

建信双周安心理财债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.5 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.....	44
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47

10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	48
10.9 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录.....	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信双周安心理财债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,613,098,341.74份	
基金合同存续期	不定期	
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	785,025,411.87份	828,072,929.87份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	蒋松云
	联系电话	010-66228888	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010) 66105798
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		许会斌	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、 《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	建信双周理财 A	建信双周理财 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	25,146,598.49	17,047,318.29
本期利润	25,146,598.49	17,047,318.29
本期净值收益率	2.4616%	2.6095%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	785,025,411.87	828,072,929.87
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	13.3039%	14.2431%

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、本基金的利润分配按日结转基金份额；

3、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 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	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.3125%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2015%	0.0024%
过去三个月	1.2282%	0.0089%	0.3366%	0.0000%	0.8916%	0.0089%
过去六个月	2.4616%	0.0082%	0.6695%	0.0000%	1.7921%	0.0082%
过去一年	4.9730%	0.0104%	1.3500%	0.0000%	3.6230%	0.0104%
自基金合同 生效起至今	13.3039%	0.0075%	3.8355%	0.0000%	9.4684%	0.0075%

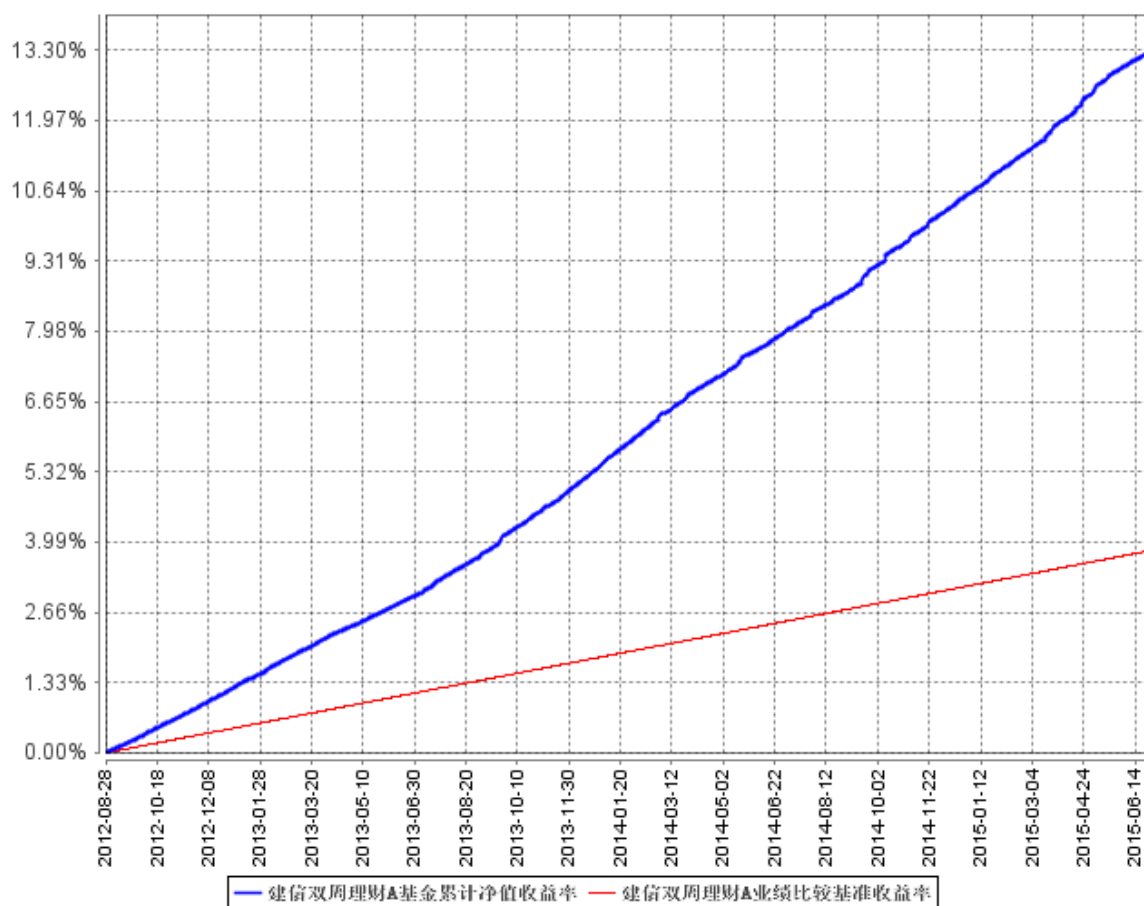
建信双周理财 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.3366%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2256%	0.0024%
过去三个月	1.3017%	0.0089%	0.3366%	0.0000%	0.9651%	0.0089%
过去六个月	2.6095%	0.0082%	0.6695%	0.0000%	1.9400%	0.0082%
过去一年	5.2781%	0.0104%	1.3500%	0.0000%	3.9281%	0.0104%
自基金合同 生效起至今	14.2431%	0.0075%	3.8355%	0.0000%	10.4076%	0.0075%

