

2016年11月2日

三季度分级A全面溢价,行业ETF与债券指数基金成为申报新热点

—2016年3季度指数型基金季报分析

相关研究

《指数基金规模总体增加,分级A上半年表现亮眼——2016年2季度指数型基金季报分析》,宋施怡,2016年7月26日

《指数基金规模下降,黄金ETF规模业绩双升——2016年1季度指数型基金季报分析》,宋施怡,2016年4月28日

《指数基金规模有所回升,分级A成2015年最佳配置资产——2015年4季度指数型基金季报分析》,宋施怡,2016年1月29日

《指数基金规模下滑,分级基金经历大考——2015年3季度指数型基金季报分析》,朱岚,2016年11月4日

《指数分级规模大涨,多空分级全部撤回——2015年2季度指数型基金季报分析》,朱岚,2015年8月4日

证券分析师

宋施怡 A0230515070001
songsy@swsresearch.com

联系人

宋施怡
 (8621) 23297818×7599
songsy@swsresearch.com



申万宏源研究微信服务号

本期投资提示:

- **净值上涨叠加基金净申购使指数基金规模总体增加。**截止到2016年三季度末,市场上的414只指数基金资产规模共计5017.62亿元(不计ETF联接基金),较上季度末增加了431.4亿元,环比增加了9.41%。其中,三季度尽管市场沪强深弱,指数基金单位净值上涨使指数基金资产规模增加了116.6亿元,分级基金净申购256.3亿元对冲ETF\LOF\普通指数基金的净赎回仍使指数基金整体规模增加85.9亿元。
- **三季度指数基金发行数量、募集规模上升较快。**2016年三季度新成立了8只指数基金,合计募集183.3亿元,同时还有6只分级基金在三季度转型成LOF基金,1只LOF转型成普通指数基金。相比于上一季度,发行数量及募集规模均上升。从产品形式看,ETF有6只,普通指数基金有2只,各类型分别募集183.14亿元、0.20亿元;从标的指数类型看,规模指数基金2只,主题指数基金1只,行业指数基金5只,分别募集0.2亿元、152.20亿元、30.94亿元。其中,汇添富中证上海国企ETF募集金额152.2亿元,为近年来募集金额最高的ETF。
- **债市收益率继续下行,三季度分级A全面溢价。**截止2016年10月31日,申万金工永续型分级A指数今年以来累计上涨12.80%,大超市场预期,其中三季度债市收益率不断下行是分级A持续上涨的主要原因。目前,10年AA+企业债收益率已降至3.78%左右,与此同时,+3%型分级A平均隐含收益率约为4.33%,+3.2%型分级A平均隐含收益率约为4.43%,+3.5%型分级A平均隐含收益率约为4.64%,+4%型分级A平均隐含收益率约为5.05%,+4.5%型分级A平均隐含收益率约为4.98%,+5%型为5.29%。近期受债市波动影响,分级A出现一定幅度的调整,此外,分级A下半年以来连续大涨,也存在一定兑现压力,但债市目前引发趋势性逆转行情概率不大,不宜过度悲观,可关注分级A的低吸机会。此外股市下行风险已成为分级A不可忽视的风险点,如股市发生趋势性下跌行情,宜及时减仓分级A,规避下折行情。
- **指数基金申报类型多样,行业ETF与债券指数基金成为新热点。**根据证监会披露的上报但尚未获批的指数基金情况来看,ETF与普通指数基金成为申报较多的基金类型,而从标的来看,行业和债券指数基金成为新的热点。如银华、建信上报系列债券指数基金,而银河、南方分别上报系列行业ETF。未来市场上的指数基金布局将更加全面。
- **指数基金规模最大的前十大标的指数占据55.33%的指数基金规模。**指数基金规模前三的标的指数依次为沪深300指数、上证50指数和中证军工指数,规模分别为812亿元、367.1亿元、260亿元。指数基金数量前三的标的指数依次为沪深300指数、中证500指数、中证100指数,指数基金数量分别为40只、20只、10只。已成立的414只指数基金由68家基金公司管理。指数基金规模前十大管理人管理指数基金规模占68.61%。前三名分别为富国基金、华夏基金和易方达基金,管理指数基金规模分别为668.7亿元、553.5亿元和397.6亿元。其他58家基金公司共管理263只基金、1575.2亿元指数基金。

目录

1. 指数产品发展回顾与展望	3
2. 2016 年三季度指数基金市场状况	5
2.1 净值上涨叠加净申购，指数基金规模总体增加	5
2.2 三季度共成立 8 只指数基金，共募集 183.3 亿元	13
2.3 分级审批仍未放开，多只指数基金获批	14
3. 2016 年三季度指数基金市场表现	21
3.1 三季度沪深两市均上涨，成交量有所放大	21
3.2 交易所交易型基金成交冷热不均	21
4. 附表	23

1. 指数产品发展回顾与展望

净值上涨叠加基金净申购使指数基金规模总体增加。截止到 2016 年三季度末，市场上的 414 只指数基金资产规模共计 5017.62 亿元（不计 ETF 联接基金），较上季度末增加了 431.4 亿元，环比增加了 9.41%。其中，三季度尽管市场沪强深弱，指数基金单位净值上涨使指数基金资产规模增加了 116.6 亿元，分级基金净申购 256.3 亿元对冲 ETF\LOF\普通指数基金净赎回使指数基金整体规模增加 85.9 亿元。

三季度指数基金发行数量、募集规模上升较快。2016 年三季度新成立了 8 只指数基金，合计募集 183.3 亿元，同时还有 6 只分级基金在三季度转型成 LOF 基金，1 只 LOF 转型成普通指数基金。相比于上一季度，发行数量有所上升，募集规模有所下降。从产品形式看，ETF 有 6 只，普通指数基金有 2 只，各类型分别募集 183.14 亿元、0.20 亿元；从标的指数类型看，规模指数基金 2 只，主题指数基金 1 只，行业指数基金 5 只，分别募集 0.2 亿元、152.20 亿元、30.94 亿元。其中，汇添富中证上海国企 ETF 募集金额 152.2 亿元，为今年来募集金额最高的 ETF。

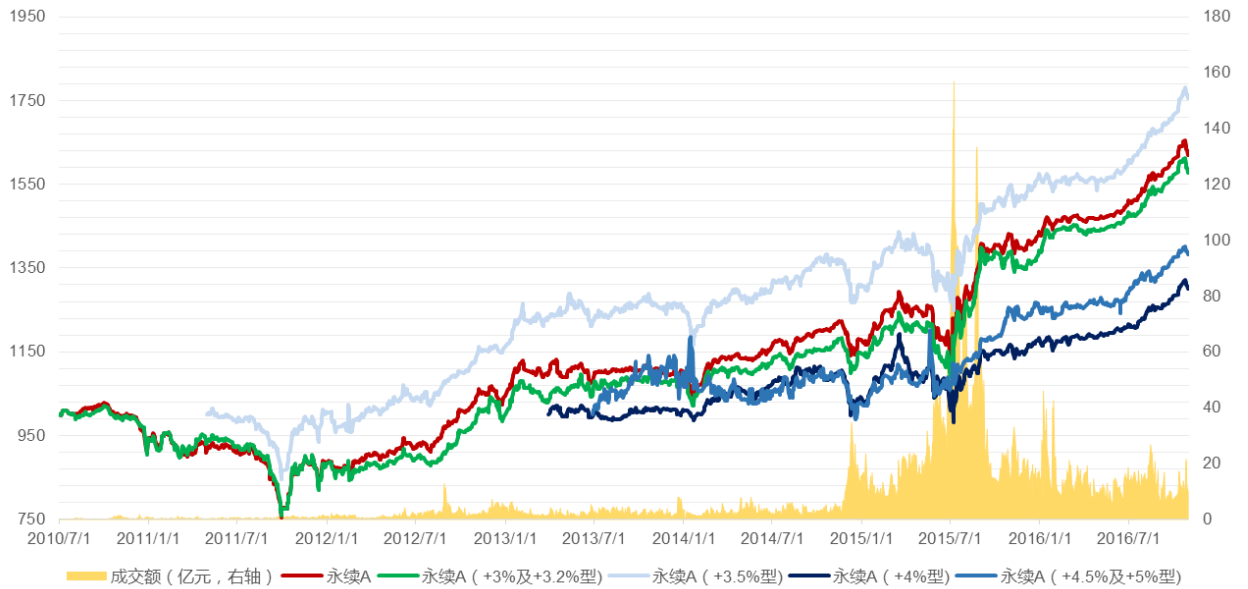
指数基金获批速度有所加快，获批基金以 LOF 或普通指数基金占据多数。分级基金产品审批仍未放开，仍有 175 只分级的审批流程被搁浅。基金公司转向发行 ETF、LOF、普通指数型以及增强指数型产品。目前共有 256 只指数基金等待审批，包含 27 只 ETF，16 只 LOF、32 只普通指数基金、6 只增强指数基金和 175 只指数分级基金。在目前已获批的指数基金中，有 4 只 ETF、12 只 LOF、9 只普通指数基金及 2 只增强指数基金。

指数基金申报类型多样，行业 ETF 与债券指数基金成为新热点。根据证监会披露的上报但尚未获批的指数基金情况来看，ETF 与普通指数基金成为申报较多的基金类型，而从标的来看，行业和债券指数基金成为新的热点。如银华、建信上报系列债券指数基金，而银河、南方分别上报系列行业 ETF。未来市场上的指数基金布局将更加全面。

债市收益率继续下行，三季度分级 A 全面溢价。截止 2016 年 10 月 31 日，申万金工永续型分级 A 指数今年以来累计上涨 12.80%，大超市场预期，其中三季度债市收益率不断下行是分级 A 持续上涨的主要原因。目前，10 年 AA+ 企业债收益率已降至 3.78% 左右，与此同时，+3% 型分级 A 平均隐含收益率约为 4.33%，+3.2% 型分级 A 平均隐含收益率约为 4.43%，+3.5% 型分级 A 平均隐含收益率约为 4.64%，+4% 型分级 A 平均隐含收益率约为 5.05%，+4.5% 型分级 A 平均隐含收益率约为 4.98%，+5% 型为 5.29%。

近期受债市波动影响，分级A出现一定幅度的调整，此外，分级A下半年以来连续大涨，也存在一定兑现压力，但债市目前引发趋势性逆转行情概率不大，不宜过度悲观，可关注分级A的低吸机会。此外股市下行风险已成为分级A不可忽视的风险点，如股市发生趋势性下跌行情，宜及时减仓分级A，规避下折行情。

图 1: 永续型分级 A 价格指数走势

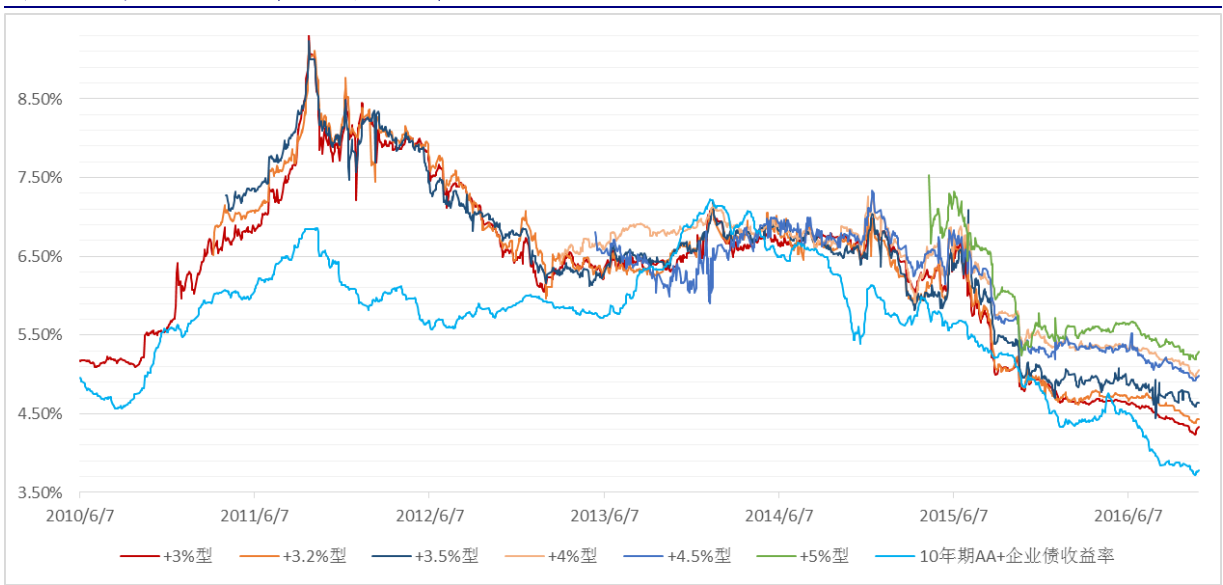


资料来源：申万宏源研究

注：1. 永续型分级 A 指数样本空间为设置下折条款的指数型永续分级 A，每月末选择最近 20 日日均成交额在 100 万以上的分级 A 进行计算，使用市值加权，权重上限为 15%，超出部分按比例分配至其他成分基金上，当成分基金不足 7 只时，使用等权重。分级 A 下折期间获取的额外收益不计入指数。

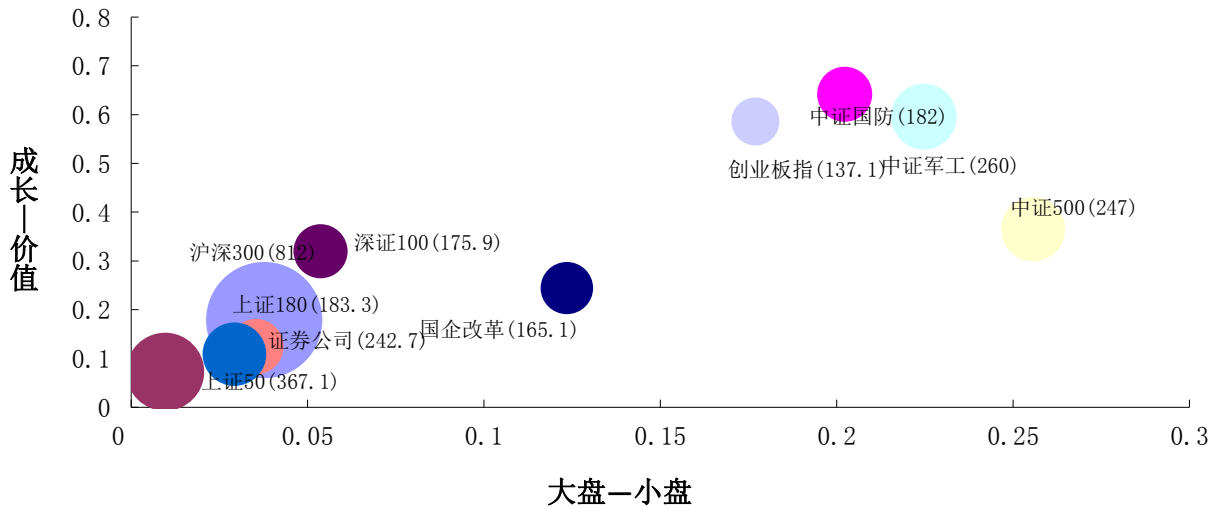
2. 各分类型的分级 A 指数不进行流动性剔除，其他编制方式同上。时间截至 2016 年 10 月 31 日。

图 1: 不同类型分级 A 平均隐含收益率曲线



资料来源：申万宏源研究

图 2：资产规模前十大指数风格分布及资产规模（单位：亿元）



资料来源：申万宏源研究

注：1. 不包括国外机构编制的指数

2. 各气泡大小与括号内数值均表示跟踪该指数的指数基金规模大小

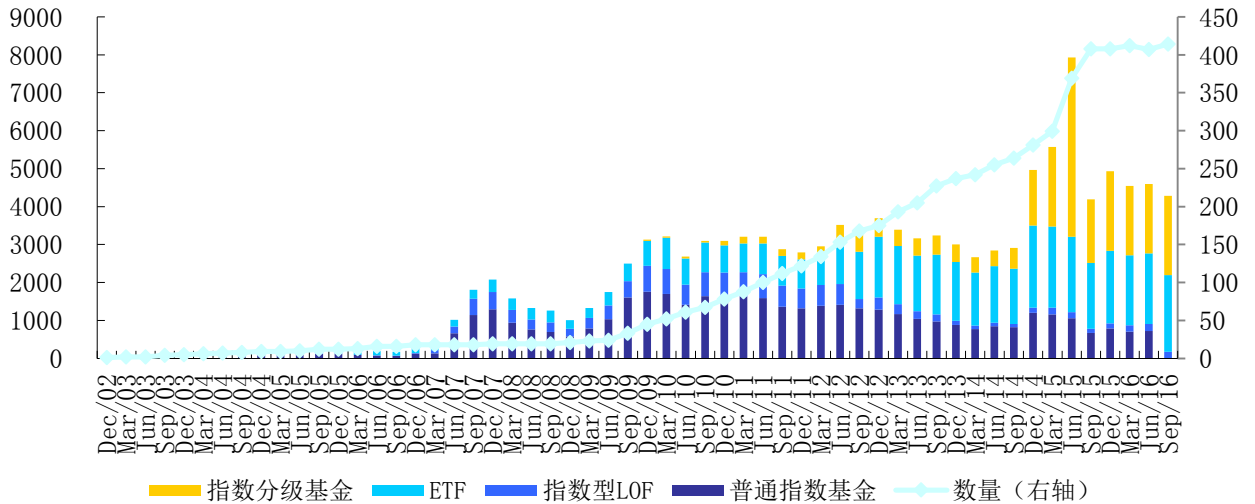
3. 横轴数值越大表示指数越偏小盘，纵轴数值越大表示指数估值越高

2. 2016 年三季度指数基金市场状况

2.1 净值上涨叠加净申购，指数基金规模总体增加

截止到 2016 年三季度末，市场上的 414 只指数基金资产规模共计 5017.62 亿元（不计 ETF 联接基金），较上季度末增加了 431.4 亿元，环比增加了 9.41%。其中，三季度尽管市场沪强深弱，指数基金单位净值上涨使指数基金资产规模增加了 116.6 亿元，分级基金净申购 256.3 亿元对冲 ETF\LOF\普通指数基金的净赎回仍使指数基金整体规模增加 85.9 亿元。

