

建信短债债券型证券投资基金(原建信月
盈安心理财债券型证券投资基金)
2020 年第 1 季度报告

2020 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：2020 年 4 月 21 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2020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2020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	建信短债债券		
基金主代码	530028		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020年1月13日		
报告期末基金份额总额	726,038,164.31份		
投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资短期债券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。		
投资策略	本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、国债期货投资策略以及资产支持证券投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。		
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率。		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期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		
下属分级基金的基金简称	建信短债债券 A	建信短债债券 C	建信短债债券 F
下属分级基金的交易代码	531028	530028	008022
报告期末下属分级基金的份额总额	558,403,255.13份	162,655,325.47份	4,979,583.71份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信月盈安心理财	
基金主代码	530028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月20日	
报告期末基金份额总额	1,543,543,206.06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150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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财 A	建信月盈安心理财 B
下属分级基金的交易代码	530028	531028
报告期末下属分级基金的份额总额	167,376,195.06份	1,376,167,011.00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（2020年1月13日-2020年3月31日）		
	建信短债债券 A	建信短债债券 C	建信短债债券 F
1. 本期已实现收益	3,206,059.30	914,499.08	9,671.44
2. 本期利润	4,264,364.20	1,222,519.42	17,747.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0076	0.0074	0.0036
4. 期末基金资产净值	562,667,960.57	163,862,108.87	5,017,747.53
5. 期末基金份额净值	1.0076	1.0074	1.0077

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年1月1日-2020年1月12日）	
	建信月盈安心理财 A	建信月盈安心理财 B

1. 本期已实现收益	140,463.46	3,207,483.79
2. 本期利润	140,463.46	3,207,483.79
3. 期末基金资产净值	167,376,195.06	1,376,167,011.00

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(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

建信短债债券 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
自基金合同生效起至今	0.76%	0.02%	0.81%	0.02%	-0.05%	0.00%

建信短债债券 C

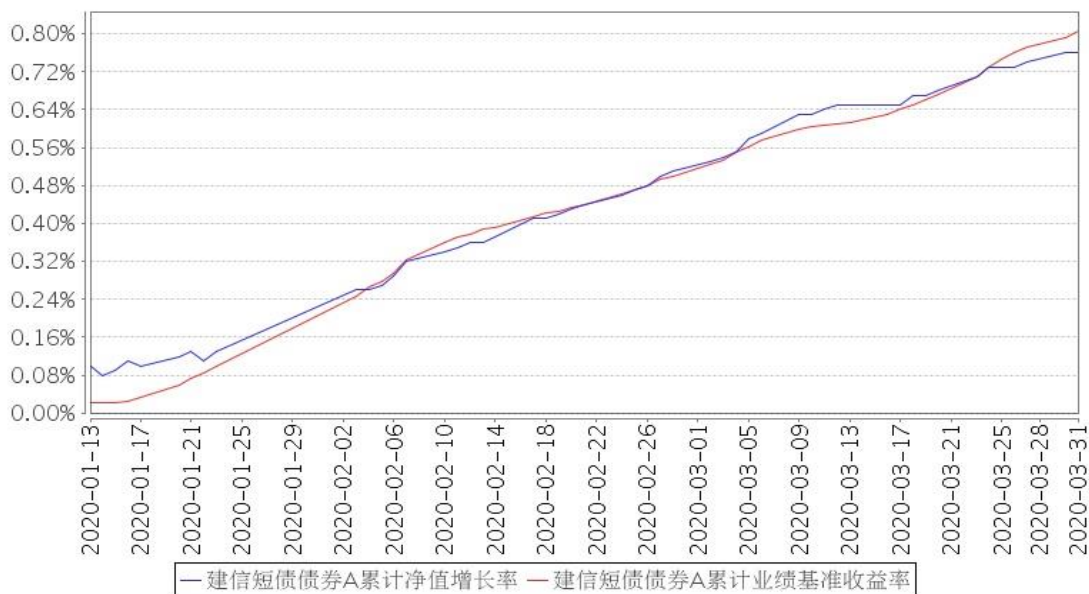
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.74%	0.02%	0.81%	0.02%	-0.07%	0.00%

