



指数产品动态 (2012 年 9 月)

2012 年第 9 期 总第 32 期

■ 深圳证券信息有限公司指数事业部

➔ 业内动态

❖ 优化基金发展平台 推动基金产品创新

在 17 日举行的第六届指数与指数化投资论坛上，深交所副总经理林凡表示，深交所已把推动基金创新作为下一步的重点工作。一是进一步发展深交所多层次、多产品的资本市场，为基金行业的创新奠定基础；二是进一步丰富指数体系；三是进一步优化基金发展平台；四是根据券商创新要求，整合内部服务体系，建立基金创新一站式服务体系。特别是将从指数规划、指数设计、指数产品和创新服务、技术和交易机制创新等方面，为基金公司下一步的产品创新提供更加高效的服务。

❖ 指数发起式基金获批 掀起基金创新高潮

9 月 14 日，华夏基金的 5 只行业系列 ETF 基金同时获批。这 5 只基金分别跟踪上证主要消费、原材料、能源、金融和医药卫生指数。据悉，这也是监管部门和交易所力推 ETF 市场发展后首次获批的行业 ETF 发起式基金。

业内人士表示，行业 ETF 是基金行业的突破和创新，在目前的市场状况下，迎合了部分投资者的需求，“相对于单纯依赖基金经理的投资能力，这种指数工具留下了选择的空间，机构可以借此类产品更灵活地调整行业配置，个人投资者则可以把行业 ETF 作为股票替代来精准把握阶段性行情”。

❖ 首只全市场债券指数基金出炉

据易方达基金公告称，易方达中债-新综合债券指数基金将从 9 月 28 日起发行，这也是国内首只涵盖全市场的债券指数基金。

债券指数基金近来正成为市场各方关注的热点，多位业内人士表示：“今年可能是债券指数基金元年”。不过，现阶段债券指数型基金发展存三大障碍，包括可做标的的指数稀缺、券种流动性不足、流动性不足所引起的跟踪误差难以控制。而其中首先要解决的就是标的指数这一问题。一个合适的指数基金标的指数需要具备较好的透明度、合理的编制规则、市场代表性强并且能被市场认可。此类指数有待进一步开发。



❖ 本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况

➤ 新上市

泰信基本面 400 指数分级基金于 9 月 19 日上市。

诺德深证 300 指数分级基金于 9 月 24 日上市。

银华上证 50 等权 ETF 于 9 月 24 日上市。

长盛同辉深 100 等权重指数分级基金于 9 月 26 日上市。

华商中证 500 指数分级基金于 9 月 26 日上市。

大成中证 500 沪市 ETF 于 10 月 8 日上市。

➤ 新成立

农银汇理深证 100 指数增强型基金于 9 月 4 日成立，首募 4.14 亿。

易方达中小板指数分级基金于 9 月 20 日成立，首募 4.01 亿。

上投摩根中证消费服务领先指数基金于 9 月 25 日成立，首募 4.44 亿。

鹏华中证 A 股资源产业指数分级基金于 9 月 27 日成立，首募 6.43 亿。

➤ 新发行

工银瑞信睿智深证 100 指数分级基金于 9 月 3 日发行。

交银施罗德沪深 300 行业分层等权重指数基金于 9 月 25 日发行。

易方达中债新综合债券指数发起式基金于 9 月 28 日发行。

➤ 新申报

上投摩根于 9 月 7 日申报上证 180 高贝塔 ETF。

德邦基金于 9 月 10 日申报德信中证中高收益企债指数分级基金。

融通基金于 9 月 14 日申报标普中国可转债指数增强型基金。

华宸未来基金于 9 月 27 日申报沪深 300 指数增强型发起式基金。

南方基金于 9 月 28 日申报中证 500 ETF。



→ 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 1079.49 亿元增加至本期的 1177.71 亿元。从基金份额和净值来看，本期嘉实沪深 300ETF 基金份额增量和资产净值增量最多，分别为 101.26 亿份和 94.05 亿元。而从申购赎回情况看，商品 ETF 净申购金额最高，为 0.66 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的两只 ETF 分别为上证 380ETF 和嘉实中创 400ETF。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 6.68 亿元和 4.24 亿元。

LOF：2012 年 9 月，LOF 指数基金的场内规模为 43.85 亿份，较上月减少 0.42 亿份；场内资产净值为 28.13 亿元，较上月减少 0.70 亿元。

创新型指数基金：2012 年 9 月，创新型指数基金的场内规模为 401.69 亿份，较上月增加 49.55 亿份；场内资产净值为 322.28 亿元，较上月增加 45.50 亿元。

境外 ETF：23 只 ETF 本期末资产规模为 604.09 亿港元，较上期增加 9.66%。在本期市场普涨的背景下，沪深 300 原材料 ETF 净值涨幅最大，达到 8.77%；安硕沪深 A 股原材料 ETF 以 7.55% 的净值涨幅紧随其后。从溢价率情况看，本期标智沪深 300ETF 日均溢价率最高，为 3.32%。从活跃程度看，安硕 A50ETF 日均成交金额最大，达到 10.79 亿港元。其日均换手率也高达 2.29%，仅次于沪深 300 地产 ETF 的 3.92%。

股指期货：9 月份沪深 300 指数收报于 2293.11，较上月涨幅为 4.0%。而同期可比股指期货合约 IF1210、IF1212、IF1303 涨幅分别为 3.89%、3.95% 和 4.20%。从成交情况看，五份合约累计成交量 11013803 手，较上月增长 37.19%，累计成交金额 74890.60 亿，较上月增长 33.49%。



→ 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	5.65%	ETF
2	164205	天弘深证成指	深证成指	2010-8-12	5.22%	LOF
3	202017	南方深成 ETF 联接	深证成指	2009-12-9	5.32%	开放式基金
4	163109	申万菱信深证成指分级	深证成指	2010-10-22	5.14%	开放式基金
5	161612	融通深证成指	深证成指	2010-11-15	5.29%	开放式基金
6	159902	华夏中小板 ETF	中小板指	2006-6-8	3.04%	ETF
7	410010	华富中小板指数增强型基金	中小板指	2011-12-9	1.97%	开放式基金
8	163111	申万菱信中小板分级	中小板指	2012-5-8	2.80%	开放式基金
9	161118	易方达中小板分级证券投资基金	中小板指	2012-9-20	/	开放式基金
10	159915	易方达创业板 ETF	创业板指	2011-9-20	-2.47%	ETF
11	110026	易方达创业板 ETF 联接	创业板指	2011-9-20	-2.31%	开放式基金
12	161613	融通创业板指	创业板指	2012-4-6	-2.32%	开放式基金
13	159907	广发中小板 300ETF	中小板 300	2011-6-3	2.63%	ETF
14	270026	广发中小板 300ETF 联接	中小板 300	2011-6-9	2.50%	开放式基金
15	162010	长城久兆中小板 300 分级	中小板 300	2012-1-30	2.41%	开放式基金
16	162510	国联安双力中小板综指分级	中小板综指	2012-3-23	1.89%	开放式基金
17	161607	融通巨潮 100	巨潮 100	2005-5-12	4.22%	LOF
18	161903	万家公用事业行业投资基金	巨潮服务指数	2005-8-15	2.78%	LOF
19	159905	工银瑞信深证红利 ETF	深证红利	2010-11-5	3.96%	ETF
20	481012	工银瑞信深证红利 ETF 联接	深证红利	2010-11-9	3.73%	开放式基金
21	159906	大成深证成长 40ETF	深证成长 40	2010-12-21	3.27%	ETF
22	090012	大成深证成长 40ETF 联接	深证成长 40	2010-10-21	3.04%	开放式基金
23	159901	易方达深证 100ETF	深证 100	2006-3-24	4.47%	ETF
24	165806	东吴深证 100 增强	深证 100	2012-3-9	4.43%	LOF
25	161604	融通深证 100	深证 100	2003-9-30	4.49%	开放式基金
26	110019	易方达深证 100ETF 联接	深证 100	2009-12-1	4.20%	开放式基金
27	161812	银华深证 100	深证 100	2010-5-7	4.28%	开放式基金
28	217016	招商深证 100	深证 100	2010-6-22	4.12%	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	4.40%	开放式基金
30	162714	广发深证 100 分级基金	深证 100	2012-5-7	3.66%	开放式基金
31	660014	农银汇理深证 100 增强型基金	深证 100	2012-9-4	/	开放式基金
32	159911	鹏华深证民营 ETF	深证民营	2011-9-2	4.54%	ETF
33	206010	鹏华深证民营 ETF 联接	深证民营	2011-9-2	4.18%	开放式基金
34	159912	汇添富深证 300ETF	深证 300	2011-9-16	3.51%	ETF



