

中国证券投资基金2008年行业统计报告

中国银河证券基金研究中心

473只证券投资基金日前披露了截至2008年12月31日的资产净值、份额净值和份额累计净值等数据,基于此我们推出《中国证券投资基金2007年行业统计报告》。

资产净值19380.68亿元

截至2008年12月31日,473只证券投资基金资产净值合计19380.68亿元,份额规模合计25731.71亿份。其中31只封闭式基金资产净值合计685.52亿元,占全部基金资产净值的3.54%,份额规模合计768.10亿份,占全部基金份额规模的2.99%。其中442只开放式基金资产净值合计18695.15亿元,占全部基金资产净值的96.46%,份额规模合计24963.61亿份,占全部基金份额规模的97.01%。

资产净值最大的基金是工银瑞信货币市场基金,2008年12月31日资产净值375.85亿元,资产净值最小的基金是万家双引擎基金,2008年12月31日资产净值5590.70万元。份额规模最大

的基金是嘉实沪深300指数(LOF)基金,2008年12月31日份额规模385.97亿份,份额规模最小的基金是万家双引擎基金,2008年12月31日份额规模5470.89万份。

股票方向基金净值缩水16636亿元

中国银河证券基金研究评价业务规则把封闭式基金中的股票基金和开放式基金内的股票型基金、指数型基金、偏股型基金和平衡型基金定义为股票投资方向基金。

截至2008年12月31日,股票方向基金共有315只,资产净值合计12798.74亿元,占全部基金资产净值19380.68亿元的66.04%。

2008年股票方向基金的数量从264只增长到315只,资产净值从29434.97亿元减少到12798.74亿元,减少16636.23亿元,股票方向基金资产净值大幅度减少的主要原因是随着A股大幅度下跌,股票方向基金净值大幅度缩水,以及上半年基金实施了金额较大的分红,还有

部分基金的净赎回。

截至2008年12月31日,沪深A股流通市值合计44419.11亿元,按照资产净值口径统计,股票投资方向基金12798.74亿元资产净值占到A股流通市值的比例是28.81%。

固定收益方向基金净值暴增

中国银河证券基金研究评价业务规则把货币市场基金、中短债基金、债券型基金、保本基金和混合基金中的偏债型基金定义为投资于固定收益方向的基金。

截至2008年12月31日,固定收益方向基金共有146只,资产净值合计5958.78亿元,占全部基金资产净值19380.68亿元的30.75%。

总体来看,2008年固定收益方向的基金无论是数量还是资产规模都发生了质的飞跃。2008年新成立的债券型基金54只(如果基金的A、B、C类按一只基金计算的话,是36只),保本基金2只(包括由一期延续下来的国泰金鹿保本二

期)。固定收益方向基金的资产净值总额由2007年年底的2051.36亿元增长到2008年年底的5958.78亿元,增长了190%,占全部基金净值的比例也由6.26%大幅度提升至30.75%。

具体细分的话,货币市场基金和中短债基金规模增长迅猛。如果说债券型基金的资产规模扩大还需要考虑到大量新发基金的影响,那么货币市场基金和中短债基金则可以剔除这一因素的影响。2008年没有新的货币市场基金和中短债基金成立,反而有两只中短债基金转型为其他类型的基金。

截至2008年12月31日,货币市场基金共有51只,资产净值合计3891.9亿元,占全部基金资产净值19380.68亿元的20.08%。其中A类40只,资产净值合计2988.59亿元,B类11只,资产净值合计903.3亿元。中短债基金1只,资产净值合计213.46亿元。

行业集中度保持较高水平

截至2008年12月31日,共有60家

基金管理公司管理了473只证券投资基金和19380.68亿元的基金资产。其中华夏基金管理公司管理21只基金,管理基金资产净值合计1888.62亿元,名列60家基金管理公司第一名,市场份额占比为9.74%。前10大基金管理公司管理了975.15亿元的基金资产,占全部基金管理公司的50.44%,说明基金管理公司的集中度仍然保持较高水平,且较2007年12月31日的49.79%有所提高,超过50%。华夏基金管理公司比第二名的嘉实基金管理公司高出513.56亿元,较上期优势依然明显,但差距缩小。

截至2008年12月31日,共有12家托管银行托管了473只基金和19380.68亿元的基金资产。工商银行托管了112只基金,托管基金资产净值5280.79亿元,名列12家托管银行第一,市场占比为27.25%。工、建、中、农、交5大国有商业银行托管了17563.85亿元的基金资产,占全部基金资产的90.64%,继续保持领先优势。