建信短债债券 F

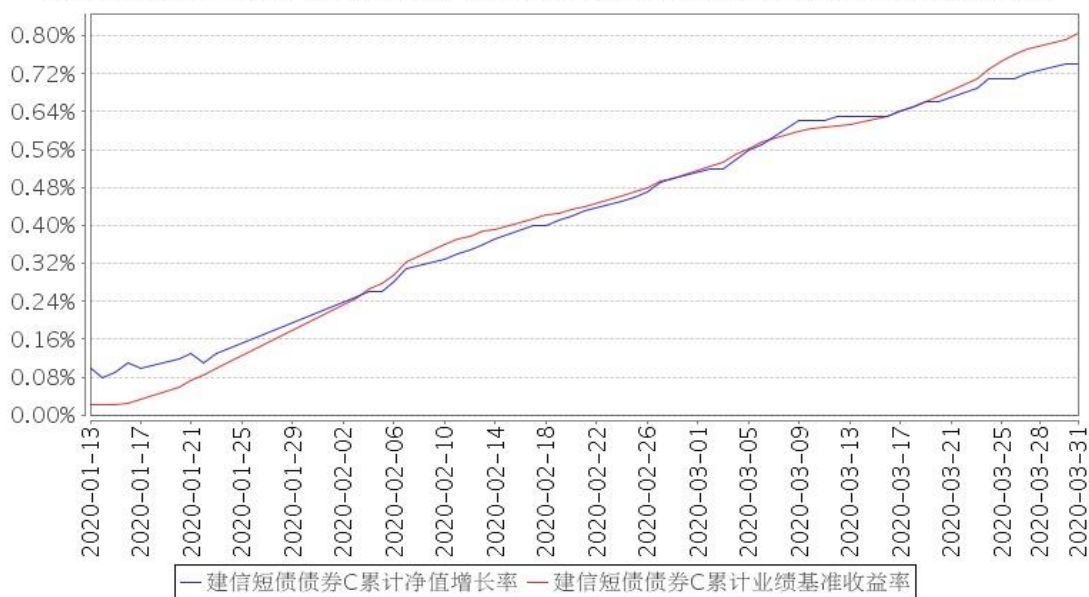
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.36%	0.01%	0.39%	0.01%	-0.03%	0.00%

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

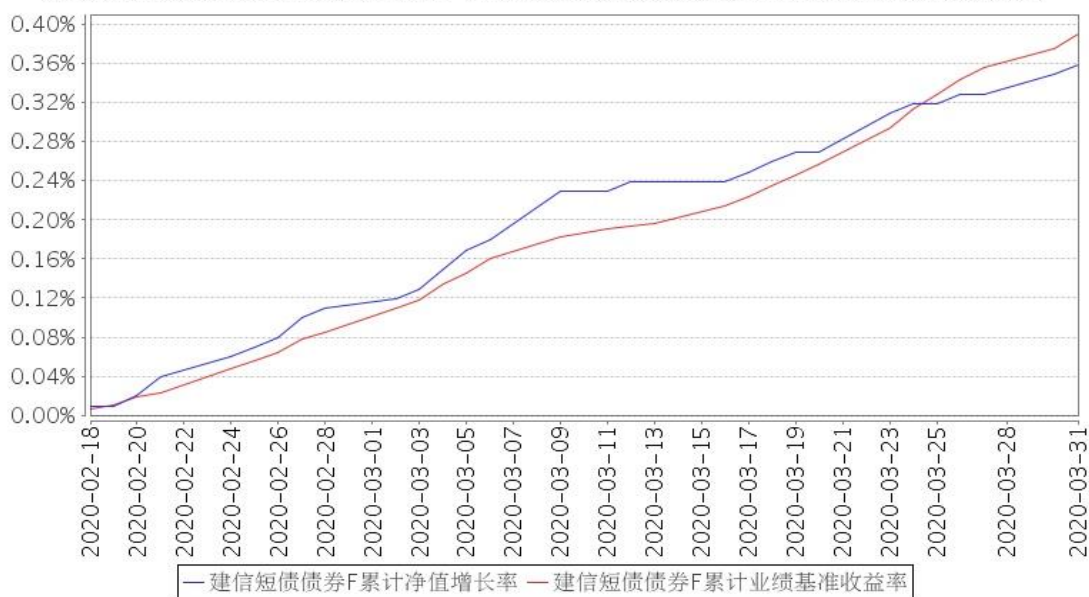
建信短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信短债债券C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



建信短债债券F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：本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

