

# 建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金(原建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金)2019 年半年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019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2019年1月1日起至6月30日止。

## 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（转型后） .....	6
2.1 基金基本情况（转型前） .....	6
2.2 基金产品说明（转型后） .....	6
2.2 基金产品说明（转型前） .....	7
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
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（转型后） .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前） .....	8
3.2 基金净值表现（转型后） .....	9
3.2 基金净值表现（转型前） .....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	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）（转型后）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表 .....	19
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>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>44</b>
6.1 资产负债表 .....	44
6.2 利润表 .....	45
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	46
6.4 报表附注 .....	48

<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>70</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	70
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	70
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.....	70
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.11 投资组合报告附注.....	72
<b>§7 投资组合报告（转型前）</b> .....	<b>73</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	73
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	73
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.....	74
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	74
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.....	75
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.....	75
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.....	75
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.11 投资组合报告附注.....	75
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后）</b> .....	<b>76</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前）</b> .....	<b>77</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
<b>§9 开放式基金份额变动（转型后）</b> .....	<b>78</b>
<b>§9 开放式基金份额变动（转型前）</b> .....	<b>78</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	80
10.8 其他重大事件(转型后).....	81
10.8 其他重大事件(转型前).....	82
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>82</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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>83</b>
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	建信安心回报 6 个月定期开放债券	
基金主代码	000346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 25 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	72,305,991.37 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 6 个月定期开放债券 A	建信安心回报 6 个月定期开放债券 C
下属分级基金的交 易代码	000346	000347
报告期末下属分级 基金的份额总额	12,123,304.84 份	60,182,686.53 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	建信安心回报两年定期开放债券	
基金主代码	000346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 5 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	73,208,217.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信安心回报两年定期开放债券 A	建信安心回报两年定期开放债券 C
下属分级基金的交 易代码	000346	000347
报告期末下属分级 基金的份额总额	12,919,344.96 份	60,288,872.83 份

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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	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。

业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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。</p> <p>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。</p> <p>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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	95555
传真	010-66228001	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	孙志晨	李建红

## 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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年4月25日(基金合同生效日)-2019年6月30日)	
	建信安心回报6个月定期开放债券A	建信安心回报6个月定期开放债券C
本期已实现收益	-126,097.30	-655,135.54
本期利润	-73,601.00	-380,555.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0060	-0.0063
本期加权平均净值利润率	-0.57%	-0.61%
本期基金份额净值增长率	-0.53%	-0.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	828,294.65	2,290,088.34
期末可供分配基金份额利润	0.0683	0.0381
期末基金资产净值	12,951,599.49	62,472,774.87
期末基金份额净值	1.0683	1.0381
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.53%	-0.57%

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

2、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。

#### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年4月24日)	
	建信安心回报 6 个月定期开放债券 A	建信安心回报 6 个月定期开放债券 C
本期已实现收益	5,345,683.34	3,250,953.87
本期利润	3,212,409.34	1,302,149.89
加权平均基金份额本期利润	0.0262	0.0185
本期加权平均净值利润率	2.51%	1.78%
本期基金份额净值增长率	4.58%	1.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年4月24日)	
期末可供分配利润	957,141.35	2,674,977.30
期末可供分配基金份额利润	0.0741	0.0444
期末基金资产净值	13,876,486.31	62,963,850.13
期末基金份额净值	1.074	1.044
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年4月24日)	
基金份额累计净值增长率	39.93%	33.63%

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

2、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（转型后）

### 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 6 个月定期开放债券 A

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

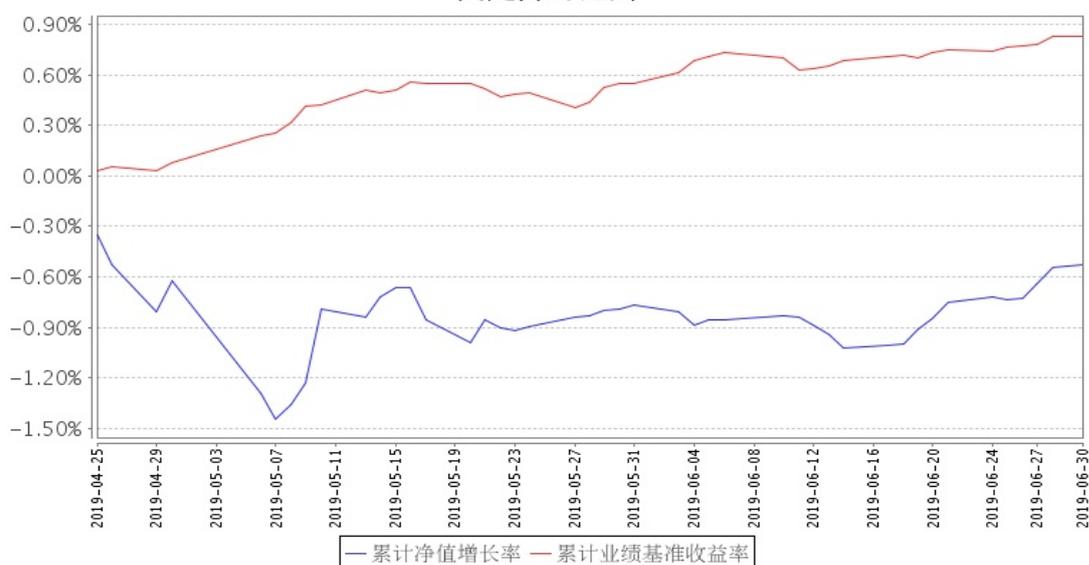
		②		准差④		
过去一个月	0.23%	0.06%	0.28%	0.03%	-0.05%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.53%	0.16%	0.83%	0.04%	-1.36%	0.12%

