

# 中国证券投资基金2013年行业统计报告(一)

中国银河证券基金研究中心 (www.yhzqjj.com)

一、业务资质说明

根据中国证券业协会2010年5月18日发布的《关于公布第一批具备协会会员资格基金评价机构名单的通知》(中证协发[2010]65号文),中国银河证券股份有限公司成为第一批具备协会会员资格的基金评价机构。根据中国证券业协会2010年5月18日发布的《关于同意银河证券基金评价业务备案申请的通知》(中证协发[2010]69号文),同意中国银河证券股份有限公司基金评价业务备案申请,其基金评价业务范围为:基金及基金管理人评级、单一指标排名。目前中国银河证券基金研究中心开展了基金研究、基金评价与

基金咨询三大业务,各自推出了一系列的产品及服务。中国银河证券基金研究评价业务发布网址:www.yhzqjj.com

二、统计说明

1、从2004年7月开始,中国证监会要求基金管理人披露半年度、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6月30日和12月31日的所有基金。截至2014年1月2日,我们采集到了全部基金的资产净值数据。我们加强了对基础数据的核实,统计范围覆盖基金全域。以基础数据为核心,汇总数据为主体,顺序递进,环环相扣,对基金不同信息披露环节中的数据进行必要的勾稽校核,从而形成《中国证劵投

资基金2013年行业统计报告》(第1版)。由于版面限制,公布报告的简年版,更多的行业统计报表我们没有列示出来。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。

2、统计指标说明。我们根据2013年12月31日时点的单位份额净值和资产净值两个数据计算了份额规模数据和,因此本报告的资产净值数据是基金管理人信息披露数据,份额规模数据是中国银河证券基金研究中心的计算数据,有些许误差。在2013年第四季度季报和2013年年报披露后,我们会对这些数据做覆盖性更新。在基金行业规模统计上我们引入4个口径的数据榜单。榜单1是资产净值口径,按照每一只基金披露的资产净值数据进行汇总计算。榜单2是剔除联接基金重复口径,由于联接基金合同明确90%以上的基金资产投向对应的ETF基金,存在重复计算的问题,我们统一按照90%的比例予以剔除,只保留计算10%的资产净值。榜单3是剔除联接基金重复、货币与短期理财债券基金口径,在榜单2的基础上剔除了货币基金和短期理财债券基金规模。榜单4是有效资产净值口径,我们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。在托管人托管规模评价上,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。“有效管理”指标是指从基金管理人管理费收入角度出发,根据基金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%,基准管理费率取股票基金管理费率1.5%,则1个货币市场基金相当于0.22个股票基金。“有效托管”指标是指从托管人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:货币市场基金托管费率是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。

3、基金数量说明。按照中国银河证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2013年12月31日,中国银河证券基金研究评价资讯系统采集到披露基金资产净值和份额规模数据的基金数量是1899只,证监会主代码口径基金1552只(A、B类基金和分级基金合并计算)。此次基金资产净值和份额规模统计,我们覆盖到我国现有的全部基金,无一遗漏。

