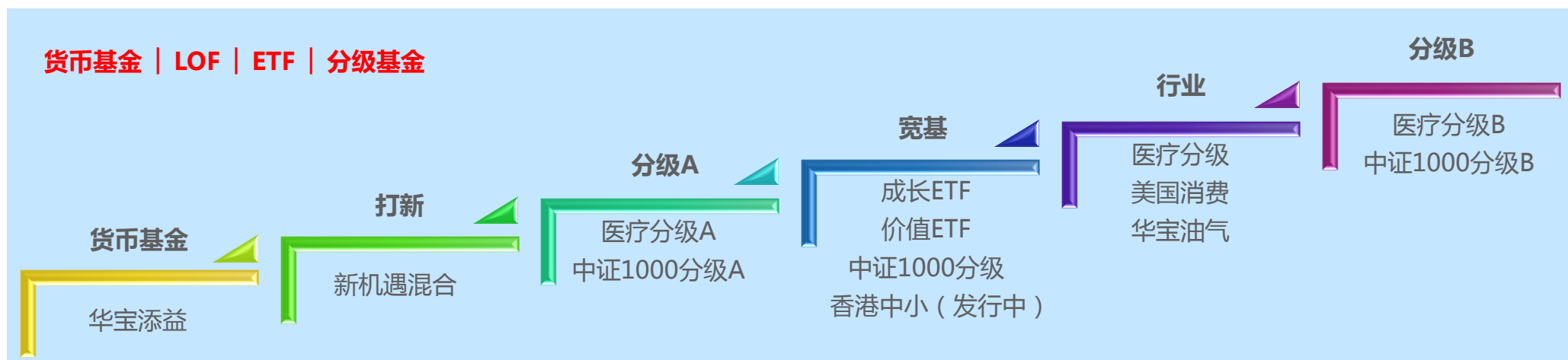




## ETP 日报：黑色星期一又现，蓝筹指数更为抗跌

「第 5 期」2016 年 6 月 14 日

### ◆ 华宝兴业场内基金布局



### ◆ 市场回顾

6月13日A股遭遇“黑色星期一”。沪深股指早盘低开，午后大幅跳水，最终大跌收官。上证指数下跌3.21%，收于2833.07点，创近3个月的最大单日跌幅，逼近2800点大关。深证成指下跌4.40%，创业板指下跌6.03%。前期热点板块，包括人工智能、智能汽车、虚拟现实、次新等均出现大幅下跌，两市有239只股票跌停。申万一级行业指数全线下跌，跌幅较小的板块是银行(-1.41%)、有色金属(-2.11%)、国防军工(-2.58%)；跌幅较大的板块是传媒(-6.67%)，综合(-6.23%)，计算机(-6.02%)。有色金属行业受益黄金上涨，跌幅相对较小。两市成交额为5892亿元，较前一交易日的5459亿元有所放大。

本报告内容仅供参考，不作为投资建议，基金投资需谨慎。

客服热线：[400-700-5588](tel:400-700-5588)

1 / 4

华宝兴业基金 ETP 产品中,6月13日 1000A 上涨 3.47%,在市场所有分级 A 中涨幅最大;1000B 受大盘影响跌停;1000 分级整体溢价率升至 4.26%,出现假溢价,当日做底仓溢价套利时 B 端可能无法卖出,6月14日开盘分级 B 大概率补跌。医疗 A 微跌 0.28%,医疗 B 跌 7.66%,整体由折价变溢价,溢价率为 0.34%。A 股大幅下跌导致市场上有多只分级 B 临近下折(母基金距离下折事件发生需要的跌幅小于 10%),而华宝兴业的 1000 分级和医疗分级母基金距离下折所需跌幅分别为 18.11%和 37.79%。受标普石油天然气上游股票指数端午期间下跌 5.40%影响,华宝油气 6月13日下跌 6.06%。成长 ETF 和价值 ETF 分别下跌 1.41%和 1.11%,跌幅明显小于大盘。美国消费和华宝添益微跌。

◆ **产品播报** (下列数据若未标明日期,即为 2016 年 6 月 13 日数据)

**货币基金**

简称	代码	收盘价	日涨跌	成交金额 (亿元)	净值	每日 百份收益	折溢价率*	七日 年化收益率	规模 (亿元)	国内最大规模 场内货币基金
华宝添益	511990.SH	99.995	-0.03%	95.31	100.000	0.6411	-0.011%	2.2880%	1343	

