

建信安心回报定期开放债券型 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

| | |
|--|-----------|
| §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 | 6 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 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..... | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| §5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 21 |
| 6.1 资产负债表..... | 21 |
| 6.2 利润表..... | 22 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 23 |
| 6.4 报表附注..... | 24 |

| | |
|--|-----------|
| §7 投资组合报告 | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 46 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 46 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 46 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 47 |
| 7.6 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..... | 47 |
| 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..... | 48 |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 48 |
| 7.9 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..... | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 48 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 49 |
| §8 基金份额持有人信息 | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| §9 开放式基金份额变动 | 51 |
| §10 重大事件揭示 | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 52 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 52 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| §11 备查文件目录 | 55 |
| 11.1 备查文件目录..... | 55 |
| 11.2 存放地点..... | 55 |
| 11.3 查阅方式..... | 55 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称 | 建信安心回报定期开放债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 建信安心回报债券 | |
| 基金主代码 | 000105 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 5 月 14 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 | 86,999,359.14 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 建信安心回报债券 A | 建信安心回报债券 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 000105 | 000106 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,662,775.48 份 | 36,336,583.66 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持较高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金在债券资产所提供的稳定收益的基础上，适当参与一级市场新股申购或增发新股，为基金份额持有人增加收益，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上，采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上，本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。</p> |
| 业绩比较基准 | 两年期银行定期存款收益率(税前)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | | 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 | 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 | 建信安心回报债券 A | 建信安心回报债券 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 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 | 1,287,008.83 | 829,724.39 |
| 本期利润 | 2,074,293.60 | 1,383,285.87 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0409 | 0.0381 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.36% | 3.19% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.43% | 3.23% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 11,838,782.00 | 7,572,384.45 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2337 | 0.2084 |
| 期末基金资产净值 | 62,737,938.95 | 44,076,936.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.238 | 1.213 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 25.02% | 22.50% |

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

建信安心回报债券 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

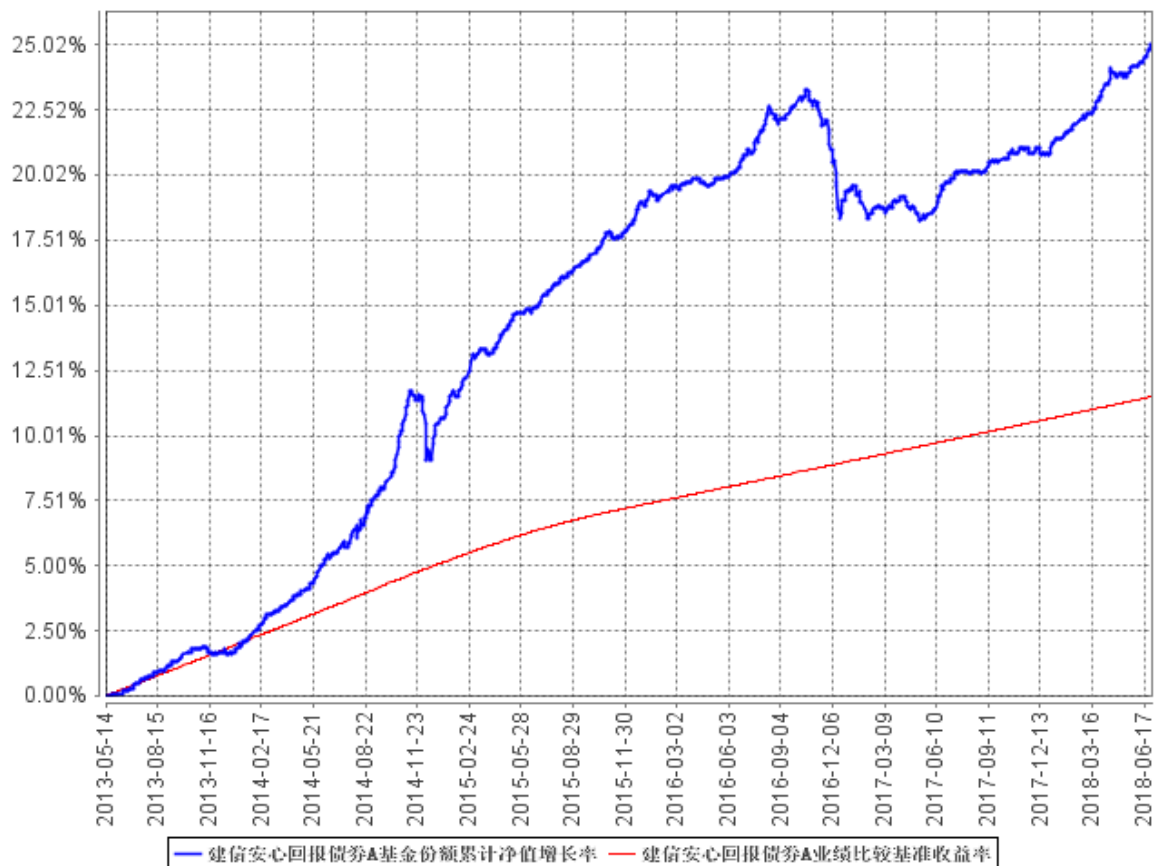
| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.65% | 0.05% | 0.13% | 0.00% | 0.52% | 0.05% |
| 过去三个月 | 1.64% | 0.07% | 0.38% | 0.00% | 1.26% | 0.07% |
| 过去六个月 | 3.43% | 0.06% | 0.76% | 0.00% | 2.67% | 0.06% |
| 过去一年 | 4.38% | 0.05% | 1.53% | 0.00% | 2.85% | 0.05% |
| 过去三年 | 8.69% | 0.08% | 4.80% | 0.00% | 3.89% | 0.08% |
| 自基金合同 生效起至今 | 25.02% | 0.09% | 11.50% | 0.01% | 13.52% | 0.08% |

