

银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人：银河基金管理有限公司
基金托管人：杭州银行股份有限公司
送出日期：2019年3月29日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构承诺不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。半年度报告已经二分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年3月29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、勤勉尽责的原则履行管理职责，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。
本报告财务资料已审计并附会计师事务所盖章。
本报告自2019年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------|
| 基金名称 | 银河铭忆3个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 铭忆3月 |
| 前次交易代码 | 000284 |
| 赎回交易代码 | — |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年12月20日 |
| 基金管理人 | 银河基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 杭州银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,046,125,760.89份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金上市交易所及上市时间 | 上海证券交易所 2018年12月11日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在一定程度上控制组合流动性波动的前提下，力争实现基金长期稳定增值。本基金投资于中国证监会核准上市的不含可转债、可交换债券、分离交易可转债、定向增发股票、权证、股指期货等品种的固定收益类资产，并参与国债期货投资，采用不同的投资策略，在控制风险的前提下，力争实现基金长期稳定增值。 |
| 投资策略 | （一）信用债投资策略 1. 债券筛选策略 2. 债券组合配置策略 3. 债券风险控制策略 （二）可转债投资策略 （三）股指期货投资策略 （四）国债期货投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期风险和预期收益高于货币型基金，低于股票型基金、混合型基金。 |

2.3 基金管理人及基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------|----------------------|----------------|
| 名称 | 银河基金管理有限公司 | 杭州银行股份有限公司 |
| 法定代表人 | 朱建雄 | 李存 |
| 注册地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路188号15层 | 浙江省杭州市上城区平海路1号 |
| 办公地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路188号15层 | 浙江省杭州市上城区平海路1号 |
| 电话 | 021-38687700 | 0571-88476626 |

2.4 基金业绩表现

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------|----------------------|----------------|
| 名称 | 银河基金管理有限公司 | 杭州银行股份有限公司 |
| 法定代表人 | 朱建雄 | 李存 |
| 注册地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路188号15层 | 浙江省杭州市上城区平海路1号 |
| 办公地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路188号15层 | 浙江省杭州市上城区平海路1号 |
| 电话 | 021-38687700 | 0571-88476626 |

3.1 主要会计数据和财务指标

| 项目 | 2018年12月31日 | 2017年12月31日 | 2016年12月31日 |
|----------------------|------------------|---------------|---------------|
| 本期基金份额总额 | 3,046,125,760.89 | 15,694,724.08 | 15,694,724.08 |
| 本期基金份额持有人户数 | 10,825 | 10,016 | 10,016 |
| 本期基金份额持有人平均持有基金份额 | 281,119,168.20 | 1,569,472.41 | 1,569,472.41 |
| 本期基金份额持有人平均持有基金份额的时间 | 0.60年 | 0.18年 | 0.18年 |
| 本期基金份额持有人户数 | 10,825 | 10,016 | 10,016 |
| 本期基金份额持有人平均持有基金份额的时间 | 0.60年 | 0.18年 | 0.18年 |

3.2 基金净值表现

| 阶段 | 份额净值增长率 | 业绩比较基准增长率 | 业绩比较基准收益率 | ①-② | ②-③ |
|------------|---------|-----------|-----------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.44% | 0.03% | 1.99% | 0.05% | -0.02% |
| 过去六个月 | 3.09% | 0.05% | 2.57% | 0.80% | -0.01% |
| 过去一年 | 6.69% | 0.04% | 4.79% | 0.07% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.77% | 0.04% | 4.78% | 0.07% | -0.03% |

3.3 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.4 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.5 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.6 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.7 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.8 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.9 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.10 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.11 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.12 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.13 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.14 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.15 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.16 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.17 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.18 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.19 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.20 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.21 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.22 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

3.23 基金业绩比较基准

中债综合全价指数收益率

会计主体：银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
报告主体：2018年1月1日至2018年12月31日

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|----------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790.39 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 公允价值变动收益 | 123,964,545.56 | 18,812,679.41 | 18,812,679.41 |
| 其他收入 | 138,798,946.12 | — | — |
| 二、费用 | 2,707,406.49 | — | — |
| 三、利润总额 | 4,040,200.11 | — | — |
| 四、净利润 | 4,040,200.11 | — | — |

项目 **期初至** **本期** **上期可比期间**

| | | | |
|------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 一、收入 | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 | 2017年12月20日至2018年12月31日 |
| 利息收入 | 229,239,790. | | |