



指数产品动态 (2012 年 5 月)

2012 年第 5 期 总第 28 期

■ 深圳证券交易所有限公司指数事业部

→ 业内动态

❖ 两只沪深 300ETF 挂牌上市 首日成交超 40 亿

华泰柏瑞沪深 300ETF 和嘉实沪深 300ETF 于 5 月 28 日分别在上海证券交易所和深圳证券交易所挂牌上市，打开申购赎回。

上市首日，两只沪深 300ETF 双双低开高走，最后以红盘报收。华泰柏瑞沪深 300ETF 成交 32.86 亿元，嘉实沪深 300ETF 成交 10.38 亿元。成交额超过了其他所有 ETF 基金之和的两倍，占当天整个 ETF 基金成交额的 70% 以上。

❖ 交易所：符合条件 ETF 可作融资融券标的

2012 年 5 月中下旬，沪深两市交易所分别颁布了《关于交易所交易基金作为融资融券标的证券相关事项的通知》。根据通知，沪深两市交易所都明确：符合条件的交易所交易基金(ETF)在上交所上市交易 5 个交易日后可作为融资融券标的证券。

同时，两市的具体条件也有差异。沪市交易所规定为：日均资产规模不低于 100 亿元，基金持有户数不少于 10000 户，跟踪指数的成份股不少于 30 只，总市值不低于 5000 亿元。深市交易所规定为：日平均资产规模不低于 20 亿元人民币；基金持有户数不少于 4000 户。

❖ 证监会：拟降低基金募集份额及金额门槛

证监会 5 月 4 日公布《关于修改第六条及第十二条的决定（征求意见稿）》，向社会公开征求意见。《决定》放松了对基金产品申报数量的限制，对基金募集金额、募集份额也都有所下调。

证监会有关部门负责人表示，放松对基金产品申报数量的限制，一方面为现行的多通道审核制度提供依据，另一方面为将来实行基金产品注册制度预留空间；对基金募集金额、募集份额等进行调整，是为将来推出发行式基金预留空间，而发行式基金有单独的审批通道。



❖ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

➤ 新上市

中创 400 交易型开放式指数基金于 5 月 11 日上市。

上证自然资源 ETF 于 5 月 11 日上市。

申万菱信中小板指数分级基金于 5 月 28 日上市。

嘉实沪深 300 交易型开放式指数基金于 5 月 28 日上市。

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数基金于 5 月 28 日上市。

长盛同庆中证 800 指数分级基金于 5 月 31 日上市。

➤ 新成立

华泰柏瑞沪深 300ETF 于 5 月 4 日成立，首募 329.69 亿。

浙商沪深 300 指数分级基金于 5 月 7 日成立，首募 3.54 亿。

广发深证 100 指数分级基金于 5 月 7 日成立，首募 5.67 亿。

嘉实沪深 300ETF 于 5 月 7 日成立，首募 193.33 亿。

申万菱信中小板指数分级基金于 5 月 8 日成立，首募 7.84 亿。

长盛同庆中证 800 指数分级基金于 5 月 12 日成立，首募 146.86 亿。

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金于 5 月 14 日成立，首募 4.13 亿。

中银沪深 300 等权重指数基金(LOF) 于 5 月 17 日成立，首募 14.90 亿。

海富通中证内地低碳经济主题指数基金于 5 月 25 日成立，首募 7.56 亿。

华泰 300ETF 联接基金于 5 月 29 日成立，首募 3.67 亿。

易方达标普全球高端消费品指数基金（QDII）于 6 月 4 日成立，首募 3.84 亿。

➤ 新发行

景顺长城上证 180 等权重 ETF 及联接基金于 5 月 2 日起发行。

易方达标普全球高端消费品指数基金于 5 月 2 日起发行。

汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数基金于 5 月 8 日起发行。

长安沪深 300 非周期行业指数基金于 5 月 14 日起发行。

博时标普 500 指数型证券投资基金于 5 月 15 日起发行。

招商中证大宗商品指数分级基金于 5 月 21 日起发行。



华安沪深 300 指数分级基金于 6 月 1 日起发行。

➤ 新获批

交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数基金于 5 月 7 日获批。

易方达中小板指数分级基金于 5 月 21 日获批。

➤ 新申报

易方达于 5 月 3 日申报中债新综合债券指数基金（LOF）。

银河基金于 5 月 10 日申报沪深 300 成长增强指数分级基金。

汇添富于 6 月 1 日申报沪深 300 指数增强型指数基金。



→ 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 836.57 亿元增加至本期的 1278.80 亿元。从基金份额和净值来看, 本期深成 ETF 基金份额增量最多, 增加了 2.90 亿份, 深 100ETF 净值增量均最多, 增加了 4.94 亿元。而从申购赎回情况看, 中小板 ETF 净申购金额最高, 为 5.80 亿元; 其次为深成 ETF 和深 100ETF。从跟踪误差情况看, 本期最低的两只 ETF 分别为上证 380ETF 和工银瑞信深证红利 ETF。从成交活跃情况来看, 日均成交金额以两只 300ETF 为领先, 分别为 15.83 亿元和 7.93 亿元。

LOF: 本期 LOF 指数基金的场内规模为 46.60 亿份, 较上月减少 0.61 亿份; 场内资产净值为 33.53 亿元, 较上月减少 0.52 亿元。

创新型指数基金: 本期有两只创新型分级基金新上市, 分别为申万菱信中小板指数分级基金和长盛同庆中证 800 指数分级基金。创新型指数基金的场内规模为 269.88 亿份, 较上月增加 23.12 亿份; 场内资产净值为 236.11 亿元, 较上月增加 18.29 亿元。

境外 ETF: 24 只 ETF 本期末资产规模为 601.76 亿港币, 较上期减少 6.07%。在本期市场普跌的背景下, 仅有沪深 300 地产 ETF 和沪深 300 医药卫生 ETF 净值增幅较大, 分别为 6.02% 和 3.57%。从溢价率情况看, 本期香港市场 A 股 ETF 整体日均溢价率下降, 其中标智沪深 300ETF 日均溢价率最高, 为 3.83%。从活跃程度看, 安硕 A50ETF 日均成交金额最大, 达到 8.51 亿港币, 沪深 300 公用事业 ETF 本期日均换手率最高, 达到 3.74%。

股指期货: 5 月份沪深 300 指数收报于 2632.04, 较上月涨幅为 0.22%。而同期可比股指期货合约 IF1206、IF1209、IF1212 涨幅分别为 -0.48%、-1.4% 和 -1.75%。从成交情况看, 五份合约累计成交量 7207413 手, 较上月增加 18.88%, 累计成交金额 56844.05 亿, 较上月增加 21.61%。



