■ 上市基金看台

Alpha产品优化组合风险收益比

□银河证券基金研究中心 李薇

上周，沪深两市基金指数双双下跌。其中，上证基金指数收报3967.4点，下跌105.05点，周跌幅2.58%。深证基金指数收报4615.45点，下跌169.59点，周跌幅3.54%。

场内ETF又添新丁

场内ETF又添新丁，嘉实中证500ETF和南方中证500ETF已于3月15日上市交易。纳入统计的270只场内基金中，上涨基金数量为44只，下跌基金数量为215只，场内基金周交易价格(简单，以下同)平均跌幅1.68%。

从单只基金表现来看，中欧沪深300指数增强（LOF）、消费进取、华宝油气、诺德300B和信诚双盈分级债券B交易价格周涨幅分别为8.49、7.55、5.09、4.03和3.05个百分点，在全部上市基金中排名涨幅前五位。

从创新上市基金、传统封闭式基金、LOF基金、ETF基金四个分类基金来看，创新上市基金平均跌幅较小，周交易价格平均下跌1.3个百分点。上涨基金数量也最多，周上涨基金数量达到29只。其中，封闭式债券型分级子基金(优先份额)整体价格表现最为坚挺，周交易平均价格仅小幅下跌2Bp。

传统封闭式基金整体跌幅较大，正常交易的21只传统封闭式基金周交易价格平均下跌3.03%，周交易价格平均振幅为4.2%。流动性方面，日均换手率为0.35%。除基金安信、兴华停牌以外，仅有基金泰和周交易价格略涨0.21%，其它20只封闭式基金价格均有不同程度下跌。

81只LOF周交易价格平均跌幅为1.43%，周交易价格平均振幅为2.22%。从流动性表现来看，日均换手率为1.71%，其中，日均成交金额在100万元以上的基金仅有5只。从单只价格表现来看，中欧300、华宝油气、银华300、银华300和招商成长相对周涨幅较高。

纳入统计的50只ETF周交易价格平均跌幅为2.44%，周交易价格平均振幅为3.38%，日均换手率为2.03%。股票指数ETF中仅有深TMT周交易价格略涨0.18%，其它ETF则均有不同程度的下跌。跨市场指数流动性表现良好，日均换手率为5.6%，日均成交金额1亿以上的基金数量有4只。

大幅震荡或为常态

短期来看若无重大利空消息，市场下跌幅度可能比较有限，但上涨幅度依然不会太大，大幅震荡仍然是市场常态之一。

以资本市场为代表投资组合理论将收益归为系统回报(β)以及超额收益(α)两个部分，低成本β和多样化α也是近年来我国基金发展的两条重要脉络。2010年以后，股票指数类分级基金、ETF等指数类Beta基金产品成为行业快速发展的重要组成部分，而传统的从资产配置到个股选择的全能型产品正在受到市场越来越严格的挑战。近年来QDII、黄金、固定收益等其它投资标的多样化趋势，有效扩充了Alpha的来源，成为新的发展蓝海。

对于基金投资者而言，资产配置将成为更为个性化的选择，而多样化Alpha产品有助于优化组合的风险和收益配比。场内基金投资者宜放宽选择视野，关注新兴的另类投资基金品种，优化组合配置。

■ 直击创新型封基

泰达进取 引入股指期货投资策略对冲风险

□天相投顾 张春雷 仪胜男

泰达宏利中证500指数分级基金（简称“泰达中证500分级”）设立于2011年12月，是泰达宏利基金公司旗下的分级基金。该基金按照4：6的份额配比，分为优先类份额（泰达稳健）和进取类份额（泰达进取），优先类份额和进取类份额在深证交易所上市。截至2013年3月15日，该基金基础份额泰达宏利500的单位净值为0.985元；泰达稳健的单位净值为1.013元，二级市场价格1.021元，溢价率为0.79%；泰达进取的单位净值为0.966元，二级市场价格0.98元，溢价率为1.45%。

