

深证红利交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

2.由于四舍五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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 矿采业 - -

C 制造业 802,421,474.07 61.89

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 6,666,980.00 0.51

E 建筑业 - -

F 批发业、零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 在制品、仓储业 - -

I 信息技术、软件和信息技术服务业 - -

J 钢铁业 201,299,020.04 8.83

K 纺织、服装、皮革、皮毛业 153,734,682.00 11.98

L 食品、饮料和烟草制造业 35,951,762.00 2.77

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 国际贸易、旅游和租赁业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 1,294,947,989.01 99.11

注:由于四舍五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。

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 000661 恒生电子 2,882,324 199,523,310.00 12.23

2 000333 中国银行 3,097,621 167,525,858.00 12.15

3 000988 五粮液 1,107,631 130,496,079.45 10.08

4 300088 中国国航 2,368,406 84,951,176.30 6.58

5 000022 中国银行 2,890,299 79,794,043.00 6.15

6 000001 中国平安 5,065,406 69,663,030.00 5.57

7 002815 申万宏源 2,167,583 69,506,131.14 4.90

8 002204 中国银行 341,826 41,163,827.20 3.21

9 000668 中国银行 473,928 36,289,580.07 2.96

10 000277 中信银行 6,799,100 36,061,762.01 2.77

5.2.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000972 京东方A 743 80,927,926.00 0.01

2 200694 朗科科技 791 31,803.31 0.00

3 300798 中信出版 1,566 23,100.60 0.00

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有的基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期初基金份额总额 528,443,951.00

报告期期间内单一投资者持有的基金份额 369,000,000.00

报告期末基金份额总额 199,000,000.00

报告期初基金份额持有人数 708,443,951.00

报告期末基金份额持有人数 5

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额 528,443,951.00

报告期期间基金份额变动 369,000,000.00

报告期末基金份额总额 199,000,000.00

报告期基金份额变动次数 1

报告期基金份额变动原因 其他

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有所本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予基金募集注册的文件;

2.《深证红利交易型开放式指数证券投资基金》、《证券投资基金托管协议》;

3.《深证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件和营业执照;

5.基金托管人业务资格批件和营业执照;

6.报告期内基金费用的支付凭证;

7.基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要;

8.基金定期报告、半年度报告和年度报告;

9.临时公告、澄清公告;

10.基金半年度报告、年度报告中的“影响投资者决策的重要信息”等专章;

11.基金季度报告、中期报告中的“影响投资者决策的重要信息”等专章;

12.基金上市公告书;

13.基金销售机构的合法合规证明;

14.基金宣传推介材料;

15.基金募集申请表、基金备案材料、基金产品资料概要;

16.基金销售机构的合法合规证明;

17.基金销售机构的合法合规证明;

18.基金销售机构的合法合规证明;

19.基金销售机构的合法合规证明;

20.基金销售机构的合法合规证明;

21.基金销售机构的合法合规证明;

22.基金销售机构的合法合规证明;

23.基金销售机构的合法合规证明;

24.基金销售机构的合法合规证明;

25.基金销售机构的合法合规证明;

26.基金销售机构的合法合规证明;

27.基金销售机构的合法合规证明;

28.基金销售机构的合法合规证明;

29.基金销售机构的合法合规证明;

30.基金销售机构的合法合规证明;

31.基金销售机构的合法合规证明;

32.基金销售机构的合法合规证明;

33.基金销售机构的合法合规证明;

34.基金销售机构的合法合规证明;

35.基金销售机构的合法合规证明;

36.基金销售机构的合法合规证明;

37.基金销售机构的合法合规证明;

38.基金销售机构的合法合规证明;

39.基金销售机构的合法合规证明;

40.基金销售机构的合法合规证明;

41.基金销售机构的合法合规证明;

42.基金销售机构的合法合规证明;

43.基金销售机构的合法合规证明;

44.基金销售机构的合法合规证明;

45.基金销售机构的合法合规证明;

46.基金销售机构的合法合规证明;

47.基金销售机构的合法合规证明;

48.基金销售机构的合法合规证明;

49.基金销售机构的合法合规证明;

50.基金销售机构的合法合规证明;

51.基金销售机构的合法合规证明;

52.基金销售机构的合法合规证明;

53.基金销售机构的合法合规证明;

54.基金销售机构的合法合规证明;

55.基金销售机构的合法合规证明;

56.基金销售机构的合法合规证明;

57.基金销售机构的合法合规证明;

58.基金销售机构的合法合规证明;

59.基金销售机构的合法合规证明;

60.基金销售机构的合法合规证明;

61.基金销售机构的合法合规证明;

62.基金销售机构的合法合规证明;

63.基金销售机构的合法合规证明;

64.基金销售机构的合法合规证明;

65.基金销售机构的合法合规证明;

66.基金销售机构的合法合规证明;

67.基金销售机构的合法合规证明;

68.基金销售机构的合法合规证明;

69.基金销售机构的合法合规证明;

70.基金销售机构的合法合规证明;

71.基金销售机构的合法合规证明;

72.基金销售机构的合法合规证明;

73.基金销售机构的合法合规证明;

74.基金销售机构的合法合规证明;

75.基金销售机构的合法合规证明;

76.基金销售机构的合法合规证明;

77.基金销售机构的合法合规证明;

78.基金销售机构的合法合规证明;

79.基金销售机构的合法合规证明;

80.基金销售机构的合法合规证明;

81.基金销售机构的合法合规证明;

82.基金销售机构的合法合规证明;

83.基金销售机构的合法合规证明;

84.基金销售机构的合法合规证明;

85.基金销售机构的合法合规证明;

86.基金销售机构的合法合规证明;

87.基金销售机构的合法合规证明;

88.基金销售机构的合法合规证明;

89.基金销售机构的合法合规证明;

90.基金销售机构的合法合规证明;

91.基金销售机构的合法合规证明;

92.基金销售机构的合法合规证明;

93.基金销售机构的合法合规证明;

94.基金销售机构的合法合规证明;

95.基金销售机构的合法合规证明;

96.基金销售机构的合法合规证明;

97.基金销售机构的合法合规证明;

98.基金销售机构的合法合规证明;

99.基金销售机构的合法合规证明;