

建信中证 800 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 16 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 17 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中证 800ETF 基金
场内简称	ZZ800
基金主代码	515620
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 17 日
报告期末基金份额总额	75,157,721.00 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。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 800 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年4月17日-2020年6月30日）
1. 本期已实现收益	3,585,111.47
2. 本期利润	7,696,918.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0326
4. 期末基金资产净值	80,339,330.99
5. 期末基金份额净值	1.0689

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

2、所述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要低于所列数字。

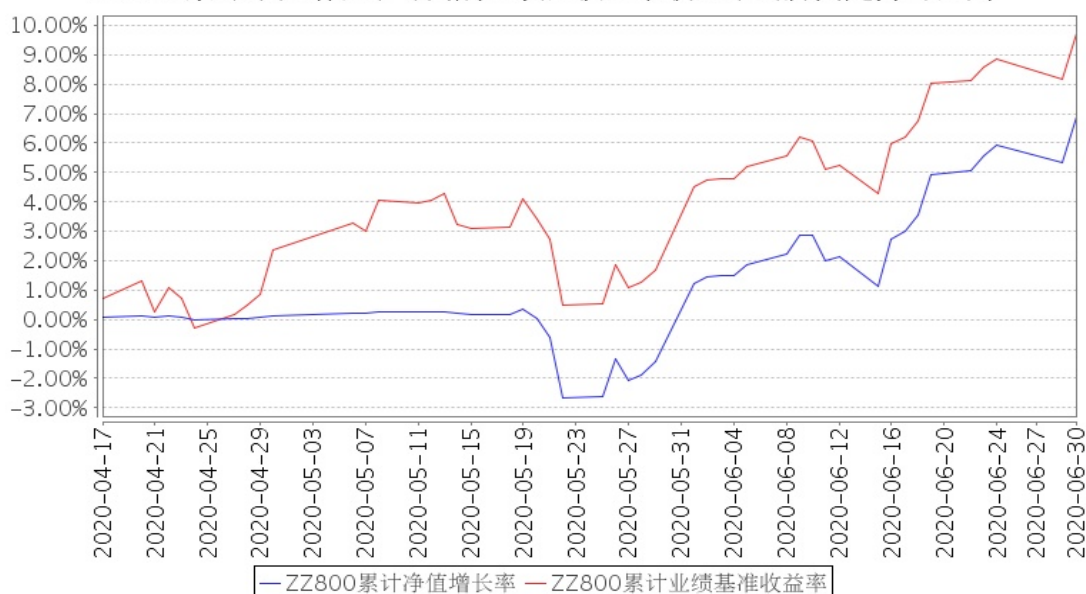
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	6.89%	0.71%	9.70%	0.85%	-2.81%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

ZZ800 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2020 年 4 月 17 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚佳佳	本基金的基金经理	2020 年 4 月 17 日	-	7 年	龚佳佳先生，硕士。2012 年 7 月至 2014 年 10 月在诺安基金管理有限公司数量投资部担任研究员、基金经理助理；2014 年 10 月至 2015 年 3 月在工银瑞信基金管理有限公司指数投资部担任量化研究员；2015 年 3 月至 2018 年 5 月在华夏基金管理有限公司数量投资部担任研究员、投资经理；2018 年 5 月至今在建信基金管理公司金融工程及指数投资部担任基金经理助理。2019 年 2 月 22 日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 7 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2019 年 8 月 23 日起任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 6 日起任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 17 日起任建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 29 日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为被动指数基金，跟踪的标的指数为中证 800 指数。投资策略上主要采用完全复制法，即根据指数的成分股分布确定组合的持仓结构，同时还对少量仓位采用了股指期货替代。

本基金成立于 2020 年 4 月 17 日，本报告期基金还处于建仓期。后续，本管理人将在基金建仓期满后，力争将基金的跟踪误差和跟踪偏离度控制在业内较低水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 6.89%，波动率 0.71%，业绩比较基准收益率 9.70%，波动率 0.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	74,343,544.29	89.00

	其中：股票	74,343,544.29	89.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,329.80	0.00
	其中：债券	1,329.80	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,338,777.63	9.98
8	其他资产	845,888.19	1.01
9	合计	83,529,539.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	985,191.00	1.23
B	采矿业	1,745,210.00	2.17
C	制造业	38,115,165.81	47.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,526,832.80	1.90
E	建筑业	1,338,690.00	1.67
F	批发和零售业	1,656,433.60	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,888,334.30	2.35
H	住宿和餐饮业	58,191.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,601,235.54	5.73
J	金融业	16,198,872.76	20.16
K	房地产业	2,693,915.60	3.35
L	租赁和商务服务业	1,072,236.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	496,911.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	168,963.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	88,710.00	0.11
Q	卫生和社会工作	770,701.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	628,697.00	0.78
S	综合	158,966.00	0.20
	合计	74,193,256.41	92.35

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	1,266.00	0.00
C	制造业	104,532.00	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,111.04	0.01
E	建筑业	694.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,055.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,072.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,967.84	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	546.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,677.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	367.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	150,287.88	0.19

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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

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	601318	中国平安	39,800	2,841,720.00	3.54
2	600519	贵州茅台	1,800	2,633,184.00	3.28
3	600036	招商银行	37,813	1,275,054.36	1.59
4	000858	五粮液	7,400	1,266,288.00	1.58
5	600276	恒瑞医药	13,700	1,264,510.00	1.57
6	000333	美的集团	18,600	1,112,094.00	1.38
7	000651	格力电器	18,200	1,029,574.00	1.28
8	002475	立讯精密	14,839	761,982.65	0.95
9	600030	中信证券	31,200	752,232.00	0.94
10	601166	兴业银行	46,000	725,880.00	0.90

5.3.2 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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	408	40,922.40	0.05
2	600763	通策医疗	100	16,677.00	0.02
3	002049	紫光国微	200	14,550.00	0.02
4	600956	新天绿能	2,026	10,211.04	0.01
5	600536	中国软件	100	7,920.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,329.80	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,329.80	0.00

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113583	益丰转债	10	1,329.80	0.00

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2007	IF2007	2	2,470,800.00	105,360.00	-
IC2007	IC2007	2	2,319,760.00	73,920.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					179,280.00
股指期货投资本期收益 (元)					313,514.56
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					179,280.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	843,076.11

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,812.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	845,888.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年4月17日)基金份额总额	321,157,721.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	246,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	75,157,721.00

§ 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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 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、中国证监会批准建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2020 年 7 月 20 日