

## 2014 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

#### 机构关注中国债券市场 境内首只债券 ETF 登陆美国

10 月 29 日，中国债券 ETF 首次在美国交易所上市，该基金主要追踪中国主权债、准主权债和公司债。这意味着美国投资者借此可参与中国债市。中国中央国债登记结算公司和上海清算所数据显示，今年 9 月末债券托管余额合计约 32.96 万亿元人民币。

中国高收益债吸引了众多机构的兴趣。10 月份以来，至少有德意志银行等四家机构递交文件，准备进军中国债市。业内人士表示，随着全球资产配置时代的到来，加上人民币国际化的加速推进，预计会有更多机构关注中国债券市场的投资机会。

#### 创业板酝酿多项革新 指数产品开发面临新方向

10 月 30 日，深圳证券交易所理事长吴利军表示，深交所将对创业板上市公司比较集中的地区，编制区域板块指数，并在此基础上开发可交易的指数产品，还将创造条件让国内已经在海外上市的创新创业企业，能够回归创业板上市，逐步让境外投资者可以直接投资创业板。

吴利军表示，创业板需要在制度设计上进一步突破，不断增强板块的包容性和覆盖面，更好适应实体经济新技术、新业态、新模式的创新步伐。

#### 沪港通有望解决 QFII 三大难题 助力 A 股市场国际化

10 月 29 日，MSCI 亚洲研究总监谢征侯指出，沪港通将解决 QFII(合格境外投资者)、RQFII(人民币合格境外投资者)的三大难题。包括在 QFII、RQFII 下，小型机构投资者由于没有配额，无法进入 A 股市场的问题；其次，沪港通没有资金流动的限制，股票卖掉可以实时得到现金，投资 A 股不设锁定期；另外沪港通可能一次过解决困扰境外投资者的税务风险问题。

➤ **指数基金上市/成立/发行/获批/申报情况**

**新上市**

新华中证环保产业指数分级基金于 10 月 16 日上市。

**新成立**

国泰国证食品饮料行业指数分级基金于 10 月 23 日成立。

广发中证百度百发策略 100 指数基金于 10 月 30 日成立。

南方中证 500 医药卫生指数 ETF 于 10 月 30 日成立。

**新发行**

大成纳斯达克 100 指数基金于 10 月 20 日发行。

华润元大富时中国 A50 指数基金于 10 月 27 日发行。

华安中证细分医药 ETF 联接基金于 10 月 30 日发行。

**新获批**

（本月无新获批基金。）

**新申报**

华夏基金于 10 月 10 日申报沪港通恒生 ETF（QDII）。

华夏基金于 10 月 10 日申报沪港通恒生 ETF 联接基金（QDII）。

易方达于 10 月 11 日申报沪深 300 非银行金融 ETF 联接基金。

广发基金于 10 月 22 日申报中证全指信息技术 ETF。

广发基金于 10 月 22 日申报中证全指信息技术 ETF 联接基金。

富国基金于 10 月 27 日申报中证全指证券公司指数分级基金。

## 市场要点

### 国内 ETF

2014 年 10 月，沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1458 亿元降至本期的 1399 亿元。从产品规模来看，嘉实沪深 300ETF 规模最大，达 268.14 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 16.85 亿元和 6.77 亿元。

### LOF

2014 年 10 月，LOF 指数基金的场内份额 26.29 亿份，较上月减少 1.13 亿份；场内资产净值为 19.54 亿元，较上月减少 0.49 亿元。

### 分级基金

2014 年 10 月，分级基金的场内份额为 523.72 亿份，较上月增加 23.91 亿份；场内资产净值为 453.54 亿元，较上月增加 37.28 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	91	1	0	0	1
LOF	33	0	0	0	0
分级基金	57	1	0	0	1
其他指数基金	142	1	3	0	4
总计	323	3	3	0	6

注: 统计期间为 2014.10.1-2014.10.31。

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	57	0	0	0	0
上证指数	64	0	0	0	0
巨潮指数	9	1	0	0	0
中证指数	151	2	1	0	4
其他机构	42	0	2	0	2
总计	323	3	3	0	6

注: 统计期间为 2014.10.1-2014.10.31。

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	标的指数	本期净值增幅
150144	银华中证转债 B	中证转债	16.81%
150165	东吴中证可转换债券 B	中证转债	13.05%
000179	广发美国房地产人民币	MSCI 美国 REIT 指数 (境外指数)	9.36%
150170	汇添富恒生指数 B	恒生指数	8.57%
150172	申万菱信申万证券行业 B	证券 II (申万)	8.50%
160416	华安标普全球石油	标普全球石油指数 (境外指数)	-4.62%
740101	长安 300 非周期	300 非周期	-6.56%
162411	华宝兴业标普油气	标普油气指数 (境外指数)	-12.12%
161024	富国中证军工	中证军工	-33.49%
150182	富国中证军工 B	中证军工	-49.97%

