银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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8月26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。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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23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	银河铭忆3个月定开债券
场内简称	–
基金主代码	005384
前端交易代码	–
后端交易代码	–
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	3,114,983,723.47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	–

2.2 基金产品说明

投资目标	在一定程度上控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合封闭期和开放期的设置,采用不同的投资策略。 (一)封闭期内的投资策略 1、债券资产配置策略 本基金在债券配置上将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略。 2、债券品种选择策略 在债券资产久期、期限和类属配置的基础上,本基金根据债券市场收益率数据,运用利率模型对单个债券进行估值分析,并结合债券的内外部信用评级结果、流动性、信用利差水平、息票率、税赋政策等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。 3、动态增强策略 在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活策略,获取超额收益。 4、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时,还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,获取较高的投资收益。 (二)开放期内的投资策略 在开放期内,本基金为保持较高的流动性,在遵守本基金合同中有关投资限制与投资比例的前提下,调整配置高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
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,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。

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		银河基金管理有限公司	杭州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	陈凯伦
	联系电话	021-38568989	0571-87253683
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	chenkailun@hzbank.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95398
传真		021-38568769	0571-86475525

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、上海市世纪大道1568号中建大厦15楼 2、杭州市庆春路46号杭州银行大厦

§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)
本期已实现收益	71,732,325.55
本期利润	64,100,435.00
加权平均基金份额本期利润	0.0209
本期基金份额净值增长率	2.06%
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	0.0046
期末基金资产净值	3,167,428,083.68
期末基金份额净值	1.0168

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、基金合同生效日为2017年12月20日。

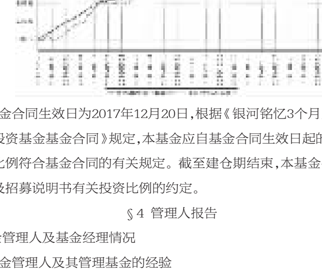
3.2 基金净值表现

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

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	0.47%	0.03%	0.28%	0.03%	0.19%	0.00%
过去三个月	0.81%	0.04%	-0.24%	0.06%	1.05%	-0.02%
过去六个月	2.06%	0.04%	0.24%	0.06%	1.82%	-0.02%
过去一年	5.21%	0.04%	2.82%	0.06%	2.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.94%	0.04%	5.02%	0.06%	2.92%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

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:本基金合同生效日为2017年12月20日,根据《银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》规定,本基金应自基金合同生效日起的6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至建仓期结束,本基金各项资产配置符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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有限公司、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2019年6月30日,公司管理的基金有: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、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河久益回报6个月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、银河泰利纯债债券型证券投资基金、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、银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金、银河睿丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银河和美生活主题混合型证券投资基金、银河如意债券型证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金、银河中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金、银河睿安纯债债券型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘铭	基金经理	2017年12月20日	–	8	硕士研究生学历,8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。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、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,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,2018年9月起担任银河沃丰纯债债券型证券投资基金的基金经理,2018年12月起担任银河家盈纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河嘉裕纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注:1、上表中任职日期为基金合同生效之日;

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。

针对同向交易部分,本报告期内,公司对旗下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,并针对溢价金额、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。

针对反向交易部分,公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易(包括股票和债券)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,由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

上半年国内经济开局良好,2019年一季度GDP同比增长6.4%,各项数据超出市场一致预期,但二季度增长动能再度减弱。1-5月,全国固定资产投资规模同比增长5.6%,较前四个月累计增速下滑0.5%。前5个月,出口同比增长6.1%,进口同比增长1.8%,贸易顺差8933.6亿元,扩大45%。1-5月社会消费品零售总额同比8.1%,连续下滑,比去年同期下降1.4%。1-5月工业增加值同比6.0%,连续下滑,比去年同期下降0.9%。海外方面,受国际贸易摩擦升级影响,全球经济景气度回落。今年上半年货币政策整体中性偏松,年初央行降准对冲1季度的MLF到期,2月份央行在公开市场的操作日趋谨慎,月末资金面出现超预期收紧,3月和4月资金面整体仍不宽松,但5月份中美贸易摩擦升级叠加同业刚兑打破的影响,央行除宣布对中小银行降准外,两次超量续作MLF,并在公开市场不断投放资金,带来了较为宽松的资金面。

