

2013 年 7 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

➤ 首只创业板指数分级基金即将问世

据报道，由富国基金设计的创业板指数分级产品即将发行问世，这意味着，以创业板指数为投资标的的指数型杠杆化产品即将实现零的突破。创业板指数分级产品的问世，为投资者提供了新的分享创业板指数高收益的杠杆型指数化投资产品。

据了解，一方面，2013 年以来，A 股主板市场一直处于震荡调整期。在这种情况下，创业板指数却一枝独秀，表现惊艳。而另一方面，目前市场上跟踪创业板指数的产品已经远不能满足投资者的需求，现有跟踪创业板指数的指数基金仅有易方达创业板 ETF 及联接基金、融通创业板指数增强型基金等三只产品，而可以在二级市场交易的仅有易方达创业板 ETF。创业板指数分级基金的面世将填补这一空白。

➤ 多空分级指数基金获反馈 风险控制是监管层关注重点

经过接近半年之久的漫长等待后，多空分级基金募集申请终于得到证监会的首次反馈意见。7 月 23 日晚间证监会公布基金募集申请核准进度，首次发布对中欧沪深 300 指数多空分级基金等 3 只多空分级基金的反馈意见。

据了解，对于多空分级指数基金，目前有两大问题是基金公司考虑的重点，同时也是监管部门最为关注的。首先，此类产品市场接受度如何，上市之后的风险是否有充分考虑与应对方案；其次，在硬件上，基金公司及交易所是否做好系统对接准备。

➤ 深交所：深市债券 ETF 迈入 T+0 时代

7 月 28 日，深圳证券交易所正式发布《深圳证券交易所交易规则（2013 年修订）》，新版交易规则明确了深市债券 ETF 将于 2013 年 8 月 5 日正式实行当日回转交易，深市债券 ETF 从此将正式迈入 T+0 时代。

近期，市场对债券 ETF 产品热度不减。据悉，深证信用债综指 ETF 已经获批，实现了深市债券 ETF 产品零的突破。在深市债券 ETF 实行当日回转交易后，深信用债 ETF 未来表现或值得期待。

➤ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

新上市

本月无新基金上市。

新成立

上证 180 高贝塔 ETF 于 7 月 8 日成立，首募 3.25 亿。

上证企债 30ETF 于 7 月 11 日成立，首募 34.25 亿。

鹏华沪深 300ETF 于 7 月 19 日成立，首募 13.06 亿。

国金通用沪深 300 指数分级基金于 7 月 26 日成立，首募 3.23 亿。

新发行

广发美国房地产指数基金于 7 月 8 日发行。

汇添富中证主要消费、医药卫生、能源、金融地产 ETF 于 7 月 15 日发行。

银华中证转债指数增强分级基金于 7 月 15 日发行。

国联安中证医药 100 指数基金于 7 月 22 日发行。

信诚中证 800 指数分级基金于 7 月 22 日发行。

国泰国证医药卫生行业指数分级基金于 8 月 5 日发行。

新获批

华安中证高等级信用债 ETF 及其联接基金于 7 月 2 日获批。

金鹰中证大消费 360ETF 及其联接基金于 7 月 12 日获批。

嘉实中证能源、可选消费、金融地产、主要消费、医药卫生 ETF 于 7 月 12 日获批。

新申报

万家基金于 7 月 5 日申报上证 380 ETF。

景顺长城于 7 月 5 日申报沪深 300 指数增强型基金。

华安基金于 7 月 12 日申报沪深 300 量化增强基金。

市场要点

➤ 国内指数基金概况

本期基金二季报披露完毕，截止 2013 年 6 月 30 日，指数基金的资产规模为到 3849 亿元。华夏基金管理有限公司所管理的指数基金资产规模名列第一，达到约 650 亿元，跟踪沪深 300 指数的基金规模最大，近似 1541 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近 75% 的份额，前十大指数基金占据了 48% 的份额。

➤ 国内 ETF

2013 年 7 月，本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1455.98 亿元减少到至本期的 1443.37 亿元。从产品规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，资产净值达到 289.12 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的 ETF 为嘉实中证 500ETF。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 7.69 亿元和 6.59 亿元。

➤ LOF

2013 年 7 月，LOF 指数基金的场内规模为 34.05 亿份，较上月增加 0.18 亿份；场内资产净值为 21.63 亿元，较上月增加 0.29 亿元。

➤ 创新型指数基金

2013 年 7 月，创新型指数基金的场内规模为 536.97 亿份，较上月增加 39.68 亿份；场内资产净值为 384.22 亿元，较上月增加 34.37 亿元。

➤ 境外 ETF

本期末，28 只 ETF 资产规模为 942.97 亿港元。以沪深 300 医药卫生指数 ETF 的净值涨幅最大，涨幅为 9.54%；从活跃程度看，安硕富时 A50 ETF 日均成交金额最大，达到 10.96 亿港元，CSOP 富时 A50 ETF 日均换手率最高，达到 3.01%。

➤ 股指期货

7 月份沪深 300 指数收报于 2193.02，较上月下跌 0.35%。而同期可比股指期货合约 IF1308、IF1309、IF1312 涨跌幅分别为 0.08%、-0.74%和-1.40%。从成交情况看，五份合约累计成交量 23211627 手，较上月增加 68.88%，累计成交金额 153581.37 亿，较上月增加 60.87%。