建信安心回报6个月定期开放债券C

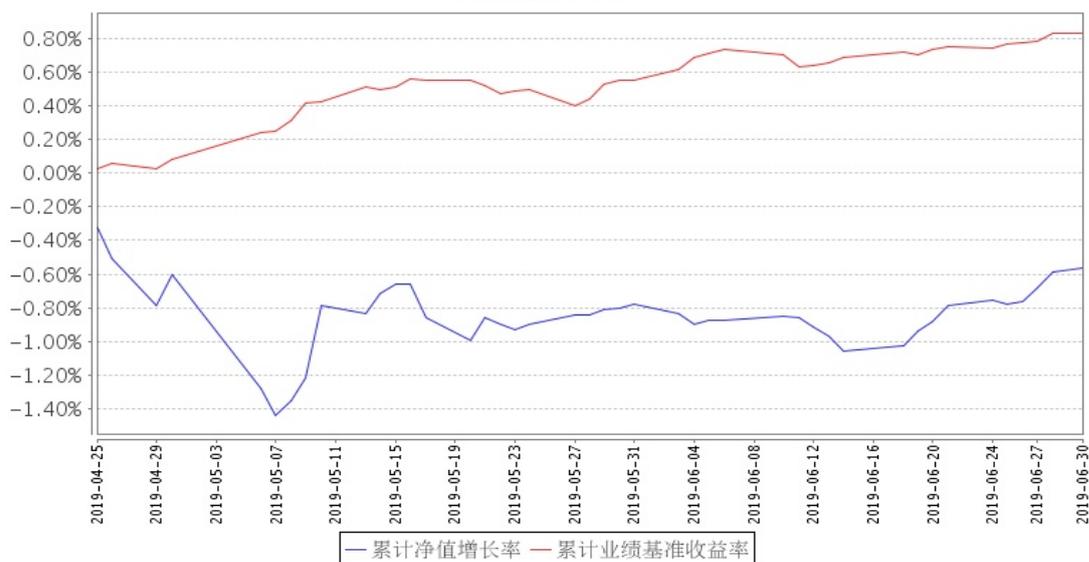
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.06%	0.28%	0.03%	-0.07%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.57%	0.16%	0.83%	0.04%	-1.40%	0.12%

### 3.2.2 自基金转型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6个月定期开放债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信安心回报6个月定期开放债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.2 基金净值表现 (转型前)

#### 3.2.1 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

建信安心回报两年定期开放债券 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
过去三个月	-0.37%	0.20%	0.14%	0.01%	-0.51%	0.19%
过去六个月	4.58%	0.37%	0.67%	0.01%	3.91%	0.36%
过去一年	8.11%	0.23%	1.75%	0.01%	6.36%	0.22%
过去三年	17.18%	0.13%	6.18%	0.01%	11.00%	0.12%
自基金合同生效起至今	39.93%	0.11%	15.21%	0.01%	24.72%	0.10%

建信安心回报两年定期开放债券 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
过去三个月	-0.48%	0.19%	0.14%	0.01%	-0.62%	0.18%
过去六个月	1.75%	0.14%	0.67%	0.01%	1.08%	0.13%

过去一年	5.04%	0.10%	1.75%	0.01%	3.29%	0.09%
过去三年	12.98%	0.07%	6.18%	0.01%	6.80%	0.06%
自基金合同生效起至今	33.63%	0.08%	15.21%	0.01%	18.42%	0.07%

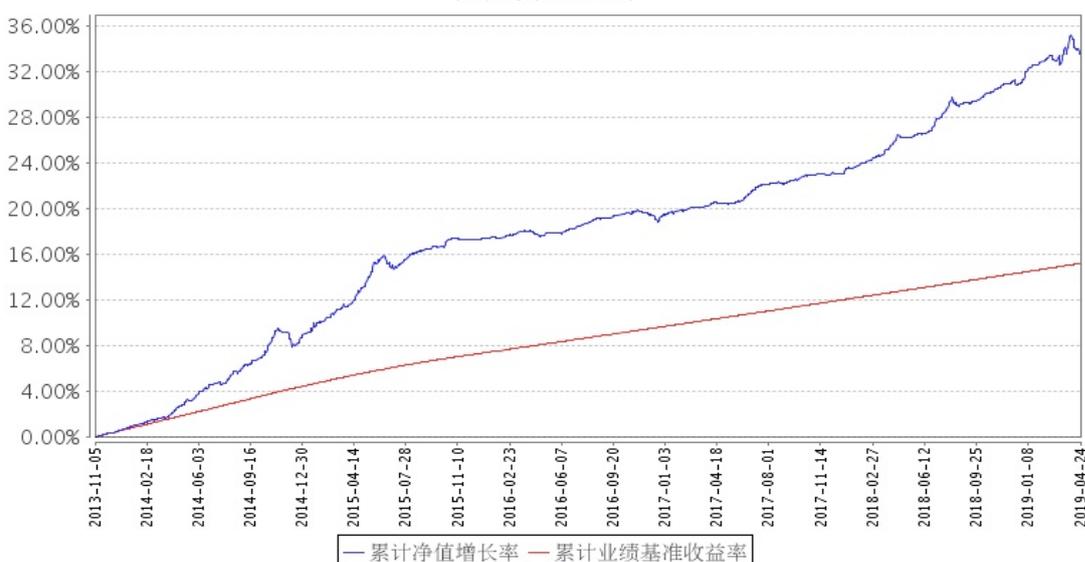
注:本基金该部分数据“过去三个月”指2019年4月1日至2019年4月24日,“过去六个月”指2019年1月1日至2019年4月24日,“过去一年”指2018年7月1日至2019年4月24日,“过去三年”指2016年7月1日至2019年4月24日。