建信安心回报债券 C

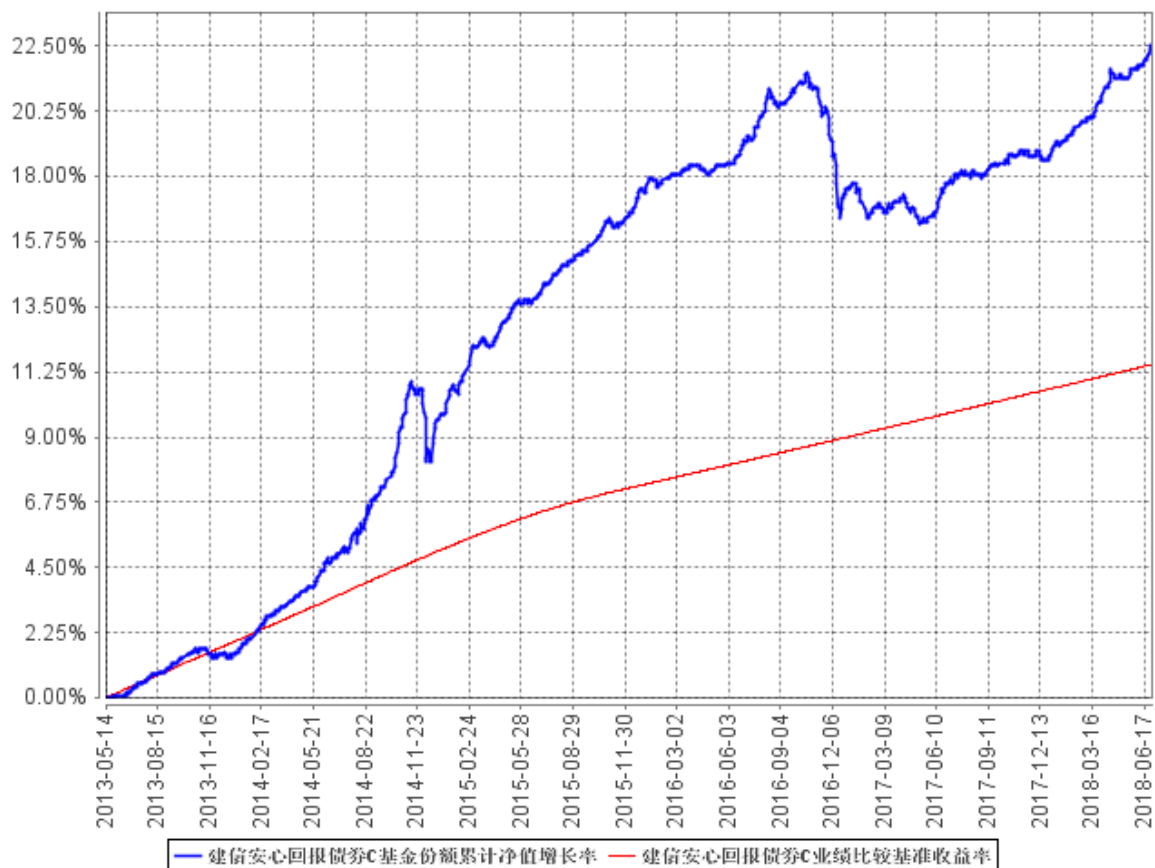
| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.66% | 0.05% | 0.13% | 0.00% | 0.53% | 0.05% |
| 过去三个月 | 1.59% | 0.07% | 0.38% | 0.00% | 1.21% | 0.07% |
| 过去六个月 | 3.23% | 0.06% | 0.76% | 0.00% | 2.47% | 0.06% |
| 过去一年 | 4.03% | 0.05% | 1.53% | 0.00% | 2.50% | 0.05% |
| 过去三年 | 7.54% | 0.08% | 4.80% | 0.00% | 2.74% | 0.08% |
| 自基金合同 生效起至今 | 22.50% | 0.09% | 11.50% | 0.01% | 11.00% | 0.08% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

建信安心回报债券A基金份额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



建信安心回报债券C基金份额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



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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 | | |
| 朱建华 | 本基金的基金 经理 | 2013 年 5 月 14 日 | - | 10 | <p>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、基金经理助理、基金经理。2012 年 8 月 28 日至 2015 年 8 月 11 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 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的基金经理；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的基金经理；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的基金经理；2013 年 12 月 10 日起任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 3 月 14 日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 4 月 28 日至 2018 年 5 月 3 日任建信</p> |

| | | | | | |
|----|----------|-----------------|---|---|--|
| | | | | | 安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理， 2016 年 6 月 1 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理， 2016 年 11 月 1 日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理； 2018 年 4 月 20 日起任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 闫晗 | 本基金的基金经理 | 2018 年 4 月 20 日 | - | 5 | 闫晗先生，硕士。 2012 年 10 月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基金经理助理， 2017 年 11 月 3 日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理； 2018 年 4 月 20 日起任建信安心回报定期开放债券型基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

