



指数产品动态 (2012 年 6 月)

2012 年第 6 期 总第 29 期

■ 深圳证券信息有限公司指数事业部

→ 业内动态

❖ 3 只跨境 ETF 获准在港沪深三地上市

6 月 29 日，证监会通报正式推出港股 ETF 基金，分别是华夏基金恒生指数 ETF 和易方达中国企业指数 ETF，将分别在上海和深圳证券交易所挂牌交易。同日，香港证监会宣布，认可全球首只人民币合格境外机构投资者(RQFII) A 股 ETF 在港交所上市。

对此，业内人士表示，跨境 ETF 的推出对于基金行业而言，将成为推动 ETF 产品发展创新的里程碑。首批港股 ETF 作为境内首批跨境 ETF，是内地与香港金融合作、落实 CEPA 的重要措施之一，可以为投资者提供简单的、跟踪误差较小的投资香港恒生指数、国企指数的工具，可以比较便捷地分享香港市场的平均收益，对于未来跨境 ETF 产品的推出将产生深远影响。

❖ 基金法修订 构建资产管理行业大格局

6 月 26 日，基金法草案提交全国人大常委会审议，草案将私募基金纳入监管，同时，基金组织形式增加，行业管制放松，各项业务松绑。所有这一切，都在为资产管理行业的大格局构建统一平台。

本次基金法草案的修订，有以下几大亮点值得关注。首先是将私募基金纳入监管，尤其是将股权类私募基金纳入监管，这也是基金法修订审议多年重点讨论的议题；其次，对基金的组织形式有所增加，目前的基金都是契约型，此次修订将补充两种新的形式理事会型和无限责任型，即通常所说的公司型与合伙型，但由于公司型与合伙型的名称容易产生歧义，因而在名称上有所更改；第三，基金行业管制放松，如产品核准制改为注册制，首次明确基金公司可以推行股权激励机制等。

❖ 证监会：拟推发起式基金

6 月 19 日，中国证监会正式向社会公布《关于修改〈证券投资基金运作管理办法〉第六条及第十二条的决定》。证监会有关负责人表示《运作办法》的修改是为推出发起式基金做法律上的准备，从而引入基金管理的内在约束机制，促进基金管理



公司股东、基金公司和管理层与基金持有人利益保持一致，更好体现持有人利益优先的原则。

本次修改主要的两项内容：一是修改《运作办法》第六条，为将来实行基金产品注册制预留空间；二是修改《运作办法》第十二条，为推出发起式基金预留空间。

❖ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

➤ 新上市

广发深证 100 指数分级基金于 6 月 12 日上市。

金鹰中证 500 指数分级基金于 7 月 3 日上市。

➤ 新成立

金鹰中证 500 指数分级基金于 6 月 5 日成立，首募 3.93 亿。

上证 180 等权重交易型开放式指数基金于 6 月 12 日成立，首募 12.7 亿。

博时标普 500 指数型基金（QDII）于 6 月 14 日成立，首募 3.10 亿。

华安沪深 300 指数分级基金于 6 月 25 日成立，首募 6.07 亿。

长安沪深 300 非周期行业指数基金于 6 月 25 日成立，首募 2.77 亿。

景顺长城上证 180 等权重联接基金于 6 月 25 日成立，首募 2.44 亿。

招商中证大宗商品股票指数分级基金于 6 月 28 日成立，首募 10.63 亿。

➤ 新发行

华安沪深 300 指数分级基金于 6 月 1 日起发行。

万家中证创业成长指数分级基金于 7 月 2 日起发行。

➤ 新获批

华夏香港恒生指数基金（QDII）于 6 月 14 日获批。

易方达恒生中国企业 ETF 及其联接基金（QDII）于 6 月 14 日获批。

大成中证 500 沪市交易型开放式指数基金及其联接基金于 6 月 25 日获批。

➤ 新申报

国联安基金于 6 月 14 日申报中证医药 100 指数基金。

华安基金于 6 月 18 日申报纳斯达克 100 指数基金（QDII）。

招商基金于 6 月 19 日申报标普高收益红利贵族指数增强型基金（QDII）。



→ 市场要点

本地 ETF：本期沪深交易所上市的 ETF 资产净值由上期 1278.80 亿元减少至本期的 1185.74 亿元。从基金份额和净值来看，本期深证 100ETF 基金份额增量最多，增加了 4.85 亿份，中小板 ETF 净值增量最多，增加了 4.75 亿元。而从申购赎回情况看，上证 50ETF 净申购金额最高，为 3.20 亿元；其次为深 100ETF 和 180ETF。从跟踪误差情况看，本期最低的两只 ETF 分别为上证 380ETF 和易方达创业板 ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额以华泰柏瑞沪深 300ETF 和上证 50ETF 领先，分别为 5.22 亿元和 3.85 亿元；换手率最高的为创业板 ETF，达到 11.34%。

LOF：本期 LOF 指数基金的场内份额规模为 45.52 亿份，较上月减少 1.80 亿份；场内资产净值为 31.506 亿元，较上月减少 3.80 亿元。

创新型指数基金：本期新上市的创新型分级基金是广发深证 100 指数分级基金。创新型指数基金的场内规模为 334.61 亿份，较上月增加 62.52 亿份；场内资产净值为 269.55 亿元，较上月增加 31.25 亿元。

境外 ETF：24 只 ETF 本期末资产规模为 570.46 亿港币，较上期减少 5.19%。在本期市场普跌的背景下，沪深 300 能源 ETF 净值跌幅最大，达到 15.87%；沪深 300 医药 ETF 本期净值涨幅最高，为 5.3%。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 2.97%。从活跃程度看，安硕 A50ETF 日均成交金额最大，达到 6.91 亿港币，沪深 300 金融 ETF 本期日均换手率最高，达到 1.83%。

股指期货：6 月份沪深 300 指数收报于 2461.61，较上月跌幅为 -6.48%。而同期可比股指期货合约 IF1207、IF1209、IF1212 跌幅分别为 -6.32%、-5.83% 和 -5.69%。从成交情况看，五份合约累计成交量 7139091 手，较上月减少 0.95%，累计成交金额 54311.21 亿，较上月减少 4.46%。



→ 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	-6.07%	ETF
2	164205	天弘深证成指	深证成指	2010-8-12	-5.82%	LOF
3	161612	融通深证成指	深证成指	2010-11-15	-5.82%	开放式基金
4	163109	申万菱信深证成指分级	深证成指	2010-10-22	-5.79%	开放式基金
5	202017	南方深成 ETF 联接	深证成指	2009-12-9	-5.77%	开放式基金
6	159902	华夏中小板 ETF	中小板指	2006-6-8	-4.49%	ETF
7	163111	申万菱信中小板分级	中小板指	2012-5-8	-3.98%	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	-4.09%	开放式基金
9	159915	易方达创业板 ETF	创业板指	2011-9-20	-1.04%	ETF
10	110026	易方达创业板 ETF 联接	创业板指	2011-9-20	-0.99%	开放式基金
11	161613	融通创业板指	创业板指	2012-4-6	-1.37%	开放式基金
12	159907	广发中小板 300ETF	中小板 300	2011-6-3	-5.05%	ETF
13	162010	长城久兆中小板 300 分级	中小板 300	2012-1-30	-4.92%	开放式基金
14	270026	广发中小板 300ETF 联接	中小板 300	2011-6-9	-4.85%	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	-4.15%	开放式基金
16	161607	融通巨潮 100	巨潮 100	2005-5-12	-4.41%	LOF
17	161903	万家公用事业行业投资基金	巨潮服务指数	2005-8-15	-6.04%	LOF
18	159905	工银瑞信深证红利 ETF	深证红利	2010-11-5	-6.84%	ETF
19	481012	工银瑞信深证红利 ETF 联接	深证红利	2010-11-9	-6.51%	开放式基金
20	159906	大成深证成长 40ETF	深证成长 40	2010-12-21	-1.03%	ETF
21	090012	大成深证成长 40ETF 联接	深证成长 40	2010-10-21	-1.01%	开放式基金
22	159901	易方达深证 100ETF	深证 100	2006-3-24	-7.22%	ETF
23	165806	东吴深证 100 增强	深证 100	2012-3-9	-6.55%	LOF
24	110019	易方达深证 100ETF 联接	深证 100	2009-12-1	-6.81%	开放式基金
25	161604	融通深证 100	深证 100	2003-9-30	-6.78%	开放式基金
26	161812	银华深证 100	深证 100	2010-5-7	-7.01%	开放式基金
27	162714	广发深证 100 分级基金	深证 100	2012-5-7	-5.54%	开放式基金
28	217016	招商深证 100	深证 100	2010-6-22	-6.68%	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	-6.92%	开放式基金
30	159911	鹏华深证民营 ETF	深证民营	2011-9-2	-5.60%	ETF
31	206010	鹏华深证民营 ETF 联接	深证民营	2011-9-2	-5.28%	开放式基金
32	159912	汇添富深证 300ETF	深证 300	2011-9-16	-5.97%	ETF



