

# 沪市 ETF 投资手册

——服务长期价值投资需求

近年来，围绕“一所连百业、一市跨全球”的发展战略，上交所 ETF 市场实现持续快速发展，截至 2022 年 3 月底，沪市 ETF 市值规模超 1.1 万亿元，标的资产覆盖股票、债券、商品、货币以及境外资产，财富管理功能逐渐显现。

ETF 具备成本低廉、高效透明、分散投资等特点，是进行长期投资、价值投资的重要配置工具。随着境内 ETF 市场的蓬勃发展，投资者参与热情持续高涨。2021 年全年参与沪市 ETF 交易的账户数超过 1150 万户，是五年前 50 万左右参与人数的 23 倍，越来越多的机构投资者、长期资金开始进入 ETF 市场，促进 A 股市场长期投资、价值投资风气形成。

价值投资和长期投资是资本市场发展的基石，长期来看，投资的最终收益来自于经历时间沉淀的内在价值增长。为便于投资者更好地运用 ETF 进行长期投资，了解沪市 ETF 产品布局，我们制作了上交所 ETF 投资手册，供广大投资者参考。

## **一、宽基 ETF**

宽基 ETF 主要跟踪上证 50、沪深 300、中证 500、科创 50、MSCI 中国 A50、中证 1000 等宽基指数，成分股覆盖范围较广，市场表征作用良好。投资者通过购买宽基 ETF 可有效跟踪 A 股市场的整体走势，并有效分散风险，降低某一个股或者行业权重过高导致的非系统性风险。

<b>上证50</b>	<b>科创50</b>	<b>沪深300</b>	<b>中证500</b>
7只 516亿元	8只 413亿元	19只 963亿元	16只 504亿元
<b>中证100</b>	<b>上证180</b>	<b>中证800</b>	<b>中证1000</b>
2只 4亿元	1只 200亿元	5只 21亿元	2只 18亿元
<b>上证综指</b>	<b>上证380</b>	<b>沪港深300</b>	<b>沪港深500</b>
2只 9亿元	1只 2亿元	2只 21亿元	5只 17亿元
<b>MSCI中国 A50互联互通</b>	<b>MSCI中国A股 国际通实时</b>	<b>企业核心 竞争力50</b>	<b>科创创业50</b>
2只 179亿元	6只 22亿元	1只 1.12亿元	7只 77亿元

表 1 沪市宽基 ETF 代表性产品

跟踪指数	证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
上证 50	510050	上证 50ETF	华夏基金	492.99
	510100	上证 50ETF 易方达	易方达基金	8.11
	510800	50ETF 基金	建信基金	5.88
	510710	上证 50ETF 博时	博时基金	5.87
科创 50	588000	科创 50ETF	华夏基金	223.30
	588080	科创板 50ETF	易方达基金	104.11
	588050	科创 ETF	工银瑞信基金	38.59
	588090	科创板 ETF	华泰柏瑞基金	27.36
	588180	科创 50ETF 基金	国联安基金	14.81
沪深 300	510300	沪深 300ETF	华泰柏瑞基金	434.53
	510330	300ETF 基金	华夏基金	220.33
	510310	沪深 300ETF 易方达	易方达基金	93.90
	515330	300ETF 天弘	天弘基金	60.29
	515380	泰康沪深 300ETF	泰康资产	38.73
	510350	工银沪深 300ETF	工银瑞信基金	31.31
	510380	国寿 300ETF	国寿安保基金	24.27
	561300	300 增强 ETF	国泰基金	15.38
	510360	沪深 300ETF 基金	广发基金	13.88
	515390	华安沪深 300ETF	华安基金	7.69
	510390	平安沪深 300ETF	平安基金	7.22
515660	国联安沪深 300ETF	国联安基金	5.69	
中证 500	510500	中证 500ETF	南方基金	388.12

