



## 有关RQFII ETF交易事宜

吕丽雯  
香港交易所交易科副总监

2012年6月19日

## 香港ETF的交易安排

### 香港ETF的交易安排

#### 股份代号

- 非人民币ETF：2800-2849及3000-3199
- 人民币ETF：82800-82849及83000-83199
- 股份代号配置：(i) 從「普通组」中抽选；(ii) 捐出50万元可從「特别组」中抽选；(iii) 捐出100万元可自选股份代号

#### 股份简称

- 非人民币ETF：英文15个位,中文8个位
- 人民币ETF：英文13个位,中文6个位;简称末端加上「-R」

#### 庄家制

- ETF 发行人需为其ETF委任最少一名庄家提供流通量

#### 沽空安排

- 交易所可把ETF纳入允许沽空名单,并获豁免卖空价限制

#### 印花稅

- 适用于含港股多过40% 的ETF;RQFII ETF则不适用

## ETF的庄家制度

### 香港ETF的庄家制度

#### 申请庄家执照

- 只有交易所参与者才可向香港交易所申请成为「证券庄家」
- 申请人须证明具有合适资格进行庄家活动(交易所会考虑交易所参与者的财务状况、交易记录、职员、计算机设备、内部保安程序及风险管理政策及程序等)
- 若申请成为人民币交易的RQFII ETF证券庄家,必须证明有能力以人民币交易並准备就绪

#### 庄家责任

- 当市场上的买卖差价过阔时,庄家有责任于指定的时限内输入一定数量的买卖盘,把差价收窄
- 庄家责任细节与相关庄家磋商后由交易所拟定

## 证券庄家的激励机制

- 证券庄家的优惠包括减免印花税、交易征费及交易费

交易	印花税 (代政府收取)		交易征费 (代香港证监会收取)		交易费 (香港交易所收取)	
	非证券庄家	证券庄家	非证券庄家	证券庄家	非证券庄家	证券庄家
买入 / 卖出 >40% 香港股票作为相关资产的ETF	0.10%	每交易 \$5	0.003%	豁免	0.005%	豁免
买入 / 卖出 非香港股票作为相关资产的ETF (如 RQFII ETF)	-	-	0.003%	豁免	0.005%	豁免

- 证券庄家可安装庄家专用终端机，或于其专用的开放式网间连接器获分配一个或以上节流率，以供输入庄家买卖盘

## ETF的交易信息

### ETF的交易信息

- ETF 发行人需就其发行的ETF每天向香港交易所递交以下数据:每个基金单位之资产净值、每个新增设基金单位之资产净值、已发行之基金单位数目、管理资产总额、溢价/折让

#### 交易所買賣基金的交易資料

交易所買賣基金經理名稱

XXXX

交易所買賣基金名稱

XXXX

股份代號

XXXX

日期(ddmmmyyyy)

ddmmmyyyy

每個基金單位之資產淨值(以交易貨幣計算)(附註 1)

貨幣

RMB

X.XX

每個新增設基金單位之資產淨值(附註 2)

RMB

X.XX

每個新增設基金單位之實際現金值(附註 3)

RMB

X.XX

已發行之基金單位(香港單位)(附註 4)

XXX

已發行之基金單位(基金總值)(附註 4)

XXX

管理資產總額(香港單位)

RMB

XXX

管理資產總額(基金總值)

RMB

XXX

(百分率%)

溢價/折讓(%) (附註 5)

X.XX

每個基金單位之等值股息金額(附註 6)

RMB

X.XX

每個新增基金單位之等值股息金額(附註 7)

RMB

XXX

每個新增基金單位之現金結餘額(附註 8)

RMB

X.XX

## 香港交易所网站ETF专区

### 香港交易所网站ETF专区

- 为方便投资者搜寻适合自己需要的交易所买卖基金,香港交易所网站于去年十月提升交易所买卖基金一栏的版面
- 新增项目包括交易所买卖基金搜寻器,让投资者搜寻及比较交易所买卖基金,以列出买卖最活跃的交易所买卖基金、提供浏览每日/每月数据及其他新功能
- 网址：[www.hkex.com.hk/chi/prod/secprod/etf/etfmain\\_c.htm](http://www.hkex.com.hk/chi/prod/secprod/etf/etfmain_c.htm)