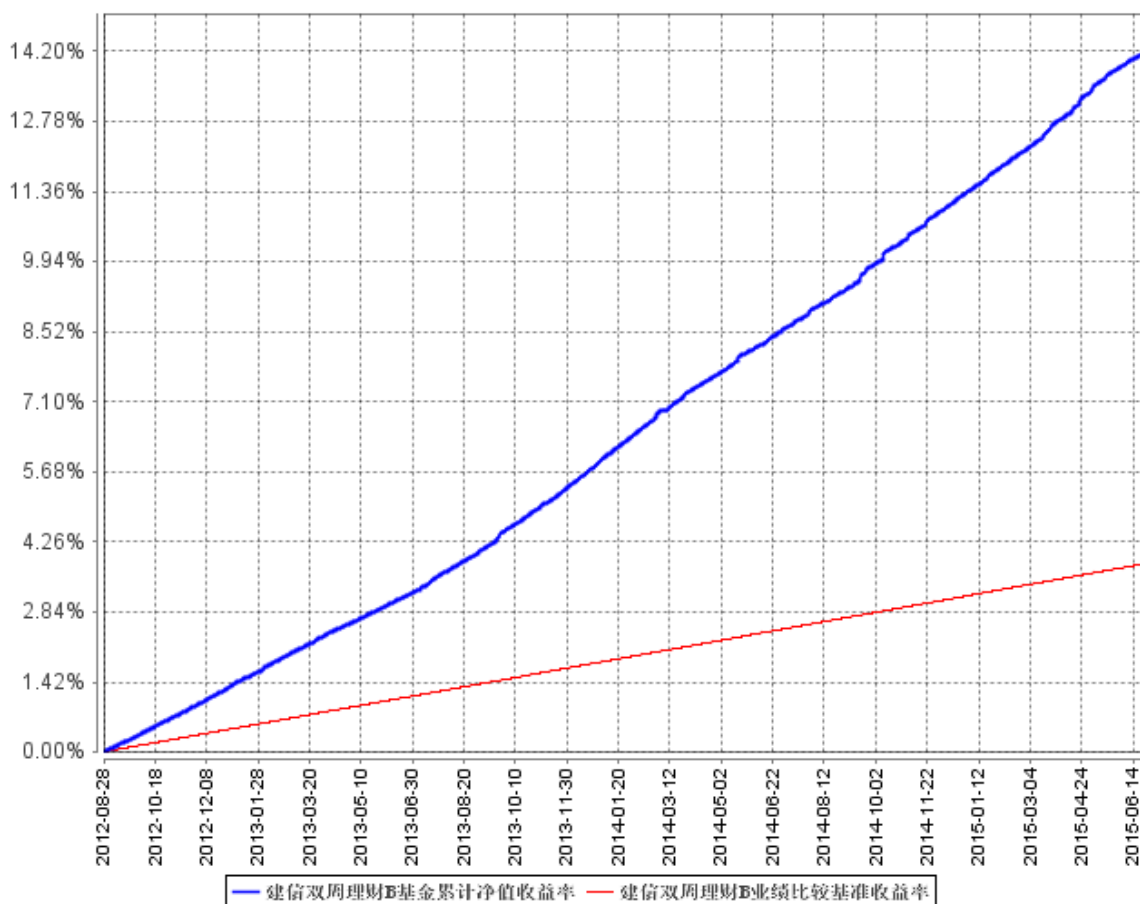
注：基金收益分配按日结转份额。

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

建信双周理财A基金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



建信双周理财B基金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



注：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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司，设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来，

公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金，共计 55 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 1654.99 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	7	<p>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，2013 年 8 月 5 日起任建信货币市场基金基金经理；2014 年 1 月 21 日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经</p>
-----	--------------	--------------------	---	---	--

					理； 2014 年 9 月 17 日 起任建信 现金添利 货币基金 的基金经 理。
朱建华	本基金的 基金经理	2012 年 8 月 28 日	-	7	硕士。曾任大连博 达系统工程公司职 员、中诚信国际信 用评级公司项目组 长， 2007 年 10 月起任 中诚信证 券评估有 限公司公 司评级部 总经理助 理， 2008 年 8 月起任 国泰基金 管理公司 高级研究 员。朱建 华于 2011 年 6 月加入 本公司， 历任高级 债券研究 员、货币 市场基金 的基金经 理助理， 2012 年 8 月 28 日 起任建信 双周安心

					<p>理财债券型证券投资基金基金经理；2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理；2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理。</p>