35	160415	华安深证 300	深证 300	2011-9-2	3.48%	LOF
36	470068	汇添富深证 300ETF 联接	深证 300	2011-9-28	3.37%	开放式基金
37	233010	大摩深证 300	深证 300	2011-11-15	2.95%	开放式基金
38	700002	平安大华深证 300 增强型基金	深证 300	2011-12-20	2.88%	开放式基金
39	165707	诺德深证 300 分级基金	深证 300	2012-9-10	/	开放式基金
40	159913	交银深证 300 价值 ETF	深证 300 价值	2011-9-22	3.09%	ETF
41	519706	交银深证 300 价值 ETF 联接	深证 300 价值	2011-9-28	2.98%	开放式基金
42	159917	国泰中小板 300 成长 ETF	中小板 300 成长	2012-3-15	3.85%	ETF
43	020025	国泰中小板 300 成长 ETF 联接	中小板 300 成长	2012-3-15	2.93%	开放式基金
44	159909	招商深证 TMT50ETF	深证 TMT50	2011-6-27	1.28%	ETF
45	217019	招商深证 TMT50ETF 联接	深证 TMT50	2011-6-27	1.23%	开放式基金
46	159918	嘉实中创 400 ETF	中创 400	2012-3-22	0.34%	ETF
47	070030	嘉实中创 400ETF 联接	中创 400	2012-3-22	0.31%	开放式基金
48	160809	长盛同辉深证 100 等权重分级基金	深证 100 等权	2012-9-13	/	开放式基金
49	510210	富国上证综指 ETF	上证综指	2011-1-30	2.08%	ETF
50	470007	汇添富上证综指	上证综指	2009-7-1	2.05%	开放式基金
51	100053	富国上证综指 ETF 联接	上证综指	2011-1-30	2.04%	开放式基金
52	510290	南方上证 380ETF	上证 380	2011-9-16	1.35%	ETF
53	202025	南方上证 380ETF 联接	上证 380	2011-9-20	1.31%	开放式基金
54	590007	中邮上证 380	上证 380	2011-11-22	1.25%	开放式基金
55	399011	中海上证 380	上证 380	2012-3-7	1.14%	开放式基金
56	510180	华安上证 180ETF	上证 180	2006-4-13	3.91%	ETF
57	519180	万家上证 180	上证 180	2003-3-15	3.70%	开放式基金
58	040180	华安上证 180ETF 联接	上证 180	2009-9-29	3.86%	开放式基金
59	510880	华泰柏瑞红利 ETF	上证红利	2006-11-17	2.43%	ETF
60	510050	华夏上证 50ETF	上证 50	2004-12-30	4.16%	ETF
61	510430	银华上证 50 等权重 ETF	上证 50 等权重	2012-8-23	2.80%	ETF
62	110003	易方达上证 50	上证 50	2004-3-22	3.68%	开放式基金
63	399001	中海上证 50	上证 50	2010-3-25	2.42%	开放式基金
64	180033	银华上证 50 等权重 ETF 联接	上证 50 等权重	2012-8-29	0.30%	开放式基金
65	510230	国泰上证 180 金融 ETF	180 金融	2011-3-31	1.99%	ETF
66	020021	国泰上证 180 金融 ETF 联接	180 金融	2011-3-31	1.98%	开放式基金
67	510010	交银 180 治理 ETF	180 治理	2009-9-25	3.14%	ETF
68	519686	交银 180 治理 ETF 联接	180 治理	2009-9-29	3.05%	开放式基金
69	510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF	180 成长	2011-8-4	4.34%	ETF
70	240019	华宝兴业上证 180 成长 ETF 联接	180 成长	2011-8-9	4.07%	开放式基金
71	510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	180 价值	2010-4-23	1.88%	ETF
72	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
73	510060	工银上证央企 50ETF	上证央企 50	2009-8-26	2.85%	ETF
74	510020	博时超大盘 ETF	超大盘	2009-12-29	6.70%	ETF
75	050013	博时超大盘 ETF 联接	超大盘	2009-12-29	6.37%	开放式基金
76	510130	易方达上证中盘 ETF	上证中盘	2010-3-29	3.61%	ETF



77	110021	易方达上证中盘 ETF 联接	上证中盘	2010-3-31	3.36%	开放式基金
78	510220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	上证中小盘	2011-1-26	2.50%	ETF
79	460220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接	上证中小盘	2011-1-26	2.37%	开放式基金
80	510090	建信上证社会责任 ETF	上证社会责任	2010-5-28	2.73%	ETF
81	530010	建信上证社会责任 ETF 联接	上证社会责任	2010-5-28	2.59%	开放式基金
82	510070	鹏华上证民企 50ETF	上证民企 50	2010-8-5	2.81%	ETF
83	206005	鹏华上证民企 50ETF 联接	上证民企 50	2010-8-5	2.58%	开放式基金
84	510420	上证 180 等权重 ETF	上证 180 等权重	2012-6-12	3.92%	ETF
85	263001	上证 180 等权重联接基金	上证 180 等权重	2012-6-25	3.66%	开放式基金
86	510270	中银上证国企 ETF	上证国企	2011-6-16	4.28%	ETF
87	510110	海富通上证周期 ETF	上证周期	2010-9-19	4.00%	ETF
88	519027	海富通上证周期 ETF 联接	上证周期	2010-9-28	3.80%	开放式基金
89	510120	海富通上证非周期 ETF	上证非周期	2011-4-22	3.71%	ETF
90	519032	海富通上证非周期 ETF 联接	上证非周期	2011-4-27	3.47%	开放式基金
91	510190	华安上证龙头 ETF	上证龙头	2010-11-18	4.43%	ETF
92	040190	华安上证龙头 ETF 联接	上证龙头	2010-11-18	4.07%	开放式基金
93	510170	国联安上证商品 ETF	上证大宗商品	2010-11-26	8.63%	ETF
94	257060	国联安上证商品 ETF 联接	上证大宗商品	2010-12-1	8.02%	开放式基金
95	510260	诺安上证新兴产业 ETF	上证新兴产业	2011-4-7	3.08%	ETF
96	320014	诺安上证新兴产业 ETF 联接	上证新兴产业	2011-4-7	2.83%	开放式基金
97	510410	博时上证自然资源 ETF	上证自然资源	2012-4-10	8.32%	ETF
98	050024	博时上证自然资源 ETF 联接	上证资源	2012-4-10	7.88%	开放式基金
99	510150	招商上证消费 80ETF	上证消费 80	2010-12-8	3.98%	ETF
100	217017	招商上证消费 80ETF 联接	上证消费 80	2010-12-8	3.81%	开放式基金
101	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-4	4.02%	ETF
102	159919	嘉实沪深 300ETF	沪深 300	2012-5-7	4.04%	ETF
103	160706	嘉实沪深 300	沪深 300	2005-8-29	3.81%	LOF
104	160615	鹏华沪深 300	沪深 300	2009-4-3	3.64%	LOF
105	161811	银华沪深 300	沪深 300	2009-10-14	3.90%	LOF
106	165309	建信沪深 300	沪深 300	2009-11-5	3.72%	LOF
107	166007	中欧沪深 300	沪深 300	2010-6-24	3.79%	LOF
108	160807	长盛沪深 300	沪深 300	2010-8-4	3.51%	LOF
109	163407	兴全沪深 300	沪深 300	2010-11-2	3.89%	LOF
110	163821	中银沪深 300 等权重	沪深 300	2012-5-17	3.58%	LOF
111	050002	博时裕富沪深 300	沪深 300	2003-8-26	3.57%	开放式基金
112	200002	长城久泰沪深 300	沪深 300	2004-5-21	3.70%	开放式基金
113	519300	大成沪深 300	沪深 300	2006-4-6	3.81%	开放式基金
114	020011	国泰沪深 300	沪深 300	2007-11-11	3.71%	开放式基金
115	270010	广发沪深 300	沪深 300	2008-12-30	3.69%	开放式基金
116	481009	工银瑞信沪深 300	沪深 300	2009-3-5	3.80%	开放式基金
117	202015	南方沪深 300	沪深 300	2009-3-25	3.82%	开放式基金
118	000051	华夏沪深 300	沪深 300	2009-7-10	3.85%	开放式基金



