建信双周安心理财债券型证券投资基金

【2014】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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年8月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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2014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	建信双周理财	
基金主代码	530014	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月28日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,783,639,869.39份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信双周理财A	建信双周理财B
下属分级基金的交易代码:	530014	531014
报告期末下属分级基金的份额总额	1,096,438,306.57份	687,201,562.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	联系电话	010-66228888	(010)66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告报告备置地点	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

基金级别	建信双周理财A	建信双周理财B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)
本期已实现收益	32,987,193.72	12,363,181.63
本期利润	32,987,193.72	12,363,181.63
本期净值收益率	2.3806%	2.5282%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	1,096,438,306.57	687,201,562.82
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;

2、本基金的利润分配按日结转基金份额;

3、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信双周理财A

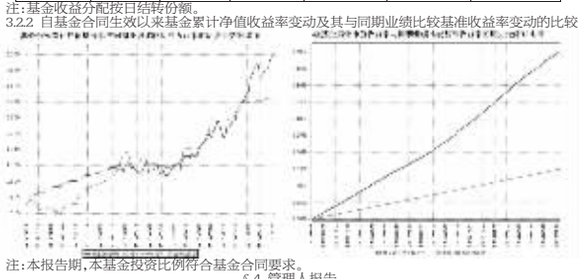
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3310%	0.0043%	0.1126%	0.0000%	0.2184%	0.0043%
过去三个月	1.0555%	0.0055%	0.3418%	0.0000%	0.7137%	0.0055%
过去六个月	2.3806%	0.0070%	0.6810%	0.0000%	1.6996%	0.0070%
过去一年	4.8190%	0.0064%	1.3781%	0.0000%	3.4409%	0.0064%
自基金合同生效起至今	7.9363%	0.0053%	2.5520%	0.0000%	5.3843%	0.0053%

建信双周理财B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3551%	0.0043%	0.1126%	0.0000%	0.2425%	0.0043%
过去三个月	1.1287%	0.0055%	0.3418%	0.0000%	0.7869%	0.0055%
过去六个月	2.5282%	0.0070%	0.6810%	0.0000%	1.8472%	0.0070%
过去一年	5.1233%	0.0064%	1.3781%	0.0000%	3.7452%	0.0064%
自基金合同生效起至今	8.5156%	0.0053%	2.5520%	0.0000%	5.9636%	0.0053%

注:基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京四家分公司,设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持"诚信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司"。

截至2014年6月30日,公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金和建信货币市场基金,共计42只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为551.21亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年1月21日	-	6	于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理。
朱建华	本基金的基金经理	2012年8月28日	-	6	硕士,曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经理助理,2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年8月28日	-	8	硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员,2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年,衰退式宽松的预期为债市酝酿了良好的牛市氛围。

基本面经济增长明显走弱是主导因素,这体现在需求端,主要是制造业和房地产出现双杀,新开工投资明显回落,虽然2季度稳增长口号下基建投资有所反弹,但仍显得枯木难支,与此同时,实体资金整体是偏紧的,表外非标受监管严控,表内新增存款不足,都制约了社会融资总量的扩张,直至5月在一系列定向宽松政策推出后才出现反弹;

政策面意图宽松是引领预期的关键,在货币增速与通胀增长都不构成压力的背景下,央行主动收紧的必要性下降,但这在1季度数据出来之前仍显得不够令市场信服,甚至汇率市场连续异动还曾引起担忧,而进入2季度,信号变得更为明确,在降低社会融资成本口号下,央行更积极地'定向'资金出去,再贷款、定向降准等各种工具应声而出,基础货币的投放方式全面转向更为主动的时代,常规的公开市场操作中正回购也有缩量的迹象,整体政策层面传递的信号是比较积极的,也因此引发了降息降准预期的发酵;

资金面充裕是影响短端定价的媒介,市场预期是从春节后开始变化的,这与政策传递的信号直接相关,春节后资金宽松的背景下正回购的量价表现都相对温和,进入2季度这种信心更进一步得到强化,降准降息预期发酵下,月末、季末的传统季节效应明显消退,资金面整体波澜不惊;

