

中国银河证券股份有限公司

银河金星 1 号集合资产管理计划

2013 年年度报告

管理人：中国银河证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 2 月 28 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人招商银行股份有限公司于 2014 年 2 月 26 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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划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集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期间：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日。

一、集合资产管理计划概况

1、 基本资料

名称	银河金星1号集合资产管理计划
类型	开放式、非限定性、存续期五年
成立日	2009年4月8日
报告期末份额总额	284,908,138.11份
投资目标	本计划将以股票投资为主，在主动控制风险的前提下，基于管理人对于中国经济发展特征的洞察，投资于中国经济主导产业中的优势企业，以期最大限度地分享中国经济增长的成果，实现集合计划资产的保值增值目标。
投资理念	分享中国经济增长的成果。
投资基准	本集合计划的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70% + 中证债券指数收益率×30%。

2、 管理人

名称	中国银河证券股份有限公司
注册地址	北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址	北京市西城区金融大街35号C座
法定代表人	陈有安
联系地址	北京市西城区金融大街35号C座607室
联系电话	4008-888-888
传真	010-66568864
网址	www.chinastock.com.cn

3、 托管人

名称	招商银行股份有限公司
办公地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人	傅育宁
托管业务批准文号	中国证监会证监基金字【2002】83号

托管部门联系人 张燕
联系电话 0755-83199084
传真 0755-83195201

4、 注册登记机构

名称 中国证券登记结算有限责任公司
办公地址 北京市西城区太平桥大街17号
公司网址 <http://www.chinaclear.cn>

5、 会计师事务所和经办注册会计师

名称 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
地址 中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼（即东三办公楼）16层
法定代表人 葛明
经办注册会计师 李慧民 程凯
联系电话 010-58153000
传真 010-85188298

6、 律师事务所和经办律师

名称 北京德恒律师事务所
注册地址 北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人 王丽
经办律师 刘焕志 鄂秀琄
联系人 白庆玲
联系电话 66575888、52682888
传真 65232181、52682999

二、主要财务指标

1、主要财务指标（单位：人民币元）

期间：2013.01.01—2013.12.31

本期利润	-13,924,265.48
净值增长率	-6.79%
期末资产净值	168,636,232.15
期末每份额净值	0.5919
期末每份额累计净值	0.6179

2、业绩表现

截止2013年12月31日，本集合计划单位净值0.5919元，累计单位净值0.6179元，本期集合计划净值增长率-6.79%。

3、本集合计划历史各时间段净值增长率和超额收益

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	超额收益①-②
2013年四季度	-0.37%	-2.91%	2.54%
2013年	-6.79%	-5.26%	-1.53%
2012年	-14.71%	6.78%	-21.49%
2011年	-18.38%	-16.47%	-1.91%
自产品成立至今	-39.28%	-0.92%	-38.36%

4、本期每份额增长率与投资基准收益率的比较

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
2013年	-6.79%	0.97%	-5.26%	0.98%	-1.53%	-0.01%

三、管理人报告

1、投资主办人简介

赵胜利，北京交通大学工业管理工程专业毕业，中国人民大学在职研究生，经济学硕士学位。拥有中国证券从业资格，逾 15 年证券从业经验。1997 年，就职于中华会计师事务所，先后参加齐鲁石化等十几家公司股份制改造和上市公司定期财务审计工作；1998-2000 年，就职于中国信达信托投资有限公司，在证券投资部为中国石油等大型企业客户管理受托账户；2000 年，加入中国银河证券研究所，先后负责市场策略和汽车行业研究工作，高级研究员。从 2008 年 1 月，转入中国银河证券资产管理总部工作。从 2010 年 12 月起，担任银河 99 指数集合计划投资主办人。从 2012 年 9 月 27 日起，担任央视 50 平衡集合计划投资主办人。从 2013 年 4 月 22 日起，担任银河金星 1 号集合计划投资主办人，从 2013 年 5 月 21 日起，担任银河智远有限补偿 1 号集合计划投资主办人。现任资产管理总部总监、投资经理。