→ 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	基金代码	基金名称	标的指数	成立日期	本期净值增幅	备注
1	159903	南方深成 ETF	深证成指	2009-12-4	-0.22%	ETF
2	164205	天弘深证成指	深证成指	2010-8-12	-0.25%	LOF
3	161612	融通深证成指	深证成指	2010-11-15	-0.24%	开放式基金
4	163109	申万菱信深证成指分级	深证成指	2010-10-22	-0.28%	开放式基金
5	202017	南方深成 ETF 联接	深证成指	2009-12-9	-0.20%	开放式基金
6	159902	华夏中小板 ETF	中小板指	2006-6-8	2.56%	ETF
7	163111	申万菱信中小板分级	中小板指	2012-5-8	/	开放式基金
8	410010	华富中小板指数增强型基金	中小板指	2011-12-9	2.80%	开放式基金
9	159915	易方达创业板 ETF	创业板指	2011-9-20	7.53%	ETF
10	110026	易方达创业板 ETF 联接	创业板指	2011-9-20	7.01%	开放式基金
11	161613	融通创业板指	创业板指	2012-4-6	1.30%	开放式基金
12	159907	广发中小板 300ETF	中小板 300	2011-6-3	2.89%	ETF
13	162010	长城久兆中小板 300 分级	中小板 300	2012-1-30	2.58%	开放式基金
14	270026	广发中小板 300ETF 联接	中小板 300	2011-6-9	2.77%	开放式基金
15	162510	国联安双力中小板综指分级	中小板综指	2012-3-23	1.10%	开放式基金
16	161607	融通巨潮 100	巨潮 100	2005-5-12	-0.50%	LOF
17	161903	万家公用事业行业投资基金	巨潮服务指数	2005-8-15	0.12%	LOF
18	159905	工银瑞信深证红利 ETF	深证红利	2010-11-5	0.93%	ETF
19	481012	工银瑞信深证红利 ETF 联接	深证红利	2010-11-9	0.91%	开放式基金
20	159906	大成深证成长 40ETF	深证成长 40	2010-12-21	0.26%	ETF
21	090012	大成深证成长 40ETF 联接	深证成长 40	2010-10-21	0.13%	开放式基金
22	159901	易方达深证 100ETF	深证 100	2006-3-24	1.68%	ETF
23	165806	东吴深证 100 增强	深证 100	2012-3-9	-0.90%	LOF
24	162714	广发深证 100 分级基金	深证 100	2012-5-7	/	开放式基金
25	110019	易方达深证 100ETF 联接	深证 100	2009-12-1	1.64%	开放式基金
26	161604	融通深证 100	深证 100	2003-9-30	1.53%	开放式基金
27	161812	银华深证 100	深证 100	2010-5-7	1.55%	开放式基金
28	217016	招商深证 100	深证 100	2010-6-22	1.78%	开放式基金
29	530018	建信深证 100 指数增强型基金	深证 100	2012-3-16	-0.99%	开放式基金
30	159911	鹏华深证民营 ETF	深证民营	2011-9-2	1.64%	ETF
31	206010	鹏华深证民营 ETF 联接	深证民营	2011-9-2	1.53%	开放式基金
32	159912	汇添富深证 300ETF	深证 300	2011-9-16	2.06%	ETF



33	160415	华安深证 300	深证 300	2011-9-2	1.71%	LOF
34	233010	大摩深证 300	深证 300	2011-11-15	2.11%	开放式基金
35	470068	汇添富深证 300ETF 联接	深证 300	2011-9-28	2.13%	开放式基金
36	700002	平安大华深证 300 增强型基金	深证 300	2011-12-20	1.50%	开放式基金
37	159913	交银深证 300 价值 ETF	深证 300 价值	2011-9-22	1.45%	ETF
38	519706	交银深证 300 价值 ETF 联接	深证 300 价值	2011-9-28	1.18%	开放式基金
39	159917	国泰中小板 300 成长 ETF	中小板 300 成长	2012-3-15	2.97%	ETF
40	020025	国泰中小板 300 成长 ETF 联接	中小板 300 成长	2012-3-15	2.31%	开放式基金
41	159909	招商深证 TMT50ETF	深证 TMT50	2011-6-27	4.61%	ETF
42	217019	招商深证 TMT50ETF 联接	深证 TMT50	2011-6-27	4.35%	开放式基金
43	159918	嘉实中创 400 ETF	中创 400	2012-3-22	2.59%	ETF
44	070030	嘉实中创 400ETF 联接	中创 400	2012-3-22	1.73%	开放式基金
45	510210	富国上证综指 ETF	上证综指	2011-1-30	-1.00%	ETF
46	100053	富国上证综指 ETF 联接	上证综指	2011-1-30	-0.96%	开放式基金
47	470007	汇添富上证综指	上证综指	2009-7-1	-0.90%	开放式基金
48	510290	南方上证 380ETF	上证 380	2011-9-16	1.28%	ETF
49	202025	南方上证 380ETF 联接	上证 380	2011-9-20	1.20%	开放式基金
50	399011	中海上证 380	上证 380	2012-3-7	0.78%	开放式基金
51	590007	中邮上证 380	上证 380	2011-11-22	1.17%	开放式基金
52	510180	华安上证 180ETF	上证 180	2006-4-13	0.36%	ETF
53	040180	华安上证 180ETF 联接	上证 180	2009-9-29	0.60%	开放式基金
54	519180	万家上证 180	上证 180	2003-3-15	0.19%	开放式基金
55	510880	华泰柏瑞红利 ETF	上证红利	2006-11-17	-1.23%	ETF
56	510050	华夏上证 50ETF	上证 50	2004-12-30	-0.65%	ETF
57	110003	易方达上证 50	上证 50	2004-3-22	-1.14%	开放式基金
58	399001	中海上证 50	上证 50	2010-3-25	-0.66%	开放式基金
59	510230	国泰上证 180 金融 ETF	180 金融	2011-3-31	-1.75%	ETF
60	020021	国泰上证 180 金融 ETF 联接	180 金融	2011-3-31	-1.76%	开放式基金
61	510010	交银 180 治理 ETF	180 治理	2009-9-25	0.00%	ETF
62	519686	交银 180 治理 ETF 联接	180 治理	2009-9-29	0.00%	开放式基金
63	510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF	180 成长	2011-8-4	0.61%	ETF
64	240019	华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接	180 成长	2011-8-9	0.49%	开放式基金
65	510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	180 价值	2010-4-23	-1.97%	ETF
66	240016	华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接	180 价值	2010-4-23	-1.80%	开放式基金
67	510060	工银上证央企 50ETF	上证央企 50	2009-8-26	-1.44%	ETF
68	510020	博时超大盘 ETF	超大盘	2009-12-29	1.00%	ETF
69	050013	博时超大盘 ETF 联接	超大盘	2009-12-29	0.95%	开放式基金
70	510130	易方达上证中盘 ETF	上证中盘	2010-3-29	1.94%	ETF



71	110021	易方达上证中盘 ETF 联接	上证中盘	2010-3-31	1.82%	开放式基金
72	510220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	上证中小盘	2011-1-26	1.67%	ETF
73	460220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接	上证中小盘	2011-1-26	1.48%	开放式基金
74	510090	建信上证社会责任 ETF	上证社会责任	2010-5-28	-0.24%	ETF
75	530010	建信上证社会责任 ETF 联接	上证社会责任	2010-5-28	-0.20%	开放式基金
76	510070	鹏华上证民企 50ETF	上证民企 50	2010-8-5	2.18%	ETF
77	206005	鹏华上证民企 50ETF 联接	上证民企 50	2010-8-5	2.07%	开放式基金
78	510270	中银上证国企 ETF	上证国企	2011-6-16	-0.52%	ETF
79	510110	海富通上证周期 ETF	上证周期	2010-9-19	-0.76%	ETF
80	519027	海富通上证周期 ETF 联接	上证周期	2010-9-28	-0.74%	开放式基金
81	510120	海富通上证非周期 ETF	上证非周期	2011-4-22	1.30%	ETF
82	519032	海富通上证非周期 ETF 联接	上证非周期	2011-4-27	1.13%	开放式基金
83	510190	华安上证龙头 ETF	上证龙头	2010-11-18	0.50%	ETF
84	040190	华安上证龙头 ETF 联接	上证龙头	2010-11-18	0.46%	开放式基金
85	510170	国联安上证商品 ETF	上证大宗商品	2010-11-26	0.72%	ETF
86	257060	国联安上证商品 ETF 联接	上证大宗商品	2010-12-1	0.76%	开放式基金
87	510260	诺安上证新兴产业 ETF	上证新兴产业	2011-4-7	2.63%	ETF
88	320014	诺安上证新兴产业 ETF 联接	上证新兴产业	2011-4-7	2.47%	开放式基金
89	510410	博时上证自然资源 ETF	上证自然资源	2012-4-10	-0.88%	ETF
90	050024	博时上证自然资源 ETF 联接	上证资源	2012-4-10	0.12%	开放式基金
91	510150	招商上证消费 80ETF	上证消费 80	2010-12-8	3.54%	ETF
92	217017	招商上证消费 80ETF 联接	上证消费 80	2010-12-8	3.46%	开放式基金
93	159919	嘉实沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-7	/	ETF
94	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-4	/	ETF
95	163821	中银沪深 300 等权重	沪深 300	2012-5-17	/	LOF
96	160615	鹏华沪深 300	沪深 300	2009-4-3	0.32%	LOF
97	160706	嘉实沪深 300	沪深 300	2005-8-29	0.41%	LOF
98	160807	长盛沪深 300	沪深 300	2010-8-4	0.35%	LOF
99	161811	银华沪深 300	沪深 300	2009-10-14	0.37%	LOF
100	163407	兴全沪深 300	沪深 300	2010-11-2	-0.30%	LOF
101	165309	建信沪深 300	沪深 300	2009-11-5	0.27%	LOF
102	166007	中欧沪深 300	沪深 300	2010-6-24	0.70%	LOF
103	166802	浙商沪深 300 分级基金	沪深 300	2012-5-7	/	开放式基金
104	000051	华夏沪深 300	沪深 300	2009-7-10	0.53%	开放式基金
105	020011	国泰沪深 300	沪深 300	2007-11-11	0.18%	开放式基金
106	050002	博时裕富沪深 300	沪深 300	2003-8-26	0.38%	开放式基金
107	100038	富国沪深 300	沪深 300	2009-12-16	1.01%	开放式基金
108	110020	易方达沪深 300	沪深 300	2009-8-26	0.41%	开放式基金
109	161207	国投瑞银瑞和 300	沪深 300	2009-10-14	0.20%	开放式基金
110	165515	信诚沪深 300 指数分级	沪深 300	2012-2-1	0.29%	开放式基金