119	110020	易方达沪深 300	沪深 300	2009-8-26	3.63%	开放式基金
120	450008	国富沪深 300	沪深 300	2009-9-3	3.41%	开放式基金
121	161207	国投瑞银瑞和 300	沪深 300	2009-10-14	3.53%	开放式基金
122	100038	富国沪深 300	沪深 300	2009-12-16	3.84%	开放式基金
123	519116	浦银安盛沪深 300	沪深 300	2010-12-10	3.19%	开放式基金
124	660008	农银汇理沪深 300	沪深 300	2011-4-12	3.85%	开放式基金
125	165515	信诚沪深 300 指数分级	沪深 300	2012-2-1	3.09%	开放式基金
126	166802	浙商沪深 300 分级基金	沪深 300	2012-5-7	3.74%	开放式基金
127	460300	华泰柏瑞沪深 300ETF 联接	沪深 300	2012-5-29	3.80%	开放式基金
128	160417	华安沪深 300 指数分级	沪深 300	2012-6-25	3.76%	开放式基金
129	160620	鹏华中证 A 股资源产业分级基金	A 股资源	2012-9-27	/	开放式基金
130	370023	上投摩根中证消费服务领先基金	消费服务	2012-9-25	/	开放式基金
131	510160	南方小康产业 ETF	小康产业	2010-8-27	3.29%	ETF
132	202021	南方小康产业 ETF 联接	小康产业	2010-8-27	3.11%	开放式基金
133	162307	海富通中证 100	中证 100	2009-10-30	3.85%	LOF
134	519100	长盛中证 100	中证 100	2006-11-22	3.81%	开放式基金
135	163808	中银中证 100	中证 100	2009-9-4	3.65%	开放式基金
136	240014	华宝兴业中证 100	中证 100	2009-9-29	3.79%	开放式基金
137	320010	诺安中证 100	中证 100	2009-10-27	3.78%	开放式基金
138	410008	华富中证 100	中证 100	2009-12-30	3.89%	开放式基金
139	213010	宝盈中证 100	中证 100	2010-2-8	4.26%	开放式基金
140	162509	国联安双禧中证 100	中证 100	2010-4-16	3.41%	开放式基金
141	290010	泰信中证 200	中证 200	2011-6-9	3.72%	开放式基金
142	160808	长盛同瑞中证 200 分级基金	中证 200	2011-12-16	2.58%	开放式基金
143	510440	大成中证 500 沪市 ETF	中证 500	2012-8-24	2.11%	ETF
144	160119	南方中证 500	中证 500	2009-9-25	1.78%	LOF
145	162711	广发中证 500	中证 500	2009-11-26	1.83%	LOF
146	160616	鹏华中证 500	中证 500	2010-2-5	1.66%	LOF
147	161017	富国中证 500	中证 500	2011-10-12	2.20%	LOF
148	165511	信诚中证 500 分级	中证 500	2011-2-11	1.22%	开放式基金
149	660011	农银汇理中证 500	中证 500	2011-11-29	1.79%	开放式基金
150	162216	泰达宏利中证 500	中证 500	2011-12-1	1.19%	开放式基金
151	164809	工银瑞信睿智中证 500 分级	中证 500	2012-1-31	1.69%	开放式基金
152	162107	金鹰中证 500 指数分级	中证 500	2012-6-5	-0.96%	开放式基金
153	090020	大成中证 500 沪市 ETF 联接	中证 500	2012-8-28	0.20%	开放式基金
154	166301	华商中证 500 分级基金	中证 500	2012-9-6	/	开放式基金
155	160806	长盛同庆中证 800 分级基金	中证 800	2012-5-12	2.65%	开放式基金
156	161211	国投瑞银沪深 300 金融	沪深 300 金融	2010-4-9	2.97%	LOF
157	519671	银河沪深 300 价值	沪深 300 价值	2009-12-28	1.95%	开放式基金
158	310398	申万菱信沪深 300 价值	沪深 300 价值	2010-2-11	2.08%	开放式基金
159	161907	万家中证红利	中证红利	2011-3-17	3.21%	LOF
160	100032	富国天鼎中证红利	中证红利	2008-11-20	3.97%	开放式基金



161	090010	大成中证红利	中证红利	2010-2-2	3.10%	开放式基金
162	160716	嘉实基本面 50	基本面 50	2009-12-30	1.56%	LOF
163	163001	长信中证央企 100	中证央企 100	2010-3-26	2.87%	LOF
164	162213	泰达宏利中证财富大盘	中证财富大盘	2010-4-23	1.76%	开放式基金
165	090016	大成中证内地消费主题	中证内地消费	2011-11-8	4.93%	开放式基金
166	161819	银华中证内地资源分级基金	中证内地资源	2011-12-8	8.76%	开放式基金
167	690008	民生加银中证内地资源	中证内地资源	2012-3-8	8.06%	开放式基金
168	163209	诺安中证创业成长分级基金	中证创业成长	2012-3-29	1.78%	开放式基金
169	161910	万家中证创业成长分级	中证创业成长	2012-8-2	0.10%	开放式基金
170	161217	国投瑞银中证上游	中证上游	2011-7-21	7.76%	开放式基金
171	161213	国投瑞银中证下游	中证下游	2010-12-16	2.88%	LOF
172	585001	东吴中证新兴产业	中证新兴产业	2011-2-1	1.91%	开放式基金
173	519117	浦银安盛中证锐联基本面 400	基本面 400	2012-5-14	2.11%	开放式基金
174	162907	泰信中证锐联基本面 400 分级基金	基本面 400	2012-9-7	/	开放式基金
175	740101	长安沪深 300 非周期指数基金	沪深 300 非周期	2012-6-25	3.03%	开放式基金
176	161816	银华中证等权重 90	中证等权重 90	2011-3-17	5.00%	开放式基金
177	210007	金鹰中证技术领先	中证技术领先	2011-6-1	0.97%	开放式基金
178	519034	海富通中证内地低碳	中证内地低碳	2012-5-25	1.12%	开放式基金
179	161715	招商中证大宗商品指数分级	中证大宗商品	2012-6-28	5.63%	开放式基金
180	159916	建信深证基本面 60ETF	深基本面 60	2011-9-8	3.72%	ETF
181	530015	建信深证基本面 60ETF 联接	深基本面 60	2011-9-8	3.52%	开放式基金
182	159910	嘉实深证基本面 120ETF	深基本面 120	2011-8-1	3.52%	ETF
183	070023	嘉实深证基本面 120ETF 联接	深基本面 120	2011-8-1	3.33%	开放式基金
184	159908	博时深证基本面 200ETF	深基本面 200	2011-6-10	3.22%	ETF
185	050021	博时深证基本面 200ETF 联接	深基本面 200	2011-6-10	3.00%	开放式基金
186	040002	华安 MSCI 中国 A 股	MSCI 中国 A 股	2002-11-8	4.42%	开放式基金
187	180003	银华道琼斯 88 精选	道琼斯 88	2004-8-11	5.44%	开放式基金
188	540012	汇丰晋信行业龙头	恒生行业龙头	2012-8-1	4.16%	开放式基金

❖ 注：统计期为 2012.9.1-2012.9.30；“/”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