## 香港交易所网站ETF专区

### 搜寻及比较ETF

- 投资者可输入一或多项条件,例如股份代号、相关指数、相关市场等,从所有在香港上市的ETF进行搜寻

### 交易所買賣基金搜尋

更新日期: 26/04/2012

工具



基本資料							市場					
股份代號 ▽	ETF名稱 △	相關指數 △	相關市場 △	ETF經理 △	上市方式 △	ETF類別 △	交易貨幣 △	收市價 △	最高價 △	最低價 △	成交金額 ( '000) △	每單位資產 淨值 △
2800	盈富基金	恒生指數	股票 - 香港	道富環球投資管理亞洲有限公司	本地	實物資產	HKD	21.100	21.150	20.900	203,115	21.0784 (26/04/12)
2825	標智中證香港100指數基金	中證香港 100 指數	股票 - 香港	中銀國際英國保誠資產管理有限公司	本地	實物資產	HKD	17.440	-	-	0	17.6955 (26/04/12)
2833	恒生指數上市基金	恒生指數	股票 - 香港	恒生投資管理有限公司	本地	實物資產	HKD	210.200	209.800	209.000	2,202	210.3000 (26/04/12)
3000	匯豐MSCI香港ETF	MSCI 香港指數	股票 - 香港	匯豐投資基金(香港)有限公司	本地	實物資產	HKD	28.350	28.350	28.350	5,008	28.3411 (26/04/12)
3070	中國平安CSI香港高息股ETF	中證香港紅利指數	股票 - 香港	中國平安資產管理(香港)有限公司	本地	實物資產	HKD	19.680	-	-	0	19.7785 (26/04/12)
3072	中國平安CSI香港中型股精選ETF	中證香港中盤精選指數	股票 - 香港	中國平安資產管理(香港)有限公司	本地	實物資產	HKD	19.600	19.600	19.600	10	19.7247 (26/04/12)
3098	中國平安CSI RAFI香港50 ETF	中證銳聯香港基本面50 指數	股票 - 香港	中國平安資產管理(香港)有限公司	本地	實物資產	HKD	16.680	-	-	0	16.7227 (26/04/12)

## 香港交易所网站ETF专区

### 浏览每日及每月ETF数据

- 投资者可取得ETF的相关市场数据,如收市价、最高/最低价格、成交金额及平均每日成交金额,及以每日或每月形式显示的数据,如每单位资产净值及溢价/折让

#### 每日交易所買賣基金數據

更新日期: 26/04/2012

[下载全部纪录](#) (只供参考用途)

