

2013 年 6 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

➤ 基金中考出炉 创业板指数基金表现抢眼

截止 6 月 30 日，偏股型基金的中考排名尘埃落定。在此次排名中，跟踪创业板指数的基金表现抢眼。其中，易方达创业板 ETF、融通创业板以及易方达创业板联接基金在有可比数据的 523 家偏股型基金中脱颖而出，均进入前五名，形成一道独特的创业板风景。

据了解，今年以来股市整体差强人意，但新兴产业和成长股居多的创业板市场却连创新高，其中，创业板指数一度接近 1100 点，上半年上涨超过 40%。这也是跟踪创业板的指数基金表现优异的主要原因。

➤ 亚洲首只离岸人民币债券 ETF 挂牌

6 月 18 日，亚洲首只离岸人民币债券交易所买卖基金(ETF)——iShares 安硕人民币债券指数 ETF 于港交所挂牌上市。该 ETF 由 iShares 安硕亚洲信托基金发行，将同时以港元及人民币买卖及结算，分两个柜台买卖，并设有略不相同的股份代号；基金单位为相同类别，基金单位持有人亦享有相同待遇。

据悉，这只 ETF 追踪花旗人民币债券权重上限指数，当中至少 70% 的资产投资于投资级别的人民币债券。这只 ETF 上市后，在联交所上市的人民币计价 ETF 数目将增至 7 只，而上市 ETF 总数将为 110 只，包括 3 只债券 ETF。

➤ 《新基金法》实施首月成果斐然 创新产品成最大亮点

自 6 月 1 日新《基金法》实施以来，创新产品密集获批成最大亮点。其中，ETF 成为了创新产品的最大赢家之一，包括黄金 ETF 破题，行业 ETF、债券 ETF 以及跨境 ETF 相继扩容。在率先推出国内首只浮动费率基金后，浮动费率基金也再添新军。此外，国内首批定期支付基金也拿到发行批文，即将面世。

此外，据证监会网站基金募集申请及审核情况公示表显示，产品审批通道效率也在不断提高，其中，6 月以来，新基金获批速度加快，创新基金的诞生也正在提速。基金业的新篇章正在开启。

► 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

新上市

华宸未来沪深 300 指数增强型发起式基金 (LOF) 于 6 月 3 日上市。
德邦德信中证中高收益企债指数分级基金于 6 月 3 日上市。
景顺长城沪深 300 等权 ETF 于 6 月 5 日上市。
银河沪深 300 成长增强指数分级基金于 6 月 6 日上市。

新成立

易方达沪深 300 量化增强基金于 6 月 7 日成立, 首募 2.49 亿。
申万菱信沪深 300 指数增强型基金于 6 月 7 日成立, 首募 0.56 亿。
国联安中证股债动态策略指数基金于 6 月 26 日成立, 首募 2.32 亿。

新发行

上证 180 高贝塔 ETF 于 6 月 3 日发行
华安纳斯达克 100 指数基金于 6 月 13 日发行。
鹏华沪深 300ETF 于 6 月 17 日发行。
华泰柏瑞量化指数增强股票型基金于 6 月 19 日发行。
博时上证企债 30ETF 于 6 月 24 日发行。

新获批

易方达中债高信用等级债券 ETF 及其联接基金于 6 月 6 日获批。
招商沪深 300 高贝塔指数分级基金于 6 月 6 日获批。
大成中债 5 年期国债 ETF 于 6 月 6 日获批。
博时标普 500ETF 于 6 月 6 日获批。
中证主要消费、医药卫生、金融地产 ETF 于 6 月 6 日获批。
中证能源 ETF 及其联接基金于 6 月 6 日获批。
博时中证中期信用债 ETF 及其联接基金于 6 月 13 日获批。
汇添富中证中期企业债 ETF 及其联接基金于 6 月 13 日获批。
大成中证 500 深市 ETF 于 6 月 14 日获批。
信诚中证 800 有色指数分级基金于 6 月 24 日获批。
信诚中证 800 医药指数分级基金于 6 月 24 日获批。
华泰柏瑞中证申万食品饮料 ETF 于 6 月 26 日获批。

新申报

华安基金于 6 月 5 日申报沪深 300ETF 及其联接基金。
华安基金于 6 月 7 日申报中证细分医药 ETF 及其联接基金。
华安基金于 6 月 7 日申报中证细分地产、细分金融 ETF。
鹏华基金于 6 月 18 日申报中证 500 ETF。
大成基金于 6 月 18 日申报沪深 300 能源、医药卫生、金融地产 ETF。

