金于 2 月 6 日获批。

国联安中证股债动态策略指数基金于 2 月 6 日获批。

德信中证中高收益企债指数分级基金于 2 月 16 日获批。

国泰国证医药卫生行业指数分级基金于 2 月 17 日获批。

嘉实中证金边中期国债 ETF 及其联接基金于 2 月 16 日获批。

广发中证 500ETF 于 2 月 17 日获批。

新申报

博时基金于 2 月 1 日申报中证中期信用债 ETF 及联接基金。

中欧基金于 2 月 4 日申报沪深 300 指数多空分级基金。

华泰柏瑞于 2 月 4 日申报中证申万医药生物 ETF。

国金通用于 2 月 7 日申报沪深 300 指数分级基金。

中海基金于 2 月 16 日申报沪深 300 指数双向分级发起式基金。

中邮创业于 2 月 22 号申报沪深 300 指数分级发起式基金。

市场要点

➤ 国内 ETF

本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1598.96 亿元减少至本期的 1528.03 亿元。从产品规模来看,嘉实沪深 300ETF 规模最大,资产净值达到 367.05 亿元。从跟踪误差情况看,本期最低的 ETF 为上证自然资源 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 15.51 亿元和 9.14 亿元。

➤ LOF

2013 年 2 月,LOF 指数基金的场内规模为 37.63 亿份,较上月减少 2.42 亿份;场内资产净值为 27.93 亿元,较上月减少 1.84 亿元。

➤ 创新型指数基金

2013 年 2 月,创新型指数基金的场内规模为 386.38 亿份,较上月减少 16.82 亿份;场内资产净值为 330.83 亿元,较上月减少 13.95 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末,27 只 ETF 资产规模为 1392.06 亿港元。以沪深 300 医药卫生 ETF 的净值涨幅最大,达到 4.85%;从活跃程度看,安硕 A50 中国 ETF 日均成交金额最大,达到 22.53 亿港元,沪深 300 金融 ETF 日均换手率最高,达到 6.49%。

➤ 股指期货

2 月份沪深 300 指数收报于 2673.33,较上月跌幅为 0.50%。而同期可比股指期货合约 IF1303、IF1306、IF1309 跌幅分别为 1.26%、1.15%和 1.11%。从成交情况看,五份合约累计成交量 11207028 手,较上月减少 25.50%,累计成交金额 90740.34 亿,较上月减少 22.33%。

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	52	3	9	3	2
LOF	27	1	0	0	0
创新型基金	30	1	1	2	4
其他指数基金	120	1	4	3	1
总计	229	6	14	8	7

注: 统计期间为 2013.2.1-2013.2.28

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	56	0	0	0	0
上证指数	54	0	7	2	0
巨潮指数	7	2	1	1	0
中证指数	86	4	5	5	7
其他机构	26	0	1	0	0
总计	229	6	14	8	7

注: 统计期间为 2013.2.1-2013.2.28

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
159915	易方达创业板 ETF	易方达	创业板指 (399006)	10.61%
161613	融通创业板指数增强型	融通	创业板指 (399006)	10.21%
110026	易方达创业板 ETF 联接	易方达	创业板指 (399006)	10.05%
159909	招商 TMT50ETF	招商	TMT50P (399610)	6.50%
217019	招商 TMT50ETF 联接	招商	TMT50P (399610)	6.31%
510170	上证大宗商品 ETF	国联安	上证商品 (000066)	-3.58%
510410	上证自然资源 ETF	博时	上证资源 (000068)	-3.65%
161819	银华中证内地资源主题指数分级	银华	内地资源 (000944)	-3.94%
690008	民生加银中证内地资源主题	民生加银	内地资源 (000944)	-3.96%
161217	国投瑞银中证上游资源 (LOF)	国投瑞银	中证上游 (000961)	-4.16%

注: 统计期间为 2013.2.1-2013.2.28

> 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	19	0	729.57	47.75%
沪市	30	0	798.46	52.25%
总计	49	0	1528.03	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.2.28；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	17	0	314.03	20.55%
上证指数	26	0	414.96	27.16%
中证指数	4	0	793.56	51.93%
其他指数	2	0	5.47	0.36%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.2.28；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
华夏基金管理有限公司	4	0	423.91	27.74%
嘉实基金管理有限公司	3	0	405.34	26.53%
易方达基金管理有限公司	4	0	201.47	13.19%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	194.90	12.75%
华安基金管理有限公司	2	0	77.67	5.08%

