

2014 年 9 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

➤ 深市 ETF 期权开测 ETF 市场需求将增加

9 月 9 日，深交所期权正式启动首场仿真测试，仿真测试标的中有 3 只 ETF 期权。开展仿真交易测试意味着深市期权业务已迈出第一步。

分析认为，未来将推出的 ETF 期权将对 ETF 市场产生深远的影响：通过 ETF 与 ETF 期权搭配使用可以实现各种不同的策略，这将有效地增加对 ETF 的需求并改善 ETF 的流动性，同时还可以改善 ETF 市场的投资者结构，将各种类型的投资者引入 ETF 市场，尤其是机构投资者，并为基于 ETF 及 ETF 期权的产品创新铺平道路。

➤ 证监会推动指基市场多样化 基金加速研发商品期货 ETF

9 月 12 日，证监会发言人表示，在国内推出商品期货 ETF，可以引入机构参与商品期货投资以改善当前商品期货市场投资者结构，并拓宽基金业发展空间、满足投资者多样化资产配置需求。

此前，证监会公布了《公开募集证券投资基金运作指引第 1 号——商品期货交易型开放式基金指引（征求意见稿）》，对商品期货 ETF 的定义、投资范围、风险控制、相关主体责任、监管要求等内容进行了规范。

虽然目前国内 ETF 产品众多，但商品期货 ETF 市场依然空白。自《指引》公布以来，国内不少基金管理公司研发商品期货 ETF 的速度明显加快。也有行业人士呼吁，在控制风险的同时，适当松绑商品期货 ETF 的投资及交易约束，以吸引更多的机构投资者参与。在证监会的推动下，国内商品期货 ETF 有望推出，期货市场的投资渠道也将会增加。

➤ **本期指数基金上市/成立/发行/获批/申报情况**

新上市

华安国际龙头（DAX）ETF 于 9 月 5 日上市。

富国中证移动互联网指数分级基金于 9 月 22 日上市。

鹏华中证 800 地产指数分级基金于 9 月 23 日上市。

新成立

新华中证环保产业指数分级基金于 9 月 11 日成立。

新发行

国泰国证食品饮料行业指数分级基金于 9 月 15 日发行。

新获批

海富通上证可质押城投债 ETF 于 9 月 9 日获批。

广发中证百度百发策略 100 指数基金于 9 月 15 日获批。

鹏华中证国防指数分级基金于 9 月 17 日获批。

鹏华中证传媒指数分级基金于 9 月 17 日获批。

华润元大富时中国 A50 指数基金于 9 月 19 日获批。

易方达中证 500ETF 于 9 月 28 日获批。

易方达中证 500ETF 联接基金于 9 月 28 日获批。

新申报

（本月无新申报产品。）

市场要点

➤ 国内 ETF

2014 年 9 月，沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1519.63 亿元降至本期的 1457.96 亿元。从产品规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，达 281.22 亿元。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 16.32 亿元和 8.52 亿元。

➤ LOF

2014 年 9 月，LOF 指数基金的场内份额 27.43 亿份，较上月减少 1.11 亿份；场内资产净值为 19.54 亿元，较上月增长 0.19 亿元。

➤ 分级基金

2014 年 9 月，分级基金的场内份额为 499.80 亿份，较上月减少 9.12 亿份；场内资产净值为 416.26 亿元，较上月增加 16.91 亿元。

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	90	0	0	2	0
LOF	33	0	0	0	0
分级基金	56	3	1	2	0
其他指数基金	141	0	0	3	0
总计	320	3	1	7	0

注: 统计期间为 2014.9.1-2014.9.30。

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	57	0	0	0	0
上证指数	64	0	0	1	0
巨潮指数	8	0	1	0	0
中证指数	149	3	0	5	0
其他机构	42	0	0	1	0
总计	320	3	1	7	0

注: 统计期间为 2014.9.1-2014.9.30。

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	标的指数	本期净值增幅
161024	富国中证军工	中证军工	17.97%
163115	申万菱信中证军工	中证军工	17.96%
000596	前海开源中证军工	中证军工	17.65%
510290	南方上证 380ETF	上证 380	11.96%
510260	诺安上证新兴产业 ETF	上证新兴	11.71%
164815	工银瑞信标普全球资源	标普全球资源	-7.80%
160121	南方金砖四国	标普金砖四国	-8.51%
161714	招商标普金砖四国	标普金砖四国	-8.65%
000049	中银标普全球精选	标普全球精选	-8.82%
162411	华宝兴业标普油气	标普油气指数	-12.28%

