银河景行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

2019-06-30

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019-08-26

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金简介
  - 基金基本情况
  - 基金产品说明
  - 基金管理人和基金托管人
  - 信息披露方式
  - 其他相关资料
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要会计数据和财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
- 管理人报告
  - 基金管理人及基金经理情况
    - 基金管理人及其管理基金的经验
    - 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明
  - 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司（以下简称：兴业银行）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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至06月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金名称	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	银河景行3个月定开债券
场内简称	
基金主代码	005790
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-06-13
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,503,386,606.08
基金合同存续期	

基金产品说明

投资目标	在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. （1）久期偏离策略 久期偏离是根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期， 以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期， 以规避债券价格下降的风险。 本基金通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期， 提高债券投资组合的收益水平。 本基金主要考虑的宏观经济政策因素包括：经济增长、固定资产投资、库 存周期、企业盈利水平、居民收入等反映宏观经济运行态势的重要指标，银行 信贷、货币供应和公开市场操作等反映货币政策执行情况的重要指标，以及居 民消费物价指数和工业品出厂价格指数等反映通货膨胀变化情况的重要指标 等。 （2）收益率曲线策略 本基金通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状 变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯形的短-中-长期债券品种的组合 期限配置，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。 本基金主要考虑的债券市场微观因素包括：收益率曲线、历史期限结构、 新债发行、回购及市场拆借利率等。 （3）类属配置策略 本基金依据宏观经济层面的信用风险周期和代表性行业的信用风险结构变 化，做出信用风险收缩或扩张的基本判断。 本基金根据对金融债、企业债、公司债、中期票据等债券品种与同期限国 债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类 属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不 同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 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。 （1）利率品种：本基金主要考虑绝对收益水平和利率变动趋势，配置目标 以获取资本利得为主，在信用环境出现恶化及投资组合必须保持相当的流动性 时，作为次要防御目标。 （2）信用债券：在风险可控前提下，本基金将主要配置信用类债券，以获取较高的息票收益和骑乘收益。 本基金投资的信用类债券需经国内评级机构进行信用评估。为了防范和控 制基金的信用风险，本基金将依据公司建立的内部信用评价模型对外部评级结 果进行检验和修正，并基于公司对宏观和行业研究的优势，深入分析发行人所 处行业发展前景、竞争状况、市场地位、财务状况、管理水平、债务水平、抵 押物质量、担保情况、增信方式等因素，评价债券发行人在预期投资期内的信 用风险，进一步识别外部评级高估的信用债潜在风险，发掘外部评级低估的信 用债投资机会，做出可否投资、以何种收益率投资和投资量的决策； 本基金亦会考虑信用债一二级市场之间的利差变动水平，对投资组合内的 个券做出短期获利了结和继续持有的决策。 如果债券获得主管机构的豁免评 级，本基金根据对债券发行人的信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的 投资范围。 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，主要包括： （1）骑乘策略 骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处 的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券 的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，获得资本 利得收益。 （2）息差策略 息差策略是指通过正回购融资并买入债券的操作，套取债券全价变动和融 资成本之间的利差。只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大 的套利目标。 本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实 施息差策略，提高投资组合的收益水平。 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	本基金的业绩比较基准为：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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	吴荣
	联系电话	021-38568989	021-62677777-213117
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95561
传真		021-38568769	021-62535823
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层	福建省福州市湖东路154号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层	上海市静安区江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		刘立达	高建平

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	1、中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15层 2、上海市静安区江宁路168号兴业大厦20楼

其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期	报告期(2019-01-01 至 2019-06-30)
本期已实现收益	79,805,639.67
本期利润	79,119,509.30
加权平均基金份额本期利润	0.0226
本期加权平均净值利润率	2.21 %
本期基金份额净值增长率	2.24 %
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
期末可供分配利润	15,359,820.31
期末可供分配基金份额利润	0.0044
期末基金资产净值	3,548,227,997.89
期末基金份额净值	1.0128
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
基金份额累计净值增长率	6.20 %

