

## 2015 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

#### ➤ 指数基金交易渠道拓宽 中欧所拟将 ETF 纳入交易产品

上交所 30 日透露，拟成立的中欧国际交易所的业务产品范围将包括但不限于交易所交易基金(ETF)、债券、存托凭证(DR)等。目前产品准备充分，已有十多家国内外金融机构计划合作发行若干只 ETF 产品，包括权益类、债券类和货币类基金等。除了目前正在准备的 ETF、债券、DR 等产品外，未来中欧所还将积极推出各种交易品种，把合资交易平台建设成为离岸人民币证券交易中心。

#### ➤ 内地与香港基金互认开跑 具体名单有望年底前公布

10 月 13 日，中国证监会在基金募集申请核准进度公示表中披露，就内地与香港基金互认事项，证监会已经受理两支恒生指数基金参与基金互认安排。此外证监会还披露，已有 17 支香港基金排队申请内地销售许可。而也有约 13 只内地基金递交了南下申请，并已和证监会进行了多轮问答，预期将与北上申请同步推出，具体产品名单有望在年底前公布。

近日，香港金融发展局也发表报告称，计划将香港 ETF 纳入沪港通和基金互认，A 股市场的指基品种和供应来源有望更多样化。

#### ➤ A 股市场首现 ETF 退市 无效产品加速淘汰

10 月 13 日，长盛基金上证市值百强 ETF 退市一事尘埃落定。长盛基金发布公告称，自 14 日起，长盛上证市值百强 ETF 进入财产清算期，不再接受投资者提出的申购和赎回申请。

部分市场人士认为，包括市值百强 ETF 在内的迷你基金规模过小，对基金公司来说属于不良资产。而自公募基金推行注册制以来，产品发行速度加快，今年 6 月以来的大跌 ETF 和 QDII 成为了迷你基金的重灾区。ETF 等指数产品作为应牛市而生的一揽子投资产品，在非单边上涨的市场环境下，ETF 产品的新陈代谢是正常的市场行为。

➤ 指数基金上市/成立/发行/获批/申报情况

**新上市**

（本月无新基金上市。）

**新成立**

（本月无新基金成立。）

**新发行**

东海中证社会发展安全产业主题指数基金于 10 月 28 日发行。

**新获批**

博时中证银联智惠大数据 100 指数基金于 10 月 9 日获批。

浙商资管汇金中证转型成长指数型于 10 月 9 日获批。

鹏华中证银联智策消费大数据指数基金于 10 月 13 日获批。

中欧中证银联智策大数据 100 指数基金于 10 月 26 日获批。

大成标普美国中概股 50 指数基金（QDII-LOF）于 10 月 26 日获批。

**新申报**

长信基金于 10 月 8 日申报上证港股通指数基金。

华润元大于 10 月 16 日申报港股通恒生中国企业 ETF。

华润元大于 10 月 16 日申报港股通恒生中国企业 ETF 联接基金。

长信基金于 10 月 23 日申报中证能源互联网主题指数基金（LOF）。

长信基金于 10 月 23 日申报中证上海改革发展主题指数基金（LOF）。

## 市场要点

---

### 国内 ETF

2015 年 10 月，沪深交易所上市的 ETF 总资产净值由上期 1700 亿元增至本期的 1889 亿元。从产品规模来看，华夏上证 50ETF 规模最大，达 304.32 亿元。从成交活跃情况来看，日均成交金额以易方达创业板 ETF 和华夏上证 50ETF 领先，分别为 6.71 亿元和 6.51 亿元。

### LOF

2015 年 10 月，LOF 指数基金的场内份额 52.78 亿份，较上月减少了 4.94 亿份；场内资产净值为 43.39 亿元，较上月减少了 1.26 亿元。

### 分级基金

2015 年 10 月，分级基金的场内份额为 1059.33 亿份，较上月减少 29.1 亿份；场内资产净值为 1073.34 亿元，较上月增加 156 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	112	0	0	0	1
LOF	33	0	0	0	2
分级基金	136	0	0	0	0
其他指数基金	191	0	1	5	2
总计	472	0	1	5	5