注: 统计期间为 2014.9.1-2014.9.30。

▶ 国内 ETF

表 4: 深沪交易所上市 ETF 概况

上市地点	ETF 数量	资产净值 (亿元)	市场份额
深圳	33	498.74	34.21%
上海	57	959.22	65.79%
总计	90	1457.96	100.00%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.9.30。

表 5: 跟踪各系列指数 ETF 概况

跟踪标的	ETF 数量	资产净值 (亿元)	市场份额
深证	17	176.98	12.14%
上证	35	435.84	29.89%
中证	33	833.15	57.14%
其他	5	11.99	0.82%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.9.30。

表 6: ETF 前五大指数基金管理人列表

基金公司	ETF 数量	资产净值 (亿元)	市场份额
华夏	9	430.77	29.55%
嘉实	8	292.81	20.08%
华泰柏瑞	3	177.60	12.18%
易方达	7	156.69	10.75%
华安	5	131.54	9.02%

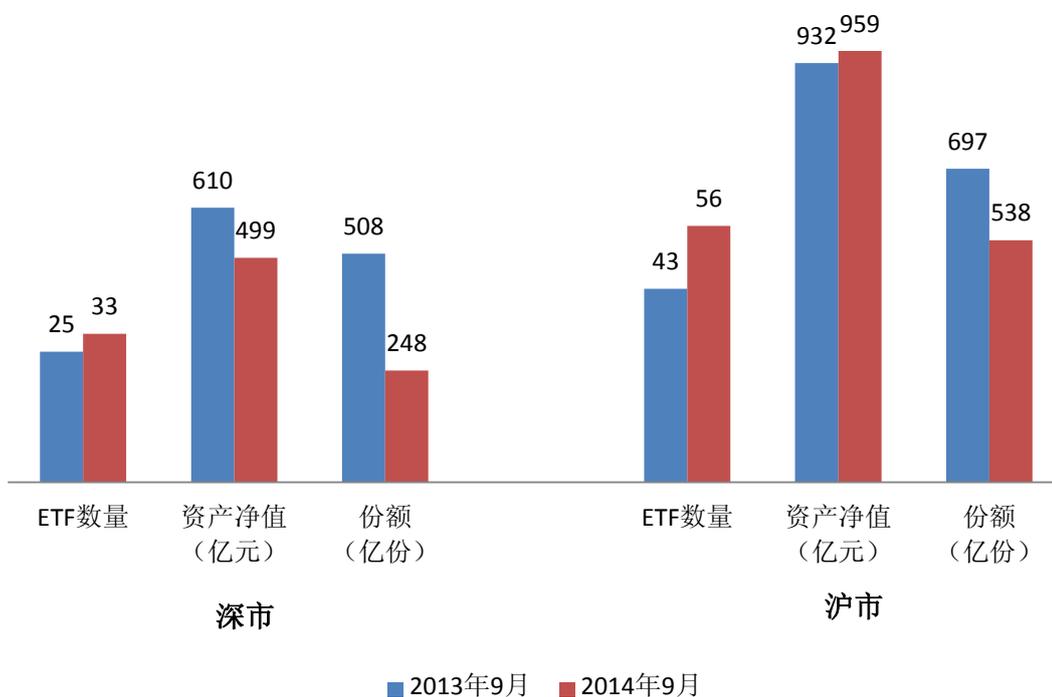
数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.9.30。

表 7: 规模最大的前十只 ETF 列表

代码	简称	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)	市场份额
159919	嘉实沪深 300ETF	109.84	281.22	19.29%
510330	华夏沪深 300ETF	82.52	206.77	14.18%
510050	华夏上证 50ETF	110.58	183.78	12.61%
510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	66.60	166.04	11.39%
510180	华安上证 180ETF	56.86	121.58	8.34%
159901	易方达深证 100ETF	30.46	90.46	6.20%
510500	南方中证 500ETF	39.19	54.16	3.71%
510310	易方达沪深 300ETF	44.38	44.10	3.02%
510510	广发中证 500ETF	20.82	28.85	1.98%
159902	华夏中小板 ETF	10.34	27.00	1.85%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.9.30。

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 2014.9.30。

图 2: 日均成交金额前 10 只 ETF (亿元)