市场要点

➤ 国内 ETF

2013 年 6 月, 本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1524.37 亿元减少到至本期的 1455.98 亿元。从产品规模来看, 嘉实沪深 300ETF 规模最大, 资产净值达到 282.04 亿元。从跟踪误差情况看, 本期最低的 ETF 为嘉实中创 400ETF。从成交活跃情况来看, 日均成交金额以国泰上证 5 年期 ETF 和华泰柏瑞沪深 300ETF 领先, 分别为 10.76 亿元和 10.45 亿元。

➤ LOF

2013 年 6 月, LOF 指数基金的场内规模为 36.57 亿份, 较上月增加 0.08 亿份; 场内资产净值为 23.78 亿元, 较上月减少 3.39 亿元。

➤ 创新型指数基金

2013 年 6 月, 创新型指数基金的场内规模为 497.92 亿份, 较上月增加 53.14 亿份; 场内资产净值为 350.28 亿元, 较上月减少 25.59 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末, 27 只 ETF 资产规模为 980.49 亿港币。以安硕 A 股主要消费指数 ETF 的净值跌幅最小, 跌幅为 6.41%; 从活跃程度看, 安硕 A50 中国 ETF 日均成交金额最大, 达到 15.86 亿港币, 沪深 300 金融指数 ETF 日均换手率最高, 达到 6.57%。

➤ 股指期货

6 月份沪深 300 指数收报于 2200.64, 较上月下跌 15.57%。而同期可比股指期货合约 IF1307、IF1309、IF1312 跌幅分别为 16.33%、16.73%和 16.85%。从成交情况看, 五份合约累计成交量 13744845 手, 较上月下降 18.60%, 累计成交金额 95468.98 亿, 较上月下跌 26.04%。

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	66	0	3	11	8
LOF	29	0	0	0	0
创新型基金	33	0	0	3	0
其他指数基金	129	3	2	4	2
总计	256	3	5	18	10

注: 统计期间为 2013.6.1-2013.6.30

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	63	0	2	0	0
巨潮指数	8	0	0	0	0
中证指数	100	3	1	14	10
其他机构	29	0	2	4	0
总计	256	3	5	18	10

注: 统计期间为 2013.6.1-2013.6.30

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
159926	嘉实中证金边中期国债 ETF	嘉实	中期国债 (H11017)	0.65%
150108	长盛同辉深证 100 等权重指数分级	长盛	深证 100 等权 (399632)	0.57%
000087	嘉实中证金边中期国债 ETF 联接	嘉实	中期国债 (H11017)	0.40%
000062	中证成长股债恒定组合 30/70 基金	银华	成长 3070 (000837)	0.30%
511010	上证 5 年期国债 ETF	国泰	5 年国债 (000140)	-0.17%
510410	上证自然资源 ETF	博时	上证资源 (000068)	-20.35%
161819	银华中证内地资源主题指数分级	银华	内地资源 (000944)	-20.54%
161217	中证上游资源产业指数基金(LOF)	国投瑞银	中证上游 (000961)	-20.79%
690008	民生加银中证内地资源基金	民生加银	内地资源 (000944)	-21.19%
160620	鹏华中证 A 股资源产业指数分级	鹏华	A 股资源 (000805)	-22.02%

注: 统计期间为 2013.6.1-2013.6.30

➤ 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	23	1	560.45	38.49%
沪市	41	0	895.52	61.51%
总计	64	1	1455.98	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.6.30；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	17	0	237.89	16.34%
上证指数	33	0	496.88	34.13%
中证指数	11	1	716.53	49.21%
其他指数	3	0	4.67	0.32%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.6.30；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
华夏基金管理有限公司	9	0	442.43	30.39%
嘉实基金管理有限公司	4	0	291.90	20.05%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	172.28	11.83%
易方达基金管理有限公司	5	0	169.04	11.61%
华安基金管理有限公司	2	0	126.27	8.67%

