

# 建信双周安心理财债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 25 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 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
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的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>20</b>
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 债券回购融资情况.....	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	47
7.8 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.....	48
7.9 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
11.1 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.....	54
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55

12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §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	15,766,542,996.48 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	993,610,230.95 份	14,772,932,765.53 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。	
	建信双周理财 A	建信双周理财 B

### 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	郭明
	联系电话	010-66228888	(010) 66105798
	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) 66105799
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号	北京市西城区复兴门内大街

	英蓝国际金融中心 16 层	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	孙志晨	易会满

## 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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,220,781.93	242,552,192.85
本期利润	20,220,781.93	242,552,192.85
本期净值收益率	2.1651%	2.3116%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	993,610,230.95	14,772,932,765.53
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	25.2862%	27.4284%

- 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	0.3349%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2239%	0.0002%
过去三个月	1.0416%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.7050%	0.0003%
过去六个月	2.1651%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.4956%	0.0005%
过去一年	4.3544%	0.0005%	1.3500%	0.0000%	3.0044%	0.0005%
过去三年	10.5754%	0.0028%	4.0537%	0.0000%	6.5217%	0.0028%
自基金合同生效起至今	25.2862%	0.0058%	7.8892%	0.0000%	17.3970%	0.0058%

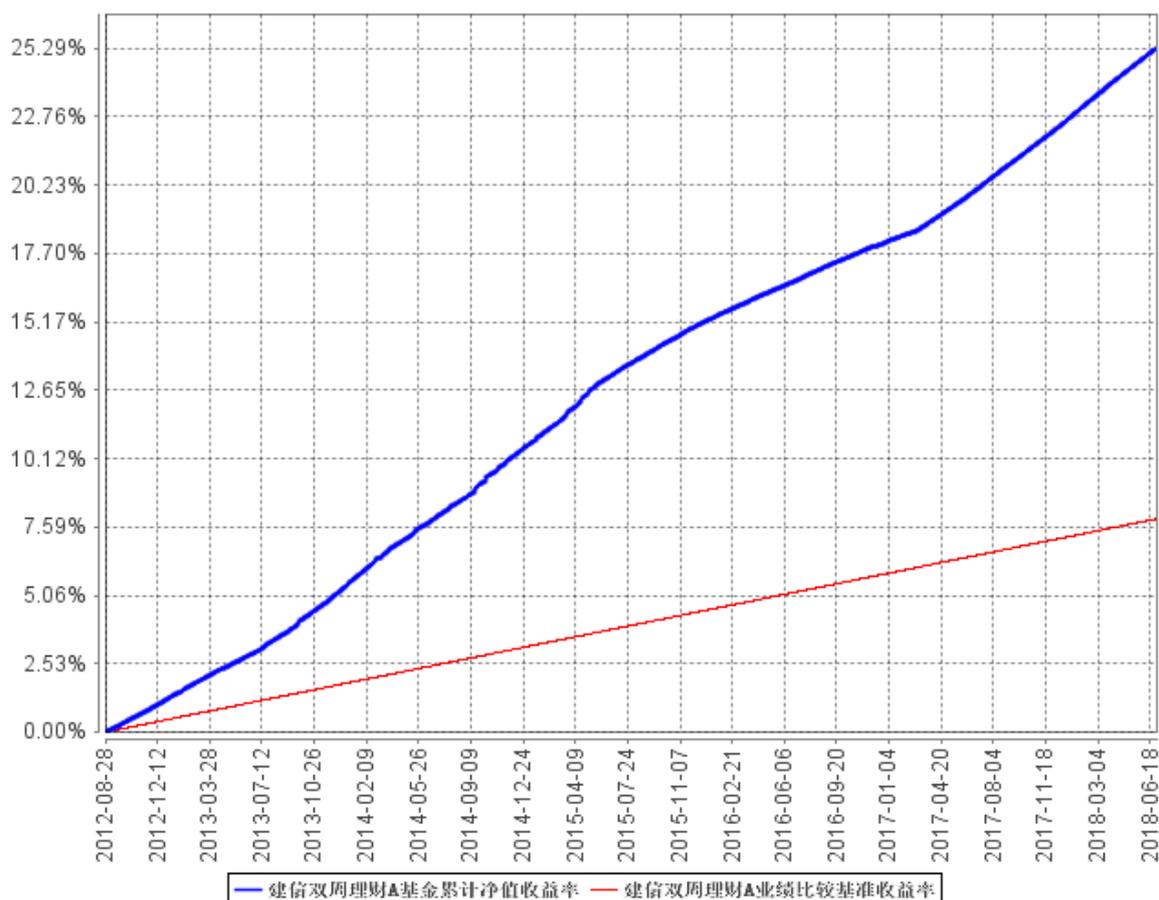
## 建信双周理财 B

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	0.3589%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.2479%	0.0002%
过去三个月	1.1147%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.7781%	0.0003%
过去六个月	2.3116%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	1.6421%	0.0005%
过去一年	4.6565%	0.0005%	1.3500%	0.0000%	3.3065%	0.0005%
过去三年	11.5414%	0.0028%	4.0537%	0.0000%	7.4877%	0.0028%
自基金合同 生效起至今	27.4284%	0.0058%	7.8892%	0.0000%	19.5392%	0.0058%

