建信双息红利债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2019年8月29日

§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。

基金托管人中信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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信双息红利债券		
基金主代码	530017		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月13日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	452,328,931.40份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C	建信双息红利债券H
下属分级基金的交易代码	530017	531017	960029
报告期末下属分级基金的份额总额	409,354,221.66份	41,203,379.33份	1,771,330.41份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动管理债券组合,力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。
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。同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。
业绩比较基准	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	李修辰
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)		
	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C	建信双息红利债券H
本期已实现收益	27,496,282.97	2,437,635.18	94,910.82
本期利润	25,031,789.36	2,213,519.01	87,260.51
加权平均基金份额本期利润	0.0522	0.0468	0.0484
本期基金份额净值增长率	4.46%	4.17%	4.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
期末可供分配基金份额利润	0.0394	0.0247	0.0399
期末基金资产净值	469,350,049.87	45,330,849.25	2,031,908.15
期末基金份额净值	1.147	1.100	1.147

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

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

建信双息红利债券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	0.61%	0.05%	0.44%	0.07%	0.17%	-0.02%
过去三个月	0.61%	0.09%	-0.33%	0.13%	0.94%	-0.04%
过去六个月	4.46%	0.18%	2.87%	0.13%	1.59%	0.05%
过去一年	6.01%	0.24%	6.17%	0.13%	-0.16%	0.11%
过去三年	3.64%	0.21%	11.15%	0.13%	-7.51%	0.08%
自基金合同生效起至今	81.36%	0.28%	41.17%	0.18%	40.19%	0.10%

建信双息红利债券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	0.55%	0.05%	0.44%	0.07%	0.11%	-0.02%
过去三个月	0.46%	0.09%	-0.33%	0.13%	0.79%	-0.04%
过去六个月	4.17%	0.18%	2.87%	0.13%	1.30%	0.05%
过去一年	5.57%	0.24%	6.17%	0.13%	-0.60%	0.11%
过去三年	2.49%	0.21%	11.15%	0.13%	-8.66%	0.08%
自基金合同生效起至今	45.27%	0.31%	32.27%	0.19%	13.00%	0.12%

建信双息红利债券H

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	0.53%	0.05%	0.44%	0.07%	0.09%	-0.02%
过去三个月	0.53%	0.08%	-0.33%	0.13%	0.86%	-0.05%
过去六个月	4.37%	0.18%	2.87%	0.13%	1.50%	0.05%
过去一年	6.01%	0.24%	6.17%	0.13%	-0.16%	0.11%
过去三年	3.65%	0.21%	11.15%	0.13%	-7.50%	0.08%
自基金合同生效起至今	4.34%	0.21%	11.43%	0.13%	-7.09%	0.08%

注:1、本基金于2014年9月1日新增C类份额,原有份额全部转换为A类份额。

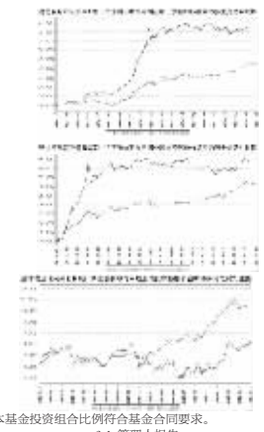
2、本基金的业绩比较基准为:90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。

本基金为债券型证券投资基金,主要投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于债券的资产占基金资产的比例不低于80%,在实际投资运作中,本基金债券投资比例均值约为90%,故本基金采取90%作为复合业绩比较基准中衡量债券投资业绩的权重,相应将10%作为衡量权益类投资业绩的权重。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征,也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势,测算债券投资回报率水平,判断债券供求动向提供了很好的依据。因此,本基金债券投资的业绩比较基准选择中国债券总指数收益率。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。因此,本基金权益类证券品种的业绩比较基准选择中证红利指数收益率。

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



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、建信嘉新宝货币市场基金、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、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信证券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、建信证券交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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、建信睿利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)、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债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、建信中债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