泰达稳健的约定年基准收益率为1年期银行定期存款税后利率加上3.5%。目前泰达稳健的约定年基准收益率为6.5%。这种每半年调整约定收益的设计使得泰达稳健在降息周期的吸引力降低，而在加息周期的吸引力较其他年度调整约定收益的稳健份额更加灵活。

泰达进取的初始杠杆倍数为1.67倍。在正常情况下，泰达进取承担泰达宏利500分级基金的投资风险，在满足泰达稳健的约定收益之后有望获取相对较高收益。截至2013年3月15日，溢价率为1.45%，3月15日的价格杠杆倍数为7.77倍。泰达宏利500分级基金以中证500指数为跟踪指数，采用数量化指数投资方法，以完全复制的策略构建指数化投资组合，该基金所持有的股票和入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占资产的85%-100%，其中投资于股票的资产不低于总资产的85%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。通过股指期货投资策略，该基金有效地对冲了标的股票波动带来的风险。

值得注意的是，该基金的份额折算分为定期折算和不定期折算。定期折算是指在每个会计年度的第一个工作日对泰达宏利500、泰达稳健进行一次折算；当泰达中证500净值大于或等于2元或泰达进取净值小于或等于0.250元时进行不定期折算。

■ 分级基金透视

杠杆股基近全军覆没

□金牛理财网研究中心 赵源

3月的股市乍暖还寒，上周沪深股指分别下跌1.73%、2.01%，杠杆股基应声大跌2.97%，36只杠杆股基仅4只避免了下跌厄运，其他基金悉数下跌，股市不期而至的“倒春寒”，把杠杆股基冻得“脸色发青”，几乎全军覆没。

金牛理财网数据显示，上周跌幅超过4%的杠杆股基共有14只，超过5%的有7只，国泰房地产B下跌10.84%领跌同类基金，显示出当前房地产行业不被外界看好。价格杠杆前五的基金平均下跌3.76%，凸显高杠杆基金双刃剑的风险。大盘泥沙俱下，今年来一直表现不错的创业板、中小板也难独善其身，本周3月12日创业板指数重挫3.37%，创年内最大单日跌幅，3月11日至3月15日，创业板指数累计下跌1.25%、中小板指数累计下跌1.49%，相关杠杆股基跌幅更是普遍超过平均跌幅，往日收益胜过大盘分基的风光不再。

金牛理财网分级基金数据显示，上周跟踪中小板指数的长城久兆中小板300积极，下跌4.96%；跟踪中小板指数的易方达中小板进取、申万菱信中小板B，分别下跌4.7%、4.11%；跟踪中小板综指的国安双力B，下跌4.83%；跟踪中证创业成长指数的诺安中创进取、万家中证创业成长B分别下跌0.32%、上涨0.41%。上述6只中小盘杠杆股基平均下跌3.09%，高于杠杆股基平均跌幅，进一步吞噬今年来的收益。

份额变化方面，上周杠杆股基业绩惨淡，份额曾一度出现较大规模减少，不过14日、15日大盘的重新上涨，使得杠杆股基份额又开始增加，整体而言上周杠杆股基份额保持稳定。3月11日至3月15日，杠杆股基累计增加893.77万份，银华锐进增加6853.43万份，增加份额最多，申万进取份额减少4609.03万份，减少份额最多。南方消费进取份额减少14.42%，变动率最大。此外6只中小盘杠杆股基5只份额减少，1只增加。

有分析认为近期多空分歧加大，指数剧烈震荡。经济复苏力度偏弱，意味着大盘再度连续大涨不具条件；而复苏格局尚未打破，又铺就了回调的安全垫，因此风险偏好较高的投资者短期可适度关注大盘分基。

