



指数产品动态 (2012 年 3 月)

2012 年第 3 期 总第 26 期

■ 深圳证券信息有限公司指数事业部

➔ 业内动态

❖ 证监会进一步优化基金分类审核工作

中国证监会基金监管部 3 月 2 日向各基金管理公司、基金托管银行下发《关于进一步优化基金分类审核工作有关问题的通知》，进一步优化基金分类审核工作，基金新产品申报通道由此前的 6 条减少至 4 条，且同一基金公司可打包上报三只同类型基金。根据《通知》，基金公司通过境内基金通道上报产品，不再按照原分类方式分别排队，可以同时上报 3 只基金，3 只募集申请基金可以是同一类型，也可以是不同类型。但 QDII 基金、创新产品和特定资产管理计划仍按原方式申报。

❖ 沪深 300ETF 正式获批 设计方案披露

首批两只沪深 300ETF 产品于 3 月 23 日正式获得证监会批准，招募说明书随后也公开发布，两只产品将于 4 月 5 日起开始发售。业内人士指出，这标志着中国资本市场或将进入一个全新时代。

由产品招募说明书显示，两只沪深 300ETF 产品的设计方案存在差异。在申购赎回期限方面，华泰柏瑞采用 T+0 方式，而嘉实使用 T+2 方式；在申购赎回单位方面，华泰柏瑞产品的 1 个申购赎回单位是 90 万份，嘉实产品是 200 万份。从产品设计规则来看，一个操作灵活一个适合长期持有。

❖ QFII 和 RQFII 额度齐扩容 吸引境外长期资金

经国务院批准，证监会、央行及外管局决定分别新增 QFII、RQFII 投资额度 500 亿美元、500 亿人民币。这意味着以当前汇率计算，将有超过 3600 亿元新增资金在未来几年逐渐流入我国资本市场。

新批复的 500 亿元 RQFII 额度专门用于发行人民币 A 股 ETF 产品，投资于 A 股指数成分股并在香港交易所上市，不受 RQFII 试点办法关于股票投资比例的限制。

市场人士分析认为，QFII、RQFII 扩容对 A 股市场将构成中长期利好。更为重要的是，二者扩容将进一步提升我国资本市场对外开放水平，作为以境外长期资金



为主的机构投资者，其规模扩大还有助于改善 A 股市场投资理念，推动我国资本市场稳定发展。

❖ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

➤ 新上市

工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金于 3 月 30 日上市。

国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金于 4 月 6 日上市。

➤ 新成立

中海上证 380 指数证券投资基金于 3 月 7 日成立，首募 2.67 亿。

民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金于 3 月 8 日成立，首募 6.83 亿。

东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF) 于 3 月 9 日成立，首募 3.85 亿。

国泰中小板成长 300ETF 于 3 月 15 日成立，首募 3.45 亿。

国泰中小板成长 300ETF 联接基金于 3 月 15 日成立，首募 6.93 亿。

建信深证 100 指数增强型基金于 3 月 16 日成立，首募 17.47 亿。

嘉实中创 400ETF 于 3 月 22 日成立，首募 2.87 亿。

嘉实中创 400ETF 联接基金于 3 月 22 日成立，首募 3.78 亿。

国联安双力中小板综指分级证券投资基金于 3 月 23 日成立，首募 8.09 亿。

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金于 3 月 29 日成立，首募 12.09 亿。

华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF) 于 3 月 29 日成立，首募 5.29 亿。

融通创业板指数增强型证券投资基金于 4 月 6 日成立，首募 4.87 亿。

➤ 新发行

博时上证自然资源 ETF 及其联接基金于 3 月 5 日起发行。

国泰大宗商品 LOF 于 3 月 26 日起发行。

广发深证 100 指数基金于 3 月 27 日起发行。

浙商沪深 300 指数基金于 3 月 28 日起发行。



嘉实沪深 300ETF 于 4 月 5 日起发行。

华泰柏瑞沪深 300ETF 于 4 月 5 日起发行。

申万菱信中小板指数分级基金于 4 月 5 日起发行。

浦银安盛基本面 400 指数基金于 4 月 5 日起发行。

➤ 新获批

华宝兴业中证短融 50 指数基金于 3 月 1 日获批。

华安沪深 300 指数分级基金于 3 月 5 日获批。

招商基金中证大宗商品指数分级基金于 3 月 5 日获批。

博时标普 500 指数型基金（QDII）于 3 月 5 日获批。

农银汇理深证 100 指数增强型基金于 3 月 8 日获批。

万家中证创业成长指数分级基金于 3 月 12 日获批。

鹏华中证 A 股资源产业指数分级基金于 3 月 16 日获批。

嘉实沪深 300ETF 基金于 3 月 23 日获批。

华泰柏瑞沪深 300ETF 及其联接基金于 3 月 23 日获批。

国投瑞银中证海外中国品牌 80 指数基金（QDII）于 3 月 23 日获批。

国海富兰克林中证 100 指数增强型分级基金于 3 月 31 日获批。

➤ 新申报

工银瑞信于 3 月 9 日申报睿智深证 100 指数分级基金。

信诚基金于 3 月 16 日申报深证 300 指数分级基金。

建信基金于 3 月 23 日申报中证 500 指数增强型基金。



→ 市场要点

本地 ETF: 本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 861.46 亿元减少至本期的 803.32 亿元。从基金份额和净值来看, 本期上证 180ETF 基金份额增量和净值增量均最多, 分别为 16.35 亿份和 0.07 亿元。而从申购赎回情况看, 上证 180ETF 净申购金额最高, 为 9.01 亿元; 其次为上证 50ETF 和深 100ETF。从跟踪误差情况看, 本期最低的两只 ETF 分别为工银瑞信深证红利 ETF 和南方深成 ETF。从成交活跃情况来看, 日均成交金额仍以上证 50ETF 和深 100ETF 领先, 分别为 6.62 亿元和 5.37 亿元。

LOF: 2012 年 3 月, LOF 指数基金的场内规模为 47.00 亿份, 较上月减少 0.85 亿份; 场内资产净值为 31.76 亿元, 较上月减少 2.86 亿元。

创新型指数基金: 2012 年 3 月, 创新型指数基金的场内规模为 186.40 亿份, 较上月减少 1.68 亿份; 场内资产净值为 151.39 亿元, 较上月减少 12.96 亿元。

境外 ETF: 24 只 ETF 本期末资产规模为 599.67 亿港元, 较上期减少 6.27%。在本期市场普跌的背景下, 沪深 300 工业 ETF 和沪深 300 能源 ETF 的净值跌幅最大, 分别为 11.23% 和 10.26%。从溢价率情况看, 本期标智沪深 300ETF 日均溢价率最高, 达到 10.12%。从活跃程度看, 安硕 A50ETF 日均成交金额最大, 达到 9.49 亿港元, 沪深 300 公用事业 ETF 本期日均换手率最高, 达到 6.01%。

股指期货: 3 月份沪深 300 指数收报于 2454.9, 跌幅为 6.8%。而同期可比股指期货合约 IF1203、IF1204、IF1206、IF1209 跌幅分别为 7.44%、7.75%、7.6% 和 7.73%。从成交情况看, 五份合约累计成交量 6998856 手, 较上月下降 11.81%, 累计成交金额 54838.26 亿, 较上月减少 9.76%。



