建信双债增强债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双债增强债券	
基金主代码	000207	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月25日	
报告期末基金份额总额	43,786,424.36份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资人创造较高的当期收入和总回报。	
投资策略	本基金主要通过采取债券类属配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信双债增强债券A	建信双债增强债券C
下属分级基金的交易代码	000207	000208
报告期末下属分级基金的份额总额	27,158,908.74份	16,627,515.62份

§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(2019年4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)
	建信双债增强债券A	建信双债增强债券C
1.本期已实现收益	171,024.05	102,930.83
2.本期利润	－242,530.21	－161,543.97
3. 加权平均基金份额本期利润	－0.0087	－0.0092
4. 期末基金资产净值	33,222,532.36	19,885,748.20
5. 期末基金份额净值	1.223	1.196

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(不含公允价值变动损益)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损益。

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

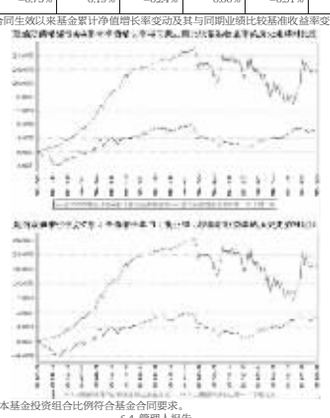
建信双债增强债券A

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	－0.73%	0.19%	－0.24%	0.06%	－0.49%	0.13%

建信双债增强债券C

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	－0.51%	0.19%	－0.24%	0.06%	－0.51%	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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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		
朱虹	固定收益投资部副总经理，本基金的基金经理	2016年6月1日	－	12年	朱虹女士，固定收益投资部副总经理，硕士。2007年1月至2009年4月任长城人寿保险公司债券投资助理;2009年4月至2011年12月任天弘基金管理公司固定收益部总监助理;2012年1月至2014年5月任万家基金管理公司固定收益部总监;2015年8月至今历任我公司投资管理部副总监、固定收益投资部副总监、副总经理,2015年10月29日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2017年11月4日转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金,朱虹自2017年11月4日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年1月4日任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年1月11日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金，朱虹自2018年1月11日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月1日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月17日起任建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信双息红利债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信双债增强债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度,在短期上涨约40%后股票市场大幅回落。本季度压制股票的主要因素仍然融资现金流有所好转,但经营情况改善仍然需要时间。四月至五月中美贸易争端升级和包商银行事件连续发生,大幅度降低了股票市场的风险偏好,转债市场随之下跌调整。

2019年二季度债券市场分歧较大,在小幅调整后逐渐明确信用分化的趋势,季度末期迎来久违的长期利率债上涨行情。本季度随着包商银行事件的发生,信用市场分化成为市场共识。包商事件在人民银行和监管机构的共同努力下,没有发生市场预期的大面积流动性风险。我们认为,未来的银行业周期将会在负债定资产的逻辑中逐步演化,市场将会重点关注资产质量和资产周期。客观上降低准备金率和市场化基准利率的要求上升,将会推动实际利率水平在三季度继续下行。

需要关注的是,未来几年信用债市场的变化将会非常剧烈。从融资难度到投后监管,信用债市场等于无风险收益的认知会逐步消失,信用债的收益获取难度将会上升。

一季报中我们认为,在2019年主要仓位仍投资于可转债,可转债经过两年的深度调整,股债水平处于历史最好的波动率启动期,吸取过去的经验,我们将会做好大类资产转换工作降低组合波动性,力争为持有人获得良好回报。二季度初,基于判断股票市场已经接近阶段性高点,减持可转债至较低仓位,基本获得了本轮市场上涨盈利。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值增长率-0.73%,波动率0.19%,本报告期本基金C净值增长率-0.75%,波动率0.19%;业绩比较基准收益率-0.24%,波动率0.06%。

§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	－	0.00
	其中:股票	－	0.00
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	48,143,535.41	90.17
	其中:债券	48,143,535.41	90.17
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	－	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	2,209,915.34	4.14
8	其他资产	3,038,810.63	5.69
9	合计	53,392,261.38	100.00

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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,766,184.00	5.21
2	央行票据	－	－
3	金融债券	4,002,400.00	7.54
	其中:政策性金融债	4,002,400.00	7.54
4	企业债券	14,293,350.00	26.91
5	企业短期融资券	12,062,200.00	22.71
6	中期票据	8,121,000.00	15.29
7	可转债(可交换债)	6,898,401.41	12.99
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	48,143,535.41	90.65

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	40,000	4,002,400.00	7.54
2	136318	16中油05	40,000	3,979,600.00	7.49
3	127010	平银转债	20,000	2,382,200.00	4.49
4	019547	16国债19	23,680	2,170,508.80	4.09
5	136513	16电投03	20,520	2,052,000.00	3.86

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该投资期内投资前十名证券的发行主体未披露被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。