33	160415	华安深证 300	深证 300	2011-9-2	-5.27%	LOF
34	233010	大摩深证 300	深证 300	2011-11-15	-6.89%	开放式基金
35	470068	汇添富深证 300ETF 联接	深证 300	2011-9-28	-5.67%	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	-5.69%	开放式基金
37	159913	交银深证 300 价值 ETF	深证 300 价值	2011-9-22	-6.97%	ETF
38	519706	交银深证 300 价值 ETF 联接	深证 300 价值	2011-9-28	-6.49%	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	-1.92%	ETF
40	020025	国泰中小板 300 成长 ETF 联接	中小板 300 成长	2012-3-15	-1.77%	开放式基金
41	159909	招商深证 TMT50ETF	深证 TMT50	2011-6-27	-5.44%	ETF
42	217019	招商深证 TMT50ETF 联接	深证 TMT50	2011-6-27	-5.15%	开放式基金
43	159918	嘉实中创 400 ETF	中创 400	2012-3-22	-4.19%	ETF
44	070030	嘉实中创 400ETF 联接	中创 400	2012-3-22	-4.01%	开放式基金
45	510210	富国上证综指 ETF	上证综指	2011-1-30	-4.49%	ETF
46	100053	富国上证综指 ETF 联接	上证综指	2011-1-30	-4.22%	开放式基金
47	470007	汇添富上证综指	上证综指	2009-7-1	-4.54%	开放式基金
48	510290	南方上证 380ETF	上证 380	2011-9-16	-7.10%	ETF
49	202025	南方上证 380ETF 联接	上证 380	2011-9-20	-6.78%	开放式基金
50	399011	中海上证 380	上证 380	2012-3-7	-6.81%	开放式基金
51	590007	中邮上证 380	上证 380	2011-11-22	-6.94%	开放式基金
52	510180	华安上证 180ETF	上证 180	2006-4-13	-5.29%	ETF
53	040180	华安上证 180ETF 联接	上证 180	2009-9-29	-5.10%	开放式基金
54	519180	万家上证 180	上证 180	2003-3-15	-4.89%	开放式基金
55	510880	华泰柏瑞红利 ETF	上证红利	2006-11-17	-5.70%	ETF
56	510050	华夏上证 50ETF	上证 50	2004-12-30	-4.09%	ETF
57	110003	易方达上证 50	上证 50	2004-3-22	-4.18%	开放式基金
58	399001	中海上证 50	上证 50	2010-3-25	-4.24%	开放式基金
59	510230	国泰上证 180 金融 ETF	180 金融	2011-3-31	-1.91%	ETF
60	020021	国泰上证 180 金融 ETF 联接	180 金融	2011-3-31	-1.79%	开放式基金
61	510010	交银 180 治理 ETF	180 治理	2009-9-25	-4.63%	ETF
62	519686	交银 180 治理 ETF 联接	180 治理	2009-9-29	-4.34%	开放式基金
63	510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF	180 成长	2011-8-4	-5.12%	ETF
64	240019	上证 180 成长 ETF 联接	180 成长	2011-8-9	-4.87%	开放式基金
65	510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	180 价值	2010-4-23	-3.13%	ETF
66	240016	上证 180 价值 ETF 联接	180 价值	2010-4-23	-3.10%	开放式基金
67	510060	工银上证央企 50ETF	上证央企 50	2009-8-26	-4.14%	ETF
68	510020	博时超大盘 ETF	超大盘	2009-12-29	-5.74%	ETF
69	050013	博时超大盘 ETF 联接	超大盘	2009-12-29	-5.45%	开放式基金
70	510130	易方达上证中盘 ETF	上证中盘	2010-3-29	-7.48%	ETF
71	110021	易方达上证中盘 ETF 联接	上证中盘	2010-3-31	-6.87%	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	-7.50%	ETF



73	460220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接	上证中小盘	2011-1-26	-7.17%	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	-4.57%	ETF
75	530010	建信上证社会责任 ETF 联接	上证社会责任	2010-5-28	-4.29%	开放式基金
76	510070	鹏华上证民企 50ETF	上证民企 50	2010-8-5	-5.64%	ETF
77	206005	鹏华上证民企 50ETF 联接	上证民企 50	2010-8-5	-5.41%	开放式基金
78	510420	上证 180 等权重 ETF	上证 180 等权重	2012-6-12	/	ETF
79	263001	上证 180 等权重联接基金	上证 180 等权重	2012-6-25	/	开放式基金
80	510270	中银上证国企 ETF	上证国企	2011-6-16	-6.00%	ETF
81	510110	海富通上证周期 ETF	上证周期	2010-9-19	-4.26%	ETF
82	519027	海富通上证周期 ETF 联接	上证周期	2010-9-28	-4.08%	开放式基金
83	510120	海富通上证非周期 ETF	上证非周期	2011-4-22	-5.90%	ETF
84	519032	海富通上证非周期 ETF 联接	上证非周期	2011-4-27	-5.60%	开放式基金
85	510190	华安上证龙头 ETF	上证龙头	2010-11-18	-3.36%	ETF
86	040190	华安上证龙头 ETF 联接	上证龙头	2010-11-18	-3.21%	开放式基金
87	510170	国联安上证商品 ETF	上证大宗商品	2010-11-26	-11.86%	ETF
88	257060	国联安上证商品 ETF 联接	上证大宗商品	2010-12-1	-11.25%	开放式基金
89	510260	诺安上证新兴产业 ETF	上证新兴产业	2011-4-7	-9.99%	ETF
90	320014	诺安上证新兴产业 ETF 联接	上证新兴产业	2011-4-7	-9.25%	开放式基金
91	510410	博时上证自然资源 ETF	上证自然资源	2012-4-10	-11.43%	ETF
92	050024	博时上证自然资源 ETF 联接	上证自然资源	2012-4-10	-10.97%	开放式基金
93	510150	招商上证消费 80ETF	上证消费 80	2010-12-8	-3.09%	ETF
94	217017	招商上证消费 80ETF 联接	上证消费 80	2010-12-8	-2.99%	开放式基金
95	159919	嘉实沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-7	-5.47%	ETF
96	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-4	-5.62%	ETF
97	160615	鹏华沪深 300	沪深 300	2009-4-3	-5.26%	LOF
98	160706	嘉实沪深 300	沪深 300	2005-8-29	-5.19%	LOF
99	160807	长盛沪深 300	沪深 300	2010-8-4	-5.21%	LOF
100	161811	银华沪深 300	沪深 300	2009-10-14	-5.32%	LOF
101	163407	兴全沪深 300	沪深 300	2010-11-2	-5.21%	LOF
102	163821	中银沪深 300 等权重	沪深 300	2012-5-17	0.20%	LOF
103	165309	建信沪深 300	沪深 300	2009-11-5	-5.31%	LOF
104	166007	中欧沪深 300	沪深 300	2010-6-24	-5.18%	LOF
105	000051	华夏沪深 300	沪深 300	2009-7-10	-5.28%	开放式基金
106	020011	国泰沪深 300	沪深 300	2007-11-11	-5.24%	开放式基金
107	050002	博时裕富沪深 300	沪深 300	2003-8-26	-5.33%	开放式基金
108	100038	富国沪深 300	沪深 300	2009-12-16	-5.13%	开放式基金
109	110020	易方达沪深 300	沪深 300	2009-8-26	-5.27%	开放式基金
110	160417	华安沪深 300 指数分级	沪深 300	2012-6-25	/	开放式基金
111	161207	国投瑞银瑞和 300	沪深 300	2009-10-14	-5.04%	开放式基金
112	165515	信诚沪深 300 指数分级	沪深 300	2012-2-1	-6.14%	开放式基金