111	200002	长城久泰沪深 300	沪深 300	2004-5-21	0.27%	开放式基金
112	202015	南方沪深 300	沪深 300	2009-3-25	0.36%	开放式基金
113	270010	广发沪深 300	沪深 300	2008-12-30	0.54%	开放式基金
114	450008	国富沪深 300	沪深 300	2009-9-3	-0.32%	开放式基金
115	481009	工银瑞信沪深 300	沪深 300	2009-3-5	0.43%	开放式基金
116	519116	浦银安盛沪深 300	沪深 300	2010-12-10	0.48%	开放式基金
117	519300	大成沪深 300	沪深 300	2006-4-6	0.30%	开放式基金
118	660008	农银汇理沪深 300	沪深 300	2011-4-12	0.40%	开放式基金
119	510160	南方小康产业 ETF	小康产业	2010-8-27	0.11%	ETF
120	202021	南方小康产业 ETF 联接	小康产业	2010-8-27	0.10%	开放式基金
121	162307	海富通中证 100	中证 100	2009-10-30	-0.66%	LOF
122	162509	国联安双禧中证 100	中证 100	2010-4-16	-0.63%	开放式基金
123	163808	中银中证 100	中证 100	2009-9-4	-0.65%	开放式基金
124	213010	宝盈中证 100	中证 100	2010-2-8	-0.64%	开放式基金
125	240014	华宝兴业中证 100	中证 100	2009-9-29	-0.63%	开放式基金
126	320010	诺安中证 100	中证 100	2009-10-27	-0.81%	开放式基金
127	410008	华富中证 100	中证 100	2009-12-30	-0.67%	开放式基金
128	519100	长盛中证 100	中证 100	2006-11-22	-0.63%	开放式基金
129	160808	长盛同瑞中证 200 分级基金	中证 200	2011-12-16	2.02%	开放式基金
130	290010	泰信中证 200	中证 200	2011-6-9	2.38%	开放式基金
131	160119	南方中证 500	中证 500	2009-9-25	2.42%	LOF
132	160616	鹏华中证 500	中证 500	2010-2-5	2.36%	LOF
133	161017	富国中证 500	中证 500	2011-10-12	2.26%	LOF
134	162711	广发中证 500	中证 500	2009-11-26	2.46%	LOF
135	162216	泰达宏利中证 500	中证 500	2011-12-1	2.34%	开放式基金
136	164809	工银瑞信睿智中证 500 分级	中证 500	2012-1-31	2.19%	开放式基金
137	165511	信诚中证 500 分级	中证 500	2011-2-11	1.56%	开放式基金
138	660011	农银汇理中证 500	中证 500	2011-11-29	2.30%	开放式基金
139	160806	长盛同庆中证 800 分级基金	中证 800	2012-5-12	/	开放式基金
140	161211	国投瑞银沪深 300 金融	沪深 300 金融	2010-4-9	-0.25%	LOF
141	310398	申万菱信沪深 300 价值	沪深 300 价值	2010-2-11	-0.91%	开放式基金
142	519671	银河沪深 300 价值	沪深 300 价值	2009-12-28	-0.92%	开放式基金
143	161907	万家中证红利	中证红利	2011-3-17	-0.14%	LOF
144	090010	大成中证红利	中证红利	2010-2-2	-0.58%	开放式基金
145	100032	富国天鼎中证红利	中证红利	2008-11-20	-0.19%	开放式基金
146	160716	嘉实基本面 50	基本面 50	2009-12-30	-2.03%	LOF
147	163001	长信中证央企 100	中证央企 100	2010-3-26	-0.36%	LOF
148	162213	泰达宏利中证财富大盘	中证财富大盘	2010-4-23	-1.08%	开放式基金
149	090016	大成中证内地消费主题	中证内地消费	2011-11-8	-0.09%	开放式基金



150	161819	银华中证内地资源分级基金	中证内地资源	2011-12-8	0.84%	开放式基金
151	690008	民生加银中证内地资源	中证内地资源	2012-3-8	1.28%	开放式基金
152	163209	诺安中证创业成长分级基金	中证创业成长	2012-3-29	0.40%	开放式基金
153	161217	国投瑞银中证上游	中证上游	2011-7-21	1.30%	开放式基金
154	161213	国投瑞银中证下游	中证下游	2010-12-16	2.29%	LOF
155	585001	东吴中证新兴产业	中证新兴产业	2011-2-1	4.06%	开放式基金
156	519117	浦银安盛中证锐联基本面 400	基本面 400	2012-5-14	/	开放式基金
157	161816	银华中证等权重 90	中证等权重 90	2011-3-17	0.26%	开放式基金
158	210007	金鹰中证技术领先	中证技术领先	2011-6-1	3.65%	开放式基金
159	519034	海富通中证内地低碳	中证内地低碳	2012-5-25	/	开放式基金
160	159916	建信深证基本面 60ETF	深基本面 60	2011-9-8	1.19%	ETF
161	530015	建信深证基本面 60ETF 联接	深基本面 60	2011-9-8	1.12%	开放式基金
162	159910	嘉实深证基本面 120ETF	深基本面 120	2011-8-1	1.37%	ETF
163	070023	嘉实深证基本面 120ETF 联接	深基本面 120	2011-8-1	1.31%	开放式基金
164	159908	博时深证基本面 200ETF	深基本面 200	2011-6-10	1.36%	ETF
165	050021	博时深证基本面 200ETF 联接	深基本面 200	2011-6-10	1.30%	开放式基金
166	160416	华安标普全球石油	标普全球石油	2012-3-29	-5.29%	LOF
167	040002	华安 MSCI 中国 A 股	MSCI 中国 A 股	2002-11-8	0.99%	开放式基金
168	180003	银华道琼斯 88 精选	道琼斯 88	2004-8-11	2.04%	开放式基金

注：统计期为 2012.5.1—2012.5.31；“/”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	335.26	218.32
159902	中小板 ETF	华夏	2006-09-05	18.27	40.29
159903	深成 ETF	南方	2010-02-02	35.57	36.63
159905	深红利 ETF	工银瑞信	2011-01-11	13.04	10.34
159906	深成长 ETF	大成	2011-02-23	19.64	15.26
159907	中小板 300ETF	广发	2011-08-10	8.79	7.65
159908	深 F200ETF	博时	2011-07-13	2.76	2.22
159909	深证 TMT50ETF	招商	2011-09-01	1.37	3.59
159910	深 F120ETF	嘉实	2011-09-27	5.62	5.12
159911	民营 ETF	鹏华	2011-10-14	1.37	3.82
159912	深 300ETF	汇添富	2011-11-24	3.02	2.87
159913	深价值	交银施罗德	2011-10-25	0.84	0.88