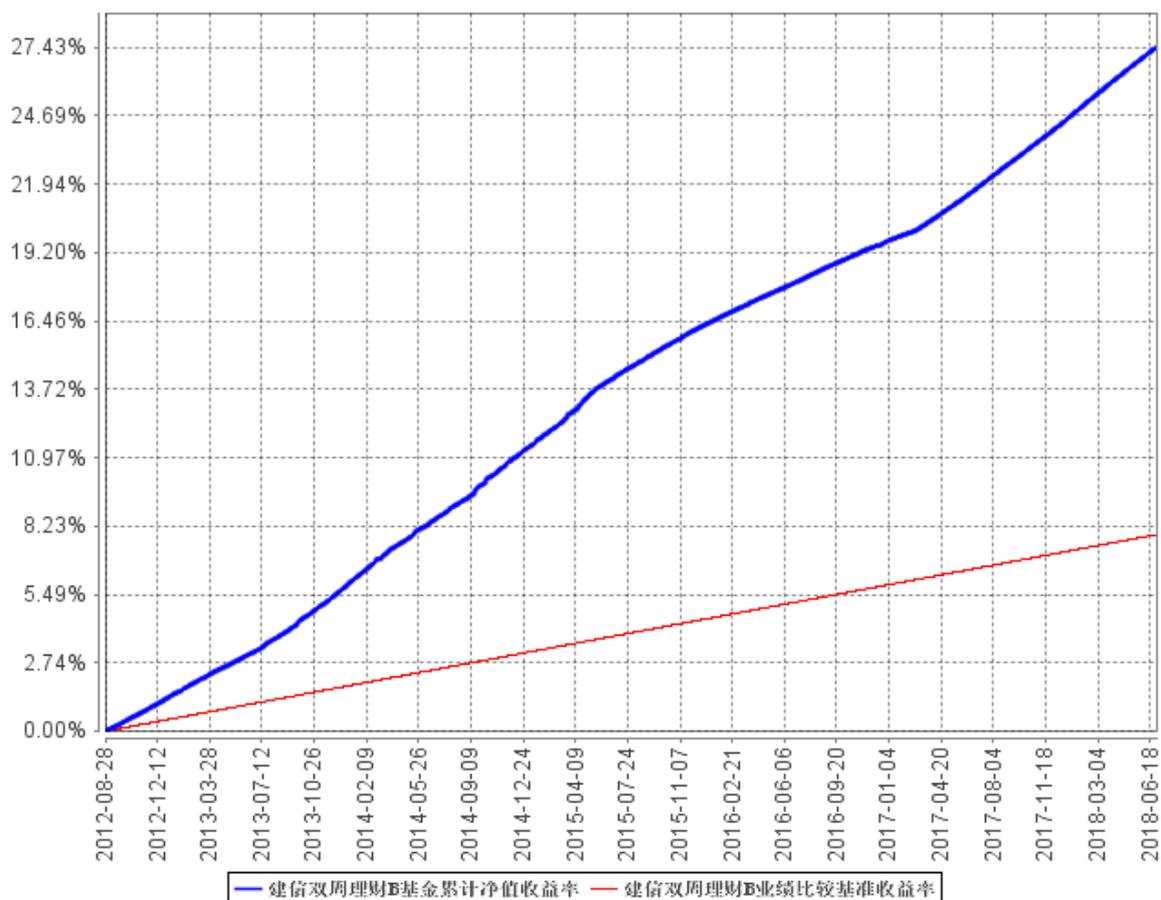
基金收益分配按日结转份额。

### 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



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、海外投资部、资产配置及量化投资部、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、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”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“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、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、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、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、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 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)、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信睿丰纯债定期开放债券

型发起式证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际  
 通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金，共计 101 只开放式基金，管理的基金净资产规  
 模共计为 6,342.88 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	-	10	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；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。
高珊	本基金的基金经理	2012 年 8 月 28 日	2018 年 4 月 2 日	11	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 8 月 28 日起至 2018 年 4 月 2 日任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2012 年 12 月 20 日至 2018 年 4 月 2 日任