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	69	3	4	7	1
LOF	29	0	0	0	0
创新型基金	34	1	3	0	0
其他指数基金	128	0	2	2	2
总计	260	4	9	9	3

注: 统计期间为 2013.7.1-2013.7.31

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	56	0	0	0	0
上证指数	65	2	0	0	1
巨潮指数	8	0	1	0	0
中证指数	102	2	7	9	2
其他机构	29	0	1	0	0
总计	260	4	9	9	3

注: 统计期间为 2013.7.1-2013.7.31

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
161613	融通创业板指数增强基金	融通	创业板指 (399006)	11.73%
159915	易方达创业板 ETF	易方达	创业板指 (399006)	11.13%
110026	易方达创业板 ETF 联接基金	易方达	创业板指 (399006)	10.53%
159909	招商 TMT50ETF	招商	TMT50P (399610)	10.18%
217019	招商 TMT50ETF 联接	招商	TMT50P (399610)	9.47%
510020	上证超级大盘 ETF	博时	超大盘 (000043)	-4.48%
050013	上证超级大盘 ETF 联接	博时	超大盘 (000043)	-4.31%
161819	银华中证内地资源指数分级	银华	内地资源 (000944)	-2.28%
510170	上证大宗商品股票 ETF	国联安	上证商品 (000066)	-2.17%
510280	上证 180 成长 ETF	华宝兴业	180 成长 (000028)	-2.12%

注: 统计期间为 2013.7.1-2013.7.31

➤ 指数基金二季报概况

表 4：国内市场前十大指数基金管理人列表

基金管理人	2013 年二季度			2013 年一季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
华夏基金管理有限公司	12	650.20	16.89%	12	648.57	15.51%
嘉实基金管理有限公司	13	614.27	15.96%	10	722.37	17.28%
易方达基金管理有限公司	15	458.38	11.91%	14	521.73	12.48%
银华基金管理有限公司	8	258.81	6.72%	8	259.62	6.21%
华安基金管理有限公司	8	196.48	5.10%	8	142.79	3.42%
华泰柏瑞基金管理有限公司	5	173.50	4.51%	5	170.67	4.08%
南方基金管理有限公司	12	172.23	4.47%	12	146.33	3.50%
融通基金管理有限公司	5	160.31	4.17%	5	184.73	4.42%
国泰基金管理有限公司	11	118.43	3.08%	9	168.9	4.04%
博时基金管理有限公司	8	102.27	2.66%	8	116.35	2.78%
总计	97	2904.88	75.47%	91	3082.04	73.72%

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 年二季度			2013 年一季度		
	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	33	1540.90	40.03%	29	1691.24	40.45%
深证 100	11	589.72	15.32%	11	607.05	14.52%
上证 50	3	364.98	9.48%	3	337.41	8.07%
上证 180	3	159.86	4.15%	3	101.51	2.43%
中证 500	15	142.97	3.71%	12	164.08	3.92%
深证成指	5	95.15	2.47%	5	103.7	2.48%
道琼斯中国 88 指数	1	65.47	1.70%	1	70.81	1.69%
180 治理	2	54.75	1.42%	2	56.6	1.35%
MSCI 中国 A 股指数	1	54.15	1.41%	1	59.88	1.43%
中证 100	9	52.86	1.37%	9	81.76	1.96%
总计	83	3120.80	81.08%	78	3274.04	78.30%

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	282.38	161812	银华深证 100	176.43
160706	嘉实沪深 300	248.09	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	159.37
510050	上证 50ETF	208.53	110003	易方达上证 50	154.68
510330	华夏沪深 300ETF	188.97	159901	易方达深证 100ETF	138.14
000051	华夏沪深 300	177.93	161604	融通深证 100	128.82

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 年二季度			2013 年一季度		
	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	826.01	21.46%	56	865.8	20.71%
上证指数	62	843.34	21.91%	61	857.39	20.51%
巨潮指数	8	53.16	1.38%	8	63.47	1.52%
中证指数	99	1916.68	49.80%	89	2167.47	51.85%
其他机构	29	209.77	5.45%	27	226.43	5.42%
总计	254	3848.97	100.00%	241	4180.56	100.00%

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	23	0	575.33	39.86%
沪市	41	0	868.04	60.14%
总计	64	0	1443.37	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.7.31；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	235.14	16.29%
上证指数	33	0	481.35	33.35%
中证指数	11	0	722.10	50.03%
其他指数	3	0	4.78	0.33%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.7.31；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	9	0	443.08	30.70%
嘉实基金管理有限公司	4	0	297.80	20.63%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	156.81	10.86%
易方达基金管理有限公司	5	0	156.43	10.84%
华安基金管理有限公司	2	0	126.42	8.76%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.7.31。