图 3：指数基金季度规模和数量（规模单位：亿元）



资料来源：申万宏源研究，注：不计ETF联接基金，指数分级基金合并计算，债券型指数基金A、C类合并计算

具体来看，普通指数基金规模为734.7亿元，较上季度末增加了19.5亿元(+2.73%)。指数型LOF资产规模为174.2亿元，较上季度末减少11.6亿元(-6.23%)。ETF资产规模为2017.7亿元，较上季度末增加163.7亿元(+8.83%)。指数分级基金资产规模为2091亿元，较上季度末增加259.8亿元(+14.18%)。

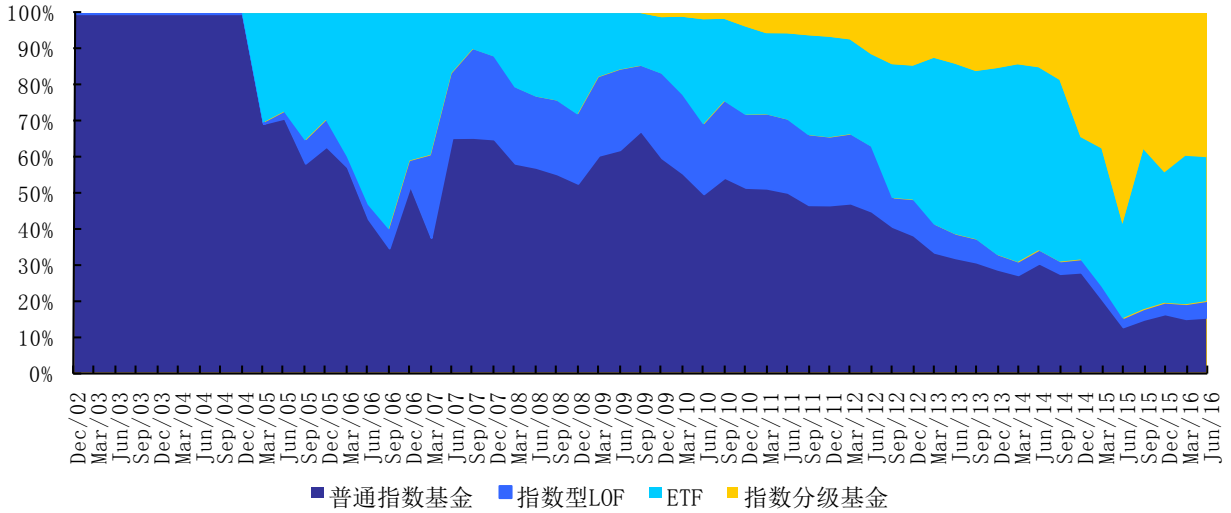
表 1：不同产品形式的指数基金规模及变化（规模单位：亿元）

产品形式	资产规模	规模占比	规模变化	规模变化率	资产规模变化原因				基金数量	新成立数量
					单位净值变化	申赎	新成立基金	分红		
普通指数基金	734.7	14.64%	19.5	2.73%	27.4	-8.6	0.2	0.0	120	2
指数型LOF	174.2	3.47%	-11.6	-6.23%	10.5	-87.2	61.2	0.0	41	6
ETF	2017.7	40.21%	163.7	8.83%	75.2	-74.6	183.1	-0.9	119	6
指数分级基金	2091.0	41.67%	259.8	14.18%	3.5	256.3	0.0	0.0	134	1
总体	5017.62	100.00%	431.4	9.41%	116.6	85.9	244.6	-0.9	414	15

资料来源：申万宏源研究，注：不计ETF联接基金，指数分级基金合并计算，债券型指数基金A、C类合并计算

指数分级基金规模占比小幅上升，ETF、普通指数型基金及指数型LOF规模占比有所下降，其中指数分级基金规模占比上升较多，上升1.80%。2016年三季度末，指数分级基金规模占比为41.67%，相比上季度末上升1.80个百分点；ETF规模占比为40.21%，相比上季度末下降0.13个百分点；普通开放式指数基金规模占比14.64%，相比上季度末下降1.05个百分点；指数型LOF规模占比为3.47%，相比上季度末下降0.62个百分点。

图 4：不同产品形式的指数基金季度规模占比



资料来源：申万宏源研究，注：不计ETF联接基金，指数分级基金合并计算，债券型指数基金A、C类合并计算

从标的指数类型看，主题、行业、风格、商品、债券指数基金规模均上涨，宽基、QDII、策略基金规模均下降。其中，宽基指数基金规模为2143.8亿元，相比上季度末减少38.9亿元(-1.78%)；主题指数基金规模为1126.3亿元，相比上季度末增加231.7亿元(+25.90%)；行业指数基金规模为1122.1亿元，相比上季度末增加221.7亿元(+24.62%)；风格指数基金规模为7.7亿元，相比上季度末增加0.2亿元(+2.11%)；策略指数基金规模为39.2亿元，相比上季度末基本持平(-0.10%)；QDII指数基金规模为294.8亿元，相比上季度末减少37.2亿元(-11.22%)；债券指数基金规模为166.8亿元，相比上季度末增加18.9亿元(+12.82%)；商品指数基金规模为117亿元，相比上季度末增加35.0亿元(+42.78%)。

表 2：不同标的指数类型的指数基金规模及变化（规模单位：亿元）

标的指数类型	资产规模	规模占比	规模变化	规模变化率	资产规模变化原因				基金数量	新成立数量
					单位净值变化	申赎	新成立基金	分红		
宽基指数基金	2143.8	42.72%	-38.9	-1.78%	76.6	-112.6	0.2	0.0	138	2
主题指数基金	1126.3	22.45%	231.7	25.90%	-1.6	87.4	156.4	0.0	98	4
行业指数基金	1122.1	22.36%	221.7	24.62%	4.2	191.2	31.4	0.0	97	7
风格指数基金	7.7	0.15%	0.2	2.11%	0.4	-0.2	0.0	0.0	7	0
策略指数基金	39.2	0.78%	0.0	-0.10%	1.7	-1.8	0.0	0.0	20	0
QDII 指数基金	294.8	5.87%	-37.2	-11.22%	31.9	-73.1	0.0	0.0	33	0
债券指数基金	166.8	3.32%	18.9	12.82%	3.0	-39.7	56.5	-0.9	17	2
商品指数基金	117.0	2.33%	35.0	42.78%	0.4	34.6	0.0	0.0	4	0
总体	5017.6	100.00%	431.4	9.41%	116.6	85.9	244.6	-0.9	414	15

资料来源：申万宏源研究，注：不计ETF联接基金，指数分级基金合并计算，债券型指数基金A、C类合并计算

指数基金规模最大的前十大标的指数占据55.33%的指数基金规模。指数基金规模前三的标的指数依次为沪深300指数、上证50指数和中证军工指数，规模分别为812亿元、367.1亿元、260亿元。指数基金数量前三的标的指数依次为沪深300指数、中证500指数、深证100指数，指数基金数量分别为40只、20只、10只。

表 3：指数基金规模前十大的标的指数

标的指数	资产规模(亿元)	资产规模占比	数量
沪深 300	812.0	16.18%	40
上证 50	367.1	7.32%	8
中证军工	260.0	5.18%	8
中证 500	247.0	4.92%	20
证券公司	242.7	4.84%	9
上证 180	183.3	3.65%	2
中证国防	182.0	3.63%	1
深证 100	175.9	3.51%	10
国企改革	165.1	3.29%	2
上海国企	141.2	2.81%	1
其他指数	2241.3	44.67%	313
总计	5017.6	100.00%	414

资料来源：申万宏源研究

已成立的 414 只指数基金由 68 家基金公司管理。指数基金规模前十大的管理人管理指数基金规模占 68.61%。前三名分别为富国基金、华夏基金和易方达基金，管理指数基金规模分别为 668.7 亿元、553.5 亿元和 397.6 亿元。其他 58 家公司共管理 263 只基金、1575.2 亿元指数基金。

表 4：指数基金规模前十大的基金管理人（规模单位：亿元）

基金管理人	指数基金数量	指数基金规模	规模占比	相比上季度规模变化
富国基金	15	668.7	13.33%	35.2
华夏基金	12	553.5	11.03%	11.8
易方达基金	21	397.6	7.92%	4.6
鹏华基金	23	334.9	6.67%	70.3
南方基金	21	311.7	6.21%	-1.1
华安基金	15	292.2	5.82%	29.5
华泰基金	5	226.7	4.52%	-14.0
国泰基金	14	222.3	4.43%	44.0
嘉实基金	12	221.7	4.42%	-19.6
招商基金	13	213.2	4.25%	79.7
其他管理人	263	1575.2	31.39%	191.1
总计	414	5017.6	100.00%	431.4

资料来源：申万宏源研究

2016 年三季度，指数基金规模增加最多的前三名为：汇添富基金增加 132.2 亿元、招商基金增加 79.7 亿元、鹏华基金增加 70.3 亿元。规模减少最多的前三名依次为：嘉实基金减少 19.6 亿元、银华基金减少 16.9 亿元、国联安基金减少 14.0 亿元。

表 5：指数基金资产规模变化前十名和后十名的基金管理人（规模单位：亿元）

前十名				后十名			
基金管理人	指数基金数量	指数基金规模	规模变化 (环比)	基金管理人	指数基金数量	指数基金规模	规模变化 (环比)

汇添富基金	10	194.6	132.2	新华基金	1	3.0	-0.7
招商基金	13	213.2	79.7	南方基金	21	311.7	-1.1
鹏华基金	23	334.9	70.3	国寿基金	3	6.3	-4.3
国泰基金	14	222.3	44.0	国投瑞银	6	26.2	-4.4
富国基金	15	668.7	35.2	泰达宏利	2	1.6	-7.8
华安基金	15	292.2	29.5	工银瑞信	10	33.4	-9.3
中融基金	4	39.6	20.7	华泰柏瑞	5	226.7	-14.0
申万菱信	11	209.9	18.1	国联安基金	5	7.0	-14.0
博时基金	14	131.8	16.4	银华基金	11	183.2	-16.9
天弘基金	20	45.6	12.9	嘉实基金	12	221.7	-19.6

资料来源：申万宏源研究

规模前十的指数基金的标的指数中，沪深 300 指数基金 3 只、上证 50 指数基金 1 只、上证 180 指数基金 1 只、中证 500 指数基金 1 只、中证军工指数基金 1 只、国企改革指数基金 1 只、中证国防基金 1 只，中证证券公司基金 1 只。从产品形式看，前十大指数基金有 6 只为 ETF、4 只为指数分级基金。

表 6：规模前十大的指数基金（规模单位：亿元）

基金简称	产品形式	标的指数类型	规模
华夏上证 50ETF	ETF	规模	275.72
华泰柏瑞沪深 300ETF	ETF	规模	192.26
富国中证军工	分级	行业	189.56
鹏华中证国防	分级	主题	182.01
南方中证 500ETF	ETF	规模	175.42
招商中证证券公司	分级	行业	171.22
华安上证 180ETF	ETF	规模	167.89
嘉实沪深 300ETF	ETF	规模	167.22
华夏沪深 300ETF	ETF	规模	160.57
富国国企改革	分级	主题	159.89

资料来源：申万宏源研究

表 7，表 8 中分别列出了不同产品形式、不同标的指数类型的指数基金规模的前五名。ETF 与指数分级基金规模相对其他产品形式更高，分级基金规模有所上升。

表 7：不同产品形式下规模前五名的指数基金（单位：亿元）

产品形式	基金简称	规模
普通指数基金	易方达上证 50	81.47
	南方大数据 100	69.80
	融通深证 100A	54.78
	博时裕富沪深 300A	46.34
	华夏亚债中国 A	44.97
指数型 LOF	华宝兴业标普油气人民币	25.10
	天弘添利	16.33
	嘉实恒生中国企业	14.41
	嘉实基本面 50	12.14

	汇添富中证精准医疗 A	9.84
ETF	华夏上证 50ETF	275.72
	华泰柏瑞沪深 300ETF	192.26
	南方中证 500ETF	175.42
	华安上证 180ETF	167.89
	嘉实沪深 300ETF	167.22
指数分级基金	富国中证军工	189.56
	鹏华中证国防	182.01
	招商中证证券公司	171.22
	富国国企改革	159.89
	申万菱信中证申万证券	98.97

资料来源：申万宏源研究

从标的指数类型看，规模指数基金的规模大于其他标的指数类型的指数基金。规模指数基金中，规模最大的指数基金为华夏上证 50ETF，其规模为 275.72 亿元，主题指数基金中，规模最大的为鹏华中证国防，取代富国国企改革指数分级，其规模为 182.01 亿元，行业指数基金中，规模最大的为富国中证军工指数分级，其规模为 189.56 亿元。

表 8：不同标的指数类型的指数基金规模前五名（单位：亿元）

标的指数类型	基金简称	规模
规模指数基金	华夏上证 50ETF	275.72
	华泰柏瑞沪深 300ETF	192.26
	南方中证 500ETF	175.42
	华安上证 180ETF	167.89
	嘉实沪深 300ETF	167.22
主题指数基金	鹏华中证国防	182.01
	富国国企改革	159.89
	汇添富中证上海国企 ETF	141.20
	前海开源中航军工	97.69
	富国中证移动互联网	75.35
行业指数基金	富国中证军工	189.56
	招商中证证券公司	171.22
	申万菱信中证申万证券	98.97
	国泰国证医药卫生	89.62
	鹏华中证银行	68.89
风格指数基金	大成深证成长 40ETF	1.85
	银河沪深 300 价值	1.63
	申万菱信沪深 300 价值	1.48
	华宝兴业上证 180 价值 ETF	1.39
	华宝兴业上证 180 成长 ETF	0.56
策略指数基金	嘉实基本面 50	12.14
	广发中证百发 100A	11.22

	招商沪深 300 地产	3.03
	银华中证等权重 90	2.58
	汇添富沪深 300 安中动态策略	2.54
QDII 指数基金	易方达恒生 H 股 ETF	90.35
	银华恒生 H 股	69.99
	华宝兴业标普油气人民币	25.10
	华夏沪港通恒生 ETF	14.72
	嘉实恒生中国企业	14.41
债券指数基金	海富通上证可质押城投债 ETF	62.31
	华夏亚债中国 A	44.97
	天弘添利	16.33
	嘉实中证中期企业债 A	8.14
	国泰上证 5 年期国债 ETF	7.64
商品指数基金	华安易富黄金 ETF	62.58
	博时黄金 ETF	30.02
	易方达黄金 ETF	17.72
	国泰黄金 ETF	6.7

资料来源：申万宏源研究

2016 年三季度，规模增加最多的指数基金依次是招商中证证券公司、鹏华中证国防、国泰国证医药卫生。规模减少最多的依次为华泰柏瑞沪深 300ETF、银华恒生 H 股、国联安双力中小板。

表 9：规模变化前十名和后十名的指数基金（单位：亿元）

前十名				后十名			
基金简称	产品形式	标的指数类型	规模变化	基金简称	产品形式	标的指数类型	规模变化
招商中证证券公司	分级母基金	行业	69.26	华泰柏瑞沪深 300ETF	ETF	规模	-17.46
鹏华中证国防	分级母基金	主题	47.59	银华恒生 H 股	分级母基金	QDII	-14.12
国泰国证医药卫生	分级母基金	行业	22.78	国联安双力中小板	LOF	规模	-13.77
富国国企改革	分级母基金	主题	21.44	嘉实沪深 300ETF	ETF	规模	-13.33
鹏华中证银行	分级母基金	行业	20.62	工银瑞信沪深 300	普通	规模	-11.08
华安易富黄金 ETF	ETF	商品	16.92	富国创业板指数分级	分级母基金	规模	-10.07
中融国证钢铁	分级母基金	行业	14.50	易方达恒生 H 股 ETF	ETF	QDII	-9.18
前海开源中航军工	分级母基金	主题	13.10	嘉实恒生中国企业	LOF	QDII	-8.96
申万菱信中证申万证券	分级母基金	行业	10.86	泰达宏利中证财富大盘	普通	主题	-7.90
富国中证移动互联网	分级母基金	主题	10.66	南方中证 500ETF	ETF	规模	-7.75

资料来源：申万宏源研究，注：不考虑 2016 年三季度新成立的指数基金

表 10、表 11 中分别列出不同产品形式、不同标的指数类型的指数基金规模变化的前五名和后五名。

表 10：不同产品形式下规模变化前五名和后五名的指数基金（单位：亿元）

产品形式	前五名		后五名	
	基金简称	规模变化	基金简称	规模变化
普通指数基金	华夏亚债中国 A	6.32	工银瑞信沪深 300	-11.08
	华安 MSCI 中国 A 股	5.72	泰达宏利中证财富大盘	-7.90