113	166802	浙商沪深 300 分级基金	沪深 300	2012-5-7	-4.90%	开放式基金
114	200002	长城久泰沪深 300	沪深 300	2004-5-21	-5.22%	开放式基金
115	202015	南方沪深 300	沪深 300	2009-3-25	-5.44%	开放式基金
116	270010	广发沪深 300	沪深 300	2008-12-30	-5.37%	开放式基金
117	450008	国富沪深 300	沪深 300	2009-9-3	-3.35%	开放式基金
118	481009	工银瑞信沪深 300	沪深 300	2009-3-5	-5.39%	开放式基金
119	519116	浦银安盛沪深 300	沪深 300	2010-12-10	-5.79%	开放式基金
120	519300	大成沪深 300	沪深 300	2006-4-6	-5.44%	开放式基金
121	660008	农银汇理沪深 300	沪深 300	2011-4-12	-5.41%	开放式基金
122	510160	南方小康产业 ETF	小康产业	2010-8-27	-7.45%	ETF
123	202021	南方小康产业 ETF 联接	小康产业	2010-8-27	-7.07%	开放式基金
124	162307	海富通中证 100	中证 100	2009-10-30	-4.27%	LOF
125	162509	国联安双禧中证 100	中证 100	2010-4-16	-4.32%	开放式基金
126	163808	中银中证 100	中证 100	2009-9-4	-4.21%	开放式基金
127	213010	宝盈中证 100	中证 100	2010-2-8	-5.12%	开放式基金
128	240014	华宝兴业中证 100	中证 100	2009-9-29	-4.22%	开放式基金
129	320010	诺安中证 100	中证 100	2009-10-27	-4.38%	开放式基金
130	410008	华富中证 100	中证 100	2009-12-30	-4.27%	开放式基金
131	519100	长盛中证 100	中证 100	2006-11-22	-4.27%	开放式基金
132	160808	长盛同瑞中证 200 分级基金	中证 200	2011-12-16	-6.74%	开放式基金
133	290010	泰信中证 200	中证 200	2011-6-9	-7.60%	开放式基金
134	160119	南方中证 500	中证 500	2009-9-25	-7.07%	LOF
135	160616	鹏华中证 500	中证 500	2010-2-5	-6.91%	LOF
136	161017	富国中证 500	中证 500	2011-10-12	-6.34%	LOF
137	162711	广发中证 500	中证 500	2009-11-26	-6.72%	LOF
138	162107	金鹰中证 500 指数分级	中证 500	2012-6-5	/	开放式基金
139	162216	泰达宏利中证 500	中证 500	2011-12-1	-6.96%	开放式基金
140	164809	工银瑞信睿智中证 500 分级	中证 500	2012-1-31	-7.25%	开放式基金
141	165511	信诚中证 500 分级	中证 500	2011-2-11	-7.56%	开放式基金
142	660011	农银汇理中证 500	中证 500	2011-11-29	-6.98%	开放式基金
143	160806	长盛同庆中证 800 分级基金	中证 800	2012-5-12	-4.85%	开放式基金
144	161211	国投瑞银沪深 300 金融	沪深 300 金融	2010-4-9	-2.75%	LOF
145	310398	申万菱信沪深 300 价值	沪深 300 价值	2010-2-11	-3.93%	开放式基金
146	519671	银河沪深 300 价值	沪深 300 价值	2009-12-28	-3.98%	开放式基金
147	161907	万家中证红利	中证红利	2011-3-17	-5.74%	LOF
148	090010	大成中证红利	中证红利	2010-2-2	-5.60%	开放式基金
149	100032	富国天鼎中证红利	中证红利	2008-11-20	-4.99%	开放式基金
150	160716	嘉实基本面 50	基本面 50	2009-12-30	-2.75%	LOF
151	163001	长信中证央企 100	中证央企 100	2010-3-26	-4.41%	LOF
152	162213	泰达宏利中证财富大盘	中证财富大盘	2010-4-23	-4.36%	开放式基金



153	090016	大成中证内地消费主题	中证内地消费	2011-11-8	-4.11%	开放式基金
154	161819	银华中证内地资源分级基金	中证内地资源	2011-12-8	-11.48%	开放式基金
155	690008	民生加银中证内地资源	中证内地资源	2012-3-8	-7.69%	开放式基金
156	163209	诺安中证创业成长分级基金	中证创业成长	2012-3-29	-3.28%	开放式基金
157	161217	国投瑞银中证上游	中证上游	2011-7-21	-11.15%	开放式基金
158	161213	国投瑞银中证下游	中证下游	2010-12-16	-2.83%	LOF
159	585001	东吴中证新兴产业	中证新兴产业	2011-2-1	-7.12%	开放式基金
160	519117	浦银安盛中证锐联基本面 400	基本面 400	2012-5-14	-0.50%	开放式基金
161	740101	长安沪深 300 非周期指数基金	沪深 300 非周期	2012-6-25	/	开放式基金
162	161816	银华中证等权重 90	中证等权重 90	2011-3-17	-6.73%	开放式基金
163	210007	金鹰中证技术领先	中证技术领先	2011-6-1	-7.33%	开放式基金
164	519034	海富通中证内地低碳	中证内地低碳	2012-5-25	-3.81%	开放式基金
165	161715	招商中证大宗商品指数分级	中证大宗商品	2012-6-28	/	开放式基金
166	159916	建信深证基本面 60ETF	深基本面 60	2011-9-8	-6.69%	ETF
167	530015	建信深证基本面 60ETF 联接	深基本面 60	2011-9-8	-6.35%	开放式基金
168	159910	嘉实深证基本面 120ETF	深基本面 120	2011-8-1	-6.66%	ETF
169	070023	嘉实深证基本面 120ETF 联接	深基本面 120	2011-8-1	-6.30%	开放式基金
170	159908	博时深证基本面 200ETF	深基本面 200	2011-6-10	-6.77%	ETF
171	050021	博时深证基本面 200ETF 联接	深基本面 200	2011-6-10	-6.37%	开放式基金
172	160416	华安标普全球石油	标普全球石油	2012-3-29	3.27%	LOF
173	040002	华安 MSCI 中国 A 股	MSCI 中国 A 股	2002-11-8	-5.31%	开放式基金
174	180003	银华道琼斯 88 精选	道琼斯 88	2004-8-11	-3.65%	开放式基金

注：统计期为 2012.6.1—2012.6.29；“/”表示基金净值数据不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

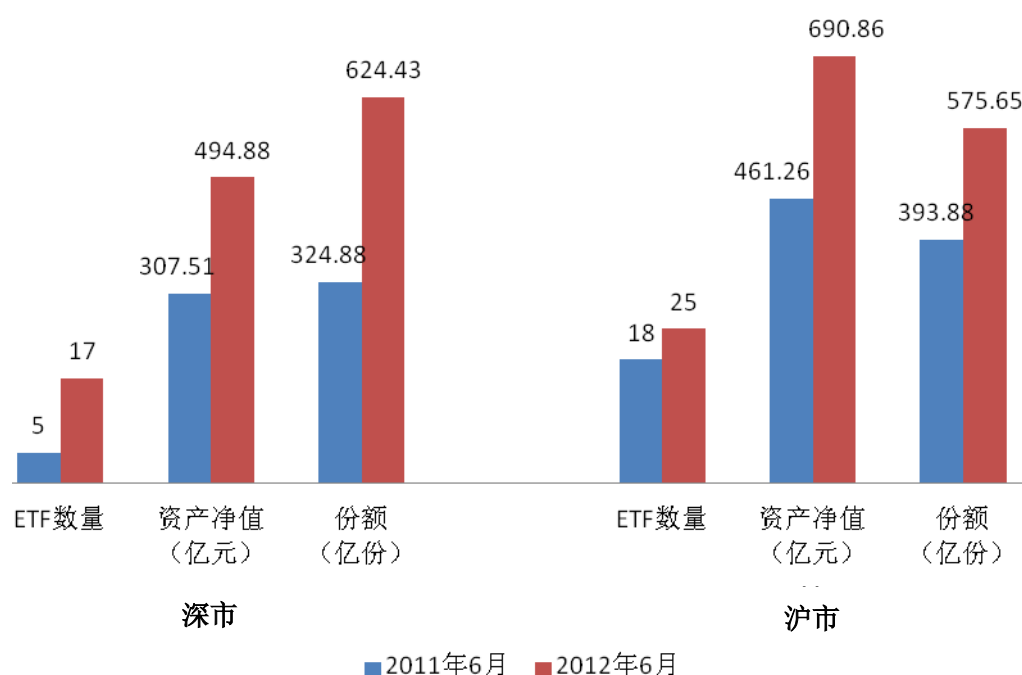
代码	简称	管理人	上市日期	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)
159901	深 100ETF	易方达	2006-04-24	340.11	205.49
159902	中小板 ETF	华夏	2006-09-05	21.38	45.04
159903	深成 ETF	南方	2010-02-02	35.75	34.58
159905	深红利 ETF	工银瑞信	2011-01-11	12.96	9.57
159906	深成长 ETF	大成	2011-02-23	19.68	15.13
159907	中小板 300ETF	广发	2011-08-10	9.01	7.45
159908	深 F200ETF	博时	2011-07-13	2.71	2.03
159909	深证 TMT50ETF	招商	2011-09-01	1.34	3.34
159910	深 F120ETF	嘉实	2011-09-27	5.59	4.75



