建信双月安心理财债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双月安心理财	
基金主代码	530029	
交易代码	530029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月29日	
报告期末基金份额总额	23,455,638,695.99份	
投资目标	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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天。	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
下属分级基金的交易代码	530029	531029
报告期末下属分级基金的份额总额	98,925,775.87份	23,356,712,920.12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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
1. 本期已实现收益	758,823.75	179,154,933.27
2. 本期利润	758,823.75	179,154,933.27
3. 期末基金资产净值	98,925,775.87	23,356,712,920.12

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入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

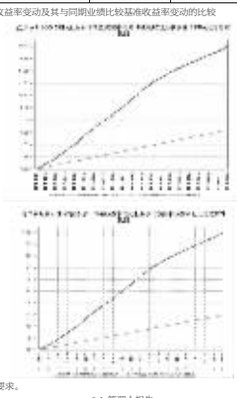
建信双月安心理财A

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	0.6984%	0.0016%	0.3329%	0.0000%	0.3655%	0.0016%

建信双月安心理财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	0.7706%	0.0016%	0.3329%	0.0000%	0.4377%	0.0016%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



本报告期,本基金投资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		
高珊	本基金的基金经理	2013年1月29日	-	10	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10月26日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信盈安心理财债券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26日起任建信现金添利货币市场基金基金经理;2016年6月3日起任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理;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。

4.2 管理人对报告期内本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《建信双月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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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

2017年一季度,经济增长稳中有进,工业增加值、投资、消费、出口、物价、就业、国际收支等主要经济指标好于预期,经济内生性增长动力逐步恢复,PMI、PPI、CPI、M2等多项指标创近期新高,但是,在经济内生性增长动力逐步恢复的同时,外部冲击因素也有所抬头,美国特朗普当选总统后,美国大选后的不确定性因素逐渐消退,美国经济复苏的预期逐渐加强,美国加息预期升温,美元指数大幅上升,新兴市场国家资本外流压力较大,人民币汇率出现较大幅度贬值。

报告期内,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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	6,735,983,466.89	28.71
	其中:债券	6,735,983,466.89	28.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	16,572,878,172.35	70.64
4	其他资产	151,450,627.91	0.65
5	合计	23,460,312,267.15	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.31	
	其中:买断式回购融资	-	
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	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

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180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	7.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	30.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	16.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	31.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.36	-

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

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,177,055,660.86	5.02
	其中:政策性金融债	1,177,055,660.86	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,558,927,806.03	23.70
8	其他	-	-
9	合计	6,735,983,466.89	28.72
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	111712059	17北京银行CD059	10,000,000	990,828,167.03	4.22
2	111698368	16浙江网商银行CD003	7,000,000	699,245,689.25	2.98
3	120240	12国开40	5,000,000	501,652,159.33	2.14
4	111710100	17兴业银行CD100	5,000,000	496,297,694.56	2.12
5	111709084	17浦发银行CD084	5,000,000	495,999,872.74	2.11
5	111710113	17兴业银行CD113	5,000,000	495,999,872.74	2.11
6	111716059	17上海银行CD059	5,000,000	495,474,150.60	2.11
6	111712057	17北京银行CD057	5,000,000	495,474,150.60	2.11
7	111793881	17杭州银行CD077	5,000,000	489,813,717.62	2.09
8	111697703	16怀融湘江银行CD054	4,500,000	443,396,441.12	1.89
9	120408	12农发08	2,500,000	250,293,643.27	1.07
10	160304	16进出04	2,500,000	250,017,955.50	1.07

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	-0.0248%
报告期内偏离度的最低值	-0.1529%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0683%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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

本基金投资的前十名债券发行主体本期未未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,192.88
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	151,426,435.03
4	应收申购款	1,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	151,450,627.91

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
报告期期初基金份额总额	124,310,728.93	23,303,894,943.24
报告期期间基金总申购份额	2,333,543.75	179,154,933.27
报告期期间基金总赎回份额	27,718,496.81	126,336,956.39
报告期期末基金份额总额	98,925,775.87	23,356,712,920.12

上述总申购份额含红利再投资份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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	1月1日至3月31日	23,169,301,088.75	0.00	0.00		23,348,556,811.32	99.54
产品特有风险								
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有人合法权益。								

§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双月安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2.《建信双月安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信双月安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信双月安心理财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。

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
2017年4月22日

建信双债增强债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月22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2017年4月19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2017年1月1日起至3月31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	
交易代码	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	153,579,911.22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	112,613,851.16份	40,966,060.06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(2017年1月1日 - 2017年3月31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	-4,169,706.83	-1,346,069.27
2. 本期利润	-2,627,270.01	-531,962.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0118	-0.0116
4. 期末基金资产净值	138,541,058.64	49,676,500.37
5. 期末基金份额净值	1.230	1.213

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

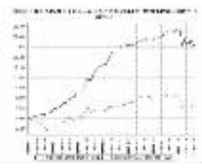
建信双债增强债券A

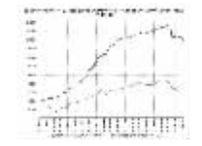
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.20%	0.24%	-1.24%	0.07%	0.04%	0.17%

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	-1.22%	0.24%	-1.24%	0.07%	0.02%	0.17%

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





本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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	-	9	硕士。2007年加入长城人寿保险股份有限公司,任债券投资助理。2009年4月加入天弘基金管理有限公司,任基金经理,固定收益投资总助理。2012年1月,加入万家基金管理有限公司,任基金经理,固定收益总监。2014年8月加入我公司,历任投资管理部副总监、固定收益投资部副总经理,2015年10月29日任建信安心保本二号混合型证券投资基金基金经理,2016年1月4日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金基金经理,2016年6月3日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理,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基金经理。