注：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2018年6月13日。

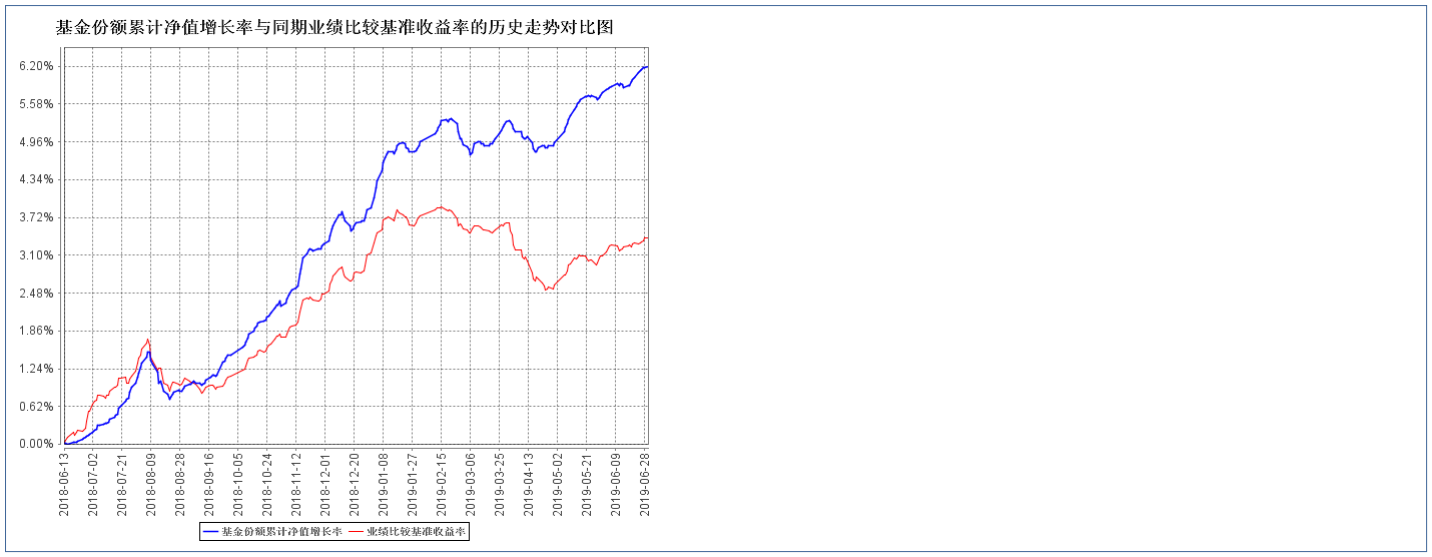
基金净值表现

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	净值增长率①	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	0.41 %	0.03 %	0.28 %	0.03 %	0.13 %	0.00 %
过去三个月	0.85 %	0.04 %	-0.24 %	0.06 %	1.09 %	-0.02 %
过去六个月	2.24 %	0.05 %	0.24 %	0.06 %	2.00 %	-0.01 %
过去一年	6.03 %	0.06 %	2.82 %	0.06 %	3.21 %	0.00 %
自基金合同生效起至今	6.20 %	0.05 %	3.38 %	0.06 %	2.82 %	-0.01 %

注：注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率

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：注：本基金合同生效日为2018年6月13日，根据《银河景行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。

基金管理人及基金经理情况

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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩晶	基金经理	2019-01-08	-	17	中共党员，经济学硕士，17年证券从业经历，曾就职于中国民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部总监、基金经理。2011年8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2016年3月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理，2018年2月起担任银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年3月起担任银河鑫月享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8月起担任银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018年12月起担任银河如意债券型证券投资基金的基金经理，2019年1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、银河家盈纯债债券型证券投资基金的基金经理。
刘铭	基金经理	2018-06-13	-	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、上表中刘铭的任职日期为基金合同生效之日，韩晶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。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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，参与中长端利率债的短期波段交易，组合杠杆约1.1-1.3倍，组合久期2年左右。

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1.0128元；本报告期基金份额净值增长率为2.24%，业绩比较基准收益率为0.24%。

