

中国证券投资基金2012年上半年行业统计报告(一)

中国银河证券基金研究中心

出了一系列的产品及服务。

没有列示出来。中国银河证券基金研究评价资讯系统记录了自1998年以来基金行业主要的公开数据。

“有效管理”指标是指从基金资产管理费率收入角度出发,根据基金资产管理费率和基准管理费率的对比对资产净值和份额规模进行折算。例如:货币市场基金管理费率是0.33%,基准管理费率为0.33%,则1个货币市场基金相当于0.22个股票基金。“有效托管”指标是指从托管银行托管费收入角度出发,根据基金托管费率和基准托管费率的对比对资产净值和份额规模进行折算。例如:货币市场基金管理费率是0.1%,基准托管费率取股票基金托管费率0.25%,则1个货币市场基金相当于0.4个股票基金。联接基金按照基金资产净值的10%计算有效资产净值和有效份额规模。

券基金研究中心的业务规则和基金基础信息维护机制,截至2012年6月30日,中国银河证券基金研究评价资讯系统记录的正式运作的证券投资基金共有1254只,系统采集到的基金资产净值和份额规模数据的基金数量是1154只,其中按照证监会主代码口径则是1026只。为避免重复计算,有100只基金没有计算其规模数据,它们全部是分级基金的子基金。因此,这次基金资产净值和份额规模统计,覆盖到我国现有的全部基金,无一遗漏。

亿元和1450.89亿份。各个类型基金规模增长情况如下:按照银河证券一级分类:股票基金数量增加60只,资产净值增加726.41亿元,份额规模增加87.79亿份;混合基金数量增加12只,资产净值减少13.45亿元,份额规模减少264.70亿份;债券基金数量增加36只,资产净值增加790.91亿元,份额规模增加904.34亿份;货币市场基金数量增加6只,资产净值增加652.57亿元,份额规模增加652.57亿份;QDII基金数量增加8只,资产净值减少0.75亿元,份额规模减少20.15亿份;封闭式股票基金数量减少1只,资产净值减少90.65亿元,份额规模减少146.87亿份;封闭式债券基金数量增加14只,资产净值增加272.89亿元,份额规模增加237.89亿份。

中国银河证券基金研究评价业务发布网址: <http://fund.chinastock.com.cn>

二、统计说明

1、从2004年7月开始,中国证监会要求基金管理公司披露半年度、年度的基金资产净值报表,该报表未经审计,披露对象是截至当年6月30日和12月31日的所有基金。截至2012年7月2日,采集到了全部基金的资产净值数据,形成《中国证券投资基金2012年上半年行业统计报告》(第1版)。2012年7月下旬我们结合基金2012年第二季度季报数据增加一些数据和分析,并公布本报告的2版。2012年9月,结合基金2012半年报,再次增加一些数据和分析,并公布本报告的3版。由于负面限制,公布报告的简要版,更多的行业统计报表我们

2、统计指标说明。我们根据2012年6月30日时点的份额净值和资产净值两个数据计算了份额规模数据,因此本报告的资产净值数据是基金资产管理公司信息披露数据,份额规模数据是基金研究中心的计算数据,有些许误差。在2012年第二季度季报披露后,对这些数据我们会做覆盖性更新。在基金资产管理公司管理规模评价上,在基金资产净值和基金份额规模的基础上,增加了“有效管理基金资产净值”和“有效管理基金份额规模”两个规模评价指标。在托管银行托管规模评价上,在基金资产净值和基金份额规模的基础上,增加了“有效托管基金资产净值”和“有效托管基金份额规模”两个规模评价指标。按照中国银河证

3、基金数量说明。按照中国银河证

基金行业资产净值和份额规模分类汇总表(行业规模榜单)

