



2012 年 10 月 指数产品动态

深圳证券信息有限公司指数事业部

业内动态

首批两只跨境 ETF 在沪深交易所挂牌上市

10 月 22 日，首批两只跨境的港股 ETF 华夏恒生 ETF(简称“恒生 ETF”)与易方达恒生国企 ETF(简称“H 股 ETF”)分别在深交所和上交所上市交易，上市交易的份额分别为 35.86 亿份、20.16 亿份。即日起，内地投资者可在场内直接便捷地交易香港指数。港股 ETF 也是继跨市场的沪深 300ETF 之后，ETF 市场年内推出的又一创新品种。

有市场人士表示，港股 ETF 的上市将有助于 A 股与港股折溢价率的收窄，A 股与港股的估值水平可望接轨。此外，港股 ETF 的推出或将对其他合格境内机构投资者(QDII)基金产生挤出效应。

首只国债 ETF 上报 债券 ETF 破冰之路启动

据报道，国泰基金国债 ETF 已于近期上报监管层，正式拉开了债券 ETF 破冰之路。此外，博时基金旗下的债券 ETF(企业债)亦在积极准备上报材料，有望近期上报。

业内人士表示，推出国债 ETF，有利于促进跨市场投资者在银行间和交易所两个市场买卖国债并进行转托管，从而起到有效连接两个市场的作用；而具备跨市场投资能力的投资者利用银行间国债、交易所国债、国债 ETF 三者间定价的差异进行套利活动，也有助于抹平两个市场间的定价差异，提升交易所债券市场的活跃度。

沪深港三地交易所在港设合资指数公司

10 月 30 日，由香港交易及结算所有限公司、上海证券交易所和深圳证券交易所成立之合资公司——中华证券交易服务有限公司(中华交易服务)正式开业，沪深港三地交易所合作由此进入新的里程碑。

合资公司主要致力于开发并对外授权指数交易产品、股票衍生品等，包括以三方市场交易品种为样本编制跨境指数，研究开发上市公司分类标准、信息标准、信息产品以及市场推介、参与者服务、技术服务和设施建设等。



➤ **本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报 情况**

新上市

大成中证 500 沪市 ETF 于 10 月 8 日上市。

万家中证创业成长指数分级基金于 10 月 12 日上市。

鹏华中证 A 股资源分级基金于 10 月 18 日上市。

华夏恒生 ETF 于 10 月 22 日上市。

易方达恒生国企 ETF 于 10 月 22 日上市。

工银瑞信睿智深证 100 指数分级基金于 11 月 5 日上市。

新成立

工银瑞信睿智深证 100 指数分级基金于 10 月 25 日成立，首募 4.71 亿。

新发行

易方达中债新综合债券指数发起式基金(LOF)于 9 月 28 日发行。

银华中证中票 50 指数债券型基金(LOF)于 11 月 5 日发行。

诺安中小板等权 ETF 及其联接基金于 11 月 5 日发行。

新获批

招商央视财经 50 指数基金于 10 月 8 日获批。

东方央视财经 50 指数增强型基金 10 月 10 日获批。

银华中证中票 50 指数债券型基金 (LOF) 于 10 月 12 日获批。

新申报

大成基金于 10 月 11 日申报中证 100ETF 及其联接基金。

南方基金于 10 月 18 日申报中债中期票据指数债券型发起式基金。

财通基金于 10 月 23 日申报中证财通中国可持续发展 100 指数增强型基金。

嘉实基金于 10 月 24 日申报中证中期企业债指数基金。



市场要点

国内指数基金概况

本期基金三季报披露完毕，截止 2012 年 9 月 30 日，指数基金的资产规模达到 3814.25 亿元。易方达基金管理有限公司所管理的指数基金资产规模名列第一，达到 572 亿元，跟踪沪深 300 指数的基金规模最大，为 1388 亿元。从指数基金的市场格局来看，前十大指数基金管理人占据了 70% 的份额，前十大指数基金占据了 46% 的份额。跟踪深证指数的基金资产规模超越跟踪上证指数的基金规模，达到 891 亿元。

国内 ETF

本期沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1177.71 亿元增加至本期的 1312.09 亿元。深市 ETF 资产规模已经超越沪市，占据 52% 的市场份额。从产品规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，资产净值达到 356.72 亿元。从跟踪误差情况看，本期最低的 ETF 为上证 380ETF。从成交活跃情况来看，日均成交金额以华泰柏瑞沪深 300ETF 和易方达深 100ETF 领先，分别为 5.83 亿元和 3.51 亿元。

LOF

2012 年 10 月，LOF 指数基金的场内规模为 43.24 亿份，较上月减少 0.61 亿份；场内资产净值为 27.35 亿元，较上月减少 0.78 亿元。

创新型指数基金

2012 年 10 月，创新型指数基金的场内规模为 414.86 亿份，较上月增加 6.06 亿份；场内资产净值为 323.60 亿元，较上月减少 6.32 亿元。

境外 ETF

本期末，25 只 ETF 资产规模为 712.89 亿港币。以沪深 300 医药卫生 ETF 的净值涨幅最大，达到 3.05%；从活跃程度看，安硕 A50ETF 日均成交金额最大，达到 12.58 亿港币，其日均换手率也最高，达到 2.38%。

股指期货

10 月份沪深 300 指数收报于 2254.82，较上月跌幅为 1.67%。而同期可比股指期货合约 IF1211、IF1212、IF1303 跌幅分别为 3.19%、3.27% 和 3.46%。从成交情况看，五份合约累计成交量 9572553 手，较上月增加 19.24%，累计成交金额 66271.51 亿，较上月增加 18.13%。