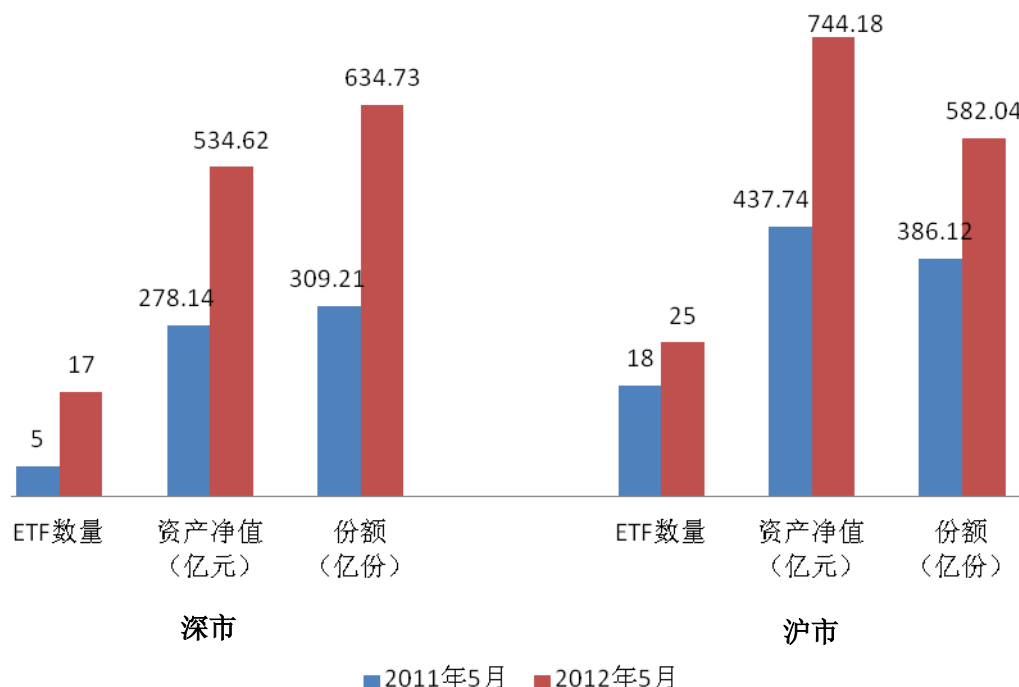


159915	创业板 ETF	易方达	2011-12-09	6.87	5.09
159916	深 F60	建信	2011-10-24	2.16	3.90
159917	中小成长	国泰	2012-04-06	0.60	0.62
159918	中创 400	嘉实	2012-05-11	3.08	3.13
159919	300ETF	嘉实	2012-05-28	176.47	174.88
510010	治理 ETF	交银施罗德	2009-12-15	46.71	31.25
510020	超大 ETF	博时	2010-03-19	59.62	11.44
510030	价值 ETF	华宝兴业	2010-05-28	5.18	12.10
510050	50ETF	华夏	2005-02-23	113.14	204.90
510060	央企 ETF	工银瑞信	2009-10-27	6.08	6.91
510070	民企 ETF	鹏华	2010-10-29	3.40	3.50
510090	责任 ETF	建信	2010-08-09	4.51	3.84
510110	周期 ETF	海富通	2010-11-15	1.45	3.20
510120	非周 ETF	海富通	2011-06-08	1.79	3.34
510130	中盘 ETF	易方达	2010-06-23	4.24	10.49
510150	消费 ETF	招商	2011-02-25	5.58	14.07
510160	小康 ETF	南方	2010-11-01	8.76	3.15
510170	商品 ETF	国联安	2011-01-25	4.31	10.90
510180	180ETF	华安	2006-05-18	177.17	100.46
510190	龙头 ETF	华安	2011-01-10	3.51	7.84
510210	综指 ETF	富国	2011-03-25	1.76	4.23
510220	中小 ETF	华泰柏瑞	2011-03-28	0.45	1.23
510230	金融 ETF	国泰	2011-05-23	2.26	6.95
510260	新兴 ETF	诺安	2011-06-08	9.02	7.04
510270	国企 ETF	中银	2011-08-18	1.67	1.28
510280	成长 ETF	华宝兴业	2011-10-18	3.94	3.93
510290	380ETF	南方	2011-11-08	2.46	2.26
510300	300ETF	华泰柏瑞	2012-05-28	101.96	268.66
510410	资源 ETF	博时	2012-05-11	4.35	4.39
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	2007-01-18	8.72	16.83
合计				1216.77	1278.80

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.5.31；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 2012.5.31；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	218.32	1.06%	17.07%
159902	中小板 ETF	40.29	0.51%	3.15%
159903	深成 ETF	36.63	0.27%	2.86%
159905	深红利 ETF	10.34	0.12%	0.81%
159906	深成长 ETF	15.26	0.18%	1.19%
159907	中小板 300ETF	7.65	0.06%	0.60%
159908	深 F200ETF	2.22	0.01%	0.17%
159909	深证 TMT50ETF	3.59	0.08%	0.28%
159910	深 F120ETF	5.12	0.02%	0.40%
159911	民营 ETF	3.82	0.04%	0.30%
159912	深 300ETF	2.87	0.01%	0.22%
159913	深价值	0.88	0.01%	0.07%
159915	创业板 ETF	5.09	0.31%	0.40%
159916	深 F60	3.90	0.03%	0.31%



159917	中小成长	0.62	0.01%	0.05%
159918	中创 400	3.13	0.04%	0.24%
159919	300ETF	174.88	0.14%	13.68%
深市合计		534.62		41.81%
510010	治理 ETF	31.25	0.04%	2.44%
510020	超大 ETF	11.44	0.02%	0.89%
510030	价值 ETF	12.10	0.02%	0.95%
510050	50ETF	204.90	0.28%	16.02%
510060	央企 ETF	6.91	0.01%	0.54%
510070	民企 ETF	3.50	0.04%	0.27%
510090	责任 ETF	3.84	0.01%	0.30%
510110	周期 ETF	3.20	0.00%	0.25%
510120	非周 ETF	3.34	0.02%	0.26%
510130	中盘 ETF	10.49	0.04%	0.82%
510150	消费 ETF	14.07	0.11%	1.10%
510160	小康 ETF	3.15	0.01%	0.25%
510170	商品 ETF	10.90	0.03%	0.85%
510180	180ETF	100.46	0.10%	7.86%
510190	龙头 ETF	7.84	0.01%	0.61%
510210	综指 ETF	4.23	0.00%	0.33%
510220	中小 ETF	1.23	0.00%	0.10%
510230	金融 ETF	6.95	0.02%	0.54%
510260	新兴 ETF	7.04	0.07%	0.55%
510270	国企 ETF	1.28	0.00%	0.10%
510280	成长 ETF	3.93	0.02%	0.31%
510290	380ETF	2.26	0.01%	0.18%
510300	300ETF	268.66	0.21%	21.01%
510410	资源 ETF	4.39	0.00%	0.34%
510880	红利 ETF	16.83	0.03%	1.32%
沪市合计		744.18		58.19%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.5.31，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	2.06	0.62%	4.94	2.32%
159902	中小板 ETF	0.00	0.00%	1.00	2.56%
159903	深成 ETF	2.90	8.87%	2.91	8.62%
159905	深红利 ETF	-0.28	-2.10%	-0.12	-1.19%