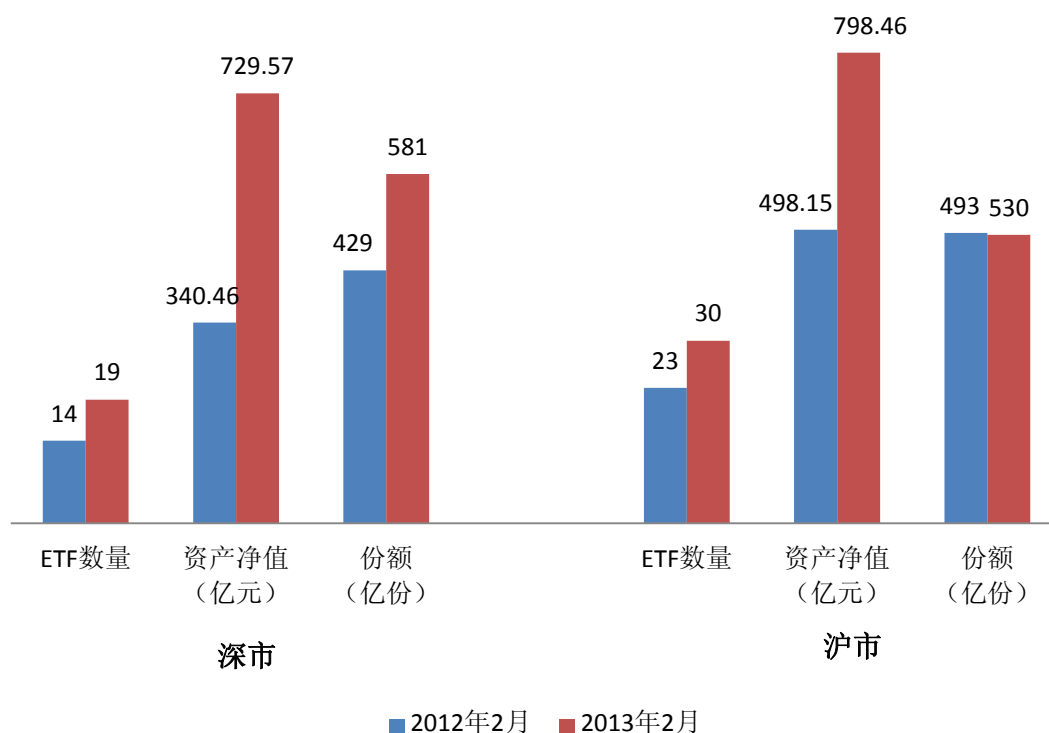
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.2.28。

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	137.44	367.05	0.28%
510330	沪深 300 ETF	华夏	73.65	197.08	0.15%
159901	深证 100 ETF	易方达	296.62	184.35	0.89%
510300	沪深 300 ETF	华泰柏瑞	67.14	179.38	0.14%
510050	上证 50 ETF	华夏	90.23	176.40	0.23%
510180	上证 180 ETF	华安	121.22	70.79	0.07%
159902	中小板 ETF	华夏	21.57	47.08	0.58%
159903	深成 ETF	南方	34.14	33.63	0.25%
159922	中证 500 ETF	嘉实	31.09	31.06	0.13%
510010	180 治理 ETF	交银施罗德	41.07	29.82	0.03%

