

建信利率债债券型证券投资基金(原建信
双周安心理财债券型证券投资基金)
2021 年第 1 季度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 4 月 21 日

0、公告标题

§1 重要提示

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

2.1 基金基本情况（转型前）

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

3.1 主要财务指标（转型前）

3.2 基金净值表现（转型后）

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

3.2.2 自基金转型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

3.2 基金净值表现（转型前）

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

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

3.3 其他指标

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金的业绩表现

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（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.3 本期国债期货投资评价

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。](#)

[5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。](#)

[5.10.3 其他资产构成](#)

[5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细](#)

[5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明](#)

[5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分](#)

[§ 5 投资组合报告（转型前）](#)

[5.1 报告期末基金资产组合情况](#)

[5.2 报告期债券回购融资情况](#)

[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](#)

[5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例](#)

[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](#)

[5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细](#)

[5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离](#)

[5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细](#)

[5.9 投资组合报告附注](#)

[5.9.1 基金计价方法说明](#)

[5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。](#)

[5.9.3 其他资产构成](#)

[5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分](#)

[§6 开放式基金份额变动（转型后）](#)

[§6 开放式基金份额变动（转型前）](#)

[§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）](#)

[7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况](#)

[7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细](#)

[§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）](#)

[§9 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](#)

[8.2 影响投资者决策的其他重要信息](#)

[§10 备查文件目录](#)

[9.1 备查文件目录](#)

[9.2 存放地点](#)

[9.3 查阅方式](#)

§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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	建信利率债债券
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	2021 年 1 月 21 日
报告期末基金份额总额	273,063,878.83 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过对固定收益类证券的积极投资，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体包括久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略、个券选择策略等。
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信双周安心理财债券
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	686,016,635.59 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	建信双周安心理财债券 A	建信双周安心理财债券 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	232, 596, 849. 81 份	453, 419, 785. 78 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 1 月 20 日-2021 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	3, 997, 300. 28
2. 本期利润	4, 218, 370. 28
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0071
4. 期末基金资产净值	275, 475, 434. 14
5. 期末基金份额净值	1. 0088

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。

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 1 月 20 日）	
	建信双周安心理财债券 A	建信双周安心理财债券 B
1. 本期已实现收益	348, 510. 45	1, 624, 824. 57
2. 本期利润	348, 510. 45	1, 624, 824. 57
3. 期末基金资产净值	232, 596, 849. 81	453, 419, 785. 78

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。

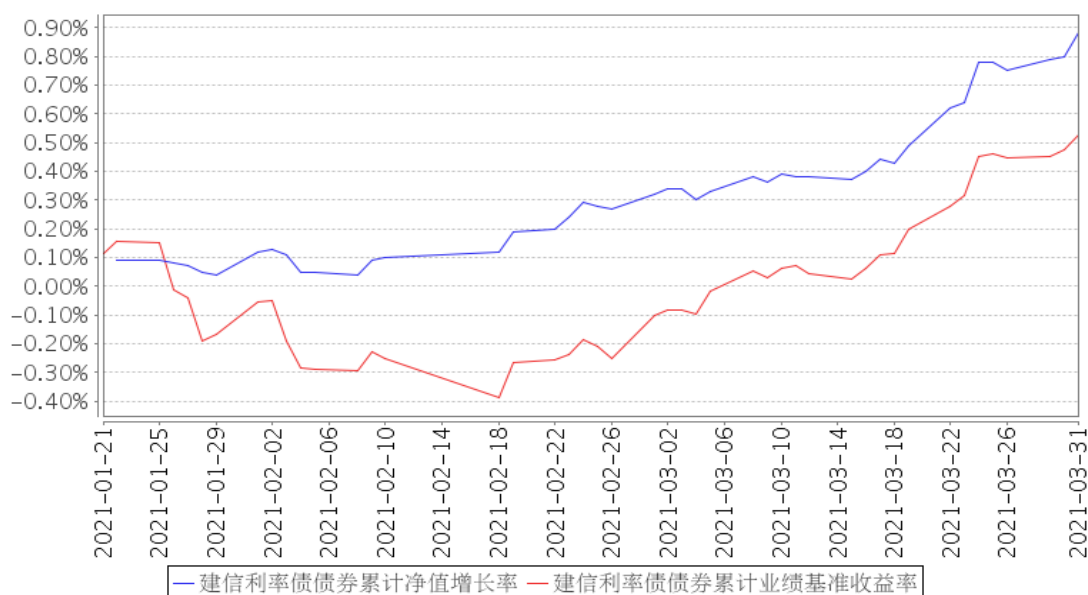
3.2 基金净值表现（转型后）

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	0.88%	0.04%	0.52%	0.07%	0.36%	-0.03%