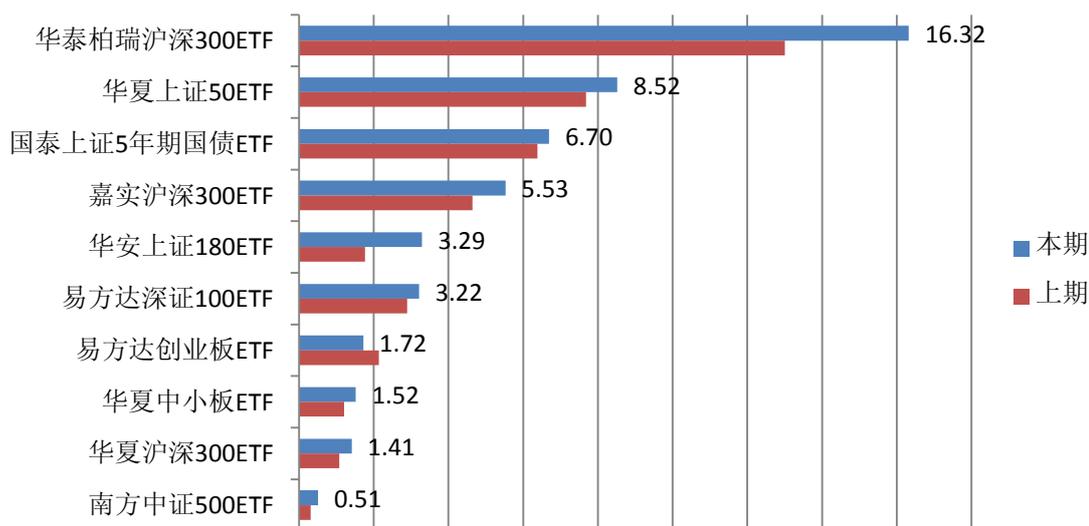
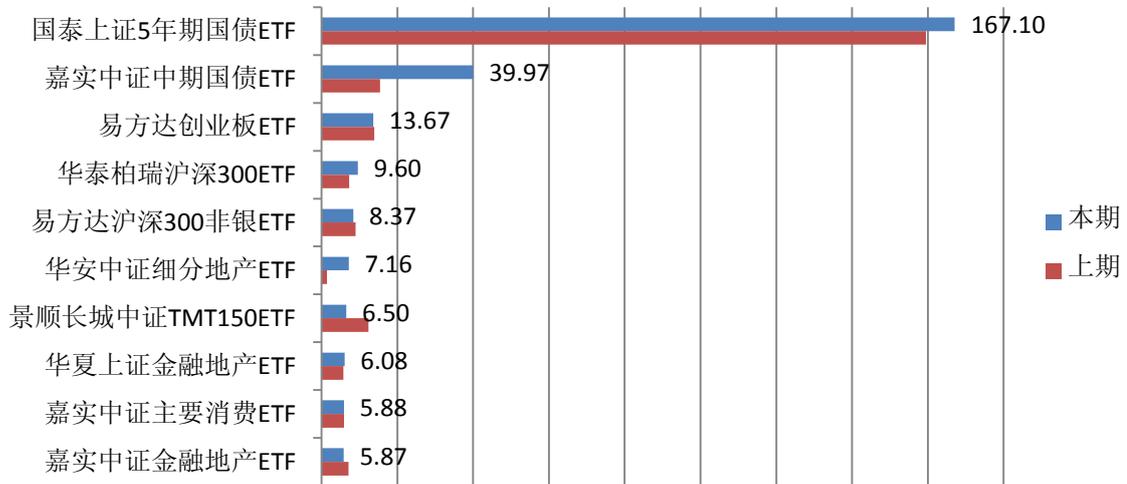