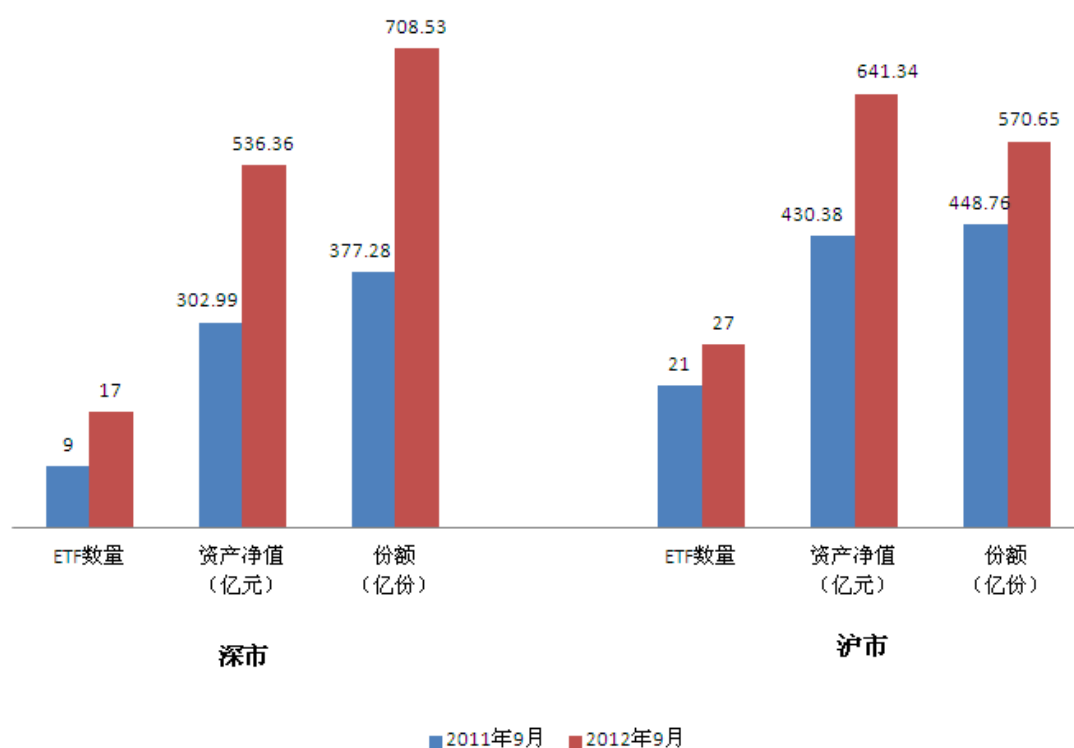
代码	简称	管理人	上市日期	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)
159901	深 100ETF	易方达	2006-04-24	328.64	182.20
159902	中小板 ETF	华夏	2006-09-05	21.38	42.83
159903	深成 ETF	南方	2010-02-02	36.44	32.36
159905	深红利 ETF	工银瑞信	2011-01-11	12.77	8.57
159906	深成长 ETF	大成	2011-02-23	19.18	13.92
159907	中小板 300ETF	广发	2011-08-10	8.67	6.76
159908	深 F200ETF	博时	2011-07-13	2.71	1.83
159909	深证 TMT50ETF	招商	2011-09-01	1.30	3.10
159910	深 F120ETF	嘉实	2011-09-27	6.21	4.73
159911	民营 ETF	鹏华	2011-10-14	1.26	3.08
159912	深 300ETF	汇添富	2011-11-24	2.93	2.42
159913	深价值	交银施罗德	2011-10-25	1.12	0.98
159915	创业板 ETF	易方达	2011-12-09	6.21	4.31
159916	深 F60	建信	2011-10-24	2.02	3.05
159917	中小成长	国泰	2012-04-06	0.72	0.70
159918	中创 400	嘉实	2012-05-11	2.66	2.42
159919	300ETF	嘉实	2012-05-28	254.31	223.11
510010	治理 ETF	交银施罗德	2009-12-15	44.50	26.30
510020	超大 ETF	博时	2010-03-19	59.20	10.37
510030	价值 ETF	华宝兴业	2010-05-28	4.84	10.22
510050	50ETF	华夏	2005-02-23	111.35	184.06
510060	央企 ETF	工银瑞信	2009-10-27	6.08	6.25
510070	民企 ETF	鹏华	2010-10-29	3.29	3.01
510090	责任 ETF	建信	2010-08-09	4.56	3.43
510110	周期 ETF	海富通	2010-11-15	1.39	2.78
510120	非周 ETF	海富通	2011-06-08	1.71	2.82
510130	中盘 ETF	易方达	2010-06-23	4.69	9.88
510150	消费 ETF	招商	2011-02-25	5.54	13.17
510160	小康 ETF	南方	2010-11-01	8.66	2.72
510170	商品 ETF	国联安	2011-01-25	5.39	11.80
510180	180ETF	华安	2006-05-18	172.22	86.97
510190	龙头 ETF	华安	2011-01-10	3.41	6.91
510210	综指 ETF	富国	2011-03-25	1.79	3.87
510220	中小 ETF	华泰柏瑞	2011-03-28	0.43	1.00
510230	金融 ETF	国泰	2011-05-23	2.69	7.59



510260	新兴 ETF	诺安	2011-06-08	8.76	5.56
510270	国企 ETF	中银	2011-08-18	1.55	1.06
510280	成长 ETF	华宝兴业	2011-10-18	3.90	3.47
510290	380ETF	南方	2011-11-08	2.08	1.64
510300	300ETF	华泰柏瑞	2012-05-28	89.06	207.51
510410	资源 ETF	博时	2012-05-11	4.04	3.55
510420	180EWETF	景顺长城	2012-7-9	6.19	5.74
510430	50 等权	银华	2012-9-24	4.80	4.93
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	2007-01-18	8.53	14.74
合计				1279.18	1177.71

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.9.30；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 2012.9.30；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	182.20	0.99%	15.47%
159902	中小板 ETF	42.83	0.58%	3.64%
159903	深成 ETF	32.36	0.27%	2.75%
159905	深红利 ETF	8.57	0.11%	0.73%
159906	深成长 ETF	13.92	0.19%	1.18%
159907	中小板 300ETF	6.76	0.06%	0.57%
159908	深 F200ETF	1.83	0.01%	0.16%
159909	深证 TMT50ETF	3.10	0.08%	0.26%
159910	深 F120ETF	4.73	0.03%	0.40%
159911	民营 ETF	3.08	0.04%	0.26%
159912	深 300ETF	2.42	0.01%	0.21%
159913	深价值	0.98	0.01%	0.08%
159915	创业板 ETF	4.31	0.27%	0.37%
159916	深 F60	3.05	0.02%	0.26%
159917	中小成长	0.70	0.01%	0.06%
159918	中创 400	2.42	0.03%	0.21%
159919	300ETF	223.11	0.20%	18.94%
深市合计		536.36		45.54%
510010	治理 ETF	26.30	0.04%	2.23%
510020	超大 ETF	10.37	0.04%	0.88%
510030	价值 ETF	10.22	0.01%	0.87%
510050	50ETF	184.06	0.27%	15.63%
510060	央企 ETF	6.25	0.01%	0.53%
510070	民企 ETF	3.01	0.04%	0.26%
510090	责任 ETF	3.43	0.01%	0.29%
510110	周期 ETF	2.78	0.00%	0.24%
510120	非周 ETF	2.82	0.01%	0.24%
510130	中盘 ETF	9.88	0.04%	0.84%
510150	消费 ETF	13.17	0.24%	1.12%
510160	小康 ETF	2.72	0.01%	0.23%
510170	商品 ETF	11.80	0.04%	1.00%
510180	180ETF	86.97	0.09%	7.38%
510190	龙头 ETF	6.91	0.01%	0.59%
510210	综指 ETF	3.87	0.00%	0.33%
510220	中小 ETF	1.00	0.00%	0.09%
510230	金融 ETF	7.59	0.02%	0.64%
510260	新兴 ETF	5.56	0.06%	0.47%
510270	国企 ETF	1.06	0.00%	0.09%
510280	成长 ETF	3.47	0.02%	0.29%
510290	380ETF	1.64	0.01%	0.14%



510300	300ETF	207.51	0.18%	17.62%
510410	资源 ETF	3.55	0.01%	0.30%
510420	180EWETF	5.74	0.01%	0.49%
510430	50 等权	4.93	0.01%	0.42%
510880	红利 ETF	14.74	0.03%	1.25%
沪市合计		641.34		54.46%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.9.30，中小板 ETF 为场内场外总资产，对指数覆盖率为对指数的流通市值覆盖率。

表 4：基金份额及资产净值变化情况

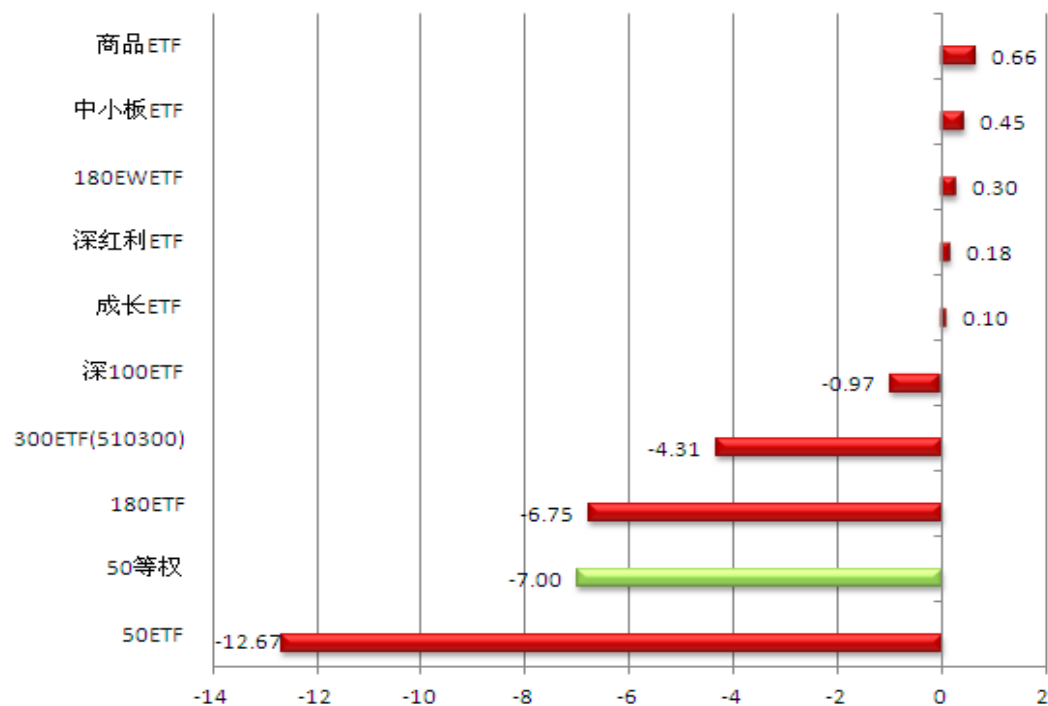
代码	简称	基金份额增量 (亿份)	增幅	资产净值增量 (亿元)	增幅
159901	深 100ETF	-1.90	-0.57%	6.78	3.87%
159902	中小板 ETF	0.00	0.00%	1.26	3.03%
159903	深成 ETF	-0.15	-0.40%	1.61	5.23%
159905	深红利 ETF	0.27	2.16%	0.50	6.21%
159906	深成长 ETF	0.00	0.00%	0.44	3.27%
159907	中小板 300ETF	-0.02	-0.23%	0.16	2.39%
159908	深 F200ETF	0.00	0.00%	0.06	3.22%
159909	深证 TMT50ETF	0.02	1.96%	0.10	3.26%
159910	深 F120ETF	-0.16	-2.51%	0.04	0.92%
159911	民营 ETF	-0.04	-3.08%	0.04	1.32%
159912	深 300ETF	0.02	0.55%	0.09	4.08%
159913	深价值	0.00	0.00%	0.03	3.09%
159915	创业板 ETF	-0.12	-1.89%	-0.19	-4.32%
159916	深 F60	-0.06	-2.88%	0.02	0.73%
159917	中小成长	0.01	1.41%	0.04	5.31%
159918	中创 400	-0.03	-1.12%	-0.02	-0.78%
159919	300ETF	101.26	66.16%	94.05	72.88%
510010	治理 ETF	-0.62	-1.37%	0.45	1.72%
510020	超大 ETF	-1.11	-1.84%	0.47	4.74%
510030	价值 ETF	-0.01	-0.21%	0.17	1.67%
510050	50ETF	-7.86	-6.59%	-5.12	-2.71%
510060	央企 ETF	-0.09	-1.46%	0.08	1.35%
510070	民企 ETF	-0.03	-0.90%	0.06	1.88%
510090	责任 ETF	0.06	1.33%	0.14	4.10%
510110	周期 ETF	-0.01	-0.71%	0.09	3.26%
510120	非周 ETF	-0.03	-1.72%	0.05	1.92%
510130	中盘 ETF	0.04	0.86%	0.43	4.50%



