建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信中证政策性金融债8-10年指数（LOF）
场内简称	政债八十
基金主代码	501105
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2017年4月9日
报告期末基金份额总额	160,474,274.23份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差控制在4%以内。 如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证政策性金融债8-10年指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，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	中国民生银行股份有限公司

§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1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	2,199,092.30
2.本期利润	-185,779.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0008
4.期末基金资产净值	182,344,987.94
5.期末基金份额净值	1.1363

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

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	0.36%	0.18%	0.77%	0.13%	-0.41%	0.02%

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		
刘思	本基金的基金经理	2017年4月9日	-	9年	刘思女士，硕士，2009年5月加入建信基金管理公司，历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理。基金经理，2016年7月19日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月8日至2018年1月16日任建信睿茗纯债债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月22日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金的基金经理；2017年4月9日起任建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2017年8月9日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金（LOF）基金经理；2017年8月16日至2018年8月31日任建信睿源纯债债券型证券投资基金（LOF）；2017年8月16日至2018年8月31日任建信睿源纯债债券型证券投资基金的基金经理；2018年3月26日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2019年3月25日起任建信中债1-3年国开行债券指数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

本报告期内，本基金管理人恪守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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）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》、《建信基金管理公司公平交易制度指导意见》、《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，本基金管理人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%的情况有1次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年以来，全球经济增速步伐继续放缓。2月美国非农就业数据爆冷，建筑业等行业就业数据低迷，但薪资增速大幅增长，CPI和PMI数据也继续走弱。随后3月美联储议息会议正式确认货币政策转鸽，并计划9月结束缩表。欧央行对欧元区经济放缓的担忧也不断加剧，欧元区通胀率表现仍然较弱，制造业PMI下滑至荣枯线以下，但服务业PMI小幅回升。

一季度全国固定资产投资三大项中基建与地产反弹，但制造业投资增速却出现回落。分项来看，今年一季度总体地方债发行量也远超去年同期，发行的地方债以新增债为主，新增专项债用于土地储备、棚户区改造、公路铁路等交通设施、水利环保、学校医院等基础设施项目和重点民生项目，对基建形成强力的拉动作用。1-2月的基础设施投资（不含电力）增长4.3%相比于上年末回升0.5个百分点，基建投资增速有所反弹。房地产方面，随着房贷利率高位回落，一线和强二线城市商品房销售略有转暖，但市场整体冷热不均，区域分化进一步加大，1-2月份的房地产投资名义增长11.6%，增速水平相比于上年末提高了2.1个百分点，维持较高增速水平。制造业投资增速有所回落，2月末累计增速5.9%比上年末回落了3.6个百分点。当前工业企业整体面临利润率和利润总额增速同时下滑，考虑到新兴制造业和信息技术行业等在固定资产投资中的占比不高，与盈利能力背离的投资反弹可能难以持续，投资增速仍将向利润增速的走势靠拢。

出口方面，尽管欧元区PMI及日韩出口等外需指标仍然疲软，但由于去年基数较低、美国暂时取消2000亿美元商品清单加征关税计划等，出口的下降速度已经放缓。进口方面，受节后复工全面开启、原油等大宗商品价格上涨等因素影响，预计3月份进口也将有所回升，PMI进口、新出口订单均有所回升也一定程度反映了这种情况。从人民币汇率上看，今年一季度人民币汇率升值较多，3月末人民币兑美元汇率升值2.1%以及人民币兑CFETS篮子货币汇率指数升值2.0%

一季度债市收益波动较大，开年中美贸易摩擦谈判结果向好，基建补短板托底经济仍无法动摇市场对经济的悲观预期，10年期国债收益率继续下行，但随着1月社融和信贷数据的改善，债市开始在底部震荡。2月的社融数据和PMI数据下滑，加之春节停工、雨雪频繁等多重因素的干扰，收益短时间平稳。但股市快速回升导致股债行情转换，收益率继续进入上行通道。3月末时点，10年国开债收益率相比于去年末3.64%的位置下行6BP到3.58%，而10年国债收益率则下行16BP到3.07%。

通胀方面，一季度维持了CPI低位和PPI通缩的局面。春节后猪肉需求季节性回落，但近两月存栏量大幅下降制约出栏空间，供求格局逐步切换，猪肉价格环比微升。蔬菜价格经历高点后略有下行，但南方持续降雨或导致菜价下行偏缓。