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		
朱虹	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2018年4月20日	-	12	朱虹女士,固定收益投资部副总经理,硕士。2007年1月至2009年4月任长城人寿保险公司债券投资助理;2009年4月至2011年12月任天弘基金管理公司固定收益部总监助理;2012年1月至2014年5月任万家基金管理公司固定收益部总监;2015年8月至今历任我公司投资管理部副总监、固定收益投资部副总监、副总经理,2015年10月20日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2017年11月4日转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金,朱虹自2017年11月4日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年1月4日任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年1月11日起转型为建信铭利灵活配置混合型证券投资基金,朱虹自2018年1月11日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月1日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月17日起任建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信双息红利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

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

2019年上半年,宏观经济总水平波动较小,结构性问题较为突出。具体表现在以下几部分:一是制造业投资下滑较快,从去年底的5%大幅下滑至-7%,体现了产业资本较差的预期。二是房地产投资受政策关注较大,多地住房政策仍在收紧状态,地产企业拿地、去化情况较差,房地产投资水平处于10%左右的中性偏弱水平。三是政府投资水平较低,基建投资在3%附近的低位运行,地方债发行补流现有的项目意愿较强,新增投资项目意愿较弱。

上半年的全社会投制债务水平和债务偿还是重要的工作。为此央行有针对性地对中小银行进行了定向宽松,对信贷投放于中小企业的大银行实施了鼓励性指标考核,保持多种短期流动性工具的运行平稳。财政部和央行共同进行了金融机构补充流动性、补充资本金工具的创新,商业银行和其他金融机构在上半年大量发行资本补充工具。此外,财政部还提前下发了地方债部分额度,以用于地方债顺利发行。截至上半年末,共发行各类资本工具4593亿,有效地补充了资本金。

上半年的包商事件在大民银行和监管机构的共同努力下,没有发生市场预期的大面积流动性风险。

2019年上半年在短期上涨约40%后股票市场大幅回落。压制股票的主要因素在于一季度融资现金流有所好转,但二季度显示经营情况改善仍然需要时间。四月至五月中美贸易争端升级和包商银行事件连续发生,大幅度降低了股票市场的风险偏好。

2019年上半年债券市场分歧较大,上半年总全价指数亏损0.37%,短债指数平均获利2%,以防守为主。在小幅调整后逐渐明确信用分化的趋势,季度末期迎来久违的长期利率债上涨行情。未来的银行业周期将会在负债定资产的逻辑中逐步演化,市场将会重点关注资产质量和资产周期。客观上需要降低准备金率和实际利率水平下行方可有风险对冲作用。

需要关注的是,未来几年信用债市场的变化将会非常剧烈。从融资难度到投后监管,信用债市场等于无风险收益的认知会逐步消失,信用债的收益获取难度将会上升。

在第一季度报告中,我们认为2019年股票市场的机会远大于债券,二季度的货币政策观察期进行可能的大类资产转换。在二季度初,基本处现了股票收益,在季度末期加配超长利率债和长期利率债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值增长率4.46%,波动率0.18%,本报告期本基金C净值增长率4.17%,波动率0.18%,本报告期本基金H净值增长率4.37%,波动率0.18%;业绩比较基准收益率2.87%,波动率0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综合地分析下半年的宏观经济情况,以下几个问题需要特别关注:一是银行机构资产负债表的质量和企业的资产负债表质量,二是政府债务接续问题,三是货币政策何时进行宽松。下半年重大时间节点较多,国际环境复杂多变,具体影响已不同程度体现在各国的股票市场和债券市场走势中。结合以上的情况,我们认为下半年在风险资产获利难度较大,复杂的环境下主要获利来源是宽松预期带来的机会。本基金将会在适当的风险收益的约束下,为持有人获取稳定回报。

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(适用非货市基金)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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对建信双息红利债券型证券投资基金2019年上半年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信双息红利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信双息红利债券型证券投资基金2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:建信双息红利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	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款		1,558,323.64	4,729,562.12
结算备付金		513,786.90	3,091,773.99
存出保证金		322,572.86	135,110.97
交易性金融资产		626,131,516.83	1,018,742,704.47
其中:股票投资		540,985.48	44,248,950.12
基金投资		-	-
债券投资		625,590,531.35	974,493,754.35
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		995,076.71	-
应收利息		13,151,687.17	18,418,322.63
应收股利		-	-
应收申购款		32,868.00	22,670.45
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		642,705,832.11	1,045,140,144.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		120,599,450.60	219,479,375.78
应付证券清算款		-	93,279.54
应付赎回款		1,761,762.15	1,162,335.93
应付管理人报酬		300,298.85	494,023.89
应付托管费		85,799.67	141,149.64
应付销售服务费		13,407.82	16,888.03
应付交易费用		2,889,713.74	2,910,504.89
应交税费		59,746.61	70,861.15
应付利息		45,467.94	188,159.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		237,377.46	413,951.92
负债合计		125,993,024.84	224,970,530.29
所有者权益:			
实收基金		452,328,931.40	748,717,900.45
未分配利润		64,383,875.87	71,451,713.89
所有者权益合计		516,712,807.27	820,169,614.34
负债和所有者权益总计		642,705,832.11	1,045,140,144.63

