银河钱包货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:银河基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08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2018年01月01日起至06月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	银河钱包货币	
场内简称	-	
基金主代码	150988	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月29日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,901,222,020.43份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	银河钱包货币A	银河钱包货币B
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	150988	150998
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	51,069,531.90份	12,850,152,488.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险并满足流动性的前提下,发掘投资机会,实现组合增值。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
	银河钱包货币A	银河钱包货币B
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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		银河基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	陆志俊
	联系电话	021-38568989	95559
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-0860	95559
传真		021-38568769	021-62701216

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.galaxyasset.com
基金半年度报告备置地点	1、中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层 2、中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号

§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

基金级别	银河钱包货币A	银河钱包货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	1,643,975.79	296,001,953.05
本期利润	1,643,975.79	296,001,953.05
本期净值收益率	2.0316%	2.0777%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	51,069,531.90	12,850,152,488.53
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

注:1、上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(例如:开放式基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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,由于货币市场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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

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

银河钱包货币A

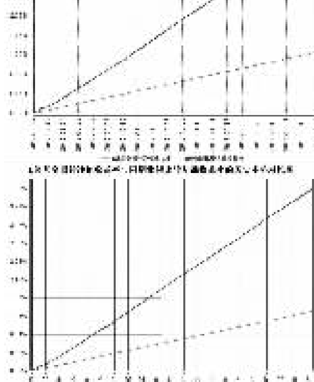
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3239%	0.0009%	0.1125%	0.0000%	0.2114%	0.0009%
过去三个月	1.0076%	0.0016%	0.3412%	0.0000%	0.6664%	0.0016%
过去六个月	2.0316%	0.0014%	0.6787%	0.0000%	1.3529%	0.0014%
过去一年	4.1027%	0.0016%	1.3687%	0.0000%	2.7340%	0.0016%
自基金合同生效起至今	4.1121%	0.0017%	1.3762%	0.0000%	2.7359%	0.0017%

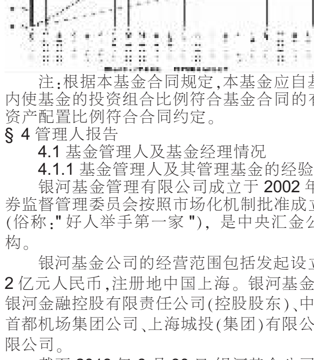
银河钱包货币B

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	0.3314%	0.0009%	0.1125%	0.0000%	0.2189%	0.0009%
过去三个月	1.0303%	0.0016%	0.3412%	0.0000%	0.6891%	0.0016%
过去六个月	2.0777%	0.0014%	0.6787%	0.0000%	1.3990%	0.0014%
过去一年	4.1993%	0.0016%	1.3687%	0.0000%	2.8306%	0.0016%
自基金合同生效起至今	4.2089%	0.0016%	1.3762%	0.0000%	2.8327%	0.0016%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

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:根据本基金合同规定,本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定;报告期末各项资产配置比例符合合同约定。

§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

银河基金管理有限公司成立于2002年6月14日,是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司(俗称:"好人举手第一家"),是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等,注册资本2亿元人民币,注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为:中国银河金融控股有限责任公司(控股股东)、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海城投(集团)有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

截至2018年6月30日,银河基金公司旗下共管理58只公募基金产品:银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深300价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金(LOF)、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值100A股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河润利保本混合型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河量化配置混合型证券投资基金、银河庭芳3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河量化多策略混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金(LOF)、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金。

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		
刘铭	基金经理	2017年6月29日	-	7	硕士研究生学历,7年金融行业相关从业经历。曾任职于上海汽车集团财务有限责任公司固定收益部、上海银行股份有限公司资产管理部,从事固定收益交易、研究与投资相关工作,2016年7月加入我公司固定收益部。2016年12月起担任银河银富货币市场基金的基金经理,2017年4月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年6月起担任银河钱包货币市场基金的基金经理,2017年12月起担任银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2018年3月起担任银河庭芳3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河鑫月享6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2018年6月起担任银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
张沛	基金经理	2018年2月2日	-	12	硕士研究生学历,12年金融行业从业经历。曾任职于花旗银行、东亚银行、大华银行、招商银行、上海赞庚投资公司等金融机构。2017年11月加入我公司。2018年2月起担任银河钱包货币市场基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河银富货币市场基金的基金经理。

