

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：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 07 月 17 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 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 8 日
报告期末基金份额总额	2,697,437,198.00 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。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 800 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

注：扩位证券简称为 800ETF。

§ 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 1 日-2020 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	22,256,694.79
2. 本期利润	523,641,616.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1297
4. 期末基金资产净值	2,811,387,886.87
5. 期末基金份额净值	1.0422

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。

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。

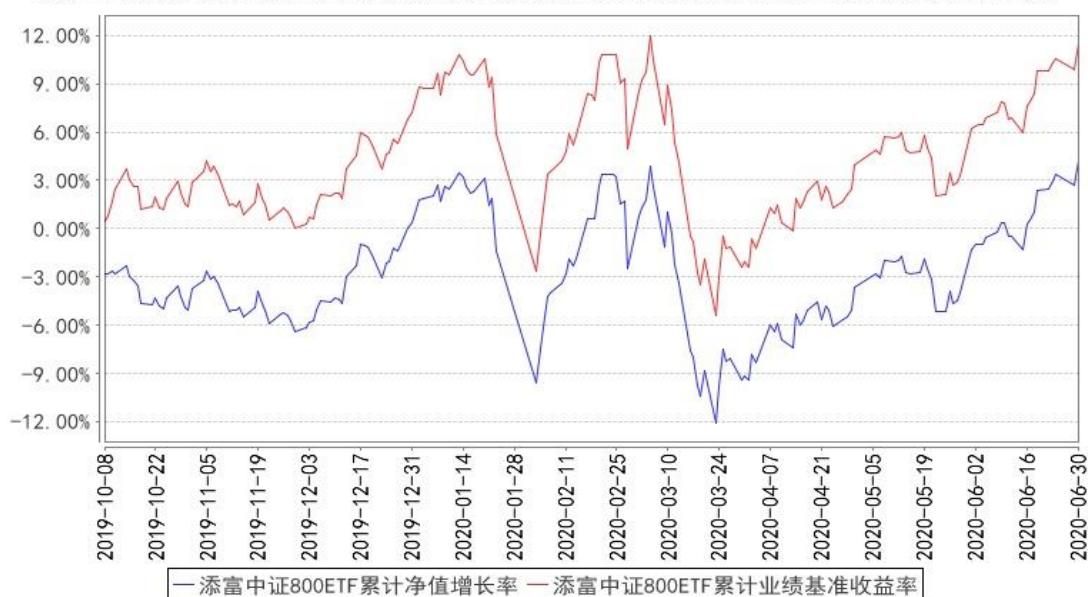
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	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
过去三个月	14.75%	0.93%	13.79%	0.92%	0.96%	0.01%
过去六个月	3.80%	1.56%	3.94%	1.56%	-0.14%	0.00%
自基金合同 生效起至今	4.22%	1.34%	11.44%	1.34%	-7.22%	0.00%

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

添富中证800ETF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《基金合同》生效之日为 2019 年 10 月 08 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 10 月 08 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 8 日	-	6 年	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至今任添富中证银行 ETF 联接的基金经理，2019 年 7 月 26 日至今任添富中证长三角 ETF 的基金经理，2019 年 10 月 8 日至今任添富中证 800ETF 的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理	2019 年 10 月 8 日	-	9 年	国籍：中国，学历：中国科学技术大学金融工程博士研究生，相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司任基金经理助理，2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生

					ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金、汇添富中证主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300ETF 基金、汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技指数 (LOF) 基金的基金经理，2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数 (LOF) 基金的基金经理，2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) 基金的基金经理，2018 年 10 月 23 日至今任中证银行 ETF 基金的基金经理，2019 年 3 月 26 日至今任添富中证医药 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 4 月 15 日至今任添富中证银行 ETF 联接基金的基金经理，2019 年 10 月 8 日至今任添富中证 800ETF 基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本报告期未发生本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两

两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司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 26 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

年初新冠病毒爆发的影响在全球仍在持续，各国在防控和复工之间进行不同的政策权衡，疫情反复也对经济复苏形成一定扰动。疫情影响下，美国、日本、欧洲等都已启动多项政策工具为市场注入流动性，各地央行均显著扩表，全球进入全面的流动性宽松态势，多地资本市场表现出疫情恐慌后的反弹行情。

国内来看，疫情防控启动早、控制效果较好，为复工复产奠定了坚实的基础。目前复工复产进度显著快于其他受影响国家，二季度以来国内经济数据显示出持续改善，5 月 PMI 录得 50.6，PMI 在 2 月见底后快速回升并持续 3 个月在荣枯线上方，工业增加值同比增长 4.4%，社会消费品零售总额同比下降 2.8%，固定资产投资 1-5 月累计同比下降 6.3%，总体符合预期，降幅自 3 月以来均持续收窄。基建投资增速恢复，房地产销售改善支撑投资端的韧性，汽车生产和销售都有明显改善。5-6 月尽管疫情在国内少数区域有所反复，引起一定担忧，但并未影响经济整体复苏趋势。