→ 统计数据

❖ A股市场指数基金

表 1: A 股市场指数基金净值增长统计

序号	代码	基金名称	成立日期	本期净值增幅	备注
1	159901	易方达深证 100ETF	2006-3-24	-7.15%	ETF
2	159902	华夏中小板 ETF	2006-6-8	-5.71%	ETF
3	159903	南方深成 ETF	2009-12-4	-6.47%	ETF
4	159905	工银瑞信深证红利 ETF	2010-11-5	-6.94%	ETF
5	159906	大成深证成长 40ETF	2010-12-21	-5.02%	ETF
6	159907	广发中小板 300ETF	2011-6-3	-6.23%	ETF
7	159908	博时深证基本面 200ETF	2011-6-10	-7.27%	ETF
8	159909	招商深证 TMT50ETF	2011-6-27	-6.64%	ETF
9	159910	嘉实深证基本面 120ETF	2011-8-1	-6.88%	ETF
10	159911	鹏华深证民营 ETF	2011-9-2	-5.96%	ETF
11	159912	汇添富深证 300ETF	2011-9-16	-7.11%	ETF
12	159913	交银深证 300 价值 ETF	2011-9-22	-6.82%	ETF
13	159915	易方达创业板 ETF	2011-9-20	-7.58%	ETF
14	159916	建信深证基本面 60ETF	2011-9-8	-6.67%	ETF
15	159917	国泰中小板 300 成长 ETF	2012-3-15	/	ETF
16	159918	嘉实中创 400 ETF	2012-3-22	/	ETF
17	510010	交银 180 治理 ETF	2009-9-25	-6.70%	ETF
18	510020	博时超大盘 ETF	2009-12-29	-6.37%	ETF
19	510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	2010-4-23	-6.57%	ETF
20	510050	华夏上证 50ETF	2004-12-30	-6.43%	ETF
21	510060	工银上证央企 50ETF	2009-8-26	-6.52%	ETF
22	510070	鹏华上证民企 50ETF	2010-8-5	-7.99%	ETF
23	510090	建信上证社会责任 ETF	2010-5-28	-6.97%	ETF
24	510110	海富通上证周期 ETF	2010-9-19	-5.80%	ETF
25	510120	海富通上证非周期 ETF	2011-4-22	-7.84%	ETF
26	510130	易方达上证中盘 ETF	2010-3-29	-7.57%	ETF
27	510150	招商上证消费 80ETF	2010-12-8	-6.71%	ETF
28	510160	南方小康产业 ETF	2010-8-27	-7.90%	ETF
29	510170	国联安上证商品 ETF	2010-11-26	-7.98%	ETF
30	510180	华安上证 180ETF	2006-4-13	-6.88%	ETF
31	510190	华安上证龙头 ETF	2010-11-18	-6.91%	ETF
32	510210	富国上证综指 ETF	2011-1-30	-7.06%	ETF
33	510220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	2011-1-26	-7.51%	ETF
34	510230	国泰上证 180 金融 ETF	2011-3-31	-5.81%	ETF



35	510260	诺安上证新兴产业 ETF	2011-4-7	-8.00%	ETF
36	510270	中银上证国企 ETF	2011-6-16	-6.10%	ETF
37	510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF	2011-8-4	-7.10%	ETF
38	510290	南方上证 380ETF	2011-9-16	-6.99%	ETF
39	510880	华泰柏瑞红利 ETF	2006-11-17	-5.66%	ETF
40	160119	南方中证 500	2009-9-25	-7.28%	LOF
41	160415	华安深证 300	2011-9-2	-6.31%	LOF
42	160615	鹏华沪深 300	2009-4-3	-6.55%	LOF
43	160616	鹏华中证 500	2010-2-5	-7.38%	LOF
44	160706	嘉实沪深 300	2005-8-29	-6.47%	LOF
45	160716	嘉实基本面 50	2009-12-30	-6.36%	LOF
46	160807	长盛沪深 300	2010-8-4	-6.37%	LOF
47	161017	富国中证 500	2011-10-12	-6.11%	LOF
48	161211	国投瑞银沪深 300 金融	2010-4-9	-4.81%	LOF
49	161213	国投瑞银中证下游	2010-12-16	-5.28%	LOF
50	161607	融通巨潮 100	2005-5-12	-6.14%	LOF
51	161811	银华沪深 300	2009-10-14	-6.56%	LOF
52	161903	万家公用事业行业投资基金	2005-8-15	-6.28%	LOF
53	161907	万家中证红利	2011-3-17	-5.96%	LOF
54	162307	海富通中证 100	2009-10-30	-5.98%	LOF
55	162711	广发中证 500	2009-11-26	-7.19%	LOF
56	163001	长信中证央企 100	2010-3-26	-6.59%	LOF
57	163407	兴全沪深 300	2010-11-2	-5.87%	LOF
58	164205	天弘深证成指	2010-8-12	-6.24%	LOF
59	165309	建信沪深 300	2009-11-5	-6.63%	LOF
60	165806	东吴深证 100 增强	2012-3-9	/	LOF
61	166007	中欧沪深 300	2010-6-24	-6.55%	LOF
62	000051	华夏沪深 300	2009-7-10	-6.48%	开放式基金
63	020011	国泰沪深 300	2007-11-11	-6.37%	开放式基金
64	020021	国泰上证 180 金融 ETF 联接	2011-3-31	-5.52%	开放式基金
65	020025	国泰中小板 300ETF 联接	2012-3-15	/	开放式基金
66	040002	华安 MSCI 中国 A 股	2002-11-8	-6.34%	开放式基金
67	040180	华安上证 180ETF 联接	2009-9-29	-6.44%	开放式基金
68	040190	华安上证龙头 ETF 联接	2010-11-18	-6.52%	开放式基金
69	050002	博时裕富沪深 300	2003-8-26	-6.49%	开放式基金
70	050013	博时超大盘 ETF 联接	2009-12-29	-6.06%	开放式基金
71	050021	博时深证基本面 200ETF 联接	2011-6-10	-6.82%	开放式基金
72	070023	嘉实深证基本面 120ETF 联接	2011-8-1	-6.48%	开放式基金
73	070030	嘉实中创 400ETF 联接	2012-3-22	/	开放式基金
74	090010	大成中证红利	2010-2-2	-5.87%	开放式基金



75	090012	大成深证成长 40ETF 联接	2010-10-21	-4.77%	开放式基金
76	090016	大成中证内地消费主题	2011-11-8	-4.77%	开放式基金
77	100032	富国天鼎中证红利	2008-11-20	-5.63%	开放式基金
78	100038	富国沪深 300	2009-12-16	-6.09%	开放式基金
79	100053	富国上证综指 ETF 联接	2011-1-30	-6.63%	开放式基金
80	110003	易方达上证 50	2004-3-22	-6.31%	开放式基金
81	110019	易方达深证 100ETF 联接	2009-12-1	-6.75%	开放式基金
82	110020	易方达沪深 300	2009-8-26	-6.46%	开放式基金
83	110021	易方达上证中盘 ETF 联接	2010-3-31	-7.13%	开放式基金
84	110026	易方达创业板 ETF 联接	2011-9-20	-7.30%	开放式基金
85	160808	长盛同瑞中证 200 分级基金	2011-12-16	-7.42%	开放式基金
86	161207	国投瑞银瑞和 300	2009-10-14	-6.56%	开放式基金
87	161217	国投瑞银中证上游	2011-7-21	-7.64%	开放式基金
88	161604	融通深证 100	2003-9-30	-6.68%	开放式基金
89	161612	融通深证成指	2010-11-15	-6.11%	开放式基金
90	161613	融通创业板指	2012-4-6	/	开放式基金
91	161812	银华深证 100	2010-5-7	-6.66%	开放式基金
92	161816	银华中证等权重 90	2011-3-17	-7.21%	开放式基金
93	161819	银华中证内地资源分级基金	2011-12-8	-8.11%	开放式基金
94	162010	长城久兆中小板 300 指数分级	2012-1-30	-6.47%	开放式基金
95	162213	泰达宏利中证财富大盘	2010-4-23	-5.70%	开放式基金
96	162216	泰达宏利中证 500	2011-12-1	-7.32%	开放式基金
97	163209	诺安中证创业成长分级基金	2012-3-29	/	开放式基金
98	162509	国联安双禧中证 100	2010-4-16	-6.09%	开放式基金
99	162510	国联安双力中小板综指分级基金	2012-3-23	/	开放式基金
100	163109	申万菱信深证成指分级	2010-10-22	-6.11%	开放式基金
101	163808	中银中证 100	2009-9-4	-6.02%	开放式基金
102	164809	工银瑞信睿智中证 500 分级	2012-1-31	/	开放式基金
103	165511	信诚中证 500 分级	2011-2-11	-6.01%	开放式基金
104	165515	信诚沪深 300 指数分级	2012-2-1	-7.41%	开放式基金
105	180003	银华道琼斯 88 精选	2004-8-11	-4.74%	开放式基金
106	200002	长城久泰沪深 300	2004-5-21	-6.48%	开放式基金
107	202015	南方沪深 300	2009-3-25	-6.52%	开放式基金
108	202017	南方深成 ETF 联接	2009-12-9	-6.15%	开放式基金
109	202021	南方小康产业 ETF 联接	2010-8-27	-7.53%	开放式基金
110	202025	南方上证 380ETF 联接	2011-9-20	-6.75%	开放式基金
111	206005	鹏华上证民企 50ETF 联接	2010-8-5	-7.67%	开放式基金
112	206010	鹏华深证民营 ETF 联接	2011-9-2	-5.60%	开放式基金
113	210007	金鹰中证技术领先	2011-6-1	-7.53%	开放式基金
114	213010	宝盈中证 100	2010-2-8	-6.48%	开放式基金
115	217016	招商深证 100	2010-6-22	-6.78%	开放式基金



