

建信双周安心理财债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

升,另一方面,充裕流动性下“资产荒”特征再度显现,短端资产仍是被过度追捧的侧面,1年期以内高等级短融对利率水平回落至30%分位以内,受此影响,货币类基金收益整体呈现进一步回落。

本基金作为短期理财型产品,在较低的短端利率环境下,收益相对优势出现一定下滑,但债券调整带来人类资产配置提升的溢价能力,以及提前布局高要求的规模调整能力,在保证流动性充分应对的基础上,我们积极调整资金波动的季节性机会,适当调整了部分中长期存单和高等级债券,保持组合的剩余期限中等水平,利用适度杠杆为投资者实现了对稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期双周理财A净值增长率为0.7272%,波动率0.0006%,双周理财B净值增长率为0.7597%,波动率0.0006%,业绩比较基准收益率为3.329%,波动率0.0006%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	固定收益类	7,231,689,638.89	62.47
2	权益类	7,231,689,638.89	62.47
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	3,090,590,446.09	26.84
5	其他金融资产	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,914,928,483.07	25.36
8	其他资产	46,467,168.06	0.40
9	合计	13,762,374,763.11	100.00

5.2 报告期末按摊余成本法计算的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	111814181	18国债07	30,000,000	962,623,608.09	7.26
2	1804077	18国债07	3,200,000	319,397,356.40	2.34
3	111888888	18国债07	3,000,000	299,033,966.40	2.19
4	111888888	18国债07	3,000,000	288,453,354.30	2.18
5	111888888	18国债07	3,000,000	288,911,027.40	2.18
6	111888888	18国债07	3,000,000	200,020,028.12	1.46
7	111888888	18国债07	2,000,000	199,446,945.11	1.46
8	111888888	18国债07	2,000,000	188,368,063.86	1.46
9	111888888	18国债07	2,000,000	186,712,064.36	1.46

5.3 报告期末按公允价值计量的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

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	111888888	18国债07	3,000,000	299,033,966.40	2.19
2	111888888	18国债07	3,000,000	288,453,354.30	2.18
3	111888888	18国债07	3,000,000	288,911,027.40	2.18
4	111888888	18国债07	3,000,000	200,020,028.12	1.46
5	111888888	18国债07	2,000,000	199,446,945.11	1.46
6	111888888	18国债07	2,000,000	188,368,063.86	1.46
7	111888888	18国债07	2,000,000	186,712,064.36	1.46

5.4 报告期末按公允价值计量的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

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	111888888	18国债07	3,000,000	299,033,966.40	2.19
2	111888888	18国债07	3,000,000	288,453,354.30	2.18
3	111888888	18国债07	3,000,000	288,911,027.40	2.18
4	111888888	18国债07	3,000,000	200,020,028.12	1.46
5	111888888	18国债07	2,000,000	199,446,945.11	1.46
6	111888888	18国债07	2,000,000	188,368,063.86	1.46
7	111888888	18国债07	2,000,000	186,712,064.36	1.46

5.5 报告期末按公允价值计量的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

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	111888888	18国债07	3,000,000	299,033,966.40	2.19
2	111888888	18国债07	3,000,000	288,453,354.30	2.18
3	111888888	18国债07	3,000,000	288,911,027.40	2.18
4	111888888	18国债07	3,000,000	200,020,028.12	1.46
5	111888888	18国债07	2,000,000	199,446,945.11	1.46
6	111888888	18国债07	2,000,000	188,368,063.86	1.46
7	111888888	18国债07	2,000,000	186,712,064.36	1.46

5.6 报告期末按公允价值计量的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

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	111888888	18国债07	3,000,000	299,033,966.40	2.19
2	111888888	18国债07	3,000,000	288,453,354.30	2.18
3	111888888	18国债07	3,000,000	288,911,027.40	2.18
4	111888888	18国债07	3,000,000	200,020,028.12	1.46
5	111888888	18国债07	2,000,000	199,446,945.11	1.46
6	111888888	18国债07	2,000,000	188,368,063.86	1.46
7	111888888	18国债07	2,000,000	186,712,064.36	1.46

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%~0.5%的情况次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0416%
报告期内偏离度的最低值	-0.0072%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均数	0.0106%

5.8 报告期末按公允价值计量的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

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法每日计提损益。

5.9.2

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未被披露监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.3 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	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.4 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.5 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.6 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%~0.5%的情况次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0706%
报告期内偏离度的最低值	-0.0106%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均数	0.0050%

5.9.8 报告期末按公允价值计量的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

无。

5.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法每日计提损益。

5.9.9.2

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未被披露监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.9.3 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	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.4 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.5 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.6 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%~0.5%的情况次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0706%
报告期内偏离度的最低值	-0.0106%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均数	0.0050%

5.9.9.8 报告期末按公允价值计量的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

无。

5.9.9.9 投资组合报告附注

5.9.9.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法每日计提损益。

5.9.9.9.2

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未被披露监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.9.9.3 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	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.9.4 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.9.5 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92
4	其他固定收益类	1,320,094,349.68	31.48
5	资产支持证券	120,181,227.86	2.89
6	中期票据	677,496,263.26	16.47
7	其他	-	-
8	合计	2,486,122,565.04	59.88

5.9.9.9.6 报告期末按公允价值计量的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

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	370,266,620.26	9.02
2	金融债	320,086,443.89	7.69
3	企业债	38,016,143.89	0.92</