

2013 年 4 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

➤ 首批多空杠杆 ETF 将面世

据证监会网站显示，4 月 16 日，首批申报的多空杠杆 ETF 有了新的进展，易方达沪深 300 指数期货反向 ETF、两倍杠杆 ETF 及反向两倍杠杆 ETF 已获证监会受理。

杠杆及反向 ETF 是近年来境外 ETF 发展的重大创新，市场认为，此次反向 ETF 的推出，弥补了公募基金做空的市场空白。从市场需求来看，杠杆和反向 ETF 能够实现低门槛、高效率的做空以及杠杆投资，参与主体因此也会更加广泛。

➤ 首只多资产指数基金发行

据了解，作为内地市场首只多资产指数基金，正在发行的银华成长股债 30 / 70 指数基金同时配置于股债两市，从而具备“七分稳收益，三分增动力”的特征。

业内人士表示，成熟市场的经验表明，以大类资产配置为主题的多资产指数基金很可能受到国内养老金等长期资金的青睐。长期来看，股债恒定指数能够平滑大类资产的波动性，因而更加适合养老金或是退休金等长期资金，以获得较高风险调整后的收益金。另外，低廉的管理费率也是指数基金更适合“养老投资”的原因之一。

➤ 证监会：探讨 A 股的国际化

4 月 19 日，就市场关注的 A 股纳入国际相关指数事宜，证监会新闻发言人称，证监会与包括 MSCI 在内的国际著名指数编制公司进行了沟通，对 A 股纳入相关指数的相关技术性问题进行了探讨，目前还需要就外汇管制、财税政策等事宜进行研究。虽然目前监管层与国际指数公司的接洽，仍处于技术问题讨论阶段，但已经极大地激起市场热情。

证监会发言人还表示，吸引境外的长期资金投资于 A 股市场，有利于改善投资者结构，提高市场稳定运作水平，促进资本市场的发展，这是我国资本市场对外开放的一贯政策。推进 A 股纳入相关国际指数将有效扩大资本市场的国际影响力，推动境外长期投资者投资于国际市场。

► 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

新上市

南方开元沪深 300ETF 于 4 月 11 日上市。

新成立

广发中证 500ETF 于 4 月 11 日成立，首募 4.25 亿。

长盛上证市值百强 ETF 于 4 月 24 日成立，首募 6.23 亿元。

德邦德信中高企债指数分级基金于 4 月 25 日成立，首募 8.24 亿。

国泰纳斯达克 100ETF 于 4 月 25 日成立，首募 2.68 亿。

华宸未来沪深 300 发起式基金 (LOF) 于 4 月 26 日成立，首募 2.73 亿。

新发行

长盛上证市值百强 ETF 联接基金于 4 月 3 日发行。

嘉实中证金边中债 ETF 联接基金于 4 月 8 日发行。

银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数基金于 4 月 10 日发行。

国泰纳斯达克 100ETF 于 4 月 15 日发行。

嘉实中证金边中期国债 ETF 于 4 月 17 日发行。

工银标普全球自然资源(QDII-LOF)于 4 月 18 日发行。

新获批

嘉实沪深 300 指数研究增强型于 4 月 18 日获批。

华泰柏瑞量化指数增强股票型基金于 4 月 26 日获批。

工银瑞信中证 200ETF 及其联接基金于 4 月 27 日获批。

建信中证 500 指数增强型基金于 4 月 27 日获批。

新申报

易方达于 4 月 3 日申报沪深 300 指数期货反向 ETF 发起式基金。

易方达于 4 月 8 日申报沪深 300 指数期货两倍杠杆 ETF 发起式基金。

易方达于 4 月 8 日申报沪深 300 指数期货反向两倍杠杆 ETF 发起式基金。

易方达于 4 月 8 日申报沪深 300 非银行金融 ETF、主要消费 ETF、银行 ETF、有色金属 ETF、能源 ETF、医药卫生 ETF、地产 ETF。

华安基金于 4 月 10 日申报中证高等级信用债 ETF 及其联接基金。

广发基金于 4 月 11 日申报美国房地产指数基金。

长信基金于 4 月 12 日申报沪深 300 指数多空分级发起式基金。

汇添富于 4 月 16 日申报沪深 300 指数多空分级发起式基金。

汇添富于 4 月 16 日申报恒生指数分级基金。

国投瑞银于 4 月 17 日申报沪深 300 金融地产 ETF。

嘉实基金于 4 月 17 日申报中证能源 ETF、金融地产 ETF、可选消费 ETF、中证主要消费 ETF、中证医药卫生 ETF。

嘉实基金于 4 月 19 日申报沪深 300ETF 多空分级发起式基金。

市场要点

➤ 国内指数基金概况

本期基金一季报披露完毕，截止 2013 年 3 月 31 日，指数基金的资产规模达到 4180.55 亿元。嘉实基金管理有限公司所管理的指数基金资产规模名列第一，达到 722 亿元，跟踪沪深 300 指数的基金规模最大，为 1691 亿元。从指数基金的市场格局来看，前十大指数基金管理人占据了 73% 的份额，前十大指数基金占据了 46% 的份额。