高珊	本基金的基金经理	2012年8月28日	-	9	<p>硕士。2006年7月至</p>

					<p>2007 年 6 月期间在中信建投证券公司工作，任交易员。</p> <p>2007 年 6 月加入建信基金管理公司，历任初级交易员、交易员，</p> <p>2009 年 7 月起任建信货币市场基金的基金经理助理。</p> <p>2012 年 8 月 28 日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>2012 年 12 月 20 日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>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；</p> <p>2013 年</p>
--	--	--	--	--	---

					9月17日起任建信周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经理。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2015 年上半年，债券市场整体呈现上涨，以净价计，2 季度表现好于 1 季度，利率债涨幅大于信用债，国债涨幅大于金融债，整体收益率曲线呈现明显的牛市增陡特征；赚钱机会关键在于把握波段操作，核心影响因素在于宽货币与宽信用的预期差变化。

经济基本面总体仍是陷于疲态；其一，高库存压力下，房地产销售端的回暖仍未带动开工投资的恢复，其二，上游大宗商品价格大幅调整后，短周期库存回补活动在缺乏下游需求端的有力支撑下，很难带来明显的提振力量，其三，受制于表外融资收缩以及存量债务置换压力，宽财政意图下的基建投资实际上是枯木难支，这也可以从钢铁、水泥产量的持续低迷表现中得到验证。

政策方向和意图总体是相对明确的，宽货币与宽信用的信号频发；前者体现在货币政策的明确放松基调上，半年内 3 次降息幅度达 75bp，2 次全面降准幅度达 150bp，还有各种 MLF、PSL、定向投放等，发力点剑指过高的实际利率，效果是显而易见的，隔夜利率回到 1 时代，7 天利率回到 2 时代，短端利率品种跟随回落 100bp 以上；后者理应体现在财政政策的发力上，赤字率的提高以及债务置换的落实，都在缓冲整体的信用系统风险，但与此同时也存在一些明显的妨碍宽信用的因素，其一是制度设计营造了过高的无风险利率（新股收益），导致宽裕的资金大量滞留金融体系，而难以流入实体活动，其二，债务清理框架下，新的融资模式如 PPP 等尚未成气候，被批复的大量项目投资计划仍缺乏有效的资金来源。