### 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

建信安心回报两年定期开放债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信安心回报两年定期开放债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本报告期,本基金投资组合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、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部门和内控合规部，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“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

截至 2019 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 6 个月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、建信睿怡纯债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（LOF）、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及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、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 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、建信鑫泽回报灵活配

置混合型证券投资基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、建信短债纯债债券型证券投资基金、建信短债1-3年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信短债3-5年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF），共计110只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为5,725.25亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
闫晗	本基金的基金经理	2019年04月25日	-	6	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，该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心回报定期开放债券型基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，该基金自2019年4月25日转型为建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2019年3月25日起任建信短债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2019年4月30日起任建信短债3-5年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
闫晗	本基金的基金经理	2018年4月20日	2019年4月24日	6	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，该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资

					<p>资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心回报定期开放债券型基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，该基金自 2019 年 4 月 25 日转型为建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2019 年 3 月 25 日起任建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2019 年 4 月 30 日起任建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

## 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

### 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

宏观经济方面，今年上半年经济运行整体平稳，但是增速小幅回落。上半年实现国内生产总值同比增长 6.3%，比 2018 年全年回落 0.3%，其中消费支出对 GDP 增长的贡献率最大。具体来说，从生产端层面上看，上半年全国规模以上工业增加值累计同比增长 6.0%，增速较一季度有所回

落，但是其中高技术制造业仍保持较快增长。从需求端上看，上半年全国固定资产投资同比增长 5.8%，比去年同期小幅回落 0.2%，其中制造业投资增速下滑，基建投资受到地方债政策发力的影响，增速相比于 18 年底有所回升，房地产投资在上半年则保持两位数的高速增长。进出口方面，上半年虽然中美贸易摩擦风波不断，但是对外贸易展现了较强的抗压能力，进出口金额实现累计同比增长 3.9%。物价指数方面，上半年物价指数整体平稳，其中 CPI 在食品价格带动下温和和上涨，上半年 CPI 累计同比增长 2.2%，其中尤以猪肉和鲜果价格涨幅较大。PPI 在进入二季度后，同比走势不断回落，其中石油价格回落导致输入性压力减弱。

货币政策方面，上半年货币政策基调维持稳健，资金面整体维持合理适度水平，除部分时点出现阶段性紧张外，整体流动性较为充裕。具体来说，央行 1 月份下调金融机构存款准备金率 1 个百分点用于对冲一季度到期的 MLF 资金，净释放长期资金约 8000 亿元，进入二季度后，受到 5 月下旬包商银行被接管影响，全市场质押式回购利率出现明显上行，非银机构融资成本显著抬升，特别是低等级信用债的质押融资变得极为困难，银行间市场的流动性出现分层。进入 6 月份后，随着人民银行采用头部券商定向支持和增加常备借贷便利等操作，非银机构融资难的问题才有所缓解。

债券市场方面，年初以来，社融和股市对债券市场形成了较大扰动，与此同时猪肉价格的快速上涨造成投资者对于通胀预期的担忧。然而进入 5 月份，随着特朗普发文要继续加税，贸易战风波重燃，收益率开始出现一定回落。之后随着美国对华为制裁的加大，同时国内经济和金融数据也开始出现回落，整体收益率水平开始震荡向下。整体看 10 年期国开债和国债估值收益率半年末收于 3.61% 和 3.23%，相比于去年年底分别下行 3BP 和持平。

基金操作方面，组合上半年准确的判断了市场资金面整体宽松的态势，保持了较高的杠杆水平，获得了稳定的票息收益，与此同时，本基金在今年 4 月份转型成为了 6 个月封闭式基金，基金在二季度也及时的调整了组合持仓，在 6 月份较为及时的增加了组合的久期，把握住了收益率下行的行情。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A（转型后）净值增长率-0.53%，波动率 0.16%，本报告期本基金 C（转型后）净值增长率-0.57%，波动率 0.16；业绩比较基准收益率 0.83%，波动率 0.04%。

#### 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 2019 下半年，经济下行压力依旧较大。6 月社融数据受地方专项债大增影响，社融增速达到年内高点，预计下半年社融数据会有一些的下行压力。一方面是因为中小银行在包商事件后缩表会影响社融增速的扩张，另一方面是因为上半年信托贷款萎缩明显收窄与地产融资有所恢

复有关，然而近期对于信托投向地产的政策明显收紧，对于三季度信托增量有一定影响。与此同时展望三季度，通胀压力有所缓解，汽车消费仍有较大下行压力，地产投资增速也在不断回落，均利好债券市场。信用债方面，由于当前市场风险偏好不断回落的趋势还将延续，高等级 AAA 信用债与低等级尤其是民企信用债的分化预计还将持续，机构资金在下半年大概率继续抱团优质高等级信用债。

本基金下半年会在保持一定杠杆水平的同时，对利率债谨慎进行波段操作，力求为投资者带来稳健的回报。

#### 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、投资风险管理部门和基金会计部负责人组成。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基金合同中关于利润分配条款的规

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	642,354.42
结算备付金		486,500.00
存出保证金		13,034.66
交易性金融资产	6.4.7.2	98,947,813.42
其中：股票投资		-
基金投资		-

债券投资		98,947,813.42
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		-
应收利息	6.4.7.5	1,179,965.77
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		101,269,668.27
<b>负债和所有者权 益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30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		25,549,761.67
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		18,545.24
应付托管费		6,181.73
应付销售服务费		17,921.32
应付交易费用	6.4.7.7	3,052.63
应交税费		8,371.54
应付利息		7,976.20
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	233,483.58
负债合计		25,845,293.91
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	72,305,991.37
未分配利润	6.4.7.10	3,118,382.99
所有者权益合计		75,424,374.36
负债和所有者权 益总计		101,269,668.27