责编：张 鹏 美编：王春燕

交易所上市交易基金一览表

数据来源：银河证券基金研究中心 计算截止日期：2013-3-15

序号	基金代码	基金简称	收盘价（元）	折溢价率	份额净值（元）
ETF					
1	510050	华夏上证50ETF	1.845	0.16%	1.8420
2	159901	易方达深证100ETF	0.588	-0.59%	0.5915
3	510180	华安上证180ETF	0.554	0.18%	0.5530
4	159902	华夏中小板ETF	2.142	-0.14%	2.1450
5	510880	华泰柏瑞上证红利ETF	1.966	0.46%	1.9570
6	510060	工银上证央企50ETF	1.11	-0.34%	1.1138
7	510010	交银上证180公司治理ETF	0.682	-0.15%	0.6830
8	159903	南方深证成指ETF	0.927	-0.25%	0.9293
9	510020	博时上证超级大盘ETF	1.009	0.35%	1.0025
10	510130	易方达上证中盘ETF	2.265	-0.44%	2.2750
11	510030	华宝兴业上证180价值ETF	2.498	-0.40%	2.5080
12	510090	建信上证社会责任ETF	0.896	2.40%	0.8750
13	510070	鹏华上证民营企业50ETF	1.091	-0.09%	1.0990
14	510160	中证南方小康产业指数ETF	0.337	-0.30%	0.3380
15	510110	海富通上证周期行业50ETF	2.312	-0.13%	2.3150
16	159905	工银深证红利ETF	0.712	-0.14%	0.7130
17	510190	华安上证龙头企业ETF	2.220	0.18%	2.2160
18	510170	国联安上证大宗商品股票ETF	2.09	-0.24%	2.0950
19	510150	招商上证消费50ETF	2.500	0.56%	2.4950
20	159906	大成深证成长40ETF	0.743	0.00%	0.7430
21	510220	华泰柏瑞上证中小盘ETF	2.468	-1.40%	2.5030
22	510210	富国上证综指ETF	2.307	-1.95%	2.3530
23	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	3.483	0.14%	3.4780
24	510260	诺安上证新兴产业ETF	0.695	0.14%	0.6940
25	510120	海富通上证非周期行业100ETF	1.725	-0.40%	1.7320
26	159907	广发中小板300ETF	0.843	0.46%	0.8393
27	159908	博时深证基本面200ETF	0.728	1.35%	0.7183
28	510270	中银上证国企100ETF	0.738	-0.27%	0.7400
29	159909	招商深证TMT50ETF	2.796	0.14%	2.7920
30	159910	嘉实深证基本面120ETF	0.81	-0.10%	0.8108
31	510280	华安兴业上证180系列ETF	1.005	-0.50%	1.0100
32	159911	鹏华深证民营ETF	2.726	-0.21%	2.7318
33	159916	建信深证基本面60ETF	1.582	-1.67%	1.6088
34	159912	汇添富深证300ETF	0.887	-0.56%	0.8902
35	510290	南方上证380ETF	0.858	0.53%	0.8535
36	159915	易方达创业板ETF	0.853	0.14%	0.8518
37	510300	交银深证300价值ETF	0.968	0.52%	0.9630
38	159917	国泰中小板300成长ETF	1.025	-0.39%	1.0290
39	159918	嘉实中证500ETF	1	-0.24%	1.0024
40	510410	博时上证自然资源ETF	0.846	0.21%	0.8442
41	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	2.529	-0.35%	2.5380
42	159919	嘉实沪深300ETF	2.526	-0.43%	2.5368
43	510420	景顺长城上证180等权ETF	0.997	-0.10%	0.9980
44	159920	华夏恒生ETF(QDII)	1.015	—	—
45	510900	易方达恒生中国企业ETF(QDII)	1.007	—	—
