（上接B357版）

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河银联系列证券投资基金——银河稳健证券投资基金(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”)证监基金字[2003]65号文《关于同意银河银联系列证券投资基金设立的批复》的核准，由银河基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于2003年8月4日正式生效，首次设立募集规模为1,186,651,618.30份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银河基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。2008年2月28日，本基金管理人银河基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分，拆分前，本基金的基金份额净值为人民币1.3753元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第9位(第9位以后舍去)为人民币1.375340290元，本基金管理人于拆分日，按照1:1.375340290的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币1.00000元，基金份额面值为人民币0.7271元。

本基金投资于在国内依法公开发行、具有良好流动性的金融工具，以及法律、法规及中国证监会允许的其他金融工具。本基金的投资组合遵循以下规定：(1)投资于股票和债券的比例不低于本基金资产总值的80%；(2)投资于股票的比例在正常情况下不低于基金资产净值的95%，不高于基金资产净值的75%；(3)投资组合中现金比例不低于5%；(4)投资于国家债券的比例，不低于本基金资产总值的20%；(5)持有一家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的10%；(6)与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；(7)中国证监会规定的其他比例限制。

本基金的业绩比较基准为：上证A股指数涨跌幅×75%+中信国债指数涨跌幅×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于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修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整出出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海市城市建设投资开发总公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司(“银河证券”)	受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	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
银河证券	1,046,346,934.90	10.73%	403,277,649.95	8.60%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
银河证券	22,898,536.80	19.25%	19,153,579.55	12.43%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
银河证券	1,012,000,000.00	27.82%	285,000,000.00	12.36%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	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
银河证券	952,593.10	10.88%	284,259.41	12.65%

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	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(%)
银河证券	348,474.60	8.67%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,870,780.56	19,717,793.71
其中：支付销售机构的客户维护费	2,713,343.41	2,648,695.47

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×1.50%/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

管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,645,130.09	3,286,298.94

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×0.25%/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

托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，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、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.3 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 2013年1月1日至2013年12月31日					
	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
农业银行	20,528,180.64	30,499,807.37	-	-	-	-

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
	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
农业银行	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	99,868,754.93	977,742.75	156,125,894.57	945,939.23

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
000625	长安汽车	2013年12月31日	持澄清媒体报道	11.45	2014年1月3日	11.72	1,378,640	16,566,910.39	15,785,428.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告

8.1 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	891,425,246.34	63.28
	其中：股票	891,425,246.34	63.28
2	固定收益投资	369,696,802.61	26.25
	其中：债券	369,696,802.61	26.25
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	20,000,000.00	1.42
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	105,975,174.73	7.52
7	其他各项资产	21,533,658.59	1.53
8	合计	1,408,630,882.27	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	84,884,492.15	6.06
C	制造业	626,075,550.81	44.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,587,949.32	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,854,675.65	1.49
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	42,433,770.60	3.03
J	金融业	15,313,209.41	1.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	44,030,000.00	3.14
M	科学研究和技术服务业	14,628,000.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	41,617,598.40	2.97
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	891,425,246.34	63.67

8.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	600587	新华医疗	982,424	68,681,261.84	4.91
2	002353	杰瑞股份	802,722	63,712,045.14	4.55
3	300005	探路者	3,980,884	63,296,055.60	4.52
4	603008	喜临门	5,700,176	60,763,876.16	4.34
5	600597	光明乳业	2,604,362	57,816,836.40	4.13
6	300058	蓝色光标	850,000	44,030,000.00	3.14
7	002065	东华软件	1,255,437	42,433,770.60	3.03
8	000826	桑德环境	1,195,908	41,617,598.40	2.97
9	002456	欧菲光	665,918	32,017,337.44	2.29
10	002390	信邦制药	1,101,359	30,386,494.81	2.17