	天弘沪深 300	4.31	国寿安保沪深 300	-3.44
	博时淘金大数据 100A	3.47	广发美国房地产人民币	-0.67
	博时淘金大数据 100I	3.47	富国沪深 300	-0.65
指数型 LOF	华宝兴业香港上市中国中小盘	3.98	国联安双力中小板	-13.77
	天弘添利	2.90	嘉实恒生中国企业	-8.96
	易方达中债新综合 A	2.51	汇添富中证精准医疗 A	-4.37
	嘉实中证中期企业债 A	0.61	华宝兴业标普油气人民币	-2.93
	交银中证海外中国互联网	0.37	华安标普全球石油	-0.41
ETF	华安易富黄金 ETF	16.92	华泰柏瑞沪深 300ETF	-17.46
	易方达黄金 ETF	8.10	嘉实沪深 300ETF	-13.33
	博时黄金 ETF	7.70	易方达恒生 H 股 ETF	-9.18
	华夏上证 50ETF	7.18	南方中证 500ETF	-7.75
	华安上证 180ETF	5.98	易方达深证 100ETF	-4.55
指数分级基金	招商中证证券公司	69.26	银华恒生 H 股	-14.12
	鹏华中证国防	47.59	富国创业板指数分级	-10.07
	国泰中证医药卫生	22.78	国投瑞银瑞泽中证创业成长	-4.42
	富国国企改革	21.44	汇添富恒生指数	-3.56
	鹏华中证银行	20.62	鹏华中证证券	-3.25

资料来源：申万宏源研究，注：不考虑 2016 年三季度新成立的指数基金

表 11：不同标的指数类型的指数基金规模变化前五与后五名（单位：亿元）

标的指数类型	前五名		后五名	
	基金简称	规模变化	基金简称	规模变化
规模指数基金	华夏上证 50ETF	7.18	华泰柏瑞沪深 300ETF	-17.46
	华安上证 180ETF	5.98	国联安双力中小板	-13.77
	华安 MSCI 中国 A 股	5.72	嘉实沪深 300ETF	-13.33
	申万菱信深证成指分级	5.44	工银瑞信沪深 300	-11.08
	天弘沪深 300	4.31	富国创业板指数分级	-10.07
主题指数基金	鹏华中证国防	47.59	泰达宏利中证财富大盘	-7.90
	富国国企改革	21.44	国投瑞银瑞泽中证创业成长	-4.42
	前海开源中航军工	13.10	汇添富中证精准医疗 A	-4.37
	富国中证移动互联网	10.66	富国中证工业 4.0	-2.43
	安信中证一带一路	4.04	前海开源中证健康	-1.57
行业指数基金	招商中证证券公司	69.26	鹏华中证证券	-3.25
	国泰中证医药卫生	22.78	国泰中证食品饮料	-2.53
	鹏华中证银行	20.62	鹏华中证 800 证券保险	-2.52
	中融国证钢铁	14.50	汇添富中证主要消费 ETF	-1.40
	申万菱信中证申万证券	10.86	信诚中证 800 金融	-1.11
风格指数基金	银河沪深 300 价值	0.12	大成深证成长 40ETF	-0.04
	申万菱信沪深 300 价值	0.08	华宝兴业上证 180 价值 ETF	-0.01
	交银深证 300 价值 ETF	0.02	银河沪深 300 成长	0.00
	华宝兴业上证 180 成长 ETF	0.00	华宝兴业上证 180 成长 ETF	0.00

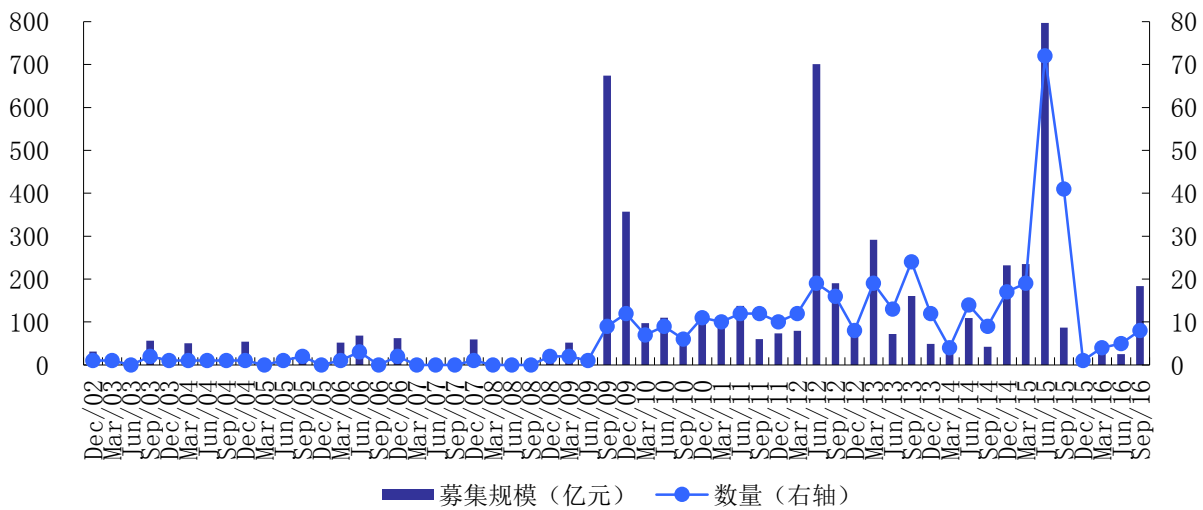
	银河沪深 300 成长	0.00	交银深证 300 价值 ETF	0.02
策略指数基金	招商沪深 300 地产	0.48	广发中证百发 100A	-0.59
	汇添富沪深 300 安中动态策略	0.12	景顺长城 180 等权 ETF	-0.16
	嘉实基本面 50	0.09	泰信基本面 400	-0.04
	银华中证 800 等权重	0.06	诺安中小板等权 ETF	-0.03
	嘉实深证基本面 120ETF	0.05	银华中证等权重 90	-0.03
	QDII 指数基金	华宝兴业香港上市中国中小盘	3.98	银华恒生 H 股
广发纳斯达克生物科技人民币		0.38	易方达恒生 H 股 ETF	-9.18
交银中证海外中国互联网		0.37	嘉实恒生中国企业	-8.96
大成标普 500 等权重		0.33	汇添富恒生指数	-3.56
华安纳斯达克 100 人民币		0.28	华宝兴业标普油气人民币	-2.93
债券指数基金	华夏亚债中国 A	6.32	银华中证转债	-0.40
	天弘添利	2.90	长盛全债	-0.31
	易方达中债新综合 A	2.51	博时上证企债 30ETF	-0.06
	国泰上证 5 年期国债 ETF	1.26	南方中债中期票据 A	0.00
	德邦企债分级	0.88	嘉实中证中期国债 ETF	0.01
商品指数基金	华安易富黄金 ETF	16.92		
	易方达黄金 ETF	8.10		
	博时黄金 ETF	7.70		
	国泰黄金 ETF	2.34		

资料来源：申万宏源研究，注：不考虑 2016 年三季度新成立的指数基金

2.2 三季度共成立 8 只指数基金，共募集 183.3 亿元

2016 年三季度新成立了 8 只指数基金，合计募集 183.3 亿元。另外有 7 只基金转型。相比于上一季度，发行数量、募集规模均有大幅度上升。

图 5：指数基金各季度成立的规模和数量



资料来源：申万宏源研究

新成立指数基金为 6 只 ETF 及 2 只普通指数基金。其中，中金发行了两只普通规模指数基金：中金沪深 300 和中金中证 500，募集规模各为 0.1 亿元，另外 6 只 ETF

分别为国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、汇添富中证上海国企 ETF、华宝兴业中证军工 ETF、华宝兴业中证全指证券、广发中证军工 ETF，募集规模分别为 5.9 亿元、4.3 亿元、152.2 亿元、5.4 亿元、6.4 亿元、8.9 亿元。8 只新成立的指数基金中，以行业 ETF 占据多数。

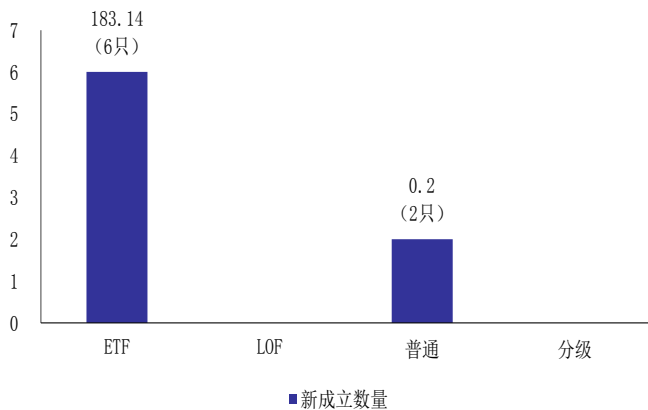
表 12: 2016 年三季度新成立的指数基金 (规模单位: 亿元)

基金代码	基金简称	成立日期	产品形式	指数类型	募集规模	2016 年三季度末规模
003015	中金沪深 300	2016/7/22	普通	规模	0.1	0.1
003016	中金中证 500	2016/7/22	普通	规模	0.1	0.1
512660	国泰中证军工 ETF	2016/7/26	ETF	行业	5.9	3.0
512880	国泰中证全指证券公司 ETF	2016/7/26	ETF	行业	4.3	2.3
510810	汇添富中证上海国企 ETF	2016/7/28	ETF	主题	152.2	141.2
512810	华宝兴业中证军工 ETF	2016/8/5	ETF	行业	5.4	
512000	华宝兴业中证全指证券	2016/8/30	ETF	行业	6.4	
512680	广发中证军工 ETF	2016/8/30	ETF	行业	8.9	8.8
总计					183.3	155.4

资料来源: 申万宏源研究

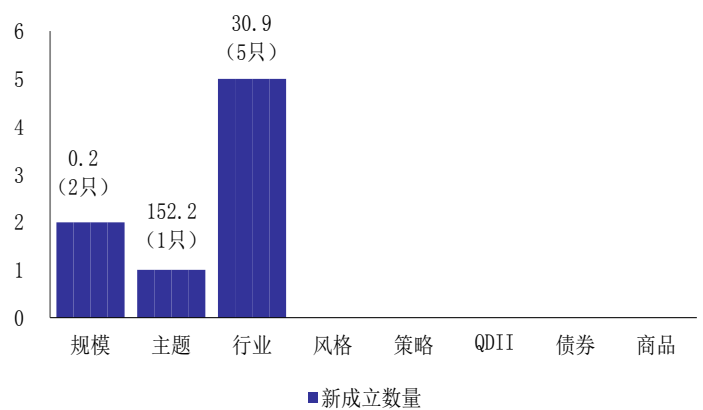
从产品形式看, ETF 有 6 只, 普通指数基金有 2 只, 各类型分别募集 183.14 亿元、0.2 亿元; 从标的指数类型看, 规模指数基金 2 只, 主题指数基金 1 只, 行业基金 5 只, 分别募集 0.2 亿元、152.2 亿元、30.9 亿元。

图 6: 不同产品形式新成立基金规模 (单位: 亿元)



资料来源: 申万宏源研究

图 7: 不同标的的指数类型新成立基金规模 (单位: 亿元)



资料来源: 申万宏源研究

2.3 分级审批仍未放开, 多只指数基金获批

分级基金产品审批仍未放开, 基金公司转向发行 ETF、LOF 以及普通指数型产品。目前仍有 175 只分级的审批流程被搁浅。下表所示为目前已上报尚未获批的指数基金, 目前共有 256 只指数基金等待审批, 包含 27 只 ETF, 16 只 LOF、32 只普通指数基金、6 只增强指数基金和 175 只指数分级基金。

表 13: 指数基金募集申请情况

序	基金管	申请事项	产品形式	标的指数	受理	审查
---	-----	------	------	------	----	----

号	理人			类型	申请材料 接收日	受理决定 日	反馈意见 日	接收反馈 材料日
1	易方达	标普 500 指数分级基金 (QDII)	分级	QDII	2015-01-04	2015-01-12	2015-03-26	
2	嘉实	中证万得重组主题指数分级基金	分级	主题	2015-01-05	2015-01-12	2015-02-15	
3	嘉实	中证证券公司指数分级基金	分级	行业	2015-01-15	2015-01-27	2015-02-15	
4	海富通	中证机器人指数分级基金	分级	主题	2015-01-29	2015-02-05	2015-02-15	
5	南方	中证高铁产业指数分级基金	分级	主题	2015-02-06	2015-02-15	2015-03-26	
6	南方	中证国有企业改革指数分级基金	分级	主题	2015-02-12	2015-02-15	2015-03-26	
7	大成	深证成份交易型开放式指数基金分级联接 基金 (LOF)	LOF	规模	2015-02-15	2015-02-27	2015-03-31	
8	华安	中证煤炭指数分级基金	分级	行业	2015-02-16	2015-03-02	2015-08-28	
9	华安	中证钢铁指数分级基金	分级	行业	2015-02-16	2015-03-02	2015-04-09	
10	国金通用	中证内地农业主题指数分级基金	分级	主题	2015-02-16	2015-03-03	2015-04-09	
11	国金通用	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-02-16	2015-03-03	2015-04-09	
12	华安	中证白酒指数分级基金	分级	行业	2015-02-16	2015-03-03	2015-04-09	
13	南方	中证互联网指数分级基金	分级	主题	2015-02-16	2015-03-05	2015-03-26	
14	易方达	保险指数分级基金	分级	行业	2015-03-06	2015-03-16	2015-04-14	
15	华宝兴业	中证互联网金融指数分级基金	分级	主题	2015-03-05	2015-03-16	2015-04-23	2015-04-23
16	交银施罗 德	中证证券保险指数分级基金	分级	行业	2015-03-13	2015-03-25	2015-04-23	
17	华宝兴业	中证基建指数分级基金	分级	行业	2015-03-11	2015-03-25	2015-04-23	
18	华宝兴业	中证汽车指数分级基金	分级	行业	2015-03-11	2015-03-25	2015-04-23	
19	华安	中证机器人指数分级基金	分级	主题	2015-03-19	2015-03-30	2015-04-21	
20	华安	中证传媒指数分级基金	分级	行业	2015-03-19	2015-03-30	2015-08-28	
21	申万菱信	中证高端装备制造指数分级基金	分级	主题	2015-03-18	2015-03-30	2015-08-28	
22	申万菱信	中证银行指数分级基金	分级	行业	2015-03-23	2015-04-03	2015-04-20	
23	天治	中证国有企业改革指数分级基金	分级	主题	2015-03-30	2015-04-08	2015-04-23	
24	信诚	中证 800 银行指数分级基金	分级	行业	2015-03-27	2015-04-08	2015-05-05	
25	信诚	中证 800 保险指数分级基金	分级	行业	2015-03-27	2015-04-08	2015-07-28	
26	信诚	中证高铁指数分级基金	分级	主题	2015-03-27	2015-04-08	2015-08-28	
27	天治	中证工业 4.0 指数分级基金	分级	主题	2015-03-30	2015-04-08	2015-04-23	
28	东吴	中证新能源汽车指数分级基金	分级	主题	2015-04-01	2015-04-09	2015-05-26	
29	招商	中证环保产业 50 指数分级基金	分级	主题	2015-04-07	2015-04-14	2015-05-19	
30	易方达	文化产业指数分级基金	分级	主题	2015-04-08	2015-04-14	2015-06-10	
31	国寿安保	中证国企改革指数分级基金	分级	主题	2015-04-10	2015-04-17	2015-05-26	
32	易方达	上证 180 指数分级基金	分级	规模	2015-04-08	2015-04-17	2015-05-26	
33	中海	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-04-09	2015-04-21	2015-06-10	
34	交银施罗 德	中证软件服务指数分级基金	分级	主题	2015-04-15	2015-04-22	2015-06-02	
35	华泰柏瑞	上证 50 指数分级基金	分级	规模	2015-04-17	2015-04-28	2015-06-16	
36	广发	中证全指证券公司指数分级基金	分级	行业	2015-04-17	2015-04-28	2015-06-10	
37	华安	中证信息安全指数分级	分级	主题	2015-04-24	2015-04-30	2015-06-04	
38	大成	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-04-23	2015-05-05	2015-06-10	
39	鹏华	上证综合指数分级基金	分级	规模	2015-04-24	2015-05-05	2015-06-24	
40	鹏华	中证混合所有制改革指数分级基金	分级	主题	2015-04-24	2015-05-05	2015-08-28	