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

建信月盈安心理财 A

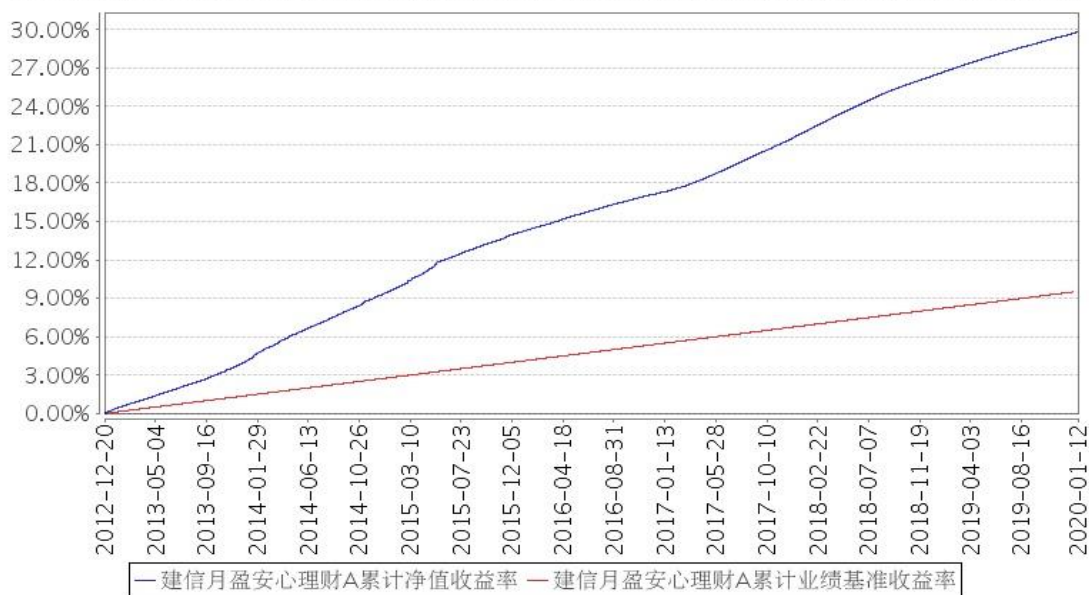
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0833%	0.0026%	0.0444%	0.0000%	0.0389%	0.0026%

建信月盈安心理财 B

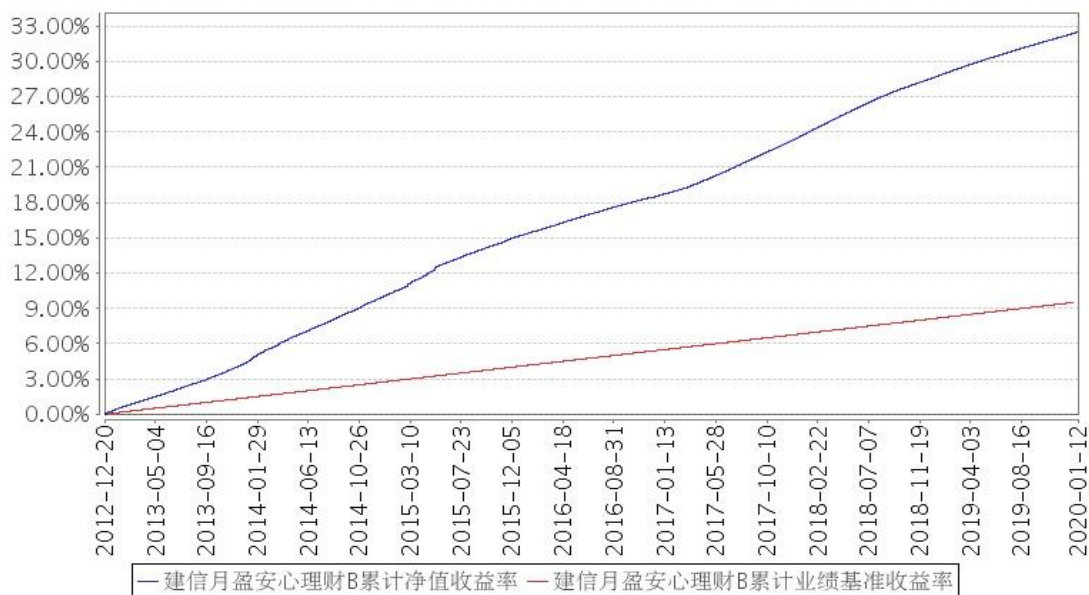
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0927%	0.0026%	0.0444%	0.0000%	0.0483%	0.0026%

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

建信月盈安心理财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



建信月盈安心理财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		
刘思	本基金的基金经理	2020年1月13日	-	10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，该基金于2020年1月13日转型为

				<p>建信短债债券型证券投资基金，刘思继续担任该基金的基金经理；2016年11月8日至2018年1月15日任建信睿享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8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）的基金经理；2017年8月9日至2020年2月23日任建信中证政策性金融债1-3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4月11日任建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金（LOF）；2017年8月16日至2018年5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；2019年4月26日起任建信睿兴纯债债券型证券投资基金的基金经理；2019年11月20日起任建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p>	
陈建良	固定收益投资部副总经理，本基金的基金经理	2020年1月13日	-	12年	<p>陈建良先生，双学士，固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行，任客户经理；2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部，任债券交易员；2013年9月加入我公司投资管理部，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理，2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理；2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理，该基金于2020年1月13日转型为建信短债债券型证券投资基金，陈建良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；2016年3月14日起任建信目标收益一年期债</p>