上半年国内宏观经济形势复杂多变，从微观层面看，上半年受供给侧改革的影响工业企业利润维持较高增速，大宗商品价格高位运行，但因宏观整体需求下降潜在的增长动力受到抑制，除地产投资外基建投资、制造业投资增速均出现下降，在房价高企的背景下社会消费者零售增额增速也显示出一定疲态。此外，上半年随着去杠杆的深入，社融与 M2 的增速均大幅走低，盈利上升带来的结果是企业财务费用增加、现金流开始出现恶化，而信用收缩所导致的债务违约也变得更加频繁，此时再叠加国际环境的不确定性国内中期经济下行压力明显增大。通胀方面，上半年 CPI 总体处于较低水平，猪价依然在低位徘徊。虽然受油价上扬的影响，但在总需求下降的情况下输入性通胀压力并未有效传导。货币政策方面，上半年虽然美国开始进入加速加息周期但中国的长期利率方向在二季度已经出现拐点，最初只是下降的幅度较慢，这和国内率先去杠杆信用紧缩有关。为配合金融去杠杆让银行表外资金回表，央行从四月份以来连续两次定向降准，特别是美国加息后国内的公开市场操作利率并未上调，而随后的货币政策执行报告也将货币政策的基调变为保持流动性充裕。种种迹象均佐证了货币政策的转向，这也是为对冲去杠杆的过程中出现系统性金融风险起到了稳定剂的作用。汇率方面，二季度以来人民币汇率在美元加速升值的背景下出现贬值，但前期的贬值更像是主动调整的结果，从银行代客结售汇和收付汇净值看非常稳定，这跟三年前的情况截然不同。虽然进入七月以来受外部环境的影响人民币汇率的波动加剧，但考虑到汇改后人民币国际化程度的提升目前的波动总体上处于合理水平。而随着未来人民币国际化

进程加速汇率的波动有可能将变得更加频繁。

债券方面，上半年债券市场收益率先上后下。其中年初的收益率上行主要是市场对流动过紧的担忧。随着二季度市场流动性趋缓债券市场收益率出现震荡下行，特别是在四月份定向降准后打开了收益率的下行空间。虽然期间受资管新规等政策出台的影响收益率曾一度出现一定上行，但随着社融数据不及预期，宏观经济的下行开始逐步得到市场的共识。由于上半年的利率债市场尚缺乏足够的配置盘，收益率的下行主要来自交易盘以及部分避险资金，叠加货币政策的转向使得利率债成为上半年配置价值最高的品种。相对利率债，上半年信用风险频发，信用息差在上半年呈现扩大并伴随着流动性明显变差。

上半年，建信安心回报虽然仍处在封闭期但因考虑到接近下一个打开申购赎回期可能的流动性冲击，因此在接近 6 月底时本基金的杠杆比例出现降低，同时随着部分短融的到期本基金增持了部分长期利率债。因在此期间市场的货币政策环境等发生变化，当市场短期利率的快速下行信用息差大幅收窄之际因本基金为应付赎回大量持有现金资产导致净值上受到一定影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安心回报 A 净值增长率 3.43%，波动率 0.06%，安心回报 C 净值增长率 3.23%，波动率 0.06%；业绩比较基准收益率 0.76%，波动率 0%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为进入七月份以来随着一系列稳杠杆举措的出台，之前一刀切似的去杠杆方式将得到了明显缓解，这对社融企稳、地方投融资平台风险化解、保增长等将起到积极作用，去杠杆的周期亦将变得长期化。这些将在短期内利好权益和信用债，并对利率债形成一定冲击。从进一步的演变看，未来可能的趋势是随着稳杠杆的推进，信用将呈现分化，更加积极的财政政策意味着基建领域的投资增速将出现拐点，经济年内预期企稳是大概率事件。货币政策方面，下半年货币政策总体上预计将维持宽裕，短期利率的快速下行将形成一致预期。但另一方面，由于对房地产的调控目前看不到放松的迹象，而目前国内宏观的环境相比 2014 年其实已经有了明显改善，加之资产价格的高位，在稳杠杆的背景下相比于 2015 年的宽财政与宽货币政策，这次的货币政策放松与财政刺激效果大概率将打折扣，所有的政策只是为了稳定经济预期，由于经济弹性的变弱，最终的效果还取决于去杠杆的实际效果以及对贸易摩擦的后续进展。

债券方面，由于当前去杠杆政策的缓和导致银行间市场出现一定程度的流动性泛滥并带动短期利率的快速下行，信用息差明显收窄、期限息差呈现走扩。由于信用环境已经从全面紧缩开始