资金面在宽货币的基调下更多是有利的变化，其一，全面降准以及各种形式货币投放工具的运用，使得银行体系的超储率维持在相对较高的水平，其二，杠杆融资下股票交易量的快速上升，贡献了更多的证券保证金，也为银行间的资金融出带来了新生力量，其三，存贷比正式取消了，季末冲击开始有所减缓；相对不利的因素在于，新股审批速度加快、批量增多后在一定程度上带来了扰动，特别是大盘 IPO 供给出来后，大量逐利的打新资金被冻结，直接影响短期货币市场的流动性。

本基金以管理流动性为第一要务，除了应对正常的季节性赎回压力，打新前后申赎的扰动也明显加大，特别是打新批次增加后，间隔周期变短，扰动变得频繁，因此我们在布局资金时，也充分关注打新时点的分布，积极捕捉资金波动的机会，充分对比线上线下、场内场外、一级二级各种资产，择优投资，并利用适度杠杆策略，为投资者获得了相对较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双周理财 A 净值收益率 2.4616%，波动率 0.0082%，双周理财 B 净值收益率 2.6095%，

波动率 0.0082%; 业绩比较基准收益率 0.6695%, 波动率 0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年, 关注金融杠杆泡沫的治理以及宽信用的推进路径。

基本面而言, 关注 3 点变化, 其一, 鉴于上半年 GDP 增长中来自于第三产业金融服务业的贡献明显上升, 那么股灾后期随着配资清理下股票交易量的下滑, 其对于经济的负反馈影响更应引起注意, 其二, 上半年明显与股市财富效应产生共振的是房地产销量的持续回暖, 股灾的发生意味着这种共振效应即将面临负反馈的作用, 房地产销量的持续回暖或面临考验, 向开工投资的传导时滞可能被动延长, 其三, 宽信用的箭仍在路上, 实体融资的真实改善还需观察, 可以跟踪 2 个纬度的变化, 一是, 杠杆泡沫下的“疯牛”被治理成“慢牛”, 金融市场的“快钱”不会抢了实体的“慢钱”, 二是, 发改委规划的各种投资项目真实落地, 发债融资量或者 PPP 模式能够放量, 或者央行给开行 PSL 的量能够加码。

政策面而言, 货币政策的宽松方向应该还是不会改变, 不过结构上为了促进向实体的传导, 也许会更更多动用中长期工具, 并试图引导长端利率有所回落, 应该注意的是, 下半年可能是美联储开启升息周期的关键时点, 而年底前我们又要促进资本项下自由兑换, 央行进一步降低基准利率的顾虑可能略有增加, 且边际上的空间和影响力可能差强人意。

资金面而言, 除了传统的季节影响因素外, 关注 2 点变化, 其一是由于股市剧烈调整, IPO 审批被暂时叫停, 即使重新放开, 预计大盘 IPO 的放行也将十分谨慎, 短期对资金面的扰动将明显减弱, 其二, 存贷比正式取消后, 银行传统季节性冲存款的压力将明显减缓, 这样理财季末回表或者线下同存冲量的必要性应有所下降, 价格竞争可能也要真实地跟着资产收益走。

债券市场自 5 月降息后, 长端收益率水平反而回到前期高点附近, 接下来可能看到一些偏有利的变化, 其一, 央行要引导资金入实体, 宽松基调应不改变, 且长期工具的引导可能更多发力, 其二, 股市看起来进入调整周期, 打新收益明显下降, 债券资产的性价比明显提升, 其三, 债务置换在 3 季度仍是高峰期, 但边际冲击可能在弱化。风险因素来自猪周期的隐患, 不过从历史上看, 猪周期基本应与经济周期同步, 且实体经济疲弱背景下货币政策出现紧缩的概率仍然不大。