3.2.2 自基金转型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

建信利率债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

建信双周安心理财债券 A

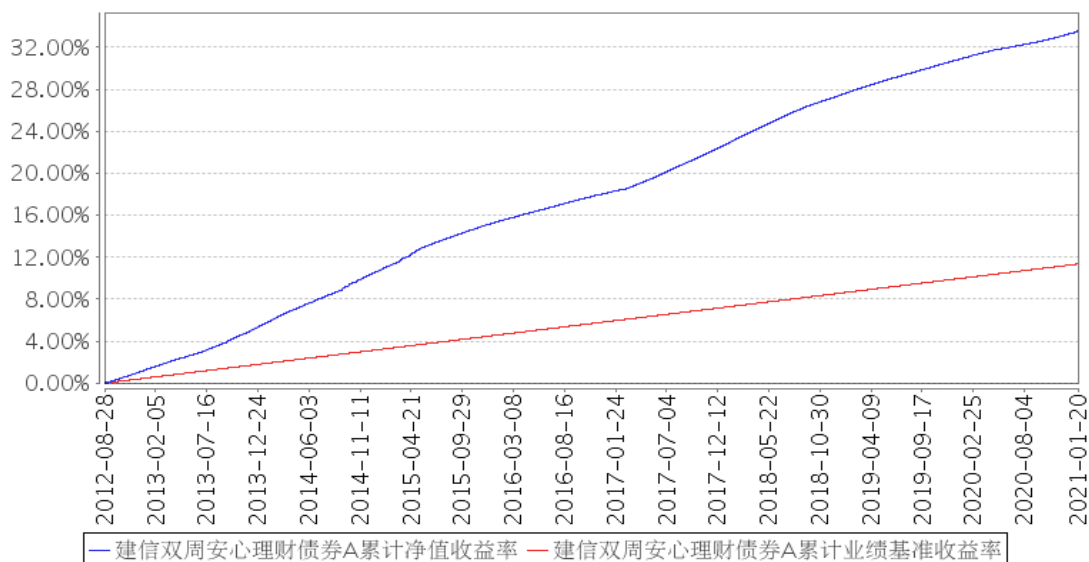
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.1572%	0.0055%	0.0740%	0.0000%	0.0832%	0.0055%
过去六个月	0.7075%	0.0024%	0.4142%	0.0000%	0.2933%	0.0024%
过去一年	1.5470%	0.0021%	1.0911%	0.0000%	0.4559%	0.0021%
过去三年	7.6956%	0.0024%	3.7948%	0.0000%	3.9008%	0.0024%
过去五年	15.1223%	0.0027%	6.4948%	0.0000%	8.6275%	0.0027%
自基金合同生效起至今	33.5369%	0.0053%	11.3474%	0.0000%	22.1895%	0.0053%

建信双周安心理财债券 B

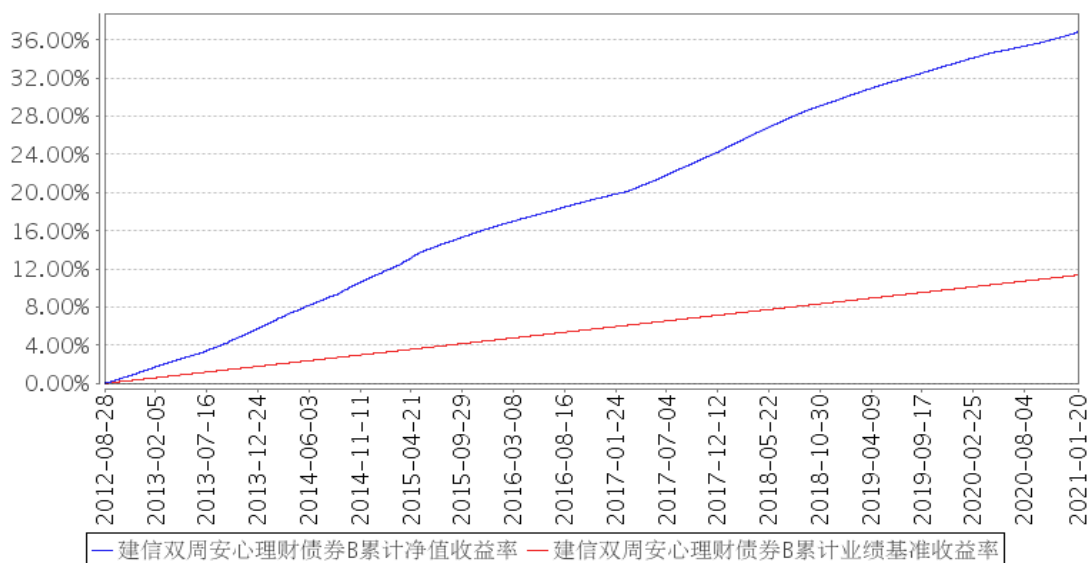
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.1730%	0.0055%	0.0740%	0.0000%	0.0990%	0.0055%
过去六个月	0.7970%	0.0024%	0.4142%	0.0000%	0.3828%	0.0024%
过去一年	1.7849%	0.0021%	1.0911%	0.0000%	0.6938%	0.0021%
过去三年	8.5776%	0.0024%	3.7948%	0.0000%	4.7828%	0.0024%
过去五年	16.7390%	0.0027%	6.4948%	0.0000%	10.2442%	0.0027%
自基金合同生效起至今	36.8334%	0.0053%	11.3474%	0.0000%	25.4860%	0.0053%