上半年债券市场收益率整体走势震荡,受资金面影响较大,先下后上再下,中债综合财富指数上半年上涨1.82%。利率债方面,10年国开在3.47-3.88区间震荡,10年国债在3.06-3.43区间震荡。信用债方面,高评级信用利差较为平稳,低评级信用品种信用利差上行。

报告期内,基金债券配置以中高评级的信用债为主,维持约1.2倍组合杠杆,2.5年左右组合久期水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0168元;本报告期基金份额净值增长率为2.06%,业绩比较基准收益率为0.24%。

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,我们认为经济将呈稳中向下的趋势。投资方面,制造业投资受贸易摩擦升级、企业盈利回落影响,向下压力较大;短期房地产投资仍能受益于补库动力较强以及去年下半年以来融资环境的放宽,保持偏稳定的增速,但在销售同比增速回落、融资再次边际收紧的情况下或将重回下行通道;唯有基建投资受益于财政政策刺激,对经济有一定的托底。消费方面,汽车销售仍然偏弱,下半年社零增速仍有压力;进出口方面,全球贸易摩擦升级,经济景气度下行,下半年出口增速影响较大。从中长期角度来讲,贸易摩擦有长期化的倾向,国内经济的发展仍然需要内生动力,经济结构调整、国有企业改革、民企融资环境的改善需持续推进,这都需要良好的资本环境支持。经济基本面及政策面都将支持无风险利率不会大幅上行,利率债将呈现震荡慢牛行情。信用债在市场风险偏好降低的背景下,信用利差预计将继续分化。权益和转债市场有一定的上涨预期,但空间不会太大,行情将结构性分化。

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

根据《基金合同》有关规定,"在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次,每次收益分配比例不低于该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配"。

本基金截止2018年6月14日,银河铭忆可分配收益129,193,742.30元,于2018年6月22日进行利润分配,银河铭忆每单位分配收益0.02070元,超过可分配收益的10%。

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

无。

§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,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

本报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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,认为其真实、准确和完整,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)

6.1 资产负债表

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		107,006,511.41	5,229,472.22
结算备付金		1,892,048.32	11,661,470.41
存出保证金		182,976.53	88,218.62
交易性金融资产		3,834,943,100.00	3,746,870,300.00
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		3,618,606,500.00	3,376,407,300.00
资产支持证券投资		216,336,600.00	370,463,000.00
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		–	–
应收利息		47,239,682.26	73,995,612.42
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		3,991,264,318.52	3,837,845,073.67
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		718,026,847.46	727,399,302.00
应付证券清算款		104,325,663.85	5,179,265.10
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		778,389.24	788,949.17
应付托管费		259,463.06	262,983.04
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		25,839.46	17,647.99
应交税费		74,503.15	85,476.69
应付利息		251,956.58	381,708.20
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		93,572.04	170,000.00
负债合计		823,836,234.84	734,285,332.19
所有者权益:			
实收基金		3,114,983,723.47	3,045,125,750.68
未分配利润		52,444,360.21	58,433,990.80
所有者权益合计		3,167,428,083.68	3,103,559,741.48
负债和所有者权益总计		3,991,264,318.52	3,837,845,073.67

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0168元,基金份额总额3,114,983,723.47份。