统计数据

国内指数基金概况

表 1: 指数基金分布情况（按基金类别统计）

类别	已成立只数	新成立只数	新发行只数	新获批只数	新申报只数
ETF	45	0	0	0	1
LOF	24	0	0	0	0
创新型基金	29	1	0	0	0
其他指数基金	112	0	0	3	4
总计	210	1	0	3	5

注：统计期间为 2012.10.1-2012.10.31

表 2: 指数基金分布情况（按跟踪标的统计）

跟踪标的	已成立只数	新成立只数	新发行只数	新获批只数	新申报只数
深证指数	53	1	0	0	0
上证指数	54	0	0	0	0
巨潮指数	4	0	0	2	0
中证指数	77	0	0	1	5
其他机构	22	0	0	0	0
总计	210	1	0	3	5

注：统计期间为 2012.10.1-2012.10.31。

表 3: 国内指数基金净值增长/下跌前五名

基金代码	基金名称	管理人	标的指数	本期净值增幅
510410	上证自然资源指数基金	博时	上证资源（000068）	-5.97%
690008	中证内地资源主题指数基金	民生加银	内地资源（000942）	-5.95%
510170	上证大宗商品指数基金	国联安	上证商品（000066）	-5.94%
161819	中证内地资源主题指数分级基金	银华	内地资源（000942）	-5.91%
161217	中证上游资源产业指数基金	国投瑞银	中证上游（000961）	-5.84%
090012	深证成长 40ETF 联接基金	大成	成长 40（399326）	0.40%
159906	深证成长 40ETF	大成	成长 40（399326）	0.41%
370023	中证消费服务领先指数基金	上投摩根	消费服务（000806）	0.50%
150108	深证 100 等权重指数分级基金	长盛	深 100 等权（399632）	0.60%
090020	中证 500 指数联接基金	大成	中证 500（000905）	0.60%

注：统计期间为 2012.10.1-2012.10.31。



➤ 指数基金三季报概况

表 4：国内市场前十大指数基金管理人列表

基金管理人	2012 年三季度			2012 年二季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
易方达基金管理有限公司	12	572.14	15.00%	9	579.7	15.59%
嘉实基金管理有限公司	8	506.27	13.27%	8	454.15	12.22%
华夏基金管理有限公司	5	444.26	11.65%	3	428.27	11.52%
银华基金管理有限公司	7	253.31	6.64%	5	252.84	6.80%
华泰柏瑞基金管理有限公司	5	225.6	5.91%	5	258.24	6.95%
融通基金管理有限公司	4	167.49	4.39%	4	178.76	4.81%
华安基金管理有限公司	8	166.66	4.37%	8	181.53	4.88%
南方基金管理有限公司	10	134.75	3.53%	10	140.91	3.79%
博时基金管理有限公司	8	112.14	2.94%	8	124.23	3.34%
国投瑞银基金管理有限公司	5	102.72	2.69%	4	36.19	0.97%
总计	72	2685.34	70.39%	64	2634.82	70.87%

注：数据来源为基金定期报告或成立公告。基金数量指该公司旗下指数基金数量。基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

表 5：国内市场跟踪产品规模最大的前十只标的指数

标的指数	2012 年三季度			2012 年二季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
沪深 300	27	1388.02	36.39%	27	1399.06	37.18%
深证 100	10	605.99	15.89%	8	544.89	14.48%
上证 50	3	352.33	9.24%	3	388.64	10.33%
上证 180	3	154.96	4.06%	3	165.46	4.40%
中证 500	10	116.73	3.06%	9	113.7	3.02%
深证成指	5	112.06	2.94%	5	103.2	2.74%
中证 100	8	87.76	2.30%	8	89.92	2.39%
道琼斯中国 88	1	67.23	1.76%	1	71.82	1.91%
180 治理	2	52.47	1.38%	2	57.31	1.52%
上证综指	3	51.92	1.36%	3	53.68	1.43%
总计	72	2989.47	78.38%	69	2987.68	79.40%

数据来源：基金定期报告或成立公告；基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

表 6：国内市场规模最大的前十只指数基金

基金代码	基金名称	资产净值(亿元)	基金代码	基金名称	资产净值(亿元)
160706	嘉实沪深 300ETF 联接基金	254.22	000051	华夏沪深 300	173.66
159919	嘉实沪深 300ETF	223.09	110003	易方达上证 50	166.30
510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	207.60	161604	融通深证 100	137.57
510050	华夏上证 50ETF	184.03	161812	银华深证 100 指数	125.02
159901	易方达深证 100ETF	183.87	510180	华安上证 180ETF	86.97

数据来源：基金定期报告或成立公告。



表 7：跟踪各系列指数的产品规模

标的指数	2012 年三季度			2012 年二季度		
	基金数量	资产(亿元)	市场份额	基金数量	资产(亿元)	市场份额
深证指数	53	891.18	23.36%	48	818.15	21.74%
上证指数	54	819.7	21.49%	52	879.25	23.37%
巨潮指数	4	34.81	0.91%	3	27.64	0.73%
中证指数	77	1819.33	47.70%	70	1872.69	49.77%
其他机构	22	249.23	6.53%	15	165.23	4.39%
总计	210	3814.25	100%	188	3762.96	100%

数据来源：基金定期报告或成立公告；基金资产规模未剔除联接基金重复部分。

国内 ETF

表 8：深沪交易所上市 ETF 概况

上市地点	ETF 数量	本月新增	资产净值(亿元)	市场份额
深市	18	1	678.08	51.68%
沪市	29	2	634.01	48.32%
总计	47	3	1312.09	100.00%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.10.31；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 9：跟踪各系列指数 ETF 概况