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。

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。

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，本基金每年收益分配次数最多为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2019年3月18日，可分配收益62,850,690.85元，于2019年3月26日进行利润分配，银河景行每单位分配收益0.0145元，超过可分配收益的10%。
本基金截止2019年6月14日，可分配收益47,785,812.42元，于2019年6月25日进行利润分配，银河景行每单位分配收益0.0120元，超过可分配收益的10%。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

托管人对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

本托管人复核审查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。

资产负债表

会计主体：银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2019-06-30

单位：人民币元

资产	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
资产：		
银行存款	131,015,850.01	90,805,796.93
结算备付金	15,975,317.15	14,435,616.94
存出保证金	81,160.20	99,166.37
交易性金融资产	3,413,087,150.00	4,737,997,256.90
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,288,382,550.00	4,677,919,256.90
资产支持证券投资	124,704,600.00	60,078,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	446,432,109.66	-
应收证券清算款	19,608,437.03	44,835,188.92
应收利息	74,919,938.83	73,080,267.14
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,101,119,962.88	4,961,253,293.20
负债和所有者权益	**本期末 2019-06-30**	**上年度末 2018-12-31**
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	551,089,335.76	1,397,151,588.42
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	881,410.24	830,730.06
应付托管费	293,803.44	276,910.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	36,761.12	89,493.85
应交税费	464,879.11	471,813.96
应付利息	32,203.28	374,523.23
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	93,572.04	110,000.00
负债合计	552,891,964.99	1,399,305,059.55
所有者权益：	-	-
实收基金	3,503,386,606.08	3,503,386,606.08
未分配利润	44,841,391.81	58,561,627.57
所有者权益合计	3,548,227,997.89	3,561,948,233.65
负债和所有者权益总计	4,101,119,962.88	4,961,253,293.20

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0128元，基金份额总额3,503,386,606.08份。

利润表

会计主体：银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
一、收入	105,215,658.17	5,613,668.36
1.利息收入	102,817,391.97	6,494,632.92
其中：存款利息收入	402,517.09	2,961,146.48
债券利息收入	99,972,413.74	638,855.61
资产支持证券利息收入	1,934,875.26	-
买入返售金融资产收入	507,585.88	2,894,630.83
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,084,396.57	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,084,396.57	-
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）	-686,130.37	-880,964.56
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	26,096,148.87	648,015.85
1. 管理人报酬	5,324,383.74	420,813.38
2. 托管费	1,774,794.61	140,271.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	42,192.68	1,354.90
5. 利息支出	18,505,163.13	73,703.58
其中：卖出回购金融资产支出	18,505,163.13	73,703.58
6. 税金及附加	323,703.85	2,070.95
7. 其他费用	125,910.86	9,801.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	79,119,509.30	4,965,652.51
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	79,119,509.30	4,965,652.51

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30		
	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）	3,503,386,606.08	58,561,627.57	3,561,948,233.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	79,119,509.30	79,119,509.30
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
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）	-	-92,839,745.06	-92,839,745.06
五、期末所有者权益（基金净值）	3,503,386,606.08	44,841,391.81	3,548,227,997.89
项目	上年度可比期间 -至-		
	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）	3,009,999,000.00	-	3,009,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,965,652.51	4,965,652.51
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,009,999,000.00	4,965,652.51	3,014,964,652.51

本报告第6.1页至第6.4页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘立达　　主管会计工作负责人：刘立达　　会计机构负责人：廖理利

注：此处为PDF文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

银河景行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》、《银河景行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[2018]422号文批准公开募集。本基金为契约型、定期开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为3,009,999,000.00份，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为安永华明(2018)验字第60821717_B10号的验资报告。基金合同于2018年6月13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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。
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《银河景行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。本基金的投资组合为：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。

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关于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。

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。

重要会计政策和会计估计

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
活期存款	131,015,850.01	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	131,015,850.01	90,805,796.93