2、投资主办人工作报告

1) 市场回顾和投资操作

2013 年股票表现差异巨大。沪深 300 指数下跌 7.65%，中证 500 指数上涨 16.89%，中小板指数上涨 17.54%，创业板指数上涨 82.73%。从行业表现看，涨幅最大五个行业分别是信息服务、信息设备、电子元器件、家用电器和医药生物，平均涨幅为 50%；跌幅最大五个行业分别是采掘、有色金属、黑色金属、房地产和建筑建材，平均跌幅为 20%。总体而言，和宏观经济关系密切的周期性行业跌幅大，和信息消费、环保产业等新兴产业关系密切的行业涨幅大。

2013 年 4 月 22 日，赵胜利担任本产品投资主办人以来，投资业绩明显改善，超越业绩基准 3.54 个百分点。在此期间，市场经历了六月和十二月两次较大幅度下跌。通过权益类资产灵活调整，降低了产品净值回撤幅度，同时把握住三季度反弹行情。十二月份，在“股债双杀、现金为王”市场背景下，大幅降低权益类资产配置比重，资金重点通过逆回购分享货币市场年终较高回报。

2) 市场展望和投资策略

本产品是 2009 年 4 月 8 日成立的非限定性集合计划，存续期为 5 年，将于 2014 年 4 月 7 日到期。根据产品合同约定，产品展期需要经过委托人和托管人同意、证券监管部门批准以及委托人重新签订合同等环节。

在本产品展期获得批准前，资产配置方面，以高流动性资产为主要配置方向。

3) 风险控制报告

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

2013 年，银河证券针对本集合计划，坚持规范运作，通过每日的风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并提醒投资主办人采取相应的风险规避措施，确保集合计划合法合规、正常运行。本报告期内，管理人严格执行中国银河证券股份有限公司内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定，保护投资者利益。

本集合计划在报告期内，管理人严格控制风险，未出现风险事故或其他损害集合计划份额持有人利益的情形。

四、托管人报告

银河金星1号集合资产管理计划

2013年年度托管人报告

托管人声明,在本报告期内,资产托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害计划份额持有人利益的行为,严格遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内资产管理人在投资运作、集合计划资产净值的计算、利润分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上,不存在任何损害计划份额持有人利益的行为,遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

资产管理人报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特此报告。

招商银行资产托管部

二〇一四年二月二十六日

五、审计报告和财务报告

银河金星1号集合资产管理计划

已审财务报表

2013年12月31日

银河金星1号集合资产管理计划

目 录

	页次
一、 审计报告	1 - 2
二、 已审财务报表	
资产负债表	3
利润表	4
所有者权益（集合计划净值）变动表	5
财务报表附注	6 - 21

审计报告

安永华明（2014）审字第 60688537_A01 号

银河金星 1 号集合资产管理计划全体份额持有人：

我们审计了后附的银河金星 1 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表，2013 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及财务报表附注。

一、集合计划管理人对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是集合计划管理人中国银河证券股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

审计报告（续）

安永华明（2014）审字第60688537_A01号

三、审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银河金星1号集合资产管理计划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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师 李慧民

中国 北京

中国注册会计师 程 凯

2014年2月25日

银河金星 1 号集合资产管理计划
资产负债表
2013 年 12 月 31 日
人民币元

项目	附注	2013年12月31日	2012年12月31日
资产：			
银行存款	六、1	3,315,639.47	123,460,008.83
结算备付金		1,026,006.57	562,445.19
存出保证金		66,701.60	250,000.00
交易性金融资产	六、2	63,805,063.83	50,057,402.64
其中：股票投资		43,939,544.72	50,057,402.64
债券投资		15,110,560.00	-
基金投资		4,754,959.11	-
买入返售金融资产		102,002,550.00	-
应收证券清算款		-	42,395,112.92
应收利息	六、3	<u>261,524.31</u>	<u>43,372.53</u>
资产总计		<u>170,477,485.78</u>	<u>216,768,342.11</u>
负债：			
应付证券清算款		327,680.07	-
应付赎回款		1,233,379.23	516,319.28
应付管理人报酬	七、2	117,769.79	144,820.53
应付托管费	七、2	29,442.46	36,205.11
应付交易费用		89,488.36	237,421.85
其他负债	六、4	<u>43,493.72</u>	<u>285,000.00</u>
负债合计		<u>1,841,253.63</u>	<u>1,219,766.77</u>
所有者权益：			
实收资金	六、5	284,908,138.11	339,461,238.93
未分配利润	六、6	<u>(116,271,905.96)</u>	<u>(123,912,663.59)</u>
所有者权益合计		<u>168,636,232.15</u>	<u>215,548,575.34</u>
负债及所有者权益总计		<u>170,477,485.78</u>	<u>216,768,342.11</u>