					建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理； 2013 年 1 月 29 日至 2018 年 4 月 2 日任建信双 月安心理财债券型证券投资 基金的基金经理； 2013 年 9 月 17 日至 2018 年 4 月 2 日任建信周 盈安心理财债券型证券投资 基金的基金经理； 2013 年 12 月 20 日至 2018 年 4 月 2 日任建信货 币市场基金的基金经理； 2015 年 8 月 25 日至 2018 年 4 月 2 日任建信现 金添利货币市场基金的基 金经理；2016 年 6 月 3 日 至 2017 年 6 月 9 日任建信 鑫盛回报灵活配置混合型 证券投资基金的基金经理； 2016 年 7 月 26 日至 2018 年 4 月 2 日任建信现 金增利货币市场基金的基 金经理；2016 年 10 月 18 日至 2018 年 4 月 2 日任 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，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 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 2018 年上半年，债券市场在分化中整体呈现大幅上涨，其中利率债曲线大幅平坦化下行，金融债表现好于国债，短期品种收益率下行 100bp，中长期品种收益率下行 60-70bp，而信用品受违约事件升级影响表现分化，评级间利差和信用利差整体走阔。总体而言，外部贸易冲突反复，内部严监管落地加剧了信用事件暴露，政策整体转向信号明显，叠加机构风险偏好明显下降，带动了债券市场的两波上涨行情。

总量宏观数据表现韧性，但信用融资整体呈现明显收缩。一方面，PMI 指数维持在景气区间内，旺季开工和环保督查事件对工业品价格构成支撑，企业生产经营活动稳定扩张，不过已有迹象显现补库存活动可能正进入尾声；需求端基建投资增速明显回落，贸易战风波对出口预期带来负面影响，但短期形势仍相对平稳，综合来看总量数据仍体现一定的韧性；另一方面，在去杠杆的下半场，由融资紧缩引起的民企、地产、城投链条风险已经陆续显现，打破刚兑的监管思路加剧了信用事件的情绪发酵，导致总体信用融资呈现明显收缩，这是更具领先意义的指标，更能代表基本面预期的走向。

政策转向信号明显，资金利率中枢震荡回落。从官方表态来看，我国已从降杠杆进入到稳杠杆阶段，货币政策委员会例会在 1 季度去掉了‘削峰填谷’的说法，在 2 季度对流动性的表述由‘合理稳定’转变为‘合理充裕’。从央行操作来看，上半年进行了 3 次降准，年初普惠降准、4 月置换降准、6 月定向降准，都为流动性提供了较强的支撑，同时央行在公开市场上进行灵活