46	510430	银华上证50等权重ETF	1.113	-0.09%	1.1140
47	510440	大成上证50沪市ETF	1.085	-0.64%	1.0920
48	510440	景顺长城上证50等权重ETF	1.448	1.45%	1.0350
49	510330	华夏沪深300ETF	2.54	-0.08%	2.5420
50	159922	嘉实中证500ETF	3.592	-2.17%	3.4673
51	510500	南方中证500ETF	0.577	0.01%	0.9609
52	159923	大成中证100ETF	0.95	-0.94%	0.9590
53	159925	南方开元沪深300ETF	—	—	—
54	511010	国泰上证5年期国债ETF	—	—	99.7860
55	159926	易方达沪深300ETF复权式	—	—	1.0002
LOF					
1	160105	南方积极配置股票(LOF)	0.944	-0.95%	0.9531
2	163001	中银中证银行主题基金(LOF)	1.29	1.39%	1.2725
3	160505	博时主题行业股票(LOF)	1.703	0.83%	1.6890
4	162703	广发小盘成长股票(LOF)	1.79	0.52%	1.7807
5	162605	景顺长城鼎益股票(LOF)	0.875	0.46%	0.8699
6	161607	融通巨潮100指数增强(LOF)	0.799	0.76%	0.7930
7	160106	南方高增长股票(LOF)	1.403	-0.10%	1.4044
8	161903	万家公用事业行业股票(LOF)	0.564	0.53%	0.5610
9	163302	大摩资源优选混合(LOF)	1.782	-0.56%	1.7885
10	163402	兴全趋势投资混合(LOF)	0.878	-0.53%	0.8827
11	161005	富国天惠成长混合(LOF)	1.337	-0.22%	1.3400
12	161706	招商优质成长股票(LOF)	1.139	2.97%	1.1061
13	162411	华宝油气上游股票(LOF)	0.512	-0.47%	0.5144
14	162607	景顺长城资源垄断股票(LOF)	0.696	0.14%	0.6950
15	162207	泰达宏利价值优选混合(LOF)	0.826	-0.82%	0.8328
16	164607	华夏平稳增长混合(LOF)	0.767	0.52%	0.7630
17	160805	长盛同智优势混合(LOF)	0.758	0.33%	0.7555
18	160610	鹏华动力增长混合(LOF)	1.09	0.00%	1.0990
19	166001	中欧新蓝筹股票(LOF)	0.753	4.15%	0.7230
20	162006	长城久富股票(LOF)	1.489	0.26%	1.4862
21	160311	华夏蓝筹混合(LOF)	0.787	0.13%	0.7860
22	160611	鹏华优质治理股票(LOF)	0.9	0.00%	0.9000
23	161011	富国通胀通缩股票(LOF)	0.727	0.14%	0.7260
24	160910	大成创新成长混合(LOF)	0.752	-0.53%	0.7560
25	160314	华夏行业股票(LOF)	0.881	-0.56%	0.8860
26	160613	鹏华盛世创新股票(LOF)	1.278	2.06%	1.2530
27	160615	鹏华沪深300指数(LOF)	0.896	-1.43%	0.9090
28	161810	银华内需精选股票(LOF)	0.701	-0.99%	0.7080
29	160119	南方中证500指数(LOF)	0.852	-0.62%	0.8573
30	161811	银华价值优选股票(LOF)	0.783	1.35%	0.7280
31	160211	国泰小盘成长股票(LOF)	0.95	1.17%	0.9390
32	162307	海富通中证100指数(LOF)	0.735	-1.87%	0.7490
33	165309	建信沪深300指数(LOF)	0.751	1.76%	0.7380
34	162711	广发中证500指数(LOF)	0.776	-0.51%	0.7800
35	166006	中欧中小盘股票(LOF)	0.81	0.30%	0.8076
36	160716	嘉实基本面50指数(LOF)	0.692	-0.87%	0.6981
37	161606	鹏华证券300指数(LOF)	0.75	1.73%	0.7210