工具

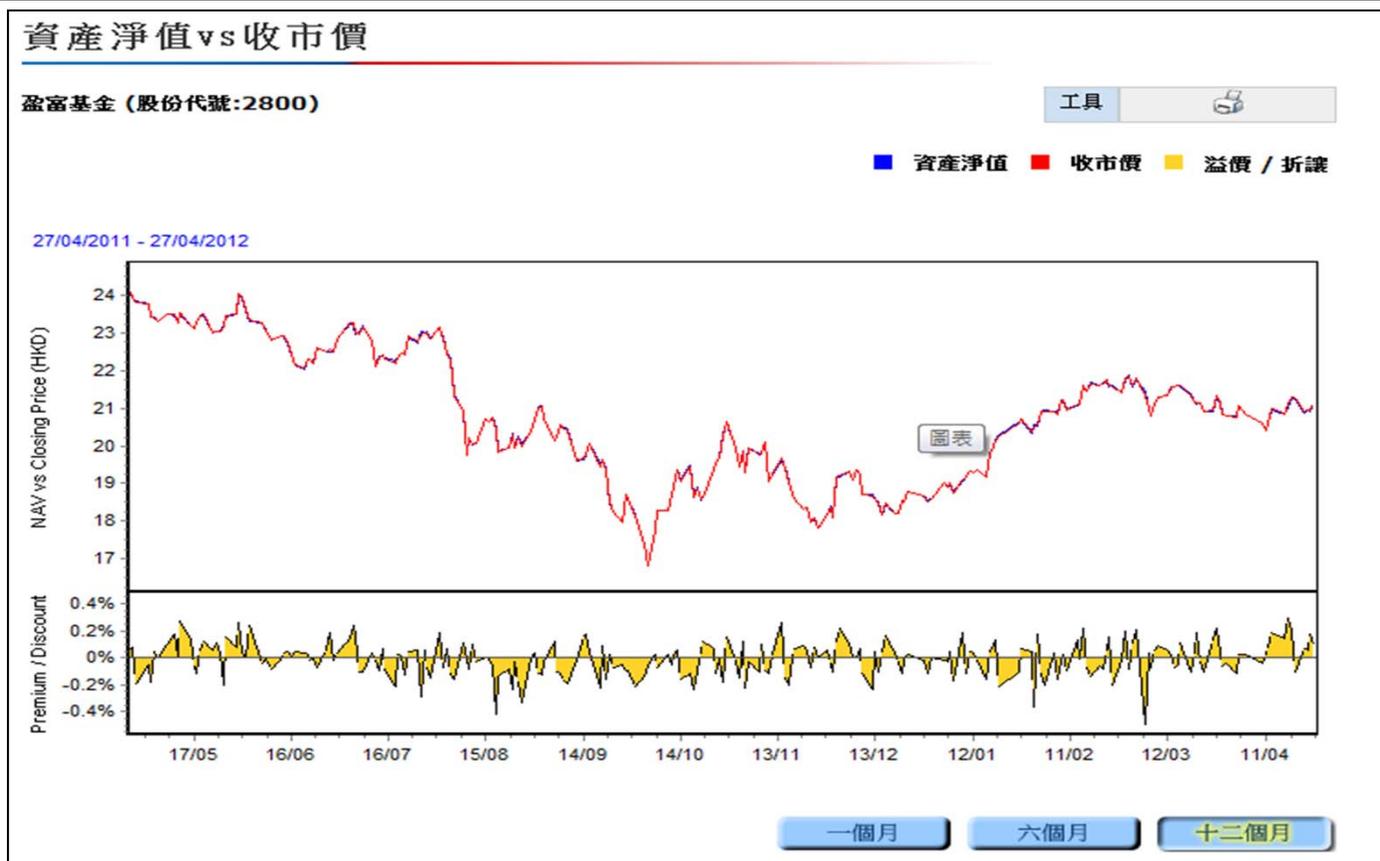


股份代号	ETF名稱	簡稱	交易貨幣	收市價	最高價	最低價	成交金額 ('000)	每單位資產淨值	管理資產總額(香港) ('000)	管理資產總額(基金總額) ('000)	溢價/折讓	由年初起截至今年平均每日成交金額 ('000)	圖表
2800	宏富基金	宏富基金	HKD	21.100	21.150	20.900	203,115	21.0784	HKD 51,304,603	HKD 51,304,603	0.10%	317,267	
2801	iShares 宏富MSCI中國指數ETF	宏富中國ETF	HKD	19.280	19.280	19.000	6,722	19.2838	HKD 2,233,061	HKD 2,233,061	-0.02%	3,958	
2802	iShares 宏富MSCI亞洲新興市場指數ETF	宏富亞洲新興市場	HKD	41.350	-	-	0	41.5692	HKD 232,788	HKD 232,788	-0.53%	332	
2816	db x-trackers 滙豐300地產指數ETF	XDB 滙豐地產	HKD	10.040	9.980	9.980	599	-	-	-	-	2,804	
2817	匯豐中國香港上市房地產指數基金	匯豐港地產	HKD	8.210	-	-	0	8.4601	HKD 50,761	HKD 50,761	-2.96%	49	
2818	中置平安CSI RAFI A 股50 ETF	X平安CRA 50	HKD	25.100	-	-	0	24.8252	HKD 397,203	HKD 397,203	1.11%	15	
2819	ABF香港創業板非指數基金	ABF港創非指	HKD	103.050	103.050	103.050	21	-	-	-	-	41	
2821	鴻富基金	鴻富基金	USD	126.600	126.750	126.600	243	-	-	-	-	654	
2823	iShares 宏富富時A50中國指數ETF	X宏富A50中國	HKD	11.040	11.040	10.960	1,375,847	10.5793	HKD 49,320,649	HKD 49,320,649	4.35%	1,131,104	
2825	匯豐中國香港100指數基金	匯豐香港100	HKD	17.440	-	-	0	17.6955	HKD 88,478	HKD 88,478	-1.44%	74	
2827	匯豐滙豐300中國指數基金	X滙豐滙豐300	HKD	29.750	29.750	29.450	66,276	28.3323	HKD 7,434,399	HKD 7,434,399	5.00%	43,757	
2828	匯豐H股指數上市基金	匯豐H股ETF	HKD	109.100	109.200	108.000	129,269	108.9900	HKD 18,547,019	HKD 18,547,019	0.10%	188,336	