注: 统计期间为 2015.10.1-2015.10.31。

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	62	0	0	0	0
上证指数	70	0	0	0	1
国证指数	18	0	0	0	0
中证指数	268	0	1	4	2
其他机构	54	0	0	1	2
总计	472	0	1	5	5

注: 统计期间为 2015.10.1-2015.10.31。

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
160630	鹏华中证国防	中证国防	31.43%
164402	前海开源中航军工	中证中航军工	28.33%
163115	申万菱信中证军工	中证军工	27.03%
161031	富国中证工业 4.0	中证工业 4.0	26.70%
160636	鹏华中证移动互联网	中证移动互联	26.53%
001397	建信精工制造	中证精工制造	0.10%
165316	建信中证申万有色金属	中证申万有色金属	0.05%
161833	银华中证一带一路	中证一带一路	0.00%
165525	信诚中证建设工程	中证建设工程	-0.10%
000820	华安中证高分红	中证高分红	-0.76%

注: 统计期间为 2015.10.1-2015.10.31。

## ▶ 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	41	452	23.94%
上海	71	1437	76.06%
总计	112	1889	100.00%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2015.10.31。

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	18	164.17	8.69%
上证	37	653.53	34.60%
中证	48	1017.53	53.87%
其他	9	53.67	2.84%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2015.10.31。

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
华夏基金管理有限公司	12	547.20	28.97%
华泰柏瑞基金管理有限公司	4	255.67	13.54%
嘉实基金管理有限公司	8	229.53	12.15%
南方基金管理有限公司	10	224.35	11.88%
易方达基金管理有限公司	5	193.54	10.25%

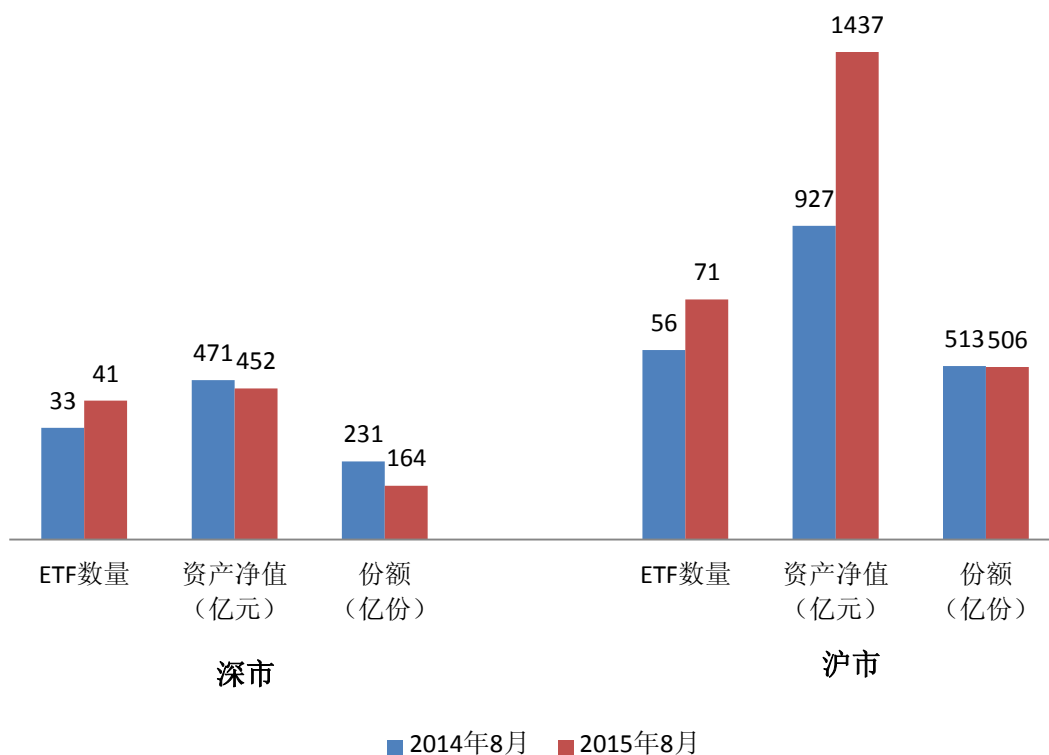
数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2015.10.31。