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，集合计划份额净值为人民币 0.5919 元，集合计划份额总额为 284,908,138.11 份。

第3页至第21页的财务报表由以下单位 / 人士签署：

集合计划管理人：中国银河证券股份有限公司

法定代表人：

主管集合计划会计工作负责人：

会计机构负责人：

载于第6页至第21页的附注为本财务报表的组成部分。

银河金星 1 号集合资产管理计划
利润表
2013 年度
人民币元

项目	附注	2013年度	2012年度
收入		(8,390,020.67)	(32,717,455.74)
利息收入		1,083,035.78	820,958.52
其中：存款利息收入	六、7	557,046.24	782,798.32
债券利息收入	六、8	374,092.55	37,178.20
买入返售金融资产收入		151,896.99	982.00
投资收益		(5,778,204.35)	(122,589,744.44)
其中：股票投资收益	六、9	(6,658,486.39)	(127,233,710.13)
债券投资收益	六、10	75,765.80	(390,983.46)
基金投资收益	六、11	(2,658,160.70)	(471,031.40)
股利收益	六、12	3,462,676.94	5,505,980.55
公允价值变动损益	六、13	(3,695,952.10)	89,049,663.51
其他收入		<u>1,100.00</u>	<u>1,666.67</u>
费用		5,534,244.81	5,052,188.44
管理人报酬	七、2	1,490,164.95	2,085,478.14
托管费	七、2	372,541.32	521,369.46
交易费用	六、14	3,618,781.61	2,384,701.16
其他费用	六、15	<u>52,756.93</u>	<u>60,639.68</u>
利润总额		(13,924,265.48)	(37,769,644.18)
所得税费用		-	-
净利润		<u>(13,924,265.48)</u>	<u>(37,769,644.18)</u>

载于第 6 页至第 21 页的附注为本财务报表的组成部分

银河金星 1 号集合资产管理计划
所有者权益（集合计划净值）变动表
2013 年度
人民币元

项目	2013 年度		
	实收资金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益（集合计划净值）	339,461,238.93	(123,912,663.59)	215,548,575.34
本年经营活动产生的集合计划净值变动数	-	(13,924,265.48)	(13,924,265.48)
本年资产份额交易产生的集合计划净值变动数	(54,553,100.82)	21,565,023.11	(32,988,077.71)
其中：集合计划申购款	231,984.17	(103,024.17)	128,960.00
集合计划赎回款	(54,785,084.99)	21,668,047.28	(33,117,037.71)
本年向集合计划份额持有人分配利润产生的集合计划净值变动数	-	-	-
年末所有者权益（集合计划净值）	<u>284,908,138.11</u>	<u>(116,271,905.96)</u>	<u>168,636,232.15</u>
项目	2012 年度		
	实收资金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益（集合计划净值）	379,047,566.19	(96,858,218.20)	282,189,347.99
本年经营活动产生的集合计划净值变动数	-	(37,769,644.18)	(37,769,644.18)
本年资产份额交易产生的集合计划净值变动数	(39,586,327.26)	10,715,198.79	(28,871,128.47)
其中：集合计划申购款	30,457.48	(10,617.48)	19,840.00
集合计划赎回款	(39,616,784.74)	10,725,816.27	(28,890,968.47)
本年向集合计划份额持有人分配利润产生的集合计划净值变动数	-	-	-
年末所有者权益（集合计划净值）	<u>339,461,238.93</u>	<u>(123,912,663.59)</u>	<u>215,548,575.34</u>

载于第 6 页至第 21 页的附注为本财务报表的组成部分

银河金星 1 号集合资产管理计划
财务报表附注
2013 年度
人民币元

一、集合计划基本情况

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2008 年 12 月 18 日《关于核准银河证券股份有限公司设立银河金星 1 号集合资产管理计划的批复》，银河金星 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2009 年 4 月 8 日募集成立。集合计划类型为非限定性，存续期为 5 年。中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）是本集合计划的管理人，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）是本集合计划的托管人，银河证券、招商银行、中国建设银行股份有限公司是本集合计划的推广机构。