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

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（%）
1	600637	百视通	131,827,119.71	9.21
2	601601	中国太保	85,493,290.55	5.97
3	600067	冠城大通	84,692,321.41	5.91
4	002065	东华软件	76,219,630.57	5.32
5	300005	探路者	69,591,816.40	4.86
6	601166	兴业银行	63,424,339.92	4.43
7	600597	光明乳业	62,302,442.74	4.35
8	300229	拓尔思	59,191,688.22	4.13
9	000977	浪潮信息	58,915,758.87	4.11
10	002456	欧菲光	58,107,204.29	4.06
11	603008	喜临门	57,697,187.83	4.03
12	000848	承德露露	54,401,763.39	3.80
13	000625	长安汽车	54,074,516.18	3.78
14	603000	人民网	52,833,047.75	3.69
15	002353	杰瑞股份	52,133,323.33	3.64
16	601808	中海油服	47,170,235.52	3.29
17	600000	浦发银行	46,499,771.63	3.25
18	002482	广田股份	45,764,211.69	3.20
19	000028	国药一致	44,169,357.40	3.08
20	600718	东软集团	42,249,738.86	2.95
21	000826	桑德环境	42,180,021.92	2.95
22	601788	光大证券	41,550,113.39	2.90
23	600820	隧道股份	41,417,680.55	2.89
24	002292	奥飞动漫	40,921,595.96	2.86
25	600196	复星医药	40,406,966.17	2.82
26	601117	中国化学	39,600,578.36	2.77
27	300054	鼎龙股份	39,230,878.28	2.74
28	600079	人福医药	39,130,255.66	2.73
29	601607	上海医药	38,939,396.13	2.72
30	600518	康美药业	38,595,757.60	2.70
31	300164	通源石油	38,505,790.85	2.69
32	002415	海康威视	38,198,007.62	2.67
33	600867	通化东宝	37,512,789.22	2.62
34	600292	中电远达	37,089,785.12	2.59
35	000100	TCL 集团	35,988,204.22	2.51
36	002588	史丹利	35,206,050.18	2.46
37	000623	吉林敖东	34,898,425.35	2.44
38	002390	信邦制药	34,662,541.07	2.42
39	000001	平安银行	34,533,200.00	2.41
40	600406	国电南瑞	33,161,025.31	2.32
41	600028	中国石化	32,666,938.58	2.28
42	600887	伊利股份	31,317,044.57	2.19
43	600976	武汉健民	31,019,070.27	2.17
44	000423	东阿阿胶	30,611,729.87	2.14
45	600030	中信证券	29,817,508.05	2.08
46	002439	启明星辰	29,544,061.98	2.06
47	002241	歌尔声学	29,531,730.11	2.06
48	600256	广汇能源	29,384,863.00	2.05
49	002653	海思科	29,190,754.48	2.04
50	300347	泰格医药	29,055,431.80	2.03
51	300168	万达信息	28,789,495.85	2.01
52	600500	中化国际	28,781,714.04	2.01

8.4.2 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

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（%）
1	600637	百视通	164,762,400.37	11.51
2	601166	兴业银行	110,545,089.37	7.72
3	600067	冠城大通	86,133,143.52	6.01
4	002456	欧菲光	82,174,441.41	5.74
5	300229	拓尔思	81,446,385.52	5.69
6	601117	中国化学	79,117,522.24	5.52
7	601318	中国平安	79,002,154.00	5.52
8	600518	康美药业	77,281,650.72	5.40
9	002482	广田股份	75,273,925.76	5.26
10	601601	中国太保	74,574,385.13	5.21
11	600315	上海家化	73,148,885.36	5.11
12	000423	东阿阿胶	61,557,997.87	4.30
13	000848	承德露露	60,311,492.58	4.21
14	000977	浪潮信息	58,341,185.73	4.07
15	603000	人民网	57,890,675.49	4.04
16	300058	蓝色光标	52,164,381.80	3.64
17	600837	海通证券	48,841,977.50	3.41
18	002065	东华软件	47,881,177.36	3.34
19	600976	武汉健民	47,342,107.88	3.31
20	000826	桑德环境	47,056,945.73	3.29
21	600000	浦发银行	46,758,217.98	3.27
22	600867	通化东宝	42,882,398.80	2.99
23	600820	隧道股份	42,316,326.45	2.95
24	600718	东软集团	42,191,339.92	2.95
25	600406	国电南瑞	41,584,471.56	2.90
26	600060	海信电器	40,624,844.15	2.84
27	000028	国药一致	40,386,702.21	2.82
28	601788	光大证券	40,273,377.59	2.81
29	000651	格力电器	40,230,324.46	2.81
30	002327	富安娜	39,052,947.03	2.73
31	600196	复星医药	38,887,176.59	2.72
32	601607	上海医药	38,608,219.55	2.70
33	600292	中电远达	38,177,673.57	2.67
34	002588	史丹利	37,707,253.73	2.63
35	002292	奥飞动漫	36,751,801.66	2.57
36	002653	海思科	36,610,976.74	2.56
37	600079	人福医药	36,348,154.38	2.54
38	002415	海康威视	36,203,801.61	2.53
39	000100	TCL 集团	35,898,521.01	2.51
40	000625	长安汽车	35,897,966.29	2.51
41	600519	贵州茅台	35,094,454.40	2.45
42	600123	兰花科创	34,477,318.45	2.41
43	600535	天士力	33,632,659.34	2.35
44	300039	上海凯宝	33,131,671.51	2.31
45	600887	伊利股份	33,100,649.65	2.31
46	002439	启明星辰	33,074,028.02	2.31
47	600809	山西汾酒	32,715,897.27	2.28
48	000623	吉林敖东	32,475,568.05	2.27
49	600500	中化国际	31,747,542.04	2.22
50	002385	大北农	31,711,335.60	2.21
51	002241	歌尔声学	31,151,891.28	2.18
52	300267	尔康制药	30,222,963.54	2.11
53	300257	开山股份	30,163,043.58	2.11
54	300168	万达信息	28,761,355.79	2.01
55	600323	瀚蓝环境	28,744,538.96	2.01