出现分化，目前银行间市场全面的流动性宽松的持续效果可能有一定反复。另外还值得注意的是，汇率的贬值导致市场已经看不到通缩的压力，反倒是在货币政策相对宽松的背景下长期输入性通胀的可能性在变大，这也可以在一定程度上解释利率债目前较高的期限息差。接下来我们将密切关注总需求的变化以及商品价格的波动。考虑到目前债券市场已经包含了未来流动性持续宽松以及对接下来总需求走扩、通胀上行的预期，因此一旦经济数据出现反复将带来期限息差走平的交易性机会。考虑到一系列稳杠杆政策的出台，从趋势上债券的行情大概率已经进入下半场。

建信安心定期开放债券型基金在下半年进入下一个运作周期，基于对市场的判断，本基金将主要以杠杆策略为主获取稳定的票息收入，同时考虑到债券市场的不确定性增加，在利率债的操作上将更加灵活。其中长期利率债方面观察 10 年国开 4%左右的压力位，同时密切关注总需求变化和供给收缩所带来的工业品溢价的持续性以及通胀预期的变化。并在严格防范信用风险下精选个券，并等待利率债可能的交易性机会。

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

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§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安心回报定期开放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，建信安心回报定期开放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安心回报定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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。本报告期内，建信安心回报定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

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安心回报定期开放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：建信安心回报定期开放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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 454,368.71 | 348,915.57 |
| 结算备付金 | | - | 161,419.90 |
| 存出保证金 | | 597.92 | 1,084.10 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 133,115,707.80 | 139,299,786.20 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 133,115,707.80 | 139,299,786.20 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 500,821.92 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,446,604.25 | 2,510,869.70 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 136,017,278.68 | 142,822,897.39 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 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 | | 28,799,756.80 | 38,879,741.68 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 61,156.16 | 61,449.35 |
| 应付托管费 | | 17,473.17 | 17,556.97 |
| 应付销售服务费 | | 12,619.07 | 12,692.56 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 5,450.60 | 4,276.25 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费 | | 16,939.81 | - |
| 应付利息 | | 17,927.15 | 26,323.57 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 271,080.48 | 463,561.04 |
| 负债合计 | | 29,202,403.24 | 39,465,601.42 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 86,999,359.14 | 86,999,359.14 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 19,815,516.30 | 16,357,936.83 |
| 所有者权益合计 | | 106,814,875.44 | 103,357,295.97 |
| 负债和所有者权益总计 | | 136,017,278.68 | 142,822,897.39 |

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 86,999,359.14 份。其中建信安心回报定期开放债券基金 A 类基金份额净值 1.238 元，基金份额总额 50,662,775.48 份；建信安心回报定期开放债券基金 C 类基金份额净值 1.213 元，基金份额总额 36,336,583.66 份。

6.2 利润表

会计主体：建信安心回报定期开放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 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 4,872,327.34 | 3,173,424.97 |
| 1.利息收入 | | 3,091,589.70 | 5,234,563.24 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 4,571.21 | 867,935.38 |
| 债券利息收入 | | 3,086,813.01 | 4,259,311.29 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 205.48 | 107,316.57 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 439,891.39 | -615,525.43 |
| 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 | 439,891.39 | -615,525.43 |
| 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 | 1,340,846.25 | -1,445,612.84 |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 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 | | 1,414,747.87 | 2,724,708.95 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 364,742.08 | 689,353.42 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 104,211.99 | 196,958.11 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 75,293.41 | 199,350.64 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 3,190.66 | 4,180.30 |
| 5. 利息支出 | | 647,839.72 | 1,428,408.18 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 647,839.72 | 1,428,408.18 |
| 6. 税金及附加 | | 10,037.49 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 209,432.52 | 206,458.30 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 3,457,579.47 | 448,716.02 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 3,457,579.47 | 448,716.02 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信安心回报定期开放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） | 86,999,359.14 | 16,357,936.83 | 103,357,295.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,457,579.47 | 3,457,579.47 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |

| | | | |
|--|---------------------------------|---------------|----------------|
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 86,999,359.14 | 19,815,516.30 | 106,814,875.44 |
| 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） | 170,245,228.48 | 29,251,950.68 | 199,497,179.16 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 448,716.02 | 448,716.02 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 170,245,228.48 | 29,700,666.70 | 199,945,895.18 |