跟踪标的	ETF 数量	本月新增	资产净值(亿元)	市场份额
深证指数	16	0	310.15	23.64%
上证指数	27	1	418.42	31.89%
中证指数	2	0	560.62	42.73%
其他指数	2	2	22.90	1.75%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.10.31；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

表 10：ETF 前五大指数基金管理人列表

基金公司	ETF 数量	本月新增	资产净值(亿元)	市场份额
嘉实基金管理有限公司	3	0	363.65	27.72%
华夏基金管理有限公司	3	1	231.08	17.61%
华泰柏瑞基金管理有限公司	3	0	218.88	16.68%
易方达基金管理有限公司	4	1	207.41	15.81%
华安基金管理有限公司	2	0	88.60	6.75%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.10.31。

表 11：规模最大的前十只 ETF 列表

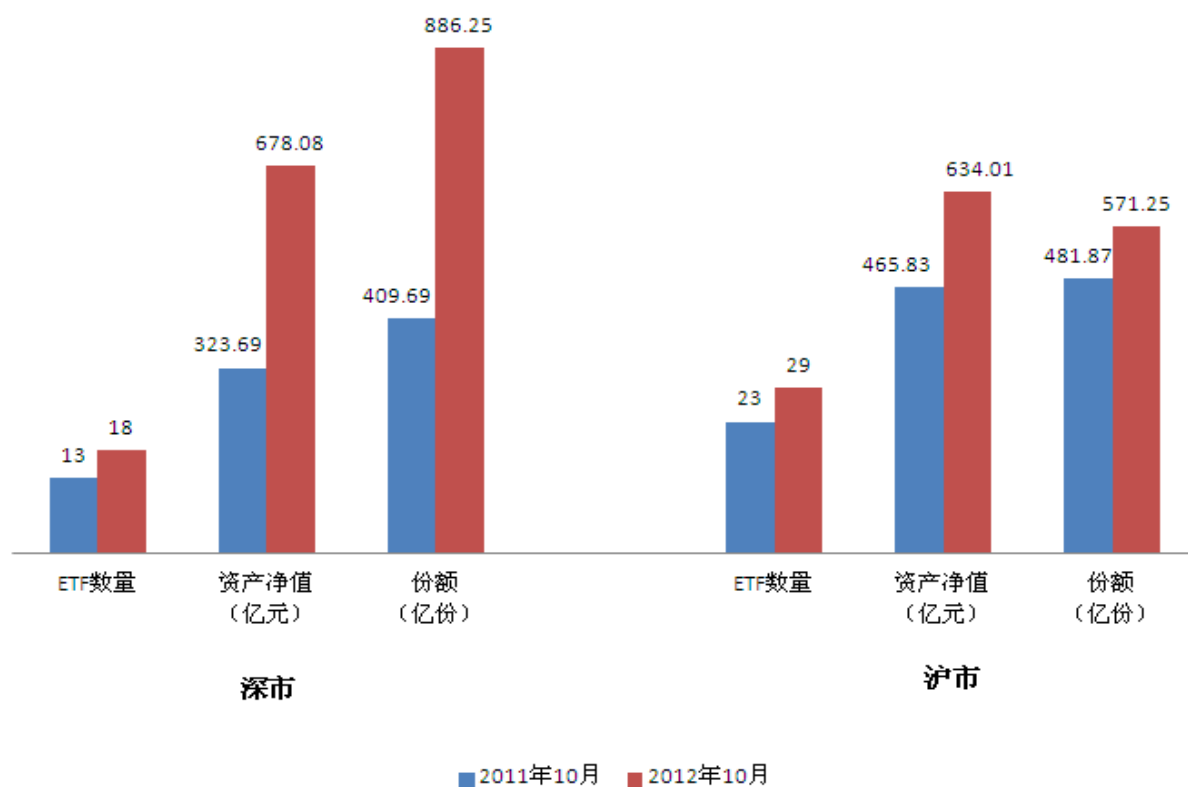
代码	简称	管理人	份额(亿份)	资产净值(亿元)	对指数覆盖率
159919	300ETF	嘉实	413.73	356.72	0.32%
510300	300ETF	华泰柏瑞	89.04	203.90	0.18%
159901	深 100ETF	易方达	336.08	181.92	1.01%



510050	50ETF	华夏	109.93	178.64	0.27%
510180	180ETF	华安	164.63	81.82	0.09%
159902	中小板 ETF	华夏	21.02	41.24	0.57%
159903	深成 ETF	南方	37.53	32.52	0.28%
510010	治理 ETF	交银施罗德	43.70	25.39	0.03%
510880	红利 ETF	华泰柏瑞	8.21	13.99	0.03%
159906	深成长 ETF	大成	19.18	13.98	0.19%