对冲，也很大程度上平抑了传统的季节波动因素。从监管视角来看，资管新规的影响意义深远，商业银行的表外资产负债行为面临较大的调整压力，这是 4 月降准后流动性一度异常紧张的重要原因，但由于表外资产被动收缩的速度快于负债，且新规细则尚未出台，执行层面仍耽于口径界定，整体监管因素对流动性的冲击仍相对有限。总体而言，上半年资金利率中枢呈现明显回落，以 3 个月存单为代表的短端利率从高点下行幅度超过 100bp。

整体来看，相对宽松的资金面环境有利于适度杠杆策略。一方面，本基金持有人以稳定的机构客户为主，精细化管理下负债端稳定性较好，通过密切跟踪申赎资金动向，可以保证流动性的充分应对；另一方面，上半年大幅震荡的资金面环境有利于我们捕捉预期差，本基金在 2-3 月、5-6 月主动增加了中长期资产的投资比例，积极延长了剩余期限分布。总体而言，在保证流动性充分应对的基础上，本基金努力捕捉资金面波动带来的配置机会，积极增厚组合的绝对收益，利用适度杠杆策略为投资者获得了稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信双周理财 A 的净值增长率为 2.1651%，波动率为 0.0005%；双周理财 B 的净值增长率为 2.3116%，波动率为 0.0005%；同期业绩比较基准收益率为 0.6695%，波动率为 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 2018 年下半年，我们立足于利率的相对低点，一方面需要观察一致性预期演绎的程度，密切关注可能的情绪调整与兑现窗口，另一方面需要思考预期差的方向，这可能来自于政策转向后的路径选择。总体而言，我们判断利率债可能进入区间震荡窗口，风险偏好在一定程度上得以修复，但不宜过分追涨。

短期内情绪交易可能放大。一方面，一致性预期最有利于债市的情绪反应已经兑现，外部贸易战叠加内部信用收缩带来的基本面预期走弱、机构风险偏好一刀切式回落以及货币政策转向信号释放，诸多因素叠加带动本轮利率实现均值回归；另一方面，政策确立转向后，托底经济预期升温，严监管口径转松，国常会释放财政发力信号，力度大于预期，这些操作带来明显的情绪波动，风险偏好得以修复。情绪与信心转换过程中，市场都有过度演绎的可能，由此带来的兑现或者小波段操作机会都是可选策略。

中期内关注预期差的方向，整体判断新一轮信用扩张的空间相对有限，政策对冲的落实力度可能在于减缓预期下滑斜率。一方面，中美贸易摩擦持续升级，且没有趋于缓和的迹象，从总需

求的角度而言，难以支持供给端的新一轮大幅扩张；另一方面，财政跟随货币发力的方式是选择大水漫灌还是定向引导，仍是关键的分歧点，国常会定调出来，宽财政信号预期强烈，而政治局会议重提去杠杆与坚决遏制房价上涨，则一定程度上体现出不走大水漫灌路径的倾向，站在中期的战略应对视角，定向引导路径可能面临短期需求不足的问题，但更有利于产业经济结构的矛盾消解与长远发展。

货币政策有望保持宽松基调，资金利率中枢快速下沉，关注政策指向性信用扩张带来的资金溢出影响。继定向降准后，央行以 MLF 供给来鼓励银行投资信用债，MPA 考核中资本项因子下调，同时理财新规基调放松，监管窗口指导信托加快项目投放，都是在保证流动性合理充裕的情境下，明确鼓励信用体系的修复，这意味着短期内流动性过度淤积在银行间体系内的局面，可能在未来一个季度内得以疏导，短端利率中枢下沉的同时，仍有波动操作的空间。另一个视角而言，利率曲线期限利差处于高位，如果流动性持续淤积在银行间体系内，没有如期导向实体，则意味着信用扩张力度不及预期，中长端利率相应具备新的交易价值。

资金利率大幅回落的环境下，本基金一方面需要关注负债端资金的稳定度变化，一些因素可能带来负面影响，如客户对收益的心理预期差、大类资产性价比变化、银行类客户面临的监管压力等，我们会提前做好压力测试工作，以便于保证充足的流动性应对能力；另一方面在资产端我们将继续保持适度杠杆策略，积极捕捉资金预期差，以谨慎态度布局资产的期限结构，在类属上择机增配高等级信用品，为可能的利率波动积累一定的安全垫，争取为投资者在低利率环境中获得相对稳定的收益。