图 3: 日均换手率前 10 只 ETF



注: 换手率根据阶段成交量与平均份额计算, 单位为%。

LOF

表 8: LOF 指数基金 (场内部分) 份额及资产净值月度变化情况

代码	基金名称	9 月份额 (亿份)	份额增量	份额增幅	9 月资产 (亿元)	资产增量	资产增幅
160119	南方中证 500 交易型指数基金	0.830	0.050	6.40%	0.991	0.148	17.59%
160123	南方中证 50 债券指数基金	0.018	-0.001	-6.80%	0.020	-0.001	-5.89%
160125	南方中国中小盘股票指数基金	0.007	0.001	10.00%	0.007	0.000	6.32%
160415	华安深证 300 指数基金	0.126	-0.021	-14.12%	0.124	-0.010	-7.76%
160416	华安标普全球石油指数基金	0.009	-0.001	-12.75%	0.010	-0.002	-19.52%
160615	鹏华沪深 300 指数基金	0.266	-0.038	-12.49%	0.247	-0.022	-8.04%
160616	鹏华中证 500 指数基金	0.455	-0.012	-2.53%	0.456	0.033	7.90%
160706	嘉实沪深 300 指数基金	18.363	-0.809	-4.22%	12.583	0.017	0.13%
160716	嘉实中证锐联基本面 50 指数基金	0.713	-0.012	-1.63%	0.481	0.004	0.87%
160717	嘉实恒生中国企业指数基金	0.272	-0.011	-3.96%	0.203	-0.021	-9.58%
160720	嘉实中证中期企业债指数基金	0.001	0.000	17.75%	0.001	0.000	18.38%
160807	长盛沪深 300 指数基金	0.051	-0.003	-4.72%	0.043	0.000	-0.09%
161017	富国中证 500 指数增强型基金	0.010	0.001	16.09%	0.014	0.003	26.60%
161119	易方达中债新综合债券指数基金	0.011	0.008	293.46%	0.011	0.008	296.73%
161213	国投瑞银中证下游消费与服务产业指数基金	0.109	-0.003	-3.03%	0.107	0.003	3.16%
161217	国投瑞银中证上游资源产业指数基金	0.241	-0.006	-2.33%	0.139	0.002	1.53%
161607	融通巨潮 100 指数基金	0.510	-0.018	-3.49%	0.379	-0.004	-1.10%
161714	招商标普金砖四国指数基金	0.004	0.000	-8.25%	0.003	-0.001	-16.19%
161821	银华中证中票 50 指数基金	0.001	-0.002	-72.55%	0.001	-0.003	-72.39%

161907	万家中证红利指数基金	0.219	-0.008	-3.45%	0.207	0.005	2.72%
162307	海富通中证 100 指数基金	0.153	0.000	-0.07%	0.108	0.003	2.55%
162411	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数基金	0.007	-0.002	-18.38%	0.008	-0.003	-28.41%
162711	广发中证 500 指数基金	0.836	-0.115	-12.08%	0.902	-0.027	-2.89%
163001	长信中证中央企业 100 指数基金	0.077	-0.007	-8.71%	0.063	-0.002	-3.24%
163407	兴全沪深 300 指数增强型基金	0.157	-0.008	-4.96%	0.136	-0.001	-0.82%
163503	天治核心成长股票型基金	3.728	-0.087	-2.27%	2.092	0.059	2.92%
163821	中银沪深 300 等权重指数基金	0.002	0.000	-1.55%	0.002	0.000	5.81%
164205	天弘深证成份指数基金	0.009	0.000	-1.81%	0.006	0.000	0.84%
164815	工银瑞信标普全球自然资源指数基金	0.006	0.004	331.96%	0.005	0.004	298.25%
165309	建信沪深 300 指数基金	0.134	-0.003	-2.26%	0.099	0.002	2.04%
165806	东吴深证 100 指数增强型基金	0.019	-0.001	-6.83%	0.017	-0.001	-3.33%
166007	中欧沪深 300 指数增强型基金	0.034	-0.010	-22.31%	0.029	-0.007	-18.81%
167901	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式基金	0.046	-0.002	-3.75%	0.045	0.000	0.05%
总计		27.425	-1.117		19.540	0.189	

注 1: 数据来源:深交所;统计期为 2014.9.1-2014.9.30.

分级基金

表 9: 分级基金 (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	9 月份额 (亿份)	份额 增量	增幅	9 月资产 (亿元)	资产增量	增幅
150001	瑞福进取	国投瑞银	2012-7-17	36.078	0.000	0.00%	31.641	2.345	8.00%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-10-14	0.795	-0.001	-0.17%	0.804	0.037	4.81%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-10-14	0.795	-0.001	-0.17%	0.797	0.031	3.98%
150012	双禧 A	国联安	2010-4-16	7.145	-0.333	-4.45%	7.823	-0.320	-3.93%
150013	双禧 B	国联安	2010-4-16	10.717	-0.500	-4.45%	9.088	0.036	0.40%
150018	银华稳进	银华	2010-5-7	124.034	-4.158	-3.24%	129.616	-3.576	-2.68%
150019	银华锐进	银华	2010-5-7	124.034	-4.158	-3.24%	54.451	4.328	8.63%
150022	申万收益	申万菱信	2010-10-22	23.262	-0.893	-3.70%	23.378	-0.218	-0.93%
150023	申万进取	申万菱信	2010-10-22	23.262	-0.893	-3.70%	2.228	-0.020	-0.90%
150028	信诚 500A	信诚	2011-2-11	3.948	-0.140	-3.43%	4.106	-0.121	-2.87%
150029	信诚 500B	信诚	2011-2-11	5.922	-0.211	-3.43%	5.164	0.693	15.51%
150030	银华金利	银华	2011-3-17	4.799	-0.412	-7.90%	5.029	-0.400	-7.37%
150031	银华鑫利	银华	2011-3-17	4.799	-0.412	-7.90%	4.444	0.046	1.05%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-1	3.088	-1.018	-24.79%	3.237	-1.046	-24.43%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-1	3.088	-1.018	-24.79%	2.329	-0.509	-17.94%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-1	0.015	-0.001	-4.56%	0.016	-0.001	-4.04%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-1	0.023	-0.001	-4.56%	0.034	0.003	10.42%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-1-31	0.019	0.013	220.15%	0.020	0.014	221.90%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-1-31	0.029	0.020	220.15%	0.040	0.029	271.81%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-1-30	0.043	-0.022	-33.39%	0.045	-0.022	-33.07%