38	163001	长信中证央企100指数(LOF)	0.822	0.98%	0.8140
39	161211	国投瑞银沪深300金融地产指数(LOF)	0.873	0.34%	0.8700
40	161210	国投瑞银全球新兴市场股票(QDII-LOF)	0.995	—	—
41	166007	中欧沪深300指数增强(LOF)	0.92	10.91%	0.8295
42	165508	信诚深度价值股票(LOF)	0.962	-0.31%	0.9650
43	160807	长盛沪深300指数(LOF)	0.856	1.54%	0.8430
44	164205	天弘深证成份指数(LOF)	0.732	1.95%	0.7180
45	160215	国泰价值经典股票(LOF)	0.82	1.36%	0.8090
46	160717	嘉实恒生中国企业指数(QDII-LOF)	0.821	—	—
47	163407	兴全沪深300指数增强(LOF)	0.898	6.07%	0.8466
48	161815	银华动通联主题(QDII-FOF-LOF)	0.828	—	—
49	161213	国投瑞银中证消费服务指数(LOF)	0.812	-1.34%	0.8230
50	165510	信诚金砖四国积极配置(QDII-FOF-LOF)	0.864	—	—
51	166009	中欧新动力股票(LOF)	1.021	2.82%	0.9930
52	161714	招商标普金砖四国指数(QDII-LOF)	0.811	—	—
53	161907	万家中证红利指数(LOF)	0.891	0.66%	0.8857
54	160512	博时主题行业股票(LOF)	1.041	4.48%	1.0350
55	163409	兴全绿色投资股票(LOF)	0.98	-0.20%	0.9820
56	161116	易方达黄金主题(QDII-FOF-LOF)	0.9	—	—
57	160123	南方中证500债券指数(A类-LOF)	1.063	-0.38%	1.0671
58	163116	申万菱信资化小盘股票(LOF)	0.999	1.11%	0.8990
59	161217	国投瑞银中证上海资源产业指数(LOF)	0.768	-0.13%	0.7690
60	165512	信诚新机遇股票(LOF)	0.982	1.34%	0.9690
61	160719	嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)	0.894	—	—
62	164701	汇添富黄金及贵金属(QDII-FOF-LOF)	0.824	—	—
63	160415	华安深证300指数(LOF)	0.925	3.58%	0.8930
64	160125	南方中国中小盘股票指数(QDII-LOF)	1.028	—	—
65	163208	诺安油气能源股票(QDII-FOF-LOF)	—	—	—
66	162411	华宝兴业标普油气上游股票指数(QDII-LOF)	1.053	—	—
67	161017	富国中证500指数增强(LOF)	0.986	2.18%	0.9650
68	161010	富国天丰强化收益债基(LOF)	1.05	0.19%	1.049
69	166008	中欧增强回报债券(LOF)	1.043	-0.39%	1.0471
70	161219	国投瑞银新兴产业混合(LOF)	1.151	-1.03%	1.1630
71	165513	信诚全球商品主题(QDII-FOF-LOF)	0.842	—	—
72	165809	东吴深证100指数增强(LOF)	0.908	-0.22%	0.9100
73	160416	华安标普全球石油指数(QDII-LOF)	1.03	—	—
74	163412	兴全轻资产投资股票(LOF)	1.055	0.09%	1.0540
75	160216	国泰大宗商品配置(QDII-FOF-LOF)	—	—	—
76	165514	信诚周期轮动股票(LOF)	1.141	7.95%	1.0570
77	163821	中银沪深300等权重指数(LOF)	1.038	1.57%	1.0220
78	160916	大成优选股票(LOF)	1.12	-0.71%	1.1280
79	161826	银华抵债保用主题债券(LOF)	1.054	0.29%	1.0510
80	160706	嘉实沪深300ETF联接(LOF)	0.673	-0.68%	0.6776
81	161119	易方达中债新综合债券指数优越式(A类-LOF)	1.019	0.00%	1.0190
82	161821	银华中证中票50年期债券(A类-LOF)	1.009	-0.49%	1.0140