#### 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[2017]13号文《中国证监会关于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。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，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。

本公司根据《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》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，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（适用货币基金和理财类基金）；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），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

#### **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。本半年度双周理财 A 应分配利润为 20,220,781.93 元，双周理财 B 应分配收益为 242,552,192.85 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》及其他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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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 2018 年半年度报告中财务指标、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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,821,957,071.86	4,388,431,711.50
结算备付金		7,013,636.36	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,543,680,679.60	1,697,243,073.59
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,543,680,679.60	1,697,243,073.59
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	1,401,526,442.29	671,451,936.73
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	49,531,217.80	36,337,146.19
应收股利		-	-
应收申购款		13,578,949.97	13,098,852.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,837,287,997.88	6,806,562,720.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		1,066,927,679.60	183,520,824.32
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,086,597.25	1,072,012.47
应付托管费		579,610.35	297,781.24
应付销售服务费		369,658.73	199,128.59
应付交易费用	6.4.7.7	74,002.52	45,096.70

应交税费		-	-
应付利息		386,346.68	128,323.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	321,106.27	561,345.49
负债合计		1,070,745,001.40	185,824,511.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	15,766,542,996.48	6,620,738,208.96
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,766,542,996.48	6,620,738,208.96
负债和所有者权益总计		16,837,287,997.88	6,806,562,720.80

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 15,766,542,996.48 份。其中建信双周理财基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 993,610,230.95 份；建信双周理财基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 14,772,932,765.53 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		288,259,076.75	96,758,911.40
1.利息收入		288,219,229.33	98,576,962.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	148,749,768.06	58,428,829.81
债券利息收入		122,718,488.77	25,501,063.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,750,972.50	14,647,069.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,847.42	-1,818,051.00
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	39,847.42	-1,818,051.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		25,486,101.97	13,925,631.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,352,593.95	5,736,218.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,875,720.56	1,691,187.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,938,293.28	667,339.62
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		10,046,878.05	5,556,766.61
其中：卖出回购金融资产支出		10,046,878.05	5,556,766.61
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	272,616.13	274,119.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		262,772,974.78	82,833,279.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		262,772,974.78	82,833,279.97

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	6,620,738,208.96	-	6,620,738,208.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	262,772,974.78	262,772,974.78
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）	9,145,804,787.52	-	9,145,804,787.52
其中：1. 基金申购款	16,237,691,127.07	-	16,237,691,127.07
2. 基金赎回款	-7,091,886,339.55	-	-7,091,886,339.55
四、本期向基金份额持	-	-262,772,974.78	-262,772,974.78

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	15,766,542,996.48	-	15,766,542,996.48
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	4,165,980,690.54	-	4,165,980,690.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,833,279.97	82,833,279.97
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）	-1,033,808,435.27	-	-1,033,808,435.27
其中：1. 基金申购款	6,983,326,017.25	-	6,983,326,017.25
2. 基金赎回款	-8,017,134,452.52	-	-8,017,134,452.52
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）	-	-82,833,279.97	-82,833,279.97
五、期末所有者权益（基金净值）	3,132,172,255.27	-	3,132,172,255.27

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：

张军红	吴曙明	丁颖
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购、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，因此形成不同的基金份额类别。本基金将设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。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)、以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金的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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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 2018 年半年度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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中

抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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，股票的股息、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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。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，暂免征收个人所得税。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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2018年6月30日
活期存款	1,957,071.86
定期存款	5,820,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	2,920,000,000.00
存款期限3个月以上	2,900,000,000.00
其他存款	-
合计：	5,821,957,071.86

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018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	9,543,680,679.60	9,556,065,000.00	12,384,320.40	0.0785%
	合计	9,543,680,679.60	9,556,065,000.00	12,384,320.40	0.0785%
	资产支持券	-	-	-	-
	合计	9,543,680,679.60	9,556,065,000.00	12,384,320.40	0.0785%