注:1、上表中刘铭的任职日期为基金合同生效之日,张沛的任职日期为我公司做出决定之日;

2、证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项管理办法、《基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着"诚实信用、勤奋律己、创新图强"的原则管理和运用基金资产,在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值,努力实现基金持有人的利益,无损害基金持有人利益的行为,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大,本基金管理人将继续秉承"诚信稳健、勤奋律己、创新图强"的理念,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定,进一步加强风险管理和完善内部控制体系,为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

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

本报告期内,公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度,在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实,确保公平对待不同投资组合。同时,公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析。

本基金不参与股票投资业务,针对本基金参与的公开竞价债券投资部分,对公司管理的所有投资组合(完全复制的指数基金除外),连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公开竞价交易的证券进行了价差分析,并对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。针对银行间投资部分,对不同投资组合临近日的反向交易的交易时间、交易价格进行了梳理和分析,未发现重大异常情况。本报告期内,不存在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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况(完全复制的指数基金除外)。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易,各投资组合经理均严格按照制度规定,事前确定好申购价格和数量,按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

报告期内,债券及权益市场受整体经济环境、宏观调控、监管政策及外部事件冲击等影响,各类资产呈分化走势。

债券市场方面,货币政策维持中性的同时,出现边际放松的倾向。央行平稳释放流动性,资金价格趋降。随着金融去杠杆的推进,社融数据持续走弱,固定资产和工业增加值双双回落,去杠杆已开始传导至实体,企业债务违约事件上升较快;加之中美贸易战的升级,使得外需未来面临着较大不确定性。在此背景下,国内政策开始明显放松。央行两次降准,同时还推出扩大MLF质押范围、降准定向使用等结构化政策,旨在缓解中小企业"融资难、融资贵"的问题,政策频率超出了市场预期。

债券市场受益于对经济基本面的担忧、政策的放松,整个上半年无风险收益率出现了较为明显的下行趋势,信用债则受信用事件激增的影响,利差出现走扩,尤其以低评级信用债较为明显。

货币政策边际放松为利率债走强奠定了较好的基础,叠加4月资管新规征求意见以及中美贸易战的持续发酵,中长端利率债走出一波行情。其中报告期间,10年国开下行60BP,5年国开下行69BP。

权益方面,上证综指持续上扬,创业板则表现较弱。随后受美股下跌影响,指数出现急跌。节后受春节消费、"两会"预期和政策鼓励等因素影响,创业板指反弹走强,行情出现结构性分化。中美贸易战对全球股市造成了冲击,随后反弹中市场延续了前期的结构性分化。随着中美"贸易战"的升级、信用事件的不断产生、市场下跌导致股票质押接近平仓的风险加大,市场风险偏好明显回落,权益市场出现连续调整、大幅下跌的局面。转债市场受权益市场回调而出现系统性下跌。

银河钱包货币市场基金严格按照中国证监会和中国人民银行各项法规要求,在保障组合流动性安全的前提下,优化短融、定存以及逆回购和政策性金融债的持仓结构,追求高于业绩比较基准的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期银河钱包货币A的基金份额净值收益率为2.0316%,本报告期银河钱包货币B的基金份额净值收益率为2.0777%,同期业绩比较基准收益率为0.6787%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来国内去杠杆政策持续发力、再融资收紧,经济需求呈边际弱化,中美贸易摩擦再度升级、外需大概率向弱,我国经济边际下行压力不容忽视。预计短期内我国宏观经济政策将围绕"稳杠杆"出台相关结构性政策,以扩大内需。

货币政策方面,经历三次降准,我们判断央行保持银行体系流动性充裕,减轻银行负债端压力已是下半年较为确定的方向。虽然降准带有一定的导向条件,但在传导至实体经济方面,我们觉得仍会存在一定时滞:一是债转股采取市场化的原则,银行主动性并不高,推进一直不是很顺利;二是去杠杆的大背景下,银行的理性选择是降低风险偏好,难以自发性地扩大对小微企业的表内信贷;三是制约银行信贷增长的各种条件仍然存在,如:资本充足率偏低、贷款行业政策限制、存款增长偏弱等。因此,银行流动性充裕的结果将更有利于无风险利率的边际下行。