2829	iShares 宏富滙豐A股指數ETF	X宏富A股	HKD	10.800	10.820	10.800	54	10.7017	HKD 791,923	HKD 791,923	0.92%	287	
2833	匯豐指數上市基金	匯豐指數ETF	HKD	210.200	209.800	209.000	2,202	210.3000	HKD 30,142,721	HKD 30,142,721	-0.05%	8,373	
2835	未來資產TIGER KOSPI 200指數ETF	MIRAE KS200	HKD	18.820	-	-	0	-	-	-	-	359	
2836	iShares 宏富BSE SENSEX 印度指數ETF	宏富印度ETF	HKD	14.420	14.460	14.280	1,757	14.3774	HKD 1,575,764	HKD 1,575,764	0.30%	6,423	

## 香港交易所网站ETF专户

查阅收市价、资产净值及溢价/折让数据

- 除各ETF的每单位资产净值对照过往收市价外,溢价/折让亦可以图表显示



## 香港交易所网站ETF专区

### 寻找买卖活跃的ETF

- 为协助投资者了解ETF的每日交易情况,投资者可按百分比升幅、百分比跌幅、成交金额及成交数量显示20大ETF

#### 投資服務中心

普通股	二十六升幅	二十六跌幅	二十六成交金額	二十六成交數量
認股權證	二十六升幅	二十六跌幅	二十六成交金額	二十六成交數量
牛熊證	二十六升幅	二十六跌幅	二十六成交金額	二十六成交數量
交易所買賣基金	二十六升幅	二十六跌幅	二十六成交金額	二十六成交數量

最後更新: 27/4/2012 14:39:00 HKT  
 此網頁提供延時最少15分鐘的價格資料。

請按此查閱實時基本報價之網站名單。

代號	公司	按盤價	變動	變動(%)	成交金額(千)	成交數量(千)	相關資料
2823	X安碩A50中國	\$ 11.04	0	0.00	582,900	52,795	請選擇 ▼
2828	恒生H股ETF	\$ 109.2	↑ 0.1	↑ 0.09	138,303	1,261	請選擇 ▼
2800	盈富基金	\$ 20.9	↓ 0.06	↓ 0.29	125,782	5,986	請選擇 ▼
3049	XD B滬深三百	\$ 6.52	0	0.00	23,674	3,636	請選擇 ▼
2827	X標智滬深300	\$ 29.6	↓ 0.15	↓ 0.50	11,846	399	請選擇 ▼
2840	SPDR金ETF	\$ 1246	↑ 1	↑ 0.08	6,709	5	請選擇 ▼
2846	X安碩滬深300	\$ 23.55	0	0.00	4,384	187	請選擇 ▼
2816	XD B滬深地產	\$ 10.02	↓ 0.02	↓ 0.20	2,742	273	請選擇 ▼

谢谢!