41	华安	中证保险主题指数分级基金	分级	主题	2015-04-24	2015-05-05	2015-06-04
42	富国	中证淘健康指数分级基金	分级	主题	2015-04-27	2015-05-07	2015-06-30
43	富国	中证淘娱乐娱乐指数分级基金	分级	主题	2015-05-04	2015-05-13	2015-06-30
44	富国	中证稀有金属主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-06	2015-05-15	2015-08-18
45	融通	中证高铁产业指数分级基金	分级	主题	2015-03-30	2015-05-15	2015-07-28
46	富国	中证稀有金属主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-06	2015-05-15	2015-08-18
47	长信	中证军工信息安全 150 指数分级基金	分级	主题	2015-05-08	2015-05-19	2015-06-17
48	国投瑞银	中证 800 机械指数分级基金	分级	行业	2015-05-12	2015-05-19	2015-06-17
49	国投瑞银	中证新能源指数分级基金	分级	主题	2015-05-12	2015-05-19	2015-06-17
50	国投瑞银	中证文体休闲指数分级基金	分级	主题	2015-05-12	2015-05-19	2015-06-17
51	国投瑞银	中证 800 运输指数分级基金	分级	行业	2015-05-12	2015-05-19	2015-07-22
52	南方	沪深 300 银行指数分级基金	分级	行业	2015-05-12	2015-05-19	2015-08-28
53	南方	沪深 300 运输指数分级基金	分级	行业	2015-05-12	2015-05-19	2015-06-19
54	易方达	机器人指数分级基金	分级	主题	2015-05-08	2015-05-19	2015-08-28
55	易方达	信息安全指数分级基金	分级	主题	2015-05-11	2015-05-19	2015-06-17
56	汇添富	中证移动互联网指数分级基金	分级	主题	2015-02-02	2015-05-19	2015-08-28
57	汇添富	中证医药卫生指数分级基金	分级	行业	2015-02-02	2015-05-19	2015-06-24
58	鹏华	中证旅游主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-13	2015-05-21	2015-06-29
59	鹏华	中证全指软件指数分级基金	分级	主题	2015-05-13	2015-05-21	2015-06-18
60	鹏华	中证沪深港内地保险指数分级基金	分级	主题	2015-05-13	2015-05-21	2015-06-29
61	招商	中证中药指数分级基金	分级	行业	2015-05-13	2015-05-21	2015-06-18
62	招商	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-05-13	2015-05-21	2015-06-18
63	广发	中证稀有金属主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-14	2015-05-21	2015-06-17
64	工银瑞信	中证新材料主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-14	2015-05-21	2015-06-17
65	工银瑞信	国证农牧渔产品行业指数分级基金	分级	行业	2015-05-14	2015-05-21	2015-06-17
66	工银瑞信	国证交通运输行业指数分级基金	分级	行业	2015-05-14	2015-05-21	2015-06-17
67	华宝兴业	标普中国 A 股红利机会指数分级基金	分级	主题	2015-05-18	2015-05-26	2015-08-18
68	华宝兴业	中证文体指数分级基金	分级	主题	2015-05-18	2015-05-26	2015-08-18
69	广发	中证信息安全主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-15	2015-05-26	2015-06-17
70	申万菱信	中证申万新兴健康产业主题投资指数分级基金	分级	主题	2015-05-18	2015-05-26	2015-07-28
71	大成	恒生国企指数分级基金 (QDII-LOF)	分级	QDII	2015-05-15	2015-05-26	2015-07-24
72	南方	中证稀土产业指数分级基金	分级	主题	2015-05-18	2015-05-26	2015-06-29
73	华宝兴业	中证文体指数分级基金	分级	主题	2015-05-18	2015-05-26	2015-08-18
74	光大保德信	中证医疗指数分级基金	分级	行业	2015-05-20	2015-05-29	2015-06-18
75	嘉实	中证申万体育主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-20	2015-05-29	2015-07-24
76	嘉实	中证医药卫生指数分级基金	分级	行业	2015-05-20	2015-05-29	2015-06-12
77	嘉实	中证主要消费指数分级基金	分级	主题	2015-05-20	2015-05-29	2015-06-12
78	国寿安保	中证工业 4.0 指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-08-01
79	富国	中证智慧农业主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-07-28
80	富国	中证土地改革农业主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-07-28
81	英大	中证稀有金属主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-07-28
82	鹏华	中证沪港深互联网指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-07-24
83	融通	中证稀土产业指数分级基金	分级	主题	2015-05-21	2015-06-01	2015-08-01

84	信诚	中证旅游指数分级基金	分级	行业	2015-05-22	2015-06-02	2015-07-28
85	信诚	中证环保指数分级基金	分级	主题	2015-05-22	2015-06-02	2015-07-28
86	招商	标普石油天然气上游股票指数分级基金	分级	主题	2015-05-22	2015-06-02	2015-06-18
87	嘉实	中证保险主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-25	2015-06-02	2015-07-24
88	招商	中证机器人指数分级基金	分级	主题	2015-05-25	2015-06-02	2015-08-01
89	信诚	中证新能源汽车指数分级基金	分级	主题	2015-05-22	2015-06-02	2015-08-01
90	信诚	中证稀土指数分级基金	分级	行业	2015-05-22	2015-06-02	2015-08-01
91	嘉实	中证智能消费指数分级基金	分级	主题	2015-05-25	2015-06-02	2015-07-24
92	浦银安盛	中证锐联基本面 200 指数分级基金	分级	主题	2015-05-27	2015-06-02	2015-07-28
93	红塔红土	中创高新指数分级基金	分级	主题	2015-05-26	2015-06-04	2015-08-28
94	嘉实	中证一带一路主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-26	2015-06-04	2015-07-17
95	鹏华	中证沪深港体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-05-26	2015-06-04	2015-07-24
96	鹏华	中证沪深港博彩娱乐指数分级基金	分级	主题	2015-05-26	2015-06-04	2015-07-24
97	南方	中证互联网金融指数分级基金	分级	主题	2015-05-29	2015-06-09	2015-07-24
98	南方	中证军工指数分级基金	分级	行业	2015-05-29	2015-06-09	2015-07-24
99	富国	中证能源互联网主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-29	2015-06-09	2015-07-28
100	富国	中证汽车后市场主题指数分级基金	分级	主题	2015-05-29	2015-06-11	2015-07-28
101	南方	中证环保 50 指数分级基金	分级	主题	2015-05-29	2015-06-11	2015-07-17
102	南方	中证新能源指数分级基金	分级	主题	2015-05-29	2015-06-11	2015-07-17
103	广发	中证工业 4.0 指数分级基金	分级	主题	2015-06-01	2015-06-12	2015-07-28
104	广发	中证核能核电指数分级基金	分级	主题	2015-06-01	2015-06-12	2015-07-20
105	易方达	移动互联网指数分级基金	分级	主题	2015-06-03	2015-06-16	2015-07-20
106	易方达	互联网金融指数分级基金	分级	主题	2015-06-03	2015-06-16	2015-07-20
107	广发	中证互联网金融指数分级基金	分级	主题	2015-06-03	2015-06-16	2015-08-01
108	南方	中证智慧农业主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-04	2015-06-18	2015-08-01
109	华泰柏瑞	中证环境治理指数分级基金	分级	主题	2015-06-05	2015-06-18	2015-07-28
110	华泰柏瑞	中证全指证券公司指数分级基金	分级	行业	2015-06-05	2015-06-18	2015-07-28
111	华泰柏瑞	中证申万医药生物指数分级基金	分级	行业	2015-06-05	2015-06-18	2015-07-28
112	大成	中证稀有金属指数分级基金	分级	主题	2015-06-10	2015-06-18	2015-07-24
113	南方	香港中盘指数分级基金 (QDII)	分级	QDII	2015-06-04	2015-06-18	2015-08-01
114	西部利得	中证细分农业产业主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-08	2015-06-23	2015-08-18
115	西部利得	国证保险证券指数分级基金	分级	行业	2015-06-08	2015-06-23	2015-08-18
116	西部利得	国证高铁指数分级基金	分级	主题	2015-06-08	2015-06-23	2015-07-28
117	西部利得	中证新能源指数分级基金	分级	主题	2015-06-08	2015-06-23	2015-07-28
118	南方	中证恒生沪港通 AH 精明指数分级基金	分级	主题	2015-06-08	2015-06-23	2015-07-28
119	富国	中证中药指数上证分级基金	分级	行业	2015-06-12	2015-06-24	2015-07-28
120	富国	中证机器人指数上证分级基金	分级	主题	2015-06-12	2015-06-24	2015-07-28
121	富国	中证新能源指数上证分级基金	分级	主题	2015-06-12	2015-06-24	2015-07-28
122	申万菱信	中证保险主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-05	2015-06-24	2015-07-28
123	富国	中证互联网金融指数上证分级基金	分级	主题	2015-06-12	2015-06-25	2015-08-18
124	富国	中证环保产业指数上证分级基金	分级	主题	2015-06-12	2015-06-25	2015-08-18
125	富国	中证旅游主题指数上证分级基金	分级	主题	2015-06-12	2015-06-25	2015-08-18
126	富国	中证银行指数上证分级基金	分级	行业	2015-06-12	2015-06-25	2015-08-18
127	国泰	中证体育指数分级基金	分级	主题	2015-06-15	2015-06-29	2015-07-28
128	国泰	国证通信指数分级基金	分级	行业	2015-06-15	2015-06-29	2015-07-28

129	国泰	国证计算机指数分级基金	分级	行业	2015-06-15	2015-06-29	2015-07-28
130	国泰	中证保险行业指数分级基金	分级	行业	2015-06-15	2015-06-29	2015-07-28
131	国泰	中证旅游指数分级基金	分级	行业	2015-06-23	2015-07-02	2015-07-28
132	南方	中证500电气指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
133	南方	中证500化工指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
134	南方	中证500房地产指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
135	南方	中证500生物制药指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
136	南方	中证500食品饮料指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
137	南方	中证500软件指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-07-28
138	南方	中证500汽车指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-18
139	南方	中证500机械指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-17
140	南方	中证500硬件指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-18
141	南方	中证500有色指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-18
142	南方	中证500交运指数分级基金	分级	行业	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-18
143	南方	中证500生活指数分级基金	分级	主题	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-18
144	金鹰	深医药等权指数分级基金	分级	行业	2015-06-25	2015-07-03	2015-08-18
145	融通	中证工业4.0指数分级基金	分级	主题	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-01
146	融通	中证一带一路主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-01
147	融通	中证互联网金融指数分级基金	分级	主题	2015-06-24	2015-07-03	2015-08-01
148	鹏华	中证新材料主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-18	2015-07-06	2015-08-18
149	广发	中证安防指数分级基金	分级	主题	2015-06-17	2015-07-06	2015-07-28
150	光大保德信	国证定向增发指数分级基金	分级	主题	2015-06-19	2015-07-06	2015-07-28
151	鹏华	中证汽车指数分级基金	分级	行业	2015-06-18	2015-07-06	2015-08-18
152	鹏华	中证机器人指数分级基金	分级	主题	2015-06-18	2015-07-06	2015-07-28
153	鹏华	中证信息安全主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-18	2015-07-06	2015-07-28
154	南方	中证中国海外互联网指数分级基金	分级	主题	2015-06-26	2015-07-06	2015-07-28
155	易方达	纳斯达克100指数分级基金	分级	规模	2015-06-29	2015-07-06	2015-07-28
156	平安大华	中证500指数增强分级基金	分级	规模	2015-06-29	2015-07-06	2015-07-28
157	鹏华	中证汽车指数分级基金	分级	行业	2015-06-18	2015-07-06	2015-08-18
158	鹏华	中证新材料主题指数分级基金	分级	主题	2015-06-18	2015-07-06	2015-08-18
159	富国	恒生综合中型股指数分级基金	分级	QDII	2015-06-30	2015-07-10	2015-08-18
160	富国	恒生综合小型股指数分级基金	分级	QDII	2015-06-30	2015-07-10	2015-08-18
161	广发	中证全指机械制造指数分级基金	分级	主题	2015-07-01	2015-07-10	2015-07-28
162	易方达	一带一路指数分级基金	分级	主题	2015-07-03	2015-07-15	2015-08-18
163	广发	中证全指家用电器指数分级基金	分级	行业	2015-07-01	2015-07-15	2015-08-18
164	光大保德信	中证全指证券公司指数分级基金	分级	行业	2015-07-02	2015-07-15	2015-08-01
165	工银瑞信	深证次新股指数分级基金	分级	主题	2015-07-02	2015-07-15	2015-08-01
166	中融	中证创投主题指数分级基金	分级	主题	2015-07-02	2015-07-15	2015-07-28
167	工银瑞信	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01
168	工银瑞信	中证智能家居指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01
169	招商	中证全指医疗保健设备与用品指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01
170	招商	中证全指海运指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01

171	汇添富	中证能源互联网主题指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01	
172	汇添富	中证环保产业指数分级基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01	
173	汇添富	中证文化产业指数分基金	分级	主题	2015-07-07	2015-07-20	2015-08-01	
174	富国	中证体育产业指数分级基金	分级	主题	2015-06-16	2015-07-22	2015-08-01	
175	富国	中证全指证券公司指数上证分级基金	分级	行业	2015-06-16	2015-07-22	2015-08-01	
176	中融	国证国家安全指数分级基金	分级	主题	2015-07-01	2015-07-27	2015-08-28	
177	天弘	中证朝阳永续预期 88 指数型	普通	主题	2015-09-11	2015-9-17	2015-10-20	
178	天弘	中证雪球领先组合 100 指数型发起式基金	普通	主题	2015-09-12	2015-9-17	2015-10-09	
179	华润元大	港股通恒生中国企业交易型开放式指数基金及其联接基金	ETF	QDII	2015-10-16	2015-10-22	2015-11-12	
180	华泰柏瑞	东证大商所农产品交易型开放式指数基金	ETF	主题	2015-10-20	2015-10-27		
181	大成	中证雪球社交投资精选大数据指数基金	普通	主题	2015-09-16	2015-10-29	2015-11-18	
182	富国	中证民参军指数基金 (LOF)	LOF	主题	2015-10-26	2015-11-4	2015-11-26	
183	富国	中证娱乐大数据指数基金	普通	主题	2015-10-27	2015-11-4	2015-11-12	
184	前海开源	金雅福黄金交易型开放式基金及其联接基金	ETF	商品	2015-10-30	2015-11-6		
185	博时	中证雪球智选大数据 100 指数型	普通	主题	2015-10-19	2015-11-18	2015-12-07	
186	博时	中证房天下大数据指数型	普通	主题	2015-10-19	2015-11-23	2015-12-07	
187	光大保德信	富时中国 A 股全指指数基金	普通	QDII	2015-11-20	2015-11-27	2015-12-22	
188	华宝兴业	标普香港上市中小盘指数基金	普通	QDII	2015-11-24	2015-11-30	2015-12-22	
189	富国	中证医药大数据指数基金 (LOF)	LOF	主题	2015-10-30	2015-12-3	2015-12-14	
190	广发	添利交易型货币市场基金	ETF	货币	2015-11-03	2015-12-9	2015-12-21	
191	建信	中证东方财富大数据 188 指数基金	普通	主题	2015-11-20	2015-12-23	2016-01-14	
192	华宝兴业	中证 500 交易型开放式指数基金	ETF	规模	2015-12-14	2016-2-4	2016-02-16	
193	富国	中证生态 100 指数基金 (LOF)	LOF	主题	2015-12-23	2016-2-5	2016-02-23	
194	平安大华	交易型货币市场基金	ETF	货币	2015-12-18	2016-2-6	2016-02-16	
195	前海开源	交易型货币市场基金	ETF	货币	2016-01-18	2016-2-6	2016-03-03	
196	招商	财富宝交易型货币市场基金	ETF	货币	2016-01-21	2016-2-25	2016-03-16	
197	浦银安盛	中证锐联沪深港基本面 100 指数基金 (LOF)	LOF	策略	2016-02-18	2016-2-26	2016-03-07	
198	工银瑞信	深证次新股指数 (LOF)	LOF	主题	2016-01-19	2016-3-4	2016-03-18	2016-04-05
199	银河	中证朝阳永续超预期 88 指数型基金	普通	主题	2016-01-22	2016-3-4	2016-03-22	
200	建信	现金添益交易型货币市场基金	ETF	货币	2016-03-09	2016-3-16	2016-03-28	
201	德邦	现金宝交易型货币市场基金	ETF	货币	2016-03-11	2016-3-21	2016-04-07	
202	安信	保证金交易型货币市场基金	ETF	货币	2016-03-16	2016-3-23	2016-04-13	
203	国投瑞银	有色金属期货指数基金 (LOF)	LOF	商品	2016-03-04	2016-3-14		
204	华泰柏瑞	易盛郑商所农产品交易型开放式指数基金	ETF	商品	2016-03-23	2016-3-31		
205	富国	中证娱乐主题指数增强型 (LOF)	LOF	主题	2016-03-31	2016-4-8	2016-04-26	
206	南方	中证全指证券公司交易型开放式指数基金联接基金	普通	行业	2016-05-06	2016-5-13	2016-05-27	
207	南方	中证全指证券公司交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-05-06	2016-5-13	2016-05-27	
208	创金合信	小盘中证 1000 指数增强型发起式	增强	规模	2016-05-13	2016-5-19	2016-06-03	
209	中融	上海清算所银行间 1-3 年中高级信用债指数发起式	普通	债券	2016-05-16	2016-5-23	2016-06-06	