5.11.2

基金投资的前十名证券未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,089.44
2	应收证券清算款	2,112,000.00
3	应收股利	－
4	应收利息	900,151.91
5	应收申购款	2,569.28
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	3,038,810.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128022	众信转债	802,324.32	1.51
2	132014	18中化EB	499,500.00	0.94
3	128028	赣锋转债	448,153.16	0.84
4	128048	张行转债	402,892.80	0.76
5	132015	18中油EB	391,560.00	0.74
6	110038	济川转债	342,986.40	0.65
7	123002	国祯转债	143,101.25	0.27
8	113521	科森转债	40,360.00	0.08
9	128014	永东转债	6,652.98	0.01
10	113504	艾华转债	5,243.50	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双债增强债券A	建信双债增强债券C
报告期期初基金份额总额	28,462,229.42	19,280,290.20
报告期期间基金总申购份额	886,104.85	907,812.87
减:报告期期间基金总赎回份额	2,189,425.53	3,560,587.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"－"填列)	－	－
报告期期末基金份额总额	27,158,908.74	16,627,515.62

注:上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信双债增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双债增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双债增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双债增强债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2019年7月17日

建信双周安心理财债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双周理财
基金主代码	530014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	12,440,808,254.18份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报，并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信双周理财A	建信双周理财B
下属分级基金的交易代码	530014	531014
报告期末下属分级基金的份额总额	548,004,222.47份	11,892,804,031.71份

§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(2019年4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)
	建信双周理财A	建信双周理财B
1. 本期已实现收益	3,951,155.32	90,948,948.54
2.本期利润	3,951,155.32	90,948,948.54
3. 期末基金资产净值	548,004,222.47	11,892,804,031.71

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(不含公允价值变动损益)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损益。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

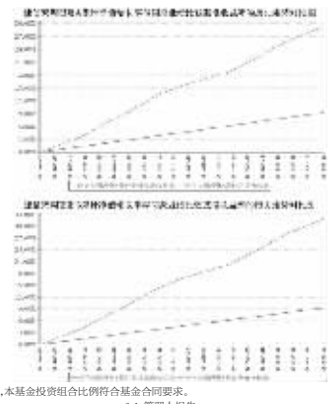
建信双周理财A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6451%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.3085%	0.0005%

建信双周理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7182%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.3816%	0.0006%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年1月21日	－	11年	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月加入金元惠理基金管理公司（原金元比联基金管理公司），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、基金经理,2013年8月5日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理;2018年3月26日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年2季度,贸易谈判预期出现反转,实体经济数据有所走弱,总量政策保持定力的同时更加突出结构性应对,流动性环境从边际收紧预期重新转入宽松局面,这些因素带动债券市场先跌后涨,最终中债综合财富指数实现0.65%的正收益,其中信用债表现好于利率债,政金债表现好于国债,整体利率债收益率曲线呈现平坦化。

2季度最重要的变化在于多重预期出现反转。外部形势来看,美欧经济出现放缓,降息预期逐步升温,5月中美贸易谈判透出不利走向,关税升级预期极大地打压了市场对经济基本面的信心。内部来看,社融信贷平稳投放,金融数据延续底部回稳,但实体经济表现开始呈现走弱信号,以PMI表征的制造业景气指数陷于收缩区域,钢材需求呈现回落,房地产投资也开始放缓,对美出口负面影响开始呈现;更出乎市场预期的是,包商接管事件打破了同业刚兑预期,流动性分层和信用分化持续发酵,引发了同业收缩风险,这对刚刚有所恢复的信用扩张体系来说,明显增加了信用负反馈的风险。

2季度相对有利的因素在于政策的灵活调整与积极应对。4月份政策层在1季度信用扩张有所修复的基础上一度传递出预调微调的信号,包括辟谣降准、货政例会重提货币供给总闸门、政治局会议提出货币政策要预调微调、国务院吹风会强调货币政策没收紧也没放松等等。5月份贸易谈判形势逆转后,针对中小银行的结构性降准开始兑现,月底包商事件出来后对市场的冲击是比较大的,央行及时开启大力度对冲,MLF增量供给、再贴现和常备借贷便利额度增加3000亿同时放宽质押品范围、增加跨半年来逆回购供给、协同多部门缓解非银流动性等等,及时抑制了风险的多层次多链条传染。此外,在应对内部需求回落方面,专项债纳入资金金、隐性债务平滑等政策也相继出台,虽然短期提振效果可能有限,但也有助于提升基建平滑经济下行压力的信心。