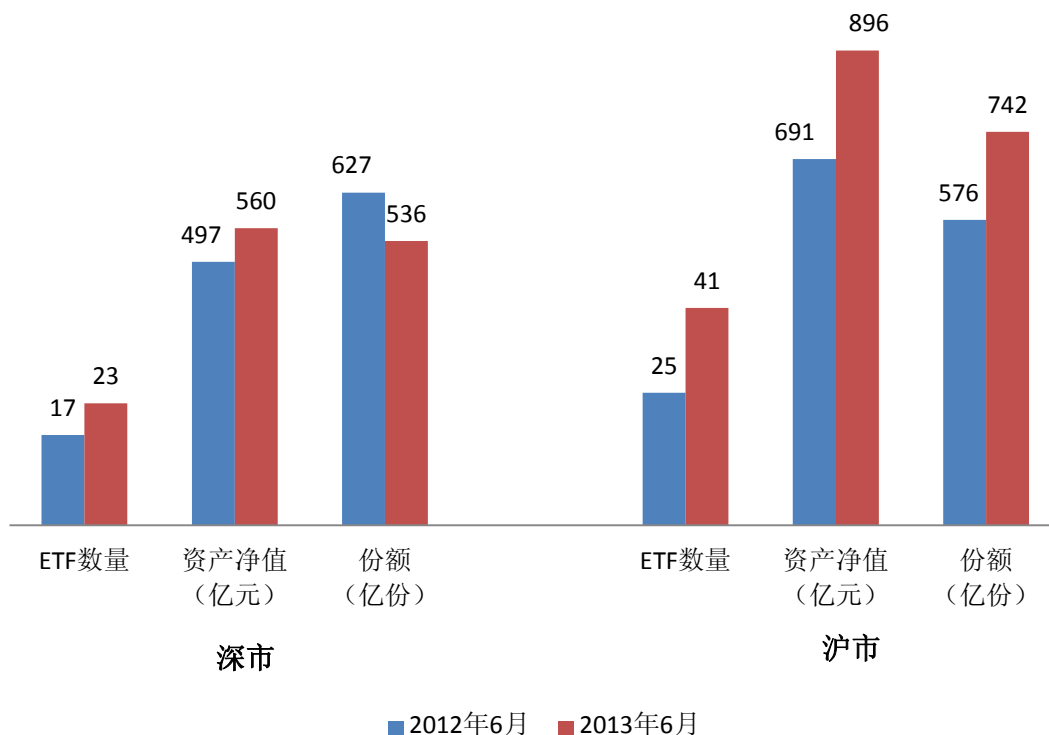
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.6.30。

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	嘉实沪深 300ETF	嘉实	126.55	282.03	0.26%
510050	华夏上证 50ETF	华夏	131.70	208.48	0.34%
510330	华夏沪深 300ETF	华夏	84.75	188.96	0.17%
510300	华泰柏瑞沪深 300 ETF	华泰柏瑞	71.47	159.37	0.15%
159901	易方达深证 100 ETF	易方达	270.42	142.46	0.84%
510180	华安上证 180 ETF	华安	248.94	120.98	0.14%
510500	南方中证 500 ETF	南方	44.76	40.71	0.18%
510010	上证 180 公司治理 ETF	交银施罗德	49.20	29.13	0.04%
159902	华夏中小企业板 ETF	华夏	13.72	28.88	0.35%
159903	南方深证成份指数 ETF	南方	28.71	22.77	0.22%

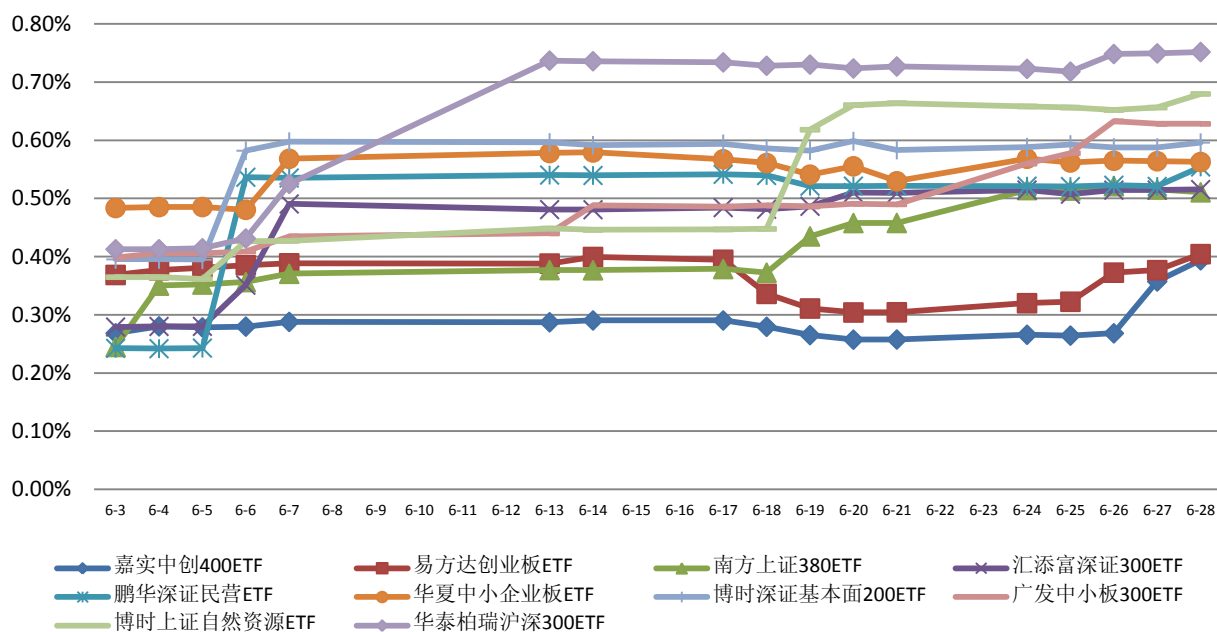
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.6.30。