## 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	2013年12月31日										2012年12月31日									
		证监会主代码	基金资产净值合计(亿元)	全部基金资产净值占比	基金份额规模(亿份)	全部基金份额规模占比	有效管理资产净值(亿元)	有效管理份额规模(亿份)	有效托管资产净值(亿元)	有效托管份额规模(亿份)	证监会主代码	基金资产净值合计(亿元)	全部基金资产净值占比	基金份额规模(亿份)	全部基金份额规模占比	有效管理资产净值(亿元)	有效管理份额规模(亿份)	有效托管资产净值(亿元)	有效托管份额规模(亿份)	证监会主代码	基金资产净值合计(亿元)
1	封闭式	76	1267.96	4.22%	1244.6	3.99%	842.68	821.09	1100.26	1077.08	68	1361.92	4.75%	1373.33	4.33%	921.18	950.75	1195.25	1214.45		
2	开放式	1476	28756.28	95.78%	29936.2	96.01%	17914.37	18993.99	20608.59	21718.83	1106	27301.87	95.25%	30336.76	95.67%	17683.25	20527.62	20206.88	23089.96		
合计		1552	30024.24	100.00%	31180.8	100.00%	18757.05	19815.08	21708.85	22795.91	1174	28663.78	100.00%	31710.09	100.00%	18604.43	21478.38	21402.13	24304.41		
银河证券一级分类																					
1	1 股票基金	610	10925.16	36.39%	11681.33	37.46%	8691.09	9253.91	8965.9	9556.69	533	11458.84	39.98%	13479.48	42.51%	8878.98	10590.77	9232.03	10993.97		
2	2 混合基金	289	5721.63	19.06%	6019.99	19.31%	5564.62	5878.73	5933.62	5905.39	221	5681.58	19.82%	6338.66	20.62%	5533.39	6408.41	5543.18	6415.85		
3	3 债券基金	396	4039.96	13.46%	3990.36	12.80%	1419.76	1404.27	2524	2496.98	223	3806.62	13.28%	5720.56	11.73%	1303.13	1266.1	2351.25	2283.53		
4	4 其他基金	4	5.59	0.02%	3.29	0.01%	1.48	0.66	1.77	0.79	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
5	5 货币市场基金	94	7475.92	24.90%	7470.52	23.96%	1581.35	1580.27	2783.25	2781.31	62	5722.4	19.96%	5722.4	18.05%	1255.93	1255.93	2285.25	2285.25		
6	6 QDII基金	83	588.02	1.96%	77.07	2.47%	656.08	87.16	740.04	977.68	67	632.43	2.21%	875.65	2.76%	711.82	1006.41	795.17	1111.37		
7	7 封闭式股票基金	20	586.37	1.95%	572.88	1.84%	538.42	521.44	559	543.73	27	675.89	2.36%	724.33	2.28%	613	659.12	647.77	696.54		
8	8 封闭式债券基金	56	681.59	2.27%	671.72	2.15%	304.26	299.65	541.26	533.35	41	686.02	2.39%	649	2.05%	308.18	291.63	547.48	517.91		
合计		1552	30024.24	100.00%	31180.8	100.00%	18757.05	19815.08	21708.85	22795.91	1174	28663.78	100.00%	31710.09	100.00%	18604.43	21478.38	21402.13	24304.41		