交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019-06-30 成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,134,848,443.14	1,144,972,550.00	10,124,106.86
	银行间市场	2,127,815,610.25	2,143,410,000.00	15,594,389.75
	合计	3,262,664,053.39	3,288,382,550.00	25,718,496.61
资产支持证券		124,000,000.00	124,704,600.00	704,600.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,386,664,053.39	3,413,087,150.00	26,423,096.61
项目		上年度末 2018-12-31 成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30 合同/名义金额	公允价值 资产	负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2018-12-31 合同/名义金额	公允价值 资产	负债	备注
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	446,432,109.66	-
合计	446,432,109.66	-

项目	上年度末 2018-12-31	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
项目	上年度末 2018-12-31						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应收活期存款利息	36,031.49	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	7,188.80	-
应收债券利息	72,077,994.98	-
应收资产支持证券利息	2,327,769.86	-
应收买入返售证券利息	470,917.20	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	36.50	-
合计	74,919,938.83	73,080,267.14

其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	36,761.12	-
合计	36,761.12	89,493.85

其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	93,572.04	-
合计	93,572.04	110,000.00

实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,503,386,606.08	3,503,386,606.08
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,503,386,606.08	3,503,386,606.08

未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,393,925.70	30,167,701.87	58,561,627.57
本期利润	79,805,639.67	-686,130.37	79,119,509.30
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-92,839,745.06	-	-92,839,745.06
本期末	15,359,820.31	29,481,571.50	44,841,391.81

存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
活期存款利息收入	164,380.80	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	237,436.76	-
其他	699.53	-
合计	402,517.09	2,961,146.48

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出股票成交总额	-	-
减：卖出股票成本总额	-	-
买卖股票差价收入	-	-

注：注：本基金本报告期无股票投资收益—买卖股票差价收入。

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,084,396.57	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,084,396.57	-

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,047,996,553.82	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,960,566,461.65	-
减：应收利息总额	84,345,695.60	-
买卖债券差价收入	3,084,396.57	-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

注：本基金未进行贵金属投资。

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖贵金属差价收入	-	-

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
赎回差价收入	-	-

贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购贵金属份额总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购贵金属成本总额	-	-
申购差价收入	-	-

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间收益金额 -至-
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
股票投资产生的股利收益	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期无股利收益。

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
1.交易性金融资产	-686,130.37	-
——股票投资	-	-
——债券投资	-1,312,730.37	-
——资产支持证券投资	626,600.00	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-686,130.37	-880,964.56

其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金赎回费收入	-	-
合计	-	-

交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
交易所市场交易费用	4,682.68	-
银行间市场交易费用	37,510.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	42,192.68	1,354.90

其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
审计费用	34,712.18	-
信息披露费	58,859.86	-
其他	600.00	-
银行间账户维护费	18,000.00	-
银行费用	13,738.82	-
合计	125,910.86	9,801.90

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

关联方关系

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。

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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	同受基金管理人控股股东控制

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。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 2018-06-13(基金合同生效日)至-	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 2018-06-13(基金合同生效日)至-	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 -至-			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的管理费	5,324,383.74	420,813.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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。

基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的托管费	1,774,794.61	140,271.14

注：注：支付基金托管人兴业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×0.10%÷当年天数。

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 2019-01-01至2019-06-30 当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 -至- 当期应支付的销售服务费

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 2019-01-01至2019-06-30					
	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
兴业银行	-	10,602,936.03	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 -至-					
	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

各关联方投资本基金的情况

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 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金合同生效日（2018-06-13）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2900 %	0.3300 %

注：注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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

份额单位：份

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业银行	3,493,386,606.08	99.7100 %	3,493,386,606.08	99.7100 %

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 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	131,015,850.01	164,380.80	27,914,326.84	354,479.70

注：注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
	本期 2019-01-01至2019-06-30			数量（单位：股/张）	总金额
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
	上年度可比期间 -至-			数量（单位：股/张）	总金额

注：注：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2019-06-25	2019-06-25	0.1200	42,040,639.27	-	42,040,639.27-	
2	2019-03-26	2019-03-26	0.1450	50,799,105.79	-	50,799,105.79-	
合计	-	-	0.2650	92,839,745.06	-	92,839,745.06-	