159911	民营 ETF	鹏华	2011-10-14	1.34	3.51
159912	深 300ETF	汇添富	2011-11-24	2.98	2.66
159913	深价值	交银施罗德	2011-10-25	1.09	1.07
159915	创业板 ETF	易方达	2011-12-09	5.99	4.40
159916	深 F60	建信	2011-10-24	2.15	3.62
159917	中小成长	国泰	2012-04-06	0.55	0.56
159918	中创 400	嘉实	2012-05-11	2.78	2.70
159919	300ETF	嘉实	2012-05-28	159.03	148.98
510010	治理 ETF	交银施罗德	2009-12-15	44.70	28.52
510020	超大 ETF	博时	2010-03-19	60.19	10.89
510030	价值 ETF	华宝兴业	2010-05-28	4.44	10.05
510050	50ETF	华夏	2005-02-23	114.79	199.39
510060	央企 ETF	工银瑞信	2009-10-27	6.16	6.71
510070	民企 ETF	鹏华	2010-10-29	3.37	3.27
510090	责任 ETF	建信	2010-08-09	4.50	3.66
510110	周期 ETF	海富通	2010-11-15	1.44	3.04
510120	非周 ETF	海富通	2011-06-08	1.78	3.12
510130	中盘 ETF	易方达	2010-06-23	4.27	9.78
510150	消费 ETF	招商	2011-02-25	5.55	13.56
510160	小康 ETF	南方	2010-11-01	8.78	2.92
510170	商品 ETF	国联安	2011-01-25	4.40	9.81
510180	180ETF	华安	2006-05-18	177.47	95.30
510190	龙头 ETF	华安	2011-01-10	3.46	7.47
510210	综指 ETF	富国	2011-03-25	1.80	4.13
510220	中小 ETF	华泰柏瑞	2011-03-28	0.44	1.11
510230	金融 ETF	国泰	2011-05-23	2.16	6.52
510260	新兴 ETF	诺安	2011-06-08	8.90	6.26
510270	国企 ETF	中银	2011-08-18	1.65	1.19
510280	成长 ETF	华宝兴业	2011-10-18	3.91	3.70
510290	380ETF	南方	2011-11-08	2.50	2.13
510300	300ETF	华泰柏瑞	2012-05-28	95.91	238.53
510410	资源 ETF	博时	2012-05-11	4.31	3.85
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	2007-01-18	8.77	15.96
合计				1200.08	1185.74

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.6.29；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 2012.6.29；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	205.49	1.07%	17.33%
159902	中小板 ETF	45.04	0.60%	3.80%
159903	深成 ETF	34.58	0.27%	2.92%
159905	深红利 ETF	9.57	0.12%	0.81%
159906	深成长 ETF	15.13	0.18%	1.28%
159907	中小板 300ETF	7.45	0.06%	0.63%
159908	深 F200ETF	2.03	0.01%	0.17%
159909	深证 TMT50ETF	3.34	0.08%	0.28%
159910	深 F120ETF	4.75	0.02%	0.40%
159911	民营 ETF	3.51	0.04%	0.30%
159912	深 300ETF	2.66	0.01%	0.22%
159913	深价值	1.07	0.01%	0.09%
159915	创业板 ETF	4.40	0.27%	0.37%
159916	深 F60	3.62	0.03%	0.30%
159917	中小成长	0.56	0.01%	0.05%



159918	中创 400	2.70	0.04%	0.23%
159919	300ETF	148.98	0.13%	12.56%
深市合计		494.88		41.74%
510010	治理 ETF	28.52	0.04%	2.41%
510020	超大 ETF	10.89	0.02%	0.92%
510030	价值 ETF	10.05	0.01%	0.85%
510050	50ETF	199.39	0.29%	16.82%
510060	央企 ETF	6.71	0.01%	0.57%
510070	民企 ETF	3.27	0.04%	0.28%
510090	责任 ETF	3.66	0.01%	0.31%
510110	周期 ETF	3.04	0.00%	0.26%
510120	非周 ETF	3.12	0.02%	0.26%
510130	中盘 ETF	9.78	0.04%	0.82%
510150	消费 ETF	13.56	0.11%	1.14%
510160	小康 ETF	2.92	0.01%	0.25%
510170	商品 ETF	9.81	0.03%	0.83%
510180	180ETF	95.30	0.10%	8.04%
510190	龙头 ETF	7.47	0.01%	0.63%
510210	综指 ETF	4.13	0.00%	0.35%
510220	中小 ETF	1.11	0.00%	0.09%
510230	金融 ETF	6.52	0.02%	0.55%
510260	新兴 ETF	6.26	0.06%	0.53%
510270	国企 ETF	1.19	0.00%	0.10%
510280	成长 ETF	3.70	0.02%	0.31%
510290	380ETF	2.13	0.01%	0.18%
510300	300ETF	238.53	0.20%	20.12%
510410	资源 ETF	3.85	0.01%	0.32%
510880	红利 ETF	15.96	0.03%	1.35%
沪市合计		690.86		58.26%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.6.29，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	4.85	1.45%	-12.83	-5.88%
159902	中小板 ETF	3.11	17.05%	4.75	11.78%
159903	深成 ETF	0.18	0.50%	-2.05	-5.59%
159905	深红利 ETF	-0.08	-0.62%	-0.77	-7.48%
159906	深成长 ETF	0.04	0.19%	-0.13	-0.84%