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

建信安心回报定期开放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[2013]第 256 号《关于核准建信安心回报定期开放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《建信安心回报定期开放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,每年定期开放一次申购和赎回,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,856,107,529.74 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(2013)第 259 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,858,300,444.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,192,914.35 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。

根据《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、分离交易可转债、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、资产支持证券、银行存款、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%。开放期内本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发;同时除分离交易可转债,本基金亦不参与可转债投资。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款收益率(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》、《建信安心回报定期开放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 | 454,368.71 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 454,368.71 |

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 | | |
|-------------------|------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,047,817.38 | 1,987,507.80 |
| | 银行间市场 | 130,418,724.33 | 131,128,200.00 |
| | 合计 | 132,466,541.71 | 133,115,707.80 |
| 资产支持证券 | - | - | - |

| | | | |
|----|----------------|----------------|------------|
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 132,466,541.71 | 133,115,707.80 | 649,166.09 |

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

无。

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 | 268.53 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 2,446,335.42 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 0.30 |
| 合计 | 2,446,604.25 |

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 | 5,450.60 |
| 合计 | 5,450.60 |

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 | 271,080.48 |
| 合计 | 271,080.48 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 建信安心回报债券 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 | 50,662,775.48 | 50,662,775.48 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| - 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 | 50,662,775.48 | 50,662,775.48 |

金额单位：人民币元

| 建信安心回报债券 C | | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| 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 | 36,336,583.66 | 36,336,583.66 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| - 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 | 36,336,583.66 | 36,336,583.66 |

根据《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金的封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金自封闭期结束之后第一个工作日(该日为非工作日，则该封闭期结束日延长至下一工作日的前一日)起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。开放时间原则上不少于五个工作日并且最长不超过十五个工作日。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 建信安心回报债券 A | | | |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 10,551,773.17 | -550,903.30 | 10,000,869.87 |
| 本期利润 | 1,287,008.83 | 787,284.77 | 2,074,293.60 |
| 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 | - | - | - |
| 本期末 | 11,838,782.00 | 236,381.47 | 12,075,163.47 |

单位：人民币元

| 建信安心回报债券 C | | | |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 6,742,660.06 | -385,593.10 | 6,357,066.96 |
| 本期利润 | 829,724.39 | 553,561.48 | 1,383,285.87 |
| 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 | - | - | - |
| 本期末 | 7,572,384.45 | 167,968.38 | 7,740,352.83 |

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 | 4,541.98 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 21.00 |
| 其他 | 8.23 |
| 合计 | 4,571.21 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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 | 439,891.39 |
| 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 | 439,891.39 |

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 | 113,280,049.04 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 109,936,741.53 |
| 减：应收利息总额 | 2,903,416.12 |
| 买卖债券差价收入 | 439,891.39 |

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

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 1,340,846.25 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 1,340,846.25 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |

| | |
|------------------------|--------------|
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 1,340,846.25 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 基金转换费收入 | - |
| 合计 | - |

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 8.16 |
| 银行间市场交易费用 | 3,182.50 |
| 合计 | 3,190.66 |

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 148,766.66 |
| 银行划款手续费 | 3,313.08 |
| 银行间账户维护费 | 27,000.00 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 合计 | 209,432.52 |

6.4.7.21 分部报告

-

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

无。

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 | 364,742.08 | 689,353.42 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 146,176.88 | 383,389.20 |

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 0.70% 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 0.70% / 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，不属于从基金资产里列支的费用项目。

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 | 104,211.99 | 196,958.11 |

