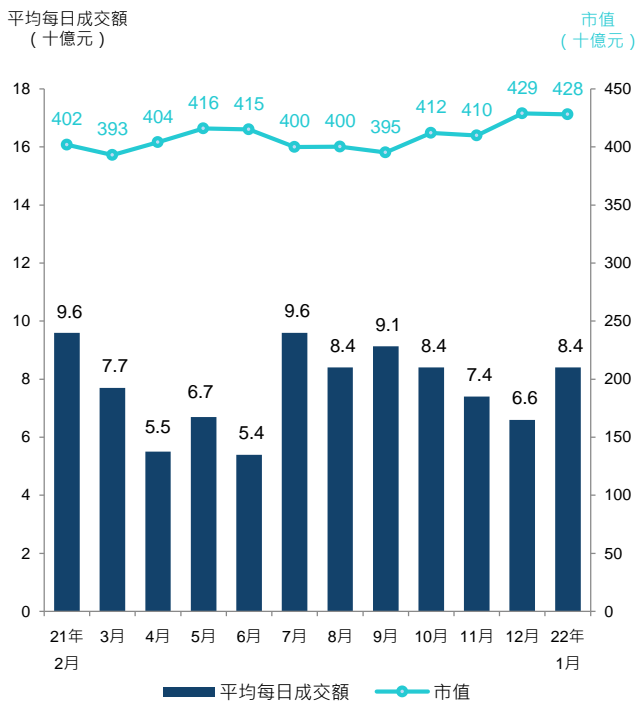


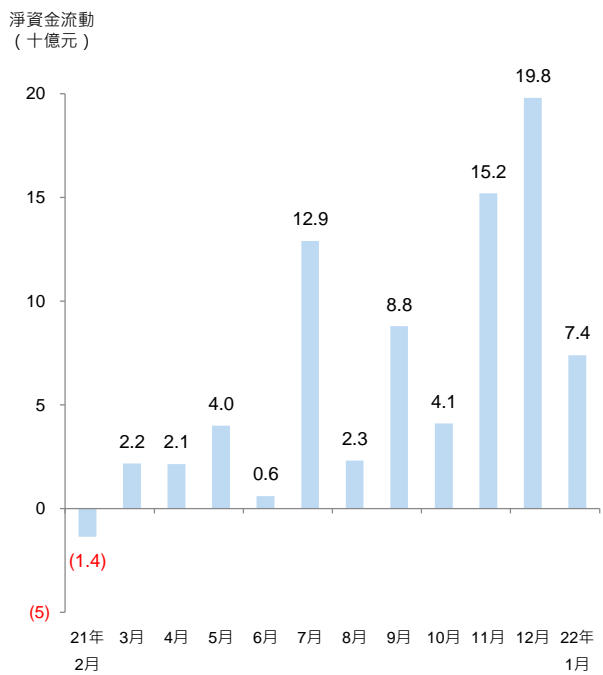
本月焦點

- 2022年1月，交易所買賣基金（ETF）和槓桿及反向產品的平均每日成交金額為84億元，較2021年12月上升27%。
- 截至2022年1月底，ETF和槓桿及反向產品的市值為4,284億元，與2021年12月相若。
- 富邦基金管理（香港）有限公司於2022年1月13日發行兩隻新ETF – 富邦富時台灣RIC權重上限指數ETF（3021）和 富邦ICE FactSet台灣核心半導體指數ETF（3076）。

平均每日成交額及市值

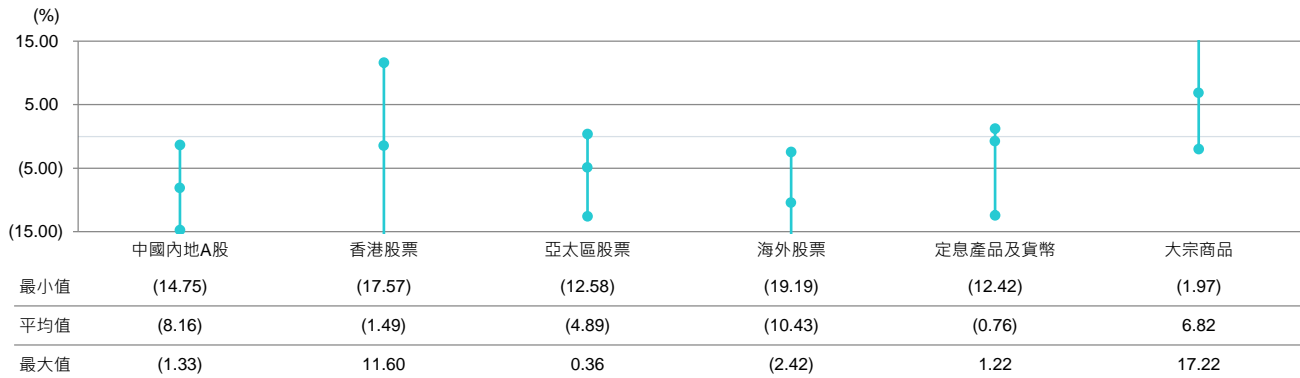


ETF及槓桿及反向產品每月淨資金流動



資產類別比較

2022年1月ETF價格回報 (按資產類別)