210	中融	上海清算所银行间 0-1 年中高级信用债指数发起式	普通	债券	2016-05-16	2016-5-23	2016-06-03
211	中融	上海清算所银行间 1-3 年高级信用债指数发起式	普通	债券	2016-05-16	2016-5-23	2016-06-06
212	中融	上海清算所银行间 3-5 年中高级信用债指数发起式	普通	债券	2016-05-16	2016-5-23	2016-06-03
213	安信	沪深 300 指数增强型发起式基金	增强	规模	2016-05-18	2016-5-25	2016-06-12
214	博时	有色金属期货交易型开放式指数基金	ETF	商品	2016-04-28	2016-5-6	
215	鹏华	港股通中证香港中小企业投资指数	普通	QDII	2016-05-13	2016-6-6	2016-06-20
216	华宝兴业	上期白银交易型开放式指数基金	ETF	商品	2016-07-11	2016-7-15	
217	前海开源	上期白银交易型开放式指数基金联接基金	普通	商品	2016-07-11	2016-7-15	
218	前海开源	上期白银交易型开放式指数基金	ETF	商品	2016-07-11	2016-7-15	
219	广发	创业板交易型开放式指数基金发起式联接基金	普通	规模	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-29
220	广发	创业板交易型开放式指数基金	ETF	规模	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-29
221	建信	中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF)	LOF	债券	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-29
222	建信	中证政策性金融债 3-5 年指数基金 (LOF)	LOF	债券	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-26
223	建信	中证政策性金融债 8-10 年指数基金 (LOF)	LOF	债券	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-26
224	建信	中证政策性金融债 5-8 年指数基金 (LOF)	LOF	债券	2016-08-08	2016-8-15	2016-08-26
225	华宝兴业	沪深 300 指数增强型发起式基金	增强	规模	2016-08-15	2016-8-22	2016-09-07
226	鹏华	中证空天一体军工指数基金 (LOF)	LOF	主题	2016-08-25	2016-8-31	2016-09-18
227	银华	中证 5 年期地方政府债指数基金	LOF	债券	2016-08-29	2016-9-5	2016-09-20
228	银河	中证保险主体交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-08-31	2016-9-7	2016-09-23
229	银河	中证有色金属交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-08-31	2016-9-7	2016-09-23
230	银河	中证银行交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-08-31	2016-9-7	2016-09-23
231	银河	中证全指证券公司交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-08-31	2016-9-7	2016-09-23
232	银华	中证 10 年期地方政府债指数基金	普通	债券	2016-09-02	2016-9-8	2016-09-23
233	银华	上证 5 年期国债指数基金	普通	债券	2016-09-05	2016-9-12	2016-09-21
234	银华	上证 10 年期国债指数基金	普通	债券	2016-09-05	2016-9-12	2016-09-21
235	银华	中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数基金	普通	债券	2016-09-05	2016-9-12	2016-09-27
236	银华	中债 AAA 信用债指数基金	普通	债券	2016-09-05	2016-9-13	2016-09-28
237	银华	中债-5 年期国债期货货币期限匹配金融债指数基金	普通	债券	2016-09-07	2016-9-14	2016-09-28
238	招商	中证 100 指数增强型	增强	规模	2016-09-08	2016-9-14	2016-09-28
239	易方达	中证军工交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-09-09	2016-9-19	2016-10-10
240	易方达	中证全指证券公司交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-09-09	2016-9-19	2016-10-10
241	招商	中证 500 指数增强型	增强	规模	2016-09-13	2016-9-21	2016-10-18
242	招商	沪深 300 指数增强型	增强	规模	2016-09-13	2016-9-21	2016-10-18
243	南方	中证全指房地产交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-09-14	2016-9-21	2016-10-17
244	南方	中证全指房地产交易型开放式指数基金发起式联接基金	普通	行业	2016-09-14	2016-9-21	2016-10-17
245	南方	中证申万有色金属交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-09-14	2016-9-21	2016-10-13
246	南方	中证申万有色金属交易型开放式指数基金发起式联接基金	普通	行业	2016-09-14	2016-9-21	

247	工银瑞信	中债—国债（7-10年）总指数基金	普通	债券	2016-09-19	2016-9-23	2016-10-18
248	工银瑞信	中债—国债总指数基金	普通	债券	2016-09-21	2016-9-27	2016-10-18
249	南方	中证银行交易型开放式指数基金	ETF	行业	2016-09-21	2016-9-27	2016-10-17
250	南方	中证银行交易型开放式指数基金发起式联接基金	普通	行业	2016-09-21	2016-9-27	2016-10-17
251	工银瑞信	中债—金融债券（7-10年）总指数基金	普通	债券	2016-09-23	2016-9-29	2016-10-20
252	广发	中证传媒交易型开放式指数发起式联接基金	普通	行业	2016-09-26	2016-10-8	
253	益民	中证智能消费主题指数基金	普通	主题	2016-10-14	2016-10-21	
254	大成	有色金属期货指数基金（LOF）	LOF	商品	2016-07-14	2016-07-20	2016-10-20
255	南方	铜交易开放式指数基金	ETF	商品	2016-07-22	2016-07-29	
256	广发	东证大商所农产品指数基金（LOF）	LOF	商品	2016-08-18	2016-09-08	2016-10-21

资料来源：申万宏源研究

3. 2016年三季度指数基金市场表现

3.1 三季度沪深两市均上涨，成交量有所放大

2016年三季度市场涨跌互现，上证综指上涨2.56%，中小板指、创业板指分别下跌1.58%、3.50%。其中，中证500上涨3.34%，涨幅最大。创业板指数下跌3.50%，跌幅最大。上证综指三季度日均成交额为1920.96亿元，较上季度成交有所放大。

表 14：市场主要宽基指数季度表现

指数名称	最新点位	区间涨跌幅(%)	日均成交量(亿股)	日均成交金额(亿元)	日均换手率(%)
上证综指	3,004.70	2.56	168.1830	1,920.96	0.70
上证180	6,958.50	3.30	62.4355	636.28	0.34
上证50	2,177.35	2.58	22.3192	222.09	0.15
深证成指	10,567.58	0.74	198.0151	3,074.77	3.84
中小板指	6,783.59	-1.58	16.7352	307.95	1.75
创业板指	2,149.90	-3.50	11.6685	265.41	2.54
深证100	3,750.96	2.06	34.9629	544.52	1.51
沪深300	3,253.28	3.15	95.8585	1,120.78	0.44
中证100	3,042.62	2.80	42.9810	476.04	0.25
中证500	6,328.09	3.34	80.0692	971.86	1.96
申万A股	3,581.11	2.45	365.3679	4,989.23	1.12

资料来源：申万宏源研究，指数点位为2016年9月30日数据

3.2 交易所交易型基金成交冷热不均

表 15 是 ETF、LOF、分级基金在 2016 年三季度的成交情况。在三季度中，ETF 以及分级基金 A、B 类份额的成交冷热不均，各类型基金成交活跃度差异越发明。

以 ETF 为例，ETF 中日成交金额前五的基金每天平均成交约 3.88 亿元，而日成交金额后五的基金每天仅平均成交 2.2 万元。LOF 整体成交活跃度较差，其中最活跃的华宝兴业标普油气在本季度的日均成交金额达 0.53 亿元，较前一季度有所下降。分级基金的成交活跃情况差异程度也较高，分级基金 A 份额中日成交最高的为招商中证证券公司 A，日均成交额 1.9 亿元，较上季度成交金额有所放大，而最低的为浙商稳健，日均仅成交 1.16 万元；分级基金 B 类份额中日成交最高的为招商中证证券公司 B，日均成交 7.13 亿元，较上一季度交易量有所上升，最低的为银河沪深 300 成长 B，日均仅成交 2.29 万元，此外，在母基金可交易的分级基金中，易方达军工成交最为活跃，日均成交额 2302.32 万元，较上季度有一个小幅度上升。

表 15：交易所交易型指数基金 2016 年三季度成交金额

	最高		最低	
	基金名称	成交金额(万元)	基金名称	成交金额(万元)
ETF	易方达创业板 ETF	47860.04	大成中证 500 沪市 ETF	1.84
	华泰柏瑞沪深 300ETF	45593.59	景顺长城中证 TMT150ETF	1.88
	华夏上证 50ETF	40170.95	招商深证 TMT50ETF	1.96
	易方达恒生 H 股 ETF	35260.09	景顺长城中证 500ETF	2.58
	国泰上证 5 年期国债 ETF	24974.91	交银深证 300 价值 ETF	2.76
LOF	华宝兴业标普油气人民币	5343.90	长盛沪深 300	0.27
	嘉实恒生中国企业	355.01	华安深证 300	0.51
	华安标普全球石油	292.65	国投瑞银中证下游	0.63
	嘉实沪深 300ETF 联接	242.72	嘉实中证中期企业债 A	1.03
	南方香港优选	185.90	兴全沪深 300	1.04
分级基金 A 份额	招商中证证券公司 A	19038.23	浙商稳健	1.16
	鹏华中证国防 A	11287.25	交银互联网金融 A	2.64
	国泰中证医药卫生 A	8805.29	广发深证 100A	2.84
	银华恒生 H 股 A	8478.46	工银瑞信中证新能源 A	3.37
	富国中证移动互联网 A	7863.20	长盛同辉深证 100 等权 A	3.69
分级基金 B 份额	招商中证证券公司 B	71250.97	银河沪深 300 成长 B	2.29
	富国创业板 B	35767.33	银华中证 800B	4.06
	申万菱信中证申万证券 B	35417.19	长盛同辉深证 100 等权 B	4.91
	鹏华中证国防 B	35176.92	国投瑞银瑞和远见	4.95
	富国中证移动互联网 B	27011.88	长盛同瑞 B	5.73
分级基金母份额	易方达军工	2302.32	长信一带一路	4.94
	易方达证券公司	882.15	西部利得中证 500	5.50
	易方达国企改革	545.55	国金上证 50	6.85
	银华恒生 H 股	177.27	长盛上证 50	7.40
	长盛中证申万一带一路	123.76	大成中证互联网金融	7.76

资料来源：申万宏源研究,仅包括在 2016 年 9 月 30 日前上市的基金

4. 附表

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
				275.7				123.5				
510050	华夏上证 50ETF	ETF	规模	2	7.18	11.06	-3.88	7	28.04	30.01	-1.97	4.30
				192.2								
510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	ETF	规模	6	-17.46	8.49	-25.95	58.01	12.35	20.39	-8.05	4.39
				189.5				175.4				
161024	富国中证军工	分级	行业	6	9.35	-7.54	16.88	7	43.37	29.32	14.05	-3.23
				182.0				239.1				
160630	鹏华中证国防	分级	主题	1	47.59	-5.97	53.56	6	149.65	83.00	66.65	-2.31
				175.4								
510500	南方中证 500ETF	ETF	规模	2	-7.75	7.03	-14.78	26.46	5.28	7.42	-2.14	3.53
				171.2				218.3				
161720	招商中证证券公司	分级	行业	2	69.26	-2.45	71.71	7	193.91	104.47	89.43	-0.88
				167.8								
510180	华安上证 180ETF	ETF	规模	9	5.98	7.55	-1.57	58.98	0.96	1.50	-0.54	4.64
				167.2								
159919	嘉实沪深 300ETF	ETF	规模	2	-13.33	7.97	-21.29	47.64	0.04	6.16	-6.12	4.52
				160.5								
510330	华夏沪深 300ETF	ETF	规模	7	3.07	7.33	-4.26	46.35	0.07	1.31	-1.23	4.66
				159.8				191.4				
161026	富国国企改革	分级	主题	9	21.44	5.73	15.71	8	50.35	31.89	18.46	4.38
				141.2								
510810	汇添富中证上海国企 ETF	ETF	主题	0	141.20							
163113	申万菱信中证申万证券	分级	行业	98.97	10.86	-0.69	11.54	88.68	28.19	18.36	9.82	-0.13
								106.0				
164402	前海开源中航军工	分级	主题	97.69	13.10	-1.48	14.58	4	49.68	33.08	16.59	-2.64
510900	易方达恒生 H 股 ETF	ETF	QDII	90.35	-9.18	10.30	-19.48	87.59	1.45	20.53	-19.08	10.55
								110.5				
160219	国泰国证医药卫生	分级	行业	89.62	22.78	4.02	18.76	0	52.86	29.22	23.64	5.39
110003	易方达上证 50	普通	规模	81.47	1.71	3.39	-1.68	81.29	1.82	3.49	-1.67	4.24
								101.1				
161025	富国中证移动互联网	分级	主题	75.35	10.66	-1.96	12.63	4	37.84	21.26	16.59	-2.61
161022	富国创业板指数分级	分级	规模	75.10	-10.07	-2.51	-7.55	75.90	9.50	16.67	-7.16	-3.51
161812	银华深证 100	分级	规模	73.50	-2.45	2.50	-4.95	78.15	13.06	18.47	-5.40	3.41
161831	银华恒生 H 股	分级	QDII	69.99	-14.12	7.49	-21.61	77.70	30.85	55.91	-25.06	10.05
001113	南方大数据 100	普通	主题	69.80	-0.61	1.14	-1.75	75.69	3.00	4.86	-1.87	1.58
160631	鹏华中证银行	分级	行业	68.89	20.62	2.18	18.44	79.98	42.88	21.69	21.19	4.87
518880	华安易富黄金 ETF	ETF	商品	62.58	16.92	0.24	16.68	21.98	7.73	1.98	5.75	1.19
511220	海富通上证可质押城投债	ETF	债券	62.31	0.33	1.25	0.00	0.61			0.00	2.01

附表 1：指数基金列表（规模单位：亿元；申赎份额单位：亿份；净值增长率单位：%）

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
ETF												
161604	融通深证 100A	普通	规模	54.78	1.37	2.35	-0.98	42.89	1.73	2.49	-0.76	4.33
159915	易方达创业板 ETF	ETF	规模	53.37	-0.24	-1.63	1.39	25.89	77.40	76.62	0.78	-3.45
161028	富国中证新能源汽车	分级	主题	51.69	-0.55	-5.64	5.09	58.51	16.63	11.20	5.43	-10.26
050002	博时裕富沪深 300A	普通	规模	46.34	1.66	2.36	-0.70	40.66	2.14	2.93	-0.79	5.29
001021	华夏亚债中国 A	普通	债券	44.97	6.32	0.88	5.44	38.61	5.04	0.30	4.74	2.10
161027	富国证券分级	分级	行业	42.34	5.05	-0.10	5.15	39.67	12.51	7.72	4.78	-0.19
510310	易方达沪深 300ETF	ETF	规模	38.31	0.48	1.72	-1.24	28.22	0.02	0.94	-0.92	4.57
159901	易方达深证 100ETF	ETF	规模	37.96	-4.55	0.98	-5.53	9.32	1.34	2.73	-1.39	2.57
163109	申万菱信深证成指分级	分级	规模	37.35	5.44	0.35	5.09	60.02	29.42	21.07	8.35	0.78
510230	国泰上证 180 金融 ETF	ETF	行业	32.69	2.15	1.47	0.68	6.38	0.31	0.18	0.13	4.86
159937	博时黄金 ETF	ETF	商品	30.02	7.70	0.09	7.60	3.36	2.71	2.57	0.15	1.37
163115	申万菱信中证军工	分级	行业	29.80	0.10	-1.15	1.25	32.04	7.37	5.40	1.97	-3.49
040002	华安 MSCI 中国 A 股	普通	规模	29.69	5.72	0.69	5.03	42.23	12.00	4.99	7.01	3.23
161031	富国中证工业 4.0	分级	主题	28.06	-2.43	-0.73	-1.70	27.91	1.48	3.14	-1.66	-2.52
159902	华夏中小板 ETF	ETF	规模	26.22	-2.40	-0.10	-2.30	8.05	14.24	14.91	-0.67	-0.82
162411	华宝兴业标普油气人民币	LOF	QDII	25.10	-2.93	2.80	-5.73	39.20	7.70	16.99	-9.29	10.73
180003	银华道琼斯 88 精选	普通	规模	23.93	-0.06	0.37	-0.43	25.99	0.19	0.64	-0.46	1.50
000172	华泰柏瑞量化 A	普通	规模	23.90	2.71	1.35	1.36	14.23	1.51	0.71	0.80	6.46
161123	易方达并购重组	分级	主题	21.51	-0.68	0.45	-1.13	22.88	0.17	1.37	-1.20	2.01
165521	信诚中证 800 金融	分级	行业	21.13	-1.11	0.90	-2.01	22.86	2.70	4.88	-2.18	4.05
160218	国泰国证房地产	分级	行业	21.10	3.27	2.82	0.46	25.88	18.60	17.22	1.37	12.07
481009	工银瑞信沪深 300	普通	规模	20.97	-11.08	1.49	-12.57	22.16	1.57	14.78	-13.21	4.43
001242	博时淘金大数据 100A	普通	主题	20.64	3.47	0.92	2.55	24.15	5.13	2.25	2.87	5.89
001243	博时淘金大数据 100I	普通	主题	20.64	3.47	0.17	3.29	24.15	5.13	2.25	2.87	5.88
168203	中融国证钢铁	分级	行业	20.35	14.50	0.16	14.34	25.71	39.67	21.63	18.04	3.80
160221	国泰国证有色金属行业	分级	行业	20.29	7.75	-1.21	8.97	19.09	21.92	14.15	7.77	-4.06
519300	大成沪深 300	普通	规模	19.41	0.45	0.85	-0.40	20.22	0.37	0.79	-0.41	4.48
020011	国泰沪深 300	普通	规模	17.97	0.07	0.90	-0.83	25.99	0.51	1.71	-1.20	5.01
159934	易方达黄金 ETF	ETF	商品	17.72	8.10	0.02	8.07	6.25	7.43	4.61	2.82	1.15
161725	招商中证白酒	分级	行业	17.56	8.25	-1.15	9.40	18.68	26.79	17.70	9.09	-3.19
164401	前海开源中证健康	分级	主题	16.60	-1.57	1.06	-2.63	16.00	2.26	4.82	-2.57	6.03
164206	天弘添利	LOF	债券	16.33	2.90	0.27	2.63	15.65	5.59	3.04	2.55	1.85
163114	申万菱信中证环保产业	分级	主题	15.67	2.32	0.24	2.08	16.45	6.05	3.96	2.08	2.52
160625	鹏华中证 800 证券保险	分级	行业	15.60	-2.52	0.50	-3.03	13.29	0.91	3.46	-2.55	2.62
519180	万家上证 180	普通	规模	15.46	0.36	0.65	-0.28	20.31	0.15	0.52	-0.37	4.24
510510	广发中证 500ETF	ETF	规模	14.96	-1.90	0.63	-2.52	8.59	2.30	3.74	-1.44	3.63
513660	华夏沪港通恒生 ETF	ETF	QDII	14.72	-1.77	1.94	-3.71	7.19	0.59	2.54	-1.95	13.48
100038	富国沪深 300	普通	规模	14.60	-0.65	0.74	-1.39	10.42	1.03	2.00	-0.96	4.63
160717	嘉实恒生中国企业	LOF	QDII	14.41	-8.96	2.31	-11.27	20.13	1.44	17.22	-15.78	10.04
164705	汇添富恒生指数	分级	QDII	14.33	-3.56	1.74	-5.30	13.95	5.63	11.17	-5.55	11.98