150058	久兆积极	长城久兆	2012-1-30	0.065	-0.032	-33.39%	0.083	-0.027	-24.74%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-8	1.232	-0.104	-7.78%	1.291	-0.101	-7.25%
150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-8	1.848	-0.156	-7.78%	2.038	-0.026	-1.24%
150064	同瑞 A	长盛	2011-12-6	0.011	-0.002	-18.51%	0.011	-0.002	-18.05%
150065	同瑞 B	长盛	2011-12-6	0.016	-0.004	-18.51%	0.018	-0.002	-8.81%
150069	双力 A	国联安	2012-3-23	0.096	-0.006	-5.80%	0.099	-0.006	-5.34%
150070	双力 B	国联安	2012-3-23	0.096	-0.006	-5.80%	0.148	0.016	12.34%
150073	诺安稳健	诺安	2012-3-29	0.024	-0.013	-35.89%	0.025	-0.014	-35.52%
150075	诺安进取	诺安	2012-3-29	0.036	-0.020	-35.89%	0.042	-0.017	-28.53%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-5-7	0.281	-0.010	-3.34%	0.294	-0.009	-2.87%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-5-7	0.281	-0.010	-3.34%	0.212	0.013	6.38%
150083	广发 100A	广发	2012-5-7	0.318	-0.033	-9.33%	0.334	-0.032	-8.83%
150084	广发 100B	广发	2012-5-7	0.318	-0.033	-9.33%	0.207	-0.001	-0.48%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-8	2.029	-1.256	-38.23%	2.082	-1.270	-37.89%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-8	2.029	-1.256	-38.23%	2.366	-0.941	-28.46%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-6-5	0.006	-0.003	-32.46%	0.006	-0.003	-32.09%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-6-5	0.006	-0.003	-32.46%	0.009	-0.002	-20.02%
150090	万家创 A	万家	2012-8-2	0.045	0.012	37.37%	0.048	0.013	38.12%
150091	万家创 B	万家	2012-8-2	0.045	0.012	37.37%	0.056	0.019	53.10%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-10	0.006	-0.006	-48.21%	0.007	-0.006	-47.91%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-10	0.006	-0.006	-48.21%	0.008	-0.006	-43.07%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-7	0.004	-0.006	-62.91%	0.004	-0.007	-62.69%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-7	0.004	-0.006	-62.91%	0.006	-0.008	-56.52%
150096	商品 A	招商	2012-6-28	10.945	-0.286	-2.54%	11.481	-0.232	-1.98%
150097	商品 B	招商	2012-6-28	10.945	-0.286	-2.54%	6.512	1.043	19.07%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-12	3.956	-0.327	-7.63%	4.051	-0.309	-7.08%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-12	5.934	-0.490	-7.63%	5.246	0.164	3.23%
150100	资源 A	鹏华	2012-9-27	2.291	-0.345	-13.07%	2.394	-0.347	-12.66%
150101	资源 B	鹏华	2012-9-27	2.291	-0.345	-13.07%	2.646	0.000	0.00%
150104	华安 300A	华安	2012-6-25	0.150	-0.008	-4.82%	0.157	-0.007	-4.27%
150105	华安 300B	华安	2012-6-25	0.150	-0.008	-4.82%	0.133	0.004	3.31%
150106	易基稳健	易方达	2012-9-20	0.198	-0.003	-1.46%	0.199	-0.016	-7.38%
150107	易基进取	易方达	2012-9-20	0.198	-0.003	-1.46%	0.285	0.029	11.24%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-13	0.532	-0.064	-10.75%	0.533	-0.102	-16.10%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-13	0.532	-0.064	-10.75%	0.622	0.002	0.40%
150110	华商 500A	华商	2012-9-6	0.006	0.000	-5.72%	0.007	0.000	-5.30%
150111	华商 500B	华商	2012-9-6	0.009	-0.001	-5.72%	0.014	0.001	9.31%
150112	工银 100A	工银瑞信	2012-10-25	0.103	0.000	-0.03%	0.105	0.001	0.53%
150113	工银 100B	工银瑞信	2012-10-25	0.103	0.000	-0.03%	0.094	0.007	7.86%
150117	房地产 A	国泰	2013-2-6	2.527	-0.105	-3.98%	2.658	-0.094	-3.43%
150118	房地产 B	国泰	2013-2-6	2.527	-0.105	-3.98%	2.699	0.099	3.79%
150121	银河优先	银河	2013-3-29	0.075	-0.007	-8.93%	0.079	-0.007	-8.40%
150122	银河进取	银河	2013-3-29	0.075	-0.007	-8.93%	0.059	0.000	0.30%