- 鐵礦石期貨ETF月內表現領先，主要因為供應緊張以及受來自中國的鐵礦石需求支持。兩隻在香港上市的石油期貨ETF繼續表現良好，主要因為東歐局勢緊張推高油價。
- 相反，受加息陰霾影響，投資於「新經濟」行業的主題式ETF繼續下挫，與生物科技、醫療保健、金融科技和互聯網相關的ETF跌幅尤其明顯。

新上市產品

富邦富時台灣RIC權重上限指數ETF (3021)

投資目標

此ETF目標追蹤富時台灣RIC上限指數的表現。該指數的成份股為台灣大型及中型股票。成份股的指數權重根據自由流通量調整後市值計算。單一成份股的指數權重上限為20%。

產品資料

發行商	富邦基金管理(香港)有限公司
資產總額(截至1月底)	383.40萬美元
上市日期	2022年1月13日
基準	富時台灣RIC上限指數
交易貨幣	港元
資產淨值(截至1月底)	7.47元
收市價(截至1月底)	7.30元
買賣單位	200
經常性開支	1.60%

富邦ICE FACTSET台灣核心半導體指數ETF (3076)

投資目標

此ETF目標反映ICE FactSet台灣核心半導體指數的表現。該指數為以規則為基礎(rules-based)的股票指數。追蹤在臺灣證券交易所或證券櫃檯買賣中心一般板上市之半導體企業表現。

產品資料

發行商	富邦基金管理(香港)有限公司
資產總額(截至1月底)	560.37萬美元
上市日期	2022年1月13日
基準	ICE FactSet台灣核心半導體指數
交易貨幣	港元
資產淨值(截至1月底)	7.40元
收市價(截至1月底)	7.30元
買賣單位	200
經常性開支	1.60%



ETFs 特寫

於1月份表現最佳的三隻ETF：

1 山證國際大商所鐵礦石期貨指數ETF (3047 / 9047)

投資目標

此ETF透過直接投資於大連商品交易所上市的鐵礦石期貨，追蹤大商所鐵礦石期貨價格指數的表現。

產品資料

發行商	山證國際資產管理有限公司
資產總額 (截至1月底)	2,550.07萬美元
上市日期	2020年3月27日
基準	大商所鐵礦石期貨價格指數
交易貨幣	港元 / 美元
資產淨值 (截至1月底)	14.72元
收市價 (截至1月底)	14.70元
買賣單位	100
經常性開支	2.50%

2 GLOBAL X 標普原油期貨增強型ER ETF (3097)

投資目標

此期貨ETF透過直接投資於在紐約商品交易所買賣的西德克薩斯中質原油 (WTI) 期貨合約，追蹤基準指數的表現。

產品資料

發行商	未來資產環球投資(香港)有限公司
資產總額 (截至1月底)	7,362.80萬元
上市日期	2016年6月16日
基準	標普高盛原油增強額外回報指數
交易貨幣	港元
資產淨值 (截至1月底)	4.99元
收市價 (截至1月底)	4.98元
買賣單位	500
經常性開支	1.33%

3 三星標普高盛原油ER期貨ETF (3175)

投資目標

此ETF的基準指數目標反映特定原油期貨投資組合的表現，該組合投資55%於一個月遠期合約，30%於兩個月遠期合約，15%於三個月遠期合約。

產品資料

發行商	三星資產運用(香港)有限公司
資產總額 (截至1月底)	12.67億元
上市日期	2016年4月29日
基準	標普高盛原油多月份期貨合約 55/30/15 1M/2M/3M 指數(美元) ER
交易貨幣	港元
資產淨值 (截至1月底)	6.06元
收市價 (截至1月底)	6.05元
買賣單位	200
經常性開支	1.33%



ETF 表現一覽

2022年1月十大表現最佳ETF

	股份代號	名稱	按月升跌 (%)
1	3047	山證國際大商所鐵礦石期貨指數ETF	17.22
2	3097	Global X 標普原油期貨增強型ER ETF	15.22
3	3175	三星標普高盛原油ER期貨ETF	13.72
4	3143	華夏香港銀行股ETF	11.60
5	3070	中國平安CSI香港高息股ETF	7.59
6	3037	南方東英恒生指數ETF	2.18
7	2800	盈富基金	1.96
8	2833	恒生指數上市基金	1.84
9	3115	iShares安碩核心恒生指數ETF	1.76
10	3110	Global X 恒生高股息率ETF	1.56