116	217017	招商上证消费 80ETF 联接	2010-12-8	-6.37%	开放式基金
117	217019	招商深证 TMT50ETF 联接	2011-6-27	-6.32%	开放式基金
118	233010	大摩深证 300	2011-11-15	-7.09%	开放式基金
119	240014	华宝兴业中证 100	2009-9-29	-6.02%	开放式基金
120	240016	华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接	2010-4-23	-6.24%	开放式基金
121	240019	华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接	2011-8-9	-6.70%	开放式基金
122	257060	国联安上证商品 ETF 联接	2010-12-1	-7.63%	开放式基金
123	270010	广发沪深 300	2008-12-30	-6.52%	开放式基金
124	270026	广发中小板 300ETF 联接	2011-6-9	-5.93%	开放式基金
125	290010	泰信中证 200	2011-6-9	-7.75%	开放式基金
126	310398	申万菱信沪深 300 价值	2010-2-11	-6.08%	开放式基金
127	320010	诺安中证 100	2009-10-27	-6.11%	开放式基金
128	320014	诺安上证新兴产业 ETF 联接	2011-4-7	-7.17%	开放式基金
129	399001	中海上证 50	2010-3-25	-6.05%	开放式基金
130	399011	中海上证 380	2012-3-7	/	开放式基金
131	410008	华富中证 100	2009-12-30	-6.09%	开放式基金
132	410010	华富中小板指数增强型基金	2011-12-9	-4.61%	开放式基金
133	450008	国富沪深 300	2009-9-3	-6.12%	开放式基金
134	460220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接	2011-1-26	-7.09%	开放式基金
135	470007	汇添富上证综指	2009-7-1	-6.47%	开放式基金
136	470068	汇添富深证 300ETF 联接	2011-9-28	-6.68%	开放式基金
137	481009	工银瑞信沪深 300	2009-3-5	-6.55%	开放式基金
138	481012	工银瑞信深证红利 ETF 联接	2010-11-9	-6.58%	开放式基金
139	519027	海富通上证周期 ETF 联接	2010-9-28	-5.40%	开放式基金
140	519032	海富通上证非周期 ETF 联接	2011-4-27	-7.54%	开放式基金
141	519100	长盛中证 100	2006-11-22	-6.03%	开放式基金
142	519116	浦银安盛沪深 300	2010-12-10	-6.52%	开放式基金
143	519180	万家上证 180	2003-3-15	-6.52%	开放式基金
144	519300	大成沪深 300	2006-4-6	-6.39%	开放式基金
145	519671	银河沪深 300 价值	2009-12-28	-6.16%	开放式基金
146	519686	交银 180 治理 ETF 联接	2009-9-29	-6.29%	开放式基金
147	519706	交银深证 300 价值 ETF 联接	2011-9-28	-6.51%	开放式基金
148	530010	建信上证社会责任 ETF 联接	2010-5-28	-6.58%	开放式基金
149	530015	建信深证基本面 60ETF 联接	2011-9-8	-6.45%	开放式基金
150	530018	建信深证 100 指数增强型基金	2012-3-16	/	开放式基金
151	585001	东吴中证新兴产业	2011-2-1	-7.87%	开放式基金
152	590007	中邮上证 380	2011-11-22	-7.60%	开放式基金
153	660008	农银汇理沪深 300	2011-4-12	-6.53%	开放式基金
154	660011	农银汇理中证 500	2011-11-29	-7.52%	开放式基金
155	690008	民生加银中证内地资源	2012-3-8	/	开放式基金



156

700002

平安大华深证 300 增强型基金

2011-12-20

-7.79%

开放式基金

注：统计期为 2012.3.1—2012.3.30；“/”表示基金净值数据未够一个完整统计期或数据缺失

❖ 本地 ETF

表 2：深沪交易所上市 ETF 概况

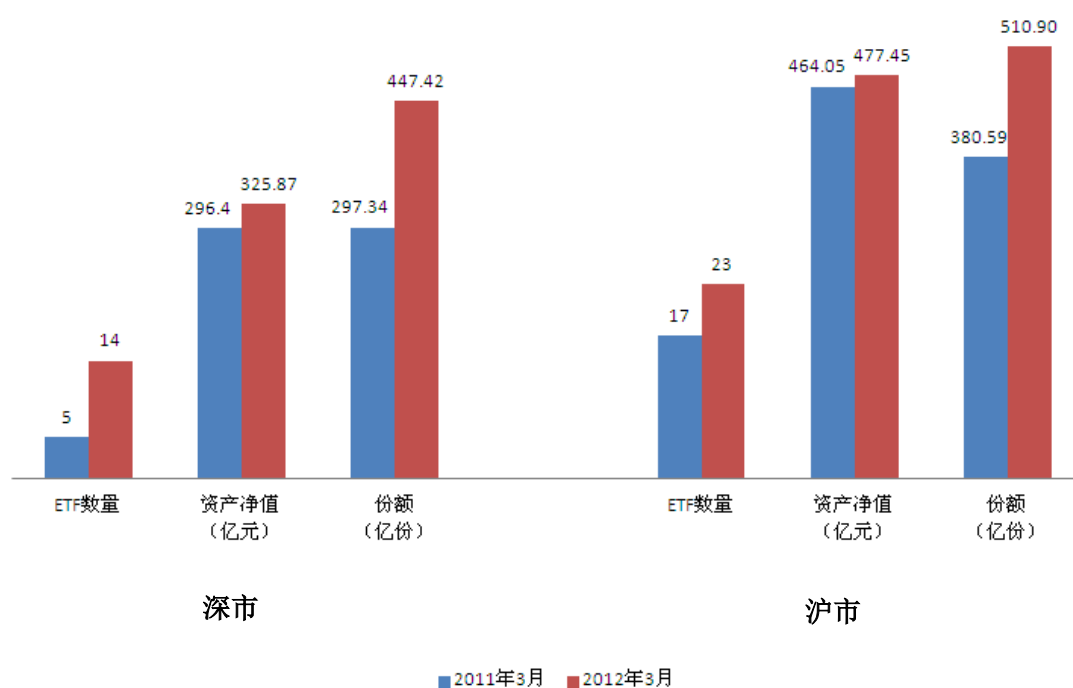
代码	简称	管理人	上市日期	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)
159901	深 100ETF	易方达	2006-04-24	330.64	197.06
159902	中小板 ETF	华夏	2006-09-05	20.99	43.30
159903	深成 ETF	南方	2010-02-02	29.02	27.71
159905	深红利 ETF	工银瑞信	2011-01-11	13.32	9.65
159906	深成长 ETF	大成	2011-02-23	20.37	15.03
159907	中小板 300ETF	广发	2011-08-10	9.55	7.77
159908	深 F200ETF	博时	2011-07-13	2.82	2.09
159909	深证 TMT50ETF	招商	2011-09-01	1.41	3.42
159910	深 F120ETF	嘉实	2011-09-27	5.11	4.30
159911	民营 ETF	鹏华	2011-10-14	1.47	3.87
159912	深 300ETF	汇添富	2011-11-24	2.98	2.59
159913	深价值	交银施罗德	2011-10-25	0.83	0.80
159915	创业板 ETF	易方达	2011-12-09	6.67	4.55
159916	深 F60	建信	2011-10-24	2.24	3.73
510010	治理 ETF	交银施罗德	2009-12-15	47.56	29.82
510020	超大 ETF	博时	2010-03-19	62.43	11.10
510030	价值 ETF	华宝兴业	2010-05-28	5.15	11.57
510050	50ETF	华夏	2005-02-23	124.07	213.27
510060	央企 ETF	工银瑞信	2009-10-27	6.26	6.82
510070	民企 ETF	鹏华	2010-10-29	3.48	3.29
510090	责任 ETF	建信	2010-08-09	4.65	3.73
510110	周期 ETF	海富通	2010-11-15	1.51	3.16
510120	非周 ETF	海富通	2011-06-08	1.86	3.21
510130	中盘 ETF	易方达	2010-06-23	4.27	9.67
510150	消费 ETF	招商	2011-02-25	5.66	12.96
510160	小康 ETF	南方	2010-11-01	9.08	3.06
510170	商品 ETF	国联安	2011-01-25	4.02	9.45
510180	180ETF	华安	2006-05-18	194.69	102.80
510190	龙头 ETF	华安	2011-01-10	3.79	7.92
510210	综指 ETF	富国	2011-03-25	1.80	4.09