159906	深成长 ETF	-0.71	-3.49%	-0.51	-3.24%
159907	中小板 300ETF	-0.44	-4.77%	-0.16	-2.01%
159908	深 F200ETF	-0.03	-1.08%	0.01	0.27%
159909	深证 TMT50ETF	-0.03	-2.50%	0.07	2.00%
159910	深 F120ETF	0.74	15.17%	0.73	16.74%
159911	民营 ETF	-0.05	-3.51%	-0.08	-1.93%
159912	深 300ETF	0.32	11.84%	0.36	14.14%
159913	深价值	0.07	9.05%	0.08	10.64%
159915	创业板 ETF	-0.04	-0.58%	0.33	6.90%
159916	深 F60	-0.06	-2.92%	-0.07	-1.76%
159917	中小成长	-0.30	-33.28%	-0.28	-31.30%
159918	中创 400	0.21	7.33%	0.26	9.10%
159919	300ETF	-16.86	-8.72%	-18.45	-9.54%
510010	治理 ETF	-0.57	-1.20%	-0.38	-1.20%
510020	超大 ETF	-1.37	-2.25%	-0.15	-1.28%
510030	价值 ETF	0.04	0.87%	-0.14	-1.12%
510050	50ETF	-3.44	-2.95%	-8.90	-4.16%
510060	央企 ETF	-0.04	-0.65%	-0.15	-2.08%
510070	民企 ETF	-0.04	-1.20%	0.03	0.96%
510090	责任 ETF	-0.13	-2.82%	-0.12	-3.05%
510110	周期 ETF	-0.05	-3.34%	-0.14	-4.08%
510120	非周 ETF	-0.02	-1.21%	0.00	0.08%
510130	中盘 ETF	-0.05	-1.09%	0.09	0.82%
510150	消费 ETF	-0.04	-0.77%	0.37	2.73%
510160	小康 ETF	-0.10	-1.14%	-0.03	-1.03%
510170	商品 ETF	0.17	4.17%	0.51	4.92%
510180	180ETF	-8.04	-4.34%	-4.19	-4.00%
510190	龙头 ETF	-0.25	-6.69%	-0.52	-6.22%
510210	综指 ETF	-0.01	-0.64%	-0.07	-1.63%
510220	中小 ETF	0.00	-0.51%	0.01	1.16%
510230	金融 ETF	-0.86	-27.51%	-2.81	-28.78%
510260	新兴 ETF	-0.07	-0.77%	0.13	1.84%
510270	国企 ETF	-0.04	-2.24%	-0.04	-2.75%
510280	成长 ETF	-0.21	-5.00%	-0.18	-4.43%
510290	380ETF	-0.06	-2.55%	-0.03	-1.31%
510300	300ETF	-20.34	-16.63%	-53.82	-16.69%
510410	资源 ETF	-4.75	-52.21%	-4.72	-51.80%
510880	红利 ETF	-0.58	-6.25%	-1.35	-7.41%
合计		-53.36		-85.55	

注：统计期为2012.5.2-2012.5.31。



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

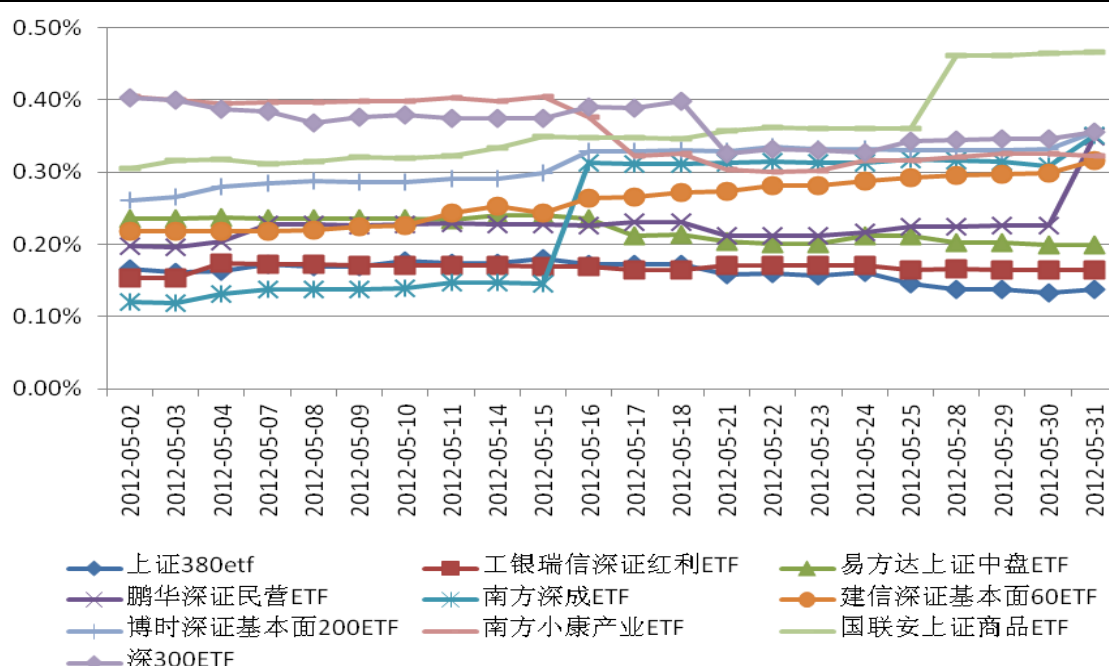
代码	简称	阶段收益	阶段超额收益	累计收益	累计超额收益
159901	深 100ETF	1.68%	0.14%	14.75%	-0.24%
159902	中小板 ETF	2.56%	0.19%	9.49%	-0.02%
159903	深成 ETF	-0.22%	0.16%	13.64%	-0.07%
159905	深红利 ETF*	0.93%	-0.02%	14.67%	-0.22%
159906	深成长 40ETF	0.26%	0.11%	7.32%	0.20%
159907	中小 300ETF	2.89%	0.20%	9.25%	0.17%
159908	深 F200	1.36%	0.07%	13.00%	-0.46%
159909	TMT50ETF	4.61%	0.09%	12.81%	-0.17%
159910	深 F120ETF	1.37%	0.10%	12.84%	-0.46%
159911	民营 ETF	1.64%	0.19%	9.40%	0.05%
159912	深 300ETF	2.06%	0.12%	13.54%	-0.29%
159913	深价值	1.45%	0.12%	15.16%	-0.53%
159915	创业板 ETF	7.53%	0.33%	1.28%	0.60%
159916	深 F60	1.19%	0.11%	13.60%	-0.19%
159917	中小成长 *	2.97%	-0.18%	2.16%	-0.39%
159918	中创 400*	0.87%	0.21%	0.87%	0.21%
159919	300ETF*	0.75%	0.09%	0.75%	0.09%
510010	180 治理 ETF	0.00%	0.34%	11.50%	0.27%
510020	超大 ETF	1.00%	0.10%	15.67%	-0.10%
510030	180 价值 ETF	-1.97%	0.29%	7.40%	0.24%
510050	50ETF	-0.65%	0.34%	11.65%	0.09%
510060	央企 ETF	-1.44%	0.35%	7.09%	0.66%
510070	民企 ETF	2.18%	0.08%	11.49%	-0.02%
510090	责任 ETF	-0.24%	0.21%	10.94%	-0.02%
510110	周期 ETF	-0.76%	0.32%	11.15%	-1.28%
510120	非周期 ETF	1.30%	0.03%	8.93%	-0.44%
510130	中盘 ETF	1.94%	0.03%	13.94%	-0.13%
510150	消费 ETF	3.54%	-0.26%	12.19%	-2.02%
510160	小康 ETF	0.11%	0.02%	10.07%	-0.37%
510170	商品 ETF	0.72%	0.15%	19.80%	-0.16%
510180	180ETF	0.36%	0.33%	12.50%	0.07%
510190	龙头 ETF	0.50%	0.10%	10.76%	-0.33%
510210	上证综指 ETF	-1.00%	0.01%	8.04%	0.19%
510220	中小盘 ETF	1.67%	0.01%	12.97%	-0.47%
510230	180 金融 ETF	-1.75%	0.41%	10.40%	0.20%
510260	新兴产业 ETF	2.63%	0.16%	14.68%	0.02%
510270	国企 ETF	-0.52%	0.10%	11.82%	-0.02%
510280	成长 ETF	0.61%	0.34%	13.04%	0.08%



510290	380ETF	1.28%	0.14%	12.90%	0.03%
510300	300ETF*	0.77%	0.11%	0.77%	0.11%
510410	资源ETF*	-1.30%	0.21%	-1.30%	0.21%
510880	红利ETF	-1.23%	0.44%	8.31%	0.20%

注：阶段=统计期；累计=年初至今。统计期为2012.5.2-2012.5.31。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 3：5 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：日均成交金额前 10 只 ETF（亿元）

