

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银 800
场内简称	中银中证 800ETF
基金主代码	515610
交易代码	515610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 16 日
报告期末基金份额总额	44,857,400.00 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，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重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动进行相应的调整。
业绩比较基准	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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	762,003.32
2.本期利润	-1,468,299.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0469
4.期末基金资产净值	46,832,641.58
5.期末基金份额净值	1.0440

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	-4.02%	1.07%	-4.36%	1.10%	0.34%	-0.03%
过去六个月	0.71%	0.97%	0.12%	1.00%	0.59%	-0.03%
过去一年	7.80%	1.11%	7.99%	1.13%	-0.19%	-0.02%
自基金合同生效日起	4.40%	1.07%	3.50%	1.20%	0.90%	-0.13%

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

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 7 月 16 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
赵建忠	基金经理	2020-07-16	-	15	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 基金基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金基金经理，2020 年 4 月至今任中银 100 基金基金经

					理，2020 年 7 月至今任中银 800 基金基金经理，2020 年 8 月至今任中银黄金基金基金经理，2020 年 9 月至今任中银上海金 ETF 联接基金基金经理，2020 年 11 月至今任中银中证 100ETF 联接基金基金经理。具备基金、期货从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生

异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，全球疫情高位回落，疫苗接种速度边际放缓。美国经济修复速度放缓，服务消费持续修复，商品消费增速边际放缓，失业率 8 月值较 6 月值下降 0.7 个百分点至 5.2%，制造业 PMI 9 月值较 6 月值上升 0.5 个百分点至 61.1，服务业 PMI 9 月值较 6 月值上升 1.8 个百分点至 61.9。美联储大概率 11 月宣布 Taper，基建计划规模两党尚未达成一致，债务上限问题被延期至 12 月。欧元区经济复苏边际放缓，失业率 8 月值较 6 月值回落 0.3 个百分点至 7.5%，制造业 PMI 9 月值较 6 月值回落 4.8 个百分点至 58.6，服务业 PMI 9 月值较 6 月值回落 1.9 个百分点至 56.4。欧央行小幅放缓 PEPP 购债规模，但目前对市场影响有限。日本经济恢复缓慢，岸田文雄就任日本第 100 任首相，应对新冠疫情和重振经济成为新政权的重点课题。

国内经济方面，“能耗双控”背景下供需双弱，经济下行压力加大。具体来看，领先指标中采制造业 PMI 于三季度中枢回落，9 月值回落至 50 以下，较 6 月回落 1.3 个百分点至 49.6，同步指标工业增加值 8 月同比增长 5.3%，较 2021 年 6 月回落 3.0 个百分点。从经济增长动力来看，出口表现相对强劲，消费投资有所回落：8 月美元计价出口增速较 2021 年 6 月回落 6.6 个百分点至 25.6% 左右，仍处于较高位置，8 月消费同比增速大幅回落，较 2021 年 6 月回落 9.6 个百分点至 2.5%，制造业表现好于房地产和基建投资，1-8 月固定资产投资增速较 2021 年二季度末回落 3.7 个百分点至 8.9% 的水平。通胀方面，CPI 震荡回落，8 月同比增速较 2021 年 6 月下降 0.3 个百分点至 0.8%；PPI 继续上行，8 月同比增速较 2021 年 6 月回升 0.7 个百分点至 9.5%。

2. 市场回顾

三季度初期在线教育、互联网、房地产等部分行业受到超预期的严厉监管政策影响而大幅下跌，并带动整体市场的风险偏好下移。叠加前期热度较高的板块部分资金选择获利了结，经过 7 月份的弱势回调之后，8 月初市场震荡反弹，指数随后重回 3500 点上方，月中出现