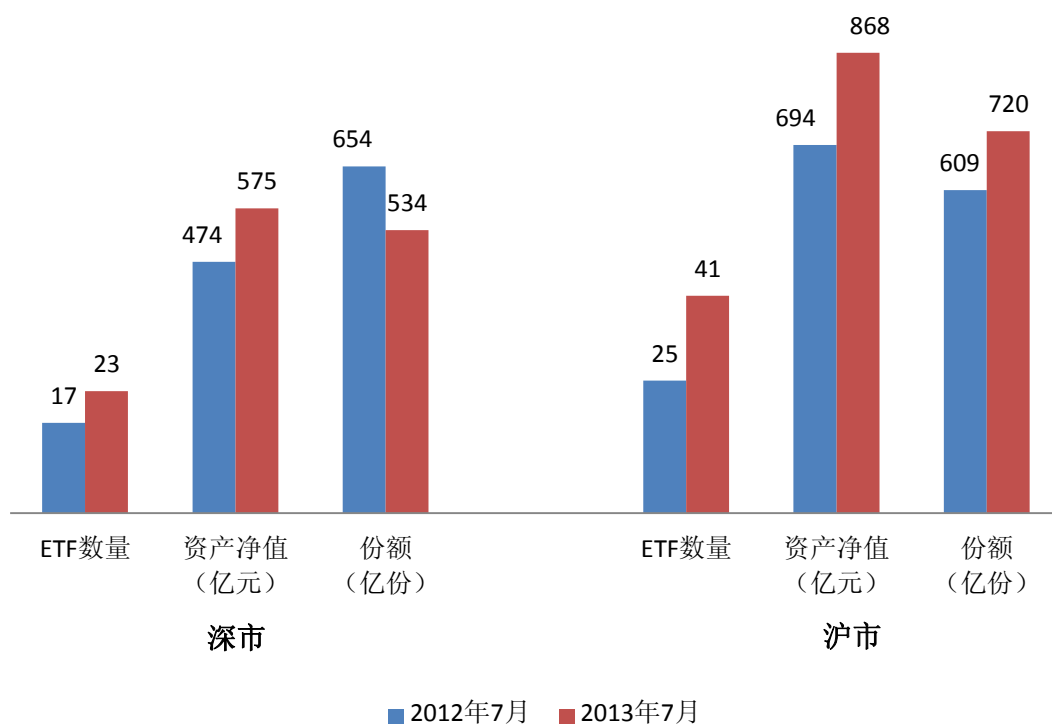
表 11：规模最大的前十只 ETF 列表

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	129.17	289.12	0.25%
510330	华夏沪深 300ETF	华夏	88.60	198.72	0.17%
510050	华夏上证 50ETF	华夏	127.37	197.81	0.29%
510300	华泰柏瑞沪深 300 ETF	华泰柏瑞	64.46	144.36	0.12%

159901	易方达深证 100 ETF	易方达	256.50	138.05	0.74%
510180	华安上证 180 ETF	华安	249.41	121.21	0.13%
510500	南方中证 500 ETF	南方	44.76	43.10	0.18%
159925	南方沪深 300ETF	南方	37.89	32.30	0.03%
159902	华夏中小企业板 ETF	华夏	13.72	29.95	0.31%
000021	上证 180 公司治理 ETF	交银施罗德	49.11	29.02	0.04%

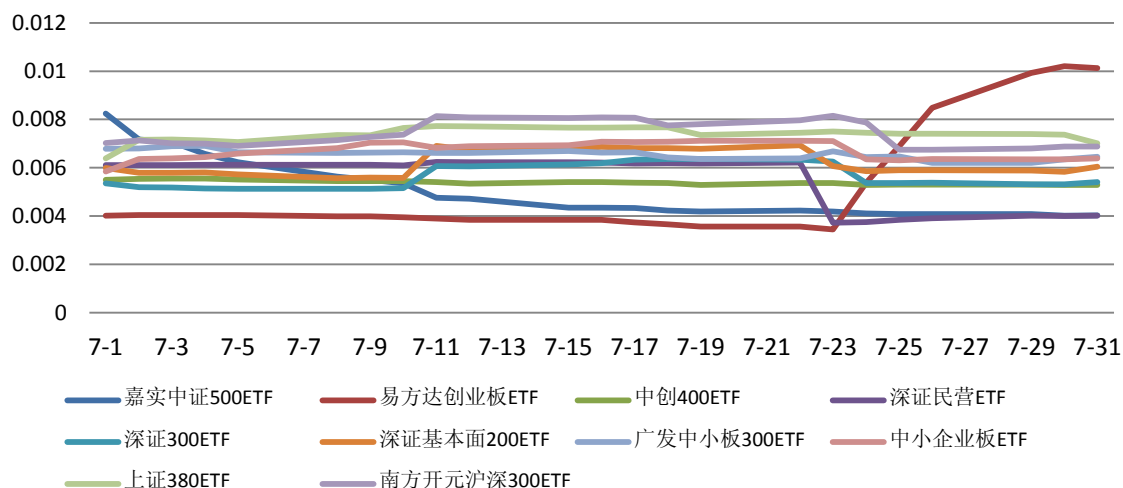
数据来源：深沪交易所；数据截止 2013.7.31。

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 2013.7.31；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：7 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）