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 2013.6.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：6 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)

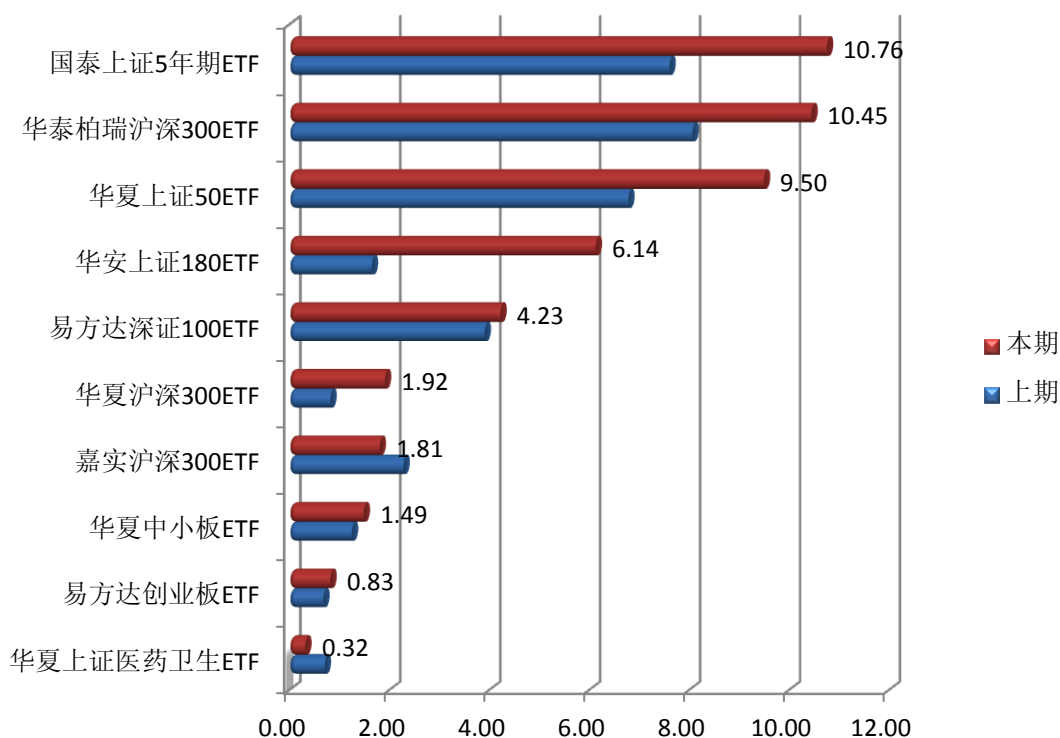
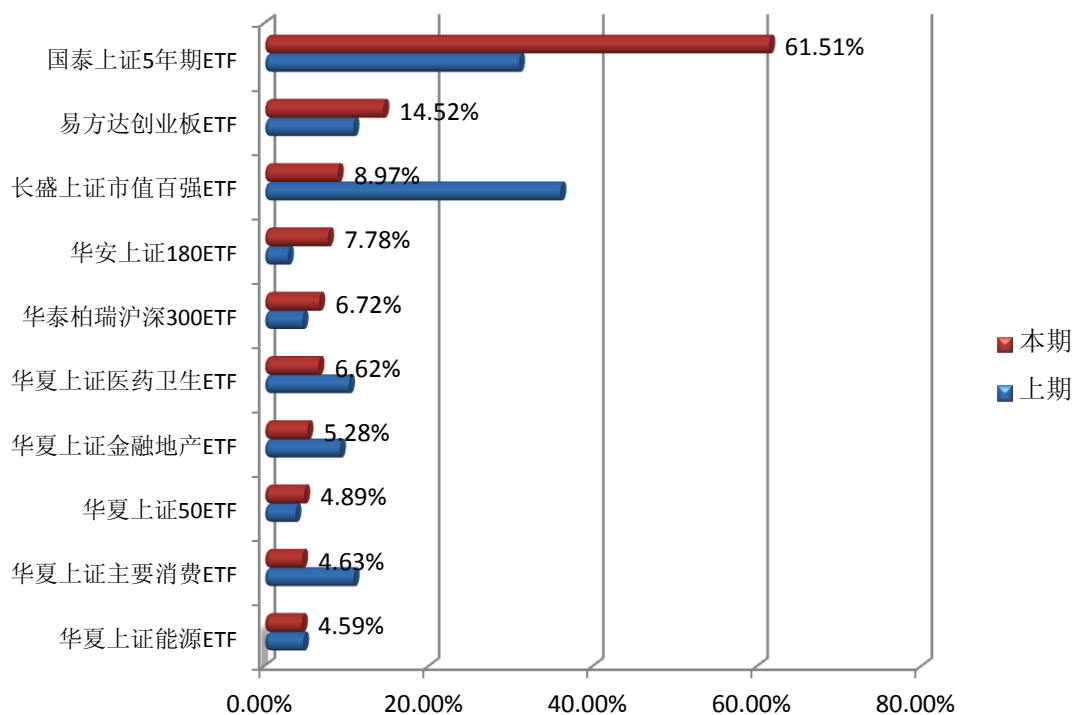