震荡反复，但月末周期类板块普遍回暖。9 月能源价格、大宗商品价格持续上涨，板块间轮动较快。经济下行压力逐渐加大，美联储 Taper 渐行渐近，部分资金选择滞涨的低估值稳增长板块避险。从各行业来看，采掘（36.60%）、公用事业（25.20%）、有色（23.11%）等行业涨幅居前，食品饮料（-13%）、休闲服务（-13.07%）、医药生物（-13.68%）等行业跌幅较大。最终，沪深 300 等权指数涨跌幅度为-2.8%；中证 100 涨跌幅-9.13%；中证 800 涨跌幅-4.36%；上证国企指数涨跌幅-2.57%。

3. 投资策略和运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-4.02%，同期业绩比较基准收益率为-4.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自 2021 年 7 月 13 日至 2021 年 9 月 16 日已出现连续超过 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	46,105,334.81	97.80
	其中：股票	46,105,334.81	97.80
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	980,710.77	2.08
7	其他各项资产	58,678.22	0.12
8	合计	47,144,723.80	100.00

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务，本基金报告期末未投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	采矿业	-	-
C	制造业	7,964.25	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	685.26	0.00
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	-	-
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	8,649.51	0.02

5.2.2 指数投资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	511,540.80	1.09
B	采矿业	1,415,046.40	3.02
C	制造业	26,106,569.64	55.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,115,161.10	2.38
E	建筑业	802,129.56	1.71
F	批发和零售业	625,963.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,233,403.60	2.63
H	住宿和餐饮业	49,255.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,961,017.80	4.19

J	金融业	8,796,786.10	18.78
K	房地产业	1,062,589.50	2.27
L	租赁和商务服务业	726,870.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	705,121.20	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	109,668.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	40,087.20	0.09
Q	卫生和社会工作	490,788.40	1.05
R	文化、体育和娱乐业	231,565.00	0.49
S	综合	113,123.00	0.24
	合计	46,096,685.30	98.43

注：股票投资合计如与报告期末资产组合情况中期末股票公允价值存在差异是因为本表不考虑可退替代款估值增值。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	1,103	2,018,490.00	4.31
2	600036	招商银行	21,800	1,099,810.00	2.35
3	601318	中国平安	19,100	923,676.00	1.97
4	000858	五粮液	3,400	745,926.00	1.59
5	601012	隆基股份	7,444	613,981.12	1.31
6	000333	美的集团	8,600	598,560.00	1.28
7	300059	东方财富	14,680	504,551.60	1.08
8	603259	药明康德	3,164	483,459.20	1.03
9	601888	中国中免	1,800	468,000.00	1.00
10	601166	兴业银行	25,500	466,650.00	1.00

5.3.2 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	001218	丽臣实业	175	7,964.25	0.02
2	605599	菜百股份	54	685.26	0.00

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 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 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

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，根据风险管理原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,540.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	330.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,807.92
8	其他	-
9	合计	58,678.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 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	001218	丽臣实业	7,964.25	0.02	新股未上市

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	32,857,400.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	44,857,400.00

§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	4,895,200.00
本报告期买入/申购总份额	9,501,700.00
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,396,900.00

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	32.09
--------------------------	-------

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	买入	2021-09-17	9,501,700.00	9,997,942.90	-
合计			9,501,700.00	9,997,942.90	

§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	2021-07-12 至 2021-07-14	540,100.00	60,050,400.00	51,068,300.00	9,522,200.00	21.2277%
	2	2021-09-16 至 2021-09-16	540,100.00	60,050,400.00	51,068,300.00	9,522,200.00	21.2277%
	3	2021-09-23 至 2021-09-30	540,100.00	60,050,400.00	51,068,300.00	9,522,200.00	21.2277%
	4	2021-08-23 至 2021-09-15	4,895,200.00	9,501,700.00	-	14,396,900.00	32.0948%
	5	2021-09-17 至 2021-09-30	4,895,200.00	9,501,700.00	-	14,396,900.00	32.0948%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。</p>							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、法律意见书；

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

9.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇二一年十月二十六日