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

无。

### 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	200,000,000.00	-
银行间买入返售证券	1,201,526,442.29	-
合计	1,401,526,442.29	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	658.83
应收定期存款利息	26,337,228.32
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,156.10
应收债券利息	20,770,112.02
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,420,062.53
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	49,531,217.80

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	74,002.52
合计	74,002.52

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	321,106.27
其他	-
合计	321,106.27

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	549,160,063.16	549,160,063.16
本期申购	3,325,327,437.47	3,325,327,437.47
本期赎回(以“-”号填列)	-2,880,877,269.68	-2,880,877,269.68
- 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	993,610,230.95	993,610,230.95

金额单位：人民币元

建信双周理财 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,071,578,145.80	6,071,578,145.80
本期申购	12,912,363,689.60	12,912,363,689.60
本期赎回(以“-”号填列)	-4,211,009,069.87	-4,211,009,069.87
- 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	14,772,932,765.53	14,772,932,765.53

**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	20,220,781.93	-	20,220,781.93
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	-20,220,781.93	-	-20,220,781.93
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	242,552,192.85	-	242,552,192.85
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	-242,552,192.85	-	-242,552,192.85
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	40,638.72
定期存款利息收入	148,588,146.05
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,074.73
其他	94,908.56
合计	148,749,768.06

**6.4.7.12 股票投资收益**

无。

**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 2018年1月1日至2018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	39,847.42
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	39,847.42

**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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,800,705,636.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,784,669,470.88
减：应收利息总额	15,996,317.81
买卖债券差价收入	39,847.42

**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**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.18 其他收入**

无。

**6.4.7.19 交易费用**

无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	56,035.79
信息披露费	148,745.49
银行划款手续费	49,234.85
其他费用	18,600.00
合计	272,616.13

## 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

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 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

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

#### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,352,593.95	5,736,218.77
其中：支付销售机构的客户维护费	841,628.55	192,479.49

1、于 2017 年 06 月 05 日前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、根据基金管理人于 2017 年 06 月 06 日发布的《关于建信双周安心理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2017 年 06 月 05 日起，本基金管理人报酬调整为按前一日基金资产净值 0.18%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×0.18%/ 当年天数。

3、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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,875,720.56	1,691,187.15

1、本基金托管费为按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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
中国工商银行	104,079.64	3,788.67	107,868.31
建设银行	602,573.10	15,580.77	618,153.87
建信基金管理有限责任公司	2,290.95	491,381.19	493,672.14
合计	708,943.69	510,750.63	1,219,694.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	363,912.21	790.55	364,702.76
建信基金	2,224.28	203,763.06	205,987.34
中国工商银行	13,392.06	86.60	13,478.66
合计	379,528.55	204,640.21	584,168.76

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.3%和0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日对应类别基金资产净值 X 约定年费率 / 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

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
工商银行股份有限公司(“工商银行”)	-	-	-	-	1,210,000,000.00	90,293.15
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行股份有限公司(“工商银行”)	-	-	-	-	-	-

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	52,426,373.51
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	1,226,045.19
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	53,652,418.70
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.36%

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	100,082,178.89
期间申购/买入总份额	-	1,187,207.86
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	50,000,000.00
期末持有的基金份额	-	51,269,386.75
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.80%

**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**

无。

**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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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：活期存款	1,957,071.86	40,638.72	4,990,564.76	92,453.09

本基金的活期存款由基金托管人中国工商银行保管，按约定利率计息。

**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**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

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
20,220,781.93	-	-	20,220,781.93	-