序号	运作方式	数据截止日期	证监会主代码口径基金数量(只)	基金资产净值合计(亿元)	占比(和全部基金资产净值比较)(%)	基金份额规模(亿份)	占比(和全部基金份额规模比较)(%)	有效管理资产净值(亿元)	有效管理基金份额规模(亿份)	有效托管资产净值(亿元)	有效托管基金份额规模(亿份)	数据截止日期	证监会主代码口径基金数量(只)	基金资产净值合计(亿元)	占比(和全部基金资产净值比较)(%)	基金份额规模(亿份)	占比(和全部基金份额规模比较)(%)	有效管理资产净值(亿元)	有效管理基金份额规模(亿份)	有效托管资产净值(亿元)	有效托管基金份额规模(亿份)
1	封闭式	2012-6-30	67	1407.2	5.76%	1453.16	5.20%	984.65	1045.55	1269.23	1324.76	2011-12-31	55	1224.96	5.59%	1362.14	5.14%	955.06	1086.11	1142.64	1282.61
2	开放式	2012-6-30	959	23029.14	94.24%	26507.66	94.80%	16771.63	19224.31	18500.35	21729.36	2011-12-31	859	20693.45	94.41%	25147.8	94.86%	16013.61	19938.84	17282.68	21323.6
	合计	2012-6-30	1026	24436.34	100.00%	27960.82	100.00%	17756.28	20969.86	19769.58	23054.12	2011-12-31	914	21918.4	100.00%	26509.93	100.00%	16968.66	21024.95	18425.31	22606.22
银河证券一级分类																					
1	1 股票基金	2012-6-30	493	10955.53	44.83%	13379.05	47.85%	8873.88	10841.29	9208	11256.03	2011-12-31	433	10229.12	46.67%	13291.26	50.14%	8559.38	10999.04	8813.59	11349.94
2	2 混合基金	2012-6-30	207	5736.14	23.47%	6560.05	23.46%	5600.88	6439.85	5612.34	6448.86	2011-12-31	195	5749.59	26.23%	6824.75	25.74%	5614.9	6701.75	5626.37	6711.22
3	3 债券基金	2012-6-30	148	2160.71	8.84%	2073.94	7.42%	840.17	803.14	1500.71	1432.8	2011-12-31	129	1189.8	5.43%	1169.6	4.41%	523.76	515.96	925.8	910.72
4	5 货币市场基金	2012-6-30	52	3601.52	14.74%	3601.52	12.88%	790.78	790.78	1437.78	1437.78	2011-12-31	51	2948.95	13.45%	2948.95	11.12%	645.63	645.63	1173.87	1173.87
5	6 QDII基金	2012-6-30	59	575.24	2.35%	893.1	3.19%	665.92	1049.25	741.52	1153.89	2011-12-31	51	575.99	2.63%	913.25	3.44%	669.95	1076.47	743.05	1179.85
6	7 封闭式股票基金	2012-6-30	29	700.12	2.87%	781.6	2.80%	666.4	743.34	704.87	788.81	2011-12-31	30	790.77	3.61%	928.47	3.50%	758.91	890.2	795.29	935.68
7	9 封闭式债券基金	2012-6-30	38	707.08	2.89%	671.56	2.40%	318.25	302.21	564.36	535.95	2011-12-31	25	434.19	1.98%	433.67	1.64%	196.15	195.92	347.35	346.93
	合计	2012-6-30	1026	24436.34	100.00%	27960.82	100.00%	17756.28	20969.86	19769.58	23054.12	2011-12-31	914	21918.4	100.00%	26509.93	100.00%	16968.66	21024.95	18425.31	22606.22
银河证券二级分类																					
1	1.1.1 标准股票型基金	2012-6-30	314	7120	29.14%	8683.74	31.06%	7115.48	8673.94	7119.78	8682.78	2011-12-31	286	7119.58	32.48%	9050.83	34.14%	7115.12	9040.62	7119.16	9049.63
2	1.1.2 普通股票型基金	2012-6-30	6	125.37	0.51%	125.03	0.44%	125.37	122.03	125.37	122.03	2011-12-31	6	122.81	0.56%	129.03	0.49%	122.81	129.03	122.81	129.03
3	1.2.1 标准指数型股票基金	2012-6-30	149	3087.15	12.63%	3774.47	13.50%	181.44	1459.87	1463.66	1425.91	2011-12-31	120	2397.92	10.94%	3204.86	12.47%	891.46	1234.05	1100.12	1522.27
4	1.2.2 增强指数型股票基金	2012-6-30	24	623.01	2.53%	798.81	2.86%	451.6	585.44	496.95	638.7	2011-12-31	21	588.81	2.69%	806.53	3.04%	429.98	595.34	471.5	647.01
5	2.1.1 偏股型基金(股票上限95%)	2012-6-30	43	1915.74	7.84%	2102.89	7.52%	1915.74	2102.89	1913.41	2100.3	2011-12-31	43	1905.23	8.69%	2184.92	8.24%	1905.23	2184.92	1902.87	2182.28
6	2.1.2 偏股型基金(股票上限80%)	2012-6-30	30	1238.37	5.07%	1712.84	6.13%	1238.37	1712.84	1233.46	1706.39	2011-12-31	30	1249.3	5.70%	1779.92	6.71%	1249.3	1779.92	1244.3	1773.08
7	2.2.1 灵活配置型基金(股票上限95%)	2012-6-30	12	693.19	2.84%	728.3	2.60%	693.19	728.3	693.19	728.3	2011-12-31	12	683.77	3.12%	748.63	2.82%	683.77	748.63	683.77	748.63