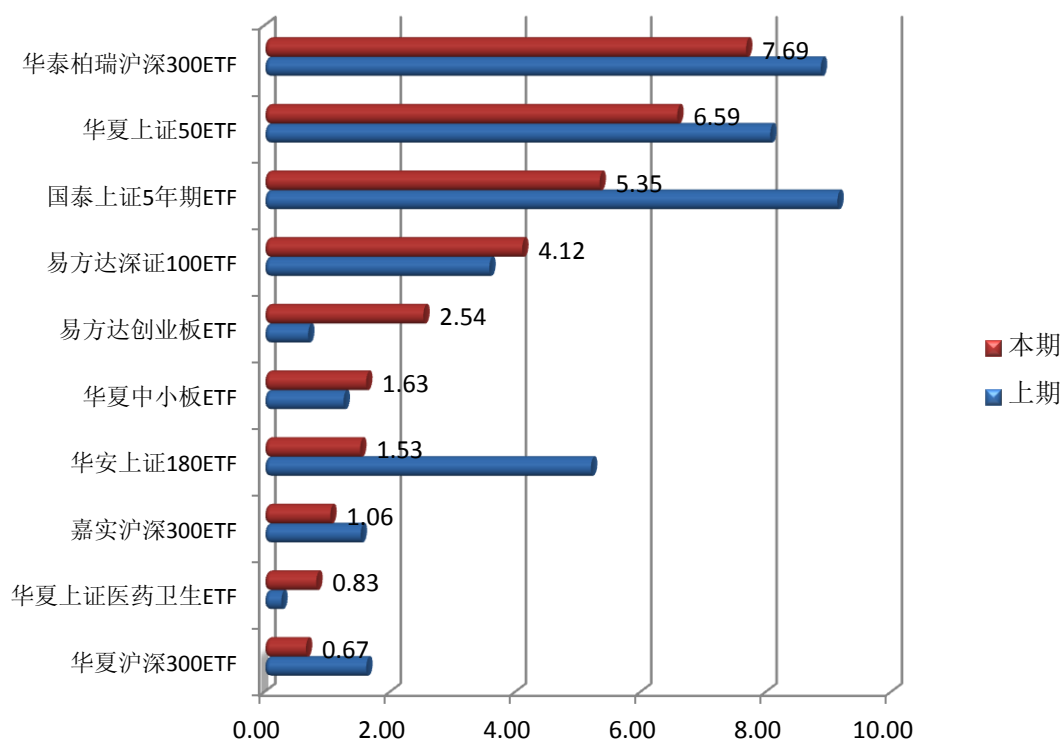
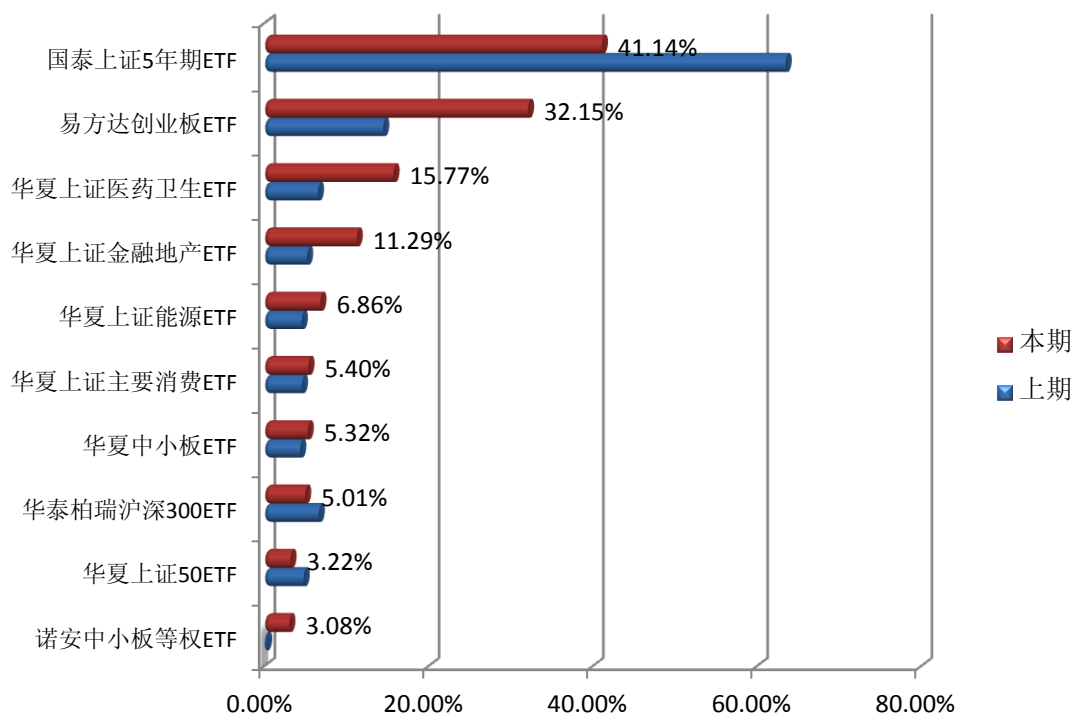


