

信息披露 Disclosure

银河收益证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:银河基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、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责任。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期无财务审计报告。

本报告期自2013年10月01日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 银河收益债券

交易代码 151002

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2003年8月4日

报告期末基金份额总额 1,283,979,846.78份

以债券投资为主，兼顾股票投资，在充分控制风险和保持较高流动性的前提下，实现基金资产的安全及长期稳定增值。

根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合分析，通过在不同行业、不同风格上相组合的投资策略，力争在控制风险的前提下，为投资者提供长期稳定的回报。

本基金的主要投资对象为债券投资的辅助和补充，力争在严格控制风险的情况下，提高基金的收益水平。

在正常情况下，债券投资的比例范围为基金净资产值的50%至95%，股票投资的比例范围为基金净资产值的0%至30%；现金的比例如范围为基金净资产值的5%至20%。

债券指数涨跌幅±8.5%+上证A股指数涨跌幅×15%，其中

债券指数为中信国证指数涨跌幅×51%+中证国债指数涨跌幅×49%。

风险收益特征 银河收益债券的预期收益风险低于股票型基金，平衡型基金、价值型基金以及收益型基金，高于纯债基金。

基金管理人 银河基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -8,377,857.53

2.本期利润 -66,770,049.22

3.加权平均基金份额本期利润 1,355,657.015.38

4.期末基金份额净值 1,055.88

注: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。

所列基金业指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计算费用后实际收益水平将低于所列示的收益。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.72% 0.28% -1.83% 0.19% -1.89% 0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.72% 0.28% -1.83% 0.19% -1.89% 0.09%

3.2.3 基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.72% 0.28% -1.83% 0.19% -1.89% 0.09%

3.2.4 基金合同生效以来前十名股票重仓股情况

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

1 601318 中国平安 168,000 7,010,640.00 0.52

2 600036 招商银行 305,215 3,323,791.35 0.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行业票据 - -

3 金融债券 - -

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 317,845,910.00 23.45

6 企业中期票据 9,930,000.00 0.73

7 可转债 105,662,000.00 7.79

8 其他 - -

9 合计 1,255,181,068.06 92.59

5.5 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债券投资明细

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 113001 中行转债 2,298,050 221,371,156.50 16.33

2 110015 石化转债 1,515,000 144,470,400.00 10.66

3 110018 国电转债 1,400,000 144,410,000.00 10.65

4 113003 重工转债 103,475,144.10 7.63

5 113002 工行转债 101,350,000.00 7.48

5.6 报告期内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

注:本报告期内未持有资产支持证券投资。

5.7 报告期内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:本基金报告期末未持有权证。

5.8 报告期末按基金持有的股票投资组合的公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有股票。

5.9 报告期末按基金持有的债券投资组合的公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有债券。

5.10 报告期末按基金持有的贵金属投资组合的公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有贵金属。

5.11 报告期末按基金持有的其他投资组合的公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有其他投资。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.45 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。

5.46 报告期末按公允价值占基金资产净值比例(%)

注:本基金报告期末未持有公允价值。