Index-linked Products Monthly Review
September 2014

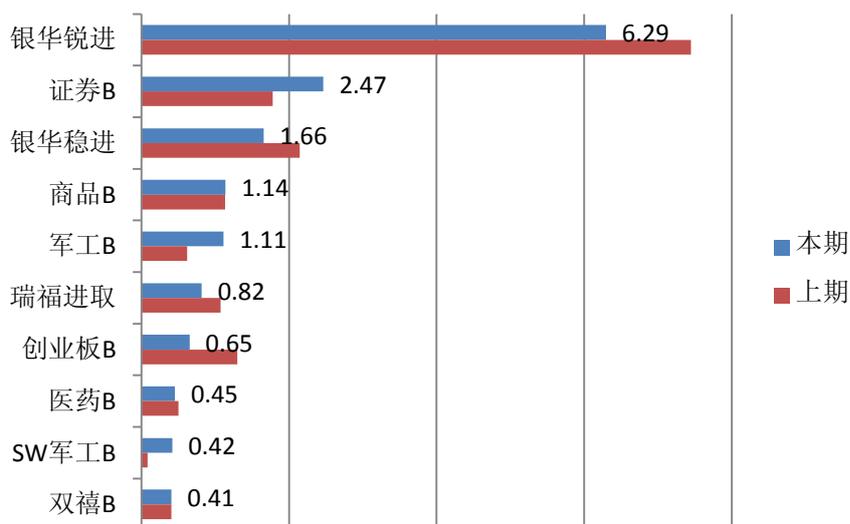


150123	建信 50A	建信	2013-3-28	1.529	-0.011	-0.73%	1.615	-0.002	-0.10%
150124	建信 50B	建信	2013-3-28	1.529	-0.011	-0.73%	1.418	0.049	3.58%
150130	医药 A	国泰	2013-8-29	5.053	0.052	1.04%	5.316	0.086	1.64%
150131	医药 B	国泰	2013-8-29	5.053	0.052	1.04%	5.667	0.742	15.08%
150133	德信 A	德邦	2013-4-25	0.026	-0.002	-8.02%	0.027	-0.002	-7.75%
150134	德信 B	德邦	2013-4-25	0.011	-0.001	-8.02%	0.012	-0.001	-4.97%
150138	银华 800A	银华	2013-11-5	0.027	-0.003	-10.72%	0.029	-0.003	-10.20%
150139	银华 800B	银华	2013-11-5	0.027	-0.003	-10.72%	0.037	0.001	4.01%
150140	国金 300A	国金通用	2013-7-26	0.040	0.002	6.35%	0.042	0.003	6.96%
150141	国金 300B	国金通用	2013-7-26	0.040	0.002	6.35%	0.045	0.006	14.31%
150143	转债 A	银华	2013-8-15	0.121	-0.023	-16.25%	0.127	-0.024	-15.76%
150144	转债 B	银华	2013-8-15	0.052	-0.010	-16.25%	0.053	-0.004	-7.27%
150145	300 高贝 A	招商	2013-8-1	0.035	-0.017	-32.46%	0.037	-0.018	-32.09%
150146	300 高贝 B	招商	2013-8-1	0.035	-0.017	-32.46%	0.036	-0.010	-22.67%
150148	800 医药 A	信诚	2013-8-16	0.290	-0.022	-6.92%	0.304	-0.021	-6.48%
150149	800 医药 B	信诚	2013-8-16	0.290	-0.022	-6.92%	0.311	0.020	6.93%
150150	800 有色 A	信诚	2013-8-30	1.223	0.294	31.66%	1.283	0.313	32.29%
150151	800 有色 B	信诚	2013-8-30	1.223	0.294	31.66%	1.146	0.380	49.71%
150152	创业板 A	富国	2013-9-12	4.765	-2.566	-35.00%	4.994	-2.645	-34.63%
150153	创业板 B	富国	2013-9-12	4.765	-2.566	-35.00%	5.432	-1.840	-25.30%
150157	800 金融 A	信诚	2013-12-20	2.034	0.813	66.66%	2.131	0.859	67.46%
150158	800 金融 B	信诚	2013-12-20	2.034	0.813	66.66%	2.286	0.959	72.33%
150164	可转债 A	东吴	2014-6-6	0.014	-0.007	-33.55%	0.015	-0.007	-33.23%
150165	可转债 B	东吴	2014-6-6	0.006	-0.003	-33.55%	0.007	-0.003	-29.83%
150167	银华 300A	银华	2014-1-21	0.078	-0.049	-38.58%	0.081	-0.050	-38.22%
150168	银华 300B	银华	2014-1-21	0.078	-0.049	-38.58%	0.090	-0.044	-33.04%
150169	恒生 A	汇添富	2014-4-11	0.093	0.017	21.78%	0.096	0.018	22.37%
150170	恒生 B	汇添富	2014-4-11	0.093	0.017	21.78%	0.096	0.005	5.07%
150171	证券 A	申万菱信	2014-3-31	14.161	3.709	35.48%	14.632	3.887	36.18%
150172	证券 B	申万菱信	2014-3-31	14.161	3.709	35.48%	18.670	6.435	52.60%