图 4：日均换手率前 10 只 ETF



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	7 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	7 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.22	-0.01	-1.08%	1.04	0.04	4.44%
160125	南方中国	0.02	0.00	-4.18%	0.02	0.00	-2.53%
160415	华安 S300	0.25	-0.01	-2.44%	0.21	0.00	0.45%
160615	鹏华 300	0.37	0.00	0.62%	0.29	0.00	1.00%
160616	鹏华 500	0.60	-0.01	-2.32%	0.43	0.01	2.70%
160706	嘉实 300	25.63	0.28	1.11%	15.43	0.23	1.53%
160716	嘉实 50	0.90	0.00	0.18%	0.54	0.00	-0.71%
160717	恒生 H 股	0.37	-0.01	-1.38%	0.25	0.00	1.61%
160807	长盛 300	0.06	0.00	-2.00%	0.05	0.00	-1.06%
161017	富国 500	0.02	0.00	-3.28%	0.02	0.00	1.21%
161211	国投金融	0.81	-0.01	-0.73%	0.61	-0.01	-1.89%
161213	国投消费	0.14	0.00	-1.49%	0.11	0.00	3.47%
161607	融通巨潮	0.60	0.00	-0.39%	0.41	0.00	-0.82%
161714	招商金砖	0.01	0.00	0.01%	0.01	0.00	4.51%
161811	银华 300	0.10	0.00	-1.69%	0.07	0.00	-2.25%
161903	万家公用	0.33	0.00	-0.09%	0.17	0.00	1.10%
161907	万家红利	0.49	0.00	-1.00%	0.37	-0.01	-1.71%

162307	海富 100	0.17	0.00	0.40%	0.11	0.00	-0.38%
162411	华宝油气	0.01	0.00	-21.39%	0.01	0.00	-16.21%
162711	广发 500	1.34	-0.01	-0.62%	1.04	0.05	4.78%
163001	长信 100	0.10	0.00	0.11%	0.07	0.00	0.53%
163407	兴全 300	0.25	-0.01	-2.51%	0.19	-0.01	-2.70%
163821	中银 300E	0.00	0.00	1.12%	0.00	0.00	3.01%
164205	天弘深成	0.01	0.00	24.97%	0.01	0.00	26.81%
165309	建信 300	0.17	-0.01	-3.23%	0.11	0.00	-2.93%
165806	东吴 100	0.03	0.00	0.20%	0.02	0.00	3.03%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-2.19%	0.04	0.00	-1.94%
167901	华宸 300	0.11	-0.03	-21.32%	0.10	-0.03	-21.58%
总计		34.05	0.18		21.63	0.29	