注: 统计期间为 2014.10.1-2014.10.31。

**➤ 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	2014 年三季度			2014 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
华夏基金管理有限公司	13	621.51	16.62%	12	630.94	17.82%
嘉实基金管理有限公司	19	549.63	14.70%	14	510.92	14.43%
易方达基金管理有限公司	21	399.70	10.69%	17	407.77	11.51%
银华基金管理有限公司	27	270.41	7.23%	12	245.77	6.94%
华安基金管理有限公司	17	198.94	5.32%	12	199.98	5.65%
华泰柏瑞基金管理有限公司	6	188.55	5.04%	6	192.43	5.43%
南方基金管理有限公司	16	163.78	4.38%	14	161.96	4.57%
国投瑞银基金管理有限公司	10	162.86	4.36%	6	88.65	2.50%
融通基金管理有限公司	6	139.62	3.73%	5	133.07	3.76%
博时基金管理有限公司	10	105.59	2.82%	10	105.72	2.99%
<b>总计</b>	<b>145</b>	<b>2800.59</b>	<b>74.89%</b>	<b>108</b>	<b>2677.216</b>	<b>75.59%</b>

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。

**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	2014 年三季度			2014 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	52	1489.89	39.84%	39	1483.01	41.87%
深证 100	19	590.91	15.80%	11	486.72	13.74%
上证 50	3	315.17	8.43%	3	339.88	9.60%
中证 500	28	185.77	4.97%	18	175.62	4.96%
上证 180	3	159.61	4.27%	3	158.87	4.49%
深证成指	7	59.89	1.60%	5	62.45	1.76%
道琼斯中国 88 指数	1	55.20	1.48%	1	55.32	1.56%
中证军工	7	50.43	1.35%	2	6.48	0.18%
中证 100	11	50.38	1.35%	9	47.97	1.35%
上证综指	3	44.09	1.18%	3	43.16	1.22%
<b>总计</b>	<b>134</b>	<b>3001.34</b>	<b>80.26%</b>	<b>94</b>	<b>2859.48</b>	<b>80.73%</b>

数据来源: 基金定期报告或成立公告。

**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)
159919	嘉实沪深 300ETF	280.59	000051	华夏沪深 300 指数基金	168.50
160706	嘉实沪深 300 指数基金	240.23	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	166.03
510330	华夏沪深 300ETF	206.78	121099	国投瑞银瑞福深证 100 分级	137.48
161812	银华深证 100 分级	190.58	110003	易方达 50 指数基金	129.79
510050	上证 50ETF	183.78	510180	华安上证 180ETF	121.58

数据来源: 基金定期报告或成立公告。

表 7：国内跟踪各系列指数的产品规模

标的指数	2014 年三季度			2014 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	57	778.89	20.83%	57	679.13	19.18%
上证指数	64	713.68	19.09%	64	737.91	20.84%
巨潮指数	8	42.12	1.13%	8	36.25	1.02%
中证指数	149	1971.53	52.72%	138	1884.44	53.21%
其他指数	42	233.23	6.24%	40	203.81	5.75%
总计	<b>320</b>	<b>3739.45</b>	<b>100%</b>	<b>307</b>	<b>3541.53</b>	<b>100%</b>

数据来源：最近一期基金定期报告或成立公告。

## &gt; 国内 ETF

表 8: 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	471	33.69%
上海	57	927	66.31%
总计	90	1399	100.00%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.10.31。

表 9: 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	164.11	11.73%
上证	35	430.85	30.80%
中证	33	788.33	56.36%
其他	5	15.45	1.10%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.10.31。

表 10: 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	424.98	30.38%
嘉实	8	279.92	20.01%
华泰柏瑞	3	152.50	10.90%
易方达	7	148.21	10.60%
华安	5	132.94	9.50%