6.2 利润表

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

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		79,614,938.47	209,650,314.74
1.利息收入		73,137,076.52	201,794,060.35
其中:存款利息收入		73,323.20	123,148,424.19
债券利息收入		66,109,418.75	75,505,963.80
资产支持证券利息收入		6,839,580.45	735,906.56
买入返售金融资产收入		114,754.12	2,403,765.80
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		14,109,752.50	3,167,517.14
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		14,424,295.37	3,098,270.00
资产支持证券投资收益		-314,542.87	69,247.14
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)		-7,631,890.55	4,688,737.25
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		15,514,503.47	21,344,138.56
1. 管理人报酬		4,668,016.70	11,867,096.25
2. 托管费		1,556,005.57	3,955,698.77
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		8,283.93	33,536.74
5. 利息支出		9,109,526.84	5,372,250.37
其中:卖出回购金融资产支出		9,109,526.84	5,372,250.37
6. 税金及附加		60,498.39	10,279.29
7. 其他费用		112,172.04	105,277.14
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		64,100,435.00	188,306,176.18
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		64,100,435.00	188,306,176.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

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

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)	3,045,125,750.68	58,433,990.80	3,103,559,741.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	64,100,435.00	64,100,435.00
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)	69,857,972.79	951,528.28	70,809,501.07
其中:1.基金申购款	69,857,972.79	951,528.28	70,809,501.07
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)	–	-71,041,593.87	-71,041,593.87
五、期末所有者权益(基金净值)	3,114,983,723.47	52,444,360.21	3,167,428,083.68
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)	10,010,003,000.00	15,604,724.08	10,025,607,724.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	188,306,176.18	188,306,176.18
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)	-7,014,758,407.25	-62,589,613.45	-7,077,348,020.70
其中:1.基金申购款	125,241,592.75	200,386.55	125,441,979.30
2.基金赎回款	-7,140,000,000.00	-62,790,000.00	-7,202,790,000.00
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)	–	-125,649,062.10	-125,649,062.10
五、期末所有者权益(基金净值)	2,995,244,592.75	15,672,224.71	3,010,916,817.46

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:

______刘立达______ ______刘立达______ ____廖理利____

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

银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[2017]2062号文批准公开募集。本基金为契约型、定期开放式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为10,010,003,000.00份。基金合同于2017年12月20日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为杭州银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河铭忆3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》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、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单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的相关规定)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前10 个工作日、开放期及开放期结束后10 个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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,封闭期内不受上述5%的限制。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,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:中债综合全价指数收益率。

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2019年6月30日的财务状况以及自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。

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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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,本基金同类型基金涉及的主要税项请参见下文,本基金本期依法适用相关条款:

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、债券免征营业税和增值税;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、基金销售机构
杭州银行股份有限公司("杭州银行")	基金托管人、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:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期末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:本基金本期无应付关联方的佣金。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	4,668,016.70	11,867,096.25
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

注:支付基金管理人银河基金的基金管理费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:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	1,556,005.57	3,955,698.77

注:支付基金托管人杭州银行的基金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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷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

注:本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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

份额单位:份

项目	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
基金合同生效日(2017年12月20日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	10,004,000.00	10,004,000.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	10,004,000.00	10,004,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3212%	0.3340%

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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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 2019年1月1日至2019年6月30日 期末余额	当期利息收入	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
杭州银行	107,006,511.41	32,688.57	1,335,789.40	45,245.33

注:本基金的银行存款由基金托管人杭州银行保管,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

注:本基金本报告期末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

无。

6.4.9 期末(2019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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日,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715,026,847.46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
150210	15国开10	2019年7月3日	102.86	1,500,000	154,290,000.00
150412	15农发12	2019年7月1日	102.49	490,000	50,220,100.00
170209	17国开09	2019年7月3日	101.40	500,000	50,700,000.00
180212	18国开12	2019年7月3日	101.12	1,000,000	101,120,000.00
150221	15国开21	2019年7月2日	100.65	894,000	89,981,100.00
150314	15进出14	2019年7月1日	100.76	500,000	50,380,000.00
160207	16国开07	2019年7月3日	99.43	800,000	79,544,000.00
160215	16国开15	2019年7月3日	100.04	1,600,000	160,064,000.00
合计				7,284,000	736,299,200.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币3,000,000.00元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