510220	中小 ETF	华泰柏瑞	2011-03-28	0.47	1.19
510230	金融 ETF	国泰	2011-05-23	3.10	9.10
510260	新兴 ETF	诺安	2011-06-08	9.17	6.54
510270	国企 ETF	中银	2011-08-18	1.79	1.29
510280	成长 ETF	华宝兴业	2011-10-18	4.16	3.86
510290	380ETF	南方	2011-11-08	2.52	2.12
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	2007-01-18	9.42	17.45
合计				958.31	803.32

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.3.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

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 2012.3.30；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 3：对指数及市场覆盖情况

代码	简称	资产净值 (亿元)	对指数覆盖率	市场份额
159901	深 100ETF	197.06	1.04%	24.53%
159902	中小板 ETF	43.30	0.60%	5.39%
159903	深成 ETF	27.71	0.22%	3.45%



159905	深红利 ETF	9.65	0.12%	1.20%
159906	深成长 ETF	15.03	0.19%	1.87%
159907	中小板 300ETF	7.77	0.07%	0.97%
159908	深 F200ETF	2.09	0.01%	0.26%
159909	深证 TMT50ETF	3.42	0.08%	0.43%
159910	深 F120ETF	4.30	0.02%	0.54%
159911	民营 ETF	3.87	0.05%	0.48%
159912	深 300ETF	2.59	0.01%	0.32%
159913	深价值	0.80	0.01%	0.10%
159915	创业板 ETF	4.55	0.31%	0.57%
159916	深 F60	3.73	0.03%	0.46%
深市合计		325.87		40.57%
510010	治理 ETF	29.82	0.04%	3.71%
510020	超大 ETF	11.10	0.02%	1.38%
510030	价值 ETF	11.57	0.02%	1.44%
510050	50ETF	213.27	0.30%	26.55%
510060	央企 ETF	6.82	0.01%	0.85%
510070	民企 ETF	3.29	0.05%	0.41%
510090	责任 ETF	3.73	0.01%	0.46%
510110	周期 ETF	3.16	0.00%	0.39%
510120	非周 ETF	3.21	0.02%	0.40%
510130	中盘 ETF	9.67	0.04%	1.20%
510150	消费 ETF	12.96	0.11%	1.61%
510160	小康 ETF	3.06	0.01%	0.38%
510170	商品 ETF	9.45	0.03%	1.18%
510180	180ETF	102.80	0.11%	12.80%
510190	龙头 ETF	7.92	0.01%	0.99%
510210	综指 ETF	4.09	0.00%	0.51%
510220	中小 ETF	1.19	0.00%	0.15%
510230	金融 ETF	9.10	0.02%	1.13%
510260	新兴 ETF	6.54	0.07%	0.81%
510270	国企 ETF	1.29	0.00%	0.16%
510280	成长 ETF	3.86	0.02%	0.48%
510290	380ETF	2.12	0.01%	0.26%
510880	红利 ETF	17.45	0.03%	2.17%
沪市合计		477.45		59.43%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.3.30，中小板 ETF 为场内场外总资产。