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
470007	汇添富上证综指	普通	规模	13.89	0.16	0.57	-0.41	14.63	0.51	0.93	-0.43	4.06
001420	南方大数据 300A	普通	主题	13.39	0.13	0.98	-0.85	13.85	0.31	1.32	-1.01	8.35
163118	申万菱信医药生物	分级	行业	12.38	0.16	0.66	-0.50	14.01	0.31	0.88	-0.57	5.43
168204	中融中证煤炭	分级	行业	12.28	7.04	0.87	6.18	15.53	19.98	11.87	8.11	11.88
国投瑞银瑞泽中证创业成												
161223	长	分级	主题	12.25	-4.42	-0.01	-4.41	16.20	6.78	12.60	-5.82	-0.13
160716	嘉实基本面 50	LOF	策略	12.14	0.09	0.88	-0.78	10.73	1.68	2.39	-0.71	7.42
164905	交银国证新能源	分级	主题	12.13	-1.27	-0.51	-0.76	14.45	2.68	3.56	-0.88	-3.89
502013	长盛中证申万一带一路	分级	主题	12.10	0.51	0.38	0.13	16.52	2.39	2.20	0.19	3.24
270010	广发沪深 300ETF 联接 A	普通	规模	11.93	0.71	0.52	0.20	8.02	1.57	1.49	0.07	4.60
160222	国泰国证食品饮料	分级	行业	11.61	-2.53	0.29	-2.82	13.83	3.03	6.18	-3.16	0.87
510360	广发沪深 300ETF	ETF	规模	11.46	0.94	0.48	0.46	11.45	0.48	0.03	0.45	4.63
000961	天弘沪深 300	普通	规模	11.40	4.31	0.26	4.04	11.93	17.30	13.09	4.21	4.00
160629	鹏华中证传媒	分级	行业	11.32	2.18	-0.45	2.63	9.84	8.91	6.86	2.06	-2.13
000596	前海开源中证军工 A	普通	行业	11.25	0.02	-0.29	0.31	5.94	0.92	0.86	0.05	-2.76
000826	广发中证百发 100A	普通	策略	11.22	-0.59	0.00	-0.59	12.06	1.00	1.62	-0.62	-0.11
512070	易方达沪深 300 非银 ETF	ETF	行业	11.19	0.12	0.37	-0.26	6.72	0.15	0.30	-0.15	3.31
159925	南方开元沪深 300ETF	ETF	规模	11.14	0.28	0.52	-0.24	8.41	0.10	0.28	-0.18	4.80
159920	华夏恒生 ETF	ETF	QDII	10.96	-0.70	1.41	-2.11	8.80	0.96	2.80	-1.84	13.61
159922	嘉实中证 500ETF	ETF	规模	10.88	1.93	0.33	1.59	1.72	0.27	0.03	0.25	4.01
167503	安信中证一带一路	分级	主题	10.62	4.04	0.22	3.82	14.68	11.61	6.40	5.21	4.02
159928	汇添富中证主要消费 ETF	ETF	行业	10.58	-1.40	0.26	-1.67	7.48		1.14	-1.14	1.68
001064	广发中证环保产业 A	普通	行业	10.30	0.24	0.33	-0.10	13.37	1.15	1.43	-0.28	3.31
512500	华夏中证 500ETF	ETF	规模	9.96	0.21	0.36	-0.15	3.26	0.01	0.06	-0.05	3.65
501005	汇添富中证精准医疗 A	LOF	主题	9.84	-4.37	0.28	-4.65	9.46	1.46	5.91	-4.45	1.88
000962	天弘中证 500	普通	规模	9.74	2.46	0.22	2.24	9.50	11.73	9.54	2.19	2.99
160633	鹏华中证证券	分级	行业	9.27	-3.25	0.02	-3.26	9.49	2.21	5.55	-3.34	0.21
512680	广发中证军工 ETF	ETF	行业	8.81	8.81							
660008	农银汇理沪深 300	普通	规模	8.73	0.23	0.39	-0.17	8.15	0.63	0.79	-0.16	4.62
161029	富国中证银行	分级	行业	8.60	0.71	0.41	0.29	9.31	1.67	1.37	0.30	5.37
502003	易方达军工	分级	行业	8.42	5.31	-0.93	6.24	7.75	14.24	9.24	5.01	-3.28
华宝兴业香港上市中国中												
501021	小盘	LOF	QDII	8.29	3.98							
165315	建信中证互联网金融	分级	主题	8.28	-1.08	-0.38	-0.70	10.26	2.48	3.25	-0.76	-4.96
160720	嘉实中证中期企业债 A	LOF	债券	8.14	0.61	0.16	0.44	6.69	1.25	0.89	0.36	2.21
161607	融通巨潮 100	LOF	规模	7.84	0.13	0.30	-0.17	7.97	0.08	0.25	-0.17	3.80
160639	鹏华中证高铁产业	分级	行业	7.78	4.14	0.01	4.13	10.64	13.25	7.38	5.88	-0.53
160420	华安创业板 50	分级	规模	7.71	1.98	-0.39	2.37	9.18	6.18	3.40	2.78	-6.16
511010	国泰上证 5 年期国债 ETF	ETF	债券	7.64	1.26	0.08	1.18	0.07	0.02	0.01	0.01	1.20
162412	华宝兴业中证医疗	分级	行业	7.44	-0.23	0.11	-0.34	6.65	0.80	1.11	-0.31	1.45
160418	华安中证银行	分级	行业	7.33	1.80	0.25	1.54	9.23	4.01	2.06	1.95	4.52

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
502006	易方达国企改革 广发中证全指医药卫生	分级	主题	7.27	1.95	0.24	1.71	8.22	5.48	3.57	1.91	4.88
159938	ETF	ETF	行业	6.94	0.42	0.46	-0.04	5.30	0.08	0.11	-0.03	7.10
161227	国投瑞银瑞福深证 100	LOF	规模	6.85	-0.16	0.29	-0.45	7.67	0.09	0.59	-0.50	4.08
165515	信诚沪深 300 分级	分级	规模	6.76	1.95	0.09	1.86	5.98	5.28	3.77	1.51	5.11
510010	交银 180 治理 ETF	ETF	主题	6.68	0.16	0.36	-0.20	7.24	0.01	0.23	-0.22	5.61
518800	国泰黄金 ETF	ETF	商品	6.66	2.34	0.05	2.29	2.35	1.39	0.58	0.81	1.25
510880	华泰柏瑞红利 ETF	ETF	主题	6.64	0.86	0.47	0.40	2.59	0.37	0.22	0.15	8.29
160416	华安标普全球石油	LOF	QDII	6.59	-0.41	0.22	-0.63	7.11	1.48	2.16	-0.68	3.12
510160	南方小康产业 ETF	ETF	主题	6.59	-0.13	0.35	-0.48	14.14	0.44	1.46	-1.02	5.19
100032	富国中证红利	普通	主题	6.52	1.67	0.43	1.24	4.87	1.17	0.23	0.94	8.51
512000	华宝兴业中证全指证券	ETF	行业	6.42	6.42							
200002	长城久泰沪深 300	普通	规模	6.26	0.20	0.32	-0.11	4.68	0.08	0.17	-0.08	5.22
502048	易方达上证 50 分级	分级	规模	6.16	-0.48	0.24	-0.72	5.68	0.96	1.67	-0.70	4.33
161821	银华中证中票 50A	LOF	债券	5.96	0.12	0.09	0.03	4.82	0.04	0.02	0.02	1.48
160638	鹏华中证一带一路	分级	主题	5.89	0.20	0.30	-0.10	8.19	0.98	0.81	0.17	5.24
161032	富国中证煤炭	分级	行业	5.63	0.60	0.66	-0.06	4.83	3.62	3.68	-0.06	13.23
161119	易方达中债新综合 A	LOF	债券	5.55	2.51	0.07	2.44	4.50	3.33	1.35	1.98	2.08
512220	景顺长城中证 TMT150ETF	ETF	主题	5.52	-0.30	-0.06	-0.24	3.85		0.17	-0.17	-1.04
512810	华宝兴业中证军工 ETF	ETF	行业	5.45	5.45							
310318	申万菱信沪深 300	普通	规模	5.35	-0.43	0.45	-0.87	2.91	0.18	0.65	-0.48	7.76
164906	交银中证海外中国互联网	LOF	QDII	5.21	0.37	0.98	-0.61	4.98	0.72	1.34	-0.62	21.06
160136	南方中证国企改革	分级	主题	5.21	1.20	0.20	0.99	6.01	3.16	2.02	1.14	5.19
159903	南方深成 ETF	ETF	规模	5.18	-0.23	0.04	-0.27	4.60	0.06	0.30	-0.24	0.73
161030	富国中证体育产业	分级	主题	5.15	-0.72	-0.12	-0.59	6.63	2.13	2.87	-0.74	-2.51
161726	招商国证生物医药	分级	行业	5.12	0.21	0.32	-0.11	4.75	0.51	0.61	-0.10	6.42
165522	信诚中证 TMT 产业	分级	主题	5.07	-0.50	-0.05	-0.45	5.83	1.03	1.53	-0.50	-1.25
159943	大成深证成份 ETF	ETF	规模	5.06	-0.60	0.04	-0.64	0.46		0.06	-0.06	0.57
163111	申万菱信中小板	分级	规模	4.99	-0.20	-0.07	-0.13	4.86	0.57	0.70	-0.14	-1.15
160632	鹏华中证酒	分级	主题	4.91	0.40	-0.02	0.42	5.60	4.94	4.53	0.41	0.92
161723	招商中证银行指数分级	分级	行业	4.88	0.73	0.22	0.51	5.55	1.16	0.60	0.56	5.64
160125	南方香港优选	LOF	QDII	4.82	-0.17	0.33	-0.51	5.76	0.18	0.80	-0.62	6.94
165309	建信沪深 300	LOF	规模	4.74	0.14	0.21	-0.07	4.84	0.31	0.39	-0.07	4.48
165312	建信央视财经 50	分级	主题	4.62	2.39	0.15	2.24	3.46	5.07	3.40	1.67	7.46
000311	景顺长城沪深 300	普通	规模	4.54	0.52	0.31	0.22	2.54	0.57	0.45	0.12	7.73
502010	易方达证券公司	分级	行业	4.54	0.24	0.01	0.23	3.94	1.23	1.00	0.23	0.55
161724	招商中证煤炭	分级	行业	4.49	0.15	0.66	-0.51	3.93	2.59	3.06	-0.46	15.57
	广发中证全指信息技术											
159939	ETF	ETF	行业	4.44	-0.15	-0.16	0.01	3.83	0.62	0.60	0.02	-3.81
161613	融通创业板	普通	规模	4.38	0.12	-0.15	0.27	4.15	2.04	1.77	0.27	-3.83
160213	国泰纳斯达克 100	普通	QDII	4.33	0.05	0.46	-0.41	1.95		0.19	-0.19	11.03

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
161017	富国中证 500	LOF	规模	4.29	0.08	0.35	-0.26	2.11	0.54	0.67	-0.13	8.25
160620	鹏华中证 A 股资源产业 广发中证全指可选消费 ETF	分级	主题	4.26	-1.21	0.23	-1.43	3.77	1.53	2.79	-1.26	3.96
159936	华宝兴业中证 100	普通	规模	4.25	0.23	0.14	0.09	2.78	0.12	0.06	0.06	3.47
240014	国投瑞银沪深 300 金融地 产 ETF	普通	规模	4.25	0.17	0.20	-0.03	4.33	0.07	0.10	-0.03	4.86
159933	建信中证 500	ETF	行业	4.12	0.10	0.21	-0.11	2.62	0.38	0.45	-0.08	5.55
000478	鹏华中证 800 地产	普通	规模	4.08	1.33	0.25	1.08	1.82	1.05	0.55	0.49	8.20
160628	兴全沪深 300	分级	行业	4.01	0.97	0.53	0.43	3.78	6.15	5.64	0.51	13.86
163407	广发纳斯达克生物科技人 民币	LOF	规模	3.92	0.11	0.23	-0.12	2.95	0.18	0.27	-0.09	5.91
001092	鹏华中证信息技术	普通	规模	3.82	0.38	0.44	-0.06	8.67	1.03	1.17	-0.13	12.95
160626	天弘创业板 A	分级	行业	3.81	-0.16	-0.05	-0.11	3.25	0.91	1.00	-0.10	-1.18
001592	融通中证军工	普通	规模	3.81	2.51	-0.01	2.52	4.47	7.14	4.15	2.99	-3.35
161628	工银瑞信中证传媒	分级	行业	3.77	0.92	-0.12	1.05	4.60	2.89	1.65	1.24	-3.08
164818	长盛中证金融地产	分级	行业	3.76	0.65	-0.14	0.79	4.66	2.85	1.95	0.91	-2.52
160814	中融一带一路	分级	主题	3.63	0.41	0.20	0.21	4.69	1.18	0.92	0.26	6.75
168201	华泰柏瑞中证 500ETF	分级	主题	3.62	-1.02	0.22	-1.24	3.35	0.72	1.86	-1.14	4.45
512510	易方达沪深 300 量化	ETF	规模	3.61	-0.11	0.15	-0.26	2.82	0.10	0.30	-0.20	3.86
110030	易方达中小板指数	普通	规模	3.60	-0.62	0.25	-0.86	2.05	0.34	0.83	-0.49	5.62
161118	华夏 MSCI 中国 A 股 ETF	分级	规模	3.58	-0.22	-0.02	-0.21	3.52	0.87	0.95	-0.08	-0.43
512990	长盛中证 100	ETF	规模	3.56	-0.11	0.18	-0.29	3.69		0.30	-0.30	4.95
519100	南方中证互联网	普通	规模	3.55	0.12	0.19	-0.07	3.81	0.05	0.13	-0.07	5.43
160137	中融中证银行	分级	主题	3.35	-0.24	0.00	-0.24	4.31	0.20	0.50	-0.30	-0.19
168205	嘉实沪深 300 增强	分级	行业	3.33	0.23	0.15	0.08	4.06	0.28	0.19	0.09	4.73
000176	鹏华创业板	普通	规模	3.28	0.03	0.14	-0.11	3.12	0.27	0.37	-0.11	4.47
160637	新华中证环保产业	分级	规模	3.11	-0.47	-0.09	-0.38	3.06	1.37	1.72	-0.35	-3.06
164304	招商沪深 300 地产	分级	主题	3.04	-0.72	0.11	-0.84	2.62	0.19	0.90	-0.71	2.56
161721	招商沪深 300 地产	分级	策略	3.03	0.48	0.36	0.13	4.02	3.32	3.08	0.25	11.52
165511	信诚中证 500 分级	分级	规模	3.00	0.09	0.15	-0.07	2.42	0.57	0.62	-0.05	5.17
502053	长盛中证全指证券	分级	行业	2.96	0.92	-0.04	0.97	2.83	2.47	1.58	0.89	-0.48
000059	国联安中证医药 100	分级	行业	2.96	0.14	0.14	0.00	1.87	0.19	0.19	0.00	4.99
512660	国泰中证军工 ETF	普通	行业	2.95	2.95							
001015	华夏沪深 300A	ETF	规模	2.89	0.11	0.11	0.00	2.55	0.41	0.45	-0.05	6.05
165523	信诚中证信息安全	普通	规模	2.89	-0.23	-0.18	-0.06	3.00	0.27	0.32	-0.06	-5.77
163808	中银中证 100	分级	主题	2.89	-0.23	-0.18	-0.06	3.00	0.27	0.32	-0.06	-5.77
163808	中银中证 100	普通	规模	2.87	0.10	0.16	-0.05	2.93	0.04	0.09	-0.05	5.72
159907	广发中小板 300ETF	ETF	规模	2.82	-0.28	-0.03	-0.25	1.93	0.03	0.20	-0.17	-1.10
161826	银华中证转债	分级	规模	2.82	-0.28	-0.03	-0.25	1.93	0.03	0.20	-0.17	-1.10
161826	银华中证转债	分级	债券	2.81	-0.40	0.12	-0.52	2.86	0.17	0.72	-0.54	4.14
160616	鹏华中证 500	LOF	规模	2.80	-0.25	0.14	-0.39	2.19	0.16	0.46	-0.31	4.67
161715	招商中证大宗商品	普通	规模	2.80	-0.25	0.14	-0.39	2.19	0.16	0.46	-0.31	4.67
161715	招商中证大宗商品	分级	主题	2.76	0.22	0.13	0.09	2.80	0.45	0.36	0.08	5.23
510560	国寿安保中证 500ETF	ETF	规模	2.74	-0.54	0.11	-0.66	2.08	0.64	1.14	-0.50	3.40