510150	消费 ETF	-0.03	-0.54%	0.44	3.42%
510160	小康 ETF	-0.06	-0.69%	0.07	2.58%
510170	商品 ETF	0.31	6.10%	1.56	15.26%
510180	180ETF	-13.68	-7.36%	-3.38	-3.74%
510190	龙头 ETF	-0.02	-0.58%	0.25	3.82%
510210	综指 ETF	-0.08	-4.28%	-0.09	-2.29%
510220	中小 ETF	0.00	0.00%	0.02	2.50%
510230	金融 ETF	-0.18	-6.27%	-0.35	-4.41%
510260	新兴 ETF	-0.15	-1.68%	0.07	1.35%
510270	国企 ETF	-0.03	-1.90%	0.02	2.30%
510280	成长 ETF	0.11	2.90%	0.24	7.37%
510290	380ETF	-0.02	-0.95%	0.01	0.38%
510300	300ETF	-1.97	-2.16%	3.60	1.77%
510410	资源 ETF	0.00	0.00%	0.27	8.32%
510420	180EWETF	0.34	5.81%	0.52	9.96%
510430	50 等权	-7.00	-59.32%	-6.87	-58.22%
510880	红利 ETF	-0.20	-2.29%	0.01	0.08%
合计		66.78		98.22	

注：统计期为 2012.9.1-2012.9.30。

图 2：净申购/赎回资金前五名（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

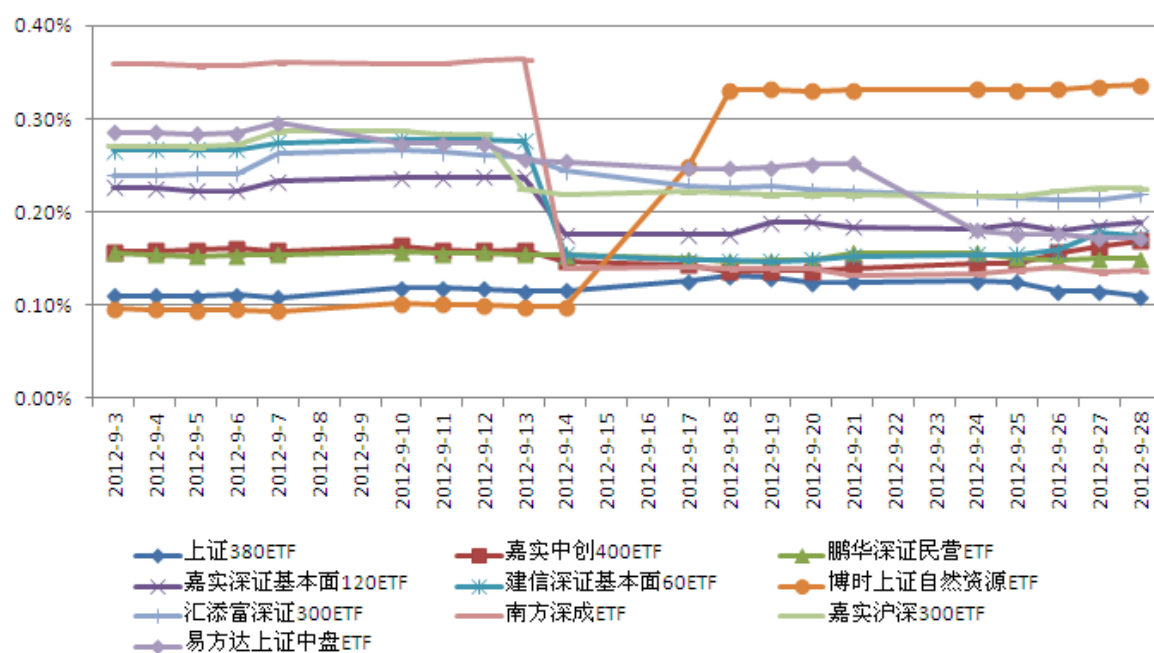
代码	简称	阶段收益	阶段超额收益	累计收益	累计超额收益
159901	深 100ETF	4.47%	-0.30%	-2.31%	0.76%
159902	中小板 ETF	3.04%	-0.03%	-0.54%	0.18%
159903	深成 ETF	5.64%	-0.06%	-2.02%	0.67%
159905	深红利 ETF	3.96%	-0.08%	-2.84%	1.26%
159906	深成长 40ETF	3.27%	-0.05%	0.28%	1.06%
159907	中小 300ETF	2.62%	-0.08%	-2.13%	-0.03%
159908	深 F200	3.22%	-0.11%	-5.39%	0.08%
159909	TMT50ETF	1.27%	-0.02%	2.09%	0.42%
159910	深 F120ETF	3.52%	-0.09%	-5.70%	0.36%
159911	民营 ETF	4.53%	-0.03%	-3.53%	0.49%
159912	深 300ETF	3.51%	-0.10%	-1.30%	0.39%
159913	深价值	3.09%	-0.09%	-4.62%	0.46%
159915	创业板 ETF	-2.47%	-0.06%	-5.10%	0.37%
159916	深 F60	3.72%	-0.09%	-4.96%	0.56%
159917	中小成长*	3.85%	-0.15%	-4.52%	-0.11%
159918	中创 400*	0.34%	-0.04%	-9.74%	-0.03%
159919	300ETF*	4.04%	0.04%	-10.81%	1.49%
510010	180 治理 ETF	3.14%	0.20%	-1.50%	1.87%
510020	超大 ETF	6.71%	-0.11%	5.54%	2.28%
510030	180 价值 ETF	1.89%	0.07%	-2.94%	2.17%
510050	50ETF	4.16%	0.17%	1.91%	2.19%
510060	央企 ETF	2.85%	-0.04%	-3.15%	3.08%
510070	民企 ETF	2.82%	0.29%	-0.76%	1.39%
510090	责任 ETF	2.72%	0.26%	-1.95%	1.74%
510110	周期 ETF	4.00%	0.16%	0.85%	0.96%
510120	非周期 ETF	3.72%	-0.17%	-3.62%	1.07%
510130	中盘 ETF	3.60%	-0.06%	-3.01%	0.66%
510150	消费 ETF	3.98%	0.68%	5.78%	-1.23%
510160	小康 ETF	3.29%	-0.14%	-3.97%	1.03%
510170	商品 ETF	8.64%	0.05%	3.69%	0.67%
510180	180ETF	3.91%	0.04%	0.20%	1.70%
510190	龙头 ETF	4.44%	0.14%	0.40%	1.62%
510210	上证综指 ETF	2.07%	0.18%	-2.84%	2.31%
510220	中小盘 ETF	2.50%	-0.12%	-3.58%	0.32%
510230	180 金融 ETF	1.99%	0.20%	1.21%	2.53%
510260	新兴产业 ETF	3.08%	-0.23%	-6.75%	0.08%
510270	国企 ETF	4.29%	-0.12%	-0.44%	1.52%
510280	成长 ETF	4.34%	-0.13%	0.79%	1.31%