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 0.20% 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 0.20% / 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 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 | | |
| | 建信安心回报债券 A | 建信安心回报债券 C | 合计 |
| 中国工商银行 | - | 512.36 | 512.36 |
| 建设银行 | - | 73,555.91 | 73,555.91 |
| 建信基金管理有限责任公司 | - | -13.42 | -13.42 |
| 合计 | - | 74,054.85 | 74,054.85 |
| 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 | | |
| | 建信安心回报债券 A | 建信安心回报债券 C | 合计 |
| 中国工商银行 | - | 835.17 | 835.17 |
| 建设银行 | - | 100,955.30 | 100,955.30 |
| 建信基金管理有限责任公司 | - | 15,068.42 | 15,068.42 |
| 合计 | - | 116,858.89 | 116,858.89 |

1、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。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.35%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.35% / 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

无。

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**

无。

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：定期存款 | - | - | - | 855,930.55 |
| 工商银行：活期存款 | 454,368.71 | 4,542.05 | 10,655,451.47 | 7,673.88 |

本基金的活期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

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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 28,799,756.80 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 |
|-----------|----------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| 011800379 | 18 联合水泥 SCP001 | 2018 年 7 月 3 日 | 100.39 | 100,000 | 10,039,000.00 |
| 011800522 | 18 冀中能源 SCP003 | 2018 年 7 月 3 日 | 100.36 | 100,000 | 10,036,000.00 |
| 041764013 | 17 陕煤化 CP001 | 2018 年 7 月 3 日 | 100.90 | 100,000 | 10,090,000.00 |
| 合计 | | | | 300,000 | 30,165,000.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 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。

6.4.12.5 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。

6.4.12.5.1 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 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 20,176,000.00 | 19,960,000.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 81,330,200.00 | 90,043,000.00 |
| 合计 | 101,506,200.00 | 110,003,000.00 |

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、央行票据、同业存单及资产支持证券等。

6.4.12.5.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.5.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.5.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 10,653,907.80 | 469,140.70 |
| AAA 以下 | 1,515,600.00 | 19,492,645.50 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 12,169,507.80 | 19,961,786.20 |

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、央行票据、同业存单及资产支持证券等。

6.4.12.5.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.5.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.6 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。

6.4.12.6.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.12.6.2 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、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。

6.4.12.7 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。

6.4.12.7.1 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、债券和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人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久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 454,368.71 | 0.00 | - | - | 454,368.71 |
| 结算备付金 | 0.00 | - | - | - | 0.00 |
| 存出保证金 | 597.92 | - | - | - | 597.92 |
| 交易性金融资产 | 101,506,200.00 | 21,835,507.80 | 9,774,000.00 | 0.00 | 133,115,707.80 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | - | - | 0.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,446,604.25 | 2,446,604.25 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 101,961,166.63 | 21,835,507.80 | 9,774,000.00 | 2,446,604.25 | 136,017,278.68 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 28,799,756.80 | 0.00 | - | - | 28,799,756.80 |
| 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 | - | - | - | 61,156.16 | 61,156.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | 17,473.17 | 17,473.17 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 12,619.07 | 12,619.07 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 5,450.60 | 5,450.60 |
| 应交税费 | - | - | - | 16,939.81 | 16,939.81 |
| 应付利息 | - | - | - | 17,927.15 | 17,927.15 |
| 应付利润 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 271,080.48 | 271,080.48 |
| 负债总计 | 28,799,756.80 | - | - | 402,646.44 | 29,202,403.24 |
| 利率敏感度缺口 | 73,161,409.83 | 21,835,507.80 | 9,774,000.00 | 2,043,957.81 | 106,814,875.44 |
| 上年度末 2017 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 348,915.57 | 0.00 | - | - | 348,915.57 |
| 结算备付金 | 161,419.90 | - | - | - | 161,419.90 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 存出保证金 | 1,084.10 | - | - | - | 1,084.10 |
| 交易性金融资产 | 110,003,000.00 | 11,947,650.70 | 17,349,135.50 | 0.00 | 139,299,786.20 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | - | - | 0.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 500,821.92 | 500,821.92 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,510,869.70 | 2,510,869.70 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 110,514,419.57 | 11,947,650.70 | 17,349,135.50 | 3,011,691.62 | 142,822,897.39 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 38,879,741.68 | 0.00 | - | - | 38,879,741.68 |
| 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 | - | - | - | 61,449.35 | 61,449.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | 17,556.97 | 17,556.97 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 12,692.56 | 12,692.56 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,276.25 | 4,276.25 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付利息 | - | - | - | 26,323.57 | 26,323.57 |
| 应付利润 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 463,561.04 | 463,561.04 |
| 负债总计 | 38,879,741.68 | 0.00 | 0.00 | 585,859.74 | 39,465,601.42 |
| 利率敏感度缺口 | 71,634,677.89 | 11,947,650.70 | 17,349,135.50 | 2,425,831.88 | 103,357,295.97 |