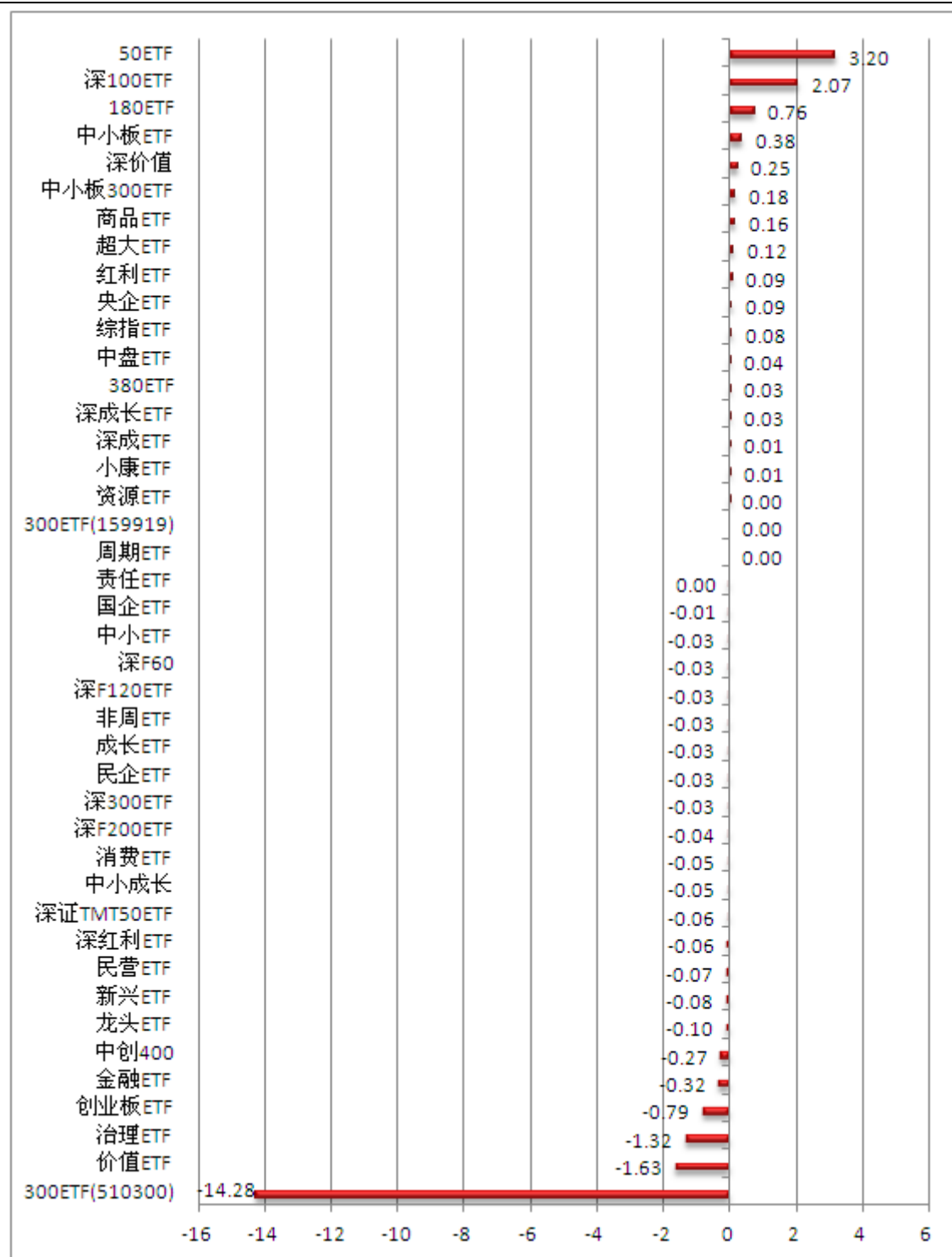


159907	中小板 300ETF	0.22	2.46%	-0.20	-2.64%
159908	深 F200ETF	-0.05	-1.73%	-0.19	-8.34%
159909	深证 TMT50ETF	-0.03	-2.17%	-0.25	-7.08%
159910	深 F120ETF	-0.03	-0.55%	-0.37	-7.15%
159911	民营 ETF	-0.03	-2.36%	-0.31	-8.09%
159912	深 300ETF	-0.04	-1.47%	-0.21	-7.36%
159913	深价值	0.25	30.15%	0.19	21.13%
159915	创业板 ETF	-0.88	-12.74%	-0.69	-13.65%
159916	深 F60	-0.01	-0.66%	-0.28	-7.28%
159917	中小成长	-0.05	-8.11%	-0.06	-9.39%
159918	中创 400	-0.30	-9.88%	-0.43	-13.64%
159919	300ETF	-17.44	-9.88%	-25.90	-14.81%
510010	治理 ETF	-2.01	-4.30%	-2.73	-8.74%
510020	超大 ETF	0.57	0.96%	-0.55	-4.82%
510030	价值 ETF	-0.74	-14.29%	-2.05	-16.96%
510050	50ETF	1.65	1.46%	-5.51	-2.69%
510060	央企 ETF	0.08	1.32%	-0.20	-2.93%
510070	民企 ETF	-0.03	-0.88%	-0.23	-6.60%
510090	责任 ETF	-0.01	-0.22%	-0.18	-4.73%
510110	周期 ETF	-0.01	-0.69%	-0.16	-5.05%
510120	非周 ETF	-0.01	-0.56%	-0.22	-6.52%
510130	中盘 ETF	0.03	0.71%	-0.71	-6.81%
510150	消费 ETF	-0.03	-0.54%	-0.51	-3.63%
510160	小康 ETF	0.02	0.23%	-0.23	-7.21%
510170	商品 ETF	0.09	2.09%	-1.09	-9.98%
510180	180ETF	0.30	0.17%	-5.16	-5.13%
510190	龙头 ETF	-0.05	-1.42%	-0.37	-4.67%
510210	综指 ETF	0.04	2.27%	-0.10	-2.38%
510220	中小 ETF	-0.01	-2.22%	-0.12	-9.42%
510230	金融 ETF	-0.10	-4.42%	-0.43	-6.23%
510260	新兴 ETF	-0.12	-1.33%	-0.78	-11.13%
510270	国企 ETF	-0.02	-1.20%	-0.09	-7.19%
510280	成长 ETF	-0.03	-0.76%	-0.23	-5.88%
510290	380ETF	0.04	1.63%	-0.13	-5.72%
510300	300ETF	-6.05	-5.93%	-30.13	-11.22%
510410	资源 ETF	-0.04	-0.92%	-0.54	-12.30%
510880	红利 ETF	0.05	0.57%	-0.87	-5.16%
合计		-16.69		-93.06	

注：统计期为2012.6.1-2012.6.29。



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	-7.22%	0.36%	6.46%	0.19%



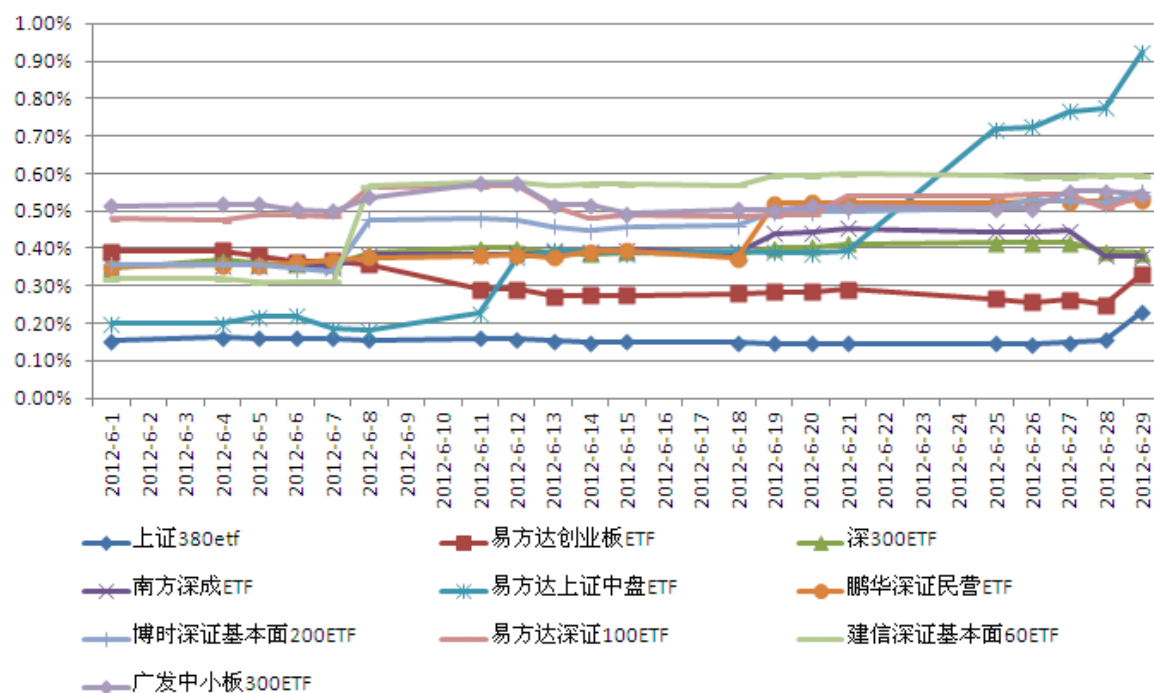
159902	中小板 ETF	-4.49%	0.33%	4.57%	0.34%
159903	深成 ETF	-6.07%	0.25%	6.74%	0.22%
159905	深红利 ETF*	-6.84%	0.63%	6.83%	0.52%
159906	深成长 40ETF	-1.03%	0.34%	6.22%	0.57%
159907	中小 300ETF	-5.05%	0.00%	3.73%	0.16%
159908	深 F200	-6.77%	0.28%	5.35%	-0.11%
159909	TMT50ETF	-5.44%	0.30%	6.68%	0.18%
159910	深 F120ETF	-6.66%	0.45%	5.32%	0.08%
159911	民营 ETF	-5.60%	0.23%	3.27%	0.30%
159912	深 300ETF	-5.97%	0.35%	6.76%	0.13%
159913	深价值	-6.97%	0.40%	7.14%	-0.03%
159915	创业板 ETF	-1.04%	0.02%	0.23%	0.61%
159916	深 F60	-6.69%	0.37%	6.00%	0.24%
159917	中小成长 *	-1.92%	0.43%	0.20%	0.06%
159918	中创 400*	-4.19%	-0.08%	-3.35%	0.12%
159919	300ETF*	-5.47%	1.01%	-4.76%	1.10%
510010	180 治理 ETF	-4.63%	1.22%	6.33%	1.61%
510020	超大 ETF	-5.74%	1.00%	9.04%	1.07%
510030	180 价值 ETF	-3.13%	1.57%	4.04%	1.92%
510050	50ETF	-4.09%	1.22%	7.08%	1.44%
510060	央企 ETF	-4.14%	1.62%	2.65%	2.36%
510070	民企 ETF	-5.64%	0.90%	5.20%	0.98%
510090	责任 ETF	-4.57%	1.16%	5.86%	1.26%
510110	周期 ETF	-4.26%	1.43%	6.41%	0.39%
510120	非周期 ETF	-5.90%	0.76%	2.51%	0.41%
510130	中盘 ETF	-7.48%	0.50%	5.41%	0.44%
510150	消费 ETF	-3.09%	-0.24%	8.72%	-2.23%
510160	小康 ETF	-7.45%	0.92%	1.87%	0.68%
510170	商品 ETF	-11.86%	0.42%	5.59%	0.36%
510180	180ETF	-5.29%	0.96%	6.54%	1.14%
510190	龙头 ETF	-3.36%	1.25%	7.03%	1.08%
510210	上证综指 ETF	-4.49%	1.70%	3.19%	2.01%
510220	中小盘 ETF	-7.50%	0.40%	4.50%	0.02%
510230	180 金融 ETF	-1.91%	1.68%	8.29%	2.05%
510260	新兴产业 ETF	-9.99%	-0.09%	3.23%	-0.08%
510270	国企 ETF	-6.00%	1.05%	5.12%	1.16%
510280	成长 ETF	-5.12%	0.96%	7.26%	1.17%
510290	380ETF	-7.10%	0.17%	4.89%	0.22%
510300	300ETF*	-5.62%	0.86%	-4.89%	0.97%
510410	资源 ETF*	-11.43%	0.47%	-12.58%	0.65%