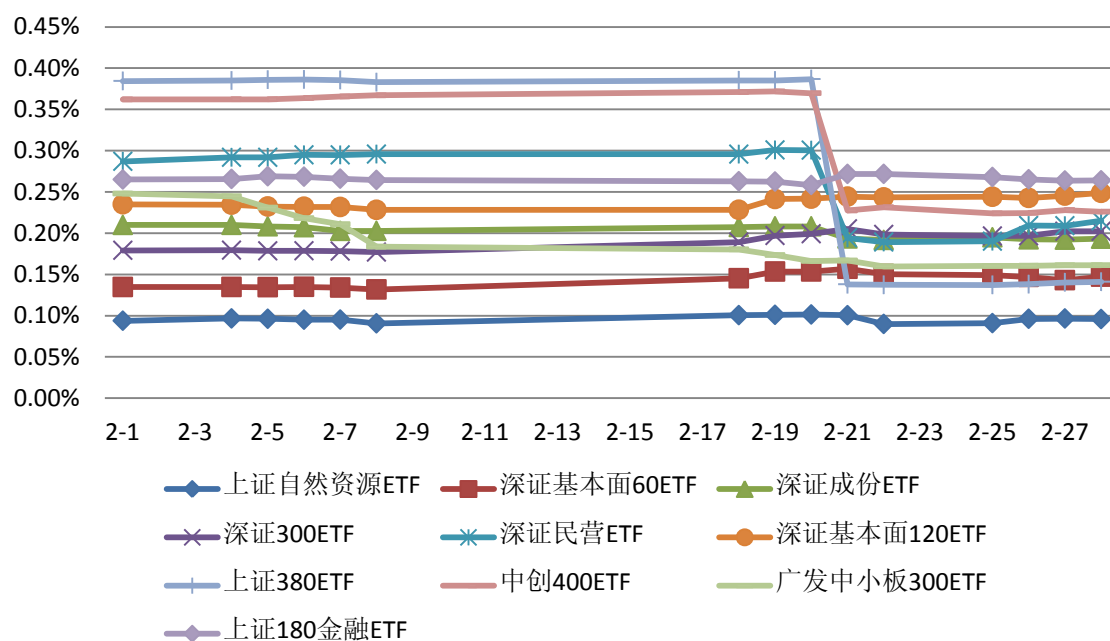
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.2.28。

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 2013.2.28；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：2 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）

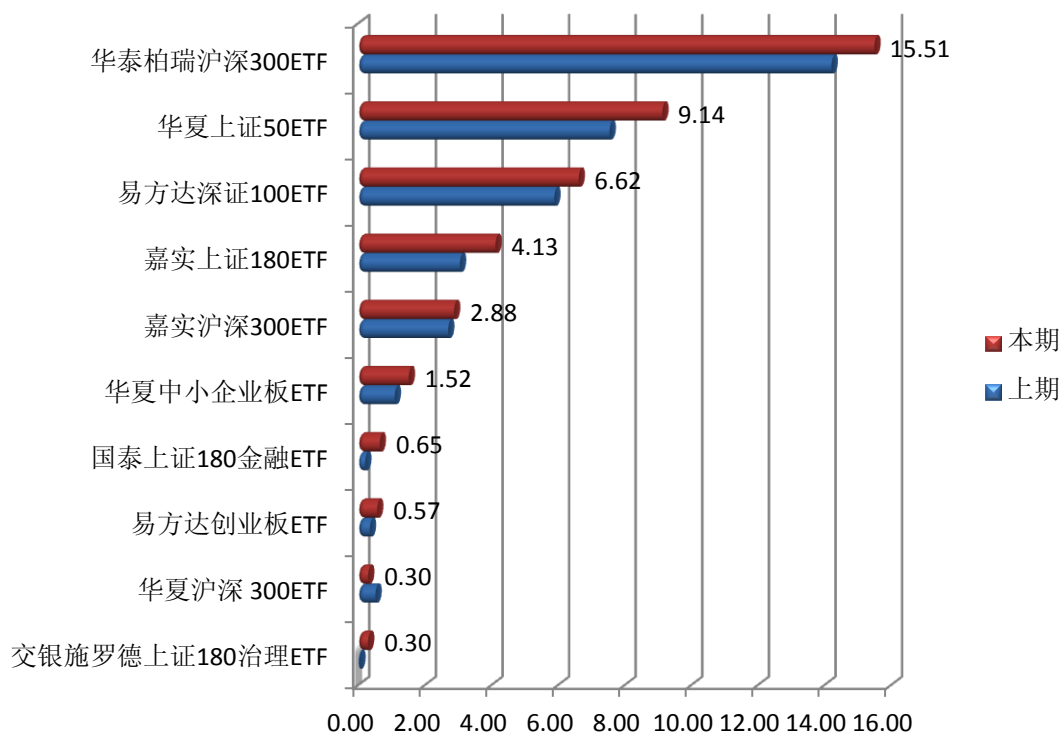
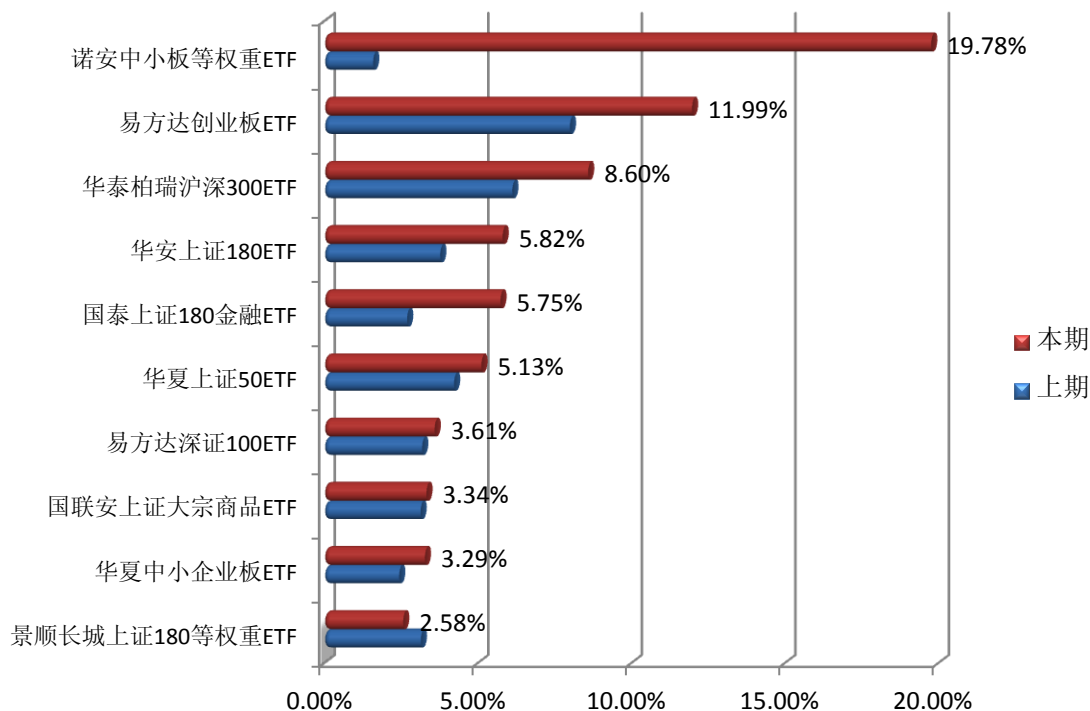