根据《证券公司客户资产管理业务试行办法》和《银河金星 1 号集合资产管理计划说明书》约定，集合计划认购对象为中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者。集合计划每份额面值为人民币 1.00 元。截至 2009 年 4 月 2 日止，集合计划已收到委托人认购参与金额扣除参与费用后的净参与金额为人民币 1,640,574,618.86 元，折合 1,640,574,618.86 份集合计划份额；参与金额在推广期内产生的利息为人民币 1,375,758.30 元，折合 1,375,758.30 份集合计划份额；以上的实收资金共计人民币 1,641,950,377.16 元，折合 1,641,950,377.16 份集合计划份额。设立投资已经安永华明会计师事务所验证，并出具安永华明（2009）验字第 60688537_A01 号验资报告。

二、财务报表编制基础

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（统称“企业会计准则”）并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制的。

本财务报表以持续经营为基础列报。

三、遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 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。

四、重要会计政策和会计估计

1. 会计年度

本集合计划采用公历年制，即自每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

2. 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

四、重要会计政策和会计估计（续）

3. 金融工具的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。

本集合计划将持有的股票投资、债券投资和基金投资于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

4. 金融工具的确认及终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

集合计划初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资、集合计划投资等，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

四、重要会计政策和会计估计（续）

4. 金融工具的确认及终止确认（续）

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

5. 金融工具的成本计价方法

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转；

四、重要会计政策和会计估计（续）

5. 金融工具的成本计价方法（续）

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于确认日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

6. 金融工具的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本集合计划的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本集合计划在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本集合计划在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本集合计划无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

本集合计划主要金融工具的估值方法如下：

(1) 股票投资

1) 上市流通的股票估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

四、重要会计政策和会计估计（续）

6. 金融工具的估值原则（续）

(1) 股票投资

2) 未上市的股票的估值

- A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；
- B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；
- C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值
 - a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；
 - b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

- 1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；
- 2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；
- 3) 未上市债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；
- 4) 在全国银行间债券市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值；

四、重要会计政策和会计估计（续）

6. 金融工具的估值原则（续）

(3) 基金投资

- 1) 上市流通的基金按估值日该基金在证券交易所的收盘价估值；该日无交易的基金，以最近一个交易日的收盘价计算；
- 2) 非上市流通的基金按基金管理公司公布的估值日净值估值；
- 3) 货币市场基金按照基金面值估值。

(4) 权证投资

- 1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；
- 2) 未上市流通的认股权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；
- 3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(5) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(4)中相关原则进行估值。

(6) 其他

- 1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，集合计划投资管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；
- 2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7. 集合计划的申购和赎回

在收到集合计划投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收集合计划未分配利润的余额占集合计划净值的比例，将确认有效的申购或赎回款项分割为实收资金和损益平准金。

四、重要会计政策和会计估计（续）

8. 实收资金

每份集合计划份额面值为人民币1.00元。实收资金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购、赎回引起的实收资金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。

9. 损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按集合计划未分配净收益占集合计划净值比例计算的金额，于集合计划申购确认日或赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润。

10. 收入的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在证券回购期内逐日计提；
- (4) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (5) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (6) 基金投资收益/（损失）于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账；
- (7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除个人所得税后的净额入账；
- (9) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

四、重要会计政策和会计估计（续）

11. 费用的确认和计量

- (1) 集合计划管理费按前一日的集合计划资产净值的0.8%的年费率逐日计提；
- (2) 集合计划托管费按前一日的集合计划资产净值的0.2%的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在证券回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期费用。

12. 集合计划的收益分配政策

- (1) 每份集合计划份额享有同等分配权；
- (2) 当年收益先弥补上一年度亏损后，再进行当年收益分配；
- (3) 如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (4) 分配收益后本集合计划每份额净值不能低于面值；
- (5) 在符合有关分红条件的前提下，每年至少分配一次；
- (6) 法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

五、税项

1. 印花税

集合计划管理人运用集合计划买卖股票按照1%的税率单边征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

参照财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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。

参照财政部、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。

银河金星 1 号集合资产管理计划
财务报表附注（续）
2013 年度
人民币元

六、财务报表主要项目注释

1. 银行存款

项目	2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
活期存款	<u>3,315,639.47</u>	<u>123,460,008.83</u>