510880 红利 ETF -5.70% 1.35% 2.13% 1.65%

注：阶段=统计期；累计=年初至今。统计期为2012.6.1-2012.6.29。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 3：6 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 4：日均成交金额前 10 只 ETF（亿元）

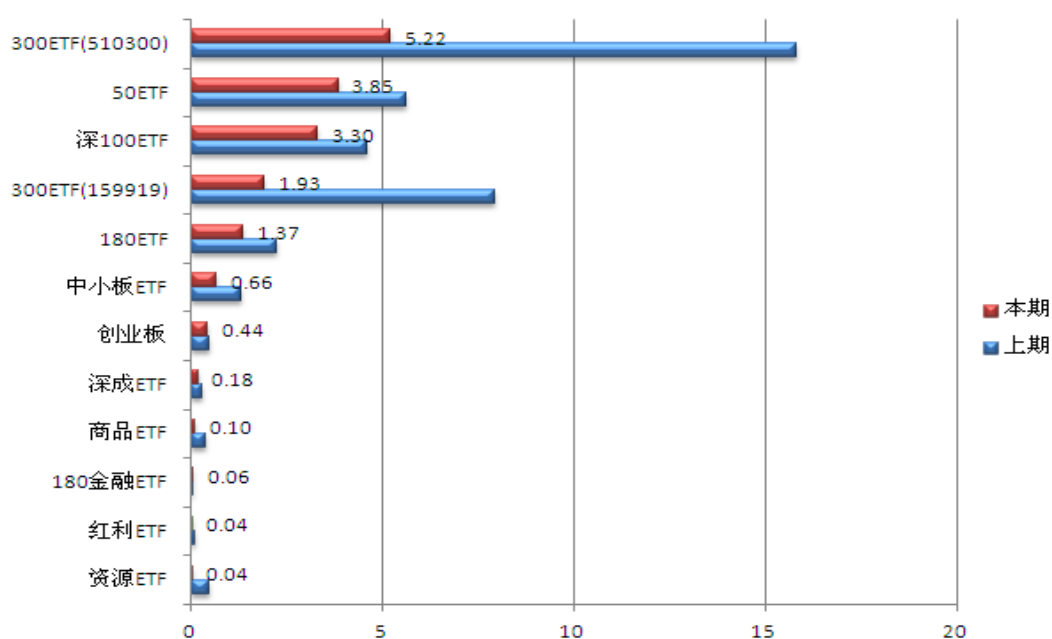
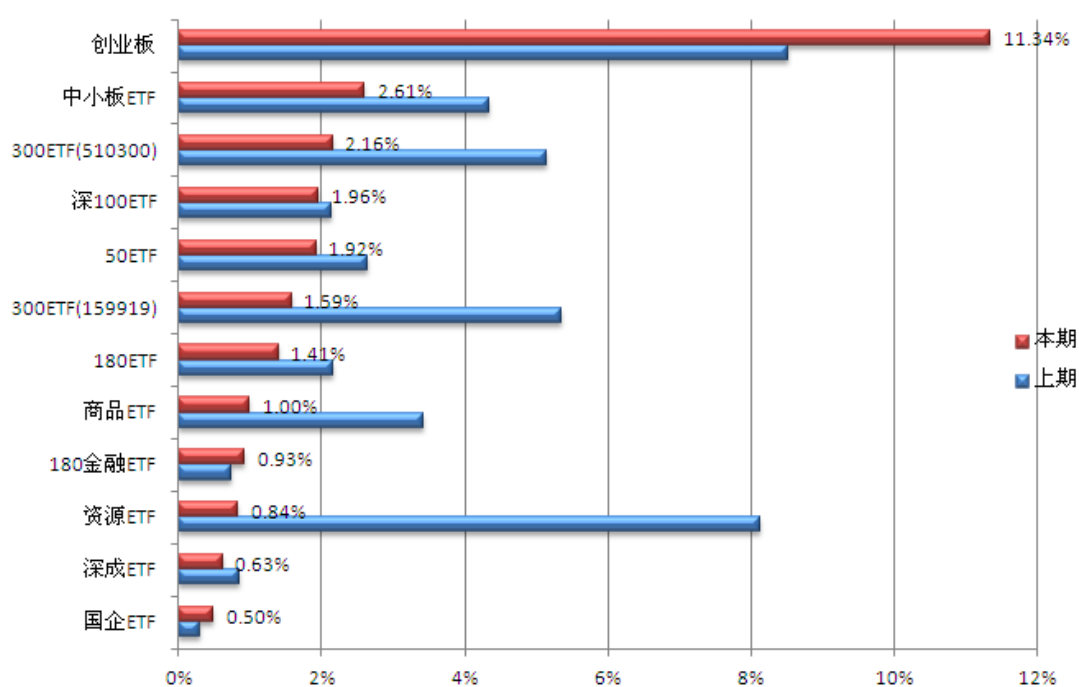


图 5：日均换手率前 10 只 ETF



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）		
		6 月	月度增量	增幅	6 月	月度增量	增幅
160119	南方 500	1.44	-0.01	-0.41%	1.24	-0.10	-7.45%
160125	南方中国	0.02	0.00	0.87%	0.02	0.00	-3.24%
160415	华安 S300	0.35	0.00	-0.82%	0.32	-0.02	-6.05%
160615	鹏华 300	0.41	0.00	-0.70%	0.36	-0.02	-5.93%
160616	鹏华 500	0.73	0.02	2.24%	0.53	-0.03	-4.82%
160706	嘉实 300	35.10	-0.94	-2.60%	23.02	-1.91	-7.65%
160716	嘉实 50	1.04	0.00	-0.33%	0.67	-0.02	-3.07%
160717	恒生 H 股	0.55	0.02	3.47%	0.37	0.01	1.59%
160807	长盛 300	0.08	0.00	-0.33%	0.07	0.00	-5.52%
161017	富国 500	0.08	0.00	4.23%	0.07	0.00	-2.38%
161211	国投金融	1.17	-0.19	-14.27%	0.91	-0.18	-16.62%
161213	国投消费	0.24	0.00	-0.68%	0.20	-0.01	-3.49%
161607	融通巨潮	0.66	0.00	-0.18%	0.50	-0.02	-4.58%
161714	招商金砖	0.02	0.00	0.39%	0.02	0.00	-0.33%
161811	银华 300	0.17	0.00	0.19%	0.13	-0.01	-5.14%
161903	万家公用	0.35	0.00	0.00%	0.20	-0.01	-6.04%
161907	万家红利	0.55	0.00	-0.51%	0.46	-0.03	-6.23%
162307	海富 100	0.20	0.00	2.29%	0.14	0.00	-2.08%
162411	华宝油气	0.04	-0.67	-94.10%	0.04	-0.58	-94.08%
162711	广发 500	1.59	-0.01	-0.63%	1.24	-0.10	-7.31%
163001	长信 100	0.12	0.00	-0.35%	0.10	0.00	-4.75%
163407	兴全 300	0.29	0.00	-1.69%	0.23	-0.02	-6.82%
164205	天弘深成	0.01	0.00	24.29%	0.01	0.00	17.05%
165309	建信 300	0.19	0.00	-0.91%	0.14	-0.01	-6.18%
165806	东吴 100	0.05	-0.01	-11.20%	0.04	-0.01	-17.02%
166007	中欧 300	0.05	0.00	-0.08%	0.04	0.00	-5.25%
合计		45.52	-1.80		31.06	-3.08	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.6.1-2012.6.29。

❖ 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）		
				6 月	月度	增幅	6 月	月度	增幅