510290	380ETF	1.35%	-0.06%	-2.89%	0.47%
510300	300ETF*	4.02%	0.02%	-10.90%	1.40%
510410	资源 ETF*	8.32%	0.07%	-13.96%	0.97%
510420	180EWETF *	3.92%	0.00%	-5.21%	0.23%
510430	50 等权*	3.32%	-0.18%	3.32%	-0.18%
510880	红利 ETF	2.43%	0.05%	-3.03%	2.37%

注：阶段=统计期；累计=年初至今。统计期为2012.9.1-2012.9.30。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 3：9 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）

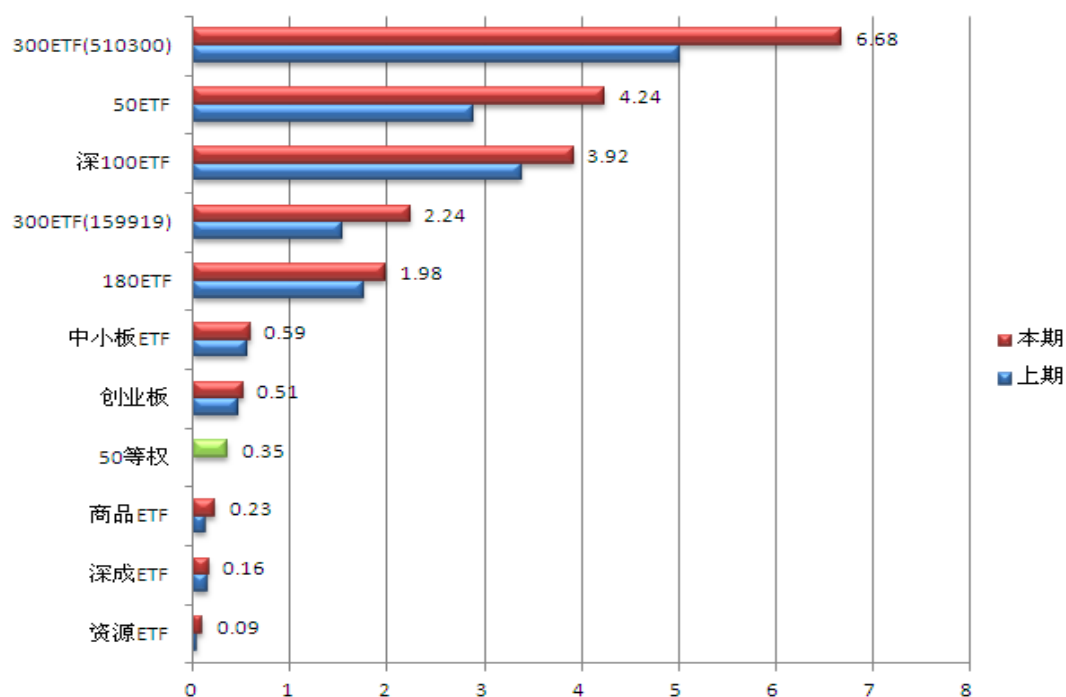
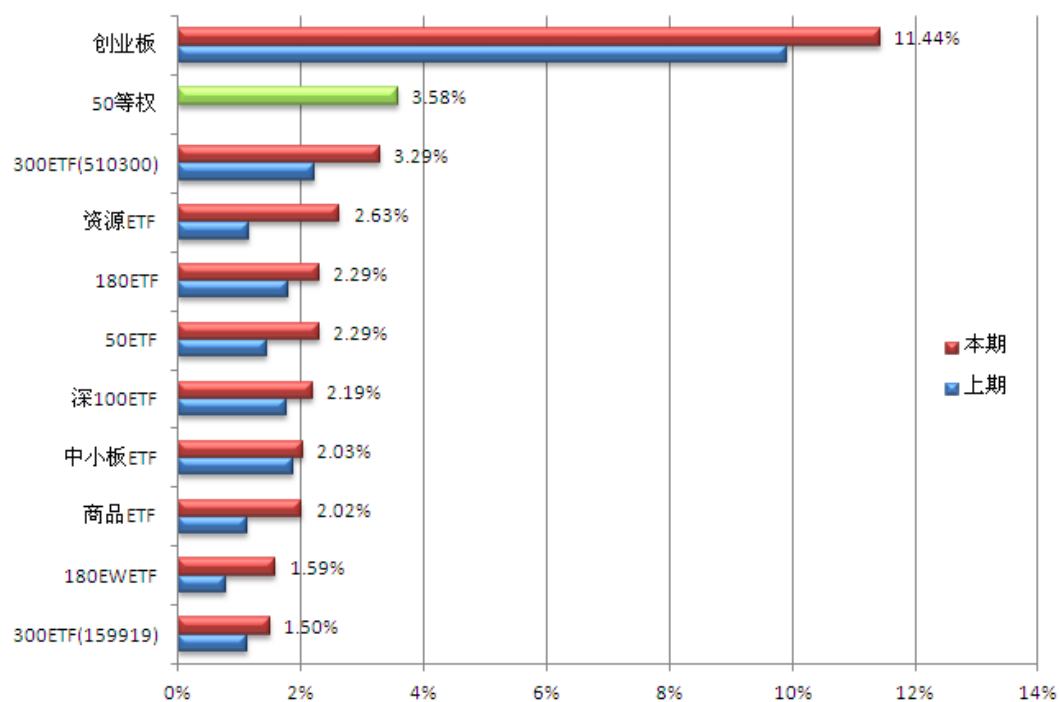


图 5：日均换手率前 10 只 ETF





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）		
		9 月	月度增量	增幅	9 月	月度增量	增幅
160119	南方 500	1.47	0.01	0.66%	1.17	0.03	2.45%
160125	南方中国	0.02	0.00	-1.12%	0.02	0.00	3.53%
160415	华安 S300	0.35	0.00	-0.24%	0.29	0.01	3.23%
160615	鹏华 300	0.40	0.00	-0.02%	0.33	0.01	3.62%
160616	鹏华 500	0.71	-0.01	-1.22%	0.48	0.00	0.42%
160706	嘉实 300	33.61	-0.37	-1.10%	20.70	0.54	2.67%
160716	嘉实 50	1.04	0.00	0.02%	0.63	0.01	1.58%
160717	恒生 H 股	0.47	-0.02	-3.89%	0.33	0.00	0.19%
160807	长盛 300	0.08	0.00	0.00%	0.06	0.00	3.51%
161017	富国 500	0.08	0.00	1.50%	0.07	0.00	3.73%
161211	国投金融	1.14	-0.01	-0.56%	0.83	0.02	2.39%
161213	国投消费	0.23	0.00	-0.11%	0.18	0.00	2.77%
161607	融通巨潮	0.65	-0.01	-0.77%	0.47	0.02	3.42%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-20.11%	0.01	0.00	-16.21%
161811	银华 300	0.16	0.00	-0.02%	0.12	0.00	3.87%
161903	万家公用	0.35	0.00	-0.17%	0.19	0.00	2.60%
161907	万家红利	0.55	0.00	-0.37%	0.43	0.01	2.83%
162307	海富 100	0.20	0.00	0.54%	0.14	0.01	4.40%
162411	华宝油气	0.02	0.00	-6.17%	0.02	0.00	0.46%
162711	广发 500	1.59	0.00	0.04%	1.15	0.02	1.87%
163001	长信 100	0.12	0.00	-0.52%	0.09	0.00	2.34%
163407	兴全 300	0.28	0.00	-0.72%	0.21	0.01	3.15%
163821	中银 300E	0.00	-0.01	-58.82%	0.00	-0.01	-57.35%
164205	天弘深成	0.01	0.00	-16.40%	0.01	0.00	-12.04%
165309	建信 300	0.19	0.00	-0.04%	0.13	0.00	3.68%
165806	东吴 100	0.04	0.00	-4.57%	0.04	0.00	-0.35%
166007	中欧 300	0.06	0.00	3.07%	0.04	0.00	6.97%
合计		43.85	-0.42		28.13	0.70	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.9.1-2012.9.30。