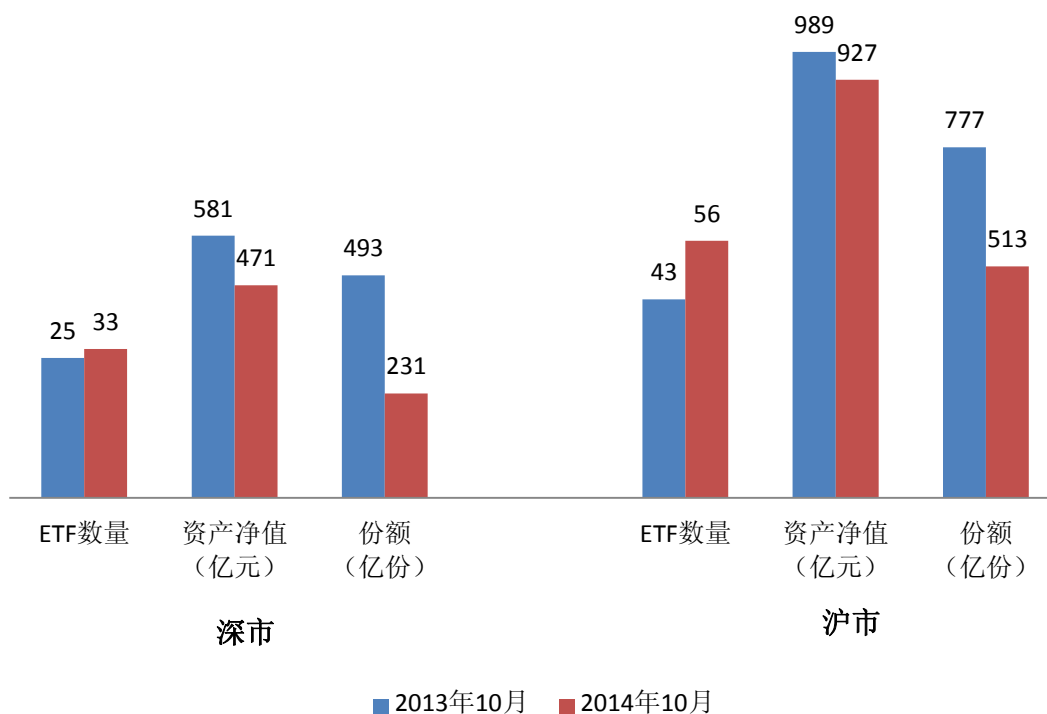
数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.10.31。

表 11: 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	102.39	268.14	19.17%
510330	华夏沪深 300ETF	80.30	205.92	14.72%
510050	华夏上证 50ETF	106.92	181.87	13.00%
510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	55.37	141.01	10.08%
510180	华安上证 180ETF	54.75	119.98	8.58%
159901	易方达深证 100ETF	28.28	85.12	6.09%
510500	南方中证 500ETF	38.06	53.33	3.81%
510310	易方达沪深 300ETF	42.46	43.14	3.08%
510510	广发中证 500ETF	19.67	27.64	1.98%
159902	华夏中小板 ETF	9.06	23.45	1.68%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2014.10.31。

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 2014.10.31。

图 2：日均成交金额前 10 只 ETF（亿元）

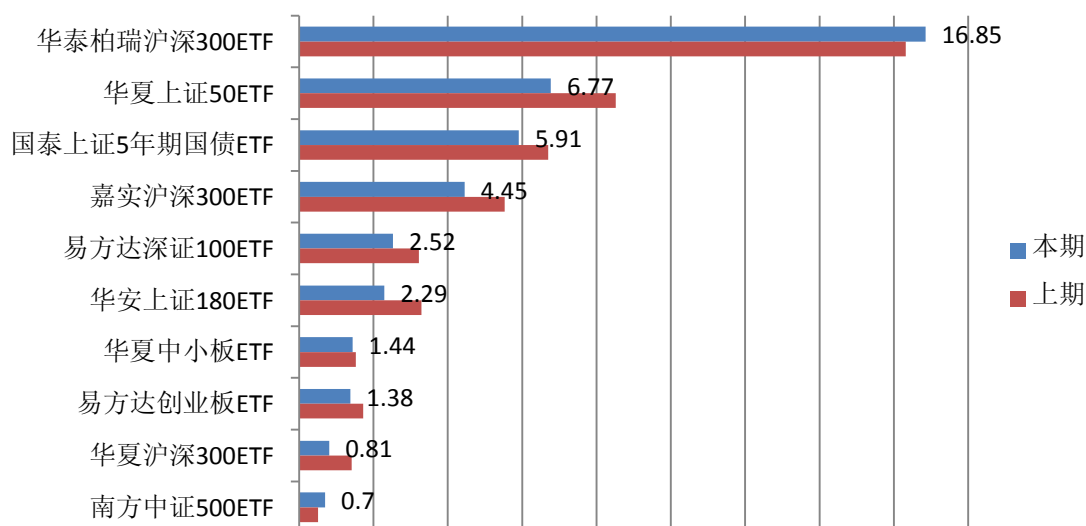
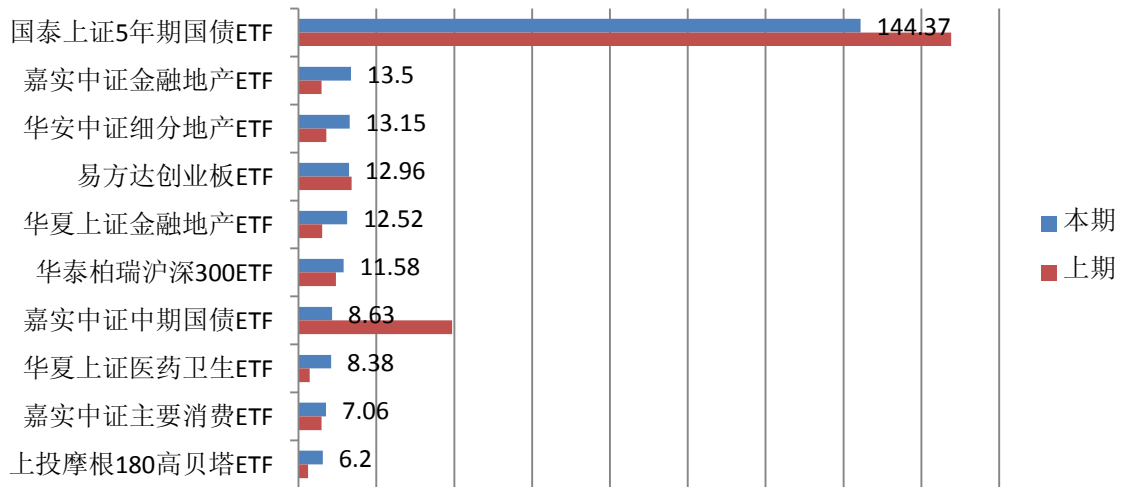