数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.10.31。

图 1：深沪交易所上市 ETF 年度变化趋势对比

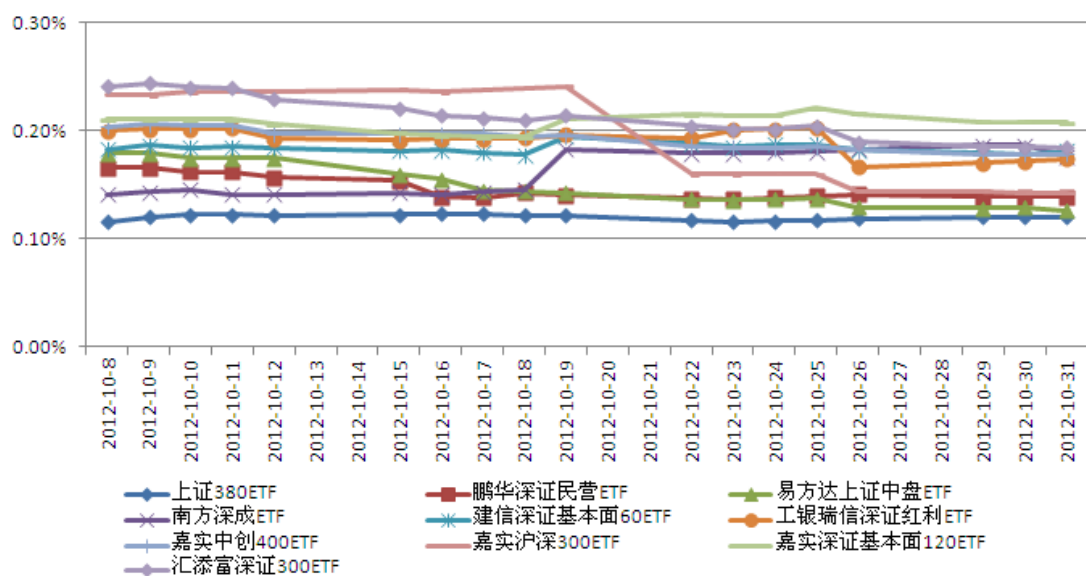


数据来源：深沪交易所；数据截止 2012.10.31；中小板 ETF 为场内场外总规模与总资产。

图 2：10 月年化跟踪误差最小的前 10 只 ETF



Index Derivatives Report October 2012



注：统计期内各个交易日对应的年化跟踪误差采用向前 30 个交易日为一周期计算。

图 3：日均成交金额前 10 只 ETF（亿元）

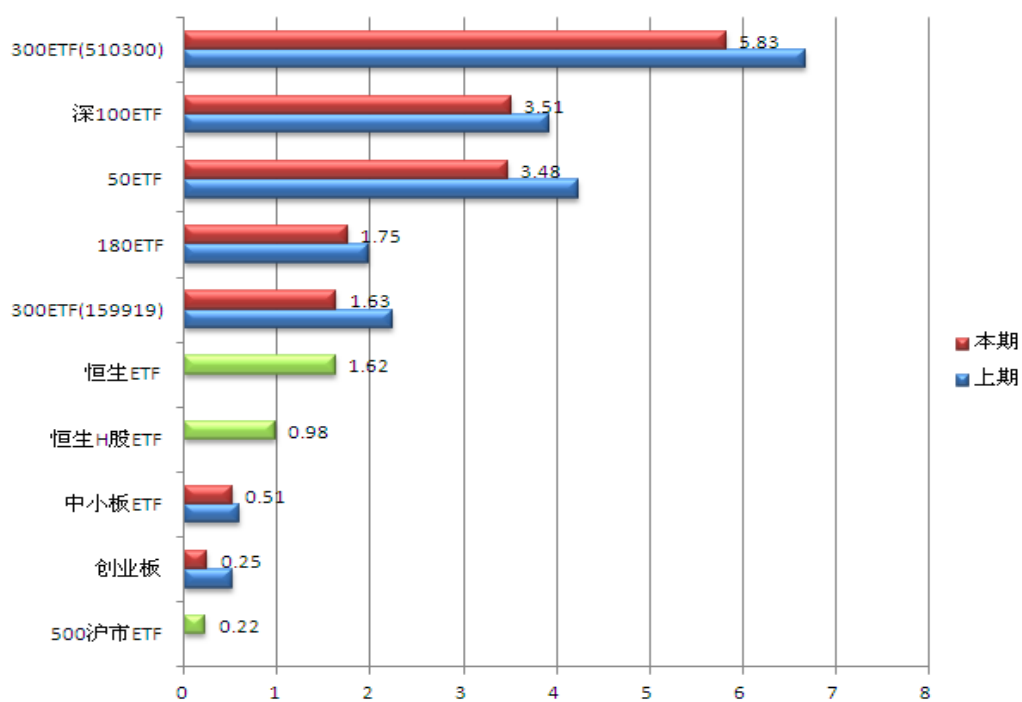
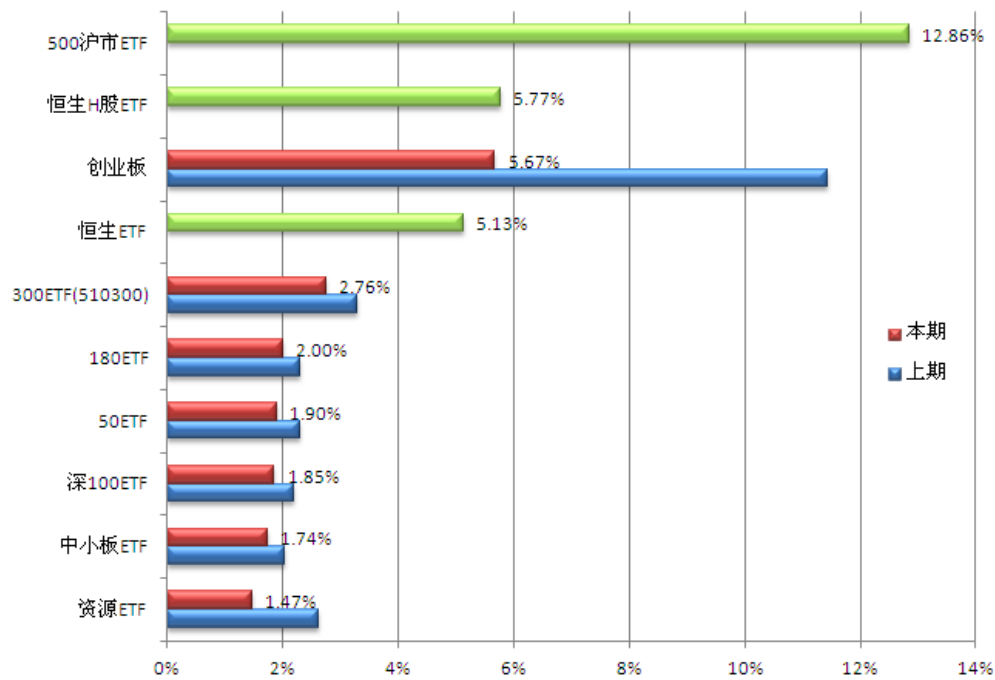