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。

6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|----|---------------|-----------------------------|-------------------|
| | | 本期末（2018年6月30日） | 上年度末（2017年12月31日） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -394,727.72 | -311,878.14 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 400,563.88 | 314,623.11 |

6.4.12.7.2 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。

6.4.12.7.3 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。

6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.12.7.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.13 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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一层级的余额为 0.00 元，属于第二层级的余额为 133,115,707.80 元，无属于第三层级的余额(2017 年 6 月 30 日：第一层级的余额为 0.00 元，第二层级的余额为 168,082,334.50 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关债券的公允价值列入第一层级；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，确定相关债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

§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 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 133,115,707.80 | 97.87 |
| | 其中：债券 | 133,115,707.80 | 97.87 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 454,368.71 | 0.33 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,447,202.17 | 1.80 |
| 8 | 合计 | 136,017,278.68 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未发生股票买入及卖出业务。

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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 19,440,000.00 | 18.20 |
| | 其中：政策性金融债 | 19,440,000.00 | 18.20 |
| 4 | 企业债券 | 1,987,507.80 | 1.86 |
| 5 | 企业短期融资券 | 101,506,200.00 | 95.03 |
| 6 | 中期票据 | 10,182,000.00 | 9.53 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 133,115,707.80 | 124.62 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 101800262 | 18 晋焦煤 MTN002 | 100,000 | 10,182,000.00 | 9.53 |
| 2 | 041764013 | 17 陕煤化 CP001 | 100,000 | 10,090,000.00 | 9.45 |
| 3 | 041753032 | 17 荣盛 CP002 | 100,000 | 10,086,000.00 | 9.44 |
| 4 | 011758097 | 17 华强 | 100,000 | 10,070,000.00 | 9.43 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| | | SCP005 | | | |
| 5 | 011760154 | 17 冀中峰峰 SCP008 | 100,000 | 10,069,000.00 | 9.43 |

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 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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 | 597.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,446,604.25 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,447,202.17 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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 安心 回报 债券 A | 1,019 | 49,718.13 | 0.00 | 0.00% | 50,662,775.48 | 100.00% |
| 建信 安心 回报 债券 C | 1,078 | 33,707.41 | 0.00 | 0.00% | 36,336,583.66 | 100.00% |
| 合计 | 2,097 | 41,487.53 | 0.00 | 0.00% | 86,999,359.14 | 100.00% |

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

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

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

| 项目 | 建信安心回报债券 A | 建信安心回报债券 C |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2013 年 5 月 14 日）基金份额总额 | 2,469,995,755.71 | 2,388,304,688.38 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 50,662,775.48 | 36,336,583.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 50,662,775.48 | 36,336,583.66 |

上述总申购份额含转换入份额，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 | |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 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、个股、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、本基金本报告期内无新增或剔除交易单元；

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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 |
| 银河证券 | 8,049,668.67 | 100.00% | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 6 月 30 日 |
| 2 | 关于建信安心回报定期开放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 24 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 |
| 4 | 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 |
| 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调整赎回费率及赎回费计入基金财产比例的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2018 年 3 月 23 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安心回报定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信安心回报定期开放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

2018 年 8 月 25 日