银河证券二级分类																				
1	1.1 股票型基金	368	7343.42	24.46%	7733.79	24.80%	7328.29	7714.28	7342.42	7731.28	340	7177.89	25.04%	8647.63	27.27%	7168.89	8633.85	7177.26	8646.06	
2	1.2 指数股票型基金	242	3581.75	11.93%	3947.54	12.66%	1362.79	1539.63	1623.49	1825.41	193	4280.94	14.94%	4831.86	15.24%	1710.09	1956.92	2054.77	2347.91	
3	2.1 偏股型基金	74	2846.52	9.48%	3229.89	10.36%	2846.52	3229.89	2841.5	3224.12	73	3046.04	10.63%	3750.07	11.83%	3046.04	3750.07	3039.29	3741.42	
4	2.2 灵活配置型基金	126	1619.42	5.39%	1604.16	5.14%	1591.77	1577.32	1618.32	1603.06	84	1358.68	4.74%	1532.7	4.83%	1348.68	1522.99	1358.68	1532.7	
5	2.3 债券平衡型基金	16	298.82	1.00%	310.23	0.99%	297.25	308.24	298.82	310.23	14	305.64	1.07%	347.46	1.10%	305.09	346.31	305.64	347.46	
6	2.4 偏债型基金	8	78.47	0.26%	76.58	0.25%	61.88	62.34	72.86	71.98	7	61.38	0.21%	59.69	0.19%	47.36	47.28	56.57	55.66	
7	2.5 保本型基金	55	580.66	1.93%	515.14	1.65%	471.37	418.83	465.13	412.73	35	637.62	2.22%	554.04	1.75%	515.29	448.33	511.42	494.57	
8	2.9 特定策略混合型基金	10	297.73	0.99%	283.99	0.91%	295.82	282.11	296.99	283.27	8	272.22	0.95%	294.71	0.93%	270.99	293.43	271.58	294.07	
9	3.1 标准债券型基金	127	1277.35	4.25%	1278.99	4.10%	566.72	567.62	1010.25	1011.85	36	915.7	3.19%	903.23	2.85%	384.42	379.22	723.14	713.41	
10	3.2 普通债券型基金	184	1250.96	4.17%	1222.64	3.92%	545.34	532.45	975.67	953.13	138	1380.18	4.82%	1305.62	4.12%	612.79	579.84	1094.04	1034.74	
11	3.3 可转换债券型基金	13	75.05	0.25%	82.96	0.27%	37.23	41.01	60.7	67.05	10	74.57	0.26%	77.54	0.24%	38.96	40.49	61.01	64.16	
12	3.4 指数债券型基金	17	90.09	0.30%	59.36	0.19%	21.53	14.29	40.19	27.67	6	83.16	0.29%	81.17	0.26%	22.29	21.87	39.3	38.18	
13	3.5 债券型分级子基金	1	20.43	0.07%	20.33	0.07%	9.53	9.49	16.35	16.26	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
14	3.6 短期理财债券型基金	54	1326.08	4.42%	1326.08	4.25%	239.41	239.41	420.84	420.84	33	1353.01	4.72%	1353.01	4.27%	244.67	244.67	433.75	433.75	
15	4.1 其他基金	4	5.59	0.02%	3.29	0.01%	1.48	0.66	1.77	0.79	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
16	5.1 货币市场基金(A类)	94	5002.31	16.66%	4996.91	16.03%	1047.22	1046.14	1803.32	1801.37	62	2928.77	10.22%	2928.77	9.24%	643.04	643.04	1169.38	1169.38	
17	5.2 货币市场基金(B类)	—	2473.61	8.24%	2473.61	7.93%	534.13	534.13	979.93	979.93	—	2793.63	9.75%	2793.63	8.81%	612.89	612.89	1115.87	1115.87	
18	6.1 QDII股票基金	69	533.35	1.78%	709.42	2.28%	618.14	832.9	682.12	912.43	59	583.38	2.04%	825.87	2.60%	679.69	973.39	746.08	1061.43	
19	6.2 QDII混合基金	1	4.37	0.01%	4.5	0.01%	5.24	5.4	6.12	6.3	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
20	6.3 QDII债券基金	7	34.16	0.11%	33.37	0.11%	20.49	20.05	34.27	33.49	2	20.85	0.07%	20.8	0.07%	10.53	10.5	18.35	18.31	
21	6.4 QDII商品基金	6	16.14	0.05%	23.4	0.08%	12.21	17.81	17.54	25.46	6	28.21	0.10%	28.97	0.09%	21.6	22.31	30.74	31.63	
22	7.1 封闭式股票型基金	19	517.94	1.73%	500	1.60%	504.2	485	517.94	500	26	605.6	2.11%	654.87	2.07%	577.85	624.39	605.6	654.87	
23	7.2 封闭式债券型基金	1	68.43	0.23%	72.88	0.23%	34.22	36.44	41.06	43.73	1	70.29	0.25%	69.46	0.22%	35.15	34.73	42.18	41.68	
24	9.1 封闭式标准债券型基金	21	286.73	0.95%	289.17	0.93%	129.12	130.33	225.37	227.31	7	146.48	0.51%	143.15	0.45%	64.69	63.18	115.84	113.23	
25	9.2 封闭式普通债券型基金	35	394.86	1.32%	382.55	1.23%	175.14	169.32	315.89	306.04	34	539.54	1.88%	505.85	1.60%	243.49	228.46	431.63	404.68	