## 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
242,552,192.85	-	-	242,552,192.85	-

**6.4.12 期末（2018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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### 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 2018 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 1,201,526,442.29 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
170211	17 国开 11	2018 年 7 月 4 日	100.13	1,500,000	150,195,000.00
180301	18 进出 01	2018 年 7 月 4 日	100.29	560,000	56,162,400.00
150418	15 农发 18	2018 年 7 月 4 日	100.03	460,000	46,013,800.00
170207	17 国开 07	2018 年 7 月 4 日	100.00	1,600,000	160,000,000.00
111895674	18 天津银行 CD124	2018 年 7 月 6 日	98.85	710,000	70,183,500.00
170410	17 农发 10	2018 年 7 月 5 日	100.03	100,000	10,003,000.00
140202	14 国开 02	2018 年 7 月 5 日	101.09	100,000	10,109,000.00
150418	15 农发 18	2018 年 7 月 5 日	100.03	140,000	14,004,200.00
160301	16 进出 01	2018 年 7 月 5 日	99.46	800,000	79,568,000.00
180201	18 国开 01	2018 年 7 月 5 日	100.30	1,300,000	130,390,000.00
180301	18 进出 01	2018 年 7 月 5 日	100.29	740,000	74,214,600.00
180407	18 农发 07	2018 年 7 月 5 日	100.16	3,000,000	300,480,000.00
合计				11,010,000	1,101,323,500.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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、  
内控合规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  
督察长和内控合规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。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，  
则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	8,513,843,058.76	1,317,715,438.32
合计	8,513,843,058.76	1,317,715,438.32

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、偏离度、剩余期限、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，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 2018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	5,621,957,071.86	200,000,000.00	0.00	-	-	5,821,957,071.86
结算备付金	7,013,636.36	-	-	-	-	7,013,636.36
存出保证金	0.00	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产	8,089,718,317.16	1,453,962,362.44	0.00	-	-	9,543,680,679.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	1,401,526,442.29	0.00	0.00	-	-	1,401,526,442.29
应收证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	49,531,217.80	49,531,217.80
应收股利	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	13,578,949.97	13,578,949.97
其他资产	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	15,120,215,467.67	1,653,962,362.44	0.00	-	63,110,167.77	16,837,287,997.88
负债						
卖出回购金融资产款	1,066,927,679.60	0.00	0.00	-	-	1,066,927,679.60
短期借款	-	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00

应付赎回款	-	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,086,597.25	2,086,597.25
应付托管费	-	-	-	-	579,610.35	579,610.35
应付销售服务费	-	-	-	-	369,658.73	369,658.73
应付交易费用	-	-	-	-	74,002.52	74,002.52
应交税费	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	-	386,346.68	386,346.68
应付利润	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	321,106.27	321,106.27
负债总计	1,066,927,679.60	0.00	0.00	-	3,817,321.80	1,070,745,001.40
利率敏感度缺口	14,053,287,788.07	1,653,962,362.44	0.00	-	-59,292,845.97	15,766,542,996.48
上年度末 2017 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	4,388,431,711.50	0.00	0.00	-	-	4,388,431,711.50
结算备付金	0.00	-	-	-	-	0.00
存出保证金	0.00	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产	1,489,031,128.16	208,211,945.43	0.00	-	-	1,697,243,073.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	671,451,936.73	0.00	0.00	-	-	671,451,936.73
应收证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	36,337,146.19	36,337,146.19
应收股利	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	13,098,852.79	13,098,852.79
其他资产	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	6,548,914,776.39	208,211,945.43	0.00	-	-49,435,998.98	6,806,562,720.80
负债						
卖出回购金融资产款	183,520,824.32	0.00	0.00	-	-	183,520,824.32
短期借款	-	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,072,012.47	1,072,012.47
应付托管费	-	-	-	-	297,781.24	297,781.24
应付销售服务费	-	-	-	-	199,128.59	199,128.59
应付交易费用	-	-	-	-	45,096.70	45,096.70
应交税费	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	-	128,323.03	128,323.03
应付利润	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	561,345.49	561,345.49
负债总计	183,520,824.32	0.00	0.00	-	2,303,687.52	185,824,511.84
利率敏感度缺口	6,365,393,952.07	208,211,945.43	0.00	-	-47,132,311.46	6,620,738,208.96

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 2017 年 06 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 880,051,361.79 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2016 年 06 月 30 日：第二层次 2,810,784,669.61 元，无第一层次或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2017 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(2016 年 06 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。

## §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	9,543,680,679.60	56.68
	其中: 债券	9,543,680,679.60	56.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,401,526,442.29	8.32
	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	5,828,970,708.22	34.62
4	其他各项资产	63,110,167.77	0.37
5	合计	16,837,287,997.88	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		5.80
	其中: 买断式回购融资		0.01
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	1,066,927,679.60	6.77
	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。