	512500	500ETF 基金	华夏基金	40.04
	510510	中证 500ETF 基金	广发基金	27.56
	510580	中证 500ETF 易方达	易方达基金	16.57
	561550	500 增强 ETF	华泰柏瑞基金	9.33
	510590	平安中证 500ETF	平安基金	7.01
	512510	中证 500 指数 ETF	华泰柏瑞基金	5.43
中证 100	512910	中证 100ETF	广发基金	3.36
上证 180	510180	上证 180ETF	华安基金	199.56
中证 800	515800	800ETF	汇添富基金	18.15
中证 1000	512100	中证 1000ETF	南方基金	17.71
上证综指	510210	上证指数 ETF	富国基金	6.90
上证 380	510290	上证 380ETF	南方基金	1.85
沪港深 300	517300	沪港深 300ETF	国寿安保基金	20.98
沪港深 500	517000	沪港深 500ETF	银华基金	6.09
	517080	沪港深 500ETF 基金	汇添富基金	5.61
MSCI 中国 A50 互联互通	560050	MSCI 中国 A50ETF	汇添富基金	94.73
	563000	中国 A50ETF	易方达基金	84.30
MSCI 中国 A 股国际通实时	515160	MSCI 中国招商 ETF	招商基金	6.53
	512160	MSCI 中国 A 股 ETF	南方基金	5.01
企业核心竞争力 50	561500	漂亮 50ETF	华泰柏瑞基金	1.12
科创创业 50	588380	创 50ETF	富国基金	19.13
	588400	双创 50ETF	嘉实基金	19.01
	588300	双创 ETF	招商基金	16.72
	588330	双创龙头 ETF	华宝基金	12.03
	588360	科创创业 ETF	国泰基金	5.79

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元或标的指数产品规模排名第一的沪市宽基 ETF

## 二、行业主题 ETF

行业主题类 ETF 以行业、主题指数为标的指数，反映了特定行业分类、概念主题、地域主题、事件主题等维度的整体走势。

目前沪市行业 ETF 布局已基本完成，主题 ETF 涵盖了央企改革、新能源、消费、芯片、5G、ESG 等热门主题，产品布局全面，紧扣市场热点，满足投资者多样化配置需求。



表 2 沪市行业主题 ETF 代表性产品

证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
512880	证券 ETF	国泰基金	319.45
512000	券商 ETF	华宝基金	227.22
510880	红利 ETF	华泰柏瑞基金	181.91
515790	光伏 ETF	华泰柏瑞基金	146.75
512170	医疗 ETF	华宝基金	126.67
512760	芯片 ETF	国泰基金	115.94
512660	军工 ETF	国泰基金	108.63
512480	半导体 ETF	国联安基金	101.21
512800	银行 ETF	华宝基金	98.00
515050	5GETF	华夏基金	95.11
515030	新能源车 ETF	华夏基金	91.65
516970	基建 50ETF	广发基金	88.38
512900	证券 ETF 基金	南方基金	76.33
512010	医药 ETF	易方达基金	75.07
515290	银行 ETF 天弘	天弘基金	69.68
510810	上海国企 ETF	汇添富基金	67.05
512690	酒 ETF	鹏华基金	58.68
515700	新能源车 ETF	平安基金	58.15

512960	央调 ETF	博时基金	54.01
512950	央企改革 ETF	华夏基金	50.19
515900	央创 ETF	博时基金	47.13
512980	传媒 ETF	广发基金	43.28
512710	军工龙头 ETF	富国基金	41.85
515000	科技 ETF	华宝基金	37.57
512400	有色金属 ETF	南方基金	36.73
512070	证券保险 ETF	易方达基金	36.47
510230	金融 ETF	国泰基金	35.51
512290	生物医药 ETF	国泰基金	33.87
515220	煤炭 ETF	国泰基金	31.45
512680	军工 ETF 基金	广发基金	31.06
515170	食品饮料 ETF	华夏基金	28.09
512200	房地产 ETF	南方基金	27.26
516150	稀土 ETF 基金	嘉实基金	24.92
516160	新能源 ETF	南方基金	24.87
512700	银行 ETF 基金	南方基金	23.29
512580	碳中和龙头 ETF	广发基金	21.40
517160	长江保护主题 ETF	南方基金	18.86
517330	长江保护 ETF	易方达基金	18.51
512670	国防 ETF	鹏华基金	18.36
515680	嘉实央企创新 ETF	嘉实基金	17.51
515600	央企创新 ETF	广发基金	16.92
515880	通信 ETF	国泰基金	16.30
515180	红利 ETF 易方达	易方达基金	16.15
515210	钢铁 ETF	国泰基金	15.85
515120	创新药 ETF	广发基金	14.15
515650	消费 50ETF	富国基金	12.39
516780	稀土 ETF	华泰柏瑞基金	11.17
516950	基建 ETF	银华基金	10.14
516880	光伏 50ETF	银华基金	10.13
515710	食品 ETF	华宝基金	9.86
515010	券商 ETF 基金	华夏基金	9.14
515080	中证红利 ETF	招商基金	8.92
516820	医疗创新 ETF	平安基金	8.15
512720	计算机 ETF	国泰基金	8.02
515150	一带一路 ETF	富国基金	7.34