❖ 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）		
				9 月 末	月度 增量	增幅	9 月 末	月度 增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	34.44	-0.10	-0.29%	31.65	2.64	9.09%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	2.18	-0.02	-0.95%	1.92	0.05	2.55%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	2.18	-0.02	-0.95%	1.92	0.05	2.55%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	15.87	0.35	2.28%	18.11	0.47	2.64%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	23.81	0.53	2.28%	15.62	1.37	9.64%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	72.63	13.41	22.65%	76.12	14.35	23.24%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	72.63	13.41	22.65%	37.04	10.33	38.69%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	35.75	8.96	33.45%	37.46	9.52	34.09%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	35.75	8.96	33.45%	6.43	3.09	92.16%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	8.51	3.88	83.91%	8.87	4.07	84.80%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	12.76	5.82	83.91%	5.23	2.46	88.51%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	15.19	-2.17	-12.48%	15.27	-2.09	-12.04%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	15.19	-2.17	-12.48%	16.63	-0.72	-4.16%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.66	0.02	2.60%	0.68	0.02	3.10%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.66	0.02	2.60%	0.50	0.04	9.70%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.11	0.05	70.07%	0.12	0.05	70.88%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.16	0.07	70.07%	0.14	0.06	73.08%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.04	0.02	116.91%	0.04	0.02	118.04%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.06	0.03	116.91%	0.05	0.03	122.83%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.08	0.01	9.85%	0.09	0.01	10.38%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.12	0.01	9.85%	0.10	0.01	14.31%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	2.47	0.79	46.54%	2.60	0.84	47.38%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	3.71	1.18	46.54%	3.15	1.31	70.87%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.06	-0.01	-14.31%	0.07	-0.01	-13.90%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.09	-0.02	-14.31%	0.08	-0.01	-10.60%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.76	-0.06	-7.67%	0.78	-0.06	-7.23%
150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.76	-0.06	-7.67%	0.60	-0.03	-4.18%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.05	0.00	-1.40%	0.06	0.00	-0.82%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.08	0.00	-1.40%	0.07	0.00	1.39%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.13	-0.05	-28.08%	0.14	-0.05	-27.73%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.13	-0.05	-28.08%	0.10	-0.03	-21.94%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.68	0.06	9.09%	0.70	0.06	9.66%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.68	0.06	9.09%	0.48	0.08	18.50%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	0.49	0.04	7.85%	0.50	0.04	8.48%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	0.49	0.04	7.85%	0.40	0.05	14.05%



150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.07	-0.01	-6.67%	0.08	-0.01	-6.18%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.07	-0.01	-6.67%	0.06	-0.01	-9.22%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.14	-0.20	-57.93%	0.14	-0.20	-57.85%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.14	-0.20	-57.93%	0.15	-0.19	-56.08%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.04	-0.08	-66.35%	0.04	-0.08	-66.25%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.04	-0.08	-66.35%	0.04	-0.08	-66.25%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	13.53	0.32	2.44%	13.87	0.40	2.94%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	20.30	0.48	2.44%	16.24	1.08	7.13%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	1.04	-0.02	-1.99%	1.06	-0.02	-1.51%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	1.04	-0.02	-1.99%	0.98	0.09	9.61%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.68	-0.08	-10.06%	0.69	-0.07	-9.62%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.68	-0.08	-10.06%	0.62	-0.02	-3.17%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	1.89	-1.06	-36.09%	1.89	-1.06	-35.96%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	1.89	-1.06	-36.09%	1.95	-1.00	-33.78%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.30	-0.54	-64.53%	0.30	-0.54	-64.46%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.44	-0.81	-64.53%	0.44	-0.81	-64.50%
合计				401.69	49.55		322.28	45.50	

注：数据来源：深交所，统计期为 2012.9.1-2012.9.30。

❖ 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	0.64
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.51
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	479.62
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	76.08
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.10
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.41
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.74
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	7.70
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	1.51
3005	沪深 300 工业 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.18
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	1.22
3017	沪深 300 能源 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.22
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.70
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.12
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.54
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	21.45



3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.43
3052	沪深 300 公用事业 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.11
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.65
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.80
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.20
3063	沪深 300 运输 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.12
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	0.04

注：基金资产单位为“亿港元”；截止日期为 2012.9.30。

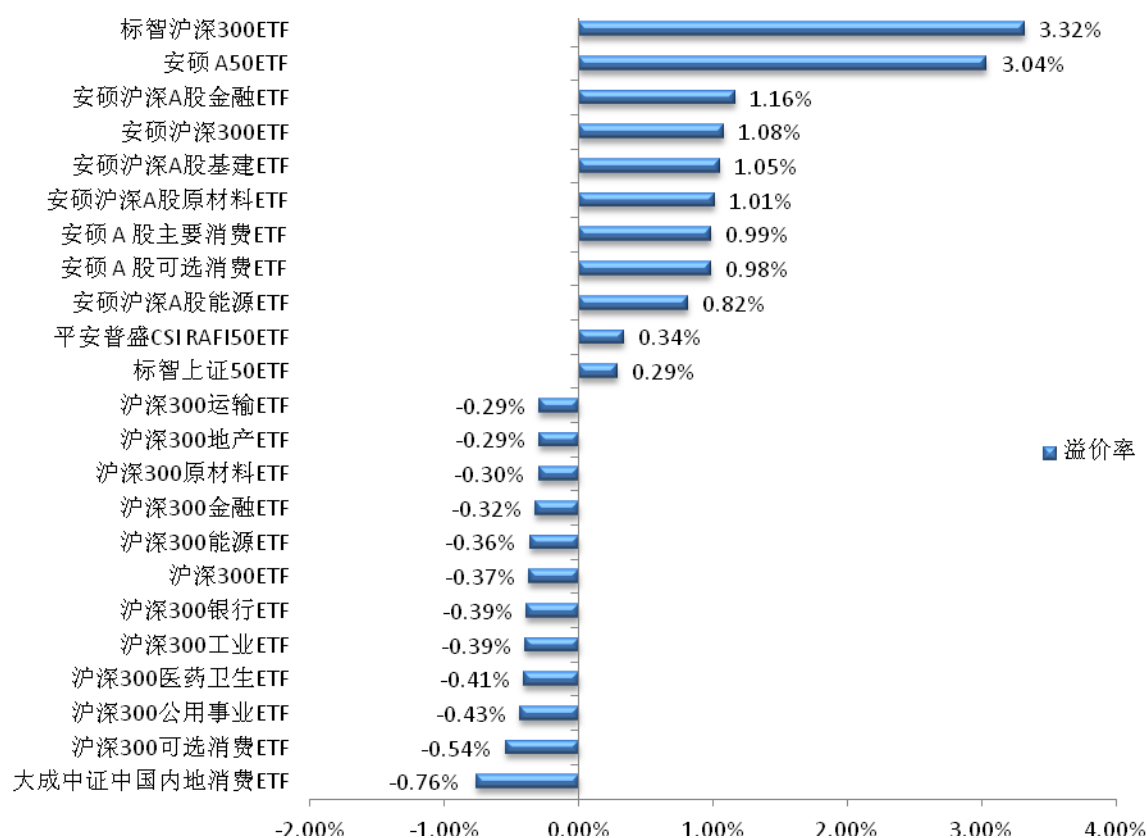
表 9：跟踪 A 股的主要跨境 ETF 净值变化

代码	名称	收盘价	增幅	单位净值	增幅
2816	沪深 300 地产 ETF	8.85	6.24%	8.96	6.93%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	21.95	3.29%	21.54	1.10%
2823	安硕 A50ETF	9.74	6.68%	9.26	3.36%
2827	标智沪深 300ETF	26.15	5.66%	25.09	4.98%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	9.65	5.35%	9.39	2.84%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	19.62	7.10%	19.26	4.51%
2844	沪深 300 金融 ETF	7.9	3.95%	7.93	3.84%
2846	安硕沪深 300ETF	21	8.14%	20.25	3.84%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	12.84	6.47%	12.56	4.41%
3005	沪深 300 工业 ETF	3.88	3.47%	3.91	3.81%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	8.92	3.60%	8.70	0.64%
3017	沪深 300 能源 ETF	6.28	5.90%	6.35	6.59%
3024	标智上证 50ETF	15.1	4.14%	15.15	4.62%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	6.57	5.29%	6.60	5.47%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	10.18	10.53%	9.93	7.55%
3049	沪深 300ETF	5.57	5.29%	5.58	4.89%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	9.77	7.48%	9.56	5.53%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	3.04	-1.94%	3.08	-0.99%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	11.18	5.67%	11.22	5.51%
3061	沪深 300 银行 ETF	7.24	-2.56%	7.32	-1.85%
3062	沪深 300 原材料 ETF	5.14	8.44%	5.17	8.77%
3063	沪深 300 运输 ETF	2.15	0.47%	2.17	1.19%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	8.88	7.25%	8.85	4.86%

注：收盘价、单位净值的单位为“港元”；统计期为 2012.9.1-2012.9.30；“/”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 2012.9.1-2012.9.30

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	188.85	4117.04%	3.92%	4106.90%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	3.10	256.50%	0.01%	270.56%
2823	安硕 A50ETF	107896.95	30.09%	2.29%	33.14%
2827	标智沪深 300ETF	2160.80	-59.01%	0.29%	-58.18%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	15.60	112.31%	0.05%	117.70%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	24.00	-1.43%	0.10%	1.36%
2844	沪深 300 金融 ETF	19.50	-48.09%	0.28%	-47.28%
2846	安硕沪深 300ETF	367.80	12.16%	0.47%	11.60%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	1.75	-83.57%	0.01%	-83.51%
3005	沪深 300 工业 ETF	4.60	241.29%	0.25%	234.37%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	50.60	646.03%	0.42%	678.30%
3017	沪深 300 能源 ETF	0.75	-68.64%	0.03%	-72.27%