图 4: 日均换手率前 10 只 ETF



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	6 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	6 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.23	-0.02	-1.45%	0.99	-0.19	-16.03%
160125	南方中国	0.02	0	0.70%	0.02	0	-8.00%
160415	华安 S300	0.25	-0.01	-3.67%	0.2	-0.05	-18.26%
160615	鹏华 300	0.36	0	0.01%	0.29	-0.05	-13.99%
160616	鹏华 500	0.61	0	-0.34%	0.42	-0.07	-14.65%
160706	嘉实 300	25.35	0.14	0.54%	15.2	-2.34	-13.33%
160716	嘉实 50	0.9	0	-0.25%	0.54	-0.09	-14.50%
160717	恒生 H 股	0.38	0	0.91%	0.25	-0.02	-8.31%
160807	长盛 300	0.06	0	-0.93%	0.05	-0.01	-15.10%
161017	富国 500	0.02	0	-2.68%	0.02	0	-16.90%
161211	国投金融	0.82	-0.01	-1.54%	0.63	-0.12	-16.00%
161213	国投消费	0.14	0	-1.34%	0.11	-0.01	-11.26%
161607	融通巨潮	0.61	0	0.10%	0.42	-0.07	-13.59%
161714	招商金砖	0.01	0	0.13%	0.01	0	-6.52%
161811	银华 300	0.1	0	-0.04%	0.07	-0.01	-14.68%
161903	万家公用	0.33	0	-0.92%	0.17	-0.02	-12.63%
161907	万家红利	0.49	0	-0.33%	0.38	-0.06	-14.24%
162307	海富 100	0.17	0	-1.32%	0.11	-0.02	-14.74%
162411	华宝油气	0.01	0	1.04%	0.01	0	-2.32%
162711	广发 500	1.35	-0.01	-0.93%	0.99	-0.18	-15.41%
163001	长信 100	0.1	0	-0.17%	0.07	-0.01	-14.31%
163407	兴全 300	0.26	0	-0.75%	0.19	-0.03	-15.01%
163821	中银 300E	0	0	-2.67%	0	0	-17.28%
164205	天弘深成	0.01	0	-3.42%	0	0	-18.57%
165309	建信 300	0.18	0.01	4.64%	0.12	-0.01	-10.17%
165806	东吴 100	0.03	0	-0.36%	0.02	0	-15.05%
166007	中欧 300	0.05	0	1.22%	0.04	-0.01	-12.55%
167901	华宸 300	2.73	/	/	2.46	/	/
总计		36.57	0.08		23.78	-3.39	

注：数据来源:深交所;统计期为 2013.6.1-2013.6.30,“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。

➤ 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	6 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	6 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	35.95	0.4	1.13%	27.89	-11.28	-28.79%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.01	0	-0.34%	0.95	-0.22	-18.90%

150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.01	0	-0.34%	0.95	-0.1	-9.54%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	8.03	0.13	1.68%	8.14	0.18	2.28%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	12.04	0.2	1.68%	9.74	-3	-23.55%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	117.18	18.13	18.31%	120.58	19.15	18.89%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	117.18	18.13	18.31%	45.35	-18.44	-28.90%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	44.65	3.39	8.23%	42.46	0.17	0.41%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	44.65	3.39	8.23%	4.13	-4.52	-52.29%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	15.31	0.67	4.61%	15.68	0.76	5.12%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	22.97	1.01	4.61%	8.98	-3.45	-27.74%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	7.72	0.12	1.56%	7.96	0.17	2.16%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	7.72	0.12	1.56%	6.5	-2.57	-28.38%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.88	0.3	53.42%	0.9	0.32	54.18%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.88	0.3	53.42%	0.56	0.03	5.54%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.04	0	-0.92%	0.04	0	-0.34%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.06	0	-0.92%	0.05	-0.02	-24.02%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.02	0	0.70%	0.02	0	1.22%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.03	0	0.70%	0.02	-0.01	-24.52%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.05	0	-7.85%	0.05	0	-7.40%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.07	-0.01	-7.85%	0.06	-0.02	-28.09%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	5.93	1.95	48.78%	6.12	2.03	49.65%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	8.9	2.92	48.78%	3	-0.63	-17.26%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.02	0	-5.18%	0.02	0	-4.72%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.04	0	-5.18%	0.03	-0.01	-25.82%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.33	-0.08	-19.47%	0.34	-0.08	-18.99%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.33	-0.08	-19.47%	0.26	-0.18	-40.94%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.21	0.03	15.37%	0.22	0.03	16.05%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.32	0.04	15.37%	0.32	-0.01	-2.69%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.12	0	0.75%	0.12	0	1.24%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.12	0	0.75%	0.08	-0.03	-29.60%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.52	0.04	7.86%	0.54	0.04	8.41%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.52	0.04	7.86%	0.3	-0.12	-28.27%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	3.03	-0.35	-10.37%	3.06	-0.34	-9.90%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	3.03	-0.35	-10.37%	2.53	-1.18	-31.85%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.02	0	-16.50%	0.02	0	-16.07%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.02	0	-16.50%	0.01	-0.01	-39.92%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.08	-0.04	-33.28%	0.08	-0.04	-32.93%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.08	-0.04	-33.28%	0.09	-0.07	-45.10%
150092	德 S300A	诺德	2012-9-24	0.01	0	-3.95%	0.01	0	-3.48%
150093	德 S300B	诺德	2012-9-24	0.01	0	-3.95%	0.01	0	-29.42%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.07	0	3.81%	0.07	0	4.42%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.07	0	3.81%	0.07	-0.02	-25.85%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	7.82	-0.21	-2.62%	7.88	-0.17	-2.14%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	11.73	-0.32	-2.62%	8.68	-3.09	-26.25%