注:1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日, 基金份额总额 72,305,991.37 份, 其中建信安心回报 6 个月定期开放债券 A 基金份额总额为 12,123,304.84 份, 基金份额净值 1.0683 元; 建信安心回报

6个月定期开放债券C基金份额总额为60,182,686.53份，基金份额净值1.0381元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2019年4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日
一、收入		-259,190.72
1. 利息收入		576,399.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,496.94
债券利息收入		552,886.83
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		16,015.96
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,163,099.06
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	-1,163,099.06
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	327,076.53

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	432.08
减：二、费用		194,965.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	41,458.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,819.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	40,039.56
4. 交易费用	6.4.7.19	1,839.75
5. 利息支出		23,061.59
其中：卖出回购金融资产支出		23,061.59
6. 税金及附加		1,942.20
7. 其他费用	6.4.7.20	72,804.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-454,156.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-454,156.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019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）	73,208,217.79	3,632,118.65	76,840,336.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-454,156.31	-454,156.31
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）	-902,226.42	-59,579.35	-961,805.77
其中：1. 基金申购款	991,196.83	62,579.73	1,053,776.56
2. 基金赎回	-1,893,423.25	-122,159.08	-2,015,582.33

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）	72,305,991.37	3,118,382.99	75,424,374.36

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 6 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金转型而来。根据原建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信安心回报两年定期开放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》，转型日为 2019 年 4 月 25 日，基金名称相应变更为“建信安心回报 6 个月定期开放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份额转换为建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2019 年 4 月 25 日起《建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金以定期开放的方式运作，即本基金以封闭期和开放相结合的方式运作。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信安心回报 6 个月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、可转换债券（含分离交易可转债）、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金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不参与投资股票、权

证，也不参与新股申购和新股增发。但可持有因可转债转股所形成的股票或分离交易可转债分离交易的权证等资产。因所持有可转换债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，本基金应在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（在每个开放期的前 15 个工作日和后 15 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制）。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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率。

#### 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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信安心回报 6 个月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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与转型前相一致。

#### 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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，包括买卖债券的差价收入，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。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。

(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 2019年6月30日
活期存款	642,354.42
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	642,354.42

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	3,382,214.70	3,475,113.42
	银行间市场	94,964,935.56	95,472,700.00
	合计	98,347,150.26	98,947,813.42
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	98,347,150.26	98,947,813.42	600,663.16

#### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	537.91
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	218.90
应收债券利息	1,179,203.16
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	5.80
合计	1,179,965.77

## 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 2019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	3,052.63
合计	3,052.63

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	233,483.58
合计	233,483.58

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信安心回报6个月定期开放债券A

项目	本期 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	12,919,344.96	12,919,344.96
本期申购	880,077.12	880,077.12
本期赎回（以“-”号填列）	-1,676,117.24	-1,676,117.24
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	12,123,304.84	12,123,304.84

## 建信安心回报 6 个月定期开放债券 C

项目	本期 2019 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	60,288,872.83	60,288,872.83
本期申购	111,119.71	111,119.71
本期赎回（以“-”号填列）	-217,306.01	-217,306.01
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	60,182,686.53	60,182,686.53

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信安心回报 6 个月定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	1,161,758.54	-204,617.19	957,141.35
本期利润	-126,097.30	52,496.30	-73,601.00
本期基金份额交易产生的变动数	-71,886.12	16,640.42	-55,245.70
其中：基金申购款	79,689.19	-20,594.33	59,094.86
基金赎回款	-151,575.31	37,234.75	-114,340.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	963,775.12	-135,480.47	828,294.65

## 建信安心回报 6 个月定期开放债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	3,606,740.65	-931,763.35	2,674,977.30
本期利润	-655,135.54	274,580.23	-380,555.31
本期基金份额交易产生的变动数	-6,443.47	2,109.82	-4,333.65
其中：基金申购款	6,831.44	-3,346.57	3,484.87
基金赎回款	-13,274.91	5,456.39	-7,818.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,945,161.64	-655,073.30	2,290,088.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日
活期存款利息收入	4,045.86
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	3,412.50
其他	38.58
合计	7,496.94

#### 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
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019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	-1,163,099.06
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	-1,163,099.06
----	---------------

#### 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
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	19,587,355.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,530,505.95
减：应收利息总额	219,948.71
买卖债券差价收入	-1,163,099.06

#### 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 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月 30日
1. 交易性金融资产	327,076.53
股票投资	-
债券投资	327,076.53
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	327,076.53
----	------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月25日（基金合同生效日）至 2019年6月30日
基金赎回费收入	432.08
合计	432.08

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月 30日
交易所市场交易费用	372.25
银行间市场交易费用	1,467.50
合计	1,839.75

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年 6月30日
审计费用	9,065.77
信息披露费	55,067.97
银行划款手续费	2,043.86
其他费用	6,626.40
合计	72,804.00

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

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

## 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	
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	41,458.91	
其中：支付销售机构的客户维护费	12,632.04	

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0.30%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 × 0.30%/ 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	
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	13,819.58	

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 × 0.10%/ 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		
	2019年4月25日（基金合同生效日）至2019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6个月定期开放债券A	建信安心回报6个月定期开放债券C	合计
建设银行	-	7,721.49	7,721.49
建信基金管理有限责任公	-	32,219.21	32,219.21

司			
招商银行	-	60.37	60.37
合计	-	40,001.07	40,001.07

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，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。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2019年4月25日至2019年6月30日	2019年4月25日至2019年6月30日
	建信安心回报6个月定期开放债券A	建信安心回报6个月定期开放债券C
基金合同生效日（2019年4月25日）持有的基金份额	-	48,422,590.07
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	48,422,590.07
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	80.46%