图 4：日均换手率前 10 只 ETF



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	2 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	2 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.38	-0.03	-2.09%	1.22	0.02	1.32%
160125	南方中国	0.03	0.00	1.19%	0.03	0.00	-2.86%
160415	华安 S300	0.30	-0.02	-6.54%	0.28	-0.01	-4.81%
160615	鹏华 300	0.38	0.00	-1.15%	0.36	-0.01	-1.87%
160616	鹏华 500	0.65	-0.01	-1.35%	0.49	0.01	2.19%
160706	嘉实 300	28.41	-2.23	-7.28%	20.21	-1.70	-7.76%
160716	嘉实 50	0.93	-0.01	-0.94%	0.69	-0.02	-2.90%
160717	恒生 H 股	0.38	0.00	-0.49%	0.30	-0.03	-8.74%
160807	长盛 300	0.07	0.00	2.87%	0.06	0.00	2.17%
161017	富国 500	0.07	0.00	-1.18%	0.07	0.00	1.77%
161211	国投金融	0.87	-0.04	-4.29%	0.81	-0.06	-6.80%
161213	国投消费	0.23	0.00	-1.12%	0.19	0.00	1.66%
161607	融通巨潮	0.62	0.00	-0.33%	0.52	-0.01	-1.86%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-6.21%	0.01	0.00	-11.92%
161811	银华 300	0.11	0.00	-0.77%	0.09	0.00	-1.36%
161903	万家公用	0.34	0.00	-0.24%	0.20	0.00	0.09%
161907	万家红利	0.52	-0.01	-1.09%	0.48	-0.01	-2.37%
162307	海富 100	0.18	-0.01	-6.30%	0.14	-0.01	-7.81%
162411	华宝油气	0.02	0.00	-0.88%	0.02	0.00	-1.66%
162711	广发 500	1.50	-0.04	-2.90%	1.21	0.01	0.45%
163001	长信 100	0.11	0.00	-1.38%	0.09	0.00	-3.29%
163407	兴全 300	0.27	0.00	-0.78%	0.24	0.00	-1.65%
163821	中银 300E	0.00	0.00	-12.26%	0.00	0.00	-11.76%
164205	天弘深成	0.01	0.00	30.59%	0.01	0.00	30.25%
165309	建信 300	0.18	0.00	-0.62%	0.14	0.00	-1.13%
165806	东吴 100	0.03	0.00	-4.02%	0.03	0.00	-3.21%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-2.07%	0.05	0.00	-2.46%
总计		37.63	-2.42		27.93	-1.84	