150096	商品 A	招商	2012-7-25	0.97	0.33	51.61%	1	0.34	52.35%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	0.97	0.33	51.61%	0.41	-0.09	-18.08%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	0.88	0.13	16.79%	0.9	0.13	17.36%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	0.88	0.13	16.79%	0.31	-0.25	-44.62%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.19	-0.02	-8.34%	0.2	-0.02	-7.90%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.19	-0.02	-8.34%	0.15	-0.08	-33.58%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.3	-0.02	-5.08%	0.32	-0.02	-4.54%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.3	-0.02	-5.08%	0.32	-0.11	-26.15%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	0.71	-0.01	-0.77%	0.74	0	-0.20%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	0.71	-0.01	-0.77%	0.64	-0.28	-30.83%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.01	0	-11.63%	0.01	0	-11.21%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.02	0	-11.63%	0.02	-0.01	-30.55%
150112	工银 100A	工银瑞信	2012-11-5	0.11	0	-0.04%	0.11	0	0.48%
150113	工银 100B	工银瑞信	2012-11-5	0.11	0	-0.04%	0.09	-0.04	-30.12%
150117	房地产 A	国泰	2013-3-7	2.33	1.39	148.88%	2.39	1.44	150.34%
150118	房地产 B	国泰	2013-3-7	2.33	1.39	148.88%	2.12	0.98	86.25%
150123	建信 50A	建信	2013-5-20	2.55	-0.16	-5.88%	2.60	-0.15	-5.47%
150124	建信 50B	建信	2013-5-20	2.55	-0.16	-5.88%	2.16	-0.72	-25.13%
150121	银河优先	银河	2013-6-6	0.22	/	/	0.23	/	/
150122	银河进取	银河	2013-6-6	0.22	/	/	0.21	/	/
总计				497.92	53.14		350.28	-25.59	