图 4：日均换手率前 10 只 ETF



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算。

➤ LOF

表 12: LOF 指数基金（场内部分）份额及资产净值月度变化情况

代码	简称	10 月规模 (亿份)	规模增量	规模增幅	10 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方 500	1.47	0.00	0.14%	1.16	-0.01	-0.88%
160125	南方中国	0.02	0.00	-0.26%	0.02	0.00	5.82%
160415	华安 S300	0.34	0.00	-0.58%	0.28	-0.01	-2.61%
160615	鹏华 300	0.40	0.00	-0.09%	0.33	-0.01	-1.66%
160616	鹏华 500	0.71	0.00	0.14%	0.48	0.00	-0.90%
160706	嘉实 300	33.15	-0.46	-1.38%	20.09	-0.62	-2.98%
160716	嘉实 50	1.04	0.00	0.00%	0.63	0.00	-0.41%
160717	恒生 H 股	0.44	-0.03	-5.68%	0.33	0.00	-0.10%
160807	长盛 300	0.09	0.01	14.20%	0.07	0.01	12.41%
161017	富国 500	0.08	0.00	1.43%	0.07	0.00	1.31%
161211	国投金融	1.01	-0.13	-11.74%	0.73	-0.11	-12.71%
161213	国投消费	0.23	0.00	-0.23%	0.18	0.00	-0.61%
161607	融通巨潮	0.65	0.00	-0.26%	0.46	-0.01	-2.07%
161714	招商金砖	0.01	0.00	-0.74%	0.01	0.00	-1.00%
161811	银华 300	0.16	0.00	-0.61%	0.12	0.00	-2.26%
161903	万家公用	0.35	0.00	-0.71%	0.19	0.00	-1.47%
161907	万家红利	0.54	-0.01	-0.97%	0.42	-0.01	-2.62%
162307	海富 100	0.20	0.00	-1.21%	0.13	0.00	-2.67%



162411	华宝油气	0.02	0.00	13.72%	0.02	0.00	8.98%
162711	广发 500	1.58	-0.01	-0.63%	1.13	-0.02	-1.59%
163001	长信 100	0.12	0.00	-0.38%	0.09	0.00	-1.83%
163407	兴全 300	0.28	0.00	-0.73%	0.21	-0.01	-2.47%
163821	中银 300E	0.01	0.01	124.40%	0.01	0.00	119.47%
164205	天弘深成	0.03	0.02	275.10%	0.02	0.01	266.34%
165309	建信 300	0.19	0.00	-0.83%	0.13	0.00	-2.46%
165806	东吴 100	0.04	0.00	-1.30%	0.04	0.00	-3.39%
166007	中欧 300	0.06	0.00	-0.25%	0.04	0.00	-1.98%
总计		43.24	-0.61		27.35	-0.78	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.10.1-2012.10.31。

► 创新型指数基金

表 13：创新型指数基金（场内部分）份额及资产净值月度变化情况

代码	简称	管理人	上市日期	10 月规模 (亿份)	规模增量	增幅	10 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-8-14	35.05	0.60	1.75%	30.49	-1.16	-3.68%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-11-19	1.90	-0.02	-1.22%	1.85	-0.07	-3.53%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-11-19	1.90	-0.02	-1.22%	1.85	-0.07	-3.53%
150012	双禧 A	国联安	2010-6-18	16.41	0.53	3.36%	18.82	0.71	3.91%
150013	双禧 B	国联安	2010-6-18	24.61	0.80	3.36%	15.48	-0.14	-0.89%
150018	银华稳进	银华	2010-6-7	73.05	0.42	0.58%	76.99	0.88	1.16%
150019	银华锐进	银华	2010-6-7	73.05	0.42	0.58%	34.19	-2.85	-7.70%
150022	申万收益	申万菱信	2010-11-8	39.81	4.06	11.36%	41.96	4.49	12.00%
150023	申万进取	申万菱信	2010-11-8	39.81	4.06	11.36%	5.81	-0.62	-9.67%
150028	信诚 500A	信诚	2011-3-14	8.60	0.10	1.14%	9.02	0.15	1.72%
150029	信诚 500B	信诚	2011-3-14	12.91	0.15	1.14%	5.16	-0.07	-1.33%
150030	银华金利	银华	2011-4-8	13.85	-1.34	-8.80%	14.01	-1.26	-8.26%
150031	银华鑫利	银华	2011-4-8	13.85	-1.34	-8.80%	14.37	-2.27	-13.63%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-17	0.63	-0.03	-4.35%	0.66	-0.03	-3.80%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-17	0.63	-0.03	-4.35%	0.45	-0.05	-9.66%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-22	0.12	0.01	7.84%	0.13	0.01	8.46%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-22	0.18	0.01	7.84%	0.15	0.01	5.22%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-3-30	0.08	0.04	86.35%	0.08	0.04	87.49%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-3-30	0.12	0.05	86.35%	0.09	0.04	81.77%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-2-21	0.11	0.03	34.92%	0.12	0.03	35.57%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-2-21	0.17	0.04	34.92%	0.13	0.03	30.33%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-21	3.53	1.06	42.80%	3.74	1.13	43.62%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-21	5.30	1.59	42.80%	4.00	0.85	26.84%
150064	同瑞 A	长盛	2012-1-12	0.06	0.00	-2.95%	0.06	0.00	-2.40%
150065	同瑞 B	长盛	2012-1-12	0.09	0.00	-2.95%	0.08	-0.01	-6.44%
150069	双力 A	国联安	2012-4-16	0.71	-0.04	-5.82%	0.74	-0.04	-5.18%