➤ 国内 ETF

2013 年 4 月，本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1528.03 亿元减少到至本期的 1427.69 亿元。从规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，资产净值达到 325.77 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的 ETF 为嘉实沪深 300ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额以华泰柏瑞沪深 300ETF 领先，为 8.17 亿元。

➤ LOF

2013 年 4 月，LOF 指数基金的场内规模为 35.19 亿份，较上月减少 1.07 亿份；场内资产净值为 24.13 亿元，较上月减少 1.14 亿元。

➤ 创新型指数基金

2013 年 4 月，创新型指数基金的场内规模为 420.50 亿份，较上月增加 29.55 亿份；场内资产净值为 327.22 亿元，较上月增加 15.26 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末，27 只 ETF 资产规模为 1154.36 亿港元。以安硕 A 股可选消费指数 ETF 的净值涨幅最大，达到 2.09%；从活跃程度看，安硕 A50 中国 ETF 日均成交金额最大，达到 18.76 亿港元，CSOP 富时中国 A50 ETF 日均换手率最高，达到 3.60%。

➤ 股指期货

4 月份沪深 300 指数收报于 2447.31，较上月跌幅为 1.91%。而同期可比股指期货合约 IF1305、IF1306、IF1309 跌幅分别为 1.89%、2.10% 和 2.19%。从成交情况看，五份合约累计成交量 14426023 手，较上月降低 20.87%，累计成交金额 107121.12 亿，较上月减少 24.10%。

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	62	3	2	1	18
LOF	28	1	1	0	0
创新型基金	33	1	0	0	3
其他指数基金	123	0	3	4	2
总计	246	5	6	5	23

注: 统计期间为 2013.4.1-2013.4.30

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	56	0	0	0	0
上证指数	62	1	1	0	0
巨潮指数	8	0	0	0	0
中证指数	92	3	3	4	21
其他机构	28	1	2	1	2
总计	246	5	6	5	23

注: 统计期间为 2013.4.1-2013.4.30

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
159915	易方达创业板指 ETF	易方达	创业板指 (399006)	2.66%
161613	融通创业板指增强型基金	融通	创业板指 (399006)	2.63%
110026	易方达创业板指联接基金	易方达	创业板指 (399006)	2.44%
159909	招商 TMT50ETF	招商	TMT50P (399610)	2.31%
159911	鹏华深证民营 ETF	鹏华	深民营 P (399337)	2.12%
160620	鹏华中证 A 股资源分级基金	鹏华	A 股资源 (000805)	-6.63%
161819	银华中证内地资源分级基金	银华	内地资源 (000942)	-6.69%
161217	国投瑞银中证上游资源(LOF)	国投瑞银	中证上游 (000961)	-6.72%
257060	国联安上证大宗商品联接基金	国联安	上证商品 (000066)	-7.21%
510170	国联安上证大宗商品 ETF	国联安	上证商品 (000066)	-7.50%

注: 统计期间为 2013.4.1-2013.4.30

➤ 指数基金一季报概况

表 4：国内市场前十大指数基金管理人列表

基金管理人	2013 年一季度			2012 年四季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
嘉实基金管理有限公司	10	722.37	17.28%	8	739.26	16.99%
华夏基金管理有限公司	12	648.57	15.51%	7	480.81	11.05%
易方达基金管理有限公司	14	521.73	12.48%	13	600.04	13.79%
银华基金管理有限公司	8	259.62	6.21%	8	293.23	6.74%
融通基金管理有限公司	5	184.73	4.42%	4	177.34	4.08%
华泰柏瑞基金管理有限公司	5	170.67	4.08%	5	256.53	5.90%
国泰基金管理有限公司	9	168.90	4.04%	6	81.81	1.88%
南方基金管理有限公司	12	146.33	3.50%	11	146.74	3.37%
华安基金管理有限公司	8	142.79	3.42%	8	192.87	4.43%
博时基金管理有限公司	8	116.35	2.78%	8	121.59	2.80%
总计	91	3082.04	73.72%	78	3090.22	71.03%

注：数据来源为基金定期报告或成立公告。基金数量指该公司旗下指数基金数量。基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

表 5：国内市场跟踪产品规模最大的前十只标的指数

标的指数	2013 年一季度			2012 年四季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
沪深 300	29	1691.24	40.45%	28	1749.78	40.23%
深证 100	11	607.05	14.52%	11	645.72	14.84%
上证 50	3	337.41	8.07%	3	387.92	8.92%
中证 500	12	164.08	3.92%	10	134.98	3.10%
深证成指	5	103.70	2.48%	5	137.29	3.16%
上证 180	3	101.51	2.43%	3	164.59	3.78%
道琼斯中国 88	1	70.81	1.69%	1	71.78	1.65%
中证 100	9	81.76	1.96%	8	99	2.28%
180 治理	2	56.60	1.35%	2	60.76	1.40%
上证综指	3	47.06	1.13%	3	52.49	1.21%
总计	78	3261.22	78.01%	74	3504.31	80.57%

数据来源：基金定期报告或成立公告；基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

表 6：国内市场规模最大的前十只指数基金

基金代码	基金名称	资产净值(亿元)	基金代码	基金名称	资产净值(亿元)
159919	嘉实沪深 300ETF	342.49	159901	易方达深证 100ETF	167.40
160706	嘉实沪深 300	275.68	510050	华夏上证 50ETF	163.83
000051	华夏沪深 300	197.84	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	154.61
510330	华夏沪深 300ETF	183.56	161604	融通深证 100	142.98
110003	易方达上证 50	171.58	161812	银华深证 100	141.29