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额452,328,931.40份,其中建信双息红利债券A基金份额总额为409,354,221.66份,基金份额净值1.147元;建信双息红利债券C基金份额总额为41,203,379.33份,基金份额净值1.100元;建信双息红利债券H基金份额总额为1,771,330.41份,基金份额净值1.147元。

6.2 利润表

会计主体:建信双息红利债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019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
一、收入		32,860,973.24	-17,151,469.04
1.利息收入		13,251,995.95	39,136,745.05
其中:存款利息收入		82,373.12	172,172.57
债券利息收入		13,148,803.68	38,947,536.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,819.15	17,035.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		22,271,870.39	-77,424,363.78
其中:股票投资收益		4,351,305.78	-69,015,982.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益		17,667,141.37	-11,265,459.51
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		253,423.24	2,857,077.77
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-2,695,260.09	21,104,718.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		32,366.99	31,430.94
减:二、费用		5,528,404.36	15,962,995.29
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	2,065,573.62	4,823,110.43
2. 托管费	6.4.8.2.2	590,163.89	1,378,031.54
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	89,113.30	146,690.46
4. 交易费用		1,212,382.05	2,051,283.21
5. 利息支出		1,296,847.16	7,209,363.88
其中:卖出回购金融资产支出		1,296,847.16	7,209,363.88
6. 税金及附加		40,925.52	109,920.58
7. 其他费用		233,398.82	244,595.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		27,332,568.88	-33,114,464.33
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		27,332,568.88	-33,114,464.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信双息红利债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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)	748,717,900.45	71,451,713.89	820,169,614.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,332,568.88	27,332,568.88
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)	-296,388,969.05	-34,400,406.90	-330,789,375.95
其中:1.基金申购款	11,914,512.78	1,477,415.19	13,391,927.97
2.基金赎回款	-308,303,481.83	-35,877,822.09	-344,181,303.92
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)	452,328,931.40	64,383,875.87	516,712,807.27
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)	1,451,242,799.91	155,083,331.08	1,606,326,130.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-33,114,464.33	-33,114,464.33
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)	-440,129,197.63	-41,563,248.81	-481,692,446.44
其中:1.基金申购款	11,052,769.49	1,056,676.62	12,109,446.11
2.基金赎回款	-451,181,967.12	-42,619,925.43	-493,801,892.55
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)	1,011,113,602.28	80,405,617.94	1,091,519,220.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1	至6.4财务报表由下列负责人签署:

张军红 _吴曙明_ _丁颖

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信双息红利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[2011]1660号《关于核准建信双息红利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,951,604,406.33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(2011)第497号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》于2011年12月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,951,677,612.70份基金份额,其中认购资金利息折合73,206.37份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《关于建信双息红利债券型证券投资基金增加C类收费模式并修改基金合同的公告》并报证监会备案,本基金于2014年9月1日起根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为A类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,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。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2014年9月1日前原有的基金份额在增加收取销售服务费的C类收费模式,全部转换为A类基金份额。

根据《建信双息红利债券型证券投资基金新增H类基金份额及修改基金合同的公告》以及更新的《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,自2016年4月15日起,本基金根据基金份额销售区域的不同,将基金份额分为不同的类别。在中华人民共和国(仅为本基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)销售的基金份额,称为A类基金份额或C类基金份额;在中国香港特别行政区销售的基金份额,称为H类基金份额。本基金各基金份额类别分别设置代码,并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双息红利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,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证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的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券类资产占基金资产的比例不低于80%,投资于权益类资产占基金资产的比例不高于20%,持有现金或买入回购日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。

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》、《建信双息红利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1月1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 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[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[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[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