指数产品动态 总第 33 期

150070	双力 B	国联安	2012-4-16	0.71	-0.04	-5.82%	0.54	-0.07	-10.91%
150073	诺安稳健	诺安	2012-4-27	0.05	0.00	-2.40%	0.06	0.00	-1.83%
150075	诺安进取	诺安	2012-4-27	0.08	0.00	-2.40%	0.07	0.00	-4.26%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-7-13	0.13	-0.01	-4.26%	0.13	-0.01	-3.70%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-7-13	0.13	-0.01	-4.26%	0.09	-0.01	-9.11%
150083	广发 100A	广发	2012-6-12	0.81	0.12	18.25%	0.84	0.13	18.98%
150084	广发 100B	广发	2012-6-12	0.81	0.12	18.25%	0.53	0.05	10.61%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-28	0.44	-0.05	-9.54%	0.46	-0.05	-9.01%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-28	0.44	-0.05	-9.54%	0.34	-0.06	-14.46%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-7-3	0.07	0.00	-5.62%	0.07	0.00	-5.04%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-7-3	0.07	0.00	-5.62%	0.06	-0.01	-10.16%
150090	万家创 A	万家	2012-10-12	0.23	-0.51	-68.70%	0.24	-0.51	-68.51%
150091	万家创 B	万家	2012-10-12	0.23	-0.51	-68.70%	0.22	-0.52	-70.71%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-24	0.14	0.00	-1.49%	0.14	0.00	-1.00%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-24	0.14	0.00	-1.49%	0.14	-0.01	-4.79%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-21	0.01	-0.03	-76.25%	0.01	-0.03	-76.11%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-21	0.01	-0.03	-76.25%	0.01	-0.03	-76.39%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-31	13.59	0.06	0.41%	14.01	0.14	1.00%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-31	20.38	0.08	0.41%	15.75	-0.48	-2.98%
150096	商品 A	招商	2012-7-25	1.03	-0.01	-0.95%	1.06	0.00	-0.37%
150097	商品 B	招商	2012-7-25	1.03	-0.01	-0.95%	0.87	-0.11	-11.12%
150100	资源 A	鹏华	2012-10-18	1.17	-1.15	-49.55%	1.18	-1.15	-49.35%
150101	资源 B	鹏华	2012-10-18	1.17	-1.15	-49.55%	1.04	-1.29	-55.40%
150104	华安 300A	华安	2012-7-23	0.60	-0.08	-11.11%	0.62	-0.07	-10.50%
150105	华安 300B	华安	2012-7-23	0.60	-0.08	-11.11%	0.53	-0.09	-14.90%
150106	易基稳健	易方达	2012-10-25	0.47	-0.28	-37.07%	0.48	-0.28	-36.92%
150107	易基进取	易方达	2012-10-25	0.47	-0.28	-37.07%	0.46	-0.29	-38.72%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-26	1.43	-0.46	-24.25%	1.44	-0.45	-23.80%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-26	1.43	-0.46	-24.25%	1.39	-0.56	-28.94%
150110	华商 500A	华商	2012-9-26	0.18	-0.12	-39.10%	0.18	-0.11	-38.74%
150111	华商 500B	华商	2012-9-26	0.27	-0.17	-39.10%	0.26	-0.19	-42.09%
总计				414.86	6.06		323.60	-6.32	

注：数据来源：深交所；统计期为 2012.10.1-2012.10.31。

➤ 跨境 ETF

表 14：跟踪 A 股的主要跨境 ETF

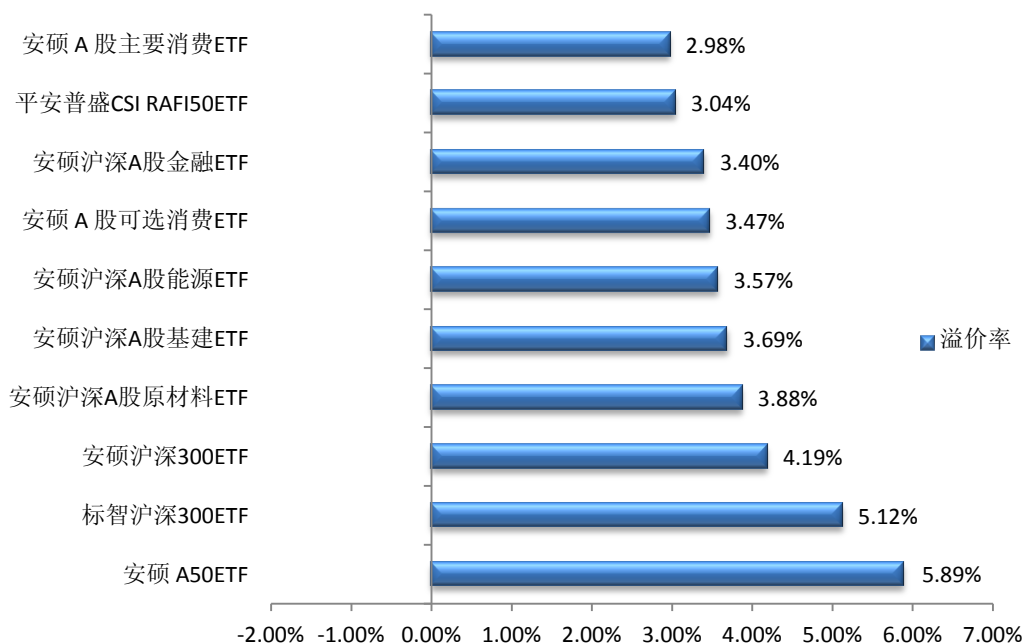
代码	名称	标的指数	管理人	上市日期	基金资产
2816	沪深 300 地产 ETF	沪深 300 地产	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.66
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	中证锐联基本面 50	Ping An of China Asset management	2010-5-7	1.51
2823	安硕 A50ETF	新华富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	508.59
2827	标智沪深 300ETF	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	75.27
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	3.08