银河证券三级分类																					
1	1.1.1 标准股票型基金	362	7213.7	24.03%	7616.39	24.43%	7198.57	7596.87	7212.7	7613.88	334	7052.85	24.61%	8526.27	26.89%	7043.85	8512.5	7052.22	8524.71		
2	1.1.2 普通股票型基金	6	129.72	0.43%	117.4	0.38%	129.72	117.4	129.72	117.4	6	125.04	0.44%	121.36	0.38%	125.04	121.36	125.04	121.36		
3	1.2.1 标准指数股票型基金	158	2303.72	7.67%	2171.83	6.97%	975.36	1002.3	1189.59	1227.09	125	2824.59	9.85%	2883.79	9.09%	1195.56	1288.57	1486.06	1610.07		
4	1.2.2 增强指数股票型基金	35	499.9	1.67%	688.17	2.21%	364.7	500.29	402.68	554.69	26	676.9	2.36%	872.24	2.75%	488.57	632.49	537.6	694.89		
5	1.2.3 ETF联接基金	49	778.12	2.59%	1087.54	3.49%	26	36.34	31.23	43.63	42	779.45	2.72%	1075.82	3.39%	25.97	35.86	31.11	42.95		
6	2.1.1 偏股型基金(股票上限95%)	43	1775.26	5.91%	1793.21	5.75%	1775.26	1793.21	1773.32	1791.32	43	1849.96	6.45%	2041.6	6.44%	1849.96	2041.6	1847.77	2039.05		
7	2.1.2 偏股型基金(股票上限80%)	31	1071.26	3.57%	1436.68	4.61%	1071.26	1436.68	1068.18	1432.81	30	1196.08	4.17%	1708.47	5.39%	1196.08	1708.47	1191.52	1702.37		
8	2.2.1 灵活配置型基金(股票上限95%)	53	982.74	3.27%	932.9	2.99%	962.85	912.93	981.63	931.8	13	671.08	2.34%	705.67	2.23%	671.08	705.67	671.08	705.67		
9	2.2.2 灵活配置型基金(股票上限80%)	73	636.69	2.12%	671.26	2.15%	628.92	664.39	636.69	671.26	71	687.6	2.40%	827.03	2.61%	677.6	817.31	687.6	827.03		

## 基金托管人托管基金资产净值和份额规模汇总统计表(榜单1)(资产净值口径)

序号	托管人简称	托管资格批复日期	数据截止日期	托管基金数量(只)(证监会主代码口径)	托管基金资产净值(亿元)	托管基金资产净值市场占比	托管基金资产净值排名	托管基金份额规模(亿份)	托管基金份额规模市场占比	托管基金份额规模排名
1	工商银行	1998-2-24	2013-12-31	385	8632.87	28.75%	1/19	8951.47	28.71%	1/19
2	建设银行	1998-3-18	2013-12-31	369	6294.7	20.97%	2/19	6305.15	20.22%	2/19
3	中国银行	1998-7-7	2013-12-31	247	4578.38	15.25%	3/19	4829.92	15.49%	3/19
4	农业银行	1998-5-29	2013-12-31	189	2960	9.86%	4/19	3095.65	9.93%	4/19
5	中信银行	2004-8-18	2013-12-31	31	2125.71	7.08%	5/19	2133.9	6.84%	6/19
6	交通银行	1998-7-3	2013-12-31	101	1930.46	6.43%	6/19	2253.38	7.23%	5/19
7	招商银行	2002-11-6	2013-12-31	71	1268.74	4.23%	7/19	1286.24	4.13%	7/19
8	民生银行	2004-7-9	2013-12-31	28	571.06	1.90%	8/19	623.47	2.00%	8/19
9	光大银行	2002-10-23	2013-12-31	25	498.41	1.66%	9/19	534.17	1.71%	9/19
10	兴业银行	2005-4-26	2013-12-31	22	370.81	1.24%	10/19	350.78	1.13%	10/19
11	浦发银行	2003-9-10	2013-12-31	17	287.98	0.96%	11/19	300.76	0.96%	11/19
12	华夏银行	2005-2-23	2013-12-31	12	175.97	0.59%	12/19	197.93	0.63%	12/19
13	邮政储蓄银行	2009-7-16	2013-12-31	21	117.55	0.39%	13/19	107.71	0.35%	13/19
14	北京银行	2008-6-3	2013-12-31	6	73.71	0.25%	14/19	73.06	0.23%	14/19
15	广东发展银行	2009-5-4	2013-12-31	12	56.34	0.19%	15/19	55.74	0.18%	15/19
16	上海银行	2009-8-18	2013-12-31	8	49.42	0.16%	16/19	48.87	0.16%	16/19
17	宁波银行	2012-11-5	2013-12-31	2	19.21	0.0640%	17/19	19.2	0.0616%	17/19
18	平安银行	2008-8-6	2013-12-31	5	12.02	0.0400%	18/19	12.52	0.0402%	18/19
19	渤海银行	2010-6-29	2013-12-31	1	0.92	0.0030%	19/19	0.86	0.0028%	19/19
	合计			1552	30024.24	100.00%		31180.8	100.00%	