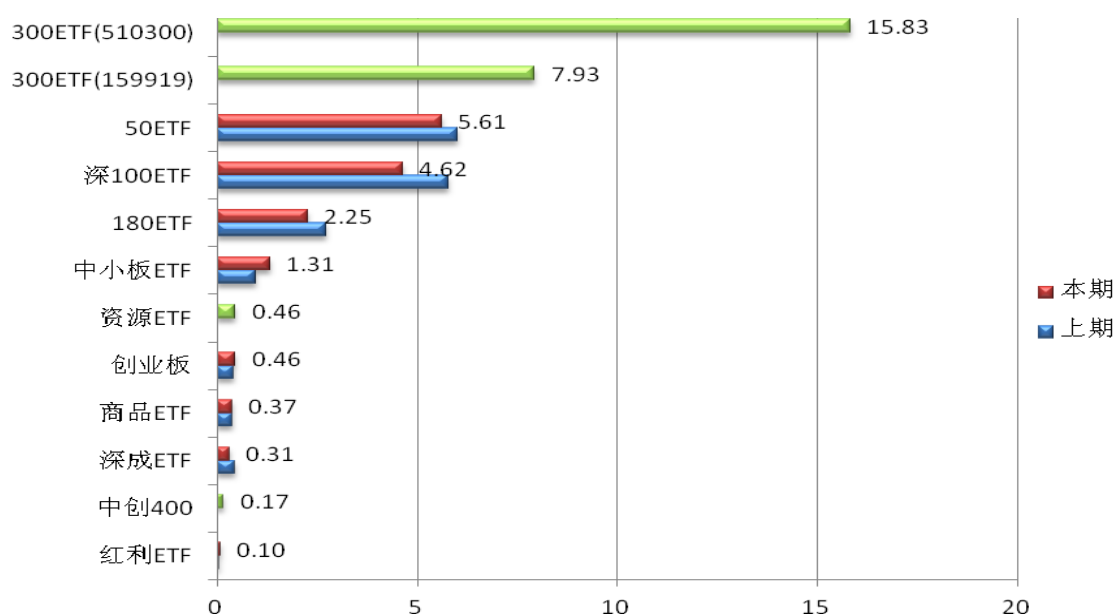
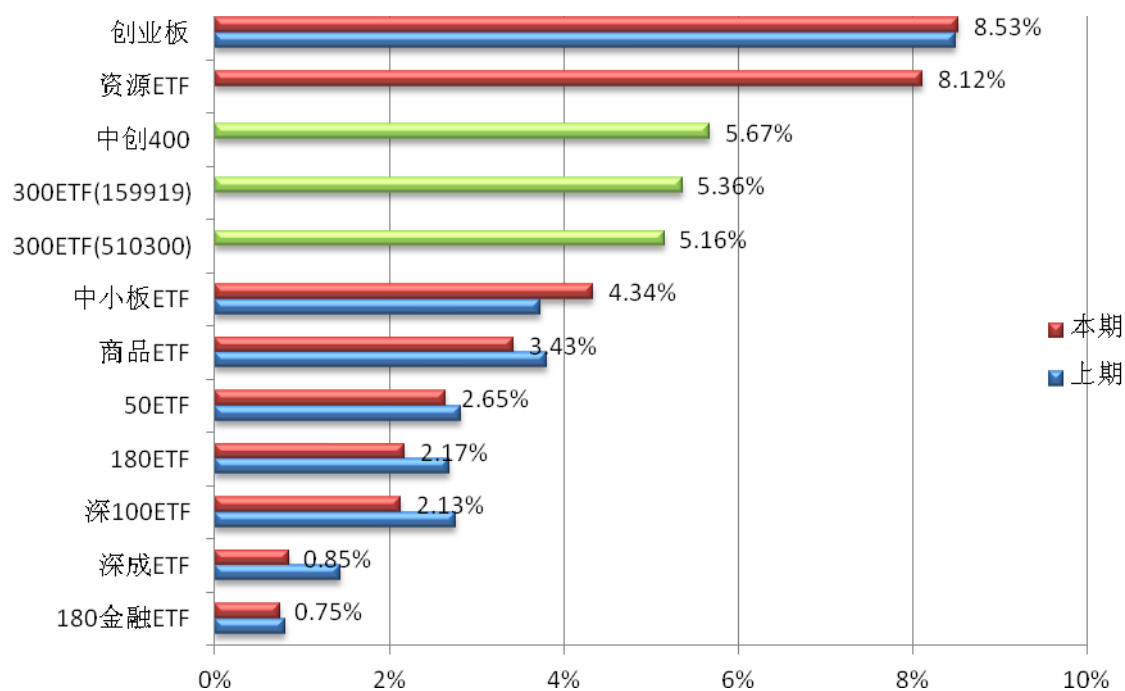


图 5：日均换手率前 10 只 ETF



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。



❖ LOF

表 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）		
		5 月	月度增量	增幅	5 月	月度增量	增幅
160119	南方 500	1.44	-0.03	-2.30%	1.34	0.00	0.06%
160125	南方中国	0.02	0.00	4.33%	0.02	0.00	-3.22%
160415	华安 S300	0.35	-0.01	-3.98%	0.34	-0.01	-2.33%
160615	鹏华 300	0.41	-0.01	-2.24%	0.38	-0.01	-1.93%
160616	鹏华 500	0.71	-0.01	-1.14%	0.56	0.01	1.19%
160706	嘉实 300	36.03	0.55	1.54%	24.93	0.48	1.95%
160716	嘉实 50	1.05	-0.02	-1.48%	0.69	-0.02	-3.48%
160717	恒生 H 股	0.53	0.06	13.01%	0.36	0.01	2.28%
160807	长盛 300	0.08	-0.05	-38.53%	0.07	-0.04	-38.32%
161017	富国 500	0.07	-0.20	-72.92%	0.07	-0.19	-72.31%
161211	国投金融	1.36	-0.62	-31.19%	1.09	-0.50	-31.36%
161213	国投消费	0.24	0.00	-0.99%	0.20	0.00	1.27%
161607	融通巨潮	0.66	-0.01	-1.14%	0.53	-0.01	-1.63%
161714	招商金砖	0.02	0.01	123.42%	0.02	0.01	96.05%
161811	银华 300	0.17	0.00	-2.07%	0.13	0.00	-1.71%
161903	万家公用	0.35	-0.01	-1.99%	0.21	0.00	-1.88%
161907	万家红利	0.56	-0.01	-1.43%	0.49	-0.01	-1.56%
162307	海富 100	0.20	0.00	-2.27%	0.15	0.00	-2.92%
162711	广发 500	1.60	-0.03	-1.79%	1.33	0.01	0.62%
163001	长信 100	0.12	0.00	-1.81%	0.10	0.00	-2.16%
163407	兴全 300	0.29	0.00	-1.15%	0.25	0.00	-1.45%
164205	天弘深成	0.01	0.00	10.40%	0.01	0.00	10.12%
165309	建信 300	0.20	0.00	-0.15%	0.15	0.00	0.12%
165806	东吴 100	0.05	-0.22	-80.28%	0.05	-0.22	-80.46%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-0.05%	0.05	0.00	0.64%
合计		46.60	-0.61		33.53	-0.52	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.5.2-2012.5.31。

❖ 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）		
				5 月 末	月度 增量	增幅	5 月 末	月度 增量	增幅