注：分级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。

##### 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

##### 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 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月 30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	642,354.42	4,045.86

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本报告期本基金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(2019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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年06月20日	2019年07月08日	新发未上市	100.00	100.00	210	20,999.72	20,999.72	-

##### 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2019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25,549,761.67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
011901276	19 阳煤 SCP004	2019 年 7 月 4 日	100.05	50,000	5,002,500.00
041900127	19 华远地产 CP001	2019 年 7 月 4 日	99.84	50,000	4,992,000.00
041900225	19 嘉善国资 CP002	2019 年 7 月 4 日	99.93	50,000	4,996,500.00
101569004	15 清控 MTN002	2019 年 7 月 4 日	101.13	60,000	6,067,800.00
101758001	17 沪世茂 MTN001	2019 年 7 月 4 日	100.80	60,000	6,048,000.00
合计				270,000	27,106,800.00

#### 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基金管理人通过事前监测、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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	9,988,500.00
A-1以下	-
未评级	20,038,800.00
合计	30,027,300.00

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、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

#### 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

无。

#### 6.4.13.2.4 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 2019年6月30日
AAA	22,375,299.72
AAA以下	25,751,213.70
未评级	-
合计	48,126,513.42

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、央行票据、

资产支持证券及同业存单等。

#### 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	642,354.42	0.00			642,354.42
结算备付金	486,500.00				486,500.00
存出保证金	13,034.66				13,034.66
交易性金融资产	42,143,100.00	33,572,200.00	23,232,513.42	0.00	98,947,813.42
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				1,179,965.77	1,179,965.77
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	43,284,989.08	33,572,200.00	23,232,513.42	1,179,965.77	101,269,668.27
负债					
卖出回购金融资产款	25,549,761.67	0.00			25,549,761.67
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				18,545.24	18,545.24
应付托管费				6,181.73	6,181.73
应付销售服务费				17,921.32	17,921.32
应付交易费用				3,052.63	3,052.63
应交税费				8,371.54	8,371.54
应付利息				7,976.20	7,976.20
应付利润				0.00	0.00
其他负债				233,483.58	233,483.58

负债总计	25,549,761.67	0.00	0.00	295,532.24	25,845,293.91
利率敏感度缺口	17,735,227.41	33,572,200.00	23,232,513.42	884,433.53	75,424,374.36

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

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（2019年6月30日）	
	市场利率上升 25个基点		-1,092,364.12
	市场利率下降 25个基点		1,147,188.80

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金

资产的 80%（在每个开放期的前 15 个工作日和后 15 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制）。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	98,947,813.42	131.19
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	98,947,813.42	131.19

#### 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2019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次的余额为2,417,513.70元，属于第二层次的余额为96,530,299.72元，无属于第三层次的余额。

(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和债券，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)、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及交易不活跃期间将相关股票和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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2019年6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。

(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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年4月24日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年4月24日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	25,691,856.41	869,775.49
结算备付金		2,422,299.38	1,616,521.00
存出保证金		12,936.26	-
交易性金融资产	6.4.7.2	58,493,866.65	295,758,610.51
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		58,493,866.65	295,758,610.51
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	8,000,000.00	-
应收证券清算款		60,440.28	112,111.29
应收利息	6.4.7.5	857,206.70	5,867,880.00
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		95,538,605.68	304,224,898.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年4月24日</b>	<b>上年度末 2018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		-	67,700,000.00
应付证券清算款		7,998,929.80	-
应付赎回款		10,455,698.24	-
应付管理人报酬		-	60,164.14
应付托管费		-	20,054.71
应付销售服务费		16,910.61	21,617.48
应付交易费用	6.4.7.7	162.50	2,318.75
应交税费		3,844.65	41,414.11
应付利息		-	-17,577.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	222,723.44	294,616.29
负债合计		18,698,269.24	68,122,607.73
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	73,208,217.79	229,907,432.19
未分配利润	6.4.7.10	3,632,118.65	6,194,858.37
所有者权益合计		76,840,336.44	236,102,290.56
负债和所有者权益总计		95,538,605.68	304,224,898.29

注：1. 报告截止日2019年4月24日，基金份额总额73,208,217.79份，其中建信安心回报两年定期开放债券A基金份额总额为12,919,344.96份，基金份额净值1.074元；建信安心回报两年定期开放债券C基金份额总额为60,288,872.83份，基金份额净值1.044元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2019年1月1日至2019年4月24日(基金合同失效前日)止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年4月24日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年4月24日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		5,757,727.46	11,874,212.69
1. 利息收入		3,465,673.17	7,845,773.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,609.14	28,439.15
债券利息收入		3,387,986.71	7,817,334.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,077.32	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,069,972.07	16,359.65
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	6,069,972.07	16,359.65
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	-4,082,077.98	4,011,346.69
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	304,160.20	732.53
减：二、费用		1,243,168.23	3,485,893.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	168,834.09	364,124.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,619.76	121,374.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	80,198.83	136,309.01
4. 交易费用	6.4.7.19	9,257.99	2,339.91
5. 利息支出		764,191.18	2,609,459.16
其中：卖出回购金融资产支出		764,191.18	2,609,459.16
6. 税金及附加		11,658.61	26,315.01
7. 其他费用	6.4.7.20	153,407.77	225,971.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,514,559.23	8,388,319.13
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,514,559.23	8,388,319.13
-------------------	--	--------------	--------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年4月24日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月24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）	229,907,432.19	6,194,858.37	236,102,290.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,514,559.23	4,514,559.23
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）	-156,699,214.40	-7,077,298.95	-163,776,513.35
其中：1. 基金申购款	77,012.77	3,119.03	80,131.80
2. 基金赎回款	-156,776,227.17	-7,080,417.98	-163,856,645.15
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）	73,208,217.79	3,632,118.65	76,840,336.44
项目	上年度可比期间 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）	240,101,602.97	7,287,081.05	247,388,684.02
二、本期经营活	-	8,388,319.13	8,388,319.13