汇率方面,我们认为近期人民币过快的贬值应是对前期汇率高估的修正,目前判断风险可控。一方面,在资本项目不完全开放的背景下,考虑到如果中国经济增速通过扩大内需企稳,同时美国加息对其中期经济增长的负面影响开始显现,则人民币趋势性贬值不可持续。另一方面,上半年欧元贬值促进出口,欧洲经济近期有向好的迹象,"美强欧弱"存在变数,美元指数预计难以维持强势上行。对债券市场来说,如果人民币汇率企稳,中美利差则不会成为制约国内利率下行的关键因素,但汇率是否能得到"经济企稳"慢变量的支持,尚需保持警惕。

宏观经济方面,从扩内需的角度来看,国开行棚改审批上收及房地产海外融资受限将会对房地产投资形成制约,房地产投资持续性存疑。此外,近两年地产去库存背景下,居民加杠杆对消费产生了挤出效应,目前刺激消费也非易事。基建方面,年初发布的财政部23号文再次严令禁止地方财政为地方融资兜底,加上资管新规对非标的约束,都使得地方政府融资平台没有资金来源,基建投资增速回落较快。近期监管政策放松,地方政府融资平台大概率率先受益,将有效缓解融资压力,预计基建投资仍然是稳经济的利器。此外,考虑到商品房库存水平不高和房地产行业存在的区域性差异,地产龙头效应有望明显提升,房地产投资也可能存在较大的预期差。

信用风险方面,三季度将迎来信用债到期高峰,表外理财非标投放目前仍然面临一定的整改压力,同时,市场风险偏好很难因资金相对充裕而迅速转向,未来还存在信用风险引爆的可能性。我们在投资中仍会重点关注对非标融资较为依赖、股权质押风险较大、下半年债务偿还压力较大的发债主体和资质较弱、行政层级较低的政府融资平台,短期对民营企业尽量回避。而受益于供给侧改革和债转股的推进,存在安全边际的大型资源型国企,以及资质好、行政层级高的政府融资平台目前存在较好的配置价值。

综上所述,我们对债券市场相对乐观,在保持流动性的前提下,在关键时点加大存款及同业存单配置力度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定,对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成,本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算,与基金托管人进行账务核对,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序,为确保估值的合规、公允,本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会,以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验,根据基金管理公司制定的相关制度,估值政策决策机构中不包括基金经理,但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议,以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定:"每日分配、按日支付"。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。

本报告期内本基金以红利再投资方式进行收益分配,其中A级分配收益1,643,975.79元,B级分配收益296,001,953.05元,符合法律法规及《基金合同》的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

2018年度,托管人在银河钱包货币市场证券投资基金的托管过程中,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、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年度,银河基金管理有限公司在银河钱包货币市场证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润:1,643,975.79元,向B级份额持有人分配利润:296,001,953.05元。

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

2018年度,由银河基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关银河钱包货币市场证券投资基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:银河钱包货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		1,815,291,783.33	8,440,855,891.58
结算备付金		332,801,818.18	-
存出保证金		-	1,676.62
交易性金融资产		7,277,844,781.35	12,074,570,585.09
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,277,844,781.35	12,058,584,682.86
资产支持证券投资		-	15,985,902.23
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		3,491,707,582.98	500,000,950.00
应收证券清算款		208,583,189.04	-
应收利息		48,166,602.30	148,832,575.68
应收股利		-	-
应收申购款		95.00	119,398.63
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		13,174,395,852.18	21,164,381,077.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	1,348,977,576.76
应付证券清算款		269,000,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,615,029.60	2,316,238.51
应付托管费		538,343.21	772,079.50
应付销售服务费		111,929.99	171,627.88
应付交易费用		108,371.11	67,298.02
应交税费		24,836.57	-
应付利息		-	2,271,364.16
应付利润		1,536,802.78	2,129,626.53
递延所得税负债		-	-
其他负债		238,518.49	160,000.00
负债合计		273,173,831.75	1,356,865,811.36
所有者权益:			
实收基金		12,901,222,020.43	19,807,515,266.24
未分配利润		-	-
所有者权益合计		12,901,222,020.43	19,807,515,266.24
负债和所有者权益总计		13,174,395,852.18	21,164,381,077.60

注:报告截止日2018年6月30日,银河钱包货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额51,069,531.9份;银河钱包货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额12,850,152,488.53份。银河钱包货币份额总额合计为12,901,222,020.43份。