83	163411	兴全商业模式优选股票(LOF)	1	-0.79%	1.0080
84	160720	嘉实中证中期企业债指数(A类-LOF)	—	—	1.0027
85	166012	国泰估值优势股票(LOF)	0.783	-1.01%	0.7910
分级股票基金					
1	150008	国投瑞银瑞和分级(A)原(A类)	1.02	-9.09%	1.1220
2	150009	国投瑞银瑞和分级进取(B)原(B类)	1.132	9.90%	1.0300
3	150012	国联安双禧指数分级(A类)	1.126	-3.60%	1.1680
4	150013	国联安双禧指数分级(B类)	0.81	3.10%	0.7850
5	150016	兴全合润分级(A类)	0.984	-1.60%	1.0000
6	150017	兴全合润分级(B类)	0.959	2.64%	0.9343
7	150018	银华保本增值分级债券(A类)	0.624	-8.70%	1.0120
8	150019	银华保本增值分级债券(B类)	0.671	16.90%	0.5740
9	150022	中芯国际深证成份分级进取(A类)	0.807	-20.27%	1.0122
10	150023	中芯国际深证成份分级进取(B类)	0.403	95.06%	0.2066
11	150028	信诚中证500指数分级(A类)	0.96	-4.57%	1.0060
12	150029	信诚中证500指数分级(B类)	0.491	4.69%	0.4690
13	150030	银华中证90指数分级金利(A类)	1.067	5.33%	1.0130
14	150031	银华中证90指数分级金利(B类)	1.128	-5.76%	1.1970
15	150036	建信双利股票分级稳健(A类)	1.03	1.68%	1.0130
16	150037	建信双利股票分级进取(B类)	0.883	-3.50%	0.9150
17	150047	银华消费股票分级观内(A类)	1.351	33.23%	1.0140
18	150048	银华消费股票分级观内(B类)	0.93	-9.73%	1.0300
19	150054	泰达宏利中证500指数分级进取(B级)	0.98	1.45%	0.9660
20	150053	泰达宏利中证500指数分级稳健(A级)	1.021	0.79%	1.0130
21	150060	长盛同瑞中证200指数分级(B级)	1.016	0.79%	1.0080
22	150064	长盛同瑞中证200指数分级(A级)	1.017	0.39%	1.0130
23	150060	银华中证内地资源指数分级鑫瑞(B级)	0.767	2.54%	0.7480
24	150059	银华中证内地资源指数分级鑫瑞(A级)	0.993	-1.97%	1.0130
25	150045	长城久兆中小板300指数分级稳健(A级)	0.955	-5.66%	1.0670
26	150058	长城久兆中小板300指数分级积极(B级)	0.9	3.33%	0.8710
27	150056	工银瑞信睿智中证500指数分级(B级)	0.862	-3.18%	0.8903
28	150055	工银瑞信睿智中证500指数分级(A级)	1.05	1.67%	1.0328
29	150051	信诚沪深300指数分级(A级)	0.929	-7.75%	1.0070
30	150052	信诚沪深300指数分级(B级)	0.953	7.20%	0.8890
31	150050	南方新兴消费股票分级进取(B级)	1.011	—	—
32	150049	南方新兴消费股票分级进取(A级)	0.963	-3.20%	1.0600
33	150069	国联安双力中小板指指数分级(A级)	1.095	2.43%	1.0690
34	150070	国联安双力中小板指指数分级(B级)	0.808	-4.83%	0.8490
35	150077	中欧盛世成长股票分级(A级)	1.073	0.94%	1.0630
36	150072	中欧盛世成长股票分级(B级)	1.109	-0.72%	1.1170
37	150073	诺安中证创业成长指数分级稳健(A级)	0.999	-1.38%	1.0130
38	150075	诺安中证创业成长指数分级进取(B级)	0.937	0.21%	0.9350
39	150074	海富通沪深300指数分级稳健(A级)	0.957	-4.13%	1.0130
40	150077	海富通沪深300指数分级进取(B级)	0.967	9.64%	0.8820
41	150084	广发深证100指数分级(B级)	0.795	1.25%	0.7852