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	3,834,943,100.00	96.08
	其中:债券	3,618,606,500.00	90.66
	资产支持证券	216,336,600.00	5.42
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	108,898,559.73	2.73
8	其他各项资产	47,422,658.79	1.19
9	合计	3,991,264,318.52	100.00

7.2 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

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	2,607,476,000.00	82.32
	其中:政策性金融债	910,330,000.00	28.74
4	企业债券	376,214,500.00	11.88
5	企业短期融资券	100,210,000.00	3.16
6	中期票据	80,032,000.00	2.53
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	454,674,000.00	14.35
9	其他	–	–
10	合计	3,618,606,500.00	114.24

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	1828001	18华夏银行01	2,900,000	294,988,000.00	9.31
2	1928005	19浦发银行小微债01	2,700,000	269,919,000.00	8.52
3	1820023	18徽商银行绿色金融01	2,000,000	203,500,000.00	6.42
4	111912045	19北京银行CD045	2,000,000	193,940,000.00	6.12
5	160215	16国开15	1,600,000	160,064,000.00	5.05

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	159201	东花04A1	700,000	69,951,000.00	2.21
2	149858	18花13A1	680,000	68,795,600.00	2.17
3	1989008	19阳光1B	500,000	50,020,000.00	1.58
4	1789345	17建元9A1	600,000	27,570,000.00	0.87

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金暂不参与国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金暂不参与国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金暂不参与国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

【1828001】18华夏银行01:

根据2018年6月12日发布的相关公告,该证券发行人未严格区分相关银行账户属性,将开立在爱建证券名下的客户交易结算资金账户上传至查控系统,造成证券公司客户交易结算资金被冻结,该行发现上述情况后,亦未及时向监管部门报告。中国证监会责令该行予以改正,完善技术系统,强化资金存管责任,杜绝此类问题再次发生。

【1828016】18民生银行01:

根据银保监银罚决字(2018)5号:2018年12月7日,发行人因贷款业务严重违反审慎经营规则,被银保监会罚款200万元。银保监银罚决字(2018)8号:2018年12月7日,发行人因内控管理严重违反审慎经营规则;同业投资违规接受担保;同业投资、理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;本行理财产品之间风险隔离不到位;个人理财资金违规投资;票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;为非保本理财产品提供保本承诺,被银保监会罚款3160万元。

报告期内基金投资的前十名证券除以上两只债券以外其他八只证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	182,976.53
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	47,239,682.26
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	47,422,658.79

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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

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
2	1,557,491,861.74	3,114,983,723.47	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

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

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,000.00	0.32	10,004,000.00	0.32	自基金合同生效之日起持有期限不少于3年。
基金管理人高级管理人员	–	0.00	–	0.00	–
基金经理等人员	–	0.00	–	0.00	–
基金管理人股东	–	0.00	–	0.00	–
其他	–	0.00	–	0.00	–
合计	10,004,000.00	0.32	10,004,000.00	0.32	自基金合同生效之日起持有期限不少于3年。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017年12月20日)基金份额总额	10,010,003,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,045,125,750.68
本报告期期间基金总申购份额	69,857,972.79
减:本报告期期间基金总赎回份额	–
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	3,114,983,723.47

注:1、总申购份额含红利再投、转换入份额。

2、总赎回份额含转换出份额。

3、基金合同生效日为:2017年12月20日。

§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

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动:

1、2019年5月30日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,原总经理范永武先生因个人原因辞职,经公司第四届董事会审议通过,由董事长刘立达先生代为履行总经理职务。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动:

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

本报告期没有涉及基金管理人、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

本报告期管理人、托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

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
太平洋证券	2	–	–	–	–	–

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
太平洋证券	494,412,856.00	100.00%	4,607,557,000.00	100.00%	–	–

§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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	3,035,121,750.68	69,857,972.79	0.00	3,104,979,723.47	99.68%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。

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

2019年8月26日