本基金以管理流动性为第一要务, 在保证正常流动性应对能力的前提下, 本基金将积极捕捉季节因素带来的资金波动机会, 适当布局资金至打新时点及传统季末赎回时点, 适当参与一级市场短券投标机会, 保持剩余期限在中等水平, 控制债券配比在合理水平, 继续利用杠杆策略以期

为投资者获得稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资，每日将当日收益结转为基金份额，当日收益结转的基金

份额参与下一日基金收益分配，并按月结转到投资者基金账户。本年度双周理财 A 应分配利润为 25,146,598.49 元，双周理财 B 应分配收益为 17,047,318.29 元，已全部分配，符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对建信双周安心理财债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，建信双周安心理财债券型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信双周安心理财债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信双周安心理财债券型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信双周安心理财债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	401,758,743.79	780,672,430.30
结算备付金		750,000.00	500,000.00

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,065,016,646.08	1,185,654,278.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,065,016,646.08	1,185,654,278.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	398,850,918.28	347,001,280.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	20,872,854.90	33,117,527.51
应收股利		-	-
应收申购款		15,439,869.06	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,902,689,032.11	2,346,945,516.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		288,399,455.80	310,089,134.86
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		387,008.82	422,967.76
应付托管费		114,669.30	125,323.80
应付销售服务费		228,152.95	349,246.31
应付交易费用	6.4.7.7	40,936.80	39,645.99
应交税费		-	-
应付利息		9,551.76	66,470.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	410,914.94	402,560.66
负债合计		289,590,690.37	311,495,349.74
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,613,098,341.74	2,035,450,167.01
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,613,098,341.74	2,035,450,167.01
负债和所有者权益总计		1,902,689,032.11	2,346,945,516.75

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,613,098,341.74 份。其中建信双周理财基金 A 类基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 785,025,411.87 份；建信双周理财基金 B 类基金

份额净值 1.000 元，基金份额总额 828,072,929.87 份。

6.2 利润表

会计主体：建信双周安心理财债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		52,529,151.66	52,664,898.43
1.利息收入		45,398,195.07	45,073,748.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,349,861.42	25,648,944.57
债券利息收入		21,370,621.20	15,350,225.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,677,712.45	4,074,577.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,130,956.59	7,591,150.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,130,956.59	7,591,150.21
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		10,335,234.88	7,314,523.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,309,768.34	2,588,588.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	684,375.84	766,989.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,587,975.58	2,124,509.58
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-150.00
5. 利息支出		5,501,165.70	1,569,708.37
其中：卖出回购金融资产支出		5,501,165.70	1,569,708.37
6. 其他费用	6.4.7.20	251,949.42	264,877.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,193,916.78	45,350,375.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		42,193,916.78	45,350,375.35

”号填列)			
-------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信双周安心理财债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,035,450,167.01	-	2,035,450,167.01
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	42,193,916.78	42,193,916.78
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	-422,351,825.27	-	-422,351,825.27
其中：1. 基金申购款	3,540,042,880.30	-	3,540,042,880.30
2. 基金赎回款	-3,962,394,705.57	-	-3,962,394,705.57
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-42,193,916.78	-42,193,916.78
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,613,098,341.74	-	1,613,098,341.74
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,926,426,746.36	-	1,926,426,746.36
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	45,350,375.35	45,350,375.35
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	-142,786,876.97	-	-142,786,876.97

其中：1. 基金申购款	7,280,947,222.13	-	7,280,947,222.13
2. 基金赎回款	-7,423,734,099.10	-	-7,423,734,099.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-45,350,375.35	-45,350,375.35
五、期末所有者权益（基金净值）	1,783,639,869.39	-	1,783,639,869.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙志晨</u>	<u>何斌</u>	<u>秦绪华</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信双周安心理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1112 号《关于核准建信双周安心理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 15,800,796,003.69 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 15,803,010,901.06 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,214,897.37 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成 A 级和 B 级两级基金份额,两级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每两周为一个运作期,运作期到期日前不得赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于良好流动性的固定收益类金融工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和银行协议存款、剩余期限一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、中期票据、短期融资券、剩余期限 397 天以内(含

