

(上接B63版)		
3. 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。		
(二) 融通深证100指数基金投资组合报告		
1. 报告期末基金资产组合情况		
序号	项目	金额(元)
1	权益投资	13,333,975,224.45
	其中：股票	13,333,975,224.45
2	固定收益投资	606,481,000.00
	其中：债券	606,481,000.00
	货币市场基金	4,311
3	金融衍生品投资	-
4	买入返售金融资产	-
	其中：买断式回购	-
5	银行存款和结算备付金合计	115,269,742.88
6	其他资产	31,749,060.55
7	合计	14,087,475,027.88
		100.00%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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(%)

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	73,634,310.00	0.52
B	采矿业	479,879,191.52	3.42
C	制造业	789,758,219.98	56.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,334,486.54	0.56
E	建筑业	199,857,653.23	1.42
F	批发和零售业	552,272,199.85	3.93
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	411,332,310.36	2.93
J	金融业	1,453,688,253.71	10.35
K	房地产业	1,380,166,441.71	9.82
L	租赁和商务服务业	67,673,153.92	0.48
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	498,699,290.45	3.55
O	公园、娱乐、休闲和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	132,211,176.30	0.94
S	综合	113,468,536.90	0.81
合计		13,333,975,224.45	94.90

2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.2.1 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)

代码	行业类别	公允价值(元)
A	农、林、渔业	73,634,310.00
B	采矿业	479,879,191.52
C	制造业	789,758,219.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,334,486.54
E	建筑业	199,857,653.23
F	批发和零售业	552,272,199.85
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	411,332,310.36
J	金融业	1,453,688,253.71
K	房地产业	1,380,166,441.71
L	租赁和商务服务业	67,673,153.92
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	498,699,290.45
O	公园、娱乐、休闲和其他服务业	-
P	教育	-
Q	卫生和社会工作	-
R	文化、体育和娱乐业	132,211,176.30
S	综合	113,468,536.90
合计		13,333,975,224.45

2.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

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五名股票投资明细

3.1 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	000002	万科A	88,152,186	804,829,458.18	5.73
2	000651	格力电器	23,332,489	619,710,907.84	4.41
3	002024	苏宁云商	552,272,199.85	3.93	
4	000001	平安银行	42,562,439	505,641,775.32	3.60
5	000776	广深港交所	29,990,320	355,388,399.65	2.53
6	000538	云南白药	2,818,457	329,928,576.42	2.35
7	000888	五粮液	17,994,413	323,899,430.00	2.31
8	000603	中兴通讯	19,152,656	317,934,089.60	2.26
9	000333	美的集团	7,342,675	317,499,267.00	2.26
10	002421	歌尔声学	7,189,229	303,960,602.12	2.16
合计			300,289,160.18	3,777	

3.2 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股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

序号 代码 债券品种 公允价值(元)

序号	代码	债券品种	公允价值(元)
1	000002	国债	-
2	110001	央票	-
3	000003	金融债	606,481,000.00
4	000004	企业债	-
5	000005	公司债	-
6	000006	可转债	-
7	000007	资产支持证券	-
8	000008	债券基金	-
9	000009	货币市场基金	-
10	000010	其他	-
合计			606,481,000.00

4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

序号 代码 债券品种 公允价值(元)

序号	代码	债券品种	公允价值(元)
1	000002	国债	-
2	110001	央票	-
3	000003	金融债	606,481,000.00
4	000004	企业债	-
5	000005	公司债	-
6	000006	可转债	-
7	000007	资产支持证券	-
8	000008	债券基金	-
9	000009	货币市场基金	-
10	000010	其他	-
合计			606,481,000.00

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

序号 代码 债券品种 公允价值(元)

序号	代码	债券品种	公允价值(元)
1	130218	国债	4,600,000
2	130201	国债	800,000
3	130207	国债	400,000
4	120419	国债	300,000
合计			2,943,000

4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

序号 代码 债券品种 公允价值(元)

序号	代码	债券品种	公允价值(元)
1	130218	国债	4,600,000
2	130201	国债	800,000
3	130207	国债	400,000
4	120419	国债	300,000
合计			2,943,000

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

序号 代码 债券品种 公允价值(元)

序号	代码	债券品种	公允价值(元)

<tbl