42	150085	广发深证100指数分级(A级)	0.993	-1.99%	1.0132
43	150085	中芯国际中小板指数分级(A级)	1.083	2.19%	1.0598
44	150086	中芯国际中小板指数分级(B级)	0.863	-3.96%	0.8986
45	150098	长盛同庆中证800指数分级(A级)	1.088	2.93%	1.0570
46	150099	长盛同庆中证800指数分级(B级)	0.878	-4.04%	0.9150
47	150088	金鹰中证500指数分级(A级)	1.05	3.63%	1.0132
48	150089	金鹰中证500指数分级(B级)	0.915	-4.13%	0.9544
49	150104	华安沪深300指数分级(A级)	1.022	0.09%	1.0130
50	150105	华安沪深300指数分级(B级)	1.052	-0.47%	1.0570
51	150097	招商中证大宗商品股票指数分级(B级)	0.843	-2.99%	0.8690
52	150096	招商中证大宗商品股票指数分级(A级)	1.037	2.37%	1.0130
53	150091	万家中证创业成长指数分级(B级)	0.985	-6.10%	1.0490
54	150090	万家中证创业成长指数分级(A级)	1.08	6.61%	1.0130
55	150110	华商中证500指数分级(A级)	1.082	4.74%	1.0330
56	150111	华商中证500指数分级(B级)	1.046	-3.33%	1.0820
57	150095	泰信中证基本面400指数分级(B级)	1.184	-0.42%	1.1890
58	150094	泰信中证基本面400指数分级(A级)	0.999	-1.38%	1.0130
59	150093	诺德深证300指数分级(B级)	1.239	9.07%	1.1360
60	150092	诺德深证300指数分级(A级)	0.98	-3.16%	1.0120
61	150108	长盛同辉深100等权重指数分级(A级)	1.095	5.80%	1.0350
62	150109	长盛同辉深100等权重指数分级(B级)	1.067	-5.99%	1.1350
63	150106	易方达中小板指数分级(B级)	1.116	1.31%	9.47%	1.0332
64	150107	易方达中小板指数分级(B级)	1.013	-10.35%	1.1300
65	150100	鹏华中证A股资源产业指数分级(B级)	0.941	-7.02%	1.0120
66	150101	鹏华中证A股资源产业指数分级(B级)	0.781	0.975	1.14%	0.9100
67	150113	工银睿智深证100指数分级(B级)	1.106	-1.42%	1.1219
68	150112	工银睿智深证100指数分级(A级)	1.05	2.39%	1.0255
69	150118	国泰国证房地产行业指数分级(B级)	0.888	-5.63%	0.9410
70	150117	国泰国证房地产行业指数分级(A级)	1.08	7.25%	1.0070
分级债券基金					
1	150033	嘉实多利债券分级进取(B级)	1.109	27.49%	0.8699
2	150032	嘉实多利债券分级优先(A级)	0.981	-6.87%	1.0439
3	150067	国泰信用互利债券分级(B级)	1.366	15.86%	1.1790
4	150066	国泰信用互利债券分级(A级)	0.931	-7.73%	1.0090
5	150040	中欧鼎利债券分级(B级)	1.084	-0.91%	1.0940
6	150039	中欧鼎利债券分级(A级)	0.972	-0.19%	0.9740
7	150016	信诚添金分级债券(B级)	—	—	1.0450
8	150015	信诚添金分级债券(A级)	—	—	1.0000
封闭式					
1	500008	华夏兴华封闭	0.938	-4.92%	0.9865
2	500003	华安安信封闭	0.966	-5.38%	1.0209
3	500000	博时裕阳封闭	0.843	-2.77%	0.8670
4	184699	鹏华普天封闭	0.905	-4.68%	0.9609
5	184690	长盛同益封闭	0.803	-9.59%	0.8882
6	500002	嘉实泰和封闭	0.964	-9.07%	1.0602
7	184691	大成景阳封闭	0.792	-9.08%	0.8711
8	500015	富国汉盛封闭	1.087	-8.16%	1.1836
9	184692	博时裕隆封闭	0.857	-8.75%	0.9392