货币政策方面，央行在1月份连续降准并开展TMLF操作，投放了1.3万亿元的流动性，货币市场利率快速下行至公开市场操作利率以下，春节后央行明显缩减了流动性投放规模，2月和3月分别实现流动性净回笼7505.5亿元和6925亿元，流动性净投放缩量直接推升了货币市场利率中枢，且波动性也明显提升。

综上所述，2019年一季度，本基金在模拟指数走势的同时，重点配置了流动较好的指数成份券。本基金在跨季时点没有进行杠杆操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.36%，波动率0.15%，业绩比较基准收益率0.77%，波动率0.13%。

§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	170,908,800.00	92.82
	其中：债券	170,908,800.00	92.82
	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	10,144,604.84	5.51
8	其他资产	3,071,398.55	1.67
9	合计	184,124,803.39	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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	170,908,800.00	93.73
	其中：政策性金融债	170,908,800.00	93.73
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债（可交换债）	-	0.00
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	170,908,800.00	93.73

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	180210	18国开10	550,000	56,430,000.00	30.95
2	180205	18国开05	400,000	43,180,000.00	23.68
3	190205	19国开05	300,000	29,748,000.00	16.31
4	170215	17国开15	190,000	19,503,800.00	10.70
5	180312	18进出12	150,000	15,042,000.00	8.25

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体本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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,971,067.53
5	应收申购款	100,331.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,071,398.55

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

报告期期初基金份额总额	221,174,673.62
报告期期间基金总申购份额	255,414,560.38
减：报告期期间基金总赎回份额	316,114,959.77
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	160,474,274.23

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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,937,388.19
报告期期间买入申购份额	-
报告期期间卖出/赎回份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,937,388.19
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	6.19

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中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）设立的文件；

2、《建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）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4月19日

建信周盈安心理财债券型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

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
报告送出日期：2019年4月19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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信周盈安心理财
基金主代码	530030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月17日
报告期末基金份额总额	573,827,529.32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。 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127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	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信周盈安心理财A　建信周盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530030　531030
报告期末下属分级基金的份额总额	545,282,788.27份　28,544,741.05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1月1日 - 2019年3月31日)	
	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
1.本期已实现收益	4,774,904.16	348,494.25
2.本期利润	4,774,904.16	348,494.25
3.期末基金资产净值	545,282,788.27	28,544,741.05

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

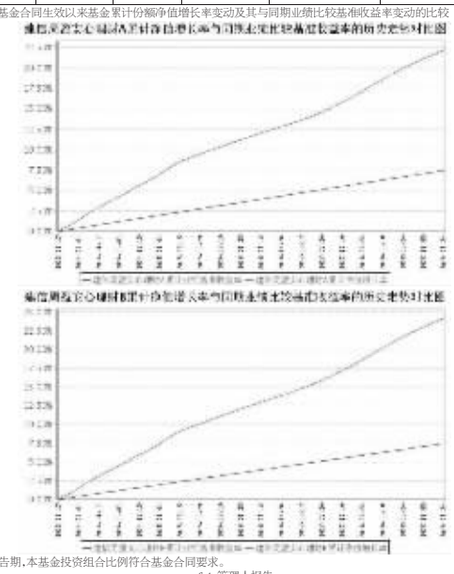
建信周盈安心理财A

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	0.7326%	0.0003%	0.3329%	0.0000%	0.3997%	0.0003%

建信周盈安心理财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	0.8048%	0.0003%	0.3329%	0.0000%	0.4719%	0.0003%

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		
先柯宇	本基金的基金经理	2018年3月26日	-	6年	先柯宇先生，硕士，2009年7月至2016年5月在中国建设银行金融市场部工作，曾从事债券管理，2012年起任债券交易员。2016年7月加入我公司，历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理，2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理，2018年3月26日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2019年1月25日起任建信天添益货币市场基金、建信嘉实货币市场基金、建信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《建信周盈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，本基金管理人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%的情况有1次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度，宏观经济运行总体平稳，一些向好趋势开始显现。随着春节后企业集中复产，制造业生产活动开始加快。制造业采购经理指数（PMI）在3月份录得50.5%，环比上升1.3个百分点，结束了连续三个月枯荣线之下的走势。从需求端看，尽管制造业投资增速有所回落，但基建投资增速反弹，房地产投资名义增长11.6%，仍然维持较高增速水平，推动固定资产投资增速实现小幅反弹，前两月累计增速达6.1%，较去年末回升0.2个百分点。消费增速继续保持平稳，结构升级趋势较为明显，剔除春节因素之后进出口总额增速为10.2%。从生产端上看，前两月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长5.3%，增速较去年12月份小幅回落0.4个百分点，其中消费品制造业保持较快增速。总体看，一季度生产需求总体保持平稳，呈现出稳中有进的态势，但是受到外部环境等不确定性因素影响，宏观经济运行仍然面临一定下行压力。