8	2.2.2 灵活配置型基金(股票上限80%)	2012-6-30	68	721.43	2.95%	861.59	3.08%	706.31	845.79	716.2	855.44	2011-12-31	61	754.03	3.44%	924.6	3.49%	737.49	906.85	747.39	916.87
9	2.3.1 股债平衡型基金	2012-6-30	14	313.86	1.28%	354.77	1.27%	313.86	354.77	313.86	354.77	2011-12-31	14	313.09	1.44%	376.47	1.42%	314.4	375.02	315.09	376.47
10	2.4.1 偏债型基金	2012-6-30	7	68.6	0.28%	64.22	0.23%	51.64	49.35	62.72	59.29	2011-12-31	7	69.25	0.32%	67.05	0.25%	51.69	50.97	63.07	61.87
11	2.5.1 保本型基金	2012-6-30	27	527.21	2.16%	455.32	1.63%	424.57	366.96	421.77	364.25	2011-12-31	22	515.12	2.35%	454.25	1.71%	415.22	366.53	412.1	363.4
12	2.9.1 特定策略混合型基金	2012-6-30	6	257.74	1.05%	280.12	1.00%	257.74	280.12	257.74	280.12	2011-12-31	6	257.79	1.18%	288.91	1.07%	257.79	288.91	257.79	288.91
13	3.1.1 长期标准债券型基金	2012-6-30	6	173.58	0.71%	163.7	0.59%	71.63	67.55	136.26	128.67	2011-12-31	5	50.85	0.23%	47.61	0.18%	20.98	19.68	38.52	36.18
14	3.1.2 中短期标准债券型基金	2012-6-30	2	23.2	0.09%	22.77	0.08%	6.55	6.42	13.52	13.24	2011-12-31	2	9.78	0.04%	9.71	0.04%	2.8	2.78	5.79	5.75
15	3.2.1 普通债券型基金(一级)	2012-6-30	57	796.38	3.26%	742.27	2.65%	345.31	321.78	634.92	591.88	2011-12-31	53	550.25	2.51%	530.07	2.00%	236.79	227.78	438.46	422.46
16	3.2.2 普通债券型基金(二级)	2012-6-30	64	864.74	3.53%	838.48	3.00%	538.48	257.08	446.66	425.91	2011-12-31	59	441.57	2.01%	438.75	1.66%	202.36	201.08	342.14	339.86
17	3.3.1 可转换债券型基金	2012-6-30	10	134.74	0.55%	140.69	0.50%	69.86	72.93	109.62	114.5	2011-12-31	8	94.98	0.43%	102.93	0.39%	51.19	55.42	77.84	84.41
18	3.4.1 指数型债券型基金	2012-6-30	3	50.42	0.21%	48.39	0.17%	12.95	12.52	25.42	24.28	2011-12-31	2	42.37	0.19%	40.53	0.15%	9.65	9.23	23.05	22.05
19	3.6.1 短期理财债券型基金	2012-6-30	6	417.65	1.71%	417.65	1.49%	76.8	76.8	134.31	134.31	2011-12-31	6	417.65	1.94%	417.65	1.58%	76.8	76.8	134.31	134.31
20	5.1.1 货币市场基金(A类)	2012-6-30	52	2081.72	8.52%	2081.72	7.45%	457.98	457.98	832.69	832.69	2011-12-31	51	1802.47	8.22%	1802.47	6.80%	396.54	396.54	720.99	720.99
21	5.2.1 货币市场基金(B类)	2012-6-30	7	1519.79	6.22%	1519.79	5.44%	332.8	332.8	605.1	605.1	2011-12-31	17	1146.47	5.23%	1146.47	4.32%	249.08	249.08	452.88	452.88
22	6.1.1 QDII全球股票基金	2012-6-30	20	297.28	1.22%	421.05	1.51%	361.86	513.93	390.85	529.96	2011-12-31	17	301.21	1.37%	433.66	1.64%	365.62	528.47	395.92	506.04
23	6.1.2 QDII亚太股票基金	2012-6-30	7	110.59	0.45%	213.99	0.77%	132.52	256.54	154.82	299.59	2011-12-31	6	112.69	0.51%	219.56	0.83%	135.03	263.21	157.76	307.38
24	6.1.3 QDII新兴市场股票基金	2012-6-30	4	3.39	0.01%	3.96	0.01%	4.04	4.73	4.61	5.38	2011-12-31	4	3.38	0.02%	4.11	0.02%	4.03	4.9	4.59	5.88
25	6.1.4 QDII成熟市场股票基金	2012-6-30	3	2.02	0.01%	2.15	0.01%	1.79	1.89	2.37	2.52	2011-12-31	3	4.82	0.02%	4.95	0.02%	4.45	4.57	5.7	5.85
26	6.1.5 QDII大中华股票基金	2012-6-30	7	105.96	0.43%	193.23	0.69%	126.11	230.7	127.8	232.49	2011-12-31	7	105.2	0.48%	198.94	0.75%	125.2	237.58	126.92	239.39
27	6.1.8 QDII指数股票基金	2012-6-30	11	23.47	0.10%	25.21	0.09%	14.8	15.74	25.74	27.51	2011-12-31	8	12.89	0.06%	15.15	0.06%	7.26	8.46	13.2	15.47
28	6.3.1 QDII债券基金	2012-6-30	1	1.38	0.01%	1.43	0.01%	0.83	0.86	1.22	1.26	2011-12-31	1	1.6	0.01%	1.68	0.01%	0.96	1.01	1.41	1.47
29	6.4.1 QDII货币基金	2012-6-30	6	31.32	0.13%	32.08	0.11%	23.97	24.86	34.09	35.18	2011-12-31	5	34.2	0.16%	35.19	0.13%	27.43	28.28	37.55	38.68
30	7.1.1 封闭式标准股票型基金	2012-6-30	4	125																	