Index Derivatives Report October 2012

2841	安硕 A 股主要消费 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	2.39
2844	沪深 300 金融 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.73
2846	安硕沪深 300ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	7.60
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	0.21
3024	标智上证 50ETF	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.67
3025	沪深 300 可选消费 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.13
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	1.45
3049	沪深 300ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	21.80
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	1.40
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	0.67
3061	沪深 300 银行 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.82
3062	沪深 300 原材料 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.19
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
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments Limited	2012-10-12	22.83
3188	华夏沪深 300ETF	沪深 300	China Asset Management (Hong Kong) Limited	2012-10-26	57.72

图 5: 溢价率前十大 A 股跨境 ETF



注: 统计期为 2012.10.1-2012.10.31

表 15: 主要 A 股跨境 ETF 交易情况



指数产品动态 总第 33 期

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	4.95	-97.38%	0.08%	-98.08%
2818	平安普盛 CSI RAFI50ETF	4.65	50.00%	0.03%	117.24%
2823	安硕 A50ETF	125833.55	16.62%	2.38%	3.72%
2827	标智沪深 300ETF	1865.25	-13.68%	0.23%	-19.41%
2829	安硕沪深 A 股金融 ETF	184.05	1079.81%	0.58%	1052.23%
2841	安硕 A 股主要消费 ETF	24.30	1.25%	0.10%	-2.83%
2844	沪深 300 金融 ETF	90.70	365.13%	1.22%	329.27%
2846	安硕沪深 300ETF	136.35	-62.93%	0.17%	-64.46%
3001	安硕 A 股可选消费 ETF	72.70	4054.29%	0.47%	4075.55%
3005	沪深 300 工业 ETF	5.25	14.13%	0.28%	14.63%
3006	安硕沪深 A 股基建 ETF	5.35	-89.43%	0.04%	-90.20%
3017	沪深 300 能源 ETF	3.20	326.67%	0.15%	366.82%
3024	标智上证 50ETF	6.30	14.55%	0.04%	16.99%
3025	沪深 300 可选消费 ETF	15.60	-5.74%	0.14%	-6.68%
3039	安硕沪深 A 股原材料 ETF	38.85	126.53%	0.24%	111.40%
3049	沪深 300ETF	2363.70	-8.10%	1.07%	-11.95%
3050	安硕沪深 A 股能源 ETF	93.50	2868.25%	0.65%	2820.15%
3052	沪深 300 公用事业 ETF	0.70	-74.07%	0.07%	-72.43%
3057	沪深 300 医药卫生 ETF	40.45	92.62%	0.61%	87.24%
3061	沪深 300 银行 ETF	43.85	-76.92%	0.54%	-75.60%
3062	沪深 300 原材料 ETF	3.95	29.51%	0.19%	31.22%
3063	沪深 300 运输 ETF	6.55	104.69%	0.55%	29.79%
3071	大成中证中国内地消 ETF	0.00	-100.00%	0.00%	-100.00%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	3519.46	/	1.50%	/
3188	华夏沪深 300ETF	5309.75	/	0.91%	/

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2012.10.1-2012.10.31；“/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。

➤ 股指期货

表 16：沪深 300 股指期货 10 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
IF1210	2306.40	2345.00	2262.00	2333.80	18.20	0	-61433	2334.29	4428623	30700.31
IF1211	2328.80	2365.00	2233.40	2255.20	-74.40	68321	65362	2254.60	4878604	33718.41
IF1212	2344.40	2377.80	2247.20	2268.20	-76.60	21034	7125	2267.60	240284	1675.19
IF1303	2380.00	2417.80	2288.40	2301.60	-82.60	3968	1774	2302.00	22599	160.10
IF1306	2415.20	2447.00	2318.40	2329.80	-70.60	693	693	2329.80	2443	17.50