表 4：基金份额及资产净值变化情况

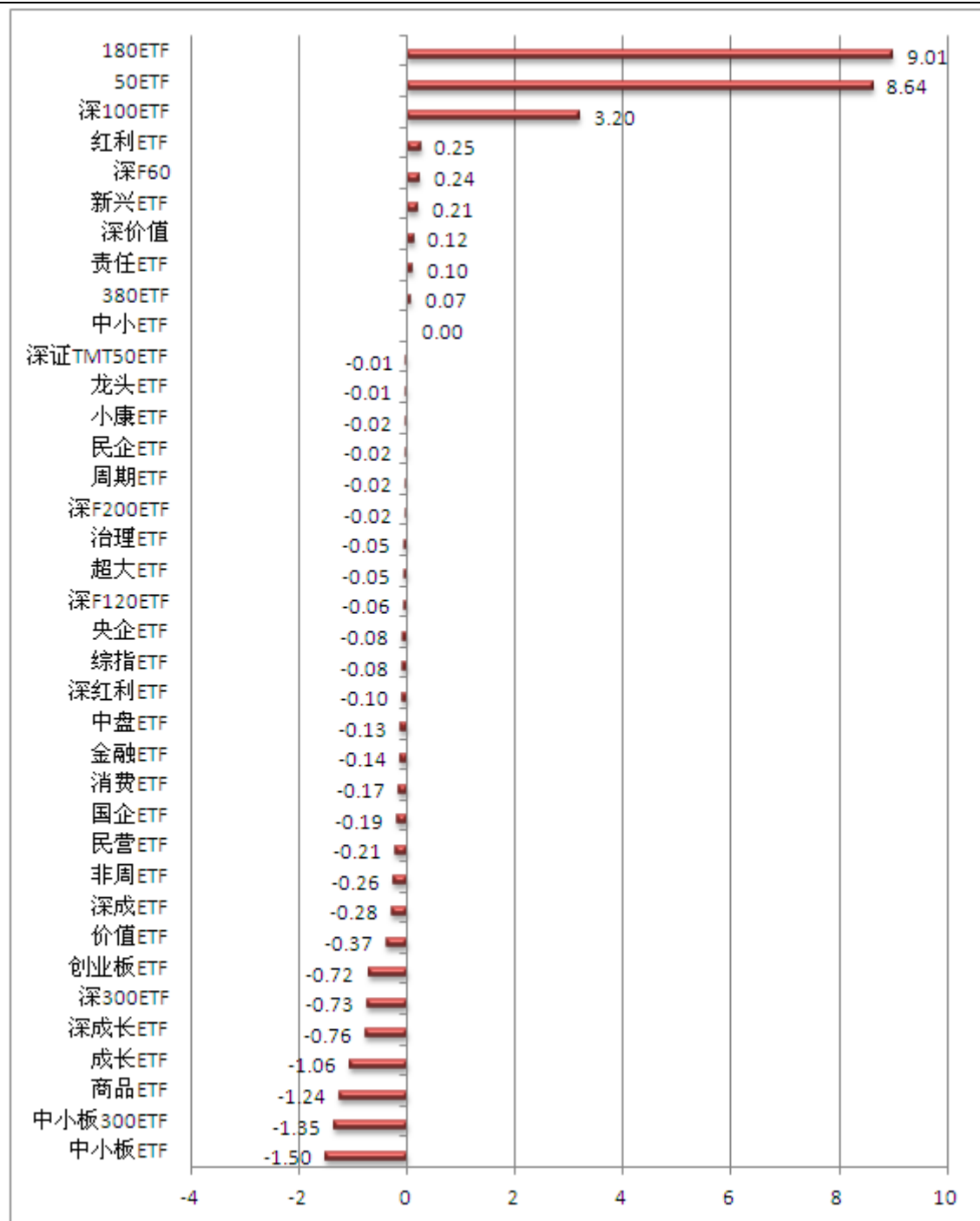


代码	简称	基金份额增量 (亿份)	增幅	资产净值增量 (亿元)	增幅
159901	深 100ETF	5.20	1.60%	-16.79	-7.85%
159902	中小板 ETF	0.00	0.00%	-3.61	-7.70%
159903	深成 ETF	-0.26	-0.87%	-2.90	-9.48%
159905	深红利 ETF	-0.13	-0.93%	-1.10	-10.25%
159906	深成长 ETF	-1.01	-4.72%	-1.88	-11.11%
159907	中小板 300ETF	-1.54	-13.89%	-2.08	-21.15%
159908	深 F200ETF	-0.03	-1.05%	-0.25	-10.61%
159909	深证 TMT50ETF	0.00	-0.18%	-0.37	-9.79%
159910	深 F120ETF	-0.06	-1.16%	-0.49	-10.27%
159911	民营 ETF	-0.08	-4.85%	-0.58	-13.11%
159912	深 300ETF	-0.77	-20.52%	-1.00	-27.93%
159913	深价值	0.12	16.82%	0.04	5.76%
159915	创业板 ETF	-0.96	-12.57%	-1.25	-21.57%
159916	深 F60	0.14	6.41%	-0.13	-3.39%
510010	治理 ETF	-0.08	-0.17%	-2.77	-8.49%
510020	超大 ETF	-0.28	-0.45%	-0.89	-7.42%
510030	价值 ETF	-0.16	-3.02%	-1.40	-10.79%
510050	50ETF	4.95	4.16%	-8.05	-3.64%
510060	央企 ETF	-0.07	-1.11%	-0.65	-8.65%
510070	民企 ETF	-0.02	-0.43%	-0.37	-10.13%
510090	责任 ETF	0.12	2.65%	-0.25	-6.25%
510110	周期 ETF	-0.01	-0.59%	-0.25	-7.40%
510120	非周 ETF	-0.14	-7.06%	-0.60	-15.69%
510130	中盘 ETF	-0.05	-1.20%	-1.15	-10.63%
510150	消费 ETF	-0.07	-1.26%	-1.35	-9.44%
510160	小康 ETF	-0.04	-0.44%	-0.34	-9.88%
510170	商品 ETF	-0.48	-10.67%	-2.18	-18.75%
510180	180ETF	16.35	9.17%	0.07	0.07%
510190	龙头 ETF	0.00	-0.13%	-0.76	-8.78%
510210	综指 ETF	-0.03	-1.91%	-0.46	-10.01%
510220	中小 ETF	0.00	0.00%	-0.12	-9.51%
510230	金融 ETF	-0.04	-1.43%	-0.83	-8.34%
510260	新兴 ETF	0.27	2.98%	-0.51	-7.18%
510270	国企 ETF	-0.25	-12.26%	-0.30	-18.68%
510280	成长 ETF	-1.07	-20.47%	-1.43	-27.06%
510290	380ETF	0.08	3.27%	-0.14	-6.09%
510880	红利 ETF	0.14	1.51%	-1.03	-5.58%
合计		19.73		-58.13	



注：统计期为2012.3.1-2012.3.30。

图 2：净申购/赎回资金量（亿元）



注：根据ETF每周净申购/赎回份额与其平均净值计算；中小板ETF以场内份额计算。

表 5：绝对收益与超额收益

代码	简称	阶段收益	阶段超额收益	累计收益	累计超额收益
159901	深 100ETF	-7.15%	-0.14%	5.02%	-0.38%

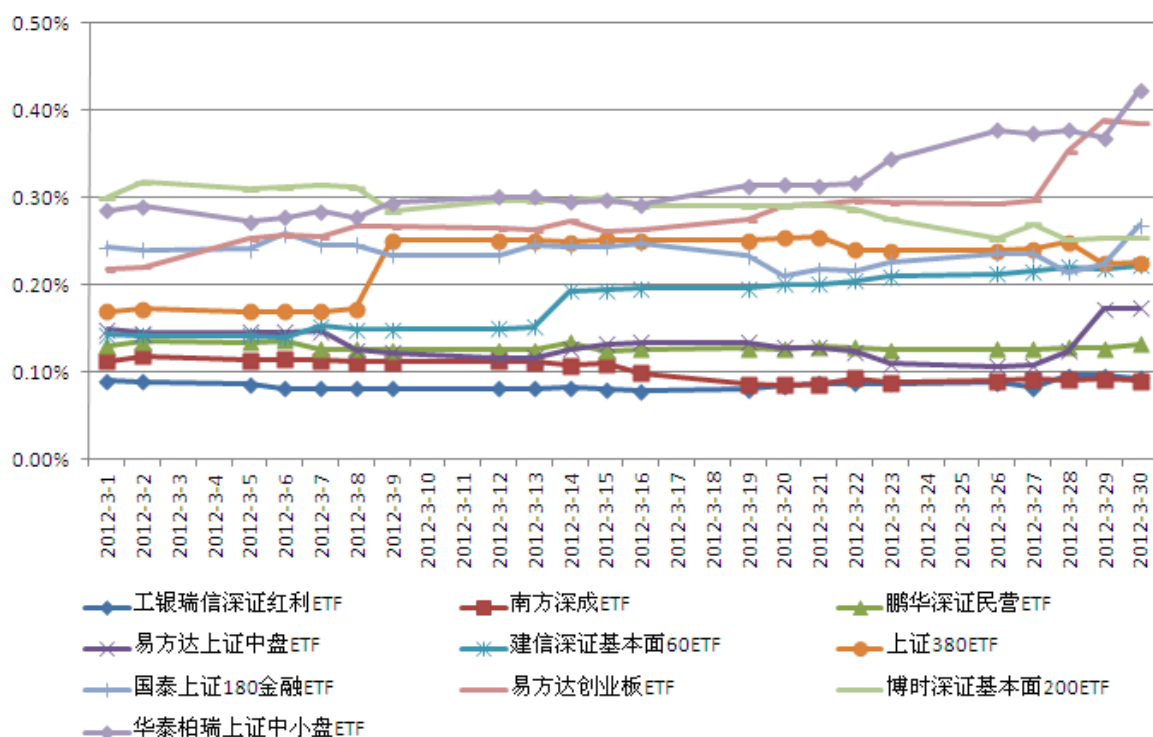


159902	中小板 ETF	-5.71%	0.20%	2.43%	-0.30%
159903	深成 ETF	-6.47%	-0.06%	5.34%	-0.17%
159905	深红利 ETF*	-6.94%	-0.04%	4.85%	-0.19%
159906	深成长 40ETF	-5.02%	-0.02%	1.93%	0.11%
159907	中小 300ETF	-6.23%	0.02%	2.10%	-0.18%
159908	深 F200	-7.27%	-0.11%	4.13%	-0.43%
159909	TMT50ETF	-6.64%	-0.03%	4.20%	-0.24%
159910	深 F120ETF	-6.88%	0.14%	4.25%	-0.39%
159911	民营 ETF	-5.96%	-0.11%	3.48%	-0.20%
159912	深 300ETF	-7.11%	0.04%	4.07%	-0.26%
159913	深价值	-6.82%	-0.01%	5.05%	-0.30%
159915	创业板 ETF	-7.58%	-0.59%	-6.87%	0.11%
159916	深 F60	-6.67%	-0.02%	4.76%	-0.25%
510010	180 治理 ETF	-6.70%	-0.07%	4.51%	-0.19%
510020	超大 ETF	-6.37%	0.14%	7.17%	-0.11%
510030	180 价值 ETF	-6.57%	-0.17%	3.34%	-0.11%
510050	50ETF	-6.43%	0.00%	5.33%	-0.11%
510060	央企 ETF	-6.52%	0.23%	2.68%	0.15%
510070	民企 ETF	-7.99%	0.01%	2.49%	-0.02%
510090	责任 ETF	-6.97%	0.05%	4.30%	-0.20%
510110	周期 ETF	-5.80%	0.11%	5.64%	-1.18%
510120	非周期 ETF	-7.84%	0.48%	1.00%	-0.21%
510130	中盘 ETF	-7.57%	0.05%	4.19%	-0.15%
510150	消费 ETF	-6.71%	-2.23%	1.96%	-1.38%
510160	小康 ETF	-7.90%	0.06%	3.16%	-0.27%
510170	商品 ETF	-7.98%	-0.07%	11.42%	-0.25%
510180	180ETF	-6.88%	-0.03%	4.76%	-0.29%
510190	龙头 ETF	-6.91%	-0.07%	3.52%	-0.37%
510210	上证综指 ETF	-7.06%	-0.23%	2.47%	-0.41%
510220	中小盘 ETF	-7.51%	-0.03%	3.64%	-0.30%
510230	180 金融 ETF	-5.81%	0.01%	5.27%	-0.15%
510260	新兴产业 ETF	-8.00%	0.19%	4.70%	-0.04%
510270	国企 ETF	-6.10%	0.10%	5.55%	-0.06%
510280	成长 ETF	-7.10%	-0.07%	5.33%	-0.26%
510290	380ETF	-6.99%	-0.04%	3.33%	-0.12%
510880	红利 ETF	-5.66%	0.01%	3.93%	-0.28%