期末（2019-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：注：本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限证券。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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149,489,335.76 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
190205	19国开05	2019-07-01	97.95	500,000	48,975,000.00
101801157	18海运集装MTN001	2019-07-01	101.73	500,000	50,865,000.00
101801375	18中建四局MTN003	2019-07-01	101.32	42,000	4,255,440.00
101801149	18中电国际MTN001	2019-07-01	101.64	500,000	50,820,000.00
合计				1,542,000	154,915,440.00

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401,600,000.00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。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。
本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。
公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。
本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	20,040,000.00	101,150,000.00
A-1以下	-	-
未评级	260,954,000.00	572,769,000.00
合计	280,994,000.00	673,919,000.00

注： 未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	1,933,205,250.00	2,552,510,740.00
AAA以下	1,005,618,300.00	1,055,499,016.90
未评级	68,565,000.00	395,990,500.00
合计	3,007,388,550.00	4,004,000,256.90

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	124,704,600.00	60,078,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	124,704,600.00	60,078,000.00

按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

上年度末 2018-12-31	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。
本基金采用定期开放的运作方式，封闭期内不得申请申购、赎回本基金。在开放期内，本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。
本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。
本基金本报告期末无重大流动性风险。

市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	131,015,850.01	-	-	-	-	-	131,015,850.01
结算备付金	15,975,317.15	-	-	-	-	-	15,975,317.15
存出保证金	81,160.20	-	-	-	-	-	81,160.20
交易性金融资产	52,625,000.00	181,971,000.00	430,351,600.00	2,679,574,550.00	68,565,000.00	-	3,413,087,150.00
买入返售金融资产	446,432,109.66	-	-	-	-	-	446,432,109.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,608,437.03	19,608,437.03
应收利息	-	-	-	-	-	74,919,938.83	74,919,938.83
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	646,129,437.02	181,971,000.00	430,351,600.00	2,679,574,550.00	68,565,000.00	94,528,375.86	4,101,119,962.88
负债							
卖出回购金融资产款	551,089,335.76	-	-	-	-	-	551,089,335.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	881,410.24	881,410.24
应付托管费	-	-	-	-	-	293,803.44	293,803.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,761.12	36,761.12
应付利息	-	-	-	-	-	32,203.28	32,203.28
应交税费	-	-	-	-	-	464,879.11	464,879.11
其他负债	-	-	-	-	-	93,572.04	93,572.04
负债总计	551,089,335.76	-	-	-	-	1,802,629.23	552,891,964.99
利率敏感度缺口	95,040,101.26	181,971,000.00	430,351,600.00	2,679,574,550.00	68,565,000.00	92,725,746.63	3,548,227,997.89
上年度末 2018-12-31	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	90,805,796.93	-	-	-	-	-	90,805,796.93
结算备付金	14,435,616.94	-	-	-	-	-	14,435,616.94
存出保证金	99,166.37	-	-	-	-	-	99,166.37
交易性金融资产	233,168,650.00	157,518,000.00	1,047,628,766.90	3,000,604,840.00	299,077,000.00	-	4,737,997,256.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	44,835,188.92	44,835,188.92
应收利息	-	-	-	-	-	73,080,267.14	73,080,267.14
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	338,509,230.24	157,518,000.00	1,047,628,766.90	3,000,604,840.00	299,077,000.00	117,915,456.06	4,961,253,293.20
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	1,397,151,588.42	-	-	-	-	-	1,397,151,588.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	830,730.06	830,730.06
应付托管费	-	-	-	-	-	276,910.03	276,910.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	89,493.85	89,493.85
应交税费	-	-	-	-	-	471,813.96	471,813.96
应付利息	-	-	-	-	-	374,523.23	374,523.23
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	1,397,151,588.42	-	-	-	-	2,153,471.13	1,399,305,059.55
利率敏感度缺口	-1,058,642,358.18	157,518,000.00	1,047,628,766.90	3,000,604,840.00	299,077,000.00	115,761,984.93	3,561,948,233.65

利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。 3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
	市场利率下降25 个基点	1,798,836.99	27,430,370.90
	市场利率上升25 个基点	-1,798,836.99	-27,430,370.90

外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上期末 2018-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