图 3：日均换手率前 10 只 ETF





注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算，单位为%。

LOF

表 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	基金名称	10 月份额 (亿份)	份额增量	份额增幅	10 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	0.733	-0.097	-11.68%	0.865	-0.126	-12.71%
160123	南方中证 50 债券指数基金	0.017	-0.002	-10.85%	0.019	-0.001	-4.96%
160125	南方中国中小盘股票指数基金	0.011	0.005	75.84%	0.012	0.005	70.57%
160415	华安深证 300 指数基金	0.113	-0.012	-9.54%	0.113	-0.011	-8.87%
160416	华安标普全球石油指数基金	0.015	0.006	66.16%	0.016	0.006	59.87%
160615	鹏华沪深 300 指数基金	0.256	-0.010	-3.76%	0.243	-0.004	-1.62%
160616	鹏华中证 500 指数基金	0.436	-0.019	-4.18%	0.444	-0.012	-2.63%
160706	嘉实沪深 300 指数基金	17.522	-0.841	-4.58%	12.267	-0.316	-2.51%
160716	嘉实中证锐联基本面 50 指数基金	0.672	-0.041	-5.75%	0.475	-0.006	-1.25%
160717	嘉实恒生中国企业指数基金	0.267	-0.005	-1.84%	0.207	0.004	1.97%
160720	嘉实中证中期企业债指数基金	0.001	0.000	0.00%	0.001	0.000	0.00%
160807	长盛沪深 300 指数基金	0.050	-0.001	-1.96%	0.043	0.000	0.00%
161017	富国中证 500 指数增强型基金	0.011	0.000	0.00%	0.015	0.001	7.01%
161119	易方达中债新综合债券指数基金	0.009	-0.002	-19.00%	0.009	-0.002	-18.45%
161213	国投瑞银中证下游消费与服务产业指数基金	0.099	-0.010	-9.16%	0.098	-0.009	-8.39%
161217	国投瑞银中证上游资源产业指数基金	0.237	-0.004	-1.66%	0.135	-0.004	-2.87%
161607	融通巨潮 100 指数基金	0.497	-0.013	-2.55%	0.379	0.000	0.00%
161714	招商标普金砖四国指数基金	0.005	0.001	22.83%	0.004	0.001	29.61%
161821	银华中证中票 50 指数基金	0.001	0.000	0.00%	0.001	0.000	0.00%
161907	万家中证红利指数基金	0.211	-0.008	-3.65%	0.203	-0.004	-1.94%
162307	海富通中证 100 指数基金	0.153	-0.001	-0.65%	0.111	0.003	2.77%

162411	华宝兴业标普石油天然气上游股票指数基金	0.031	0.024	347.70%	0.030	0.022	286.11%
162711	广发中证 500 指数基金	0.795	-0.041	-4.90%	0.869	-0.033	-3.66%
163001	长信中证中央企业 100 指数基金	0.075	-0.003	-3.87%	0.063	0.000	0.00%
163407	兴全沪深 300 指数增强型基金	0.151	-0.005	-3.19%	0.136	0.000	0.00%
163503	天治核心成长股票型基金	3.669	-0.059	-1.58%	2.085	-0.007	-0.33%
163821	中银沪深 300 等权重指数基金	0.002	0.000	0.00%	0.003	0.001	41.66%
164205	天弘深证成份指数基金	0.010	0.001	11.20%	0.006	0.000	0.00%
164815	工银瑞信标普全球自然资源指数基金	0.016	0.011	189.85%	0.015	0.010	182.64%
165309	建信沪深 300 指数基金	0.131	-0.004	-2.98%	0.098	-0.001	-1.01%
165806	东吴深证 100 指数增强型基金	0.018	-0.001	-5.29%	0.016	-0.001	-5.98%
166007	中欧沪深 300 指数增强型基金	0.034	-0.001	-2.92%	0.029	0.000	0.00%
167901	华宸未来沪深 300 指数增强型发起式基金	0.044	-0.002	-4.36%	0.044	-0.001	-2.24%
<b>总计</b>		<b>26.292</b>	<b>-1.134</b>		<b>19.054</b>	<b>-0.486</b>	

注 1: 数据来源:深交所;统计期为 2014.10.1-2014.10.31.