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
165519	信诚中证 800 医药	分级	行业	2.73	0.41	0.22	0.20	3.38	1.32	1.05	0.26	8.60
160224	国泰深证 TMT50	分级	主题	2.69	-0.17	-0.05	-0.12	2.45	0.28	0.38	-0.10	-2.01
000055	广发纳斯达克 100 美元现汇	普通	QDII	2.66	-0.24	0.33	-0.56	1.78	0.06	0.45	-0.39	11.29
270042	广发纳斯达克 100 人民币	普通	QDII	2.66	-0.24	0.33	-0.56	1.78	0.06	0.45	-0.39	12.08
510290	南方上证 380ETF	ETF	规模	2.65	0.03	0.10	-0.06	1.74	0.02	0.06	-0.04	3.64
510130	易方达上证中盘 ETF	ETF	规模	2.65	0.07	0.14	-0.07	0.78	0.00	0.02	-0.02	5.47
160516	博时中证 800 证券保险	分级	行业	2.64	-0.05	0.06	-0.11	2.41	0.14	0.24	-0.10	2.19
161816	银华中证等权重 90	分级	策略	2.58	-0.03	0.09	-0.12	2.50	0.05	0.16	-0.11	3.19
000368	汇添富沪深 300 安中动态策略	普通	策略	2.54	0.12	0.09	0.04	2.02	0.10	0.07	0.03	3.57
159905	工银瑞信深证红利 ETF	ETF	主题	2.52	0.63	0.13	0.50	2.12	3.64	3.19	0.45	4.90
160615	鹏华沪深 300	LOF	规模	2.51	0.09	0.15	-0.06	1.98	0.06	0.11	-0.04	6.21
159949	华安创业板 50ETF	ETF	规模	2.42	-3.09							
162509	国联安双禧中证 100	分级	规模	2.41	-0.39	0.13	-0.51	2.35	0.22	0.72	-0.50	4.38
160123	南方中债 10 年期国债 A	LOF	债券	2.36	2.36	0.00	-25.91	3.98	0.01	0.07	-0.06	-0.02
160123	南方中债 10 年期国债 A	LOF	债券	2.36	2.36	0.00	-25.91	3.98	0.01	0.07	-0.06	-0.02
161122	易方达生物科技	分级	主题	2.34	0.04	0.12	-0.08	2.13	0.14	0.22	-0.08	5.49
167301	方正富邦中证保险	分级	行业	2.30	0.28	0.12	0.16	2.40	1.38	1.19	0.20	4.69
510060	工银上证央企 50ETF	ETF	主题	2.28	-0.05	0.10	-0.15	1.55	0.03	0.13	-0.10	4.17
512880	国泰中证全指证券公司 ETF	ETF	行业	2.27	2.27							
160634	鹏华中证环保产业	分级	行业	2.26	0.53	0.07	0.46	2.06	0.65	0.23	0.42	3.89
165520	信诚中证 800 有色	分级	行业	2.24	0.37	-0.11	0.48	2.28	1.35	0.94	0.41	-1.80
510020	博时超大盘 ETF	ETF	规模	2.24	0.01	0.08	-0.07	1.08	0.00	0.04	-0.03	3.57
000613	国寿安保护深 300	普通	规模	2.23	-3.44	0.30	-3.74	1.52	0.58	3.11	-2.54	4.87
510630	华夏上证主要消费 ETF	ETF	行业	2.22	-0.16	0.08	-0.24	1.46	0.83	0.99	-0.16	3.36
163116	申万菱信电子行业	分级	行业	2.21	-0.23	-0.03	-0.20	2.15	0.28	0.48	-0.20	-1.31
513500	博时标普 500ETF	ETF	QDII	2.18	0.09	0.09	0.00	1.63			0.00	4.11
159926	嘉实中证中期国债 ETF	ETF	债券	2.17	0.01	0.03	-0.01	0.02		0.00	0.00	1.16
000179	广发美国房地产人民币	普通	QDII	2.08	-0.67	-0.02	-0.65	3.18		0.97	-0.97	-1.36
510080	长盛全债	普通	债券	2.06	-0.31	0.02	-0.32	1.38	0.00	0.22	-0.22	0.63
160419	华安中证全指证券	分级	行业	2.04	0.01	0.00	0.01	1.84	0.31	0.30	0.01	-0.24
450008	国富沪深 300	普通	规模	2.03	-0.07	0.10	-0.17	1.64	0.03	0.17	-0.14	4.66
502000	西部利得中证 500	分级	规模	2.02	0.34	0.05	0.29	2.01	0.36	0.08	0.29	3.18
160636	鹏华中证移动互联网	分级	主题	2.00	-0.20	-0.02	-0.18	1.83	0.10	0.26	-0.16	-1.18
159906	大成深证成长 40ETF	ETF	风格	1.85	-0.04	0.05	-0.09	1.86		0.09	-0.09	2.47
513030	华安德国 30 (DAX) ETF	ETF	QDII	1.84	-0.01	0.18	-0.19	1.99	0.41	0.60	-0.19	9.07
164907	交银互联网金融	分级	主题	1.81	-0.19	-0.10	-0.10	1.67	0.06	0.15	-0.09	-4.98
512330	南方中证 500 信息技术 ETF	ETF	行业	1.77	1.50	-0.07	1.57	2.08	2.09	0.31	1.79	-5.12
000369	广发全球医疗保健人民币	普通	QDII	1.74	-0.24	0.01	-0.25	2.92	0.03	0.44	-0.41	0.17

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
160806	长盛同庆中证 800	LOF	规模	1.73	-0.08	0.07	-0.15	1.40	0.00	0.12	-0.12	3.94
510520	诺安中证 500ETF	ETF	规模	1.70	-0.01	0.05	-0.07	1.03		0.04	-0.04	2.98
050025	博时标普 500ETF 联接	普通	QDII	1.70	0.02	0.06	-0.04	1.03	0.09	0.11	-0.03	3.83
000968	广发中证养老产业 A	普通	主题	1.68	0.09	0.05	0.05	1.71	0.24	0.22	0.02	3.03
159918	嘉实中创 400ETF	ETF	规模	1.67	-0.02	-0.05	0.03	0.80	0.09	0.08	0.01	-2.53
160135	南方中证高铁产业	分级	主题	1.67	0.06	0.01	0.06	1.69	0.53	0.47	0.06	0.24
164908	交银中证环境治理	LOF	主题	1.65	1.65	0.09	0.19	1.66	0.53	0.25	0.29	4.73
161612	融通深证成指	普通	规模	1.64	-0.03	0.04	-0.06	1.94	0.06	0.14	-0.07	2.05
519671	银河沪深 300 价值	普通	风格	1.63	0.12	0.11	0.01	1.43	0.10	0.09	0.01	7.10
510710	博时上证 50ETF	ETF	规模	1.62	0.00	0.07	-0.07	0.74	0.01	0.04	-0.03	4.36
161629	融通中证全指证券	分级	行业	1.62	-0.44	0.01	-0.45	1.44	0.72	1.12	-0.39	0.18
160225	国泰中证新能源汽车	LOF	主题	1.59	1.59	-0.13	-1.15	1.54	1.69	1.96	-0.27	-6.31
161819	银华中证内地资源主题	分级	主题	1.51	-0.07	0.01	-0.08	1.44	0.12	0.19	-0.07	0.19
310398	申万菱信沪深 300 价值	普通	风格	1.48	0.08	0.10	-0.02	1.27	0.06	0.08	-0.02	6.89
510210	富国上证综指 ETF	ETF	规模	1.44	0.05	0.05	0.00	0.43			0.00	3.91
164819	工银瑞信环保产业	分级	主题	1.44	0.51	0.00	0.51	1.82	1.24	0.62	0.62	2.57
510170	国联上证商品 ETF	ETF	主题	1.44	0.02	0.04	-0.02	0.87		0.01	-0.01	2.41
162307	海富通中证 100	LOF	规模	1.41	0.02	0.06	-0.04	1.43	0.01	0.05	-0.04	4.12
502023	鹏华国证钢铁行业	分级	行业	1.40	1.01	0.01	1.00	1.64	2.77	1.60	1.17	5.36
161811	银华沪深 300 分级	分级	规模	1.39	0.02	0.06	-0.04	1.65	0.04	0.09	-0.05	4.33
510030	华宝兴业上证 180 价值 ETF	ETF	风格	1.39	-0.01	0.08	-0.09	0.37		0.03	-0.03	6.19
163001	长信医疗保健行业	LOF	主题	1.37	0.03	0.04	-0.01	1.38	0.15	0.16	-0.01	3.21
165524	信诚中证智能家居	分级	主题	1.36	-0.19	-0.04	-0.15	1.35	0.06	0.21	-0.15	-2.90
159942	华润元大中创 100ETF	ETF	主题	1.34	-0.02	-0.03	0.01	0.70	0.10	0.09	0.01	-3.04
167701	德邦金债分级	分级	债券	1.31	0.88	0.01	0.87	1.16	0.87	0.09	0.78	1.54
320010	诺安中证 100	普通	规模	1.30	0.04	0.06	-0.03	1.35	0.02	0.05	-0.03	5.01
585001	东吴中证新兴产业	普通	主题	1.30	-0.01	0.04	-0.05	1.17	0.02	0.06	-0.04	2.87
168001	国寿安保养老产业	分级	主题	1.30	-0.27	0.03	-0.31	1.60	0.34	0.72	-0.37	1.88
399001	中海上证 50	普通	规模	1.30	-0.07	0.04	-0.11	1.38	0.09	0.21	-0.12	2.95
160517	博时中证银行	分级	行业	1.29	0.01	0.06	-0.05	1.49	0.09	0.15	-0.06	4.71
510190	华安上证龙头 ETF	ETF	主题	1.23	0.02	0.05	-0.03	0.40		0.01	-0.01	4.44
510150	招商上证消费 80ETF	ETF	主题	1.22	0.00	0.06	-0.06	0.32		0.02	-0.02	4.74
001899	东海中证社会发展安全	普通	主题	1.21	-0.08	0.03	-0.11	1.46	0.02	0.16	-0.13	2.22
590007	中邮上证 380	普通	规模	1.21	-0.09	0.02	-0.11	0.72	0.06	0.12	-0.07	1.58
163117	申万菱信传媒行业	分级	行业	1.20	0.01	-0.05	0.05	1.40	0.53	0.48	0.05	-3.23
159948	南方创业板 ETF	ETF	规模	1.20	0.01							
159940	广发中证全指金融地产 ETF	ETF	行业	1.19	0.07	0.06	0.01	1.52	0.29	0.28	0.01	5.71
161207	国投瑞银瑞和 300	分级	规模	1.17	0.03	0.06	-0.03	1.16	0.02	0.05	-0.03	5.70
161217	国投瑞银中证上游	LOF	主题	1.16	0.01	0.03	-0.02	1.94	0.40	0.44	-0.04	2.40
510660	华夏上证医药卫生 ETF	ETF	行业	1.15	0.06	0.10	-0.04	0.75	0.80	0.83	-0.03	9.58

附表 1：指数基金列表（规模单位：亿元；申赎份额单位：亿份；净值增长率单位：%）

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
502056	广发中证医疗	分级	行业	1.14	0.16	0.03	0.13	0.95	0.55	0.44	0.11	2.47
162413	华宝兴业中证 1000	分级	规模	1.12	-0.09	-0.01	-0.08	1.34	0.22	0.31	-0.09	-1.23
001027	前海开源中证大农业	普通	主题	1.08	-0.34	0.00	-0.34	1.36	0.06	0.48	-0.43	-0.13
000312	华安沪深 300 量化 A	普通	规模	1.06	0.16	0.02	0.14	0.74	0.50	0.43	0.08	5.22
510420	景顺长城 180 等权 ETF	ETF	策略	1.06	-0.16	0.05	-0.21	0.75	0.09	0.24	-0.15	4.39
002236	大成互联网+大数据	普通	主题	1.05	0.44							
502036	大成中证互联网金融	分级	主题	1.03	-0.14	-0.06	-0.08	0.95	0.08	0.15	-0.07	-5.02
159945	广发中证全指能源 ETF	ETF	行业	1.03	0.07	0.08	-0.01	1.54	0.42	0.44	-0.02	8.51
510090	建信上证社会责任 ETF	ETF	主题	1.03	0.01	0.07	-0.06	0.82		0.05	-0.05	6.94
000835	华润元大富时中国 A50	普通	规模	1.03	0.03	0.05	-0.02	0.82	0.10	0.12	-0.02	4.61
161121	易方达银行	分级	行业	1.00	0.03	0.06	-0.02	1.22	0.26	0.29	-0.03	5.64
096001	大成标普 500 等权重	普通	QDII	0.98	0.33	0.03	0.30	0.64	0.30	0.10	0.20	4.33
090010	大成中证红利	普通	主题	0.98	0.06	0.07	0.00	0.70	0.05	0.05	0.00	7.34
159929	汇添富中证医药卫生 ETF	ETF	行业	0.97	0.02	0.07	-0.05	0.68		0.04	-0.04	7.39
512310	南方中证 500 工业 ETF	ETF	行业	0.95	-0.08	0.05	-0.13	1.44	0.07	0.26	-0.20	4.95
510430	银华上证 50 等权重 ETF	ETF	策略	0.93	0.02	0.03	-0.01	0.74	0.01	0.02	-0.01	3.11
513100	国泰纳斯达克 100ETF	ETF	QDII	0.92	0.18	0.08	0.10	0.54	0.08	0.02	0.06	10.88
513600	南方恒生 ETF	ETF	QDII	0.91	-0.03	0.11	-0.14	0.44		0.07	-0.07	12.60
510260	诺安上证新兴产业 ETF	ETF	主题	0.89	0.04	0.02	0.02	0.81	0.04	0.03	0.02	2.25
160121	南方金砖四国	普通	QDII	0.89	0.26	0.07	0.20	1.04	0.34	0.10	0.23	10.32
159916	建信深证基本面 60ETF	ETF	策略	0.89	0.02	0.05	-0.04	0.34		0.02	-0.02	6.47
660011	农银汇理中证 500	普通	规模	0.88	-0.02	0.03	-0.04	0.54	0.10	0.12	-0.03	2.89
164508	国富中证 100	分级	规模	0.87	-0.03	0.03	-0.06	1.13	0.05	0.12	-0.07	2.93
511210	博时上证企债 30ETF	ETF	债券	0.87	-0.06	0.01	-0.07	0.01		0.00	0.00	1.31
162213	泰达宏利中证财富大盘	普通	主题	0.86	-7.90	0.08	-7.98	0.76	0.14	7.71	-7.57	8.41
510070	鹏华上证民企 50ETF	ETF	主题	0.84	0.02	0.04	-0.02	0.53	0.05	0.06	-0.02	5.54
270027	广发标普全球农业人民币	普通	QDII	0.84	-0.08	0.04	-0.12	1.55	0.04	0.27	-0.23	4.34
159935	景顺长城中证 500ETF	ETF	规模	0.84	-0.01	0.03	-0.03	0.51		0.02	-0.02	3.00
159944	广发中证全指原材料 ETF	ETF	行业	0.83	-0.10	0.03	-0.13	1.02	0.02	0.18	-0.16	3.34
159910	嘉实深证基本面 120ETF	ETF	策略	0.82	0.05	0.05	0.00	0.61	0.15	0.15	0.00	5.85
159909	招商深证 TMT50ETF	ETF	主题	0.80	-0.02	-0.02	0.00	0.16			0.00	-2.55
512340	南方中证 500 原材料 ETF	ETF	行业	0.79	-0.02	0.05	-0.08	1.03	0.17	0.27	-0.10	6.69
530018	建信深证 100	普通	规模	0.77	0.02	0.02	0.01	0.55	0.07	0.07	0.00	2.41
159912	汇添富深证 300ETF	ETF	规模	0.75	0.01	0.01	0.00	0.58	0.02	0.02	0.00	0.94
510410	博时自然资源 ETF	ETF	主题	0.75	0.01	0.00	0.00	1.16	0.03	0.03	0.00	0.72
162216	泰达宏利中证 500	分级	规模	0.74	0.13	0.03	0.10	0.75	0.31	0.21	0.10	4.84
519116	浦银安盛沪深 300	普通	规模	0.73	0.02	0.05	-0.03	0.64	0.04	0.07	-0.03	6.98
740101	长安 300 非周期	普通	主题	0.73	0.02	0.03	-0.01	0.57	0.03	0.04	-0.01	4.87
217027	招商央视财经 50	普通	主题	0.73	0.46	0.02	0.45	0.51	0.40	0.10	0.31	7.51
164820	工银瑞信高铁产业	分级	主题	0.72	-0.02	-0.01	-0.01	0.72	0.11	0.11	-0.01	-1.11
213010	宝盈中证 100	普通	规模	0.71	0.01	0.02	-0.01	0.68	0.15	0.16	-0.01	3.27