\* 货币基金折溢价率的计算不考虑周末和节假日的净值变化。

**打新**

简称	代码	收盘价	日涨跌	成交金额 (万元)	净值	折溢价率	今年 至今收益	打新神器 稳健收益
新机遇混合	162414.SZ	1.037	0.00%	0.00	1.0366	0.04%	0.75%	

本报告内容仅供参考,不作为投资建议,基金投资需谨慎。

客服热线: [400-700-5588](tel:400-700-5588)

## 分级A

简称	代码	收盘价	日涨跌	指数日涨跌	成交金额 (万元)	净值	折溢价率	整体折溢价率	约定收益率 (下期)	修正收益率
1000A	150263.SZ	1.103	3.47%	-5.11%	19.02	1.0272	7.38%	4.26%	5.50%	5.112%
医疗A	150261.SZ	1.061	-0.28%	-5.40%	14.77	1.0204	3.98%	0.34%	5.50%	5.285%

## 宽基

简称	代码	收盘价	日涨跌	指数日涨跌	成交金额 (万元)	净值	折溢价率	下折母基需跌	
价值ETF	510030.SH	3.556	-1.11%	-1.90%	1.03	3.5340	0.62%	不适用	国内首只风格指数ETF
成长ETF	510280.SH	1.263	-1.41%	-2.89%	0.57	1.2420	1.69%	不适用	聚焦高成长蓝筹股
1000分级	162413.OF	0.8130 (拟合价格)	母基金, 非上市	-5.11%	母基金, 非上市	0.7798	4.26%	18.11%	最具代表性的小盘股指数

## 行业

简称	代码	收盘价	日涨跌	指数日涨跌 2016-6-10	成交金额 (万元)	净值 2016-6-8	折溢价率	下折母基需跌	
美国消费 (QDII)	162415.SZ	1.006	-0.20%	-1.03%	6.68	1.0190	-1.28%	不适用	品质消费, 美元资产绝佳标的
华宝油气 (QDII)	162411.SZ	0.574	-6.06%	-4.87%	14606	0.6110	-6.06%	不适用	国内首只、目前唯一跟踪油气上游行业的基金
医疗分级	162412.OF	1.0245 (拟合价格)	母基金, 非上市	-5.40% (2016-6-13)	母基金, 非上市	1.0210 (2016-6-13)	0.34%	37.79%	高成长高弹性, “医” 骑绝尘

本报告内容仅供参考, 不作为投资建议, 基金投资需谨慎。

客服热线: [400-700-5588](tel:400-700-5588)

### 分级B

简称	代码	收盘价	日涨跌	指数 日涨跌	成交金额 (万元)	净值	折溢价率	整体 折溢价率	价格杠杆
1000B	150264.SZ	0.523	-9.98%	-5.11%	57.98	0.5324	-1.77%	4.26%	2.982
医疗B	150262.SZ	0.988	-7.66%	-5.40%	955.22	1.0216	-3.29%	0.34%	2.067

数据来源：华宝兴业基金、Wind 和集思录，2016 年 6 月 13 日

#### 【特别声明】

1、本周报均来源于我公司认为可靠的渠道，但所载内容和意见仅作为客户服务信息，并非为投资者提供对市场走势、个股和基金进行投资决策的参考。我公司对这些信息的完整性和准确性不作任何保证，也不保证有关观点或分析判断不发生变化或更新，不代表我公司或者其他关联机构的正式观点。本周报不构成对我公司旗下基金实际投资行为的约束。

2、本周报的观点、分析及预测不构成对阅读者的投资建议，如涉及个股内容不作为投资建议我公司及雇员不就本周报内容对任何投资作出任何形式的风险承诺和收益担保，不对因使用本周报内容所引发的直接或间接损失而负任何责任。

3、本周报中所有数据均经仔细核对，如有差错，以相关数据原始来源所披露的为准。

4、基金的历史表现不能代表基金未来的投资表现。我公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于我公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。基金投资有风险，投资基金需谨慎。

5、本周报著作权及其相关知识产权归我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式复制、刊登、发表或者引用，且不得对此报告进行任何有悖原意的删节或修改。

本报告内容仅供参考，不作为投资建议，基金投资需谨慎。

客服热线：[400-700-5588](tel:400-700-5588)