2. 交易性金融资产

	2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票投资	44,652,055.45	43,939,544.72	(712,510.73)
债券投资	15,099,140.00	15,110,560.00	11,420.00
基金投资	<u>4,781,573.79</u>	<u>4,754,959.11</u>	(26,614.68)
合计	<u>64,532,769.24</u>	<u>63,805,063.83</u>	(727,705.41)
	2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票投资	<u>47,089,155.95</u>	<u>50,057,402.64</u>	<u>2,968,246.69</u>

3. 应收利息

项目	2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
应收债券利息	219,322.43	-
应收买入返售利息	28,803.59	-
应收银行存款利息	12,857.42	43,094.12
应收结算备付金利息	507.87	278.41
应收交易保证金利息	<u>33.00</u>	<u>-</u>
合计	<u>261,524.31</u>	<u>43,372.53</u>

4. 其他负债

项目	2013 年 12 月 31 日	2012 年 12 月 31 日
应付券商交易保证金	-	250,000.00
预提审计费	30,000.00	35,000.00
其他	<u>13,493.72</u>	<u>-</u>
合计	<u>43,493.72</u>	<u>285,000.00</u>

银河金星 1 号集合资产管理计划
 财务报表附注（续）
 2013 年度
 人民币元

六、财务报表主要项目注释（续）

5. 实收资金

项目	2013 年度	
	份额（份）	账面金额
年初数	339,461,238.93	339,461,238.93
本年增加	231,984.17	231,984.17
本年减少	(54,785,084.99)	(54,785,084.99)
年末数	<u>284,908,138.11</u>	<u>284,908,138.11</u>

6. 未分配利润

项目	2013年度		
	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本年初余额	(100,529,410.28)	(23,383,253.31)	(123,912,663.59)
本年利润	(10,228,313.38)	(3,695,952.10)	(13,924,265.48)
本年集合计划份额交易产生的变动数	17,160,904.71	4,404,118.40	21,565,023.11
其中：集合计划申购款	(75,606.55)	(27,417.62)	(103,024.17)
集合计划赎回款	17,236,511.26	4,431,536.02	21,668,047.28
本年已分配利润	-	-	-
本年末余额	<u>(93,596,818.95)</u>	<u>(22,675,087.01)</u>	<u>(116,271,905.96)</u>

7. 存款利息收入

项目	2013 年度	2012年度
银行存款利息收入	530,206.43	774,748.17
结算备付金利息收入	21,925.18	8,050.15
交易保证金利息收入	<u>4,914.63</u>	-
合计	<u>557,046.24</u>	<u>782,798.32</u>

银河金星 1 号集合资产管理计划
 财务报表附注（续）
 2013 年度
 人民币元

六、财务报表主要项目注释（续）

8. 债券利息收入

项目	2013 年度	2012年度
上交所国债利息收入	68,999.78	-
上交所可转债利息收入	11,184.34	-
深交所企业债利息收入	174,520.55	-
银行间国债利息收入	75,576.92	-
银行间央行票据利息收入	43,810.96	-
上交所可转债利息收入	-	2,263.12
银行间企业债利息收入	-	34,915.08
合计	<u>374,092.55</u>	<u>37,178.20</u>

9. 股票投资收益

项目	2013 年度	2012年度
卖出股票成交总额	1,244,358,619.35	928,542,346.97
减：卖出股票成本总额	<u>1,251,017,105.74</u>	<u>1,055,776,057.10</u>
合计	<u>(6,658,486.39)</u>	<u>(127,233,710.13)</u>

10. 债券投资收益

项目	2013 年度	2012年度
卖出债券成交总额	37,195,407.72	47,635,394.43
减：卖出债券成本总额	35,428,624.70	47,593,462.67
应收利息总额	<u>1,691,017.22</u>	<u>432,915.22</u>
合计	<u>75,765.80</u>	<u>(390,983.46)</u>

11. 基金投资收益

项目	2013 年度	2012年度
卖出基金成交总额	126,213,151.40	9,529,635.27
减：卖出基金成本总额	<u>128,871,312.10</u>	<u>10,000,666.67</u>
合计	<u>(2,658,160.70)</u>	<u>(471,031.40)</u>

银河金星 1 号集合资产管理计划
 财务报表附注（续）
 2013 年度
 人民币元

六、财务报表主要项目注释（续）

12. 股利收益

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012 年度</u>
上交所股票股利收入	3,048,596.08	5,046,007.39
深交所股票股利收入	391,826.45	459,973.16
基金红利收入	<u>22,254.41</u>	<u>-</u>
合计	<u><u>3,462,676.94</u></u>	<u><u>5,505,980.55</u></u>