数据来源：基金定期报告或成立公告。

表 7：跟踪各系列指数的产品规模

标的指数	2013 年一季度			2012 年四季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
深证指数	56	865.80	20.71%	56	955.1	21.96%
上证指数	61	857.39	20.51%	54	878.22	20.19%
巨潮指数	8	63.47	1.52%	5	38.01	0.87%
中证指数	89	2167.47	51.85%	82	2237.94	51.45%
其他机构	27	226.43	5.42%	26	240.7	5.53%
总计	241	4180.55	100.00%	223	4349.96	100%

数据来源：基金定期报告或成立公告；基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

➤ 国内 ETF

表 8：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	22	1	631.15	44.45%
沪市	33	0	788.66	55.55%
总计	55	1	1419.81	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.4.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 9：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	256.26	18.05%
上证指数	27	0	398.70	28.08%
中证指数	9	1	759.97	53.53%
其他指数	2	0	4.88	0.34%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.4.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 10：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	382.57	26.94%
嘉实基金管理有限公司	4	0	345.03	24.30%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	181.75	12.80%
易方达基金管理有限公司	5	0	170.74	12.03%
南方基金管理有限公司	5	1	94.55	6.66%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.4.30。

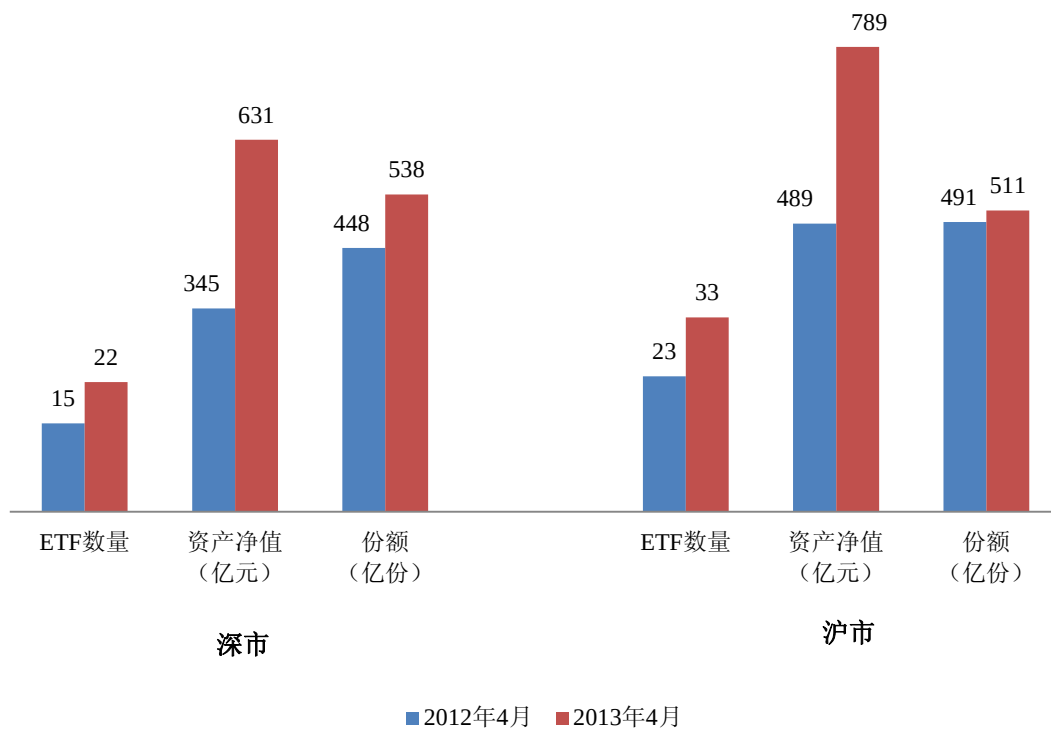
表 11：规模最大的前十只 ETF 列表

代码	简称	管理人	份额(亿份)	资产净值(亿元)	对指数覆盖率
159919	嘉实沪深 300ETF	嘉实	133.09	325.31	0.27%
510330	华夏沪深 300 ETF	华夏	73.72	180.53	0.15%
510300	华泰柏瑞沪深 300 ETF	华泰柏瑞	68.49	167.68	0.14%
510050	华夏上证 50 ETF	华夏	94.39	166.79	0.24%

159901	易方达深证 100 ETF	易方达	264.08	151.71	0.81%
510180	华安上证 180 ETF	华安	103.16	54.98	0.06%
510500	南方中证 500 ETF	南方	44.64	42.09	0.18%
159902	华夏中小企业板 ETF	华夏	15.34	32.25	0.41%
159903	南方深证成份 ETF	南方	29.31	25.99	0.22%
510010	上证 180 公司治理 ETF	交银施罗德	39.28	25.89	0.03%