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
510050	华夏上证 50ETF	131.57	304.32	16.11%
510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	68.06	244.02	12.92%
159919	嘉实沪深 300ETF	56.52	210.41	11.14%
510180	华安上证 180ETF	60.45	189.00	10.01%
510500	南方中证 500ETF	25.78	188.31	9.97%
510330	华夏沪深 300ETF	48.56	176.52	9.35%
511220	海富通上证可质押城投债 ETF	0.61	62.20	3.29%
159901	易方达深证 100ETF	13.67	57.14	3.03%
159915	易方达创业板 ETF	18.73	44.08	2.33%
510310	易方达沪深 300ETF	28.40	40.93	2.17%

数据来源: 深沪交易所; 数据截止 2015.10.31。

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 2015.10.31。

图 2: 日均成交金额前 10 只 ETF (亿元)

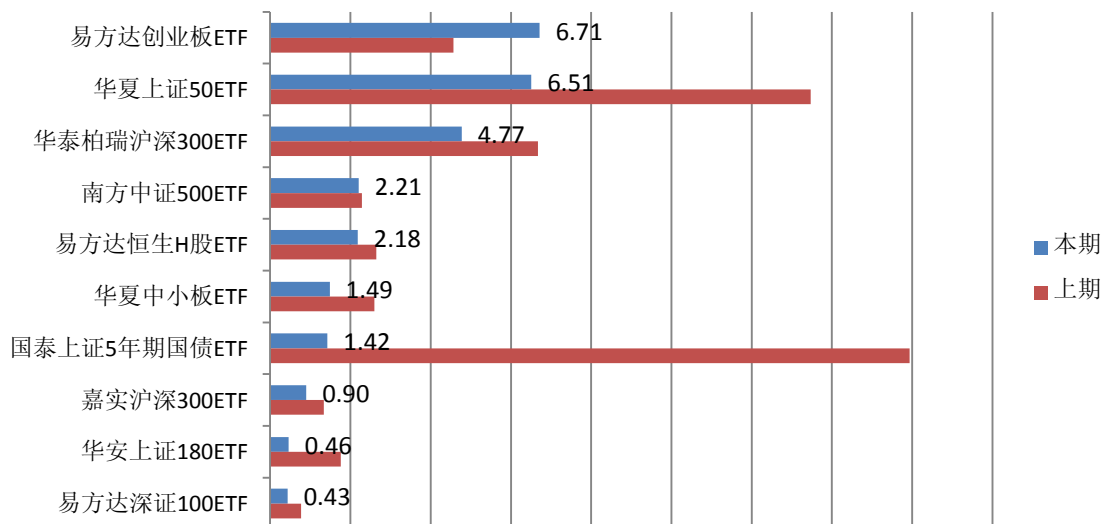
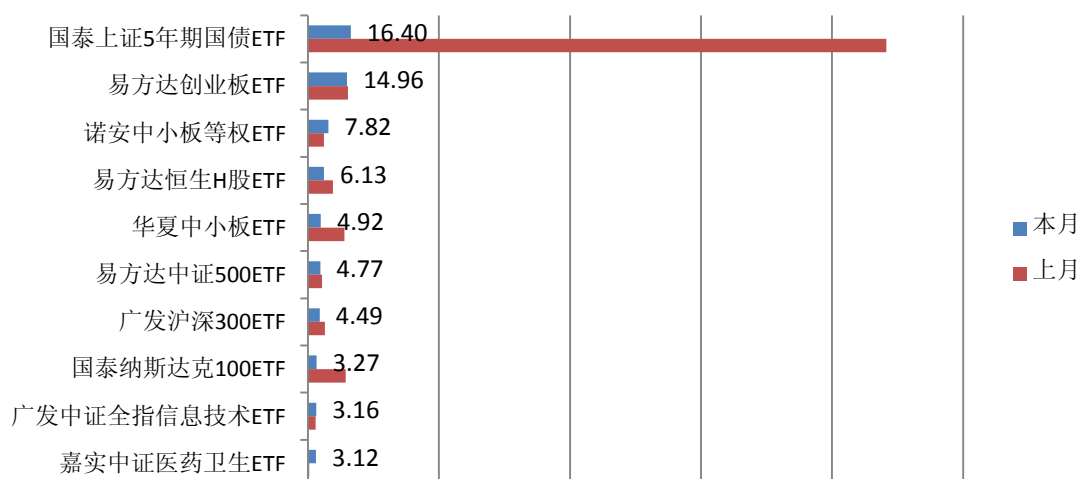