注：阶段=统计期；累计=年初至今。统计期为 2012.3.1-2012.3.30。阶段统计期内上市的 ETF，阶段收益从上市日开始计算；*表示于年内上市的 ETF，累计收益从上市日开始计算



图 3：3 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。

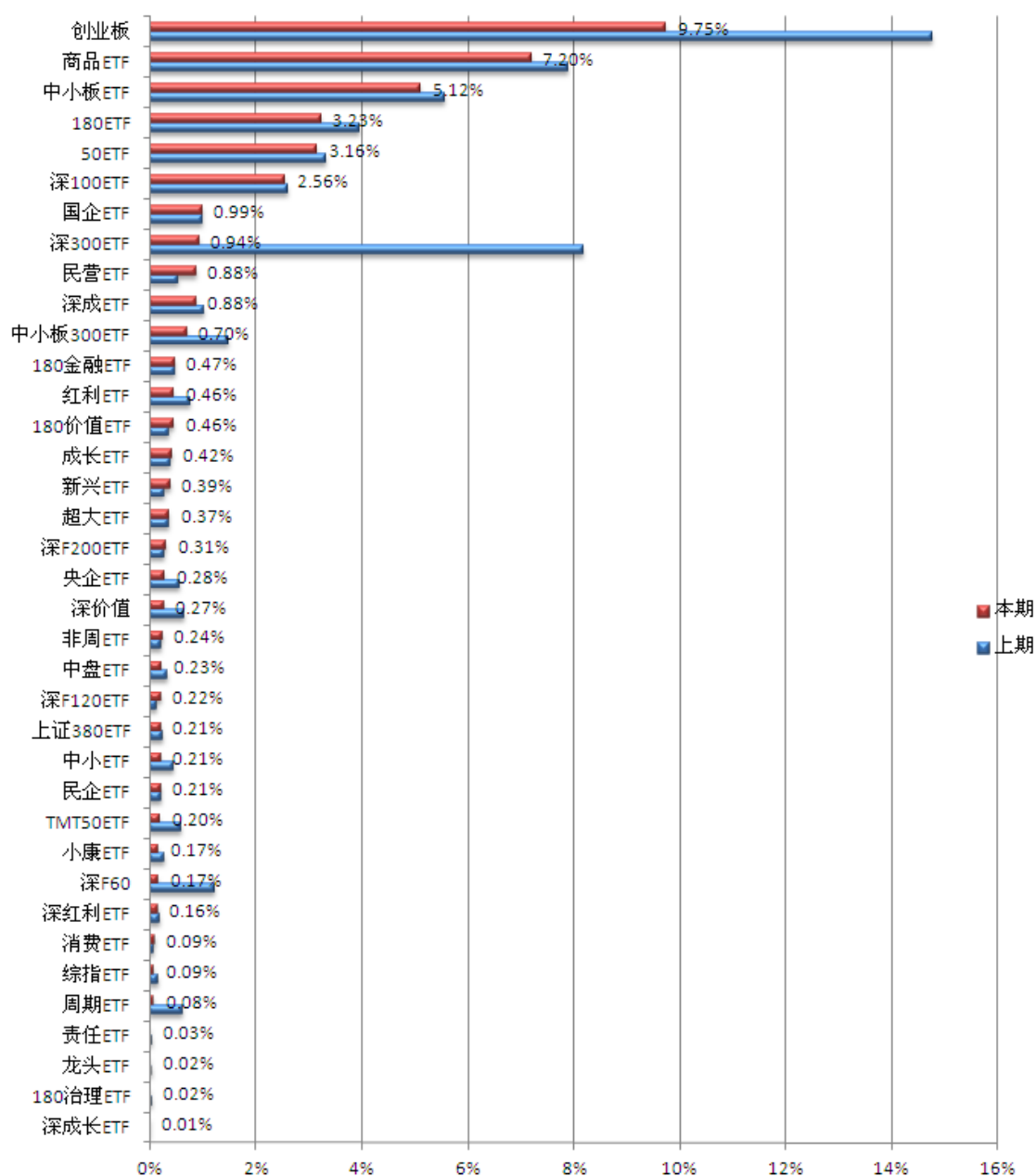


图 4：日均成交金额（亿元）





图5：日均换手率



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。



❖ LOF

表 6: 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	规模（亿份）			资产（亿元）		
		3 月末	月度增量	增幅	3 月末	月度增量	增幅
160119	南方 500	1.49	-0.04	-2.52%	1.26	-0.13	-9.61%
160125	南方中国	0.03	0.00	-0.74%	0.03	0.00	-8.07%
160415	华安 S300	0.39	-0.21	-35.10%	0.34	-0.22	-39.19%
160615	鹏华 300	0.42	0.00	-1.12%	0.37	-0.03	-7.59%
160616	鹏华 500	0.74	-0.02	-3.05%	0.53	-0.06	-10.21%
160706	嘉实 300	35.33	-0.25	-0.69%	22.84	-1.75	-7.12%
160716	嘉实 50	1.08	-0.23	-17.62%	0.70	-0.21	-22.86%
160717	恒生 H 股	0.55	-0.01	-1.50%	0.40	-0.05	-11.23%
160807	长盛 300	0.13	0.00	-1.15%	0.11	-0.01	-7.45%
161017	富国 500	0.27	0.00	0.01%	0.25	-0.02	-6.11%
161211	国投金融	2.00	-0.01	-0.55%	1.50	-0.08	-5.34%
161213	国投消费	0.25	-0.03	-10.49%	0.19	-0.03	-15.21%
161607	融通巨潮	0.67	0.00	-0.64%	0.50	-0.04	-6.73%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-3.68%	0.01	0.00	-9.97%
161811	银华 300	0.17	0.00	-1.22%	0.13	-0.01	-7.70%
161903	万家公用	0.36	0.00	-1.05%	0.21	-0.02	-7.27%
161907	万家红利	0.57	-0.01	-1.26%	0.48	-0.04	-7.14%
162307	海富 100	0.21	0.00	-2.24%	0.15	-0.01	-8.08%
162711	广发 500	1.65	-0.02	-1.26%	1.26	-0.11	-8.36%
163001	长信 100	0.13	0.00	-0.26%	0.10	-0.01	-6.83%
163407	兴全 300	0.30	-0.01	-1.78%	0.24	-0.02	-7.55%
164205	天弘深成	0.01	0.00	-1.45%	0.01	0.00	-7.60%
165309	建信 300	0.20	0.00	2.09%	0.14	-0.01	-4.68%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-1.01%	0.04	0.00	-7.50%
合计		47.00	-0.85		31.76	-2.86	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.3.1-2012.3.30。

❖ 创新型指数基金

表 7: 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	基金份额（亿份）			资产净值（亿元）		
				3 月 末	月度 增量	增幅	3 月 末	月度 增量	增幅
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.45	-0.08	-3.34%	2.27	-0.24	-9.67%