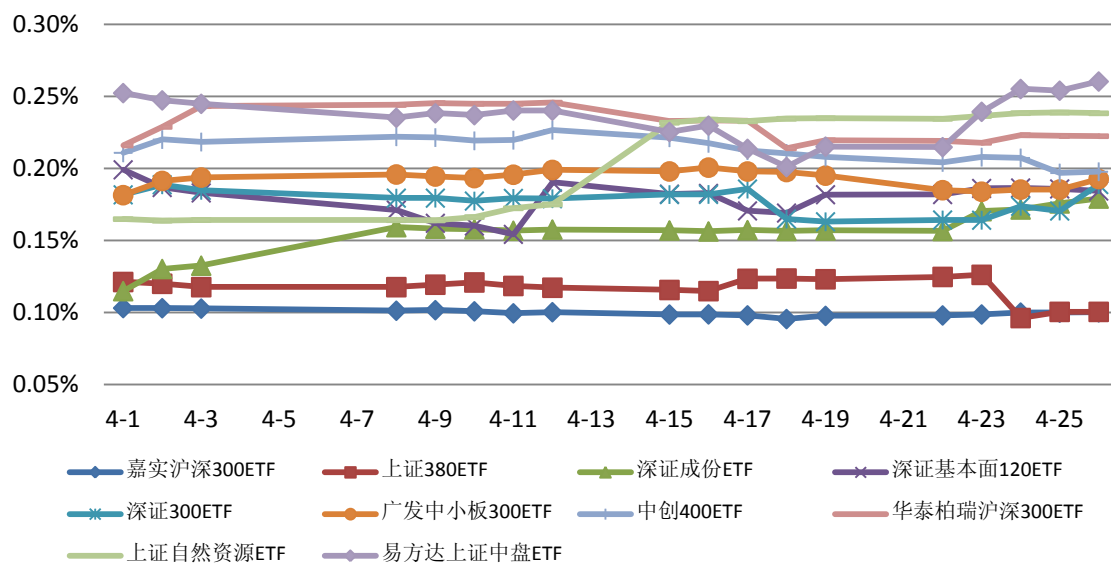
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.4.30。

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 2013.4.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：4 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）

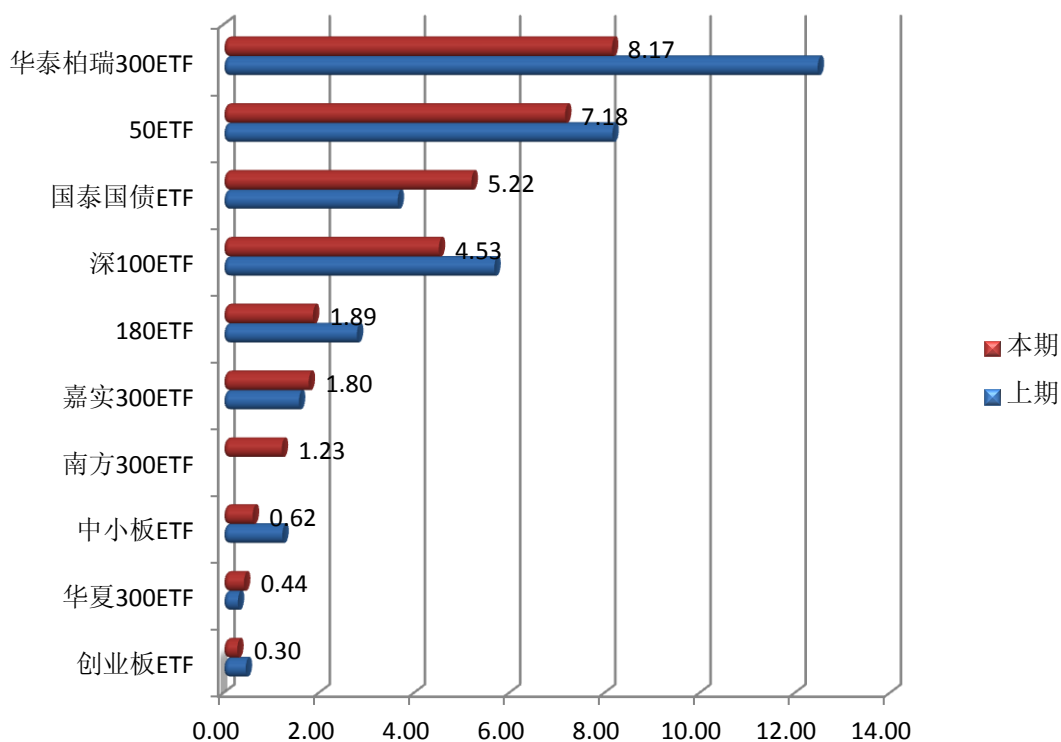
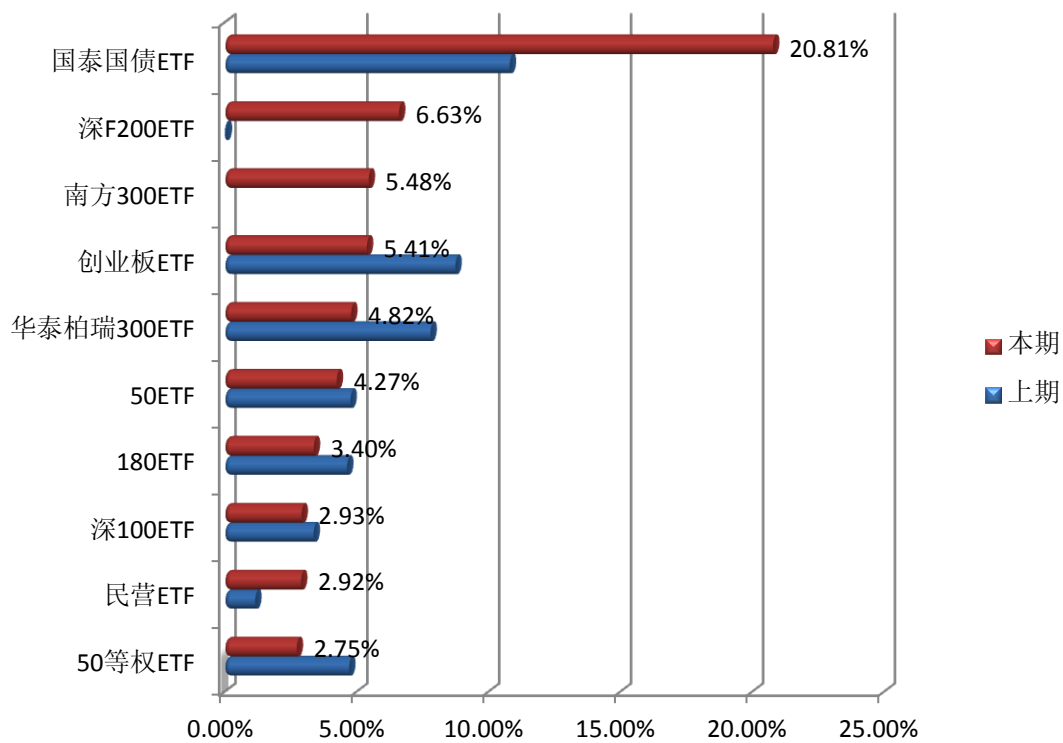