图 3: 日均换手率前 10 只 ETF



注：换手率根据阶段成交量与平均份额计算，单位为%。

### LOF

表 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	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 500ETF 联接	0.369	-0.031	-7.75%	0.622	0.038	6.50%
160123	南方中证 50 债	0.016	0.005	42.83%	0.019	0.005	36.95%
160415	华安深证 300	0.020	-0.001	-4.81%	0.027	0.003	12.40%
160416	华安标普全球石油	1.009	-0.197	-16.35%	0.854	-0.080	-8.56%
160615	鹏华沪深 300	0.092	-0.003	-3.15%	0.120	0.007	6.19%
160616	鹏华中证 500	0.108	-0.005	-4.42%	0.150	0.017	12.75%
160706	嘉实沪深 300ETF 联接	7.313	-0.313	-4.10%	7.159	0.358	5.26%
160716	嘉实基本面 50	0.463	-0.028	-5.70%	0.506	-0.003	-0.59%
160717	嘉实恒生中国企业	4.439	-0.434	-8.91%	3.227	-0.006	-0.19%
160720	嘉实中证中期企业债	0.413	0.004	0.98%	0.473	0.009	1.94%
160806	长盛同庆中证 800	2.461	-0.042	-1.68%	3.268	0.357	12.26%
160807	长盛沪深 300	0.029	0.000	0.00%	0.034	0.003	9.81%
161017	富国中证 500	0.017	-0.001	-5.65%	0.033	0.003	9.96%
161119	易方达中债新综合 A	1.242	0.091	7.91%	1.450	0.121	9.10%
161213	国投瑞银中证下游	0.011	-0.002	-16.05%	0.015	0.000	0.00%
161217	国投瑞银中证上游	0.177	-0.003	-1.66%	0.108	0.010	10.24%
161227	国投瑞银瑞福深证 100	0.224	0.002	0.90%	0.229	0.019	9.05%
161607	融通巨潮 100	0.431	-0.077	-15.14%	0.305	-0.026	-7.85%
161714	招商标普金砖四国	0.036	0.009	33.04%	0.043	0.011	34.91%
161821	银华中证中票 50A	0.068	0.000	0.00%	0.097	0.011	12.79%
161907	万家中证红利	0.034	-0.001	-2.83%	0.035	0.001	2.98%
162307	海富通中证 100	19.863	-0.211	-1.05%	11.739	1.080	10.13%
162411	华宝兴业标普油气人民币	0.294	-0.004	-1.34%	0.432	0.047	12.21%

162510	国联安双力中小板	0.067	-0.003	-4.28%	0.087	0.004	4.82%
162711	广发中证 500ETF 联接	0.007	-0.001	-12.44%	0.011	0.000	0.00%
163407	兴全沪深 300	0.134	-0.032	-19.22%	0.101	-0.015	-12.89%
163821	中银沪深 300 等权重	0.038	0.001	2.66%	0.040	0.005	14.21%
164815	工银瑞信标普全球资源	0.003	0.000	0.00%	0.004	0.001	30.75%
164906	交银中证海外中国互联网	0.014	0.000	0.00%	0.017	0.001	6.32%
165309	建信沪深 300	0.004	-0.001	-17.82%	0.006	-0.001	-13.93%
165806	东吴深证 100	13.295	-3.652	-21.55%	12.018	-0.726	-5.70%
166007	中欧沪深 300	0.092	-0.011	-10.62%	0.165	0.008	5.09%
167901	华宸未来沪深 300	0.137	-0.016	-10.48%	0.123	0.009	7.93%
总计		52.783	-4.941		43.394	1.262	

注 1: 数据来源:深交所;统计期为 2015.10.1-2015.10.31.