397 天) 债券(不含可转换债券)、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税前)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票, 根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》, 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本, 按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值; 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本, 按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种, 根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允

价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，

持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,758,743.79
定期存款	400,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	150,000,000.00
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	250,000,000.00
其他存款	-
合计：	401,758,743.79

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	1,065,016,646.08	1,070,094,636.85	5,077,990.77	0.3148%
	合计	1,065,016,646.08	1,070,094,636.85	5,077,990.77	0.3148%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	398,850,918.28	-
合计	398,850,918.28	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	273.97
应收定期存款利息	4,350,724.16
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	337.50
应收债券利息	15,687,966.46
应收买入返售证券利息	833,552.81
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	20,872,854.90

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	40,936.80
合计	40,936.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金		-
应付赎回费		-
预提费用		410,914.94
合计		410,914.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信双周理财 A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,366,866,715.69	1,366,866,715.69
本期申购	1,706,080,246.97	1,706,080,246.97
本期赎回(以“-”号填列)	-2,287,921,550.79	-2,287,921,550.79
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	785,025,411.87	785,025,411.87

金额单位：人民币元

建信双周理财 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	668,583,451.32	668,583,451.32
本期申购	1,833,962,633.33	1,833,962,633.33
本期赎回(以“-”号填列)	-1,674,473,154.78	-1,674,473,154.78
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	828,072,929.87	828,072,929.87

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信双周理财 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-	-	-
本期利润	25,146,598.49	-	25,146,598.49
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-25,146,598.49	-	-25,146,598.49
本期末	-	-	-

单位：人民币元

建信双周理财 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	17,047,318.29	-	17,047,318.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-17,047,318.29	-	-17,047,318.29
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	17,470.71
定期存款利息收入	20,327,150.45
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,815.16
其他	3,425.10
合计	20,349,861.42

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,130,956.59
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,130,956.59

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,013,107,019.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	970,015,855.99
减：应收利息总额	35,960,207.12
买卖债券差价收入	7,130,956.59

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
其他费用	18,200.00
银行汇划费用	35,395.14
合计	251,949.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,309,768.34	2,588,588.13
其中：支付销售机构的客户维护费	725,976.77	948,706.30

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	684,375.84	766,989.08

注：1、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数；

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	建信双周理财 A	建信双周理财 B	合计
中国建设银行	1,290,265.05	14,228.08	1,304,493.13
工商银行	28,683.86	1,052.20	29,736.06
建信基金管理有限责任公司	1,306.26	6,828.11	8,134.37
合计	1,320,255.17	22,108.39	1,342,363.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信双周理财 A	建信双周理财 B	合计
中国建设银行	1,959,020.27	18,484.94	1,977,505.21
中国工商银行	16,833.21	0.00	16,833.21
建信基金管理有限责任公司	556.75	7,043.65	7,600.40
合计	1,976,410.23	25,528.59	2,001,938.82

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按 A 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 和 B 类基金份额前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金管理有限责任公司，再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 A 类基金份额销售服务费 = A 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数；

日 B 类基金份额销售服务费 = B 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.01% / 当年天数；

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	200,000,000.00	6,575.35
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	50,330,014.52	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,758,743.79	17,470.71	1,051,887.67	39,197.15

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息；

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

金额单位：人民币元

建信双周理财A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
25,146,598.49	-	-	25,146,598.49	-

建信双周理财B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
17,047,318.29	-	-	17,047,318.29	-