图 4：日均换手率前 10 只 ETF



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。

➤ LOF

表 12：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	4 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	4 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.35	0.01	0.50%	1.12	-0.02	-1.44%
160125	南方中国	0.02	-0.01	-25.42%	0.02	-0.01	-23.50%
160415	华安 S300	0.29	0.00	-0.05%	0.25	-0.01	-3.34%
160615	鹏华 300	0.37	-0.01	-2.00%	0.33	-0.01	-3.94%
160616	鹏华 500	0.64	0.00	-0.55%	0.45	-0.01	-2.59%
160706	嘉实 300	26.16	-0.99	-3.66%	17.11	-0.98	-5.42%
160716	嘉实 50	0.92	0.00	0.28%	0.62	-0.01	-1.34%
160717	恒生 H 股	0.39	0.00	-1.03%	0.29	0.00	-0.91%
160807	长盛 300	0.06	-0.01	-8.51%	0.05	-0.01	-13.33%
161017	富国 500	0.07	0.00	-4.05%	0.06	0.00	6.13%
161211	国投金融	0.85	0.00	-0.36%	0.72	0.00	-0.25%
161213	国投消费	0.23	0.00	-2.01%	0.18	-0.01	-3.56%
161607	融通巨潮	0.62	0.00	-0.62%	0.47	-0.01	-2.18%
161714	招商金砖	0.01	0.00	13.93%	0.01	0.00	-14.44%
161811	银华 300	0.11	0.00	-2.57%	0.08	0.00	3.69%

161903	万家公用	0.34	0.00	0.37%	0.18	-0.01	-2.74%
161907	万家红利	0.50	0.00	0.23%	0.42	-0.01	-1.25%
162307	海富 100	0.18	0.00	-1.75%	0.13	0.00	-2.19%
162411	华宝油气	0.02	0.00	-20.29%	0.02	0.00	-22.28%
162711	广发 500	1.44	-0.02	-1.10%	1.10	-0.03	-2.88%
163001	长信 100	0.11	0.00	-1.64%	0.09	0.00	-5.51%
163407	兴全 300	0.27	0.00	-0.91%	0.22	0.00	0.29%
163821	中银 300E	0.01	0.00	-44.49%	0.01	0.00	-45.43%
164205	天弘深成	0.01	0.00	-12.94%	0.01	0.00	-40.45%
165309	建信 300	0.17	-0.01	-4.72%	0.12	-0.01	-6.07%
165806	东吴 100	0.03	0.00	-0.47%	0.03	0.00	-12.32%
166007	中欧 300	0.05	0.00	4.58%	0.04	0.00	5.27%
总计		35.19	-1.07		24.13	-1.14	