## ➤ 分级基金

表 9: 深沪交易所上市分级基金概况

上市地点	分级基金数量	资产净值 (亿元)	市场份额
深圳	120	1005.16	93.65%
上海	15	68.18	6.35%
总计	135	1073.34	100.00%

数据来源: 深沪交易所 (仅包括场内部分); 数据截止 2015.10.31。

表 10: 跟踪各系列指数分级基金概况

跟踪标的	分级基金数量	资产净值 (亿元)	市场份额
深证	13	163.74	9.63%
国证	10	124.49	7.41%
上证	3	11.75	2.22%
中证	107	735.14	79.26%
其他	2	38.22	1.48%

数据来源: 深沪交易所 (仅包括场内部分); 数据截止 2015.10.31。

表 11: 分级基金前五大指数基金管理人列表

基金公司	分级基金数量	资产净值 (亿元)	市场份额
富国基金管理有限公司	10	350.71	32.78%
申万菱信基金管理有限公司	8	122.94	11.49%
鹏华基金管理有限公司	17	111.40	10.41%
国泰基金管理有限公司	5	110.34	10.31%
银华基金管理有限公司	7	72.75	6.80%

数据来源: 深沪交易所 (仅包括场内部分); 数据截止 2015.10.31。

表 12: 规模最大的前十只分级基金列表

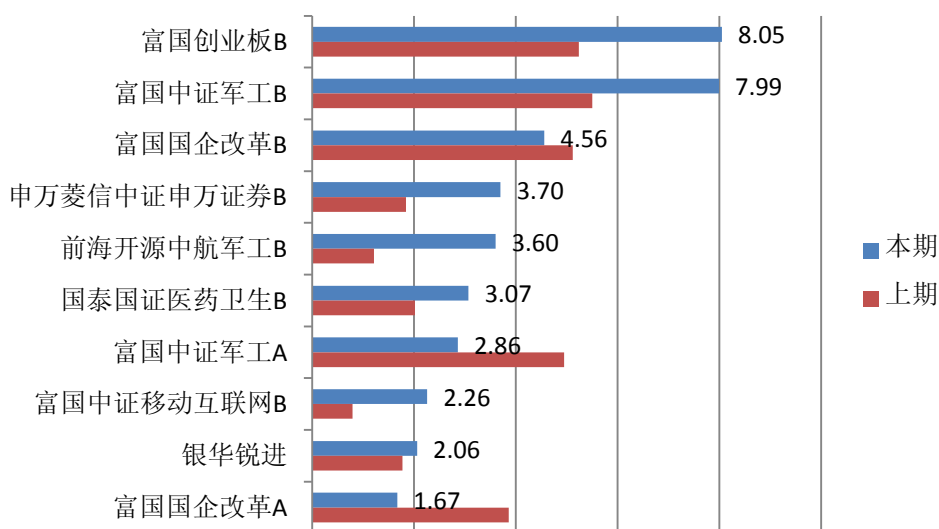
代码	简称	基金份额 (亿份)	资产净值 (亿元)	市场份额
----	----	-----------	-----------	------



150181	富国中证军工 A	63.82	65.67	6.12%
150182	富国中证军工 B	63.82	47.68	4.44%
150210	富国国企改革 B	42.31	45.61	4.25%
150130	国泰国证医药卫生 A	41.67	43.15	4.02%
150209	富国国企改革 A	42.31	42.73	3.98%
150153	富国创业板 B	28.77	39.21	3.65%
150172	申万菱信中证申万证券 B	24.06	32.63	3.04%
150227	鹏华中证银行 A	30.55	31.47	2.93%
150131	国泰国证医药卫生 B	41.67	31.05	2.89%
150222	前海开源中航军工 B	20.56	29.20	2.72%