注：本基金本报告期末（及上年度末）未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的其他市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

采用风险价值法管理风险

-

假设	-		
	-		
分析	风险价值（金额单位：人民币元）	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

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。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	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	3,413,087,150.00	83.22
	其中：债券	3,288,382,550.00	80.18
	资产支持证券	124,704,600.00	3.04
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	446,432,109.66	10.89
	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	146,991,167.16	3.58
8	其他各项资产	94,609,536.06	2.31
9	合计	4,101,119,962.88	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注：注：本基金本报告期末持有股票投资。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-

注：注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：注：本基金本报告期末持有股票投资。

报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）

注：注：本基金本报告期末未持有股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）

注：注：本基金本报告期末未持有股票。

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	-
卖出股票收入（成交）总额	-

注：注：本基金本报告期末未持有股票。

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	68,565,000.00	1.93
	其中：政策性金融债	68,565,000.00	1.93
4	企业债券	1,288,442,550.00	36.31
5	企业短期融资券	280,994,000.00	7.92
6	中期票据	1,650,381,000.00	46.51
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	0.00	0.00
10	合计	3,288,382,550.00	92.68

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101800461	18潞安MTN003	800,000	83,408,000.00	2.35
2	101800752	18兖州煤业MTN001	800,000	82,424,000.00	2.32
3	190205	19国开05	700,000	68,565,000.00	1.93
4	112523	17株国01	600,000	61,470,000.00	1.73
5	101800265	18中铝MTN001	500,000	51,650,000.00	1.46

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	139248	万科26A1	300,000	30,273,000.00	0.85
2	139253	万科27A1	300,000	30,264,000.00	0.85
3	156638	荣茂02优	300,000	30,039,000.00	0.85
4	139465	绿金2A1	200,000	20,082,000.00	0.57
5	139489	绿金3A1	100,000	10,027,000.00	0.28
6	139420	19融惠1A	40,000	4,019,600.00	0.11

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注： 注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计				-	
股指期货投资本期收益				-	
股指期货投资本期公允价值变动				-	

本基金投资股指期货的投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)				-	
国债期货投资本期收益（元）				-	
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	

注：本基金未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

投资组合报告附注

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情况的说明

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。

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

本报告期末本基金未持有股票。

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	81,160.20
2	应收证券清算款	19,608,437.03
3	应收股利	-
4	应收利息	74,919,938.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,609,536.06

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：注：本基金本报告期末持有股票。

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。

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2	1,751,693,303.04	3,503,386,606.08	100.00 %	0.00	0.00 %

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）	占上市总份额比例

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

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	3,009,999,000.00	85.92 %	3,009,999,000.00	85.92 %	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	3,009,999,000.00	85.92 %	3,009,999,000.00	85.92 %	自基金合同生效之日起持有期限不少于3年。

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。

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。

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。

基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

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。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		基金交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	-	-%	-	-%	265,351,917.53	21.67 %	-	-%	-	-%	-	-%-	
国海证券	1	-	-%	-	-%	958,939,540.24	78.33 %	29,087,600,000.00	100.00 %	-	-%	-	-%-	

注：注：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。 -

其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金变更基金经理的公告	《中国证券报》、公司网站	2019-01-09
2	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2019-01-22
3	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金（更新摘要）	《证券日报》、公司网站	2019-01-25
4	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	《中国证券报》、公司网站	2019-03-23
5	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购和赎回业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019-03-26
6	银河景行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	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019-03-29
7	关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019-03-30
8	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金2019年1季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2019-04-18
9	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券日报》、公司网站	2019-05-30
10	银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	《证券日报》、公司网站	2019-06-22
11	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有债券估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019-06-26
12	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2019-06-26

注：无。

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	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比	
机构	1	20190101-20190630	3,493,386,606.08	0.00	0.00	3,493,386,606.08	99.71 %	
个人	-	-	-	-	-	-	-	

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。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

1、中国证监会批准设立银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的文件

2、《银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

3、《银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件

5、银河景行3个月定期开放债券型发起式证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号15楼

查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：http://www.galaxyasset.com