注：数据来源：深交所；统计期为 2013.7.1-2013.7.31。

➤ 创新型指数基金

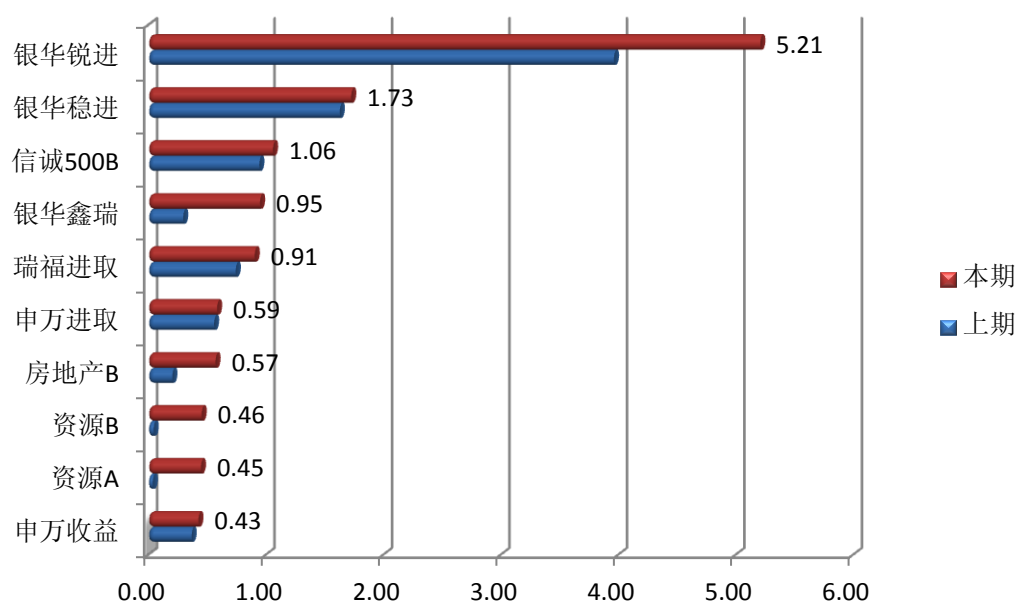
表 13：创新型指数基金（场内部分）份额及资产净值月度变化情况

代码	简称	管理人	上市日期	7 月规模 (亿份)	规模 增量	增幅	7 月资产 (亿元)	资产 增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	36.04	0.09	0.25%	29.12	1.19	4.25%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	0.99	-0.02	-1.79%	0.94	-0.01	-1.27%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	0.99	-0.02	-1.79%	0.94	-0.01	-1.27%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	7.94	-0.09	-1.08%	8.09	-0.04	-0.49%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	11.91	-0.13	-1.08%	9.46	-0.30	-3.03%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	123.19	6.01	5.13%	127.37	6.80	5.64%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	123.19	6.01	5.13%	50.51	5.16	11.37%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	43.53	-1.12	-2.52%	41.99	-0.47	-1.10%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	43.53	-1.12	-2.52%	4.08	-0.04	-1.04%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	13.02	-2.29	-14.95%	13.40	-2.28	-14.54%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	19.54	-3.43	-14.95%	8.67	-0.31	-3.42%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	7.19	-0.52	-6.80%	7.46	-0.50	-6.26%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	7.19	-0.52	-6.80%	6.03	-0.47	-7.24%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.85	-0.03	-3.30%	0.87	-0.02	-2.73%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.85	-0.03	-3.30%	0.54	-0.02	-2.99%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.04	0.00	-5.72%	0.04	0.00	-5.18%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.06	0.00	-5.72%	0.05	0.00	2.67%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.01	-0.01	-36.63%	0.01	-0.01	-36.27%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.02	-0.01	-36.63%	0.02	-0.01	-30.01%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.04	0.00	-8.64%	0.04	0.00	-8.20%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.06	-0.01	-8.64%	0.06	0.00	-0.35%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	12.39	6.45	108.73%	12.85	6.73	109.95%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	18.58	9.68	108.73%	5.76	2.75	91.44%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.02	0.00	-11.13%	0.02	0.00	-10.61%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.03	0.00	-11.13%	0.03	0.00	-8.27%

150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.29	-0.04	-12.53%	0.29	-0.04	-12.01%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.29	-0.04	-12.53%	0.25	-0.01	-3.07%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.14	-0.07	-32.68%	0.15	-0.07	-32.29%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.22	-0.11	-32.68%	0.22	-0.10	-30.67%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.01	5.27%	0.13	0.01	5.89%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.12	0.01	5.27%	0.08	0.00	4.94%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.54	0.02	3.98%	0.56	0.02	4.58%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.54	0.02	3.98%	0.33	0.02	7.21%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	3.14	0.11	3.70%	3.19	0.13	4.29%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	3.14	0.11	3.70%	2.80	0.27	10.72%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.05	0.03	199.39%	0.05	0.03	201.10%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.05	0.03	199.39%	0.04	0.03	226.83%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.05	-0.03	-38.89%	0.05	-0.03	-38.54%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.05	-0.03	-38.89%	0.05	-0.03	-37.43%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-1.76%	0.01	0.00	-1.29%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.01	0.00	-1.76%	0.01	0.00	3.32%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.07	0.00	0.94%	0.08	0.00	1.52%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.07	0.00	0.94%	0.07	0.01	7.80%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	7.78	-0.04	-0.56%	7.88	0.00	0.03%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	11.67	-0.07	-0.56%	8.84	0.14	1.59%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	1.50	0.54	55.61%	1.56	0.56	56.51%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	1.50	0.54	55.61%	0.67	0.27	65.20%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	8.64	7.76	884.27%	8.94	8.04	890.01%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	8.64	7.76	884.27%	2.83	2.51	791.57%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.19	0.00	-0.68%	0.20	0.00	-0.10%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.19	0.00	-0.68%	0.15	-0.01	-3.93%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.27	-0.03	-9.96%	0.29	-0.03	-9.42%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.27	-0.03	-9.96%	0.31	-0.01	-4.50%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	0.68	-0.03	-3.69%	0.72	-0.02	-3.05%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	0.68	-0.03	-3.69%	0.65	0.01	1.75%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.20	0.19	1640.59%	0.22	0.20	1648.87%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.31	0.29	1640.59%	0.31	0.29	1701.98%
150112	工银 100A	工银瑞信	2012-11-5	0.11	0.00	-1.50%	0.11	-0.01	-5.14%
150113	工银 100B	工银瑞信	2012-11-5	0.11	0.00	-1.50%	0.10	0.00	2.73%
150117	房地产 A	国泰	2013-3-7	4.45	2.12	91.16%	4.60	2.21	92.46%
150118	房地产 B	国泰	2013-3-7	4.45	2.12	91.16%	4.17	2.05	96.82%
150123	建信 50A	建信	2013-5-20	2.47	-0.08	-3.25%	2.53	-0.07	-2.60%
150124	建信 50B	建信	2013-5-20	2.47	-0.08	-3.25%	2.15	-0.01	-0.43%
150121	银河优先	银河	2013-6-6	0.15	-0.07	-31.71%	0.16	-0.07	-31.31%
150122	银河进取	银河	2013-6-6	0.15	-0.07	-31.71%	0.14	-0.07	-33.73%
总计				536.97	39.68		384.22	34.37	

注：数据来源：深交所；统计期为 2013.7.1-2013.7.31，“/”代表基金上期未上市或者未开放申购赎回。

图 5: 分级基金场内部分日成交金额前 10 名 (亿元)