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

建信双周安心理财债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信双周安心理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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	2021年1月21日	2021年1月27日	12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，该基金于2021年1月21日转型为建信利率债债券型证券投资基金，于倩倩自2021年1月21日至1月27日继续担任该基金的基金经理；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；2019年12月13日起任建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
闫晗	本基金的基金经理	2021年1月27日	-	8年	闫晗先生，硕士。2012年10月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基

				<p>金经理助理、基金经理。2017 年 11 月 3 日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理，该基金在 2018 年 9 月 19 日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心回报定期开放债券型基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，该基金自 2019 年 4 月 25 日转型为建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；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；2019 年 4 月 30 日起任建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2019 年 9 月 17 日起任建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 17 日起任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 5 月 7 日起任建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 15 日起任建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 9 月 28 日起任建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 27 日起任建信利率债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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	2021 年 1 月 20 日	12 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

					<p>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，该基金于 2021 年 1 月 21 日转型为建信利率债债券型证券投资基金，于倩倩自 2021 年 1 月 21 日至 1 月 27 日继续担任该基金的基金经理；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；2019 年 12 月 13 日起任建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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《建信利率债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》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，今年前两个月多个主要经济数据表现突出，经济复苏动力保持强劲。从生产端上看，1-2 月全国规模以上工业增加值同比增长 35.1%，增速较 20 年末继续提升，其中装备制造业和高技术产业增加值均维持较高增速。从需求端上看，固定资产投资增速略慢，1-2 月累计增

速去除基数影响后略低于 20 年全年固定资产投资增速,从分项上看,制造业投资整体恢复仍偏慢,基础设施投资整体偏弱,而房地产投资保持较快增长,1-2 月两年复合增速高于 2020 年末。消费方面,尽管消费结构在就地过年政策下发生改变,但总量仍延续较好的修复态势,1-2 月社会消费品零售总额同比增长 33.8%,其中通讯器材、化妆品、金银珠宝等可选消费品增速恢复较快。进出口方面,同比 20 年继续保持较高速增长,外贸增长持续好于预期。总体看,我国经济运行继续呈现较强的修复态势,同时由于 2021 年一季度因基数扰动较大,多项数据增幅都较为明显。

价格指数方面,2021 年一季度价格总体保持稳定,居民消费价格指数(CPI)和工业生产者出厂价格指数(PPI)走势出现分化,CPI 进入负区间,PPI 进入快速上行阶段。PPI 上涨的原因主要是原油、有色金属等国际大宗商品价格延续上涨趋势,带动国内工业品价格环比继续回升,叠加基数效应,PPI 整体较去年回升明显。

货币政策方面,2021 年一季度货币政策维持中性,资金面在春节前后有所波动,但总体仍呈较为平衡的态势。具体来看,央行在 1 月小幅净回笼、2-3 月大致平量续作,操作利率维持不变,并未进行降息或降准操作。利率价格方面,元旦后隔夜资金利率一度低于 1%,因此央行在春节前后,操作上边际收紧引发市场担忧,利率一度上行突破 3.1%,此后进入 3 月后,资金利率一直保持平稳且总量较为宽松。

债券市场方面,一季度受资金面和通胀等因素影响,债券市场收益率先上后下。具体来看,1 月中上旬资金面宽松,收益率迅速下行,10 年期国债收益率向下突破 3.1%;此后因央行公开市场操作边际收紧引发市场对流动性的担忧,收益率大幅上行,10 年期国债突破 3.25%,同时因市场对通胀预期有所改变,10 年期国债最高逼近 3.3%;3 月因资金面重回宽松,机构配置需求较大,市场对基本面反应有所钝化,推动长债收益率下行。至一季度末 10 年期国债收益率较去年末小幅上行 4BP 到 3.57%,10 年期国债收益率上行 5BP 到 3.19%;因利率中枢上行,1 年期国债和国债较去年末分别上行 20BP 和 10BP 至 2.76%和 2.58%,期限利差收窄。