数据来源：深沪交易所（仅包括场内部分）；数据截止 2015.10.31。

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 13：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	5.20
2811	海通沪深 300 指数 ETF	沪深 300	Haitong International Securities Group	2014-3-7	4.45

*Index-linked Products Monthly Review*  
*October 2015*



2816	沪深 300 地产 ETF	沪深 300 地产	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.21
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	富时中国 A50	CSOP Asset Management	2012-11-8	265.38
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	富时中国 A50	Blackrock	2004-11-18	421.15
2827	标智沪深 300 中国指数基金	沪深 300	BOCI - Prudential	2007-7-13	45.44
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	沪深 300 金融	Blackrock	2009-11-18	1.11
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	富时中国 A50	Bosera Asset Management (International)	2013-12-9	0.29
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	沪深 300 主要消费	Blackrock	2010-7-15	0.46
2844	沪深 300 金融指数 ETF	沪深 300 金融	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.28
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	沪深 300	Blackrock	2009-11-18	2.86
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	Blackrock	2010-7-15	0.34
3005	沪深 300 工业指数 ETF	沪深 300 工业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.23
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	沪深 300 基建	Blackrock	2009-11-18	0.48
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Universal Asset Management	2013-7-8	0.26
3017	沪深 300 能源指数 ETF	沪深 300 能源	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.17
3024	标智上证 50 中国指数基金	上证 50	BOCI - Prudential	2009-4-9	1.17
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	沪深 300 可选消费	DB Platinum Advisor	2010-3-25	1.06
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	Blackrock	2009-11-18	0.09
3049	沪深 300 指数 ETF	沪深 300	DB Platinum Advisor	2010-3-25	7.80
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	沪深 300 能源	Blackrock	2009-11-18	0.16
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	沪深 300 公用事业	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.19
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	沪深 300 医药卫生	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.86
3061	沪深 300 银行指数 ETF	沪深 300 银行	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.24
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	沪深 300 原材料	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.18
3063	沪深 300 运输指数 ETF	沪深 300 运输	DB Platinum Advisor	2010-3-25	0.17
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	0.15
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	中证 100	E Fund Management (Hong Kong)	2012-11-9	17.66
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	0.15
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	MSCI 中国 A 股	Harvest Global Investments	2012-10-12	2.51
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	0.28
3122	南方东英中国超短期债券 ETF	花旗中国政府及政策性 银行债券 0-1 年精选指数	CSOP Asset Management	2015-1-15	0.81
3127	Horizons 沪深 300ETF	沪深 300	Mirae Asset Global Investments (Hong Kong)	2014-9-26	1.67
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	3.52
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	0.47
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	MSCI 中国 A50	Harvest Global Investments	2013-6-6	0.31
3137	南方东英中华 A80ETF	中华交易服务中国 A80	CSOP Asset Management	2013-9-23	0.21

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	0.27
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	沪深 300	China Asset Management (Hong Kong)	2012-10-26	143.72
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	15.50
3147	南方东英中国创业板指数 ETF	创业板指数	CSOP Asset Management	2015-5-15	3.25
3150	嘉实中证小盘 500 指数 ETF	中证小盘 500 指数	HarvestGlobal Investments	2015-5-21	0.23
3156	广发国际 MSCI 中国 A 股国际指数 ETF	MSCI 中国 A 股国际指数	GF International Investment Management	2015-7-29	0.98
3129	南方东英沪深 300 精明 ETF	沪深 300 精明指数	CSOP Asset Management	2015-10-23	0.83

注：统计期为 2015.10.1-2015.10.31.