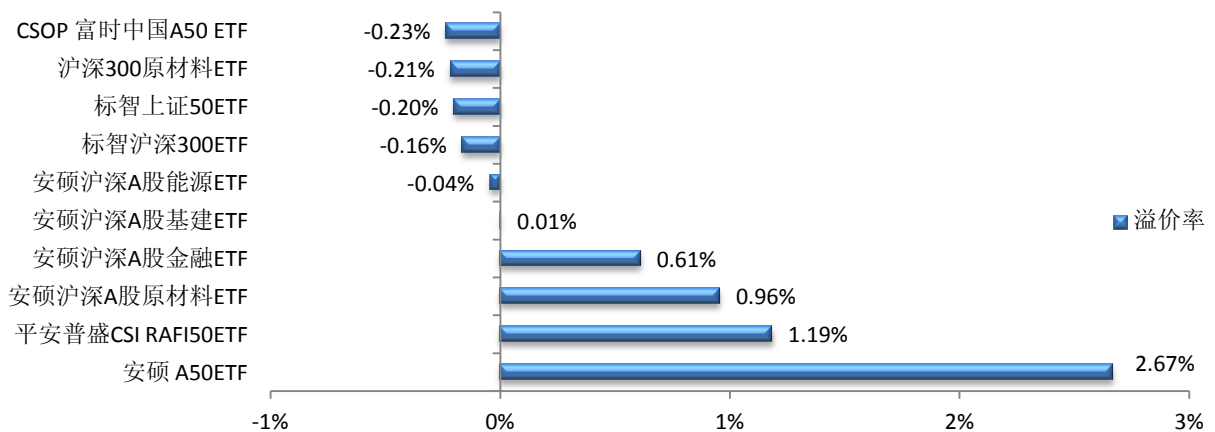
➤ 跨境 ETF

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	0.60
2818	A 股 50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.49
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50 指数	CSOP Asset Management Limited	2012-11-8	185.19
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	470.45
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	80.84
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	2.31
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	1.13
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.67
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	1.25
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.24
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	0.78
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Universal Asset management	2013-7-8	11.78
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.15
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.38
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.34
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	0.85
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	21.91
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.77
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	0.89

3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.84
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	0.10
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	22.08
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	16.37
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management	2012-10-26	114.32

图 6: 溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注: 统计期为 2013.7.1-2013.7.31

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	142.04	215.85%	2.10%	211.46%
2818	中国平安 CSI RAFI A 股 50ETF	4.06	164.70%	0.03%	171.71%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	57774.02	-9.60%	3.01%	-4.04%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	109587.63	-30.89%	2.22%	-29.46%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	2305.30	-46.19%	0.28%	-42.69%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	5.07	-80.86%	0.02%	-80.69%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	3.01	-88.25%	0.02%	-85.59%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	76.00	-87.82%	0.98%	-85.03%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	176.89	-55.87%	0.37%	-49.14%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	1.64	-87.38%	0.01%	-85.58%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	2.21	-61.19%	0.09%	-62.73%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	1.58	-4.96%	0.02%	14.02%
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	198.77	/	0.17%	/
3017	沪深 300 能源指数 ETF	4.77	-66.84%	0.31%	-64.09%
3024	标智上证 50 中国指数基金	2.07	-57.56%	0.01%	-53.66%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	12.97	-84.27%	0.09%	-83.90%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	1.38	-27.16%	0.02%	-26.36%
3049	沪深 300 指数 ETF	2370.30	-26.72%	1.03%	-19.15%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	6.06	1423.70%	0.08%	1566.06%

3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	0.89	-96.20%	0.08%	-96.30%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	56.27	-27.28%	0.64%	-32.77%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	176.68	-23.46%	1.89%	-8.63%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	51.65	-46.61%	2.55%	-40.32%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	2.33	-65.96%	0.21%	-64.67%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.00	-100.00%	0.00%	-100.00%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	1278.24	-67.52%	0.45%	-49.14%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	489.45	-29.32%	0.33%	-21.40%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	25479.75	-14.83%	2.01%	-0.13%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2013.7.1-2013.7.31；“/”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 7 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
IF1307	2158.00	2360.80	2104.00	2217.00	48.40	0	-59806	2216.80	12020469	79572.95
IF1308	2158.00	2348.00	2087.40	2165.00	1.80	65439	62765	2170.00	10044428	66443.89
IF1309	2160.60	2343.80	2083.40	2155.00	-16.00	24032	10363	2159.80	1018178	6713.43
IF1312	2185.60	2347.40	2096.40	2159.60	-30.60	6837	3079	2165.00	121433	804.11
IF1403	2167.20	2279.80	2133.00	2172.00	-1.00	817	817	2176.40	7119	46.98