				末	增量		末	增量	
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.27	-0.02	-1.03%	2.13	-0.14	-6.03%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.27	-0.02	-1.03%	2.13	-0.14	-6.03%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	13.41	0.06	0.47%	15.11	0.14	0.92%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	20.11	0.09	0.47%	15.33	-1.37	-8.20%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	47.47	10.15	27.20%	48.99	10.70	27.95%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	47.47	10.15	27.20%	31.62	1.76	5.90%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	22.84	5.34	30.53%	23.57	5.60	31.16%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	22.84	5.34	30.53%	6.94	0.10	1.48%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	3.34	0.12	3.78%	3.43	0.14	4.39%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	5.01	0.18	3.78%	2.59	-0.40	-13.30%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	50.20	18.05	56.14%	51.90	18.86	57.05%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	50.20	18.05	56.14%	20.48	3.83	22.98%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.54	0.23	17.35%	1.59	0.24	18.03%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	2.30	0.34	17.35%	2.08	-0.11	-4.86%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.61	-0.01	-2.06%	0.62	-0.01	-1.48%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.61	-0.01	-2.06%	0.55	-0.09	-14.60%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.12	-0.03	-19.18%	0.12	-0.03	-18.70%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.17	-0.04	-19.18%	0.17	-0.07	-28.52%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.02	0.00	0.32%	0.02	0.00	0.86%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.04	0.00	0.32%	0.03	0.00	-11.93%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.10	-0.01	-11.60%	0.10	-0.01	-11.25%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.15	-0.02	-11.60%	0.13	-0.03	-19.19%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	1.54	0.23	17.35%	1.59	0.24	18.03%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	2.30	0.34	17.35%	2.08	-0.11	-4.86%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.10	-0.01	-11.67%	0.11	-0.01	-11.16%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.15	-0.02	-11.67%	0.16	-0.04	-21.42%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.74	-0.08	-9.52%	0.75	-0.07	-8.98%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.74	-0.08	-9.52%	0.68	-0.14	-17.59%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.06	-0.02	-22.50%	0.07	-0.02	-22.12%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.10	-0.03	-22.50%	0.09	-0.03	-27.00%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.74	-0.36	-32.80%	0.75	-0.36	-32.58%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.74	-0.36	-32.80%	0.66	-0.42	-38.75%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	0.48	-0.08	-14.19%	0.48	-0.08	-13.76%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	0.48	-0.08	-14.19%	0.44	-0.12	-21.46%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	13.34	-1.95	-12.75%	13.43	-1.89	-12.31%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	20.01	-2.92	-12.75%	18.61	-4.67	-20.06%
合计				334.61	62.52		269.55	31.25	

注：数据来源：深交所，统计期为2012.6.1-2012.6.29。



❖ 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	0.37
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	3.72
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	444.35
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	69.31
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.58
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.90
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.71
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	8.52
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.77
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.21
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.51
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.23
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.91
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.25
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.93
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	24.14
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.61
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	0.70
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.09
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.24
3063	沪深 300 运输 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.04
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	0.24

注：基金资产单位为“亿港元”；截止日期为 2012.6.29。

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	9.74	-5.80%	9.87	-6.37%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	22.85	-5.58%	23.24	-3.38%
2823	安硕 A50ETF	10.1	-4.90%	9.95	-3.35%
2827	标智沪深 300ETF	27.55	-5.33%	26.58	-5.39%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	10.1	-3.81%	10.23	-2.96%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	19.68	-2.57%	19.98	-1.91%
2844	沪深 300 金融 ETF	8.43	-4.64%	8.51	-5.38%

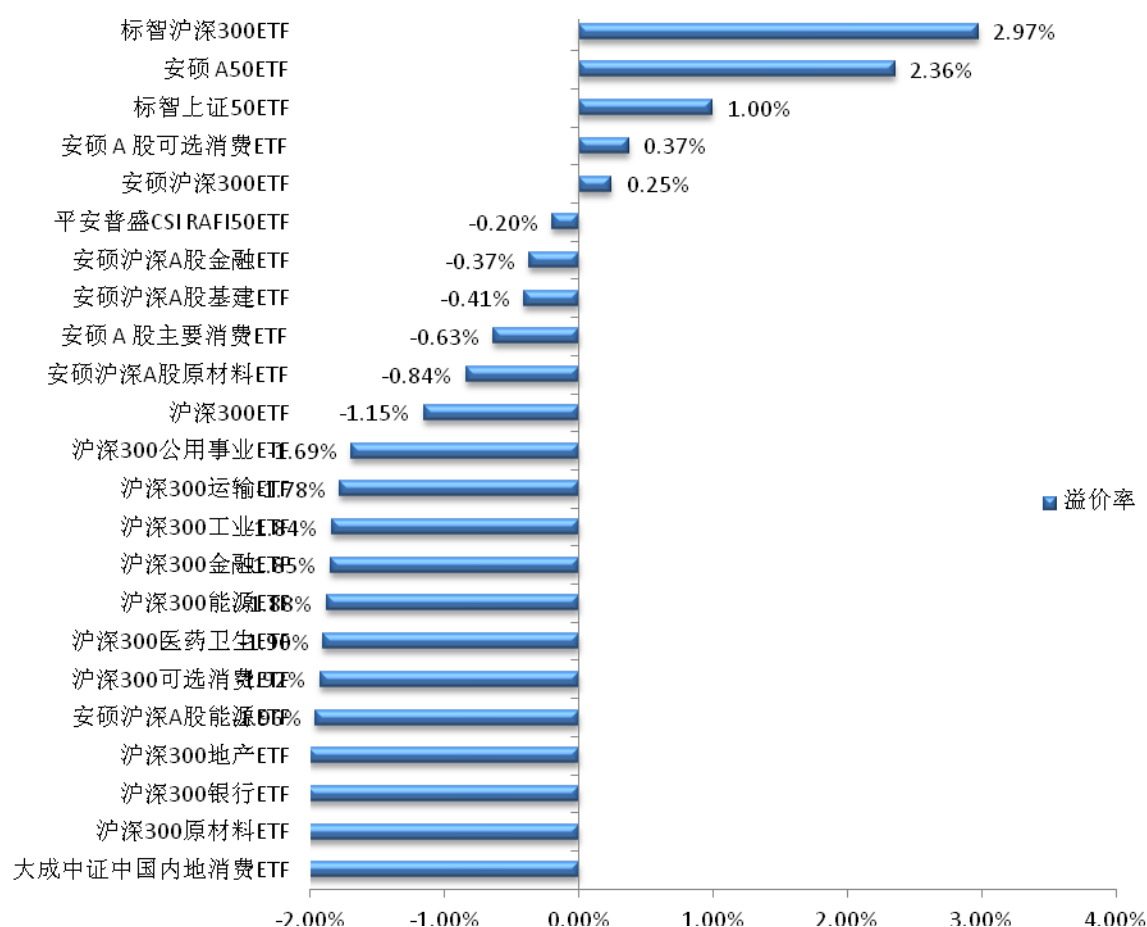


2846	安硕沪深 300ETF	22.2	-5.33%	21.85	-5.75%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	13.52	-8.77%	13.65	-7.73%
3005	沪深 300 工业 ETF	4.44	-9.76%	4.50	-10.48%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	9.43	-4.84%	9.46	-4.70%
3017	沪深 300 能源 ETF	6.68	-14.25%	6.71	-15.87%
3024	标智上证 50ETF	15.88	-5.59%	15.88	-3.97%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	7.07	-8.06%	7.12	-8.66%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	10.26	-11.40%	10.41	-11.32%
3049	沪深 300ETF	5.99	-5.07%	5.94	-7.56%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	10.02	-12.57%	10.07	-13.36%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	3.35	0.60%	3.41	0.91%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	10.92	5.00%	11.02	5.30%
3061	沪深 300 银行 ETF	7.97	-3.39%	8.10	-4.64%
3062	沪深 300 原材料 ETF	5.24	-12.81%	5.33	-13.10%
3063	沪深 300 运输 ETF	2.5	-6.72%	2.53	-7.00%
3071	大成中证中国内地消 ETF	9.17	-4.48%	9.40	-4.57%

注：收盘价、单位净值的单位为“港元”；统计期为 2012.6.1-2012.6.29；“/”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 2012.6.1-2012.6.29

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	46.62	-67.00%	1.02%	-67.19%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	2.00	-22.81%	0.01%	-18.01%
2823	安硕 A50ETF	69091.33	-18.83%	1.50%	-14.19%
2827	标智沪深 300ETF	1170.43	-52.52%	0.16%	-49.12%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	4.90	-75.53%	0.01%	-75.10%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	10.10	105.64%	0.04%	117.44%
2844	沪深 300 金融 ETF	129.43	122.80%	1.83%	135.24%
2846	安硕沪深 300ETF	155.71	-48.38%	0.17%	-45.40%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	7.62	-29.87%	0.04%	-24.02%