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 288,399,455.8 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140443	14 农发 43	2015 年 7 月 1 日	100.05	500,000	50,025,000.00
100230	10 国开 30	2015 年 7 月 1 日	100.44	100,000	10,044,000.00
140230	14 国开 30	2015 年 7 月 1 日	100.54	200,000	20,108,000.00
140311	14 进出 11	2015 年 7 月 1 日	101.19	200,000	20,238,000.00
041458080	14 三安 CP002	2015 年 7 月 1 日	99.98	300,000	29,994,000.00
071545003	15 瑞银 CP003	2015 年 7 月 1 日	99.98	300,000	29,994,000.00
041477001	14 蓝色光 标 CP001	2015 年 7 月 1 日	100.20	80,000	8,016,000.00
041460098	14 汉当科 CP001	2015 年 7 月 1 日	99.98	300,000	29,994,000.00
071521003	15 渤海证 券 CP003	2015 年 7 月 1 日	99.99	300,000	29,997,000.00
041464064	14 玉皇化 工 CP003	2015 年 7 月 1 日	100.00	200,000	20,000,000.00
011599149	15 鲁商 SCP004	2015 年 7 月 1 日	100.00	200,000	20,000,000.00
041458080	14 鲁宏桥 CP003	2015 年 7 月 1 日	99.98	200,000	19,996,000.00
041458076	14 龙盛 CP001	2015 年 7 月 1 日	100.10	200,000	20,020,000.00
合计				3,080,000	308,426,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	444,807,759.73	655,550,920.80
A-1 以下	-	-
未评级	519,794,819.02	349,964,131.48
合计	964,602,578.75	1,005,515,052.28

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过影子价格对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的平均剩余期限等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1- 5年	5年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	401,758,743.79	-	-	-	-	401,758,743.79
结算备付金	750,000.00	-	-	-	-	750,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,004,803,886.52	60,212,759.56	-	-	-	1,065,016,646.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	398,850,918.28	-	-	-	-	398,850,918.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-20,872,854.90	20,872,854.90
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-15,439,869.06	15,439,869.06
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,806,163,548.59	60,212,759.56	-	-	-36,312,723.96	1,902,689,032.11
负债						
卖出回购金融资产款	288,399,455.80	-	-	-	-	288,399,455.80
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	387,008.82	387,008.82
应付托管费	-	-	-	-	114,669.30	114,669.30
应付销售服务费	-	-	-	-	228,152.95	228,152.95
应付交易费用	-	-	-	-	40,936.80	40,936.80

应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	9,551.76	9,551.76
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	410,914.94	410,914.94
负债总计	288,399,455.80	-	-	-	1,191,234.57	289,590,690.37
利率敏感度缺口	1,517,764,092.79	60,212,759.56	-	-	-35,121,489.39	1,613,098,341.74
上年度末 2014年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	680,672,430.30	100,000,000.00	-	-	-	780,672,430.30
结算备付金	500,000.00	-	-	-	-	500,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	870,965,621.63	314,688,656.81	-	-	-	1,185,654,278.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	347,001,280.50	-	-	-	-	347,001,280.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-33,117,527.51	33,117,527.51
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,899,139,332.43	414,688,656.81	-	-	-33,117,527.51	2,346,945,516.75
负债						
卖出回购金融资产款	310,089,134.86	-	-	-	-	310,089,134.86
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	422,967.76	422,967.76
应付托管费	-	-	-	-	125,323.80	125,323.80
应付销售服务费	-	-	-	-	349,246.31	349,246.31
应付交易费用	-	-	-	-	39,645.99	39,645.99
应交税费	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	66,470.36	66,470.36

应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	402,560.66	402,560.66
负债总计	310,089,134.86	-	-	-	1,406,214.88	311,495,349.74
利率敏感度缺口	1,589,050,197.57	414,688,656.81	-	-	-31,711,312.63	2,035,450,167.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,065,016,646.08 元，无属于第一或第三层次的余额(2014 年 6 月 30 日：第二层次 1,384,310,961.98 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 6 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,065,016,646.08	55.97
	其中: 债券	1,065,016,646.08	55.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	398,850,918.28	20.96
	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	402,508,743.79	21.15
4	其他各项资产	36,312,723.96	1.91
5	合计	1,902,689,032.11	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	22.03	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	288,399,455.80	17.88
	其中: 买断式回购融资	-	-

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

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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过 134 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。