4.2 管理人对报告期内本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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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

按照2017年一季度可观测的地产去化速度,中国三、四线城市库存较大这一主要长期风险有望逐步降低。三、四线城市高库存背后的地方财政举债风险、银行坏账风险都有望被化解。从一季度中央财政收入看,房地产对于税收项的拉动十分明显,中央政府收入增加。3月作为年内第一个政府债务到期高峰,发行地方债力度低于预期,并未对市场造成较大冲击。

从以上基本面看,地产、基建(政府)、企业在开年以来显示出较强的风险抵御能力,整体没有观测到较大的债务敞口。而银行端由于供给侧改革、房地产去化、基建加速等带来的企业利润水平的上升,坏账率有所好转,预计拨备计提对于利润的拖累有所下降。总体看来,我们仍然认为2017年中国经济系统性风险概率较低。

股票市场由于再融资制度的改革,无异于改变市场投融资结构,是对市场具有深远意义的举措。中国经济总量增速不再上升的情况下,企业利润水平将逐步代替GDP增速成为整个A股的锚之一。大盘蓝筹股的价值回归,在相当长的时间内仍是市场最关注的热点。许多大盘蓝筹股曾经在2001年是成长型股票,所以对于成长型龙头股票同样不应过于悲观。

年初我们认为债券市场的波动率在2017年可能产生超额的回报,但各主要央行目标之间的时差、美联储细表的进度,会极大影响债券资产整体回报率。从3月末的情况看,债券市场的应对和央行的态度并未有突破市场预期的情况,对债券市场二季度表现我们保持乐观。

综上所述,债券市场年内首次出现超额回报窗口。本基金于月初大幅增配长期国债。

可转债在年初有较大幅度调整,使基金净值有一定影响。原因在于一季度一级债基整体赎回规模较大,导致该类账户减持可转债。随着大盘创出年内新高,我们仍然看好可转债全年的表现。将继续保持可转债的仓位。本基金在力争在控制风险的基础上,追求可持续的稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期双债增强A净值增长率-1.2%,波动率0.24%,双债增强C净值增长率-1.22%,波动率0.24%;业绩比较基准收益率-1.24%,波动率0.07%。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	242,057,538.94	95.59
	其中:债券	242,057,538.94	95.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,850,468.70	3.89
8	其他资产	1,319,145.65	0.52
9	合计	253,227,153.29	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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	65,544,566.00	34.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,921,090.80	7.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	162,591,882.14	86.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	242,057,538.94	128.61

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	010107	21国债(7)	346,710	36,047,438.70	19.15
2	132005	15国资EB	174,810	18,491,401.80	9.82
3	110035	白云转债	143,200	18,424,112.00	9.79
4	132004	15国盛EB	189,620	18,366,593.20	9.76
5	019547	16国债19	201,170	18,272,271.10	9.71

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	63,469.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,255,016.10
5	应收申购款	659.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,319,145.65

5.10.4 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	132005	15国资EB	18,491,401.80	9.82
2	110035	白云转债	18,424,112.00	9.79
3	132004	15国盛EB	18,366,593.20	9.76
4	113009	广汽转债	18,165,000.00	9.65
5	110033	国贸转债	18,120,157.90	9.63
6	132001	14宝钢EB	16,870,511.20	8.96
7	110034	九州转债	15,075,555.10	8.01
8	113008	电气转债	9,577,791.00	5.09
9	110032	三一转债	9,300,164.40	4.94
10	113010	江南转债	7,007,814.80	3.72
11	128010	顺昌转债	5,700,085.10	3.03
12	128011	汽模转债	3,726,124.92	1.98
13	110031	航信转债	1,643,580.00	0.87
14	128012	辉丰转债	990,526.00	0.53
15	123001	蓝标转债	8,683.92	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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	303,073,209.89	65,530,895.57
报告期期间基金总申购份额	448,321,091.38	1,161,875.85
减:报告期期间基金总赎回份额	638,780,450.11	25,726,711.36
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	112,613,851.16	40,966,060.06

总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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	1月1日至1月16日	80,512,841.09	0.00	80,512,841.09		0.00	0.00
	2	1月1日至3月21日	79,999,200.00	0.00	79,999,200.00		0.00	0.00
本基金本报告期未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。

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
2017年4月22日

建信双周安心理财债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月22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2017年4月19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2017年1月1日起至3月31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	
交易代码	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	5,660,334,635.15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	300,432,288.14份	5,359,902,347.01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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信双周理财A	建信双周理财B
1. 本期已实现收益	2,060,883.80	27,363,103.95
2. 本期利润	2,060,883.80	27,363,103.95
3. 期末基金资产净值	300,432,288.14	5,359,902,347.01

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入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

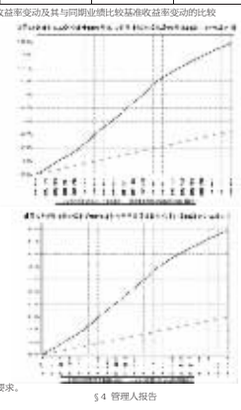
建信双周理财A

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	0.6349%	0.0027%	0.3329%	0.0000%	0.3020%	0.0027%

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	0.7070%	0.0027%	0.3329%	0.0000%	0.3741%	0.0027%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



本报告期,本基金投资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