3005	沪深 300 工业 ETF	21.90	-63.02%	0.79%	-61.14%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	2.48	-67.57%	0.02%	-66.75%
3017	沪深 300 能源 ETF	33.67	-53.53%	0.94%	-49.64%
3024	标智上证 50ETF	1.81	-65.68%	0.01%	-63.93%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	37.29	-75.90%	0.26%	-74.28%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	4.86	-79.13%	0.02%	-78.09%
3049	沪深 300ETF	2482.52	-11.29%	1.01%	-6.27%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	4.71	-13.57%	0.03%	0.07%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	5.90	-87.41%	0.47%	-87.32%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	23.10	-48.73%	0.29%	-48.11%
3061	沪深 300 银行 ETF	240.19	55.74%	1.75%	60.56%
3062	沪深 300 原材料 ETF	53.71	-50.76%	1.47%	-47.11%
3063	沪深 300 运输 ETF	16.57	-55.05%	1.73%	-52.43%
3071	大成中证中国内地消 ETF	1.00	-65.63%	0.04%	-64.01%

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.6.1-2012.6.29；“/”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 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
IF1206	2630.00	2659.80	2511.00	2556.00	-79.60	0	-44773	2555.79	2863639	22009.33
IF1207	2626.80	2652.20	2431.00	2469.00	-159.80	56213	44900	2467.60	4165264	31465.83
IF1208	2582.20	2593.20	2435.80	2474.00	-85.80	4272	4272	2472.20	38981	292.00
IF1209	2634.80	2659.00	2446.00	2483.80	-153.80	9657	3191	2482.60	60885	464.62
IF1212	2657.80	2678.80	2472.80	2507.40	-151.20	2576	1453	2508.60	10322	79.43

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 2012.6.29

图 7: 沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

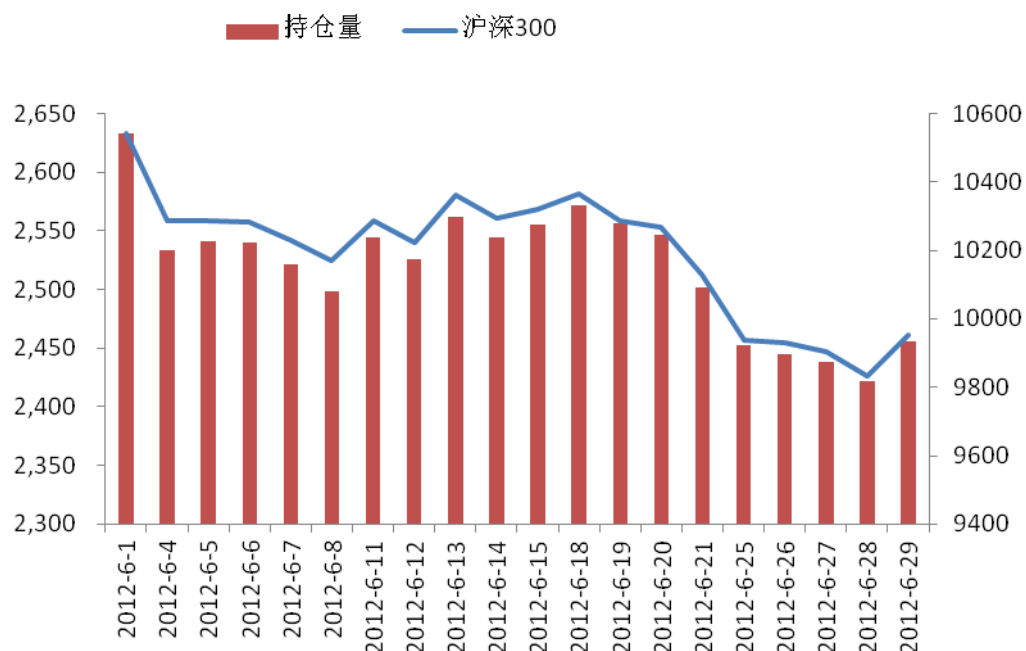
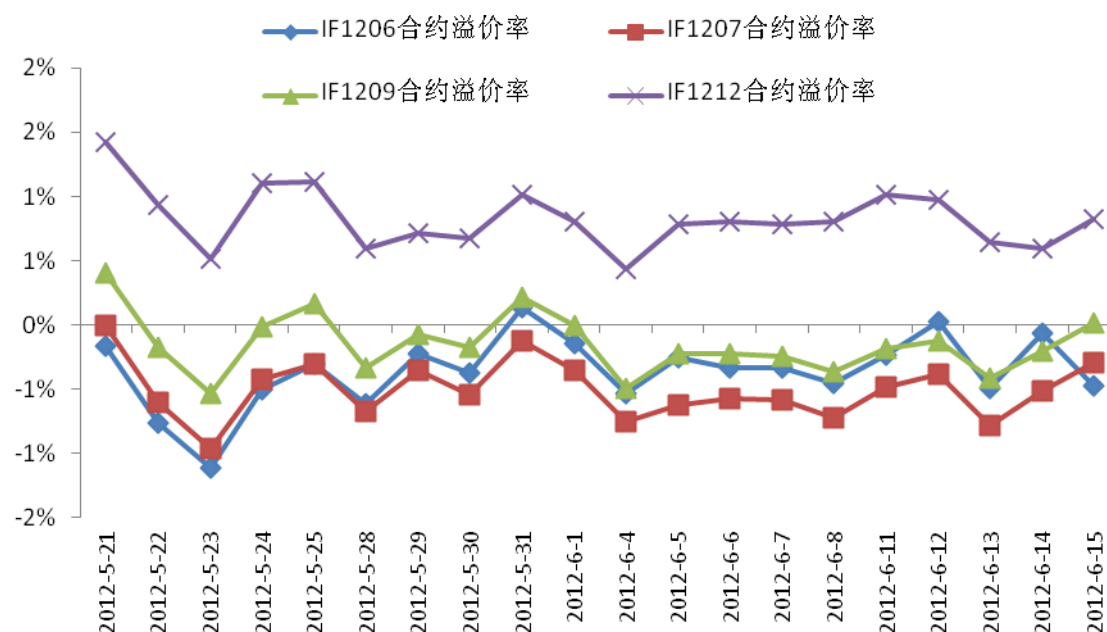
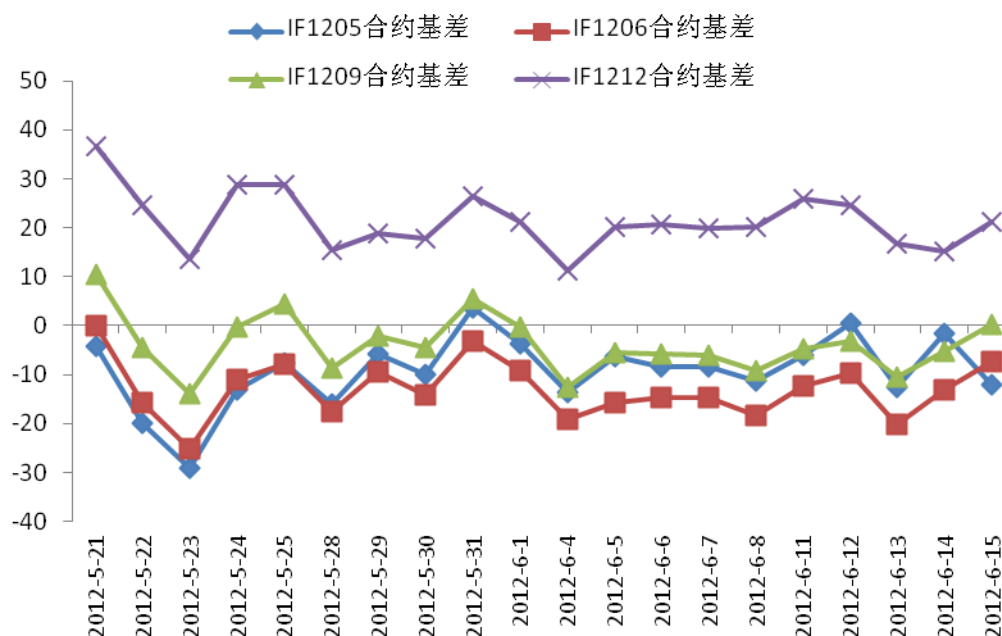


图 8: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注: 合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1; 统计期为 2012.5.21-2012.6.15

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 2012.5.21-2012.6.15



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>