8.4.3 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	4,671,723,748.83
卖出股票收入（成交）总额	5,082,378,892.58

8.5 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	234,790,815.00	16.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,240,000.00	9.44
	其中：政策性金融债	132,240,000.00	9.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,665,987.61	0.19
8	其他	-	-
9	合计	369,696,802.61	26.40

8.6 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	010107	21国债(7)	613,060	59,681,391.00	4.26
2	019113	11国债13	500,000	49,950,000.00	3.57
3	090203	09国开03	400,000	38,152,000.00	2.72
4	130203	13国开03	400,000	37,672,000.00	2.69
5	019217	12国债17	300,000	30,063,000.00	2.15

8.7 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

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(%)

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 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。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货.

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

注：本基金未投资国债期货。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

注：本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	957,455.13
2	应收证券清算款	12,018,721.28
3	应收股利	-
4	应收利息	8,221,088.66
5	应收申购款	336,393.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,533,658.59

8.12.4 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

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

§9 基金份额持有人信息

9.1 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		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
52,909	23,750.78	453,545,599.13	36.09%	803,084,344.00	63.91%

9.3 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	184,662.05	0.0147%

注：截止2013年12月31日，公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量为10万份至50万份(含)；本基金的基金经理持有本基金份额总量为0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年8月4日）基金份额总额	1,186,651,618.30
本报告期期初基金份额总额	1,581,219,034.13
本报告期基金总申购份额	304,508,677.71
减:本报告期基金总赎回份额	629,097,768.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,256,629,943.13

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议

11.2 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

报告期内基金管理人、托管人未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所，本基金本期报告内应支付给安永华明会计师事务所的报酬为100,000.00元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供5年的审计服务。

11.6 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。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	1	1,957,555,204.41	20.07%	1,732,240.53	19.78%	-
中银国际	2	1,659,471,979.37	17.01%	1,468,468.15	16.77%	-
申银万国	1	1,554,781,750.24	15.94%	1,415,465.09	16.16%	-
安信证券	2	1,151,768,542.48	11.81%	1,043,861.81	11.92%	-
银河证券	1	1,046,346,934.90	10.73%	952,593.10	10.88%	-
光大证券	2	921,721,681.26	9.45%	839,132.67	9.58%	-
国泰君安	2	869,908,455.38	8.92%	781,377.25	8.92%	-
招商证券	1	573,436,394.84	5.88%	507,434.56	5.79%	-
华宝证券	1	12,059,370.57	0.12%	10,671.37	0.12%	-
江海证券	1	7,052,327.96	0.07%	6,240.62	0.07%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	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
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申银万国	11,744,064.10	9.87%	952,000,000.00	26.17%	-	-
安信证券	19,525,275.60	16.41%	607,000,000.00	16.68%	-	-
银河证券	22,898,536.80	19.25%	1,012,000,000.00	27.82%	-	-
光大证券	-	-	700,000,000.00	19.24%	-	-
国泰君安	64,811,782.10	54.47%	367,000,000.00	10.09%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

银河基金管理有限公司

2014年3月28日

（上接B357版）

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河收益证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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）	2,854,712,172.25	327,064,107.03	3,181,776,279.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-36,199,777.13	-36,199,777.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（份额减少以“-”号填列）	-1,570,732,325.45	-172,374,626.83	-1,743,106,952.28
其中：1.基金申购款	218,943,462.57	29,799,421.66	248,742,884.23
2.基金赎回款	-1,789