债券市场在以上多重因素的支撑下呈现出比较明显的牛市行情,中债银行间债券总净价指数上涨3.51%,其中1季度上涨1.36%,2季度上涨2.12%,净价而言,金融债领涨,全价来说,企业债占优,收益率曲线的变化来看,大体上1季度是牛陡,2季度是牛平,6月后长端出现调整,行情重新过渡到牛陡,主要是降息降准预期已被反应,机构获利了结的心态居上;

本基金以管理流动性为第一要务,在保证春节、季末、半年末几个重大赎回时点流动性的前提下,积极捕捉资金波动的时机,1季度重点布局部分资金至2季度,2季度重点布局资金到下半年,同时也适当参与了一级短券的投标,以博弈一二级市场差价收益,整体在类属资产配置上,考虑到非标被打压后,同业存款利率吸引力下滑,债券收益优势凸显,我们重点增加了对债券资产的配置,同时进一步拉长了剩余期限的分布。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双周理财A净值收益率2.3806%,波动率0.0070%,双周理财B净值收益率2.5282%,波动率0.0070%,业绩比较基准收益率0.6810%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,一些新的变化值得我们关注。

基本面经济而言,去年同期的增长基数相对较高已在预期中,地产仍未见底也基本是市场的共识,但二三限城市限购逐渐放开,价格可能进入实质下降通道,有助于后期销量逐渐恢复,此外,制造业库存调整可能呈现略微积极的变化,出口进一步改善的可能性在增加,定向宽松的资金逐步落实下基建投资仍有拉升空间,因此,整体经济低位企稳的预期可能有所上升;通胀而言,4季度,猪周期带来隐忧,通胀预期可能有所升温;

政策面而言,5-6月表内信贷开始超预期,在低基数的基础上下半年M2增速可能超出监管目标,我们怀疑这在一定层面上是否会影响央行进一步宽松的意图,此外,7月初市场传言央票再度续发,虽然还没有看到正式的公告,但仍可能给市场带来相对混乱的信号;大的方向而言,显然目前的基本面环境仍难以支持政策方向的转向,但可能宽松的程度有不达预期的可能性;

资金层面关注2个纬度的变化,一是央行在公开市场操作上的风吹草动,二是资金流向实体的进度,前者主要是影响市场参与者的心理预期,后者可能带来的是挤出效应,一般而言,为保证后者进展流畅,前者要保持宽松的持续性,如果是这样,资金利率的反应应该会滞后1-2个季度,基于这样的判断,我们并不过分担心下半年资金的起伏,但要小心脆弱预期多变带来的扰动;

债券市场在以上多重因素的影响下,可能面临一定的调整压力,长端压力大于短端;

本基金以流动性管理为第一要务,半年末时点过后,资金可能重新迎来回流,配置上我们继续以年内到期资产为主,重点布局3季末和年底到期资金,同时择机兑现部分上半年一级投标的短券收益,控制组合剩余期限在中等偏高的水平,争取为投资者继续实现稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,每日将当日收益结转为基金份额,当日收益结转的基金份额参与下一日基金收益分配,并按月结转到投资者基金账户。本年度双周理财A应分配利润为32,987,193.72元,双周理财B应分配收益为12,363,181.63元,已全部分配,符合法律法规和《基金合同》的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内,建信双周安心理财债券型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信双周安心理财债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信双周安心理财债券型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:建信双周安心理财债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		521,051,887.67	1,275,804,305.43
结算备付金		-	23,809.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,384,310,961.98	595,704,450.88
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,384,310,961.98	595,704,450.88
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		100,000,350.00	50,000,195.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		36,453,941.39	26,864,929.36
应收股利		-	-
应收申购款		10,883,081.24	22,294,900.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,052,700,222.28	1,970,692,590.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		226,129,566.93	42,749,858.62
应付证券清算款		41,608,421.92	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		477,284.28	558,371.90
应付托管费		141,417.56	165,443.55
应付销售服务费		340,123.20	461,058.94
应付交易费用		33,791.38	14,778.37
应交税费		-	-
应付利息		18,832.68	3,771.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		310,914.94	312,560.66
负债合计		269,060,352.89	44,265,843.83
所有者权益:			
实收基金		1,783,639,869.39	1,926,426,746.36
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,783,639,869.39	1,926,426,746.36
负债和所有者权益总计		2,052,700,222.28	1,970,692,590.19