注：数据来源:深交所;统计期为 2013.2.1-2013.2.28

➤ 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	2 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	2 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	35.55	0.10	0.28%	39.56	0.47	1.19%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.38	-0.07	-4.82%	1.62	-0.09	-5.46%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.38	-0.07	-4.82%	1.50	-0.13	-7.70%

150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	11.07	-1.01	-8.33%	12.89	-1.12	-8.02%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	16.60	-1.51	-8.33%	14.66	-1.78	-10.86%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	75.08	-1.98	-2.56%	75.76	-1.69	-2.18%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	75.08	-1.98	-2.56%	49.33	-0.84	-1.67%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	38.34	-1.74	-4.33%	38.71	-1.57	-3.89%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	38.34	-1.74	-4.33%	10.68	-0.87	-7.52%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	13.90	-1.05	-7.05%	13.94	-1.98	-12.46%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	20.85	-1.58	-7.05%	10.70	-0.12	-1.07%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	8.04	0.20	2.51%	8.12	0.24	3.02%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	8.04	0.20	2.51%	10.59	0.05	0.44%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.61	0.00	-0.80%	0.61	0.00	-0.30%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.61	0.00	-0.80%	0.60	-0.02	-3.05%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.05	-0.08	-60.73%	0.06	-0.08	-60.54%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.08	-0.13	-60.73%	0.09	-0.12	-58.45%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.03	0.00	-1.10%	0.03	0.00	-0.62%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.04	0.00	-1.10%	0.04	0.00	4.33%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.06	-0.01	-15.34%	0.06	-0.01	-14.92%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.09	-0.02	-15.34%	0.08	-0.01	-9.95%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	2.67	-0.05	-1.68%	2.70	-0.03	-1.19%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	4.00	-0.07	-1.68%	3.32	-0.32	-8.83%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.03	-0.01	-15.03%	0.03	-0.01	-14.61%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.05	-0.01	-15.03%	0.06	-0.01	-13.73%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.71	-0.08	-9.92%	0.76	-0.08	-9.41%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.71	-0.08	-9.92%	0.64	-0.02	-3.22%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.03	0.00	-10.64%	0.03	0.00	-10.19%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.05	-0.01	-10.64%	0.05	0.00	-3.39%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.00	-2.10%	0.12	0.00	-1.61%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.00	-2.10%	0.12	0.00	-3.77%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.56	-0.02	-3.96%	0.57	-0.02	-3.48%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.56	-0.02	-3.96%	0.49	-0.02	-3.74%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	1.48	0.10	7.28%	1.57	0.11	7.83%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	1.48	0.10	7.28%	1.39	0.19	15.60%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.02	0.00	-10.85%	0.02	0.00	-10.41%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.02	0.00	-10.85%	0.03	0.00	-5.24%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.12	-0.01	-7.18%	0.12	-0.01	-6.72%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.12	-0.01	-7.18%	0.13	0.00	-0.10%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-25.99%	0.01	0.00	-25.69%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-25.99%	0.02	0.00	-24.29%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.09	0.04	109.13%	0.09	0.05	110.17%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.09	0.04	109.13%	0.11	0.06	117.72%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	9.10	-1.39	-13.23%	9.59	-1.41	-12.82%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	13.65	-2.08	-13.23%	13.54	-2.10	-13.41%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	0.55	-0.14	-20.22%	0.56	-0.14	-19.82%