注：数据来源：深交所；统计期为 2013.6.1-2013.6.30，“/”代表基金上期末上市或者未开放申购赎回。

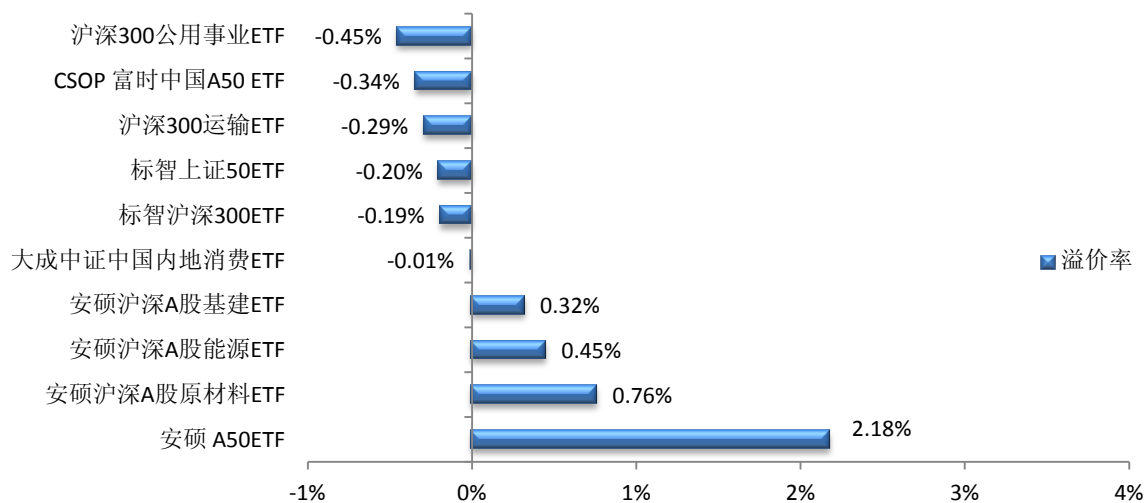
➤ 跨境 ETF

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	0.72
2818	A 股 50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.50
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50 指数	CSOP Asset Management Limited	2012-11-8	193.30
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	477.28
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	81.41
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	2.35
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	1.80
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.84
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	4.81
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.43
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.25
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.21
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.16
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.42
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.43
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	0.86
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	23.55

3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.81
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.11
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.81
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.00
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	0.11
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	0.12
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management (Hong Kong)	2012-11-9	34.31
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	13.20
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management	2012-10-26	135.50

图 5：溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注：统计期为 2013.6.1-2013.6.30

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	44.97	-15.73%	0.67%	3.70%
2818	中国平安 CSI RAFI A 股 50ETF	1.53	541.47%	0.01%	618.42%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	63906.30	-13.47%	3.14%	-6.36%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	158570.93	11.06%	3.15%	25.41%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	4284.22	-1.69%	0.49%	10.81%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	26.49	19.72%	0.11%	33.64%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	25.62	117.41%	0.14%	132.53%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	623.92	83.57%	6.57%	158.52%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	400.81	28.70%	0.72%	36.16%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	12.97	90.99%	0.09%	114.20%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	5.69	-76.85%	0.24%	-72.66%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	1.66	8.17%	0.01%	24.81%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	14.39	-45.47%	0.86%	-34.10%
3024	标智上证 50 中国指数基金	4.87	-46.72%	0.03%	-32.59%

3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	82.45	309.66%	0.58%	363.81%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	1.89	39.40%	0.02%	67.00%
3049	沪深 300 指数 ETF	3234.73	23.91%	1.28%	45.29%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	0.40	-91.29%	0.00%	-89.67%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	23.44	408.44%	2.12%	501.27%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	77.38	105.75%	0.95%	118.24%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	230.82	39.23%	2.07%	65.55%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	96.75	13.32%	4.28%	26.34%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	6.83	1220.55%	0.60%	1400.76%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.09	-45.81%	0.01%	-44.74%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	3935.46	103.92%	0.89%	216.29%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	692.46	-22.38%	0.42%	1.04%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	29915.22	19.92%	2.02%	39.89%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2013.6.1-2013.6.30；“/”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 6 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
IF1306	2604.40	2620.00	2277.60	2315.60	-284.40	0	-87934	2315.00	5536090	41144.80
IF1307	2598.00	2612.00	1996.00	2168.60	-423.40	59806	41869	2144.60	7769043	51356.79
IF1308	2300.00	2300.00	2002.40	2163.20	-140.80	2674	2674	2144.20	59423	381.96
IF1309	2609.80	2626.00	2006.40	2171.00	-436.20	13669	-5390	2150.40	334784	2272.16
IF1312	2624.00	2653.00	2036.00	2190.20	-443.80	3758	1073	2166.80	45505	313.26

