

# 建信现金添利货币市场基金招募说明书(更新)

2017年第2号

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
二〇一七年十月

【重要提示】  
本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]535号文注册募集。本基金的基金合同于2014年9月17日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2017年9月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人概况

名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
设立日期:2005年9月19日  
法定代表人:许会斌  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228888  
注册资本:人民币2亿元  
建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,65%;美国信安金融服务公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。  
本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东大会依法行使权利,不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总经理等高级管理人员的监督和奖惩权。

公司监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

### (二)主要人员情况

#### 1、董事会成员

许会斌先生,董事长,高级经济师,享受国务院特殊津贴,中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽大财经学院基建财务与信用专业,获学士学位。历任中国建设银行筹资储备部副主任,零售业务部副总经理,个人银行部副总经理,营业部主要负责人、总经理,个人银行业务部总经理,个人银行业务委员会副主任,个人金融部总经理,2006年3月起任中国建设银行河南省分行行长,2011年3月出任中国建设银行批发业务总,2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生,董事,现任建信基金管理有限责任公司总裁,兼任建信资本管理有限公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西便门支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生,董事,现任信安北亚地区副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士学位。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经理,美国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事。

郑树明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡兴发资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华薇女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于北京大学,获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监,锦辉控股集团有限公司副总裁,锦辉精工化工有限公司总经理,吉林信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理,光大证券财富管理中心总经理(MD)。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员,正大国际资产管理有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生,独立董事,曾任中国人寿保险有限公司首席执行官,中银保诚退休金信托管理有限公司董事,英国保诚保险有限公司首席执行官,美国国际保险集团亚太区资深副总裁,美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席执行官等。1989年获Pacific Southern University工商管理硕士学位。

伏军先生,独立董事,法学博士,现任对外经济贸易大学法学院教授,兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

#### 2、监事会成员

张军红先生,监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科长、副主任科员,主任科员;零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处助理、高级副经理;行办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理;投资托管部总经理助理、副总经理;投资托管业务部副总经理;资产托管业务部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席。

方轸敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与战略研究部总经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业金融部经理。

严冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规部审计部(二级部)总经理。英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计员,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司内控合规部。

安峰先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系,获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部、中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、处长,建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理,信息技术部执行总经理、总经理。

#### 3、公司高管人员

孙志晨先生,总裁(简历请参见董事会成员)。

曲寅军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员,副主任科员,团委主任科员,重组改制办公室高级副经理、行办公室高级副经理;2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日起任我公司副总裁,并专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理。

张威威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券基金销售业务,任高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴曙明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员、

机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入我公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

#### 4、督察长

吴曙明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。

#### 5、本基金基金经理

陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理,2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财富型证券投资基金基金经理;2014年9月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金基金经理;2016年3月14日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金基金经理;2016年9月13日起任建信瑞添添利混合型证券投资基金基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金基金经理。

高珊女士,硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员,2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财富型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财富型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双周安心理财富型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财富型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2015年8月25日起任建信现金添利货币市场基金基金经理;2016年6月3日至2017年6月9日任建信鑫盛回报灵活配置型基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金基金经理。

于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入元惠理基金管理公司(原元惠比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财富型证券投资基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生,总裁。

梁洪钧先生,金融工程及指数投资部总经理。

钟敏女士,固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁女士,固定收益投资部总经理。

姚娜女士,权益投资部总经理。

许杰先生,权益投资部副总经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)  
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD  
法定代表人:牛锡明  
住所:上海市浦东新区银城中路188号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号  
邮政编码:200120  
注册时间:1987年3月30日  
注册资本:7,422.62亿元  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号  
联系人:陆志伟  
电话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发祥行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本本位列第13位,较上年上升4位;根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第153位,较上年上升37位。

截至2017年6月30日,交通银行总资产为人民币89308.38亿元。2017年1-6月,交通银行实现净利润归属于母公司股东)人民币389.75亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### (二)主要人员情况

牛锡明先生,董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生,副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学与技术专业,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

### (三)基金托管业务经营情况

截至2017年6月30日,交通银行共托管证券投资基金298只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

## 三、相关服务机构

### (一)基金份额发售机构

1.直销机构  
本基金直销机构为本公司直销柜台以及网上交易平台。  
(1)直销柜台  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
法定代表人:许会斌  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228800

#### (2)网上交易平台

投资者可以通过本公司网上交易平台办理基金的认购、申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址:www.ccbfund.cn。

#### 2.代销机构

(1)中国建设银行股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街25号  
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心  
法定代表人:王洪章  
客服电话:95533  
网址:www.ccb.com  
基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

### (二)基金份额登记机构

名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
法定代表人:许会斌  
联系人:郑文广  
电话:010-66228888

(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:北京德恒律师事务所  
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
负责人:王丽  
联系人:刘焕志  
电话:010-52682888  
传真:010-52682999  
经办律师:刘焕志、孙艳利

(四)审计计基金的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系人:陈熾  
联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:许康伟、陈熾

## 四、基金的名称

本基金名称:建信现金添利货币市场基金

## 五、基金的类型

本基金类型:货币市场基金

## 六、基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资方向

本基金将投资于以下金融工具:

1.现金;  
2.期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;  
3.剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具;  
4.法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。

1.资产配置策略  
基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征,决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。

## 2、个券选择策略

在个券选择上,基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。

## 3、利率策略

通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的可能情景,并预测财政货币政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上,预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

## 4、利用短期市场机会的灵活策略

由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡;新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明更新中公告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税前)。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7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。

本投资组合报告所载数据截至2017年6月30日,本报告中财务资料未经审计。

## 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	固定收益类	24,942,969,075.31	20.79
	其中:债券	24,942,969,075.31	20.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	23,931,022,206.42	19.94
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	465,039,439.88	0.39
3	银行存款和结算备付金合计	69,538,525,092.36	58.28
4	其他资产	1,183,728,031.36	0.99
5	合计	119,996,234,405.44	100.00

## 2、报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.07
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	10,026,178,793.26	9.13
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例,为报告期内每个交易日基金资产净值占基金资产净值的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

## 3、基金投资组合平均剩余期限

### (1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

(2)报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明  
报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

### (3)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	20.48	9.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天-60天	13.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.36	-
3	60天-90天	30.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天-120天	26.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天-397天(含)	17.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
	合计	100.71	9.13

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明  
本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

## 5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	839,713,392.74	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,713,152,539.96	5.20
	其中:政策性金融债	5,713,152,539.96	5.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,708,804,940.35	1.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	16,681,287,202.26	15.19
8	其他	-	-
9	合计	24,942,969,075.31	22.71
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	388,889,182.39	0.36

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111720111	17广发银行CD111	35,000,000	3,463,603,966.74	3.15
2	170204	17国开04	14,100,000	1,404,678,181.81	1.28
3	111613104	16 蒙 商CD104	9,900,000	989,968,945.74	0.90
4	111720113	17广发银行CD113	10,000,000	989,425,501.31	0.90
5	1703026	17贵阳银行CD088	10,000,000	988,909,680.48	0.90
6	170408	17农发08	9,000,000	897,712,140.27	0.82
7	111680640	16重庆银行CD061	9,000,000	895,485,223.97	0.82
8	150207	15国开07	7,000,000	762,619,289.29	0.69
9	111780395	17西安银行CD020	7,000,000	692,319,223.26	0.63
10	111799422	17西安银行CD014	6,800,000	672,943,724.87	0.61