10	500009	华安宝利封闭	0.962	-8.18%	1.0477
11	184693	鹏华景丰封闭	0.776	-11.24%	0.8562
12	500018	华夏兴和封闭	0.854	-11.22%	0.9619
13	184698	南方天元封闭	0.788	-10.41%	0.8796
14	500011	嘉实泰和封闭	1.008	-12.61%	1.1535
15	500013	长盛同鑫封闭	0.902	-13.60%	1.0430
16	184701	大成景阳封闭	0.832	-13.84%	0.9657
17	500015	富国汉兴封闭	0.843	-13.24%	0.9716
18	500038	国泰通胀封闭	0.651	-18.61%	0.7991
19	184728	宝盈鸿利封闭	0.559	-21.58%	0.7128
20	500056	易方达科瑞封闭	0.767	-21.30%	0.9746
21	184721	嘉实丰和封闭	0.784	-20.51%	0.9863
22	184722	长城久盈封闭	0.686	-20.74%	0.8655
23	500058	银河银丰封闭	0.658	-23.67%	0.8620
24	150003	建信优势动力股票封闭	0.922	-1.66%	0.9370
27	150004	国投瑞银瑞福深100分级进取封闭(B级)	0.835	-17.16%	1.0080
30	160128	南方金利定期开放债券(A类)	1.025	-2.47%	1.0510
31	161117	易方达永旭添利定期开放债券	1.032	-0.29%	1.0350
32	164810	工银瑞信定期开放债券	1.005	-2.05%	1.0260
33	160621	鹏华中证全债指数增强封闭式越式	1.034	-0.19%	1.0360
35	166902	民生加银平稳增利定期开放债券(A类)	1.009	-2.70%	1.0370
40	161713	招商信用添利债券封闭	1.045	-1.97%	1.0660
41	161813	银华信用恒泰封闭	1.051	-0.47%	1.0560
42	164105	华富强化可报债券封闭	1.022	-0.58%	1.0320
44	165509	信诚增强收益债券封闭	1.03	-0.39%	1.0340
46	161115	易方达岁丰添利债券封闭	1.017	-0.78%	1.0250
47	166904	鹏华平稳回报债券封闭	1.039	-0.57%	1.0430
49	164902	交银信用添利债券封闭	1.051	-1.13%	1.0630
50	164808	工银瑞信四季收益债券封闭	1.059	-0.19%	1.0610
51	161116	国投瑞银双债债券封闭	1.04	-1.05%	1.0510
56	165311	建信信用增强债券封闭	1.044	-1.14%	1.0560
58	162712	广发聚利债券封闭	1.092	-0.36%	1.0960
60	164606	华泰柏瑞信用增利债券封闭	0.997	-1.92%	1.0170
61	164906	融通四季添利债券封闭	1.014	-0.88%	1.0230
67	163819	中银信用增利债券封闭	1.074	-0.46%	1.0790
71	161019	富国新天锋定期开放债券	1.05	2.24%	1.0270
75	164708	汇添富季季红债券	1	-3.80%	1.0400
79	150020	富国汇利债券分级封闭(A级)	1.089	-0.73%	1.0970
80	150021	富国汇利债券分级封闭(B级)	1.359	-0.80%	1.3700
81	150025	大成景丰债券分级封闭(A级)	1.089	-0.73%	1.0970
82	150026	大成景丰债券分级封闭(B级)	0.951	-3.35%	0.9850
84	150027	天弘添利债券分级封闭(B级)	1.1	-9.61%	1.2170
85	150034	泰达宏利聚利债券分级封闭(A级)	1.034	-4.17%	1.0790
86	150035	泰达宏利聚利债券分级封闭(B级)	1.339	-7.17%	1.4420
88	150041	富国天盈债券分级封闭(B级)	1.323	0.46%	1.3170
90	150038	万家添利债券分级封闭(B级)	1.25	-3.55%	1.2960
92	150043	博时裕祥债券分级封闭(B级)	1.213	-6.62%	1.2990
93	150042	长信利息收益分级封闭(B级)	1.12	-9.09%	1.2343
95	150045	海富通稳进增利债券分级封闭(B级)	1.491	-6.23%	1.5990