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 2013.7.31

图 7：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

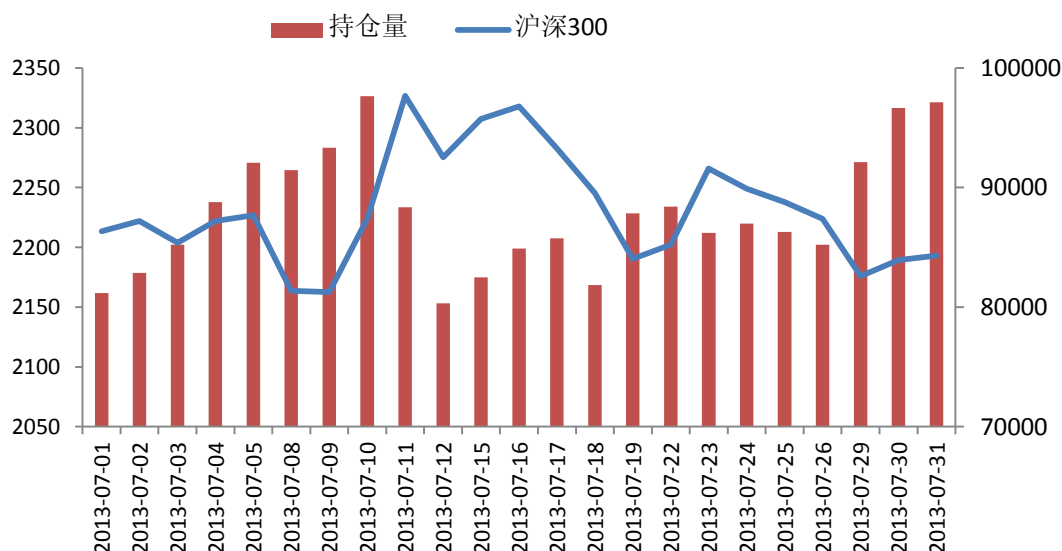
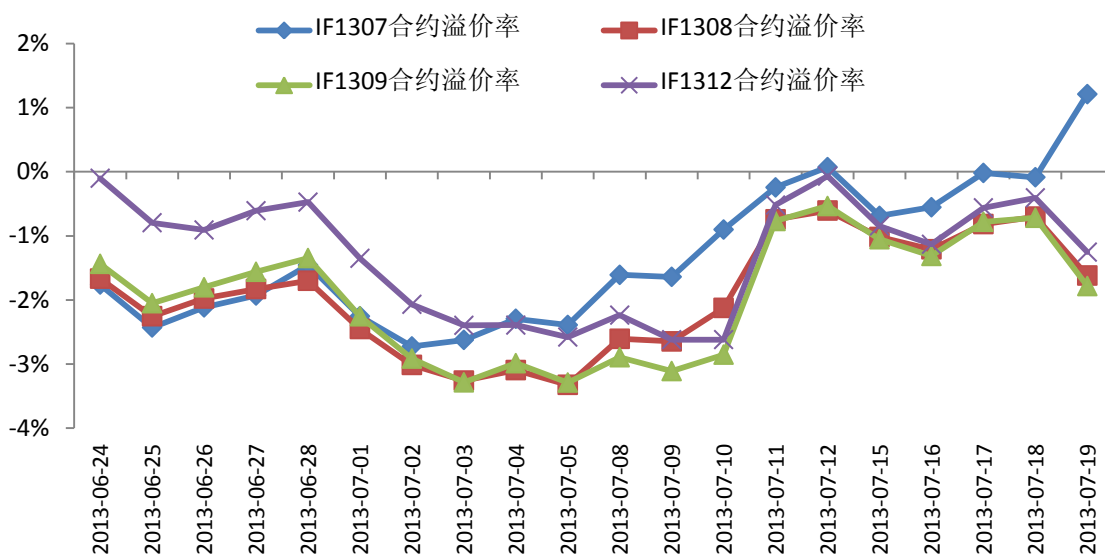
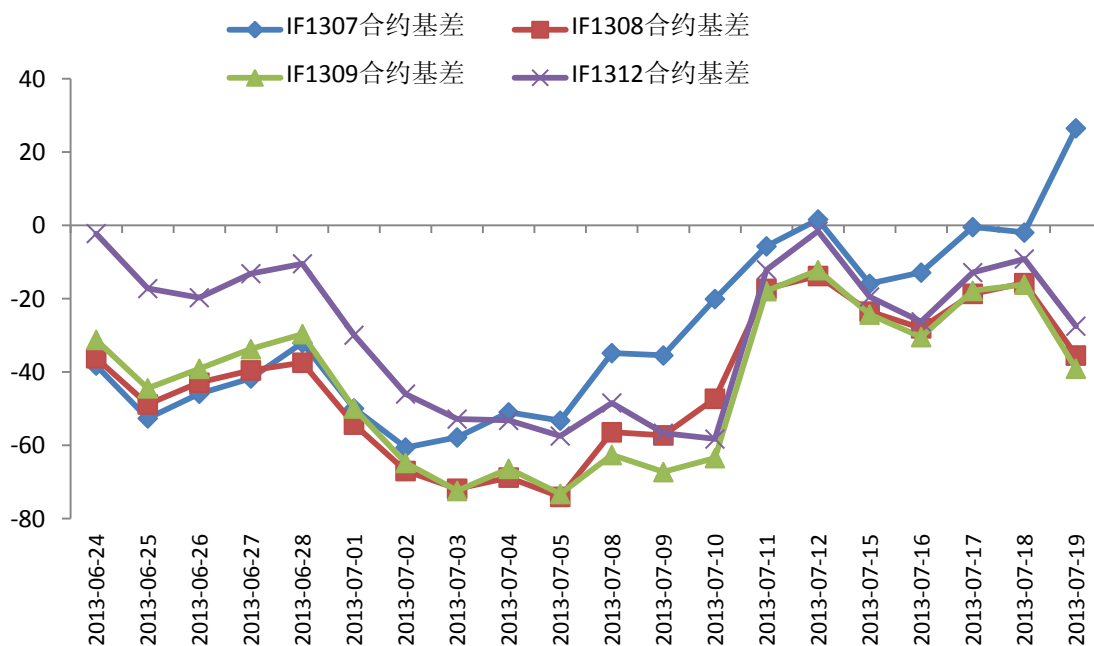


图 8: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2013.6.24-2013.7.19

图 9: 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 2013.6.24-2013.7.19

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>