## 分级基金

表 13: 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	10 月份额 (亿份)	份额 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	2012-7-17	36.078	0.000	0.00%	32.254	0.613	1.94%
150008	瑞和小康	国投瑞银	2009-10-14	0.793	-0.002	-0.25%	0.818	0.014	1.74%
150009	瑞和远见	国投瑞银	2009-10-14	0.793	-0.002	-0.25%	0.799	0.002	0.25%
150012	双禧 A	国联安	2010-4-16	7.929	0.784	10.97%	8.722	0.899	11.49%
150013	双禧 B	国联安	2010-4-16	11.894	1.177	10.98%	10.550	1.462	16.09%
150018	银华稳进	银华	2010-5-7	114.133	-9.901	-7.98%	119.839	-9.777	-7.54%
150019	银华锐进	银华	2010-5-7	114.133	-9.901	-7.98%	51.360	-3.091	-5.68%
150022	申万收益	申万菱信	2010-10-22	22.417	-0.845	-3.63%	22.870	-0.508	-2.17%
150023	申万进取	申万菱信	2010-10-22	22.417	-0.845	-3.63%	2.179	-0.049	-2.20%
150028	信诚 500A	信诚	2011-2-11	4.041	0.093	2.36%	4.223	0.117	2.85%
150029	信诚 500B	信诚	2011-2-11	6.062	0.139	2.35%	5.437	0.273	5.29%
150030	银华金利	银华	2011-3-17	4.270	-0.529	-11.02%	4.500	-0.529	-10.52%
150031	银华鑫利	银华	2011-3-17	4.270	-0.529	-11.02%	4.073	-0.371	-8.35%
150051	信诚 300A	信诚	2012-2-1	2.414	-0.674	-21.82%	2.542	-0.695	-21.47%
150052	信诚 300B	信诚	2012-2-1	2.414	-0.674	-21.82%	1.900	-0.429	-18.42%
150053	泰达稳健	泰达	2011-12-1	0.013	-0.003	-19.71%	0.013	-0.003	-18.81%
150054	泰达进取	泰达	2011-12-1	0.019	-0.004	-17.52%	0.028	-0.006	-17.66%
150055	工银 500A	工银瑞信	2012-1-31	0.014	-0.005	-26.24%	0.015	-0.005	-25.03%
150056	工银 500B	工银瑞信	2012-1-31	0.021	-0.007	-24.49%	0.030	-0.010	-25.07%
150057	久兆稳健	长城久兆	2012-1-30	0.041	-0.002	-4.65%	0.043	-0.002	-4.48%
150058	久兆积极	长城久兆	2012-1-30	0.061	-0.003	-4.65%	0.077	-0.006	-7.27%
150059	银华金瑞	银华	2011-12-8	1.168	-0.064	-5.19%	1.231	-0.060	-4.65%