150097	商品 B	招商	2012-7-25	0.55	-0.14	-20.22%	0.54	-0.17	-23.74%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	0.50	-0.05	-8.28%	0.50	-0.04	-7.83%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	0.50	-0.05	-8.28%	0.50	-0.09	-14.49%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.25	-0.04	-12.89%	0.25	-0.04	-12.46%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.25	-0.04	-12.89%	0.29	-0.05	-14.29%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.30	-0.03	-10.33%	0.31	-0.03	-9.87%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.30	-0.03	-10.33%	0.35	-0.02	-4.35%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	0.99	-0.03	-3.35%	1.02	-0.03	-2.88%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	0.99	-0.03	-3.35%	1.23	-0.03	-2.17%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.05	0.00	-3.82%	0.05	0.00	-3.35%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.08	0.00	-3.82%	0.09	0.00	0.63%
总计				386.38	-16.62		330.83	-13.95	

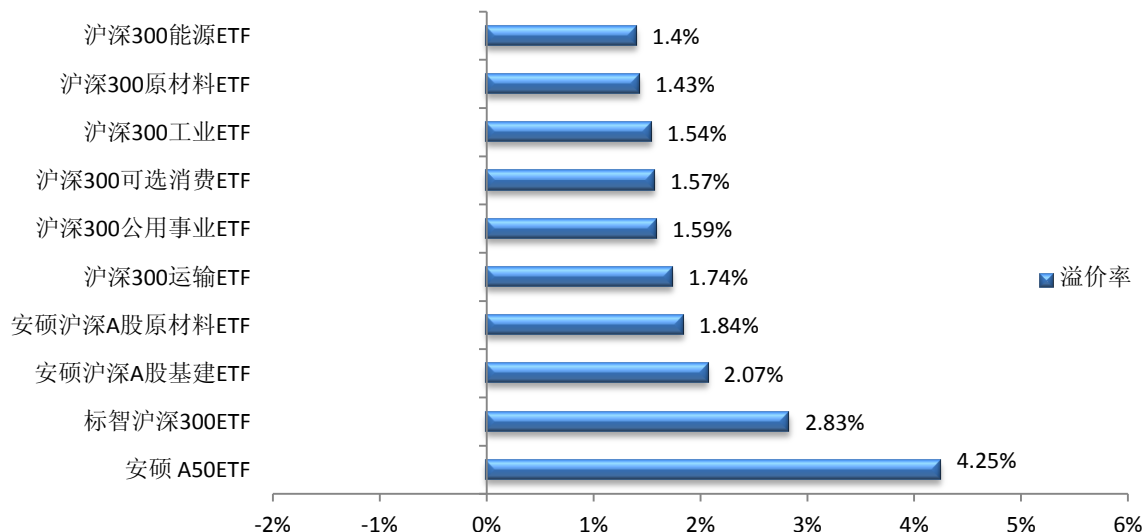
注：数据来源:深交所;统计期为 2013.2.1-2013.2.28

➤ 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	0.81
2818	A 股 50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.85
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50 指数	CSOP Asset Management Limited	2012-11-8	220.18
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	651.40
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	104.94
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.36
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.13
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.02
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	7.12
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.75
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.31
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.36
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	2.03
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.66
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	32.43
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	0.13
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.83
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.39
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.28
3063	沪深 300 运输指数 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.14
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	0.13
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management (Hong Kong)	2012-11-9	138.11
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	30.36

图 5：溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注：统计期为 2013.2.1-2013.2.28

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	89.82	-62.97%	1.02%	-60.90%
2818	中国平安 CSI RAFIA 股 50ETF	0.32	-81.41%	0.00%	-81.51%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	85691.85	-2.03%	3.79%	-3.48%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	225269.93	-5.24%	3.28%	-7.92%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	5421.63	-44.49%	0.49%	-48.43%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	168.74	258.67%	0.48%	238.30%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	44.68	22.28%	0.21%	25.30%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	741.62	187.64%	6.49%	184.46%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	392.60	-1.78%	0.54%	-4.80%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	17.38	20.58%	0.10%	18.60%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	18.00	-57.03%	0.56%	-64.38%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	18.75	40.47%	0.13%	42.24%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	1.90	-79.61%	0.08%	-79.32%
3024	标智上证 50 中国指数基金	41.07	-5.79%	0.20%	-10.87%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	75.68	-18.78%	0.43%	-25.43%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	8.43	90.37%	0.05%	88.11%
3049	沪深 300 指数 ETF	2485.46	-30.27%	0.76%	-33.69%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	3.81	-29.88%	0.03%	-28.88%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	0.39	-92.28%	0.03%	-92.64%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	35.68	-48.88%	0.42%	-52.93%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	310.30	155.76%	2.18%	134.90%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	21.51	-20.11%	0.75%	-29.63%