2季度资金利率中枢先升后降,短端信用资产收益出现分化,高等级被追捧,信用利差明显走阔。资金来看,部分时点出现阶段性紧张,主要是4月政策预调微调和5月底包商事件冲击,进入6月,得益于央行的大力度对冲,银行间隔夜加权利率跌破1%,但抵押品与机构信用明显被区分定价,最高利率显著攀升。短端资产方面,6月同业存单净融资为负,一级发行成功率明显下降,二级AAA及以上存单利率回落10-20bp,AA+存单利率上行30bp左右,利差走阔40-50bp,同期AAA短融利率下行13-38bp不等,分位值回到30%以内,跨年期限利差居于高位,AA+评级利差走阔13-19bp。

本基金作为短期理财型产品,后期将面临转型压力。一方面,短端资产收益持续下沉的大环境下,2季度机构客户资金仍表现相对稳定,来自大类资产配置层面的分流压力整体相对可控;另一方面,在产品转型前,策略上以保证流动性为主,我们跟随政策预期变化及时调整组合结构,在资金阶段性紧张时点适当布局了部分跨季资产,包商事件后进一步强化了组合的安全性,并适当锁定了部分高等级品种的配置机会。总体而言,通过利用适度杠杆策略,我们为投资者实现了相对稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值收益率0.6451%,波动率0.0005%,本基金B净值收益率0.7182%,波动率0.0006%;业绩比较基准收益率0.3366%,波动率0.0000%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

－

§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	固定收益投资	6,718,592,851.33	52.97
	其中:债券	6,718,592,851.33	52.97
	资产支持证券	－	0.00
2	买入返售金融资产	4,319,722,916.35	34.06
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	1,609,679,199.64	12.69
4	其他资产	35,519,772.08	0.28
5	合计	12,683,514,739.40	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.31
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	239,589,760.20	1.93
	其中:买断式回购融资	－	0.00

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过134天。

5.3.2 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	37.94	1.93
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	23.01	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	24.94	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	2.01	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天（含）—397天（含）	13.77	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		101.67	1.93

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 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	国家债券	548,531,156.38	4.41
2	央行票据	－	－
3	金融债券	271,407,425.04	2.18
	其中：政策性金融债	271,407,425.04	2.18
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	3,019,375,500.34	24.27
6	中期票据	－	－
7	同业存单	2,879,278,769.57	23.14
8	其他	－	－
9	合计	6,718,592,851.33	54.00
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

5.6 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	199920	19贴现国债20	3,900,000	388,803,814.01	3.13
2	071900031	19华泰证券CP001	3,000,000	300,026,792.97	2.41
3	071900021	19国泰君安CP002	3,000,000	299,992,929.16	2.41
4	111883316	18重庆银行CD125	3,000,000	298,685,118.70	2.40
5	111889306	18郑州银行CD165	3,000,000	298,620,794.58	2.40
6	111909153	19浦发银行CD153	3,000,000	298,492,079.18	2.40
7	111915224	19民生银行CD224	3,000,000	298,217,659.09	2.40
8	071900023	19浙商证券CP001	2,000,000	200,000,021.67	1.61
9	011900667	19宝钢SCP006	2,000,000	199,853,626.91	1.61
10	011901132	19东航SCP002	2,000,000	199,398,758.41	1.60

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	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)－0.5%间的次数	－
报告期内偏离度的最高值	0.0942%
报告期内偏离度的最低值	0.0187%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0501%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

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,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	35,519,772.08
4	应收申购款	－
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	35,519,772.08

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双周理财A	建信双周理财B
报告期期初基金份额总额	809,969,496.88	12,869,514,291.14
报告期期间基金总申购份额	4,992,870.20	90,948,948.54
报告期期间基金总赎回份额	266,958,144.61	1,067,659,207.97
报告期期末基金份额总额	548,004,222.47	11,892,804,031.71

注:上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金明细

无。

§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

单位:份

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	2019年05月21日－2019年05月28日	1,000,000,000.00	5,008,209,560.69	5,076,518,923.10	931,690,637.59	17.17

注:本基金本报告期申购份额中包含了收益结转份额。

本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信天添益货币市场基金设立的文件;

2、《建信天添益货币市场基金基金合同》;

3、《建信天添益货币市场基金招募说明书》;

4、《建信天添益货币市场基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2019年7月17日

建信天添益货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:江苏银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信天添益货币		
基金主代码	003391		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年10月18日		
报告期末基金份额总额	5,424,710,559.15份		
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。		
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。		
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)。		
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。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	江苏银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信天添益货币A	建信天添益货币B	建信天添益货币C
下属分级基金的交易代码	003391	003392	003393
报告期末下属分级基金的份额总额	497,852,821.38份	163,529,981.73份	4,763,327,756.04份

§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(2019年4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)
	建信天添益货币A	建信天添益货币B	建信天添益货币C
1. 本期已实现收益	4,147,986.85	1,277,839.87	73,413,543.57
2. 本期利润	4,147,986.85	1,277,839.87	73,413,543.57
3. 期末基金资产净值	497,852,821.38	163,529,981.73	4,763,327,756.04

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,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信天添益货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6635%	0.