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额总额1,783,639,869.39份。其中建信双周理财基金A类基金份额净值1.000元,基金份额总额1,096,438,306.57份;建信双周理财基金B类基金份额净值1.000元,基金份额总额687,201,562.82份。

6.2 利润表

会计主体:建信双周安心理财债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		52,664,898.43	61,705,458.38
1.利息收入		45,073,748.22	58,529,453.18
其中:存款利息收入		25,648,944.57	36,160,532.75
债券利息收入		15,350,225.87	14,215,503.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,074,577.78	8,153,417.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		7,591,150.21	3,176,005.20
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		7,591,150.21	3,176,005.20
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		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		7,314,523.08	10,251,377.76
1.管理人报酬		2,588,588.13	3,884,668.73
2.托管费		766,989.08	1,151,012.94
3.销售服务费		2,124,509.58	2,786,244.16
4.交易费用		-150.00	1,250.00
5.利息支出		1,569,708.37	2,134,962.72
其中:卖出回购金融资产支出		1,569,708.37	2,134,962.72
6.其他费用		264,877.92	293,239.21
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		45,350,375.35	51,454,080.62
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		45,350,375.35	51,454,080.62

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信双周安心理财债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,926,426,746.36	-	1,926,426,746.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,350,375.35	45,350,375.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-142,786,876.97	-	-142,786,876.97
其中:1.基金申购款	7,280,947,222.13	-	7,280,947,222.13
2.基金赎回款	-7,423,734,099.10	-	-7,423,734,099.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-45,350,375.35	-45,350,375.35
五、期末所有者权益(基金净值)	1,783,639,869.39	-	1,783,639,869.39
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	9,547,666,025.86	-	9,547,666,025.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,454,080.62	51,454,080.62
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)	-8,039,111,037.64	-	-8,039,111,037.64
其中:1.基金申购款	8,452,081,797.34	-	8,452,081,797.34
2.基金赎回款	-16,491,192,834.98	-	-16,491,192,834.98
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)	-	-51,454,080.62	-51,454,080.62
五、期末所有者权益(基金净值)	1,508,554,988.22	-	1,508,554,988.22

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:

孙志晨 何斌 秦绪华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于良好流动性的固定收益类金融工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和银行协议存款、剩余期限一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、中期票据、短期融资券、剩余期限397天以内(含397天)债券(不含可转换债券)、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税前)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年1月1日至2014年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014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更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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	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、基金代销机构
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、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无

6.4.8.1.2 权证交易

无

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,588,588.13	3,884,668.73
其中:支付销售机构的客户维护费	948,706.30	1,250,260.90

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数;

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	766,989.08	1,151,012.94

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信双周理财A	建信双周理财B	合计
中国建设银行	1,959,020.27	18,484.94	1,977,505.21
中国工商银行	16,833.21	0.00	16,833.21
建信基金管理有限责任公司	556.75	7,043.65	7,600.40
合计	1,976,410.23	25,528.59	2,001,938.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信双周理财A	建信双周理财B	合计
中国建设银行	2,705,323.26	24,746.94	2,730,070.20
中国工商银行	13,027.02	-	13,027.02
建信基金管理有限责任公司	728.83	27,988.91	28,717.74
合计	2,719,079.11	52,735.85	2,771,814.96

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

日A类基金份额销售服务费=A类基金份额前一日基金资产净值X0.30% / 当年天数;

日B类基金份额销售服务费=B类基金份额前一日基金资产净值X0.01% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.8.4.2 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

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,051,887.67	39,197.15	809,073.73	58,715.34

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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