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-5,845,888.18	-64,624.82	-5,910,513.00
其中：1. 基金申购款	350,643.24	3,537.02	354,180.26
2. 基金赎回款	-6,196,531.42	-68,161.84	-6,264,693.26
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）	-	-11,769,701.37	-11,769,701.37
五、期末所有者权益（基金净值）	234,255,714.79	3,841,073.99	238,096,788.78

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

建信安心回报两年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]1161号《关于核准建信安心回报两年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《建信安心回报两年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,本基金以定期开放的方式运作,即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币374,958,650.49元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第690号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

375,157,841.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 199,191.06 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/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。在投资人认购/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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。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。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《关于建信安心回报两年定期开放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》，本基金于 2019 年 4 月 25 日转型，基金名称变更为“建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金”。《建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》自 2019 年 4 月 25 日起生效，原《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金托管协议》自同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信安心回报两年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、可转换债券(含分离交易可转债)、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、资产支持证券、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制)。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%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因持有股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的 1 个月内卖出。本基金的业绩比较基准为两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(以下

简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信安心回报两年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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《关于建信安心回报两年定期开放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》，本基金于 2019 年 4 月 25 日转型为建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金，存续期不定，因此本基金本期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 24 日(基金合同失效前日)止期间的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 2019 年 4 月 24 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 24 日(基金合同失效前日)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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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，包括买卖债券的差价收入，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。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。

(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 2019年4月24日
活期存款	25,691,856.41
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	25,691,856.41

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月24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	10,243,805.28	15,661.37
	银行间市场	47,976,474.74	257,925.26
	合计	58,220,280.02	273,586.63
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	58,220,280.02	58,493,866.65	273,586.63
----	---------------	---------------	------------

#### 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 2019年4月24日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,000,000.00	-

##### 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 2019年4月24日
应收活期存款利息	19,277.12
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	4,457.72
应收债券利息	833,457.92
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	13.94
合计	857,206.70

#### 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 2019年4月24日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	162.50
合计	162.50

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月24日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	222,723.44
合计	222,723.44

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信安心回报6个月定期开放债券A

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月24日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	159,236,022.67	159,236,022.67
本期申购	57,763.49	57,763.49
本期赎回(以“-”号填列)	-146,374,441.20	-146,374,441.20
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	12,919,344.96	12,919,344.96

## 建信安心回报6个月定期开放债券C

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月24日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	70,671,409.52	70,671,409.52
本期申购	19,249.28	19,249.28
本期赎回(以“-”号填列)	-10,401,785.97	-10,401,785.97
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	60,288,872.83	60,288,872.83

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信安心回报6个月定期开放债券A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,412,318.61	1,942,774.09	4,355,092.70
本期利润	5,345,683.34	-2,133,274.00	3,212,409.34
本期基金份额交易产生的变动数	-6,596,243.41	-14,117.28	-6,610,360.69
其中：基金申购款	1,673.51	694.80	2,368.31
基金赎回款	-6,597,916.92	-14,812.08	-6,612,729.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,161,758.54	-204,617.19	957,141.35
建信安心回报6个月定期开放债券C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	971,867.28	867,898.39	1,839,765.67
本期利润	3,250,953.87	-1,948,803.98	1,302,149.89
本期基金份额交易产生的变动数	-616,080.50	149,142.24	-466,938.26
其中：基金申购款	517.58	233.14	750.72
基金赎回款	-616,598.08	148,909.10	-467,688.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,606,740.65	-931,763.35	2,674,977.30

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月24日
活期存款利息收入	27,018.43
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	15,575.34

其他	15.37
合计	42,609.14

#### 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 2019年1月1日至2019年4月24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	6,069,972.07
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	6,069,972.07

##### 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 2019年1月1日至2019年4月24日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	548,073,294.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	530,697,248.21
减：应收利息总额	11,306,074.42
买卖债券差价收入	6,069,972.07

##### 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
	2019年1月1日至2019年4月24日
1. 交易性金融资产	-4,082,077.98
股票投资	-
债券投资	-4,082,077.98
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-4,082,077.98

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月24日
基金赎回费收入	304,160.20
合计	304,160.20

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月24日
交易所市场交易费用	1,390.49
银行间市场交易费用	7,867.50
合计	9,257.99

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月24日
审计费用	16,035.81
信息披露费	93,697.74
银行划款手续费	6,700.62
其他费用	36,973.60
合计	153,407.77

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

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

#### 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 2019年1月1日至2019年 4月24日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	168,834.09	364,124.37
其中：支付销售机构的客户维护费	17,675.03	50,381.85

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0.30%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 × 0.30%/ 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 2019年1月1日至2019年 4月24日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,619.76	121,374.78

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/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 2019年1月1日至2019年4月24日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信安心回报两年定期 开放债券A	建信安心回报两年定期 开放债券C	合计
建设银行	-	13,766.20	13,766.20
建信基金管理有限责任公司	-	66,369.34	66,369.34
招商银行	-	13.99	13.99
合计	-	80,149.53	80,149.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	建信安心回报两年定期 开放债券A	建信安心回报两年定期 开放债券C	合计
建设银行	-	32,732.28	32,732.28
建信基金管理有限责任公司	-	103,496.45	103,496.45
招商银行	-	21.69	21.69
合计	-	136,250.42	136,250.42