注：数据来源：深交所；统计期为 2013.4.1-2013.4.30

► 创新型指数基金

表 13：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	4 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	4 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	0.00	-0.01%	33.31	-1.45	-4.18%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.31	-0.04	-3.33%	1.38	-0.10	-6.61%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.31	-0.04	-3.33%	1.32	-0.07	-4.70%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	8.33	-2.66	-24.20%	8.35	-4.51	-35.09%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	12.50	-3.98	-24.18%	12.56	0.31	2.52%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	96.81	13.19	15.77%	98.64	13.85	16.34%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	96.81	13.19	15.77%	49.85	3.86	8.40%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	37.54	2.50	7.12%	38.25	2.70	7.60%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	37.54	2.50	7.12%	5.32	-0.87	-14.08%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	14.27	1.75	14.00%	14.46	1.84	14.57%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	21.41	2.63	14.00%	9.44	0.69	7.90%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	7.43	-0.14	-1.87%	7.58	-0.11	-1.47%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	7.43	-0.14	-1.87%	8.19	-0.45	-5.25%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.54	0.04	7.05%	0.54	0.04	8.55%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.54	0.04	7.05%	0.44	0.02	4.25%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.05	0.00	-2.64%	0.05	0.00	-0.69%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.07	0.00	4.32%	0.07	0.00	-4.86%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.02	0.00	24.54%	0.03	0.00	-15.29%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.04	0.00	-6.59%	0.03	0.00	4.85%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.06	0.00	-5.16%	0.06	0.00	-3.83%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.09	0.00	-5.16%	0.07	-0.01	-12.08%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	3.22	0.40	14.03%	3.28	0.42	14.69%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	4.82	0.60	14.30%	2.88	-0.05	-1.55%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.03	0.00	-5.06%	0.03	0.00	-3.07%

150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.04	0.00	6.80%	0.04	0.00	2.42%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.47	-0.02	-3.51%	0.48	-0.01	-2.93%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.47	-0.02	-3.51%	0.38	-0.04	-9.95%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.03	0.00	-16.56%	0.03	0.00	-14.89%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.04	0.00	-6.13%	0.04	0.00	-9.69%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.00	-2.65%	0.12	0.00	-0.80%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.00	-2.65%	0.09	-0.01	-5.72%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.52	-0.01	-2.33%	0.53	0.00	-0.31%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.52	-0.01	-2.33%	0.38	-0.02	-5.20%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	1.52	0.08	5.86%	1.63	0.10	6.40%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	1.52	0.08	5.86%	1.30	-0.01	-1.14%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.03	0.01	46.73%	0.03	0.01	49.77%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.03	0.01	46.73%	0.03	0.01	30.34%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.09	-0.03	-24.03%	0.09	-0.03	-22.45%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.09	-0.03	-24.03%	0.10	-0.03	-24.39%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-20.92%	0.01	0.00	-19.42%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-20.92%	0.01	0.00	-15.78%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.08	0.00	2.00%	0.08	0.00	4.04%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.08	0.00	2.00%	0.09	-0.01	-11.38%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	8.60	-0.34	-3.80%	9.16	-0.31	-3.28%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	12.90	-0.51	-3.80%	11.12	-0.85	-7.10%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	0.51	0.00	-0.57%	0.52	0.01	1.52%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	0.51	0.00	-0.57%	0.35	-0.05	-13.41%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	0.50	0.07	16.49%	0.51	0.08	18.71%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	0.50	0.07	16.49%	0.35	0.00	0.33%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.23	-0.01	-5.07%	0.23	-0.02	-6.95%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.23	-0.01	-5.07%	0.22	-0.03	-11.15%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.22	-0.01	-2.28%	0.23	-0.01	-2.50%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.22	-0.01	-2.28%	0.24	-0.02	-7.26%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	0.86	-0.01	-1.10%	0.90	0.00	-0.28%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	0.86	-0.01	-1.10%	0.90	-0.06	-5.80%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.02	0.00	-21.72%	0.02	0.00	-18.59%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.02	-0.01	-21.72%	0.02	-0.01	-19.92%
150112	工银 100A	工银瑞信	2012-11-5	0.15	0.00	0.00%	0.15	-0.01	-3.17%
150113	工银 100B	工银瑞信	2012-11-5	0.15	0.00	0.00%	0.15	-0.01	-3.15%
150117	房地产 A	国泰	2013-3-7	0.28	0.24	600.59%	0.28	0.24	611.09%
150118	房地产 B	国泰	2013-3-7	0.28	0.24	600.59%	0.28	0.24	601.29%
总计				420.50	29.55		327.22	15.26	