150060	银华鑫瑞	银华	2011-12-8	1.752	-0.096	-5.19%	1.887	-0.151	-7.41%
150064	同瑞 A	长盛	2011-12-6	0.010	0.000	0.00%	0.011	0.000	0.00%
150065	同瑞 B	长盛	2011-12-6	0.016	0.000	0.00%	0.018	0.000	0.00%
150069	双力 A	国联安	2012-3-23	0.089	-0.007	-7.28%	0.093	-0.006	-6.03%
150070	双力 B	国联安	2012-3-23	0.089	-0.007	-7.28%	0.138	-0.010	-6.74%
150073	诺安稳健	诺安	2012-3-29	0.024	0.000	0.00%	0.025	0.000	0.00%
150075	诺安进取	诺安	2012-3-29	0.036	0.000	0.00%	0.041	-0.001	-2.38%
150076	浙商稳健	浙商基金	2012-5-7	0.198	-0.084	-29.88%	0.207	-0.087	-29.61%
150077	浙商进取	浙商基金	2012-5-7	0.198	-0.084	-29.88%	0.155	-0.057	-26.85%
150083	广发 100A	广发	2012-5-7	0.295	-0.023	-7.23%	0.311	-0.023	-6.89%
150084	广发 100B	广发	2012-5-7	0.295	-0.023	-7.23%	0.197	-0.010	-4.82%
150085	中小板 A	申万菱信	2012-5-8	1.777	-0.253	-12.47%	1.833	-0.249	-11.96%
150086	中小板 B	申万菱信	2012-5-8	1.777	-0.253	-12.47%	2.026	-0.340	-14.37%
150088	金鹰 500A	金鹰	2012-6-5	0.005	-0.001	-16.40%	0.005	-0.001	-15.64%
150089	金鹰 500B	金鹰	2012-6-5	0.005	-0.001	-16.40%	0.007	-0.002	-22.44%
150090	万家创 A	万家	2012-8-2	0.034	-0.011	-24.28%	0.036	-0.012	-25.26%
150091	万家创 B	万家	2012-8-2	0.034	-0.011	-24.28%	0.040	-0.016	-28.62%
150092	诺德 S300A	诺德	2012-9-10	0.005	-0.001	-15.63%	0.005	-0.002	-29.91%
150093	诺德 S300B	诺德	2012-9-10	0.005	-0.001	-15.63%	0.006	-0.002	-25.19%
150094	泰信 400A	泰信	2012-9-7	0.003	-0.001	-27.07%	0.003	-0.001	-25.83%
150095	泰信 400B	泰信	2012-9-7	0.003	-0.001	-27.07%	0.005	-0.001	-17.13%
150096	商品 A	招商	2012-6-28	9.802	-1.142	-10.43%	10.332	-1.149	-10.01%
150097	商品 B	招商	2012-6-28	9.802	-1.142	-10.43%	5.685	-0.827	-12.70%
150098	同庆 800A	长盛	2012-5-12	3.755	-0.201	-5.08%	3.864	-0.187	-4.62%
150099	同庆 800B	长盛	2012-5-12	5.633	-0.302	-5.09%	5.075	-0.171	-3.26%
150100	资源 A	鹏华	2012-9-27	2.150	-0.141	-6.15%	2.257	-0.137	-5.72%
150101	资源 B	鹏华	2012-9-27	2.150	-0.141	-6.15%	2.417	-0.229	-8.65%
150104	华安 300A	华安	2012-6-25	0.148	-0.002	-1.33%	0.156	-0.001	-0.64%
150105	华安 300B	华安	2012-6-25	0.148	-0.002	-1.33%	0.137	0.004	3.00%
150106	易基稳健	易方达	2012-9-20	0.125	-0.073	-36.80%	0.126	-0.073	-36.72%
150107	易基进取	易方达	2012-9-20	0.125	-0.073	-36.80%	0.176	-0.109	-38.26%
150108	同辉 100A	长盛	2012-9-13	0.448	-0.083	-15.61%	0.452	-0.081	-15.19%
150109	同辉 100B	长盛	2012-9-13	0.448	-0.083	-15.61%	0.527	-0.095	-15.26%
150110	华商 500A	华商	2012-9-6	0.004	-0.002	-33.35%	0.005	-0.002	-29.54%
150111	华商 500B	华商	2012-9-6	0.006	-0.003	-33.35%	0.010	-0.004	-29.25%
150112	工银 100A	工银瑞信	2012-10-25	0.079	-0.024	-23.33%	0.081	-0.024	-22.96%
150113	工银 100B	工银瑞信	2012-10-25	0.079	-0.024	-23.33%	0.074	-0.020	-21.23%
150117	房地产 A	国泰	2013-2-6	2.666	0.139	5.50%	2.821	0.163	6.13%
150118	房地产 B	国泰	2013-2-6	2.666	0.139	5.50%	2.984	0.285	10.56%
150121	银河优先	银河	2013-3-29	0.067	-0.009	-11.93%	0.070	-0.009	-11.37%
150122	银河进取	银河	2013-3-29	0.067	-0.009	-11.93%	0.054	-0.005	-8.46%
150123	建信 50A	建信	2013-3-28	1.525	-0.004	-0.26%	1.620	0.005	0.31%
150124	建信 50B	建信	2013-3-28	1.525	-0.004	-0.26%	1.389	-0.029	-2.05%