150175	银华 H 股 A	银华	2014-5-12	0.021	-0.025	-53.99%	0.022	-0.025	-53.73%
150176	银华 H 股 B	银华	2014-5-12	0.021	-0.025	-53.99%	0.024	-0.034	-59.09%
150177	非银行 A	鹏华	2014-5-19	0.407	0.026	6.73%	0.416	0.028	7.25%
150178	非银行 B	鹏华	2014-5-19	0.407	0.026	6.73%	0.521	0.072	16.05%
150179	信息 A	鹏华	2014-5-19	0.203	-0.013	-6.10%	0.208	-0.012	-5.64%
150180	信息 B	鹏华	2014-5-19	0.203	-0.013	-6.10%	0.298	0.017	6.10%
150181	军工 A	富国	2014-4-23	2.901	1.037	55.67%	2.985	1.077	56.43%
150182	军工 B	富国	2014-4-23	2.901	1.037	55.67%	5.625	2.845	102.30%
150184	环保 A	申万菱信	2014-6-16	0.588	0.182	44.86%	0.600	0.188	45.61%
150185	环保 B	申万菱信	2014-6-16	0.588	0.182	44.86%	0.812	0.321	65.55%
150186	SW 军工 A	申万菱信	2014-8-11	1.312	0.900	218.59%	1.327	0.913	220.24%
150187	SW 军工 B	申万菱信	2014-8-11	1.312	0.900	218.59%	1.862	1.428	328.84%
150192	地产 A	鹏华	2014-9-22	0.139	0.139	/	0.139	0.139	/
150193	地产 B	鹏华	2014-9-22	0.139	0.139	/	0.140	0.140	/

150194	互联网 A	富国	2014-9-23	0.765	0.765	/	0.769	0.769	/
150195	互联网 B	富国	2014-9-23	0.765	0.765	/	0.815	0.815	/
总计				499.802	-9.121		416.255	16.914	

注 1: 数据来源: 深交所; 统计期为 2014.9.1-2014.9.30, “/”代表基金上期未上市或者未开放申购赎回。

图 4: 分级基金场内部分日成交金额前 10 名 (亿元)



跨境 ETF (香港市场)

表 10: 跟踪境内市场的主要跨境 ETF

基金代码	基金名称	跟踪指数	基金管理人	上市日期	基金资产 (亿港元)
2808	易方达花旗中国国债 5-10 年期指数 ETF	花旗中国国债 5-10 年期	E Fund Management (Hong Kong)	2014-3-14	7.69
2811	海通沪深 300 指数 ETF	沪深 300	Haitong International Securities Group	2014-3-7	14.39
2816	沪深 300 地产 ETF	沪深 300 地产	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.23
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50	CSOP Asset Management	2012-11-8	461.79
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	712.61
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	80.69
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	1.40
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	富时中国 A50	Bosera Asset Management (International)	2013-12-9	55.96
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	0.64
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.50
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	5.01