150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.29	-0.05	-2.30%	2.27	-0.05	-2.10%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.29	-0.05	-2.30%	2.27	-0.05	-2.10%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	13.35	0.34	2.61%	14.97	0.45	3.07%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	20.02	0.51	2.61%	16.70	0.17	1.03%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	37.32	1.01	2.80%	38.29	1.22	3.30%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	37.32	1.01	2.80%	29.86	1.65	5.84%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	17.50	2.98	20.53%	17.97	3.15	21.24%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	17.50	2.98	20.53%	6.84	1.02	17.53%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	3.22	-0.28	-7.95%	3.28	-0.26	-7.40%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	4.83	-0.42	-7.95%	2.99	-0.17	-5.51%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	32.15	8.82	37.80%	33.05	9.21	38.61%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	32.15	8.82	37.80%	16.65	4.52	37.27%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.31	-0.27	-16.84%	1.35	-0.26	-16.35%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	1.96	-0.40	-16.84%	2.19	-0.42	-16.01%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.62	-0.07	-10.41%	0.63	-0.07	-9.88%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.62	-0.07	-10.41%	0.64	-0.07	-10.41%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.14	0.01	4.39%	0.15	0.01	5.00%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.21	0.01	4.39%	0.24	0.02	8.01%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.02	0.00	-11.06%	0.02	0.00	-10.50%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.03	0.00	-11.06%	0.04	0.00	-8.22%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.11	-0.03	-23.12%	0.11	-0.03	-22.67%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.17	-0.05	-23.12%	0.16	-0.04	-20.10%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.31	-0.27	-16.84%	1.35	-0.26	-16.35%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	1.96	-0.40	-16.84%	2.19	-0.42	-16.01%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.11	-0.05	-28.88%	0.12	-0.05	-28.46%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.17	-0.07	-28.88%	0.20	-0.07	-26.82%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.82	-0.08	-9.14%	0.83	-0.08	-8.60%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.82	-0.08	-9.14%	0.82	-0.07	-7.67%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.08	-0.08	-48.79%	0.08	-0.08	-48.49%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.12	-0.12	-48.79%	0.12	-0.12	-48.69%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	0.56	-0.27	-32.45%	0.56	-0.26	-32.11%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	0.56	-0.27	-32.45%	0.56	-0.27	-32.25%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	15.29	0.00	0.00%	15.32	0.00	0.00%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	22.93	0.00	0.00%	23.28	0.00	0.00%
合计				269.88	23.12		236.11	18.29	

注：数据来源：深交所，统计期为2012.5.2-2012.5.31。



❖ 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	0.56
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	3.85
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	464.27
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	74.16
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.90
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.95
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.75
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	9.50
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.92
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.35
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.59
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.50
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.98
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.75
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	2.46
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	25.61
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.92
3051	中金深证 100ETF	深证 100	CICC	2010-1-29	0.07
3052	沪深 300 公用事业 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.13
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.95
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.68
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.51
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	0.25

注：基金资产单位为“亿港元”；截止日期为 2012.5.31。

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	10.34	1.97%	10.54	6.02%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	24.2	-5.47%	24.06	-3.07%
2823	安硕 A50ETF	10.62	-5.18%	10.30	-2.51%
2827	标智沪深 300ETF	29.1	-3.48%	28.09	-0.57%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	10.5	-1.87%	10.54	-1.31%

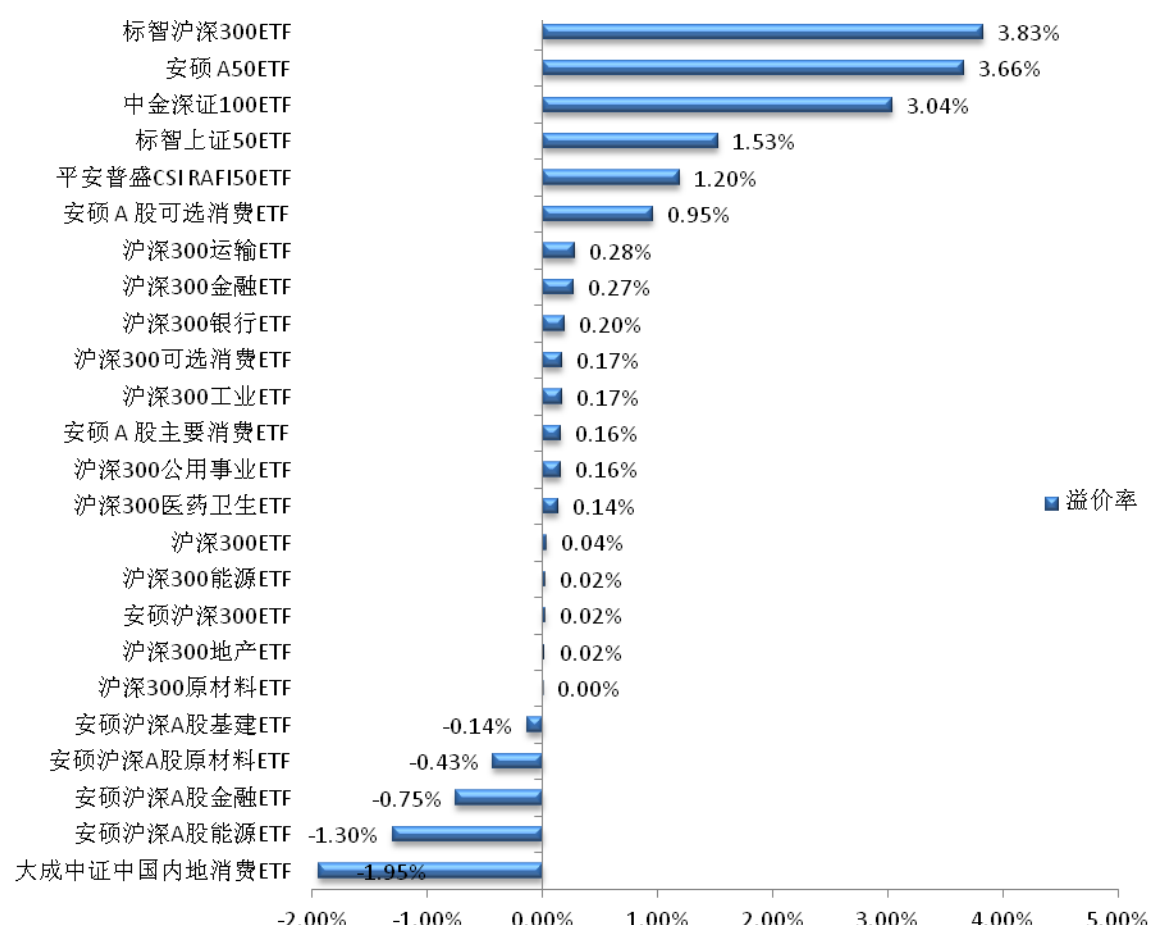


2841	安硕 A 股主要消费 ETF	20.2	-4.27%	20.37	-2.16%
2844	沪深 300 金融 ETF	8.84	-4.43%	8.99	-0.47%
2846	安硕沪深 300ETF	23.45	-1.26%	23.18	-1.36%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	14.82	-3.01%	14.79	-0.95%
3005	沪深 300 工业 ETF	4.92	-3.53%	5.02	0.57%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	9.91	-2.46%	9.92	-1.13%
3017	沪深 300 能源 ETF	7.79	-5.80%	7.98	-1.23%
3024	标智上证 50ETF	16.82	-2.21%	16.53	-1.94%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	7.69	-4.00%	7.80	-0.69%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	11.58	-2.20%	11.74	0.69%
3049	沪深 300ETF	6.31	-4.39%	6.43	-0.17%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	11.46	-4.66%	11.63	-2.56%
3051	中金深证 100ETF	19.98	-22.56%	18.01	-30.71%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	3.33	-2.92%	3.38	0.61%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	10.4	0.78%	10.47	3.57%
3061	沪深 300 银行 ETF	8.25	-9.64%	8.49	-4.74%
3062	沪深 300 原材料 ETF	6.01	-2.28%	6.13	1.70%
3063	沪深 300 运输 ETF	2.68	-5.30%	2.72	-1.46%
3071	大成中证中国内地消 ETF	9.6	-3.13%	9.85	-1.20%

注：收盘价、单位净值的单位为“港元”；统计期为 2012.5.1-2012.5.31；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。（因本期中金深证 100ETF 将于 2012-6-29 日终于交易，基金管理人在 2012-5-29 日从基金资产中计提一定的拨备，导致其本期净值与二级市场价格变动幅度较大）



图 6：主要 A 股跨境 ETF 溢价率排名



注：统计期为2012.5.1-2012.5.31

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	141.27	-60.58%	2.15%	-61.58%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	2.59	102.77%	0.01%	109.09%
2823	安硕 A50ETF	85119.23	-17.14%	1.71%	-16.04%
2827	标智沪深 300ETF	2465.18	-53.61%	0.31%	-53.63%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	20.05	-21.39%	0.03%	-18.18%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	4.91	-67.87%	0.01%	-68.23%
2844	沪深 300 金融 ETF	58.09	-68.62%	0.70%	-68.56%
2846	安硕沪深 300ETF	301.68	-11.87%	0.29%	-13.97%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	10.86	-16.79%	0.05%	-14.95%