## 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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

### 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存续期未超过 120 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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	5.96	6.77
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	45.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	14.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	26.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.39	6.77

### 7.4 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。

### 7.5 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	1,029,837,620.84	6.53
	其中：政策性金融债	1,029,837,620.84	6.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,513,843,058.76	54.00
8	其他	-	-
9	合计	9,543,680,679.60	60.53
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 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	111880204	18 华融湘江银行 CD116	5,000,000	495,111,447.34	3.14
2	111892423	18 徽商银行 CD028	3,800,000	377,584,119.78	2.39
3	111898178	18 河北银行 CD023	3,500,000	339,443,814.89	2.15
4	111818144	18 华夏银行 CD144	3,400,000	337,596,704.04	2.14
5	180407	18 农发 07	3,000,000	299,857,395.98	1.90
6	111897773	18 东莞银行 CD054	3,000,000	298,057,769.07	1.89
7	111815247	18 民生银行 CD247	3,000,000	297,984,563.31	1.89
8	111811181	18 平安银行 CD181	3,000,000	297,138,575.56	1.88
8	111810313	18 兴业银行 CD313	3,000,000	297,138,575.56	1.88
9	111899682	18 厦门银行 CD077	3,000,000	296,979,559.80	1.88
10	111880069	18 厦门银行 CD082	2,500,000	247,523,962.63	1.57

## 7.7 “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	0.1094%
报告期内偏离度的最低值	0.0009%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0325%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金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%。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

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。

### 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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。

### 7.9.3 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	49,531,217.80
4	应收申购款	13,578,949.97
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	63,110,167.77

#### **7.9.4 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。

## §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	45,584	21,797.35	7,717,379.62	0.78%	985,892,851.33	99.22%
建信双周理财 B	62	238,273,109.12	14,566,674,745.85	98.60%	206,258,019.68	1.40%
合计	45,646	345,409.08	14,574,392,125.47	92.44%	1,192,150,871.01	7.56%

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

无。

### 8.3 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	3,443,337.64	0.35%
	建信双周理财 B	-	-

	合计	3,443,337.64	0.02%
--	----	--------------	-------

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）。

#### 8.4 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信双周理财 A	>100
	建信双周理财 B	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	建信双周理财 A	-
	建信双周理财 B	-
	合计	-

### §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	11,972,684,138.09	3,831,897,911.92
本报告期期初基金份额总额	549,160,063.16	6,071,578,145.80
本报告期基金总申购份额	3,325,327,437.47	12,912,363,689.60
减：本报告期基金总赎回份额	2,880,877,269.68	4,211,009,069.87
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	993,610,230.95	14,772,932,765.53

总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2018 年第一次临时股东会和第五届董事会第一次会议审议通过，自 2018 年 4 月 18 日起，许会斌先生不再担任本公司董事长（法定代表人），由孙志晨先生担任本公司董事长（法定代表人）；孙志晨先生不再担任本公司总裁，由张军红先生担任本公司总裁。上述事项本公司已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2018 年 4 月 20 日公告。

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	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期无新增或删除交易单元。

**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	-	-	4,122,800,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

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	关于新增中投证券为旗下部分开放式基金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	2018年6月29日
2	关于建信双周安心理财债券型基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年4月4日
3	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月31日
4	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月31日
5	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月23日
6	建信双周安心理财债券型证券投资基金暂停大额申购的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年1月23日
7	关于新增珠海盈米财富管理有限公司为建信双周安心理财等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年1月16日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	2018 年 01 月 01 日 - 2018 年 03 月 26 日	2,027,449,961.83	2,052,242,593.96	2,049,925,527.64	2,029,767,028.15	12.87%
	2	2018 年 03 月 21 日 - 2018 年 06 月 26 日	0.00	3,039,929,431.88	0.00	3,039,929,431.88	19.28%

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。本基金本报告期申购份额中包含了收益结转份额。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 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

2018 年 8 月 25 日