表 14：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	5.36	267.12%	0.01%	/
2811	海通沪深 300 指数 ETF	141.83	4.64%	0.33%	-2.94%
2816	沪深 300 地产 ETF	1.57	-25.94%	0.08%	-27.27%
2822	CSOP 富时中国 A50 ETF	87801.05	-32.36%	3.56%	-42.21%
2823	安硕富时 A50 中国指数 ETF	97743.95	-26.26%	2.53%	-31.99%
2827	标智沪深 300 中国指数基金	5525.05	3.93%	1.41%	-5.37%
2829	安硕沪深 A 股金融指数 ETF	14.91	-7.56%	0.16%	-15.79%
2832	博时富时中国 A50 指数 ETF	1.55	-72.85%	0.05%	-77.27%
2841	安硕 A 股主要消费指数 ETF	10.27	-9.60%	0.27%	-6.90%
2844	沪深 300 金融指数 ETF	11.37	282.83%	0.43%	290.91%
2846	安硕沪深 300 A 股指数 ETF	48.26	7.80%	0.19%	0.00%
3001	安硕 A 股可选消费指数 ETF	15.62	11.25%	0.57%	11.76%
3005	沪深 300 工业指数 ETF	1.56	178.57%	0.07%	133.33%
3006	安硕沪深 A 股基建指数 ETF	5.36	-16.12%	0.12%	-20.00%
3008	添富共享沪深 300 指数 ETF	11.07	231.44%	0.41%	272.73%
3017	沪深 300 能源指数 ETF	0.60	50.00%	0.04%	100.00%
3024	标智上证 50 中国指数基金	11.43	656.95%	0.10%	900.00%
3025	沪深 300 可选消费指数 ETF	0.56	-79.86%	0.01%	-66.67%
3039	安硕沪深 A 股原材料指数 ETF	2.71	113.39%	0.32%	88.24%
3049	沪深 300 指数 ETF	286.79	19.47%	0.39%	11.43%
3050	安硕沪深 A 股能源指数 ETF	2.69	540.48%	0.17%	466.67%
3052	沪深 300 公用事业指数 ETF	0.26	-65.79%	0.01%	-75.00%
3057	沪深 300 医药卫生指数 ETF	11.49	151.42%	0.14%	133.33%
3061	沪深 300 银行指数 ETF	0.82	-89.53%	0.03%	-91.43%
3062	沪深 300 原材料指数 ETF	0.04	-71.43%	0.00%	-100.00%
3063	沪深 300 运输指数 ETF	3.26	539.22%	0.20%	566.67%
3071	大成中证中国内地消费 ETF	0.02	-94.29%	0.00%	-100.00%
3100	易方达中证 100A 股指数 ETF	71.55	40.82%	0.07%	-56.25%

3107	添富共享中证主要消费指数 ETF	3.14	-25.06%	0.23%	-17.86%
3118	嘉实 MSCI 中国 A 股指数 ETF	86.35	-53.05%	0.34%	-56.96%
3120	易方达中华交易服务中国 120 指数 ETF	0.58	-54.69%	0.02%	-60.00%
3122	南方东英中国超短期债券 ETF	0.75	-96.60%	0.01%	-96.43%
3127	Horizons 沪深 300ETF	39.40	15.58%	0.25%	4.17%
3128	恒生 A 股行业龙头指数 ETF	36.67	-5.10%	0.11%	0.00%
3132	添富共享中证医药卫生指数 ETF	3.73	-24.65%	0.08%	-27.27%
3136	嘉实 MSCI 中国 A50 指数 ETF	4.86	50.93%	0.17%	54.55%
3137	南方东英中华 A80ETF	1.58	-58.31%	0.08%	-57.89%
3180	华夏中华交易服务中国 A80 指数 ETF	1.64	65.66%	0.06%	50.00%
3188	华夏沪深 300 指数 ETF	29275.69	-9.13%	2.22%	-19.27%
3199	南方东英中国五年期国债 ETF	79.68	75.78%	0.04%	100.00%
3147	南方东英中国创业板指数 ETF	751.92	86.61%	2.44%	49.69%
3150	嘉实中证小盘 500 指数 ETF	0.68	28.30%	0.03%	50.00%
3156	广发国际 MSCI 中国 A 股国际指数 ETF	49.13	23.35%	0.52%	15.56%
3129	南方东英沪深 300 精明 ETF	5.12	/	0.12%	/

注：日均成交额单位为“万港元”；统计期为 2015.10.1-2015.10.31；“/”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上步工业区 10 栋 5 楼

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>