

深证红利交易型开放式指数证券投资基金

[2013] 第二季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的完整性、准确性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2013年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核后的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内基金费用未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 深证红利 ETF(场内简称,深红利)

交易代码 159905

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2010年11月5日

报告期末基金份额总额 1,583,443,951.00份

投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数的投资收益相匹配。

投资策略 本基金主要通过完全复制法,即按照标的指数的构成比例及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股价格的变动进行调整。

投资基准 业绩比较基准 深证红利指数

业绩比较基准指代数 指数

风险收益特征 大盘蓝筹股为投资对象,主要投资于深证综合指数、沪深300指数、深证成分指数、深证100指数等具有高流动性和高预期收益率特征的指数,并以此为基准进行投资。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 -31,430,613.11

2.本期利润 -102,221,351.73

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0733

4.期末基金份额净值 1,004,244,294.35

5.期末基金份额总额 0.6342

注:1.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所示数字。

2.本期已实现收益“本基金本期利息收入、投资收益、其他收入,不含公允价值变动收益”扣除相关费用后的余额;“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.所列数据截至到2013年6月30日。

4.基金净值的计算公式:

5.基金净值的计算公式:

注:1.合计项不包含可替代估值增值项;

2.由于五舍六入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

4.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 万科A 20,471,403 201,643,319.55 20.08

2 万向德农 5,346,128 133,973,967.68 13.34

3 美的电器 4,771,362 59,260,316.04 5.90

4 中国重汽 1,008,955 57,912,935.20 5.77

5 中联重科 10,043,922 54,538,496.46 5.43

6 河钢股份 1,641,759 39,041,029.02 3.89

7 中国宝安 262,911,212.06 26.18

8 中国国电 2,672,420 29,968,947.20 2.98

9 中国神华 2,078,383 28,353,634.08 2.82

10 中国石化 2,915,709 24,696,055.23 2.46

注:5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股票投资明细

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

5.3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名债券投资明细

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.3.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

5.3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股指期货投资明细

5.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名国债投资明细

5.3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产组合投资明细

5.3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名衍生品投资明细

5.3.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名黄金投资明细

5.3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名其他投资明细

5.3.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他投资明细

5.3.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他投资明细

5.3.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他投资明细

5.3.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细

5.3.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他债权投资明细

5.3.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细

5.3.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他债权投资明细

5.3.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.47 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.48 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细

5.3.49 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他债权投资明细

5.3.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.52 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.53 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.54 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.55 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.56 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.57 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细

5.3.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他债权投资明细

5.3.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.60 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.61 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.62 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.63 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.64 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.65 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细

5.3.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的其他债权投资明细

5.3.68 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的股权投资明细

5.3.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的股权投资明细

5.3.70 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的股权投资明细

5.3.71 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的债权投资明细

5.3.72 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的债权投资明细

5.3.73 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向基金的债权投资明细

5.3.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向股票的其他债权投资明细

5.3.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名未投向债券的其他债权投资明细