3024	标智上证 50ETF	5.50	224.36%	0.03%	214.45%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	16.55	127.93%	0.15%	123.31%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	17.15	8.66%	0.11%	14.00%
3049	沪深 300ETF	2571.95	23.53%	1.22%	26.33%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	3.15	-76.40%	0.02%	-75.21%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	2.70	59.23%	0.24%	73.15%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	21.00	29.49%	0.33%	30.01%
3061	沪深 300 银行 ETF	190.00	687.39%	2.20%	714.17%
3062	沪深 300 原材料 ETF	3.05	-84.24%	0.15%	-84.73%
3063	沪深 300 运输 ETF	3.20	-33.09%	0.42%	-30.49%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.20	/	0.02%	/

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.9.1-2012.9.30；“/”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 9 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
IF1209	2215.60	2362.80	2184.20	2203.60	-12.40	0	-77719	2203.72	5706495	39112.92
IF1210	2225.00	2373.20	2185.20	2315.60	86.60	61433	56560	2303.00	5146357	34670.06
IF1211	2215.80	2329.60	2199.60	2329.60	113.40	2959	2959	2318.80	35755	242.36
IF1212	2247.00	2397.00	2213.20	2344.80	89.00	13909	4810	2332.60	109429	754.66
IF1303	2287.40	2435.00	2248.00	2384.20	96.20	2194	1209	2373.00	15767	110.60

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 2012.9.30

图 7: 沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

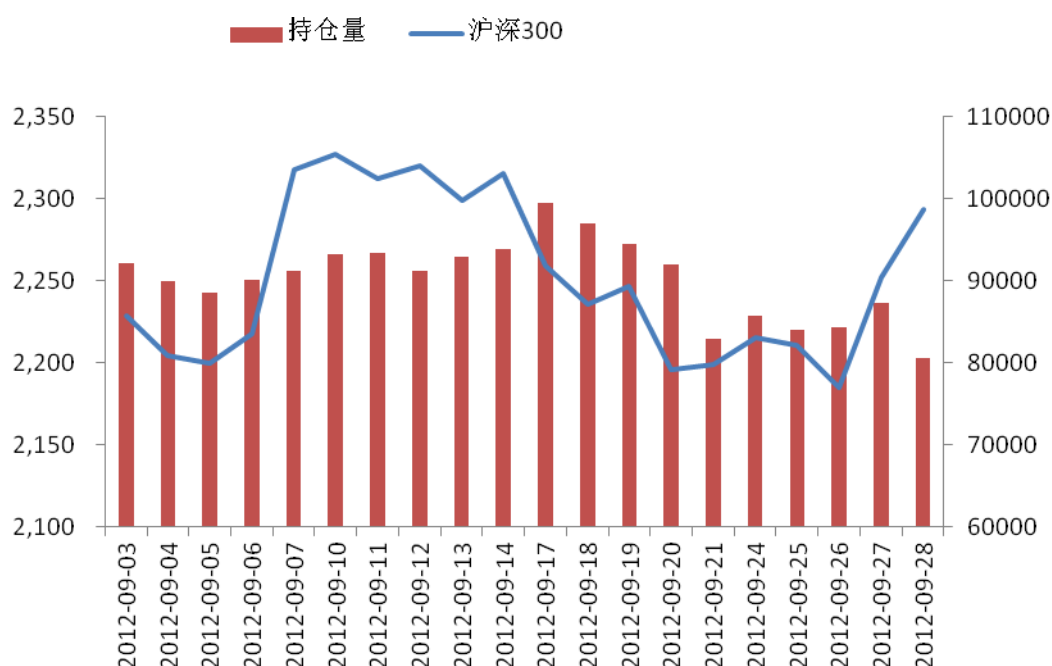
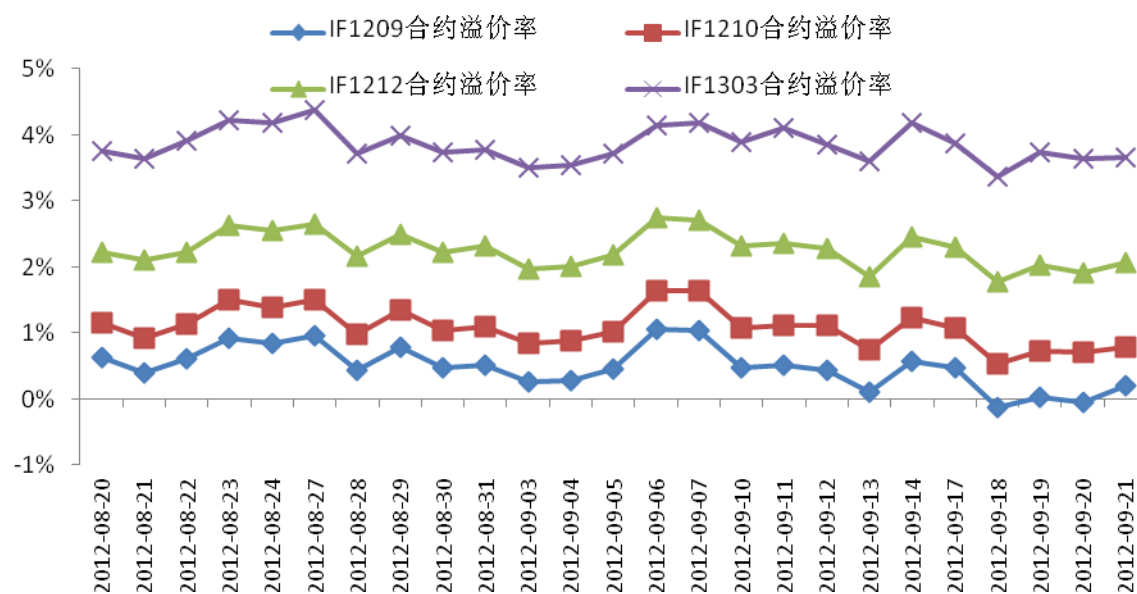


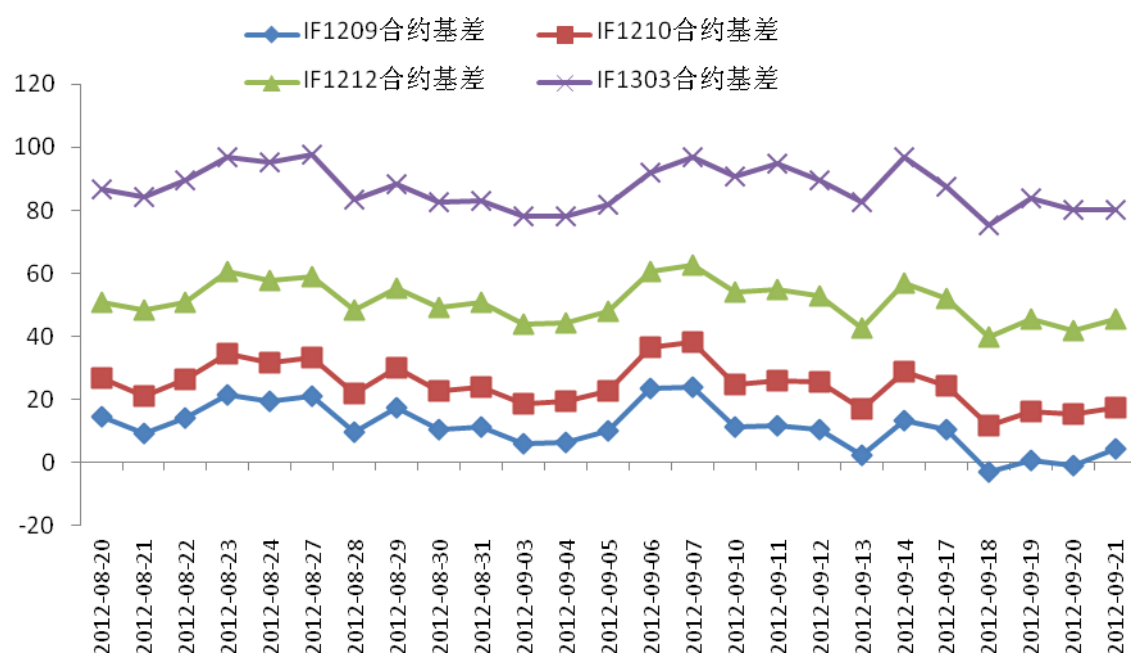


图 8：沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注: 合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2012.8.20-2012.9.21

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 2012.8.20-2012.9.21



免责声明

本报告基于已公开的数据和文字资料，我公司力求但不保证相关资料的准确性及完整性。

报告中的信息或观点仅供参考，均不构成对任何投资工具的买卖建议或投资策略的行为依据。

我公司保留报告所有版权，未经书面许可任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。

深圳证券信息公司指数事业部

地址：广东省深圳市福田区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>