3005	沪深 300 工业 ETF	59.23	-18.68%	1.70%	-18.33%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	7.64	212.40%	0.05%	208.46%
3017	沪深 300 能源 ETF	72.45	-50.88%	1.43%	-51.26%
3024	标智上证 50ETF	5.27	120.72%	0.03%	113.49%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	154.68	-24.83%	0.89%	-23.26%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	23.27	392.83%	0.07%	370.37%
3049	沪深 300ETF	2798.45	-60.63%	1.07%	-60.53%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	5.45	66.41%	0.03%	61.44%
3051	中金深证 100ETF	2.50	4400.00%	0.28%	3680.00%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	46.91	-5.23%	3.74%	-4.82%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	45.05	-55.62%	0.47%	-56.20%
3061	沪深 300 银行 ETF	154.23	-68.23%	0.86%	-66.47%
3062	沪深 300 原材料 ETF	109.09	-17.15%	1.99%	-17.78%
3063	沪深 300 运输 ETF	36.86	-36.56%	2.36%	-35.07%
3071	大成中证中国内地消 ETF	2.91	80.56%	0.12%	84.80%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.5.1-2012.5.31；“/”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 5 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
IF1205	2655.80	2726.00	2558.00	2576.00	-62.60	0	-43855	2577.07	2868626	22974.50
IF1206	2666.00	2734.80	2548.00	2635.60	-12.80	44773	30844	2631.80	4171667	32553.42
IF1209	2686.20	2762.80	2560.00	2637.60	-37.40	6466	2545	2633.40	62681	497.63
IF1212	2716.00	2794.40	2585.00	2658.60	-47.40	1123	507	2653.00	13475	108.10
IF1207	2579.00	2652.60	2545.20	2628.80	65.40	11313	11313	2625.40	90964	710.40

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 2012.5.31

图 7: 沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

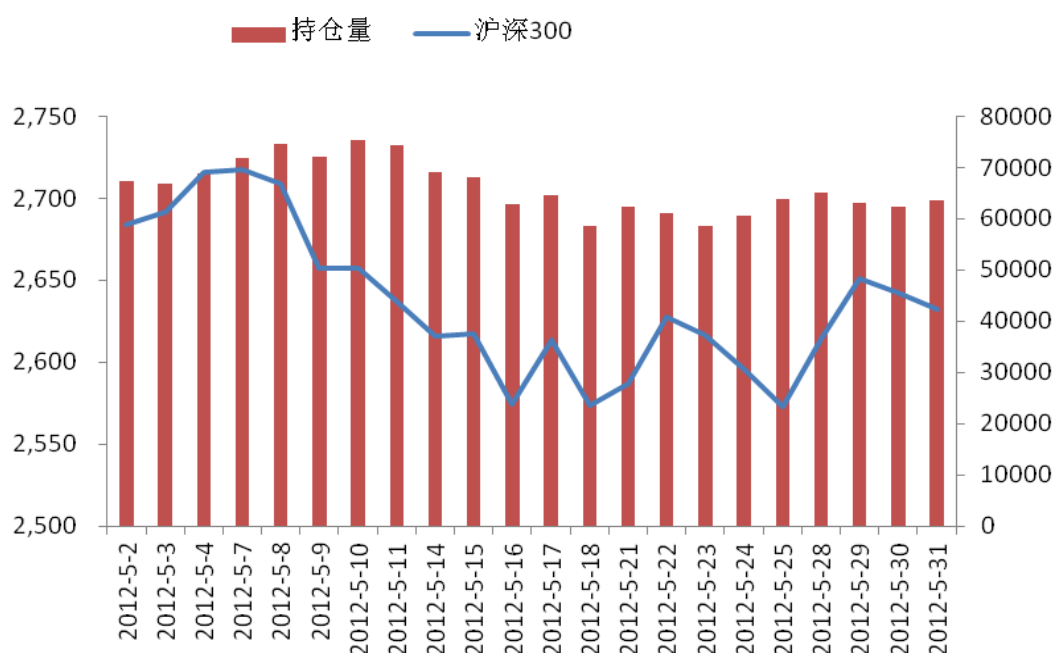
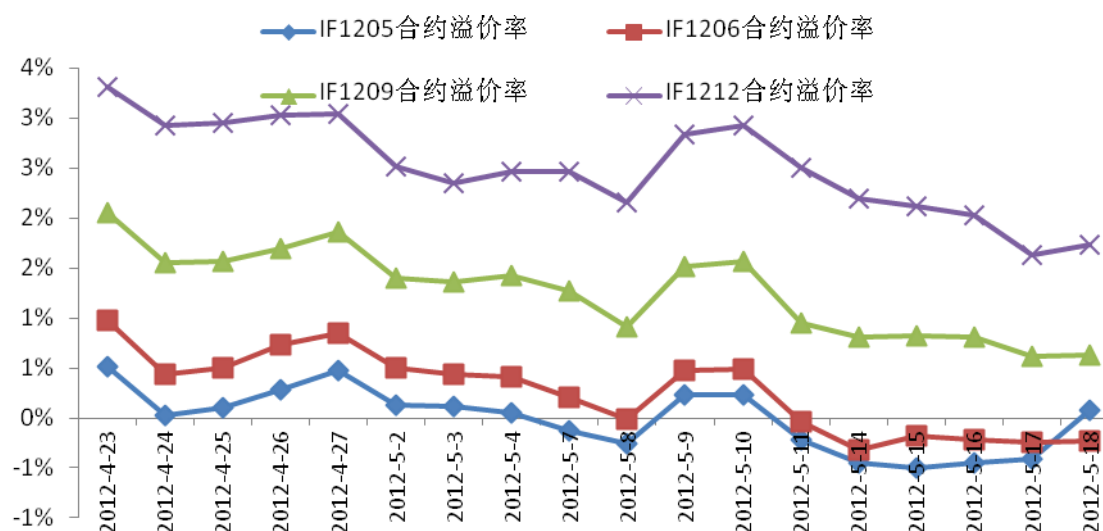


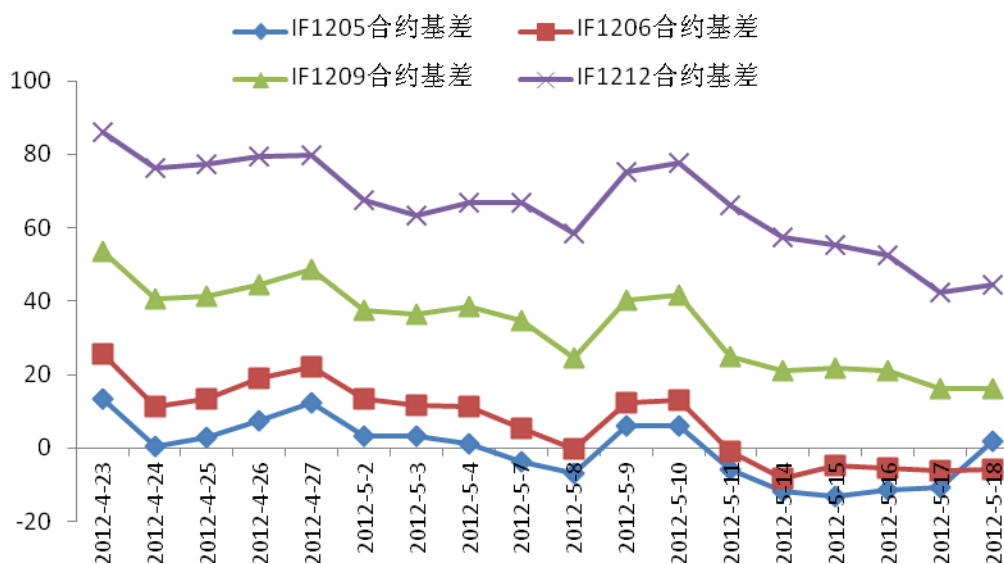


图 8：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注：合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1；统计期为 2012.4.23-2012.5.18

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 2012.4.23-2012.5.18



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>