*Index-linked Products Monthly Review*  
*October 2014*

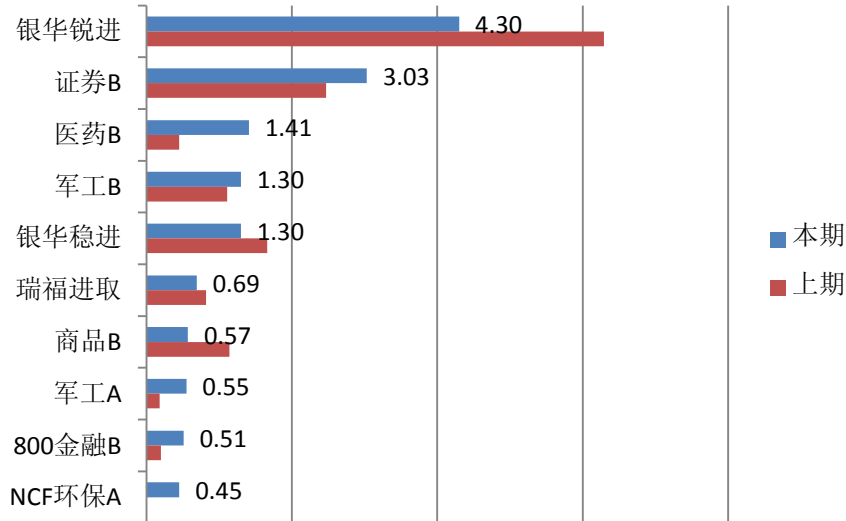


150130	医药 A	国泰	2013-8-29	11.194	6.141	121.52%	11.843	6.527	122.78%
150131	医药 B	国泰	2013-8-29	11.194	6.141	121.52%	12.924	7.257	128.06%
150133	德信 A	德邦	2013-4-25	0.026	0.000	0.00%	0.027	0.000	0.00%
150134	德信 B	德邦	2013-4-25	0.011	0.000	0.00%	0.013	0.001	8.05%
150138	银华 800A	银华	2013-11-5	0.024	-0.004	-14.69%	0.025	-0.004	-13.94%
150139	银华 800B	银华	2013-11-5	0.024	-0.004	-14.69%	0.033	-0.004	-10.95%
150140	国金 300A	国金通用	2013-7-26	0.023	-0.017	-42.96%	0.024	-0.018	-43.37%
150141	国金 300B	国金通用	2013-7-26	0.023	-0.017	-42.96%	0.027	-0.018	-39.63%
150143	转债 A	银华	2013-8-15	0.112	-0.009	-7.45%	0.118	-0.009	-7.09%
150144	转债 B	银华	2013-8-15	0.048	-0.004	-7.72%	0.057	0.004	7.55%
150145	300 高贝 A	招商	2013-8-1	0.030	-0.005	-14.35%	0.032	-0.005	-13.34%
150146	300 高贝 B	招商	2013-8-1	0.030	-0.005	-14.35%	0.032	-0.004	-11.19%
150148	800 医药 A	信诚	2013-8-16	0.339	0.049	16.91%	0.358	0.054	17.77%
150149	800 医药 B	信诚	2013-8-16	0.339	0.049	16.91%	0.383	0.072	23.16%
150150	800 有色 A	信诚	2013-8-30	1.101	-0.122	-9.98%	1.161	-0.122	-9.51%
150151	800 有色 B	信诚	2013-8-30	1.101	-0.122	-9.98%	1.003	-0.143	-12.48%
150152	创业板 A	富国	2013-9-12	4.232	-0.533	-11.19%	4.460	-0.534	-10.69%
150153	创业板 B	富国	2013-9-12	4.232	-0.533	-11.19%	4.638	-0.794	-14.62%
150157	800 金融 A	信诚	2013-12-20	3.630	1.597	78.53%	3.827	1.696	79.58%
150158	800 金融 B	信诚	2013-12-20	3.630	1.597	78.53%	4.422	2.136	93.45%
150164	可转债 A	东吴	2014-6-6	0.013	-0.002	-14.10%	0.013	-0.002	-13.77%
150165	可转债 B	东吴	2014-6-6	0.005	-0.001	-16.45%	0.007	0.000	0.00%
150167	银华 300A	银华	2014-1-21	0.065	-0.013	-16.76%	0.068	-0.013	-16.01%
150168	银华 300B	银华	2014-1-21	0.065	-0.013	-16.76%	0.077	-0.013	-14.44%
150169	恒生 A	汇添富	2014-4-11	0.203	0.111	119.54%	0.211	0.115	119.77%
150170	恒生 B	汇添富	2014-4-11	0.203	0.111	119.54%	0.229	0.133	137.99%
150171	证券 A	申万菱信	2014-3-31	17.553	3.391	23.95%	18.225	3.593	24.56%
150172	证券 B	申万菱信	2014-3-31	17.553	3.391	23.95%	25.109	6.439	34.49%
150175	银华 H 股 A	银华	2014-5-12	0.026	0.004	18.78%	0.026	0.004	18.22%
150176	银华 H 股 B	银华	2014-5-12	0.026	0.004	18.78%	0.029	0.005	21.26%
150177	非银行 A	鹏华	2014-5-19	0.608	0.202	49.68%	0.627	0.211	50.67%
150178	非银行 B	鹏华	2014-5-19	0.608	0.202	49.68%	0.843	0.322	61.77%
150179	信息 A	鹏华	2014-5-19	0.218	0.016	7.89%	0.225	0.017	8.19%
150180	信息 B	鹏华	2014-5-19	0.218	0.016	7.89%	0.315	0.017	5.70%
150181	军工 A	富国	2014-4-23	10.411	7.510	258.87%	10.453	7.468	250.17%
150182	军工 B	富国	2014-4-23	10.411	7.510	258.87%	10.099	4.474	79.54%
150184	环保 A	申万菱信	2014-6-16	2.638	2.050	348.42%	2.705	2.105	350.62%
150185	环保 B	申万菱信	2014-6-16	2.638	2.050	348.42%	3.618	2.806	345.59%
150186	SW 军工 A	申万菱信	2014-8-11	1.763	0.450	34.29%	1.792	0.465	35.04%
150187	SW 军工 B	申万菱信	2014-8-11	1.763	0.450	34.29%	2.509	0.647	34.75%
150190	NCF 环保 A	新华	2014-10-16	4.001	4.001	/	4.037	4.037	/
150191	NCF 环保 B	新华	2014-10-16	4.001	4.001	/	4.069	4.069	/
150192	地产 A	鹏华	2014-9-22	0.111	-0.028	-20.14%	0.112	-0.027	-19.37%
150193	地产 B	鹏华	2014-9-22	0.111	-0.028	-20.14%	0.117	-0.023	-16.40%