150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.45	-0.08	-3.34%	2.27	-0.24	-9.67%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	13.35	-0.95	-6.66%	14.86	-0.99	-6.24%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	20.02	-1.43	-6.66%	15.02	-3.22	-17.64%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	33.18	0.83	2.57%	33.71	1.04	3.18%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	33.18	0.83	2.57%	22.10	-3.52	-13.75%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	11.06	-0.50	-4.29%	11.24	-0.45	-3.82%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	11.06	-0.50	-4.29%	3.38	-1.20	-26.23%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	2.72	0.86	46.18%	2.74	0.88	47.06%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	4.08	1.29	46.18%	2.14	0.45	26.61%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	19.80	0.05	0.25%	20.14	0.17	0.85%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	19.80	0.05	0.25%	8.38	-2.31	-21.61%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.94	-0.33	-14.71%	1.98	-0.33	-14.21%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	2.91	-0.50	-14.71%	2.87	-1.01	-25.99%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.82	0.01	1.30%	0.83	0.01	1.80%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.82	0.01	1.30%	0.75	-0.12	-13.71%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.20	-0.02	-10.64%	0.21	-0.02	-10.11%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.30	-0.04	-10.64%	0.30	-0.08	-21.37%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.08	0.00	0.00%	0.08	0.00	0.00%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.12	0.00	0.00%	0.11	0.00	0.00%
150057	久兆稳健	长城	2012-2-21	0.18	-0.05	-22.44%	0.19	-0.05	-22.06%
150058	久兆积极	长城	2012-2-21	0.28	-0.08	-22.44%	0.25	-0.11	-31.17%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.94	-0.33	-14.71%	1.98	-0.33	-14.21%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	2.91	-0.50	-14.71%	2.87	-1.01	-25.99%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.30	-0.08	-21.06%	0.30	-0.08	-20.59%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.44	-0.12	-21.06%	0.46	-0.20	-30.51%
合计				186.40	-1.68		151.39	-12.96	

注：数据来源：深交所，统计期为2012.3.1-2012.3.30。



❖ 跨境 ETF

表 8：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	0.62
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	3.78
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	463.16
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	66.29
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	7.38
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	3.58
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.67
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	10.42
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	2.61
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.27
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.62
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.42
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.90
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.61
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	3.59
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	26.14
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	2.54
3051	中金深证 100ETF	深证 100	CICC	2010-1-29	0.09
3052	沪深 300 公用事业 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.12
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.83
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.32
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.42
3063	沪深 300 运输 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.15
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	0.14

注：基金资产单位为“亿港元”；截止日期为2012.3.30。

表 9：跟踪 A 股的主要跨境 ETF 净值变化

代码	名称	收盘价	增幅	单位净值	增幅
2816	沪深 300 地产 ETF	9.7	-3.77%	8.97	-5.80%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	24.95	-10.09%	23.61	-6.92%
2823	安硕 A50ETF	10.78	-9.11%	9.93	-6.59%
2827	标智沪深 300ETF	29.15	-9.47%	26.64	-6.66%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	10.44	-7.61%	9.97	-5.22%

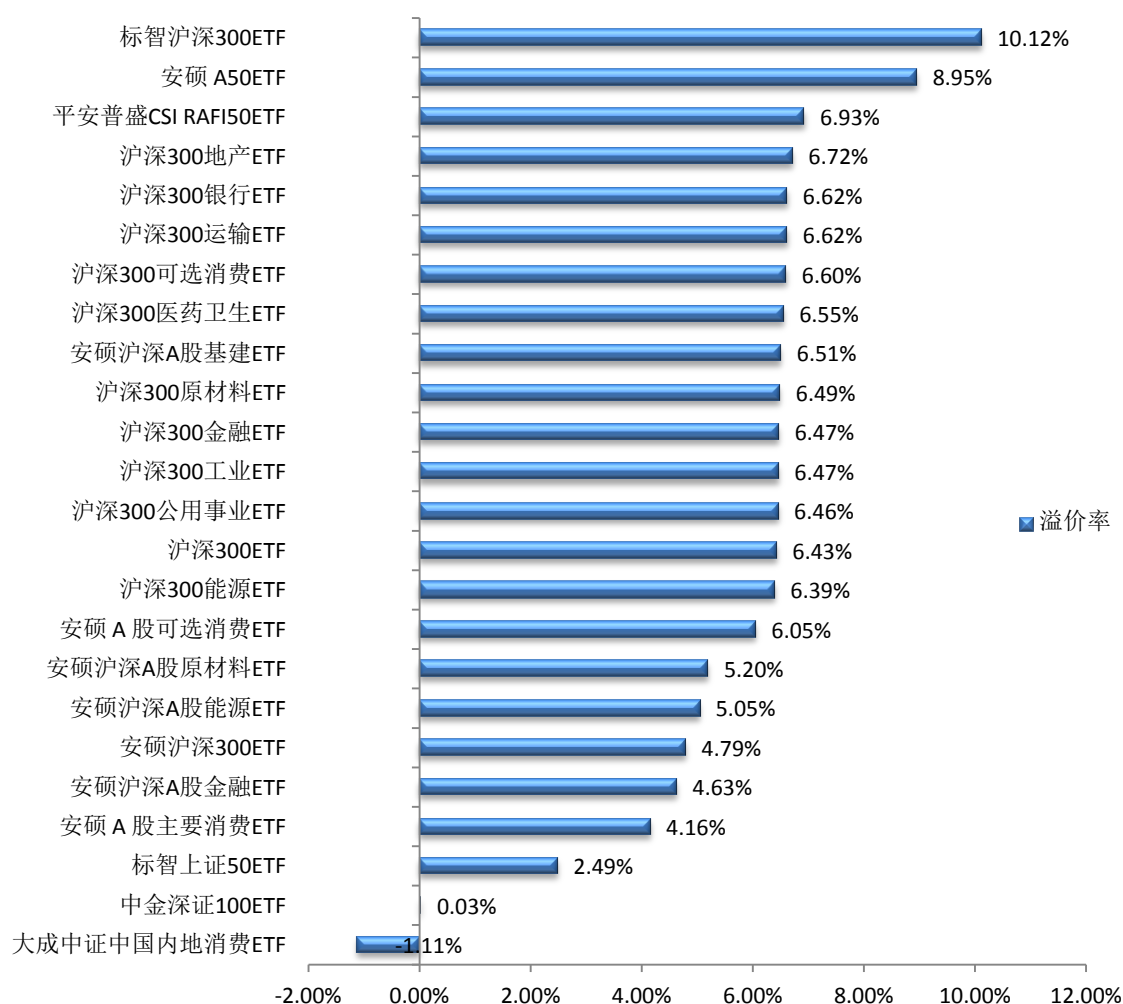


2841	安硕 A 股主要消费 ETF	20.5	-4.87%	19.37	-5.43%
2844	沪深 300 金融 ETF	8.94	-7.84%	8.32	-7.92%
2846	安硕沪深 300ETF	23.15	-10.96%	22.66	-8.77%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	14.84	-8.28%	14.09	-5.06%
3005	沪深 300 工业 ETF	4.93	-11.65%	4.62	-11.23%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	9.94	-11.88%	9.53	-7.06%
3017	沪深 300 能源 ETF	7.94	-11.48%	7.46	-10.26%
3024	标智上证 50ETF	16.18	-7.86%	15.86	-6.69%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	7.88	-7.62%	7.37	-7.02%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	11.32	-12.79%	10.88	-8.89%
3049	沪深 300ETF	6.4	-9.86%	6.01	-8.46%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	11.66	-11.26%	11.06	-8.87%
3051	中金深证 100ETF	24.6	-9.39%	24.56	-9.37%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	3.45	-9.21%	3.25	-7.80%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	10.5	-10.41%	9.94	-8.36%
3061	沪深 300 银行 ETF	9.07	-8.57%	8.46	-7.88%
3062	沪深 300 原材料 ETF	5.99	-11.52%	5.69	-8.62%
3063	沪深 300 运输 ETF	2.85	-8.95%	2.64	-9.90%
3071	大成中证中国内地消 ETF	9.4	-5.05%	9.38	-5.35%

注：收盘价、单位净值的单位为“港元”；统计期为 2012.3.1-2012.3.30；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。



图 6：主要 A 股跨境 ETF 溢价率排名



注：统计期为2012.3.1-2012.3.30

表 10：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	273.14	-0.54%	3.92%	-2.50%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	2.09	2.11%	0.00%	3.70%
2823	安硕 A50ETF	94945.64	-31.78%	1.81%	-29.82%
2827	标智沪深 300ETF	3335.45	-42.32%	0.45%	-41.79%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	12.23	-50.90%	0.02%	-49.32%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	12.64	-74.78%	0.03%	-76.52%
2844	沪深 300 金融 ETF	201.36	-25.53%	2.68%	-25.06%
2846	安硕沪深 300ETF	609.32	84.40%	0.54%	88.62%