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
690008	民生加银中证内地资源 景顺长城中证 800 食品饮	普通	主题	0.70	0.08	0.00	0.08	1.06	0.32	0.20	0.11	0.45
512210	料 ETF	ETF	行业	0.70	-0.27	0.00	-0.27	0.52	0.10	0.30	-0.20	0.16
399011	中海医疗保健	普通	规模	0.70	0.03	0.02	0.01	0.52	0.07	0.06	0.01	2.85
166007	中欧沪深 300A	LOF	规模	0.69	-0.01	0.04	-0.05	0.59	0.01	0.05	-0.04	5.29
159924	景顺长城 300 等权 ETF	ETF	策略	0.69	0.00	0.02	-0.03	0.51		0.02	-0.02	3.35
165809	东吴中证可转换债券	分级	债券	0.67	0.03	0.02	0.01	0.70	0.12	0.11	0.01	3.43
512120	华安中证细分医药 ETF	ETF	行业	0.67	0.04	0.05	-0.01	0.50	0.03	0.04	-0.01	7.99
161624	融通标普中国可转债 A	普通	债券	0.66	0.02	0.00	0.02	0.74	0.02	0.02	-0.01	3.61
512300	南方中证 500 医药卫生 ETF	ETF	行业	0.64	-0.06	0.05	-0.11	0.52	0.02	0.11	-0.09	8.13
000022	南方中债中期票据 A	普通	债券	0.63	0.00	0.00	0.00	0.53	0.13	0.13	0.00	0.76
161213	国投瑞银中证下游	LOF	主题	0.62	0.01	0.02	-0.01	0.48	0.03	0.04	-0.01	3.65
162714	广发深证 100 分级	分级	规模	0.62	0.04	0.03	0.01	0.61	0.07	0.06	0.01	4.61
160640	鹏华中证新能源	分级	主题	0.61	-0.07	-0.01	-0.06	0.70	0.18	0.23	-0.04	-1.67
164809	工银瑞信中证 500	分级	规模	0.60	0.09	0.01	0.08	0.45	0.12	0.06	0.06	2.47
519117	浦银安盛基本面 400	普通	策略	0.60	0.01	0.03	-0.02	0.39	0.01	0.03	-0.01	5.36
217016	招商深证 100	普通	规模	0.58	0.05	0.03	0.02	0.52	0.07	0.06	0.01	5.99
700002	平安大华深证 300 广发中证全指主要消费	普通	规模	0.57	0.03	0.03	0.00	0.38	0.05	0.05	0.00	5.11
159946	ETF	ETF	行业	0.57	0.09	0.01	0.08	0.60	0.21	0.13	0.08	3.04
159911	鹏华深证民营 ETF	ETF	主题	0.57	-0.03	0.00	-0.02	0.13		0.01	-0.01	-0.71
040046	华安纳斯达克 100 人民币	普通	QDII	0.56	0.28	0.03	0.24	1.12	0.68	0.18	0.50	9.16
510280	华宝兴业上证 180 成长 ETF 景顺长城中证医药卫生	ETF	风格	0.56	0.00	0.03	-0.03	0.42		0.02	-0.02	4.55
512230	ETF	ETF	行业	0.56	0.20	0.02	0.18	0.42	0.16	0.03	0.14	7.19
161033	富国中证智能汽车	LOF	主题	0.55	-0.03							
510650	华夏上证金融地产 ETF	ETF	行业	0.54	-0.05	0.03	-0.08	0.37	0.10	0.16	-0.06	4.67
166802	浙商沪深 300	分级	规模	0.54	0.01	0.03	-0.01	0.49	0.01	0.02	-0.01	4.79
290010	泰信中证 200	普通	规模	0.53	0.02	0.02	0.00	0.52	0.01	0.01	0.00	3.74
161825	银华中证 800 等权重	分级	策略	0.53	0.06	0.01	0.05	0.52	0.08	0.03	0.05	2.83
160807	长盛沪深 300	LOF	规模	0.53	0.02	0.02	-0.01	0.49	0.02	0.02	-0.01	4.69
001552	天弘中证证券保险 A	普通	行业	0.53	0.08	0.01	0.08	0.70	0.63	0.53	0.10	1.66
512640	嘉实中证金融地产 ETF	ETF	行业	0.53	-0.05	0.03	-0.08	0.32	0.03	0.08	-0.05	4.95
001631	天弘中证食品饮料 A	普通	行业	0.51	0.18	0.00	0.18	0.48	0.72	0.55	0.17	1.26
002510	申万菱信中证 500	普通	规模	0.51	-0.03							
000656	前海开源沪深 300	普通	规模	0.50	0.02	0.02	0.01	0.47	0.04	0.03	0.01	3.69
540012	汇丰晋信恒生 A 股 A	普通	行业	0.50	0.03	0.04	0.00	0.38	0.02	0.02	0.00	7.78
164821	工银瑞信中证新能源	分级	主题	0.50	0.02	-0.02	0.04	0.43	0.12	0.09	0.03	-3.14
502030	中海中证高铁产业	分级	主题	0.50	0.18	0.00	0.17	0.51	0.33	0.15	0.19	-0.46
001550	天弘中证医药 100A	普通	行业	0.49	0.10	0.02	0.08	0.62	0.46	0.36	0.10	5.07
161907	万家中证红利	LOF	主题	0.48	0.02	0.03	-0.01	0.34	0.00	0.01	-0.01	7.13

附表 1: 指数基金列表 (规模单位: 亿元; 申赎份额单位: 亿份; 净值增长率单位: %)

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
000042	财通中证 100 增强	普通	主题	0.48	0.25	0.01	0.24	0.35	0.20	0.03	0.17	5.09
233010	大摩深证 300	普通	规模	0.48	0.01	0.01	0.00	0.33	0.03	0.03	0.00	1.46
159923	大成中证 100ETF	ETF	规模	0.48	0.01	0.02	-0.01	0.38		0.01	-0.01	4.10
090016	大成消费主题	普通	主题	0.47	0.09	-0.04	0.12	0.53	0.32	0.19	0.13	-8.37
002588	博时银智大数据 100	普通	主题	0.46	0.06							
161714	招商标普金砖四国	LOF	QDII	0.46	-0.01	0.06	-0.07	0.56		0.09	-0.09	13.18
159913	交银深证 300 价值 ETF	ETF	风格	0.43	0.02	0.02	0.00	0.30			0.00	5.61
160635	鹏华中证医药卫生	LOF	行业	0.42	0.42	0.03	0.06	0.42	0.36	0.39	-0.03	0.60
510440	大成中证 500 沪市 ETF	ETF	规模	0.42	0.02	0.02	0.00	0.23			0.00	4.40
159931	汇添富中证金融地产 ETF	ETF	行业	0.41	0.03	0.02	0.01	0.28	0.13	0.12	0.01	4.41
159908	博时深证基本面 200ETF	ETF	策略	0.41	0.02	0.02	0.00	0.34	0.02	0.02	0.00	5.18
510110	海富通上证周期 ETF	ETF	主题	0.40	-0.07	0.02	-0.09	0.14		0.03	-0.03	3.93
162907	泰信基本面 400	分级	策略	0.40	-0.04	0.02	-0.06	0.53	0.18	0.25	-0.08	5.13
161507	银河沪深 300 成长	分级	风格	0.39	0.00	0.01	-0.02	0.34	0.01	0.03	-0.01	3.06
660014	农银汇理深证 100	普通	规模	0.37	0.03	0.02	0.02	0.29	0.15	0.13	0.02	3.34
001629	天弘中证计算机 A	普通	行业	0.37	0.07	-0.01	0.09	0.49	0.84	0.72	0.12	-6.74
001554	天弘中证全指运输 A	普通	行业	0.36	0.06	0.01	0.05	0.60	0.58	0.49	0.09	1.86
159932	大成中证 500 深市 ETF	ETF	规模	0.36	-0.01	0.01	-0.02	0.20	0.01	0.02	-0.01	1.81
512010	易方达沪深 300 医药卫生 ETF	ETF	行业	0.36	0.00	0.04	-0.04	0.28		0.03	-0.03	9.82
163821	中银沪深 300 等权重	LOF	策略	0.36	0.01	0.01	0.00	0.25	0.02	0.02	0.00	3.23
000049	中银标普全球精选	普通	QDII	0.36	0.14	0.01	0.13	0.39	0.20	0.07	0.14	5.62
502026	鹏华新丝路	分级	主题	0.34	0.27	-0.01	0.28	0.40	0.90	0.59	0.31	0.64
410008	华富中证 100	普通	规模	0.33	0.00	0.02	-0.02	0.34	0.01	0.03	-0.02	5.13
510120	海富通上证非周期 ETF	ETF	主题	0.33	0.00	0.01	-0.02	0.13		0.01	-0.01	3.98
161718	招商沪深 300 高贝塔	分级	策略	0.32	-0.02	0.01	-0.03	0.42	0.11	0.14	-0.04	2.03
001548	天弘上证 50A	普通	规模	0.32	0.01	0.01	0.00	0.38	0.29	0.29	-0.01	3.89
161910	万家中证创业成长	分级	主题	0.32	-0.09	0.00	-0.08	0.30	0.07	0.15	-0.08	-0.77
160809	长盛同辉深证 100 等权	分级	策略	0.31	-0.02	0.01	-0.03	0.31	0.03	0.04	-0.01	2.07
164811	工银瑞信深证 100	分级	规模	0.31	-0.03	0.01	-0.04	0.25	0.04	0.06	-0.02	3.30
519034	海富通中证低碳	普通	主题	0.30	-0.01	0.01	-0.02	0.21	0.02	0.03	-0.01	3.32
162010	长城久兆中小板 300	分级	规模	0.30	-0.02	0.00	-0.01	0.27	0.23	0.24	-0.01	-1.51
164815	工银瑞信标普全球资源	LOF	QDII	0.30	-0.03	0.02	-0.04	0.36	0.05	0.10	-0.05	5.60
502040	长盛上证 50	分级	规模	0.30	0.04	0.01	0.03	0.33	0.33	0.30	0.03	2.51
167601	国金沪深 300	分级	规模	0.29	0.00	0.01	-0.01	0.34	0.03	0.04	-0.02	4.59
160415	华安深证 300	LOF	规模	0.29	0.00	0.01	-0.01	0.23	0.03	0.03	-0.01	1.80
512610	嘉实中证医药卫生 ETF	ETF	行业	0.28	0.01	0.02	-0.01	0.20	0.03	0.03	-0.01	7.52
163209	诺安中证创业成长	分级	主题	0.28	0.00	0.00	0.00	0.24	0.03	0.02	0.00	-1.00
160417	华安沪深 300	分级	规模	0.28	0.07	0.01	0.07	0.24	0.14	0.08	0.05	3.87
510220	华泰柏瑞上证中小盘 ETF	ETF	规模	0.28	0.01	0.01	0.00	0.07			0.00	4.23
159927	鹏华沪深 300ETF	ETF	规模	0.27	0.01	0.01	0.00	0.08	0.20	0.20	0.00	3.68

附表 1：指数基金列表（规模单位：亿元；申赎份额单位：亿份；净值增长率单位：%）

基金代码	证券简称	产品形式	标的指数类型	期末规模	规模变化	规模变化原因		份额	申购份额	赎回份额	净申赎份额	净值增长率
						净值变化	申赎					
159941	广发纳斯达克 100ETF	ETF	QDII	0.25	-0.05	0.03	-0.08	0.23		0.08	-0.08	11.78
001599	天弘中证高端装备制造 A	普通	主题	0.25	0.05	0.00	0.04	0.28	0.21	0.16	0.05	0.74
502020	国金上证 50	分级	规模	0.25	-0.01	0.01	-0.02	0.22	0.02	0.03	-0.02	3.93
001560	天弘中证移动互联网 A	普通	主题	0.25	0.00	0.00	0.01	0.38	0.28	0.27	0.01	-2.38
510270	中银上证国企 ETF	ETF	主题	0.25	0.01	0.01	0.00	0.26	0.02	0.02	0.00	4.03
001590	天弘中证环保产业 A	普通	行业	0.24	0.02	0.00	0.01	0.29	0.14	0.13	0.01	2.68
001556	天弘中证全指房地产 A	普通	行业	0.23	0.09	0.01	0.08	0.29	0.57	0.48	0.10	10.46
160808	长盛同瑞中证 200	分级	规模	0.22	0.04	0.01	0.03	0.22	0.07	0.05	0.03	3.54
519981	长信标普 100 等权重	普通	QDII	0.22	0.03	0.01	0.02	0.20	0.04	0.02	0.02	3.07
161630	融通中证大农业	分级	主题	0.22	0.22	0.00	0.22	0.22	0.00	0.03	-0.03	-2.25
162510	国联安双力中小板	LOF	规模	0.21	-13.77	0.02	-13.79	0.20	0.10	13.38	-13.28	3.76
118002	易方达标普消费品人民币	普通	QDII	0.19	0.01	0.01	-0.01	0.14	0.03	0.03	-0.01	7.15
370023	上投摩根中证消费	普通	主题	0.19	0.01	0.00	0.01	0.15	0.04	0.03	0.01	1.84
001594	天弘中证银行 A	普通	行业	0.18	0.01	0.00	0.01	0.20	0.20	0.20	0.01	4.30
159921	诺安中小板等权 ETF	ETF	策略	0.18	-0.03	0.00	-0.03	0.11		0.02	-0.02	-1.05
165707	诺德深证 300 分级	分级	规模	0.16	0.02	0.00	0.02	0.15	0.07	0.05	0.02	0.87
000834	大成纳斯达克 100	普通	QDII	0.14	0.03	0.01	0.02	0.12	0.05	0.04	0.01	9.33
001558	天弘中证大宗商品 A	普通	行业	0.14	0.01	0.00	0.00	0.19	0.15	0.14	0.00	3.60
001586	天弘中证 100A	普通	规模	0.14	0.00	0.00	-0.01	0.16	0.06	0.07	-0.01	4.51
502016	长信一带一路	分级	主题	0.13	-0.08	0.01	-0.09	0.13	0.05	0.15	-0.09	3.50
165806	东吴深证 100	LOF	规模	0.13	0.01	0.00	0.00	0.11	0.00	0.00	0.00	3.63
001611	天弘中证休闲娱乐 A	普通	主题	0.13	0.00	0.00	0.00	0.18	0.14	0.14	0.00	-0.89
001617	天弘中证电子 A	普通	行业	0.13	0.00	0.00	0.00	0.14	0.12	0.11	0.01	-1.36
165525	信诚中证建筑工程	LOF	行业	0.13	0.13	0.02	0.01	0.12	0.09	0.29	-0.20	5.43
512600	嘉实中证主要消费 ETF	ETF	行业	0.12	-0.01	0.00	-0.01	0.08		0.01	-0.01	1.60
000062	银华量化智慧动力	普通	策略	0.12	-0.01	0.00	-0.01	0.09	0.32	0.33	-0.01	0.72
003016	中金中证 500	普通	规模	0.10	0.10							
003015	中金沪深 300	普通	规模	0.10	0.10							
001588	天弘中证 800A	普通	规模	0.10	0.00	0.00	0.00	0.12	0.02	0.02	0.00	3.82
002310	创金合信沪深 300A	普通	规模	0.10	0.01	0.00	0.00	0.10	0.00	0.00	0.00	6.27
002311	创金合信中证 500A	普通	规模	0.09	0.01	0.00	0.00	0.10	0.00	0.00	0.00	6.95
159930	汇添富中证能源 ETF	ETF	行业	0.09	-0.01	0.01	-0.02	0.11		0.03	-0.03	4.73
501002	长信中证能源互联网	LOF	主题	0.08	-0.14	0.00	-0.14	0.08	0.00	0.14	-0.13	-1.41
410010	华富中小板	普通	规模	0.07	0.00	0.00	0.00	0.05	0.02	0.02	0.00	-3.36
510580	易方达中证 500ETF	ETF	规模	0.07	0.00	0.00	0.00	0.01			0.00	1.48
510680	万家上证 50ETF	ETF	规模	0.06	0.00	0.00	-0.01	0.03		0.00	0.00	2.22
000060	国联安中证股债动态	普通	策略	0.03	0.00	0.00	0.00	0.03	0.00	0.01	0.00	-0.63

资料来源：申万宏源研究

信息披露

证券分析师承诺

本报告署名分析师具有中国证券业协会授予的证券投资咨询执业资格并注册为证券分析师，以勤勉的职业态度、专业审慎的研究方法，使用合法合规的信息，独立、客观地出具本报告，并对本报告的内容和观点负责。本人不曾因，不因，也将不会因本报告中的具体推荐意见或观点而直接或间接收到任何形式的补偿。

与公司有关的信息披露

本公司隶属于申万宏源证券有限公司。本公司经中国证券监督管理委员会核准，取得证券投资咨询业务许可，资格证书编号为：ZX0065。本公司关联机构在法律许可情况下可能持有或交易本报告提到的投资标的，还可能为或争取为这些标的提供投资银行服务。本公司在知晓范围内依法合规地履行披露义务。客户可通过 compliance@swsresearch.com 索取有关披露资料或登录 www.swsresearch.com 信息披露栏目查询从业人员资质情况、静默期安排及其他有关的信息披露。

机构销售团队联系人

上海	陈陶	021-23297221	18930809221	chentao@swsresearch.com
北京	李丹	010-66500610	18930809610	lidan@swsresearch.com
深圳	胡洁云	021-23297247	13916685683	hujy@swsresearch.com
海外	张思然	021-23297213	13636343555	zhangsr@swsresearch.com
综合	朱芳	021-23297233	18930809233	zhufang@swsresearch.com

法律声明

本报告仅供上海申银万国证券研究所有限公司（以下简称“本公司”）的客户使用。本公司不会因接收人收到本报告而视其为客户。客户应当认识到有关本报告的短信提示、电话推荐等只是研究观点的简要沟通，需以本公司 <http://www.swsresearch.com> 网站刊载的完整报告为准，本公司并接受客户的后续问询。本报告首页列示的联系人，除非另有说明，仅作为本公司就本报告与客户的联络人，承担联络工作，不从事任何证券投资咨询服务业务。

本报告是基于已公开信息撰写，但本公司不保证该等信息的准确性或完整性。本报告所载的资料、工具、意见及推测只提供给客户作参考之用，并非作为或被视为出售或购买证券或其他投资标的的邀请或向人作出邀请。本报告所载的资料、意见及推测仅反映本公司于发布本报告当日的判断，本报告所指的证券或投资标的的价格、价值及投资收入可能会波动。在不同时期，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告。

客户应当考虑到本公司可能存在可能影响本报告客观性的利益冲突，不应视本报告为作出投资决策的惟一因素。客户应自主作出投资决策并自行承担投资风险。本公司特别提示，本公司不会与任何客户以任何形式分享证券投资收益或分担证券投资损失，任何形式的分享证券投资收益或者分担证券投资损失的书面或口头承诺均为无效。本报告中所指的投资及服务可能不适合个别客户，不构成客户私人咨询建议。本公司未确保本报告充分考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。本公司建议客户应考虑本报告的任何意见或建议是否符合其特定状况，以及（若有必要）咨询独立投资顾问。在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何损失负任何责任。市场有风险，投资需谨慎。若本报告的接收人非本公司的客户，应在基于本报告作出任何投资决定或就本报告要求任何解释前咨询独立投资顾问。

本报告的版权归本公司所有，属于非公开资料。本公司对本报告保留一切权利。除非另有书面显示，否则本报告中的所有材料的版权均属本公司。未经本公司事先书面授权，本报告的任何部分均不得以任何方式制作任何形式的拷贝、复印件或复制品，或再次分发给任何其他人，或以任何侵犯本公司版权的其他方式使用。所有本报告中使用的商标、服务标记及标记均为本公司的商标、服务标记及标记。