2008年12月31日基金资产净值和份额规模汇总表

2008年12月31日基金资产净值和份额规模汇总表					
基金类别	统计数量(只)	资产净值(亿元)	资产净值比例(%)	份额规模(亿份)	份额规模比例(%)
全部	473	19380.68	100	25731.71	100
封闭式	31	685.52	3.54	768.1	2.99
开放式	442	18695.15	96.46	24963.61	97.01
股票型基金	164	7254.31	37.43	10589.34	41.15
指数型基金	19	984.85	5.08	1575.1	6.12
偏股型基金	59	2703.16	13.95	4110.54	15.97
平衡型基金	42	1191.63	6.15	1583.61	6.15
偏债型基金	8	82.22	0.42	114.98	0.45
债券型基金	81	1623.94	8.38	1493.18	5.8
中短债型基金	1	213.46	1.1	209.62	0.81
保本型基金	5	147.27	0.76	121.23	0.47
特殊策略基金	3	86.33	0.45	180.96	0.7
QDII基金	9	516.08	2.66	1093.15	4.25
货币市场基金(A级)	40	2988.59	15.42	2988.59	11.61
货币市场基金(B级)	11	903.3	4.66	903.3	3.51

2008年6月30日基金资产净值和份额规模汇总表

2008年6月30日基金资产净值和份额规模汇总表					
基金类别	统计数量(只)	资产净值(亿元)	资产净值比例(%)	份额规模(亿份)	份额规模比例(%)
全部	415	20867	100	22853.27	100
封闭式	33	850.62	4.08	769.17	3.37
开放式	382	20016.38	95.92	22084.1	96.63
股票型基金	146	9988.92	47.87	10957.9	47.95
指数型基金	17	1305.55	6.26	1392.74	6.09
偏股型基金	59	3730.05	17.88	4270.05	18.68
平衡型基金	32	1529.49	7.33	1639.87	7.18
偏债型基金	8	104.32	0.5	123.46	0.54
债券型基金	54	1154.52	5.53	1096.3	4.8
中短债型基金	1	21.68	0.1	21.67	0.09
保本型基金	4	129.95	0.62	107.86	0.47
特殊策略基金	2	115.42	0.55	185.44	0.81
QDII基金	8	815.55	3.91	1167.87	5.11
货币市场基金(A级)	40	935.2	4.48	935.2	4.09
货币市场基金(B级)	11	185.73	0.89	185.73	0.81

2007年12月31日基金资产净值和份额规模汇总表

2007年12月31日基金资产净值和份额规模汇总表					
基金类别	统计数量(只)	资产净值(亿元)	资产净值比例(%)	份额规模(亿份)	份额规模比例(%)
全部	363	32755.9	100	22330.3	100
封闭式	34	2321.44	7.09	735.74	3.29
开放式	329	30434.46	92.91	21594.56	96.71
股票型基金	130	16564.94	50.57	11002.04	49.27
指数型基金	17	2056.37	6.28	1248.68	5.59
偏股型基金	58	6238.41	19.05	4456.5	19.96
平衡型基金	25	2253.81	6.88	1622.91	7.27
偏债型基金	7	127.31	0.39	108.37	0.49
债券型基金	28	662.11	2.02	566.24	2.54
中短债型基金	3	9.29	0.03	9.22	0.04
保本型基金	4	142.19	0.43	90.04	0.4
特殊策略基金	2	187.78	0.57	179.6	0.8
QDII基金	4	1081.79	3.3	1200.5	5.38
货币市场基金(A级)	40	922.02	2.81	922.02	4.13
货币市场基金(B级)	11	188.44	0.58	188.44	0.84

2008年12月31日托管银行托管基金汇总表

序号	托管银行	托管基金数量(只)	托管基金资产净值(亿元)	托管基金份额规模(亿份)	托管资产净值市场占比(%)
1	工商银行	112	5280.79	7110.81	27.25
2	建设银行	108	4675.94	5785.42	24.13
3	中国银行	72	3387.66	4521.73	17.48
4	农业银行	67	2156.32	3088.18	11.13
5	交通银行	46	2063.14	2798.22	10.65
6	招商银行	20	411.16	575.44	2.12
7	兴业银行	11	370.22	411.67	1.91
8	光大银行	11	344.17	496.75	1.78
9	浦发银行	9	312.41	409.82	1.61
10	民生银行	7	158.5	256.23	0.82
11	华夏银行	6	140.57	171.16	0.73
12	中信银行	4	79.8	106.28	0.41
合计		473	19380.68	25731.71	100

2008年6月30日托管银行托管基金汇总表

序