150194	互联网 A	富国	2014-9-23	0.849	0.084	10.98%	0.858	0.089	11.58%
150195	互联网 B	富国	2014-9-23	0.849	0.084	10.98%	0.892	0.077	9.45%
<b>总计</b>				<b>523.716</b>	<b>23.911</b>		<b>453.536</b>	<b>37.280</b>	

注 1: 数据来源: 深交所; 统计期为 2014.10.1-2014.10.31, “/”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 14: 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	3.79
2811	海通沪深 300 指数 ETF	沪深 300	Haitong International Securities Group	2014-3-7	13.51
2816	沪深 300 地产 ETF	沪深 300 地产	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.22
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50	CSOP Asset Management	2012-11-8	470.91
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	701.66
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	79.99
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	1.46
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	富时中国 A50	Bosera Asset Management (International)	2013-12-9	42.36
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	0.63
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.52
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	2.77

*Index-linked Products Monthly Review*  
*October 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	0.30
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	0.62
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Universal Asset Management	2013-7-8	3.82
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	1.52
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.42
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	18.29
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.35
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.14
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.20
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.04
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	15.27
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	0.66
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	17.55
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	0.25
3127	Horizons 沪深 300ETF	沪深 300	Mirae Asset Global Investments (Hong Kong)	2014-9-26	4.00
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	4.81
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	0.95
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	MSCI 中国 A50	Harvest Global Investments	2013-6-6	18.75
3137	南方东英中华 A80ETF	中华交易服务中国 A80	CSOP Asset Management	2013-9-23	3.03
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	9.02
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management (Hong Kong)	2012-10-26	115.88
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	50.63

注：统计期为 2014.10.1-2014.10.31.

**表 15: 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	26.83	144.80%	0.03%	50.00%
2811	海通沪深 300 指数 ETF	2253.45	93.89%	1.65%	114.29%
2816	沪深 300 地产 ETF	8.12	444.97%	0.37%	1133.33%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	109981.85	-42.28%	2.39%	-39.19%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	130876.52	-32.96%	1.85%	-31.48%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	820.14	-48.40%	0.10%	-50.00%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	15.20	-70.77%	0.11%	-70.27%
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	852.17	-58.82%	0.17%	-45.16%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	19.73	-22.96%	0.32%	-17.95%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	39.37	25.58%	0.79%	58.00%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	132.05	24.26%	0.34%	54.55%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	6.76	-38.49%	0.08%	-38.46%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	17.09	8.16%	0.61%	5.17%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	5.67	-62.80%	0.10%	-64.29%
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	20.09	-63.23%	0.05%	-61.54%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	8.73	-29.60%	0.50%	-28.57%
3024	标智上证 50 中国指数基金	0.20	-94.49%	0.00%	-100.00%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	36.36	120.90%	0.26%	136.36%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	2.06	-37.00%	0.04%	-33.33%
3049	沪深 300 指数 ETF	866.11	25.46%	0.50%	25.00%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	2.73	-62.29%	0.08%	-61.90%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	2.66	-37.56%	0.21%	-40.00%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	49.60	153.32%	0.42%	133.33%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	125.65	111.18%	1.27%	111.67%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	8.88	-38.63%	0.43%	-39.44%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	1.12	-23.81%	0.09%	-25.00%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.00	-100.00%	0.00%	-100.00%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	484.17	11.46%	0.28%	47.37%
3107	添富共享中证主要消费指数 ETF	4.94	0.00%	0.07%	-22.22%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	51.42	-66.93%	0.03%	-66.67%
3120	易方达中华交易服务中国 120 指数 ETF	2.08	-54.98%	0.08%	-55.56%
3127	Horizons 沪深 300ETF	111.61	481.91%	0.32%	166.67%
3128	恒生 A 股行业龙头指数 ETF	6.86	-68.59%	0.01%	-80.00%
3132	添富共享中证医药卫生指数 ETF	15.20	209.57%	0.16%	220.00%
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	34.88	-10.95%	0.02%	0.00%
3137	南方东英中华 A80ETF	142.32	115.96%	0.48%	118.18%
3180	华夏中华交易服务中国 A80 指数 ETF	40.98	249.36%	0.04%	300.00%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	18444.45	-39.22%	1.55%	-37.75%
3199	南方东英中国五年期国债 ETF	802.74	57.06%	0.17%	240.00%

注: 日均成交额单位为“万港元”; 统计期为 2014.10.1-2014.10.31.; “/”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>