					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，陈建良自2018年9月19日至2019年8月20日继续担任该基金的基金经理；2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理；2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理；2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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		
刘思	本基金的基金经理	2016年7月19日	2020年1月12日	10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，该基金于2020年1月13日转型为建信短债债券型证券投资基金，刘思继续担任该基金的基金经理；2016年11月8日至2018年1月15日任建信睿享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8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）的基金经理；2017年8月9日至2020年2月23日任建信中证政策性金融债1-3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4月11日任建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金（LOF）；2017年8月16日至2018年5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；2019年4月26日起任建信睿兴纯债债券型证券投资基金的基金经理；2019年11月20日起任建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
陈建良	固定收益投资部副总经理，本基金的基金经理	2014年1月21日	2020年1月12日	12年	陈建良先生，双学士，固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行，任客户经理；2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部，任债券交易员；2013年9月加入我公司投资管理部，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理，2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理；2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理，该基金于2020年1月13日转型为建信短债债券型证券投资基金，陈建良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；2016年3月14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，陈建良自2018年9月19日至2019年8月20日继续担任该基金的基金经理；2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理；2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理；2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016年10月18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，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《建信短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》、《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

2020年第一季度，新冠肺炎疫情在全球迅速暴发，市场恐慌情绪升温，资金蜂拥避险资产。投资者对疫情的担忧逐步演变为对全球经济衰退的恐慌，资金迫切寻求安全港，国债受到青睐，收益率大幅下行。同时，美联储和多国央行也多次开展紧急公开市场操作，推出量化宽松政策，向市场投放了大量流动性。短期看，全球疫情不确定性增加，金融市场剧烈波动，欧美主要国家的经济衰退风险加剧。

国内方面，从制造业采购经理指数（PMI）上看，1到3月分别为50%、35.7%和52%，整体景气度在2月受到疫情因素影响经济活动处于停滞状态，但是3月随着复产复工稳步推进环比有所改善。3月PMI大幅回升最主要的原因在于PMI指标环比特性，反映的是相较2月大面积停工停产的低基数有所改善，3月制造业承受双重压力：一方面是复工复产尚不充分；另一方面，外需恶化、国内消费尚未大面积启动，造成生产扩张比较有限，新订单仍处于收缩状态。另外，1-2月中国工业增加值和服务业产出同比分别为-13.5%和-13%，3月负增长态势只是有所收敛。进出口方面，1-2月货物进出口总额人民币计价同比下滑9.6%，其中出口同比下降15.9%，进口增速同比下滑2.4%，1-2月实现贸易顺差为426亿元。

物价方面，1-2月份居民消费价格CPI同比上涨5.3%，分月看1、2月份全国居民消费价格同比分别上涨5.4%和5.2%；其中食品项中由于春节季节性因素影响和疫情下部分食品共计出现短

缺，食品烟酒价格同比上涨 15.6%维持较高涨幅对 CPI 带动较为明显。PPI 方面，国内工业品库存仍高企，海外疫情爆发需求被动收缩，国际原油价格暴跌传导至化工产业链，工业品价格全面塌陷。虽然国内复产复工，但终端需求恢复尚需时日。

货币政策层面，一季度资金面整体保持较为宽松的态势，流动性保持合理充裕。在疫情对经济造成较大冲击后，人民银行在货币政策层面进行了及时操作进行对冲。2月在首个工作日央行就下调 7 日逆回购利率 10BP 到 2.4%，并在 17 日同样下调 MLF 利率 10BP 到 3.15%，2 月的 1 年期和 5 年期 LPR 贷款市场报价利率分别下行 10BP 和 5BP 到 4.05%和 4.75%。随后央行在 3 月 30 日随着海外疫情蔓延再次下调 7 日逆回购利率 20BP 到 2.2%，引导短端资金利率持续下行。从数量工具上央行与 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，释放长期资金约 8000 多亿元，3 月 16 日又实施普惠金融定向降准，对达到考核标准的银行定向降准 0.5 至 1 个百分点，并对符合条件的股份制商业银行再额外定向降准 1 个百分点，总计共释放长期资金 5500 亿元。财政政策方面，2 月 17 日，财政部部长刘昆曾提到，“今后一段时间，财政运行仍将处于‘紧平衡’状态”。但是随着疫情冲击在全球扩散，外需萎缩导致国内对冲压力增大，财政开始向“积极有为”转变，政治局会议也提及后续发行特别国债和增加专项地方债的发行。