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 2012.10.31

图 6：沪深 300 指数与期货合约持仓量变化

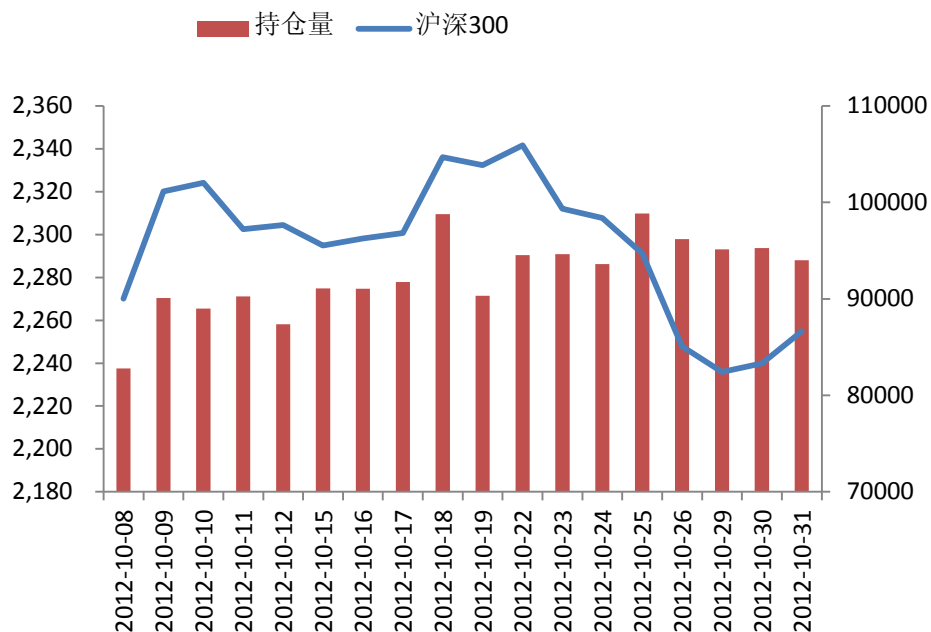
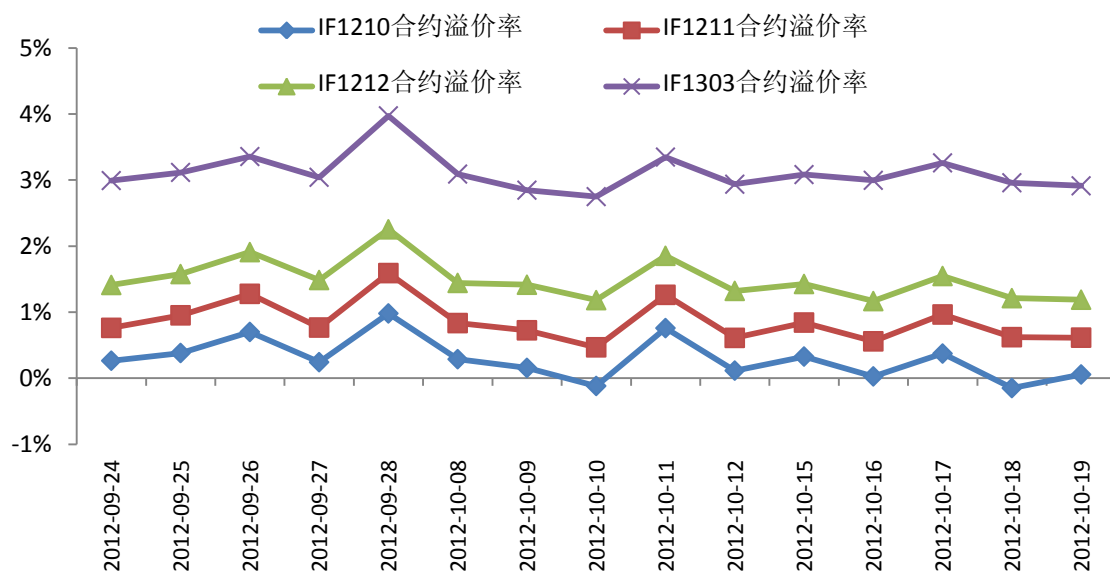
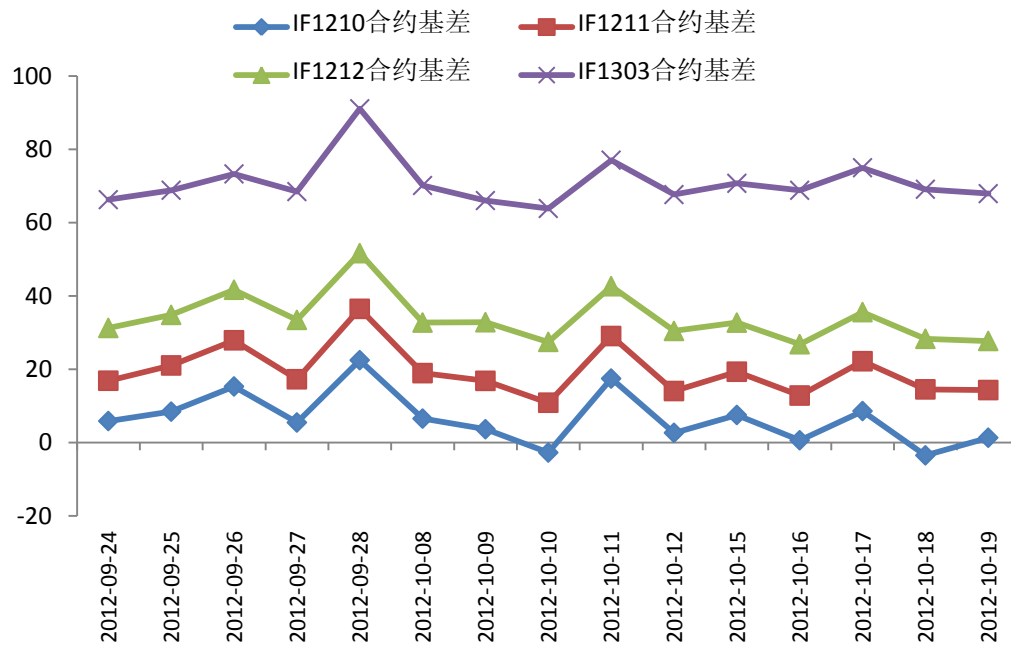


图 7: 沪深 300 股指期货合约溢价率走势



注:合约溢价率=期指收盘价/股指收盘价-1;统计期为 2012.9.24-2012.10.19

图 8: 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 2012.9.24-2012.10.19



免责声明

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

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

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

深圳证券信息公司指数事业部

地址：广东省深圳市福田区红荔西路上步工业区 10 栋

邮编：518028

电话：（+86）755-83241251

传真：（+86）755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://index.cninfo.com.cn>