本基金于 1 月 21 日由建信双周理财转型而来,在报告期以绝对收益为目标,进行利率债波段交易,3 月份以来基金经理较为准确的判断了资金面宽松的态势,组合保持了一定的杠杆水平,增厚了组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金转型后净值增长率 0.88%,波动率 0.04%,业绩比较基准收益率 0.52%,波动率 0.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	353,410,000.00	96.40
	其中：债券	353,410,000.00	96.40
	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	6,268,469.55	1.71
8	其他资产	6,932,070.30	1.89
9	合计	366,610,539.85	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	央行票据	-	-
3	金融债券	353,410,000.00	128.29

	其中：政策性金融债	353,410,000.00	128.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	353,410,000.00	128.29

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	140205	14 国开 05	800,000	85,688,000.00	31.11
2	200410	20 农发 10	700,000	70,910,000.00	25.74
3	140229	14 国开 29	500,000	51,490,000.00	18.69
4	180408	18 农发 08	500,000	51,305,000.00	18.62
5	140211	14 国开 11	300,000	32,094,000.00	11.65

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,920,269.49
5	应收申购款	11,800.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,932,070.30

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	617,677,928.21	89.96
	其中：债券	617,677,928.21	89.96
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	45,000,187.50	6.55
	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	1,581,325.58	0.23
4	其他资产	22,332,453.87	3.25
5	合计	686,591,895.16	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	6.59	
	其中：买断式回购融资	-	
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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	44
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 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	22.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) —60 天	59.53	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	14.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	96.83	-

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

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 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	79,889,847.55	11.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	537,788,080.66	78.39
8	其他	-	-
9	合计	617,677,928.21	90.04
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名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	112014027	20 江苏银行 CD027	1,000,000	99,651,682.69	14.53
2	112015132	20 民生银行	1,000,000	99,477,483.38	14.50

		CD132			
3	209953	20 贴现国债 53	600,000	59,954,242.07	8.74
4	112021097	20 渤海银行 CD097	600,000	59,756,214.97	8.71
5	112015050	20 民生银行 CD050	500,000	49,875,254.46	7.27
6	112008018	20 中信银行 CD018	500,000	49,852,621.16	7.27
7	112074006	20 洛阳银行 CD176	500,000	49,810,195.12	7.26
8	112095263	20 南京银行 CD028	500,000	49,755,911.37	7.25
9	112094900	20 天津银行 CD038	500,000	49,746,986.15	7.25
10	112018328	20 华夏银行 CD328	300,000	29,861,731.36	4.35

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1287%
报告期内偏离度的最低值	0.0565%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0839%

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 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，南京银行股份有限公司（601009）于 2021 年 3 月 11 日发布公告，公司于该日披露其 2020 年收到的各类处罚，其中因违规办理票据及信用证业务、员工行为管理不审慎等被中国银保监会派出机构根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等的规定罚款 195 万元；因为未按规定对客户身份开展持续识别、未按规定对高风险客户采取强化识别措施等被中国人民银行派出机构罚款 676 万元；因存在办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的行为等被国家外汇管理局地方分支机构依据《中华人民共和国外汇管理条例》第 47 条第 1 项规定罚款 55 万元。合计接受处罚约 926 万元。

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	8,512.69
4	应收申购款	22,323,941.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,332,453.87

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（转型后）

单位：份

报告期期初基金份额总额	686,016,635.59
报告期期间基金总申购份额	56,200,511.83
减：报告期期间基金总赎回份额	469,153,268.59
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	273,063,878.83

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	建信双周安心理财债券 A	建信双周安心理财债券 B
报告期期初基金份额总额	224,039,107.42	1,689,165,685.75
报告期期间基金总申购份额	18,199,492.64	57,947,378.44
报告期期间基金总赎回份额	9,641,750.25	1,293,693,278.41
报告期期末基金份额总额	232,596,849.81	453,419,785.78

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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	2021 年 01 月 07 日 - 2021 年 03 月 21 日	300,000,000.00	540,863.37	300,540,863.37	-	-

	2021 年 01 月 01 日					
2	-2021 年 01 月 13 日	1, 291, 238, 573. 68		-1, 291, 238, 573. 68		

注：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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§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利率债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信利率债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信利率债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信利率债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

2021 年 4 月 21 日