515070	人工智能 AIETF	华夏基金	7.29
510150	消费 ETF	招商基金	6.99
512820	银行业 ETF	汇添富基金	6.82
515250	智能汽车 ETF	富国基金	6.71
515750	科技 50ETF	富国基金	6.51
562800	稀有金属 ETF	嘉实基金	6.49
515020	银行 ETF 华夏	华夏基金	6.43
560800	数字经济 ETF	鹏扬基金	6.35
517050	互联网 50ETF	华泰柏瑞基金	6.14
516050	科技龙头 ETF	工银瑞信基金	5.88
512560	军工 ETF 易方达	易方达基金	5.84
516640	芯片龙头 ETF	富国基金	5.35
512600	必选消费 ETF	嘉实基金	5.28
516070	碳中和 50ETF	易方达基金	5.20
516660	新能源汽车 ETF	华安基金	5.10
512330	信息技术 ETF	南方基金	5.10

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元的沪市行业主题 ETF

表 3 中证一级行业代表性 ETF 产品

中证行业	证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
能源	515220	煤炭 ETF	国泰基金	31.45
原材料	512400	有色金属 ETF	南方基金	36.73
	516150	稀土 ETF 基金	嘉实基金	24.92
	515210	钢铁 ETF	国泰基金	15.85
	516780	稀土 ETF	华泰柏瑞基金	11.17
	562800	稀有金属 ETF	嘉实基金	6.49
工业	512660	军工 ETF	国泰基金	108.63
	516970	基建 50ETF	广发基金	88.38
	512710	军工龙头 ETF	富国基金	41.85
	512680	军工 ETF 基金	广发基金	31.06
	512670	国防 ETF	鹏华基金	18.36
	516950	基建 ETF	银华基金	10.14
	512560	军工 ETF 易方达	易方达基金	5.84
可选消费	562510	旅游 ETF	华夏基金	1.67
主要消费	512690	酒 ETF	鹏华基金	58.68

	515170	食品饮料 ETF	华夏基金	28.09	
	515710	食品 ETF	华宝基金	9.86	
医药卫生	512170	医疗 ETF	华宝基金	126.67	
	512010	医药 ETF	易方达基金	75.07	
	512290	生物医药 ETF	国泰基金	33.87	
	515120	创新药 ETF	广发基金	14.15	
	516820	医疗创新 ETF	平安基金	8.15	
	金融	512880	证券 ETF	国泰基金	319.45
512000		券商 ETF	华宝基金	227.22	
512800		银行 ETF	华宝基金	98.00	
512900		证券 ETF 基金	南方基金	76.33	
515290		银行 ETF 天弘	天弘基金	69.68	
512070		证券保险 ETF	易方达基金	36.47	
510230		金融 ETF	国泰基金	35.51	
512700		银行 ETF 基金	南方基金	23.29	
515010		券商 ETF 基金	华夏基金	9.14	
512820		银行业 ETF	汇添富基金	6.82	
515020		银行 ETF 华夏	华夏基金	6.43	
信息技术		512760	芯片 ETF	国泰基金	115.94
		512480	半导体 ETF	国联安基金	101.21
	512720	计算机 ETF	国泰基金	8.02	
	512330	信息技术 ETF	南方基金	5.10	
	516640	芯片龙头 ETF	富国基金	5.35	
通信服务	512980	传媒 ETF	广发基金	43.28	
	515880	通信 ETF	国泰基金	16.30	
房地产	512200	房地产 ETF	南方基金	27.26	