注：支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.35%的年费率计提，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。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年 4月24日	本期 2019年1月1日至2019年4月 24日
	建信安心回报两年定期开放 债券A	建信安心回报两年定期开放债券 C
基金合同生效日（2013年 11月5日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	58,422,590.07
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	10,000,000.00
期末持有的基金份额	-	48,422,590.07
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	80.32%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
	建信安心回报两年定期开放 债券A	建信安心回报两年定期开放债券 C
基金合同生效日（2013年 11月5日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	58,422,590.07
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	58,422,590.07
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	79.92%

注：分级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。

## 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 2019年1月1日至2019年4月 24日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
招商银行-活期存款	25,691,856.41	27,018.43	2,200,515.57	8,712.87

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

## 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(2019年4月24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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132017	19新钢EB	2019年04月22日	2019年05月14日	新发未上市	99.99	99.99	2,020	201,988.93	201,988.93	-
127012	招路转债	2019年03月26日	2019年04月30日	新发未上市	100.00	100.00	1,610	160,998.24	160,998.24	-
110057	现代转债	2019年04月03日	2019年04月30日	新发未上市	100.00	100.00	280	27,999.63	27,999.63	-
113026	核能转债	2019年04月17日	2019年05月08日	新发未上市	100.00	100.00	250	24,999.67	24,999.67	-

113024	核建 转债	2019年 04月 10日	2019 年 04月 26日	新发未 上市	100.00	100.00	160	15,999.79	15,999.79	-
128064	司尔 转债	2019年 04月 10日	2019 年 05月 07日	新发未 上市	100.00	100.00	160	15,999.58	15,999.58	-
110058	永鼎 转债	2019年 04月 18日	2019 年 05月 08日	新发未 上市	100.00	100.00	110	10,999.71	10,999.71	-

#### 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

无。

##### 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基金管理人通过事前监测、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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年4月24日	上年度末 2018年12月31日
A-1	4,983,000.00	20,216,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	11,033,100.00	30,141,000.00
合计	16,016,100.00	50,357,000.00

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、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

#### 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

无。

#### 6.4.13.2.4 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 2019年4月24日	上年度末 2018年12月31日
AAA	10,410,997.33	168,538,631.51
AAA以下	32,066,769.32	22,654,368.00
未评级	-	-
合计	42,477,766.65	191,192,999.51

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、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

#### 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。基金管理人会对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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年4月24日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,691,856.41	0.00			25,691,856.41
结算备付金	2,422,299.38				2,422,299.38
存出保证金	12,936.26				12,936.26
交易性金融资产	16,016,100.00	33,457,288.93	9,020,477.72	0.00	58,493,866.65
衍生金融资产					0.00
买入返售金融资产	8,000,000.00	0.00			8,000,000.00
应收证券清算款				60,440.28	60,440.28
应收利息				857,206.70	857,206.70
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	52,143,192.05	33,457,288.93	9,020,477.72	917,646.98	95,538,605.68
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00			0.00
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				7,998,929.80	7,998,929.80
应付赎回款				10,455,698.24	10,455,698.24
应付管理人报酬				0.00	0.00
应付托管费				0.00	0.00
应付销售服务费				16,910.61	16,910.61
应付交易费用				162.50	162.50
应交税费				3,844.65	3,844.65
应付利息				0.00	0.00
应付利润				0.00	0.00
其他负债				222,723.44	222,723.44
负债总计	0.00	0.00	0.00	18,698,269.24	18,698,269.24
利率敏感度缺口	52,143,192.05	33,457,288.93	9,020,477.72	-17,780,622.26	76,840,336.44
上年度末 2018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	869,775.49	0.00			869,775.49
结算备付金	1,616,521.00				1,616,521.00
存出保证金	0.00				0.00
交易性金融资产	112,369,000.00	141,402,611.20	41,986,999.31	0.00	295,758,610.51
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				112,111.29	112,111.29
应收利息				5,867,880.00	5,867,880.00
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	114,855,296.49	141,402,611.20	41,986,999.31	5,979,991.29	304,224,898.29
负债					
卖出回购金融资产款	67,700,000.00	0.00			67,700,000.00
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				60,164.14	60,164.14
应付托管费				20,054.71	20,054.71

应付销售服务费				21,617.48	21,617.48
应付交易费用				2,318.75	2,318.75
应交税费				41,414.11	41,414.11
应付利息		-		-17,577.75	-17,577.75
应付利润				0.00	0.00
其他负债				294,616.29	294,616.29
负债总计	67,700,000.00	0.00	0.00	422,607.73	68,122,607.73
利率敏感度缺口	47,155,296.49	141,402,611.20	41,986,999.31	5,557,383.56	236,102,290.56

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

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（2019年4月24日）	上年度末（2018年12月31日）
市场利率上升 25个基点		-234,234.54	-1632019.66
市场利率下降 25个基点		236,555.97	1658119.82

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制)。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月24日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	58,493,866.65	76.12	295,758,610.51	125.27
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,493,866.65	76.12	295,758,610.51	125.27

#### 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 2019 年 4 月 24 日（基金合同失效前），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次的余额为 8,763,481.10 元，属于第二层次的余额为 49,730,385.55 元，无属于第三层次的余额（2018 年 6 月 30 日：第一层次 1,778,665.47 元。第二层次 370,666,731.50 元，无第三层次）。

##### (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和债券，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）、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及交易不活跃期间将相关股票和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (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 2019 年 4 月 24 日（基金合同失效前），本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 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（转型后）

### 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	98,947,813.42	97.71
	其中：债券	98,947,813.42	97.71
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,128,854.42	1.11
8	其他各项资产	1,193,000.43	1.18
9	合计	101,269,668.27	100.00

### 7.2 报告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

无。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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