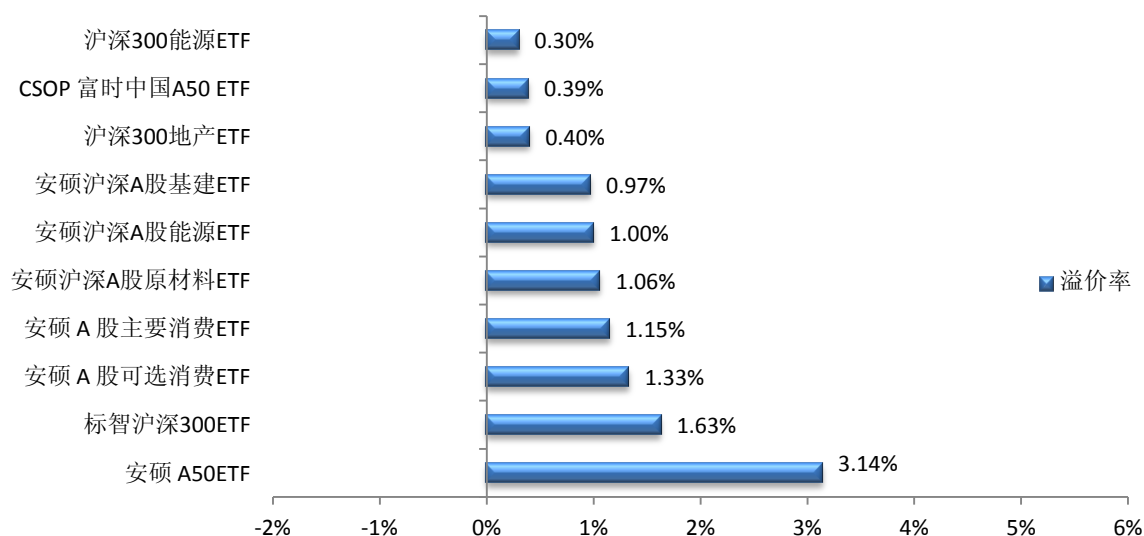
注：数据来源:深交所;统计期为 2013.4.1-2013.4.30

➤ 跨境 ETF

表 14: 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	0.75
2818	A 股 50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.69
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50 指数	CSOP Asset Management Limited	2012-11-8	200.80
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	539.34
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	95.72
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	2.60
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	1.86
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.45
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	5.70
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.58
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.27
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.31
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.20
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.85
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.52
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.05
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	28.82
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.99
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	0.82
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.28
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.25
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	0.13
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management (Hong Kong)	2012-11-9	76.15
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	20.24
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management	2012-10-26	167.75

图 5: 溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注：统计期为 2013.4.1-2013.4.30

表 15：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	36.23	-53.49%	0.47%	-53.92%
2818	中国平安 CSI RAFI A 股 50ETF	2.42	110.22%	0.01%	122.22%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	69793.10	-24.37%	3.60%	-18.67%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	187630.87	-16.99%	3.22%	-8.22%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	2980.09	-10.79%	0.30%	-6.97%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	29.65	58.13%	0.11%	88.54%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	16.27	7.06%	0.08%	18.52%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	130.85	-63.08%	0.90%	-68.18%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	471.64	6.75%	0.78%	18.48%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	4.19	-36.97%	0.03%	-35.66%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	0.32	-94.54%	0.01%	-94.35%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	1.90	-23.92%	0.01%	-19.00%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	0.40	-73.48%	0.02%	-70.39%
3024	标智上证 50 中国指数基金	20.70	359.95%	0.11%	387.23%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	49.83	-22.99%	0.33%	-21.33%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	14.59	450.50%	0.12%	548.09%
3049	沪深 300 指数 ETF	2778.72	-17.18%	0.96%	-11.73%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	2.20	-21.52%	0.02%	-3.47%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	1.56	525.90%	0.12%	540.63%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	23.80	-52.58%	0.29%	-51.60%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	212.93	95.44%	1.68%	106.98%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	41.36	-14.98%	1.63%	-9.24%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	0.15	-63.45%	0.01%	-68.49%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.19	-99.59%	0.02%	-99.55%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	2799.91	-23.73%	0.28%	0.16%

3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	691.79	-61.40%	0.31%	-52.77%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	30041.23	-22.22%	1.76%	-17.96%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2013.4.1-2013.4.30；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。

➤ 股指期货

表 16：沪深 300 股指期货 4 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
IF1304	2481.20	2530.80	2417.20	2528.20	44.40	0	-61713	2528.79	7870931	58389.47
IF1305	2482.60	2547.40	2417.00	2439.80	-47.00	48592	44062	2444.20	5632289	41890.51
IF1306	2482.00	2538.60	2410.20	2428.80	-52.20	41274	12937	2434.60	854689	6334.01
IF1309	2504.00	2542.80	2418.00	2439.80	-54.60	9060	2073	2443.80	63419	471.80
IF1312	2536.00	2560.40	2453.20	2459.00	-77.00	742	742	2463.40	4695	35.33