6.2 利润表

会计主体:银河钱包货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入		317,476,377.09	22,778.61
1.利息收入		313,759,358.19	22,778.61
其中:存款利息收入		61,920,655.47	22,778.61
债券利息收入		172,299,017.85	-
资产支持证券利息收入		68,210.61	-
买入返售金融资产收入		79,471,474.26	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,717,018.90	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,716,041.71	-
资产支持证券投资收益		977.19	-
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		19,830,448.25	3,570.04
1. 管理人报酬		10,846,487.95	851.28
2. 托管费		3,615,495.95	283.76
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	760,329.37	69.42
4. 交易费用		325.00	-
5. 利息支出		4,388,897.87	-
其中:卖出回购金融资产支出		4,388,897.87	-
6. 其他费用		209,668.49	2,365.58
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		297,645,928.84	19,208.57
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		297,645,928.84	19,208.57

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银河钱包货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	19,807,515,266.24	-	19,807,515,266.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	297,645,928.84	297,645,928.84
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)	-6,906,293,245.81	-	-6,906,293,245.81
其中:1.基金申购款	38,094,706,702.23	-	38,094,706,702.23
2.基金赎回款	-45,000,999,948.04	-	-45,000,999,948.04
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)	-	-297,645,928.84	-297,645,928.84
五、期末所有者权益(基金净值)	12,901,222,020.43	-	12,901,222,020.43
项目	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	207,143,623.96	-	207,143,623.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,208.57	19,208.57
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)	12,277.95	-	12,277.95
其中:1.基金申购款	12,277.95	-	12,277.95
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-19,208.57	-19,208.57
五、期末所有者权益(基金净值)	207,155,901.91	-	207,155,901.91

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:

范永武　　　范永武　　　虞晓清

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

银河钱包货币市场基金(以下简称"本基金"),系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[2017]866号《关于准予银河钱包货币市场基金注册的批复》的核准,由基金管理人银河基金管理有限公司自2017年6月20日到2017年6月23日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60821717_B09号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年6月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币207,137,438.08元,在募集期间产生的存款利息为人民币6,185.88元,以上实收基金(本息)合计为人民币207,143,623.96元,折合207,143,623.96份基金份额,其中A类基金份额5,137,643.96份,B类基金份额202,005,980.00份。本基金的基金管理人及注册登记机构为银河基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资的金融工具包括:现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及自2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

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,暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

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

本报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方关系没有发生变化。

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
银河基金管理有限公司("银河基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构
中国银河证券股份有限公司("银河证券")	同受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
银河证券	-	-	25,910,000.00	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
银河证券	56,860,400,000.00	100.00%	180,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,846,487.95	851.28
其中:支付销售机构的客户维护费	36,041.52	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E× 基金管理费年费率 / 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,615,495.95	283.76

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下:

H=E× 基金托管费年费率 / 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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 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 银河钱包货币A	银河钱包货币B	合计
交通银行	834.03	-	834.03
银河基金	6,499.48	701,356.76	707,856.24
银河证券	3,049.19	1,230.62	4,279.81
合计	10,382.70	702,587.38	712,970.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 银河钱包货币A	银河钱包货币B	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注:本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.1%,B类基金份额的年销售服务费率为0.01%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H=E× 该类基金份额的销售服务费年费率 / 当年天数

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
交通银行	50,321,774.66	50,528,220.55	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	-	-

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

注:本基金本期与上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

注:本基金本期末与上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
交通银行	291,783.33	14,209.08	143,623.96	4,148.61

注:本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2018年6月30日的相关余额为人民币271,000,000.00元,在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示,备付金利息收入为人民币1,469,970.00元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.10 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

1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元,属于第二层次的余额为人民币7,277,844,781.35元,属于第三层次余额为人民币0.00元。

于2017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人民币0.00元,属于第二层次的余额为人民币25,910,026.19元,属于第三层次余额为人民币0.00元。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	7,277,844,781.35	55.24
	其中:债券	7,277,844,781.35	55.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,491,707,582.98	26.50
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,148,093,601.51	16.31
4	其他各项资产	256,749,886.34	1.95
5	合计	13,174,395,852.18	100.00

7.2 债券回购融资情况

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2018年3月28日	27.77	巨额赎回	1个工作日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:在本报告期内本基金投资组合的平均剩余期限未超过120天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	46.36	2.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	30.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	17.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.74	2.09