无。

## 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	20,794,000.00	27.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,163,200.00	17.45
5	企业短期融资券	30,027,300.00	39.81
6	中期票据	32,524,800.00	43.12
7	可转债（可交换债）	2,438,513.42	3.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	98,947,813.42	131.19

## 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	180024	18 付息国债 24	200,000	20,794,000.00	27.57
2	1180101	11 宁交通债	60,000	6,211,800.00	8.24
3	101569004	15 清控 MTN002	60,000	6,067,800.00	8.04
4	101758001	17 沪世茂 MTN001	60,000	6,048,000.00	8.02

5	1680414	16 玉环城建 债 02	60,000	5,914,800.00	7.84
---	---------	-----------------	--------	--------------	------

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 7.10.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.11 投资组合报告附注

##### 7.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

##### 7.11.2

基金投资的前十名证券未超出基金合同规定的投资范围。

##### 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	13,034.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,179,965.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,193,000.43

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123016	洲明转债	2,417,513.70	3.21

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 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。

## §7 投资组合报告（转型前）

### 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,493,866.65	61.23
	其中：债券	58,493,866.65	61.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	8,000,000.00	8.37
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,114,155.79	29.43
8	其他各项资产	930,583.24	0.97
9	合计	95,538,605.68	100.00

## 7.2 报告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

无。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

### 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

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,158,800.00	17.12
5	企业短期融资券	16,016,100.00	20.84
6	中期票据	20,096,500.00	26.15
7	可转债（可交换债）	9,222,466.65	12.00
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	58,493,866.65	76.12

### 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	1180101	11 宁交通债	60,000	6,256,800.00	8.14
2	1680414	16 玉环城建债 02	60,000	5,865,000.00	7.63
3	101800171	18 华润置地 MTN001	50,000	5,139,500.00	6.69
4	101800864	18 象屿 MTN002	50,000	5,041,500.00	6.56
5	011801790	18 海沧投资 SCP006	50,000	5,033,500.00	6.55

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

#### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 7.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2

基金投资的前十名证券未超出基金合同规定的投资范围。

### 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	12,936.26
2	应收证券清算款	60,440.28
3	应收股利	-
4	应收利息	857,206.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	930,583.24

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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（转型后）

### 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6个月定期开放债券A	463	26,184.24	-	-	12,123,304.84	100.00
建信安心回报6个月定期开放债券C	275	218,846.13	48,422,590.07	80.46	11,760,096.46	19.54
合计	738	97,975.60	48,422,590.07	66.97	23,883,401.30	33.03

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

注: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

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。

# §8 基金份额持有人信息(转型前)

## 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(%)
建信安心回报两年定期开放债券A	432	29,905.89	0.00	0.00	12,919,344.96	100.00
建信安心回报两年定期开放债券C	289	208,612.02	48,422,590.07	80.32	11,866,282.76	19.68
合计	721	101,537.06	48,422,590.07	66.14	24,785,627.72	33.86

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

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（转型后）

单位：份

项目	建信安心回报 6 个月定期开放债券 A	建信安心回报 6 个月定期开放债券 C
基金合同生效日 (2019 年 4 月 25 日) 基金份额总额	12,919,344.96	60,288,872.83
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	880,077.12	111,119.71
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	1,676,117.24	217,306.01
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额 总额	12,123,304.84	60,182,686.53

## § 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	建信安心回报 6 个月定期开放债券 A	建信安心回报 6 个月定期开放债券 C
基金合同生效日 (2013 年 11 月 5 日) 基金份额总额	186,701,433.10	188,456,408.45
本报告期期初基金份 额总额	159,236,022.67	70,671,409.52
本报告期基金总申购 份额	57,763.49	19,249.28
减：本报告期基金总 赎回份额	146,374,441.20	10,401,785.97

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	12,919,344.96	60,288,872.83

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会于 2019 年 3 月 26 日表决通过了《关于建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

### 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第五届董事会第五次临时会议审议通过，自 2019 年 3 月 13 日起，曲寅军不再担任建信基金管理有限责任公司首席投资官（副总裁）。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 2019 年 3 月 16 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安永华明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(转型后)

### 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	
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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、本基金本报告期末新增或剔除交易单元，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

				比例		的比例
中投证券	9,211,992.30	70.57%	-	-	-	-
中信证券	3,841,259.10	29.43%	137,100,000.00	100.00%	-	-

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

### 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	
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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、本基金本报告期末新增或剔除交易单元，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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

		比例		成交总额的 比例		成交总额的 比例
中投证券	44,984,848.90	24.95%	-	-	-	-
中信证券	135,279,341.50	75.05%	1,961,200,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增第一创业为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-06-20
2	关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-06-01
3	关于公司旗下部分开放式基金参与民生银行直销银行费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-05-16
4	关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-05-14
5	建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金第一个开放期开放日常申购、赎回业务公告	指定报刊和/或公司网站	2019-04-25

### 10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-03-29
2	关于建信安心回报两年定期开放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	指定报刊和/或公司网站	2019-03-27
3	建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金2019年3月8日受限开放日申购赎回结果公告	指定报刊和/或公司网站	2019-03-13
4	建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金2019年3月8日受限开放申购、赎回业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-03-06
5	以通讯方式召开建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2019-02-28
6	以通讯方式召开建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2019-02-27
7	关于以通讯方式召开建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-02-25

8	关于建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2019-01-30
---	----------------------------------	-------------	------------

## § 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	2019年01月01日-2019年06月30日	58,422,590.07	0.00	10,000,000.00	48,422,590.07	66.97
	2	2019年01月01日-2019年03月27日	145,488,845.78	0.00	145,488,845.78	0.00	0.00
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申购对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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安心回报6个月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6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信安心回报6个月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6个月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。

### 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

2019年8月29日