一季度居民消费价格温和上涨，而工业品价格涨幅回落。前两月CPI累计同比上涨1.6%，较12月份回落0.3个百分点，其中受猪瘟影响导致的产能去化，猪肉价格在一季度涨幅明显，整体通胀预期有所抬升。前两月PPI同比上涨仅0.1%，较12月份回落0.8个百分点，但需要注意的是，受国际因素影响，原油价格增速从2月份开始环比由降转升。

美联储在3月份暂停了加息，人民银行公开市场操作保持定力，于1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点后，一季度到期的中期借贷便利（MLF）不再续做，净释放长期资金约8000亿元，维持资金面的合理适度，除临近季末时点出现阶段性紧张，资金面整体保持平稳水平。

债券市场方面，受社融增速企稳回升、贸易摩擦阶段性缓和以及权益市场止跌反弹等因素影响，债券收益率长端震荡加剧，短端则在相对宽松的流动性环境中小幅下行。1年国开债收益率相比于去年末2.75%的位置下行20bp到2.55%，而1年国债收益率则由2.60%下行17bp到2.43%。

期间，本基金继续规避信用债配置，保持较高的利率债及中高等级同业存单的持仓比例，使得组合备付能力足够满足投资者的流动性需求。采取灵活的杠杆和久期策略，努力通过波段操作为组合增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期周盈安心理财A净值增长率0.7326%，波动率0.0003%，周盈安心理财B净值增长率0.8048%，波动率0.0003%，业绩比较基准收益率0.3329%，波动率0.0000%。

§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	360,307,883.95	60.46
	其中：债券	360,307,883.95	60.46
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	160,326,492.01	26.90
	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	72,434,996.47	12.15
4	其他资产	2,903,823.32	0.49
5	合计	595,973,195.75	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		10.37
	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	19,999,870.00	3.49
	其中：买断式回购融资	-	0.00

注：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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2019-02-12	22.31	-	-

注：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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

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	44.91	3.76
	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	10.42	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	17.32	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	0.00	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）	30.71	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		103.35	3.76

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	50,001,112.11	8.71
	其中：政策性金融债	50,001,112.11	8.71
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	310,366,771.84	54.08
8	其他	-	0.00
9	合计	360,367,883.95	62.79
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

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	111885623	18九江银行CD070	500,000	49,585,766.67	8.64
2	111911545	19贵州银行CD005	500,000	48,651,916.34	8.48
3	180207	18国开07	400,000	40,002,235.44	6.97
4	111888594	18东莞银行CD143	300,000	29,888,211.97	5.21
5	111872529	18北部银行CD289	300,000	29,487,814.47	5.14
6	111918043	19华夏银行CD043	300,000	29,450,976.52	5.13
7	111992471	19贵州银行CD018	300,000	29,124,403.52	5.08
8	111883642	18长安银行CD113	200,000	19,887,280.52	3.47
9	111880185	18中原银行CD147	200,000	19,779,737.11	3.45
10	111885452	18长沙银行CD181	200,000	19,668,252.81	3.43

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	0.1799%
报告期内偏离度的最低值	0.0728%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1369%

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	2,903,823.32
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,903,823.32

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	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	680,087,526.09	63,456,930.37
报告期期间基金总申购份额	672,218,898.26	5,131,841.43
报告期期间基金总赎回份额	807,023,636.08	40,044,030.75
报告期期末基金份额总额	545,282,788.27	28,544,741.05

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 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周盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件；

2、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》；

3、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信周盈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。

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4月19日

建信转债增强债券型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：2019年4月19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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信转债增强债券
基金主代码	530020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月29日
报告期末基金份额总额	60,900,669.90份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。 在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析，进行灵活的大类资产配置选而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	60%×中证可转换债券指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型和股票型基金，属于中低风险收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信转债增强债券A　建信转债增强债券C
下属分级基金的交易代码	530020　531020
报告期末下属分级基金的份额总额	23,951,569.49份　36,948,500.41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1月1日 - 2019年3月31日)	
	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
1.本期已实现收益	3,281,499.31	4,767,642.44
2.本期利润	7,499,529.43	10,568,535.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.3492	0.3363
4.期末基金资产净值	59,421,566.52	89,409,185.33
5.期末基金份额净值	2.481	2.420

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