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合的平均剩余存续期超过240天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,618,951,589.20	12.55
	其中:政策性金融债	1,618,951,589.20	12.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	320,098,505.67	2.48
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,338,794,686.48	41.38
8	其他	-	-
9	合计	7,277,844,781.35	56.41
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	170413	17农发13	5,600,000	559,240,025.66	4.33
2	111803091	18农业银行CD091	5,000,000	497,542,342.22	3.86
3	180301	18进出01	3,500,000	349,784,484.52	2.71
4	111809107	18浦发银行CD107	3,000,000	299,547,715.66	2.32
5	111810238	18兴业银行CD238	3,000,000	298,209,804.43	2.31
6	111807140	18招商银行CD140	3,000,000	293,877,712.67	2.28
7	111809182	18浦发银行CD182	2,800,000	277,675,571.25	2.15
8	180407	18农发07	2,600,000	259,810,140.14	2.01
9	111895932	18徽商银行CD070	2,000,000	199,497,743.91	1.55
10	111821024	18渤海银行CD024	2,000,000	199,232,216.79	1.54

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1462%
报告期内偏离度的最低值	0.0082%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0621%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金采用摊余成本法进行估值,各估值对象的溢折价、利息收入按剩余期限摊销平均计入基金净值。

本基金采用"影子定价"的方法进行估值修正,即为了避免采用摊余成本法计算的基金净值与按市场利率和交易市价计算的资产净值发生重大偏离,当此偏离度达到或超过基金资产净值的0.50%时,适用影子定价对估值对象进行调整,调整差额于当日计入基金净值。

7.9.2

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	208,583,189.04
3	应收利息	48,166,602.30
4	应收申购款	95.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	256,749,886.34

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
银河钱包货币A	3,063	16,673.04	16,669,095.21	32.64%	34,400,436.69	67.36%
银河钱包货币B	54	237,965,786.82	12,850,152,488.53	100.00%	-	-
合计	3,117	4,138,986.85	12,866,821,583.74	99.73%	34,400,436.69	0.27%

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	2,420,700,079.70	18.76%
2	银行类机构	1,517,220,020.44	11.76%
3	其他机构	1,355,410,750.02	10.51%
4	银行类机构	1,321,314,718.09	10.24%
5	保险类机构	502,023,176.02	3.89%
6	银行类机构	404,250,613.00	3.13%
7	其他机构	400,092,049.45	3.10%
8	其他机构	356,594,044.92	2.76%
9	券商类机构	351,077,867.98	2.72%
10	银行类机构	300,785,913.54	2.33%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河钱包货币A	102,286.39	0.2003%
	银河钱包货币B	-	0.0000%
	合计	102,286.39	0.0008%

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河钱包货币A	0~10
	银河钱包货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	银河钱包货币A	0
	银河钱包货币B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	银河钱包货币A	银河钱包货币B
基金合同生效日(2017年6月29日)基金份额总额	5,137,643.96	202,005,980.00
本报告期期初基金份额总额	315,499,444.75	19,492,015,821.49
本报告期基金总申购份额	116,779,343.93	37,977,927,358.30
减:本报告期基金总赎回份额	381,209,256.78	44,619,790,691.26
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	51,069,531.90	12,850,152,488.53

注:红利再投资和基金转换转入和因分级导致的基金份额强增作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出和因分级导致的基金份额强减作为本期赎回资金的支付,统一计入本期总赎回份额,可不单独列示。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018年2月7日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于银河银富货币市场基金变更基金经理的公告》,增聘张沛担任本基金的基金经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内,基金管理人、基金管理人收到上海证监局《关于对银河基金管理有限公司采取责令整改措施的决定》,责令公司进行整改并暂停受理公募基金注册申请3个月,对相关人员采取行政监管措施。公司高度重视,制定并实施相关整改措施,并将及时向监管部门提交整改报告。

除上述情况外,本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注:本报告期内本基金无席位变更情况。

选择证券公司专用席位的标准

(1)实力雄厚;

(2)信誉良好,经营行为规范;

(3)具有健全的内部控制制度,内部管理规范,能满足本基金安全运作的要求;

(4)具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要,并能提供全面的信息服务;

(5)研究实力强,有固定的研究机构和专职的高素质研究人员,能及时提供高质量的研究支持和咨询服务,包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告;

(6)本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序:

(1)资格考察;

(2)初步确定;

(3)签订协议。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	56,860,400,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:本基金本报告期内没有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

银河基金管理有限公司

2018年8月28日