

信息披露 Disclosure

中证500交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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		222,389,827.03	1.21
B 采矿业		697,589,100.07	3.11
C 制造业		11,612,189,476.45	60.50
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		580,732,586.66	3.03
E 建筑业		428,722,036.82	2.23
F 批发和零售业		976,051,264.86	5.09
G 交通运输、仓储和邮政业		407,233,041.88	2.24
H 住宿和餐饮业		21,540,080.00	0.11
I 信息传输、软件和信息技术服务业		1,244,462,214.03	6.48
J 金融业		284,294,010.89	1.46
K 房地产业		1,065,280,004.85	5.55
L 租赁和商务服务业		289,011,422.29	1.56
M 科学研究和技术服务业		50,147,064.60	0.26
N 水利、环境和公共设施管理业		157,073,363.63	0.82
O 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
P 教育		16,896,102.00	0.09
Q 卫生和社会工作		36,019,015.06	0.19
R 文化、体育和娱乐业		106,569,646.39	1.02
S 综合		84,626,771.53	0.44
合计		18,205,812,768.23	96.72

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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		17,433,556.10	0.09
C 制造业		68,100,941.84	0.36
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		31,068.64	-
E 建筑业		-	-
F 批发和零售业		26,384.45	-
G 交通运输、仓储和邮政业		26,573.91	-
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 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		116,289.00	-
R 文化、体育和娱乐业		94,000.00	-
S 综合		-	-
合计		86,866,282.23	0.46

5.2.2 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有港股通股票投资。

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

中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的小幅偏离。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

本基金本季度跟踪误差为30.16%，并取得了超越标的指数0.64%的跟踪正偏离，较为理想地实现了投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为0.8948元，报告期内，份额净值增长率为8.90%，同期业绩比较基准增长率为9.26%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	146,580,243.07	96.62
2	固定收益	146,580,243.07	96.62
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	-
5	其他资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-
10	其他资产	-	-
11	其他资产	-	-
12	其他资产	-	-
13	其他资产	-	-
14	其他资产	-	-
15	其他资产	-	-
16	其他资产	-	-
17	其他资产	-	-
18	其他资产	-	-
19	其他资产	-	-
20	其他资产	-	-
21	其他资产	-	-
22	其他资产	-	-
23	其他资产	-	-
24	其他资产	-	-
25	其他资产	-	-
26	其他资产	-	-
27	其他资产	-	-
28	其他资产	-	-
29	其他资产	-	-
30	其他资产	-	-
31	其他资产	-	-
32	其他资产	-	-
33	其他资产	-	-
34	其他资产	-	-
35	其他资产	-	-
36	其他资产	-	-
37	其他资产	-	-
38	其他资产	-	-
39	其他资产	-	-
40	其他资产	-	-
41	其他资产	-	-
42	其他资产	-	-
43	其他资产	-	-
44	其他资产	-	-
45	其他资产	-	-
46	其他资产	-	-
47	其他资产	-	-
48	其他资产	-	-
49	其他资产	-	-
50	其他资产	-	-
51	其他资产	-	-
52	其他资产	-	-
53	其他资产	-	-
54	其他资产	-	-
55	其他资产	-	-
56	其他资产	-	-
57	其他资产	-	-
58	其他资产	-	-
59	其他资产	-	-
60	其他资产	-	-
61	其他资产	-	-
62	其他资产	-	-
63	其他资产	-	-
64	其他资产	-	-
65	其他资产	-	-
66	其他资产	-	-
67	其他资产	-	-
68	其他资产	-	-
69	其他资产	-	-
70	其他资产	-	-
71	其他资产	-	-
72	其他资产	-	-
73	其他资产	-	-
74	其他资产	-	-
75	其他资产	-	-
76	其他资产	-	-
77	其他资产	-	-
78	其他资产	-	-
79	其他资产	-	-
80	其他资产	-	-
81	其他资产	-	-
82	其他资产	-	-
83	其他资产	-	-
84	其他资产	-	-
85	其他资产	-	-
86	其他资产	-	-
87	其他资产	-	-
88	其他资产	-	-
89	其他资产	-	-
90	其他资产	-	-
91	其他资产	-	-
92	其他资产	-	-
93	其他资产	-	-
94	其他资产	-	-
95	其他资产	-	-
96	其他资产	-	-
97	其他资产	-	-
98	其他资产	-	-
99	其他资产	-	-
100	其他资产	-	-

注：上表中的股票投资项可含替代款估值增值，而5.2的合计项中不可含替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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		81,419,944.46	56.48
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		1,380,100.00	1.27
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		62,233,054.43	42.41
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 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
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		145,514,269.89	99.16

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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		43,480,028.08	83.71
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		5,718,140.84	11.01
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		940,211.80	1.81
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 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		912,638.49	1.76
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		51,164,566.72	100.13

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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		43,480,028.08	83.71
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		5,718,140.84	11.01
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		940,211.80	1.81
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 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		912,638.49	1.76
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		51,164,566.72	100.13

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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		43,480,028.08	83.71
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		5,718,140.84	11.01
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		940,211.80	1.81
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 教育、体育、新闻及其他服务业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生和社会工作		912,638.49	1.76
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		51,164,566.72	100.13

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资