2022年1月十大表現最差ETF

	股份代號	名稱	按月升跌 (%)
1	3185	Global X 金融科技ETF	-19.19
2	3174	南方東英中國醫療健康革新指數ETF	-17.57
3	2820	Global X 中國生物科技ETF	-17.19
4	3072	日興資產管理環球互聯網ETF	-16.28
5	3162	南方東英全球智能駕駛指數ETF	-15.95
6	3134	南方東英華泰柏瑞中證光伏產業ETF	-14.75
7	3194	南方東英全球雲計算科技指數ETF	-14.28
8	3023	平安納斯達克人工智能及機械人ETF	-13.89
9	3069	華夏恒生香港生物科技指數ETF	-13.65
10	2845	Global X中國電動車及電池ETF	-13.23

槓桿及反向產品表現一覽

2022年1月三大最佳槓桿及反向產品單日表現

	股份代號	名稱	日期	單日變化
1	7226	南方東英恒生科技指數 每日槓桿(2x)產品	12/1/2022	9.66%
2	7552	南方東英恒生科技指數 每日反向(-2x)產品	5/1/2022	9.64%
3	7226	南方東英恒生科技指數 每日槓桿(2x)產品	20/1/2022	9.16%

2022年1月三大最差槓桿及反向產品單日表現

	股份代號	名稱	日期	單日變化
1	7552	南方東英恒生科技指數 每日反向(-2x)產品	12/1/2022	-9.78%
2	7226	南方東英恒生科技指數 每日槓桿(2x)產品	5/1/2022	-9.53%
3	7552	南方東英恒生科技指數 每日反向(-2x)產品	20/1/2022	-9.23%

甚麼是槓桿及反向產品？

槓桿及反向產品 (L&I 產品) 是ETF的一種。槓桿產品倍大相關指數的單日回報 (香港槓桿產品的最大槓桿倍數為兩倍)，而反向產品的回報就和相關指數的單日回報相反。L&I產品投資衍生工具，例如掉期或期貨。

由於L&I產品屬於短線投資工具，適合每日進行買賣的投資者。如果投資者持有這種產品超過一日，它們的回報可能會偏離預訂的投資目標。



2022年1月ETF / 槓桿及反向產品數目、平均每日成交額及市值

產品類別	相關市場	產品數目	平均每日成交額			市值		
			百萬元	市場佔有率 (%)	按月升跌 (%)	百萬元	市場佔有率 (%)	按月升跌 (%)
ETF	中國內地A股	37	649	7.8	-13	72,901	17.0	-6
	香港股票	21	6,366	76.2	31	211,167	49.3	5
	亞太區股票	20	13	0.2	18	30,600	7.1	0
	其他股票	25	46	0.5	-41	42,829	10.0	-10
	定息產品及貨幣	18	14	0.2	227	52,917	12.4	-1
	商品	6	41	0.5	91	3,516	0.8	-1
	總計		127	7,130	85.4	25	413,929	96.6
槓桿及反向產品	香港股票	11	1,122	13.4	36	8,922	2.1	-2
	其他股票	8	69	0.8	76	3,026	0.7	18
	商品	3	8	0.1	39	1,740	0.4	-8
	中國內地A股	6	22	0.3	73	816	0.2	-3
	總計		28	1,220	14.6	39	14,505	3.4
總計		155	8,351	100	27	428,434	100	0

註

1. 所有金額均以港元為單位。
2. 交易所買賣基金與槓桿及反向產品市場概覽所載資料只包括于香港交易所證券市場上市及交易的的ETF與槓桿及反向產品。多櫃台ETF / 槓桿及反向產品只作一隻ETF / 槓桿及反向產品計算，市值並不包括SPDR金ETF。十大表現只包括上市及交易的ETF并以收市價計算，多櫃台ETF的表現只包括港元櫃台。所有數據截至月底。
3. 過去的表现不代表將來之預期。
4. 由於進位原因，本文件的數字不一定準確相加至相關總數。

免責聲明

本文件所載資料僅供參考，不構成提出要約、招攬或建議購買或出售任何證券，亦不構成提出任何投資建議或任何形式的服務。香港交易所及 / 或其附屬公司竭力確保其提供之資料準確可靠，但不保證該等資料絕對正確可靠；對於任何因資料不確或遺漏又或因根據或倚賴本文件所載資料所作決定、行動或不行動而引致之損失或損害，香港交易所及 / 或其附屬公司概不負責（不論是民事侵權行為責任或合約責任或其他）。