7.3.2 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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	34.80	17.88
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	24.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	33.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	3.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	115.70	17.88

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	340,372,429.84	21.10
	其中：政策性金融债	100,414,067.33	6.22
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	724,644,216.24	44.92
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,065,016,646.08	66.02
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	140443	14 农发 43	500,000	50,023,038.01	3.10
2	011499056	14 豫能源 SCP002	500,000	49,997,711.39	3.10
3	011599098	15 夏路桥 SCP001	500,000	49,994,960.43	3.10
4	011499076	14 包钢集 SCP001	500,000	49,993,298.76	3.10
5	071525005	15 国都证券 CP005	500,000	49,991,336.44	3.10
6	071543004	15 金元证券 CP004	500,000	49,989,679.22	3.10
7	071546004	15 国元证券 CP004	500,000	49,987,636.85	3.10
8	011515007	15 中铝业 SCP007	500,000	49,983,154.91	3.10
9	011599118	15 苏沙钢 SCP001	500,000	49,941,750.52	3.10
10	011599124	15 包钢集 SCP002	500,000	49,938,691.27	3.10

7.6 “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	99
报告期内偏离度的最高值	0.4708%
报告期内偏离度的最低值	0.1334%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3181%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

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。

7.8.2

本报告期内，本基金不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,872,854.90
4	应收申购款	15,439,869.06
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	36,312,723.96

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数(户)	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
建信双周理财 A	12,472	62,943.03	876,743.50	0.11%	784,148,668.37	99.89%
建信双周理财 B	25	33,122,917.19	648,625,906.80	78.33%	179,447,023.07	21.67%
合计	12,497	129,078.85	649,502,650.30	40.26%	963,595,691.44	59.74%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信双周理财 A	2,371.49	0.00%
	建信双周理财 B	-	0.00%
	合计	2,371.49	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	建信双周理财 A	建信双周理财 B
基金合同生效日（2012 年 8 月 28 日）基金份额总额	11,971,493,921.86	3,831,516,979.20
本报告期期初基金份额总额	1,366,866,715.69	668,583,451.32

本报告期基金总申购份额	1,706,080,246.97	1,833,962,633.33
减:本报告期基金总赎回份额	2,287,921,550.79	1,674,473,154.78
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	785,025,411.87	828,072,929.87

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期, 本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于 2015 年 3 月 26 日召开 2015 年度第一次临时股东会会议, 决定解聘杨文升先生、欧阳伯权先生公司董事职务, 并解聘顾建国先生独立董事职务, 批准聘任许会斌先生、张维义先生为公司董事, 以及李全先生为公司独立董事。2015 年 3 月 26 日公司召开第四届董事会第一次会议, 会议选举许会斌先生为公司董事长。2015 年 5 月 28 日, 公司依法完成了法定代表人变更手续, 许会斌先生为法定代表人。公司已根据相关法律法规要求, 在指定媒体公开披露了公司前述人员的变更信息, 并已在监管机构备案。

报告期内, 本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今, 本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

- （1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- （3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。
- （4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期未发生变更交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中金公司	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-614,200,000.00	100.00%	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信双周安心理财债券型证券投资基金恢复申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年6月 16日
2	建信双周安心理财债券型证券投资基金暂停申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年6月 16日
3	建信基金管理有限责任公司关于新增上海汇付金融服务有限公司为旗下代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015年6月 2日
4	建信双周安心理财债券型证券投资基金恢复申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年4月 24日
5	建信双周安心理财债券型证券投资基金暂停申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年4月 24日
6	建信双周安心理财债券型证券投资基金恢复申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年2月 12日
7	建信双周安心理财债券型证券投资基金暂停申购公告	指定报刊和/或公司网站	2015年2月 12日
8	关于新增华夏银行为旗下部分开放式基金代销机构并参加华夏银行费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015年1月 28日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信双周安心理财债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信双周安心理财债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信双周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。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 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
2015 年 8 月 29 日