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 2013.6.30

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

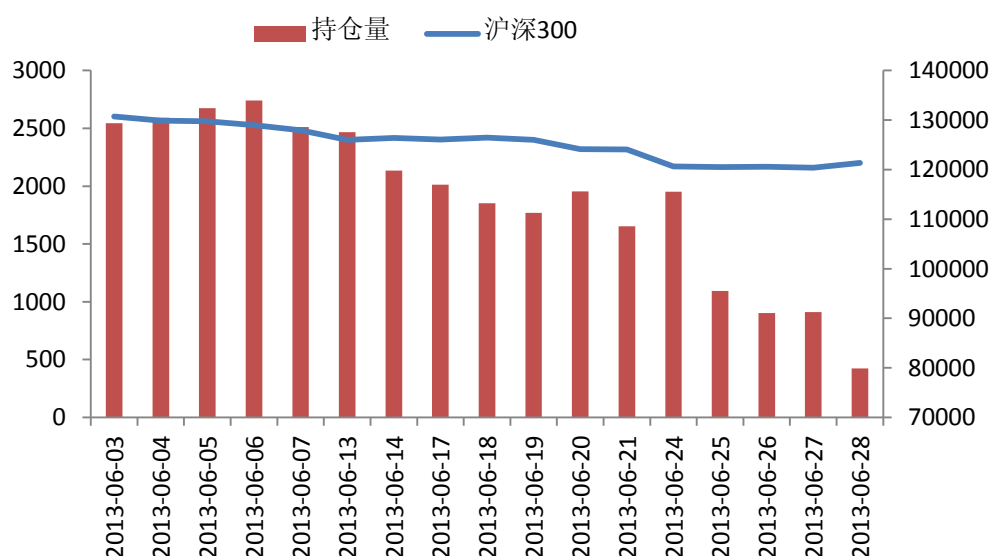
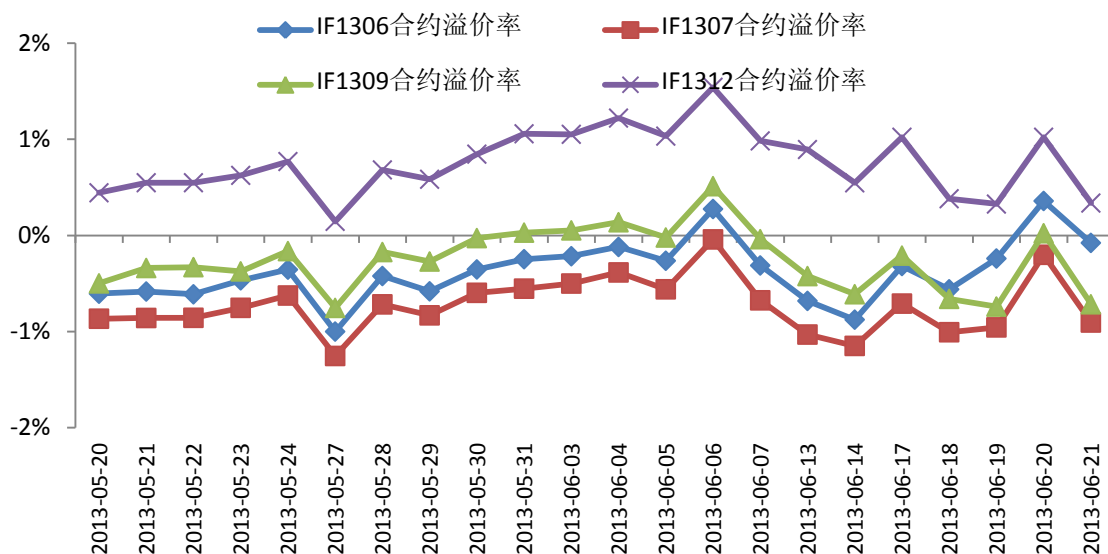
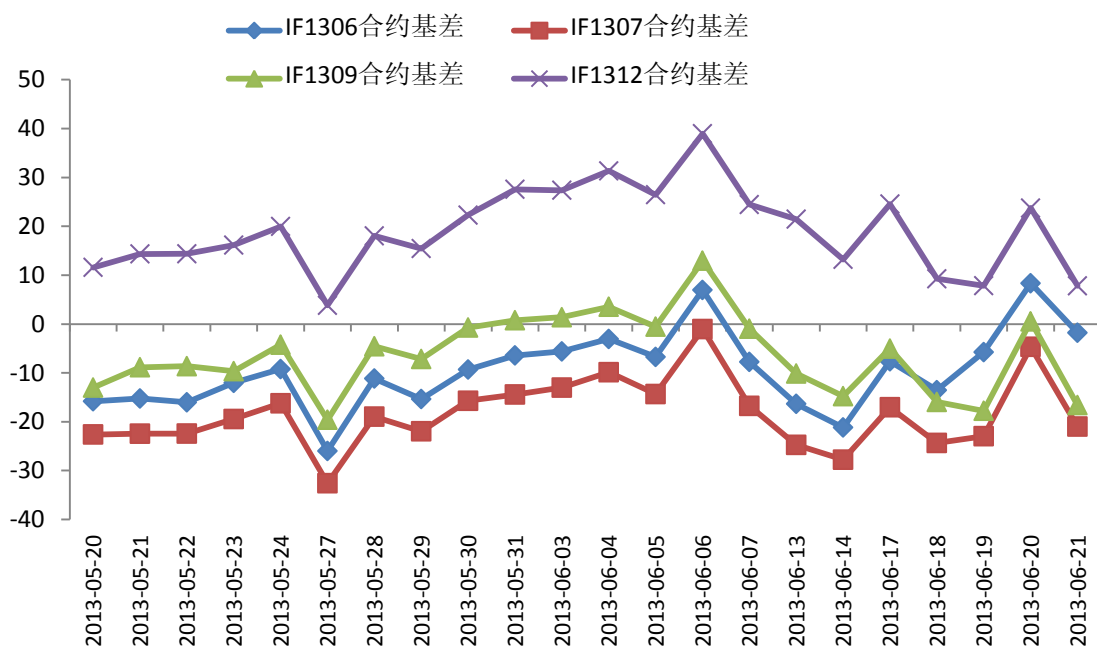


图 7: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2013.5.20-2013.6.21

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 2013.5.20-2013.6.21

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>