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元或行业排名第一的沪市行业主题 ETF

### 三、跨境 ETF

跨境 ETF 是指主要以境外市场指数为跟踪标的，在境内证券交易所上市的 ETF 产品。跨境 ETF 为境内投资者提供了投资境外市场的便利渠道，投资者无需开立境外股票账户即可通过 ETF 参与境外市场投资，是进行全球资产配置的重要工具。截



至 2022 年 3 月底，在沪市上市交易的跨境 ETF 共有 40 只，主要跟踪中国香港、美国、德国、日本、法国市场主要指数。



表 4 沪市跨境 ETF 代表性产品

地区	证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
中国香港、美国	513050	中概互联网 ETF	易方达基金	372.92
中国香港	513330	恒生互联网 ETF	华夏基金	238.39
	510900	H 股 ETF	易方达基金	101.76
	513180	恒生科技指数 ETF	华夏基金	90.15
	513130	恒生科技 ETF	华泰柏瑞基金	48.90
	513550	港股通 50ETF	华泰柏瑞基金	31.15
	513010	恒生科技 30ETF	易方达基金	26.40
	513060	恒生医疗 ETF	博时基金	23.93
	513660	恒生 ETF	华夏基金	19.54
	513090	香港证券 ETF	易方达基金	10.90
	513600	恒生指数 ETF	南方基金	5.87
美国	513980	港股科技 50ETF	景顺长城基金	5.08
	513500	标普 500ETF	博时基金	140.08
	513100	纳指 ETF	国泰基金	42.46
	513300	纳斯达克 ETF	华夏基金	6.77
日本	513000	日经 225ETF 易方达	易方达基金	0.61
法国	513080	法国 CAC40ETF	华安基金	0.59
德国	513030	德国 ETF	华安基金	6.49

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元或地区规模排名第一的沪市跨境 ETF

## 四、黄金 ETF

黄金 ETF 绝大部分基金资产投资于黄金现货，具有低成本投资黄金、可以提取黄金实物、投资效率高等特点。截至 2022 年 3 月底，沪市黄金 ETF 共计 8 只，规模合计 129.78 亿元。

表 5 沪市黄金 ETF 代表性产品

证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
518880	黄金 ETF	华安基金	116.74
518800	黄金基金 ETF	国泰基金	6.35

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元的沪市商品 ETF

## 五、货币 ETF

货币 ETF 主要投资于货币市场工具，参与方式较为灵活，既可以在二级市场交易也可以在场内进行申赎，是闲置资金实现稳健增值的现金管理工具。截至 2022 年 3 月底，沪市货币 ETF 共计 24 只，规模合计 3220.20 亿元。

表 6 货币 ETF 代表性产品

证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
511990	华宝添益 ETF	华宝基金	1538.61
511880	银华日利 ETF	银华基金	1267.05
511660	货币 ETF 建信添益	建信基金	256.02

数据来源：Wind，选取规模超 100 亿元的沪市货币 ETF

## 六、债券 ETF

债券 ETF 以债券指数为跟踪标的。通过投资债券 ETF，投资者可以便捷地实现对一篮子债券的投资。截至 2022 年 3 月底，

沪市债券 ETF 共有 11 只，底层产品包括短融、公司债、国债、地方债、可转债、城投债等。



表 7 债券 ETF 代表性产品

证券代码	基金简称	基金管理人	基金规模 (亿元)
511360	短融 ETF	海富通基金	59.07
511030	公司债 ETF	平安基金	52.58
511220	城投债 ETF	海富通基金	12.39
511020	活跃国债 ETF	平安基金	11.75
511380	可转债 ETF	博时基金	8.00
511260	十年国债 ETF	国泰基金	7.57
511010	国债 ETF	国泰基金	7.42
511270	10 年地方债 ETF	海富通基金	7.02
511060	5 年地方债 ETF	海富通基金	5.59

数据来源：Wind，选取规模超 5 亿元的沪市债券 ETF