Index-linked Products Monthly Review
September 2014

3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	0.86
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.29
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	0.60
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Universal Asset Management	2013-7-8	3.73
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.18
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.47
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.41
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	0.58
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	17.97
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.36
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.13
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.19
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.99
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.21
3063	沪深 300 运输指数 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.13
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	0.13
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management (Hong Kong)	2012-11-9	20.50
3107	添富共享中证主要消费指数 ETF	中证主要消费	China Universal Asset Management	2014-5-12	0.72
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	17.57
3120	易方达中华交易服务中国 120 指数 ETF	中华交易服务中国 120	E Fund Management (Hong Kong)	2013-10-21	0.24
3127	Horizons 沪深 300ETF	沪深 300	Mirae Asset Global Investments (Hong Kong)	2014-9-26	3.12
3128	恒生 A 股行业龙头指数 ETF	恒生 A 股行业龙头	Hang Seng Investment Management	2013-11-26	4.69
3132	添富共享中证医药卫生指数 ETF	中证医药卫生	China Universal Asset Management	2014-5-12	1.01
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	MSCI 中国 A50	Harvest Global Investments	2013-6-6	22.38
3137	南方东英中华 A80ETF	中华交易服务中国 A80	CSOP Asset Management	2013-9-23	2.92
3180	华夏中华交易服务中国 A80 指数 ETF	中华交易服务中国 A80	China Asset Management (Hong Kong)	2013-8-26	12.58
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management (Hong Kong)	2012-10-26	126.98
3199	南方东英中国五年期国债 ETF	中债五年期国债	CSOP Asset Management	2014-2-19	45.65

注：统计期为 2014.9.1-2014.9.30.

表 11: 主要跨境 ETF 交易情况

代码	名称	日均成交额	环比增幅	日均换手率	环比增幅
2808	易方达花旗中国国债 5-10 年期指数 ETF	10.96	-88.90%	0.02%	-92.88%
2811	海通沪深 300 指数 ETF	1162.22	-56.06%	0.77%	-53.56%
2816	沪深 300 地产 ETF	1.49	-80.42%	0.03%	-80.51%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	190527.78	-2.78%	3.93%	-3.51%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	195235.43	-3.07%	2.70%	-3.07%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	1589.39	110.05%	0.20%	107.04%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	52.01	-59.25%	0.37%	-58.74%
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	2069.20	242.52%	0.31%	333.62%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	25.61	87.64%	0.39%	82.42%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	31.35	-11.68%	0.50%	-30.72%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	106.27	-23.40%	0.22%	-25.75%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	10.99	-75.73%	0.13%	-76.53%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	15.80	72.69%	0.58%	59.67%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	15.24	-38.78%	0.28%	-42.15%
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	54.64	-12.23%	0.13%	0.20%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	12.40	29.62%	0.70%	25.53%
3024	标智上证 50 中国指数基金	3.63	-41.14%	0.02%	-41.32%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	16.46	-70.74%	0.11%	-73.57%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	3.27	-92.10%	0.06%	-92.28%
3049	沪深 300 指数 ETF	690.33	-16.09%	0.40%	-18.85%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	7.24	-76.29%	0.21%	-76.91%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	4.26	91.44%	0.35%	74.64%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	19.58	-56.01%	0.18%	-56.44%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	59.50	395.33%	0.60%	399.32%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	14.47	-17.38%	0.71%	-18.48%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	1.47	-13.57%	0.12%	-21.38%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.36	1624.91%	0.03%	1700.00%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	434.37	-17.39%	0.19%	-8.53%
3107	添富共享中证主要消费指数 ETF	4.94	126.40%	0.09%	270.86%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	155.49	136.44%	0.09%	128.94%
3120	易方达中华交易服务中国 120 指数 ETF	4.62	-33.44%	0.18%	-34.13%
3127	Horizons 沪深 300ETF	19.18	/	0.12%	/
3128	恒生 A 股行业龙头指数 ETF	21.84	41.25%	0.05%	37.91%
3132	添富共享中证医药卫生指数 ETF	4.91	362.16%	0.05%	402.06%
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	39.17	476.95%	0.02%	493.96%
3137	南方东英中华 A80ETF	65.90	-21.52%	0.22%	-21.77%
3180	华夏中华交易服务中国 A80 指数 ETF	11.73	-61.41%	0.01%	-52.98%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	30345.62	61.60%	2.49%	64.11%
3199	南方东英中国五年期国债 ETF	511.12	123.92%	0.05%	-85.36%

注: 日均成交额单位为“万港元”; 统计期为 2014.9.1-2014.9.30.; “/”表示基金上期未上市或未开放申购赎回。

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香梅路 1061 号中投国际商务中心 B1 栋 10F

邮编：518040

电话：(+86) 755-83241251

传真：(+86) 755-83243723

电邮：index@cninfo.com.cn

网址：<http://www.cnindex.com.cn>