3063	沪深 300 运输指数 ETF	0.38	-59.16%	0.03%	-61.18%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	1.86	149.10%	0.21%	27.61%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	9219.55	53.38%	0.65%	48.90%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	2784.61	4.50%	0.82%	2.54%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	44184.93	5.13%	2.36%	3.14%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2013.2.1-2013.2.28；“/”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 2 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
IF1302	2695.20	2799.00	2675.20	2745.60	45.80	0	-50386	2746.29	2598306	21429.19
IF1303	2706.00	2830.20	2560.00	2678.40	-34.20	74621	32822	2669.40	8265996	66535.93
IF1304	2763.60	2768.40	2573.00	2691.20	-65.40	8042	8042	2683.00	121032	960.89
IF1306	2735.40	2863.00	2587.60	2708.40	-31.60	17310	6695	2698.00	197531	1614.24
IF1309	2760.00	2883.80	2613.40	2732.00	-30.60	3646	2195	2722.60	24163	200.09

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 2013.2.28

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

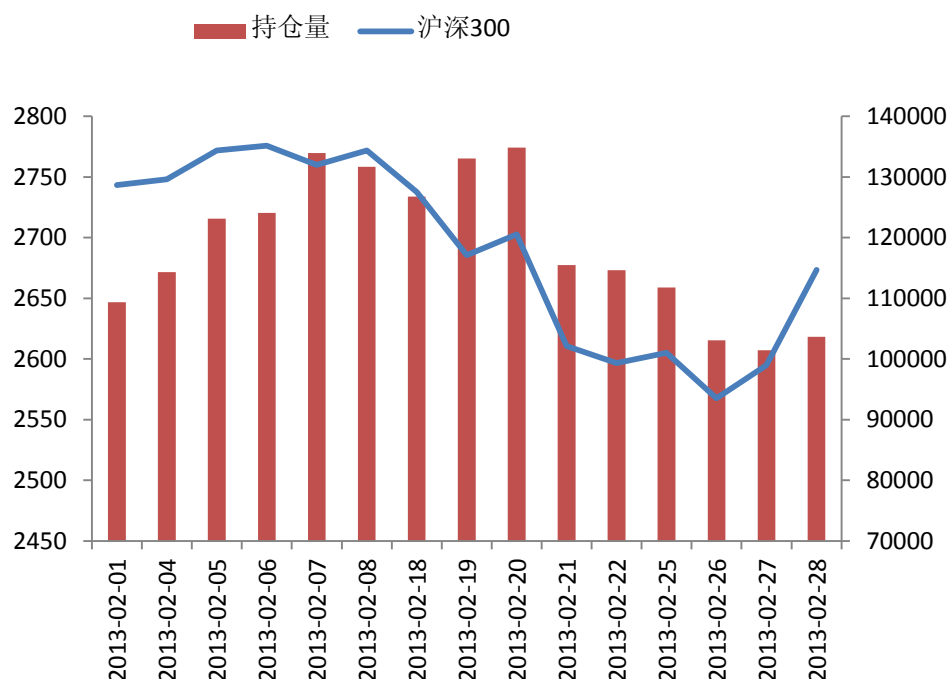
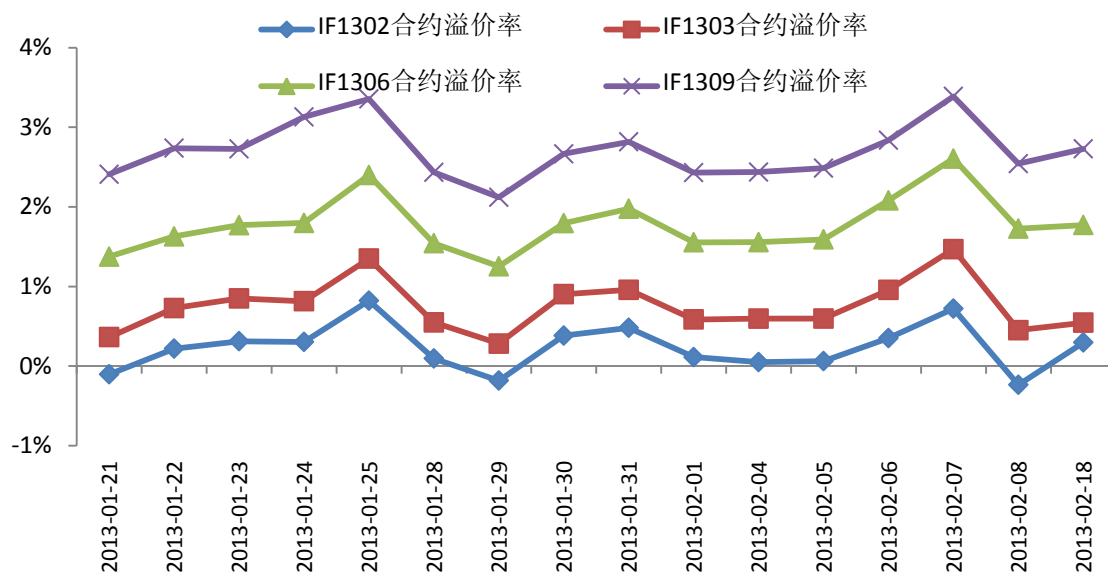
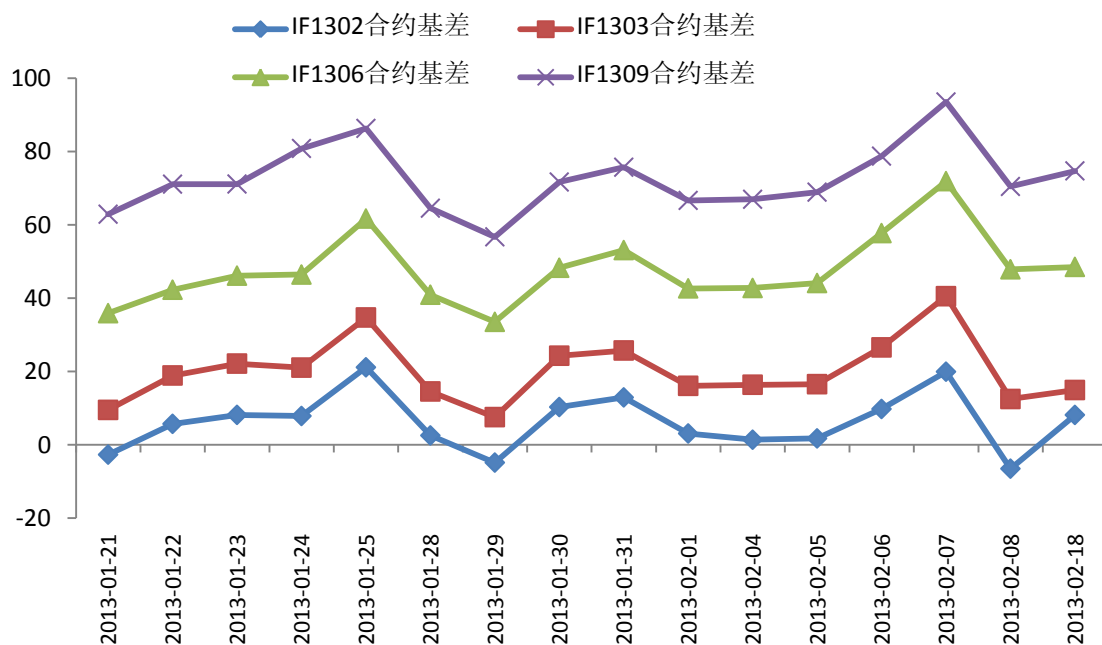


图 7：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2013.1.21-2013.2.18

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 2013.1.21-2013.2.18

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香梅路 1061 号中投国际商务中心 B1 栋 10F

邮编：518040

电话：（+86）755-83241251

传真：（+86）755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://www.cnindex.com.cn>