3001	安硕 A 股可选消费 ETF	11.41	-30.15%	0.04%	-31.00%
3005	沪深 300 工业 ETF	180.27	-25.27%	5.29%	-25.93%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	2.77	-70.74%	0.02%	-69.39%
3017	沪深 300 能源 ETF	231.68	-13.51%	4.24%	-12.14%
3024	标智上证 50ETF	3.82	-35.34%	0.02%	-34.37%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	310.14	44.38%	1.72%	37.94%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	13.00	279.17%	0.03%	266.71%
3049	沪深 300ETF	6269.09	48.83%	2.04%	48.29%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	8.59	-77.92%	0.03%	-77.59%
3051	中金深证 100ETF	0.05	-76.14%	0.01%	-61.82%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	86.64	-5.78%	6.01%	-4.95%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	158.41	49.31%	1.64%	46.61%
3061	沪深 300 银行 ETF	450.95	73.51%	2.99%	78.10%
3062	沪深 300 原材料 ETF	165.36	-23.54%	3.24%	-24.32%
3063	沪深 300 运输 ETF	97.59	-36.31%	4.60%	-35.36%
3071	大成中证中国内地消 ETF	1.45	-12.73%	0.10%	-20.66%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为2012.3.1-2012.3.30；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。



❖ 股指期货

表 11: 沪深 300 股指期货 3 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
IF1203	2639.00	2702.80	2579.20	2598.20	-52.60	0	-47967	2597.36	2966009	23600.20
IF1204	2652.80	2715.40	2444.00	2453.60	-206.20	51249	46682	2457.40	3902042	30215.07
IF1206	2670.00	2735.00	2468.00	2477.00	-203.80	7451	1524	2480.40	73742	580.96
IF1209	2708.00	2765.80	2497.40	2506.00	-210.00	2057	985	2510.60	14861	118.63
IF1205	2637.00	2644.60	2456.60	2464.40	-158.20	3380	3380	2468.60	42202	323.41

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 2012.3.30

图 7: 沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

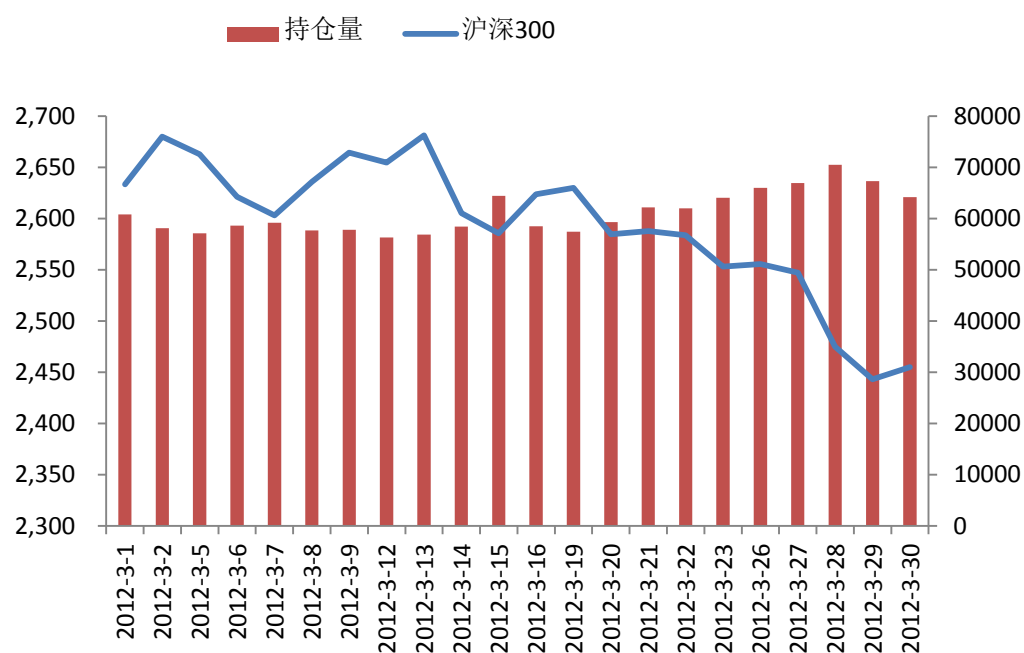
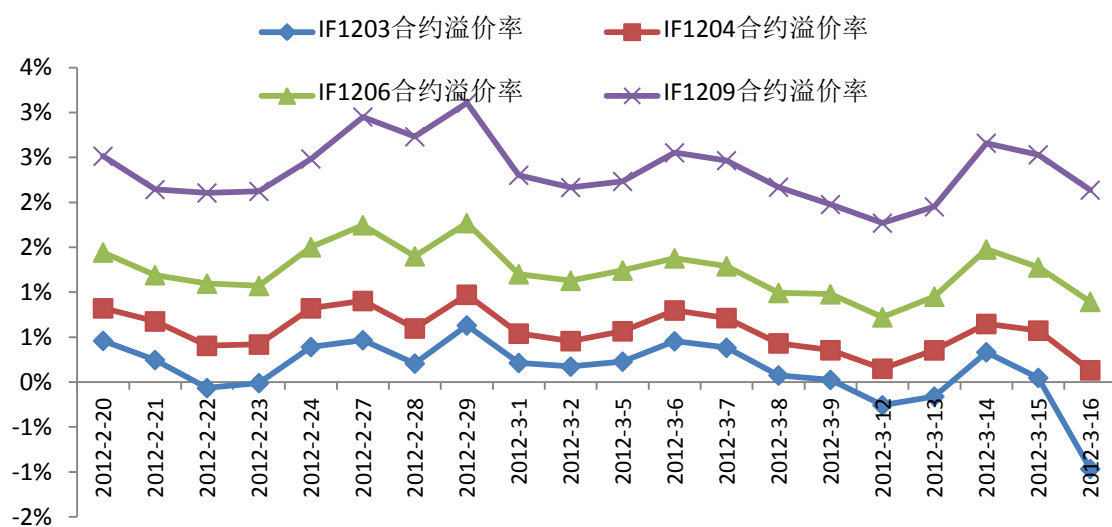


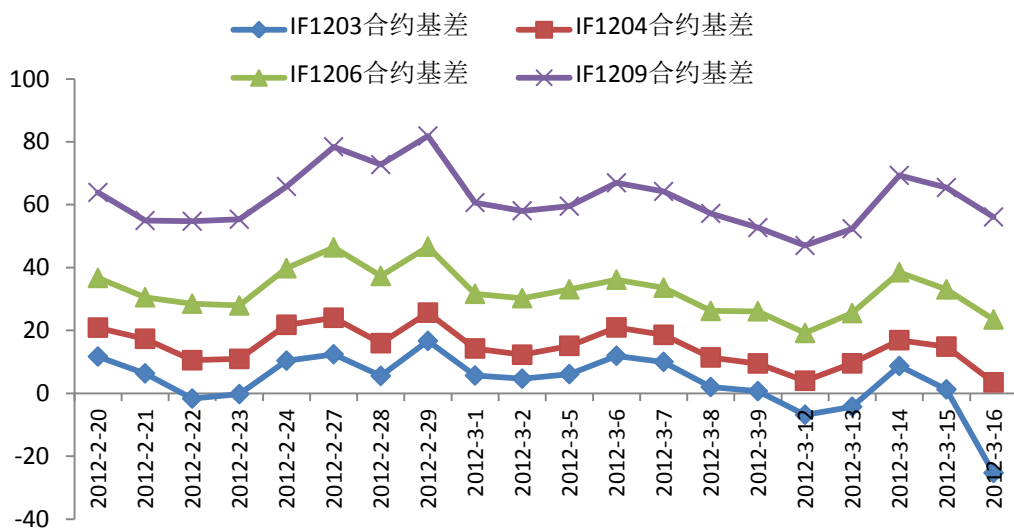


图 8：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注：合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1；统计期为 2012.2.20-2012.3.16

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 2012.2.20-2012.3.16



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：0755-83241251、83243717

传真：0755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://index.cninfo.com.cn>