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 2013.4.30

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

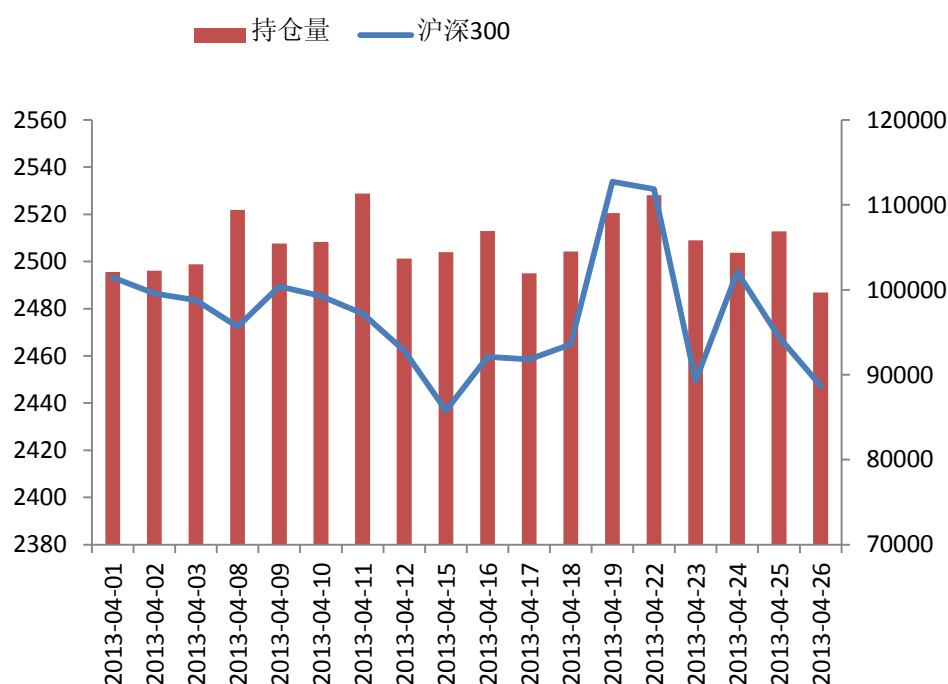
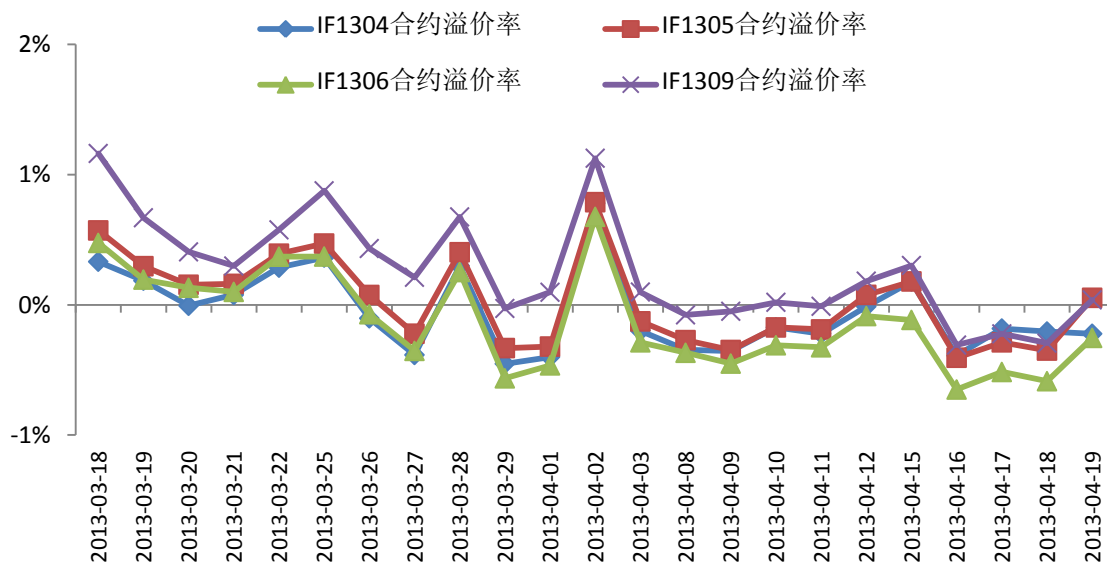
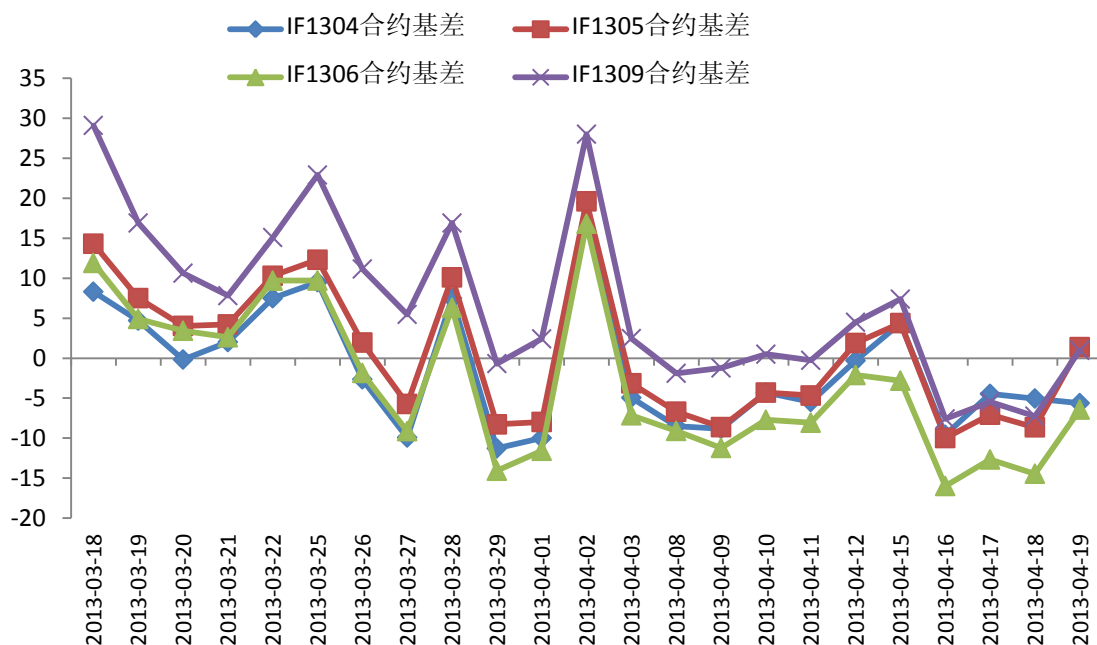


图 7：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2013.3.18-2013.4.19

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 2013.3.18-2013.4.19

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>