本基金在 2020 年第一季度已经转型成功，目前在按照新的基金合同建仓，因此在本季度内，久期和仓位都在逐渐增加。截至季末时点，本基金没有进行杠杆操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金转型后 A 净值增长率 0.76%，波动率 0.02%，本报告期本基金转型后 C 净值增长率 0.74%，波动率 0.02%，本报告期本基金转型后 F 净值增长率 0.36%，波动率 0.01%；本基金转型后 A、C 业绩比较基准收益率 0.81%，波动率 0.02%，本基金转型后 F 业绩比较基准收益率 0.39%，波动率 0.01%。

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	651,401,400.00	88.76
	其中：债券	651,401,400.00	88.76
	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	70,000,305.00	9.54
	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	5,312,134.51	0.72
8	其他资产	7,186,856.66	0.98
9	合计	733,900,696.17	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	50,225,000.00	6.87
	其中：政策性金融债	50,225,000.00	6.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	541,434,400.00	74.01
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	59,742,000.00	8.17
9	其他	-	-
10	合计	651,401,400.00	89.04

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	112004002	20 中国银行 CD002	600,000	59,742,000.00	8.17
2	041900220	19 津城建 CP004	500,000	50,315,000.00	6.88
3	150313	15 进出 13	500,000	50,225,000.00	6.87
4	042000038	20 银川通联 CP001	300,000	30,198,000.00	4.13
5	042000027	20 红狮 CP001	300,000	30,168,000.00	4.12

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。

基金投资的前十名证券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	4,308,009.26
5	应收申购款	2,878,847.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,186,856.66

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	607,743,302.33	39.34
	其中：债券	607,743,302.33	39.34
	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	633,270,409.35	41.00
4	其他资产	303,679,798.03	19.66
5	合计	1,544,693,509.71	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

无。

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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

报告期内投资组合平均剩余期限超过 150 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 150 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	60.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	29.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	7.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.76	-

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,888,754.52	10.36

	其中：政策性金融债	159,888,754.52	10.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,075,508.53	3.24
6	中期票据	-	-
7	同业存单	397,779,039.28	25.77
8	其他	-	-
9	合计	607,743,302.33	39.37
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	111915612	19 民生银行 CD612	2,000,000	198,891,420.72	12.89
2	111916381	19 上海银行 CD381	2,000,000	198,887,618.56	12.89
3	150313	15 进出 13	500,000	50,228,316.92	3.25
4	041900220	19 津城建 CP004	500,000	50,075,508.53	3.24
5	190402	19 农发 02	500,000	49,969,133.18	3.24
6	150208	15 国开 08	295,000	29,592,082.74	1.92
7	170307	17 进出 07	200,000	20,102,989.17	1.30
8	190206	19 国开 06	100,000	9,996,232.51	0.65

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	0.0778%
报告期内偏离度的最低值	0.0436%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0538%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内负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	298,798,542.86
3	应收利息	4,716,245.06
4	应收申购款	165,010.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	303,679,798.03

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

项目	建信短债债券 A	建信短债债券 C	建信短债债券 F
基金合同生效日(2020年1月13日)基金份额总额	1,376,167,011.00	167,376,195.06	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	816,469.39	23,074,764.37	4,979,583.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	818,580,225.26	27,795,633.96	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	558,403,255.13	162,655,325.47	4,979,583.71

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	建信月盈安心理财 A	建信月盈安心理财 B
报告期期初基金份额总额	171,299,048.13	5,797,020,025.70
报告期期间基金总申购份额	746,519.96	3,207,483.79
报告期期间基金总赎回份额	4,669,373.03	4,424,060,498.49
报告期期末基金份额总额	167,376,195.06	1,376,167,011.00

注：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	2020 年 01 月 01 日-2020 年 01 月 06 日	3,180,402,764.84	-	3,180,402,764.84	-	-
	2	2020 年 01 月 08 日-2020 年 01 月 09 日	534,459,162.81	-	534,459,162.81	-	-
	3	2020 年 01 月 13 日-2020 年 03 月 31 日	222,934,782.49	674,400.66	-	223,609,183.15	30.80
	4	2020 年 01 月 07 日-2020 年 01 月 12 日	815,549,730.36	-	815,549,730.36	-	-
	5	2020 年 01 月 13 日-2020 年 03 月 31 日	208,791,323.30	631,615.09	-	209,422,938.39	28.84
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。

注：本基金本报告期申购份额中包含了收益结转份额。

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

2020年4月21日