政策面来看，基调以稳为主。按照《政府工作报告》要求，在疫情防控常态化前提下，围绕做好“六稳”工作、落实“六保”任务，狠抓各项政策举措落实落地，着力稳企业保就业，努力实现全年经济社会发展目标。当前货币政策加大对实体经济的支持，同时随着企业新增减负、政府性基金的落实，财政政策将更加积极，这些将为后续经济恢复提供有力支持。

市场上，流动性维持合理充裕，资金利率仍处于较低水平。宏观流动性的充裕有利于推动

资金向股市微观流动性传导，权益市场流动性格局较好，风险偏好有望提升。以北上资金为代表的外资亦在持续加大对 A 股的配置。

上半年 A 股行业分化明显，投资者对疫情冲击下的基本面预期并不明朗，资金更加青睐医药板块、确定性较高的必选消费和中长期行业景气度较高的科技板块。下半年稳增长政策下，地产、基建投资持续回升，基建作为主要抓手，有望进一步发力。若基本面回升至正常水平后，市场交易的逻辑或将从偏防守的确定性逻辑转向对市场整体性投资逻辑。

中证 800 是 A 股市场代表性宽基指数，是整体配置国内权益类资产的优质工具，截至季末市盈率为 14.2 倍，位于近五年来估值的平均水平以下。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 95%~100%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0422 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.75%，业绩比较基准收益率为 13.79%。

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	2,605,872,446.15	90.85
	其中：股票	2,605,872,446.15	90.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	504,700.00	0.02
	其中：债券	504,700.00	0.02
	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	194,684,877.05	6.79
8	其他资产	67,146,074.58	2.34
9	合计	2,868,208,097.78	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 68,628,387.00 元，占期末基

金资产净值比例 2.44%。

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	35,046,593.00	1.25
B	采矿业	62,110,382.00	2.21
C	制造业	1,319,174,932.83	46.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,371,667.38	1.93
E	建筑业	46,980,392.00	1.67
F	批发和零售业	56,662,709.80	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	68,563,569.90	2.44
H	住宿和餐饮业	2,146,961.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	153,466,692.80	5.46
J	金融业	584,530,075.83	20.79
K	房地产业	95,661,387.52	3.40
L	租赁和商务服务业	41,172,162.00	1.46
M	科学研究和技术服务业	17,980,456.40	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	6,133,794.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,197,499.00	0.11
Q	卫生和社会工作	28,885,349.25	1.03
R	文化、体育和娱乐业	22,716,762.00	0.81
S	综合	5,585,367.00	0.20
	合计	2,604,386,753.71	92.64

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	-	-
C	制造业	1,282,194.35	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,731.77	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业		
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		
O	居民服务、修理和其他服务业		
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	1,485,692.44	0.05

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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	1,426,956	101,884,658.40	3.62
2	600519	贵州茅台	66,703	97,578,484.64	3.47
3	600036	招商银行	1,358,400	45,805,248.00	1.63
4	600276	恒瑞医药	489,202	45,153,344.60	1.61
5	000858	五粮液	256,670	43,921,370.40	1.56
6	000333	美的集团	647,061	38,687,777.19	1.38
7	000651	格力电器	634,740	35,907,241.80	1.28
8	002475	立讯精密	551,946	28,342,427.10	1.01
9	600030	中信证券	1,122,000	27,051,420.00	0.96
10	601166	兴业银行	1,643,700	25,937,586.00	0.92

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	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.03
2	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
3	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
4	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
5	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00

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）	504,700.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,700.00	0.02

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	128112	歌尔转 2	4,326	432,600.00	0.02
2	128115	巨星转债	721	72,100.00	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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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	122	150,718,800.00	7,534,860.00	-
IC2007	IC2007	42	48,714,960.00	1,474,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					9,009,460.00
股指期货投资本期收益（元）					18,140,349.52
股指期货投资本期公允价值变动（元）					33,964,100.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易

活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,944,671.34
2	应收证券清算款	45,118,577.14
3	应收股利	23,709.80
4	应收利息	59,116.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,146,074.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688208	道通科技	768,167.95	0.03	新股流通受限
2	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新股流通受限

3	688377	迪威尔	129,619.48	0.00	新股流通受限
4	688277	天智航	106,072.40	0.00	新股流通受限
5	688027	国盾量子	102,389.40	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,441,437,198.00
报告期期间基金总申购份额	20,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,764,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,697,437,198.00

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	70,034,650.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	70,034,650.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	卖出	2020年6月24日	38,974,200.00	-40,207,778.98	-
2	卖出	2020年6月30日	31,060,450.00	-32,140,171.81	-
合计			70,034,650.00	-72,347,950.79	

注：基金管理人于 2020 年 6 月 24 日场内卖出本基金 38,974,200.00 份，交易费 9,249.92 元；于 2020 年 6 月 30 日场内卖出本基金 31,060,450.00 份，交易费 7,393.94 元；相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	48.48
	2	2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	980,305,370.00	-	245,084,100.00	735,221,270.00	27.26
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 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、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 7 月 21 日