13. 公允价值变动损益

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012 年度</u>
股票投资	(3,680,757.42)	88,558,848.24
债券投资	11,420.00	490,815.27
基金投资	<u>(26,614.68)</u>	<u>-</u>
合计	<u><u>(3,695,952.10)</u></u>	<u><u>89,049,663.51</u></u>

14. 交易费用

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012 年度</u>
交易所交易费用	3,606,606.61	2,382,901.16
银行间交易费用	525.00	800.00
场外基金交易费用	<u>11,650.00</u>	<u>1,000.00</u>
合计	<u><u>3,618,781.61</u></u>	<u><u>2,384,701.16</u></u>

15. 其他费用

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012 年度</u>
银行划款费用	13,756.93	7,639.68
审计费	30,000.00	35,000.00
银行间账户维护费	<u>9,000.00</u>	<u>18,000.00</u>
合计	<u><u>52,756.93</u></u>	<u><u>60,639.68</u></u>

银河金星 1 号集合资产管理计划
财务报表附注（续）
2013 年度
人民币元

七、关联方关系及其交易

1. 关联方关系

关联方名称	与本集合计划的关系
中国银河证券股份有限公司	集合计划管理人、销售机构
招商银行股份有限公司	集合计划托管人、销售机构

2. 关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(1) 通过关联方席位进行的交易

1) 证券买卖

关联方名称	2013 年度	
	证券买卖成交金额	占本期间交易金额比例
中国银河证券股份有限公司	<u>2,935,849,319.45</u>	<u>100%</u>

关联方名称	2012 年度	
	证券买卖成交金额	占本期间交易金额比例
中国银河证券股份有限公司	<u>1,704,089,198.56</u>	<u>100%</u>

2) 佣金

关联方名称	2013 年度	
	支付的佣金	占本期间佣金比例
中国银河证券股份有限公司	1,908,840.66	100%
其中：已支付佣金	1,819,827.30	95%
应支付佣金	<u>89,013.36</u>	<u>5%</u>

关联方名称	2012 年度	
	支付的佣金	占本期间佣金比例
中国银河证券股份有限公司	1,163,987.51	100%
其中：已支付佣金	926,565.66	80%
应支付佣金	<u>237,421.85</u>	<u>20%</u>

注：上述佣金按市场佣金率计算，并已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

银河金星 1 号集合资产管理计划
 财务报表附注（续）
 2013 年度
 人民币元

七、关联方关系及其交易（续）

(2) 关联方报酬

1) 集合计划管理费

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012年度</u>
当年应支付的管理费	1,490,164.95	2,085,478.14
其中：已支付管理费	1,372,395.16	1,940,657.61
应支付管理费	<u>117,769.79</u>	<u>144,820.53</u>

a. 本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.8%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日集合计划资产净值

b. 集合计划管理费每日计提，按月支付。

2) 集合计划托管费

项目	<u>2013 年度</u>	<u>2012年度</u>
当年应支付的托管费	372,541.32	521,369.46
其中：已支付托管费	343,098.86	485,164.35
应支付托管费	<u>29,442.46</u>	<u>36,205.11</u>

a. 集合计划托管费每日按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日集合计划资产净值

b. 集合计划托管费每日计提，逐日累计，按月支付。

(3) 集合计划存放在托管银行的银行存款年末余额为人民币 3,315,639.47 元，应收利息余额为人民币 12,857.42 元，在本会计期间内所获得的利息收入为人民币 530,206.43 元；托管银行收取的银行电汇手续费为人民币 13,756.93 元。

(4) 关联方持有集合计划份额

截至 2013 年 12 月 31 日，本集合计划管理人持有本集合计划份额为 82,097,518.86 份，金额为人民币 48,593,521.41 元。

银河金星 1 号集合资产管理计划
财务报表附注（续）
2013 年度
人民币元

八、于 2013 年 12 月 31 日本集合计划持有流通受限的证券

股票代码	股票名称	停牌原因	期末 估值单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额
600547	山东黄金	重大事项	17.25	6,879	135,585.09	118,662.75
000562	宏源证券	重大事项	8.22	20,891	204,736.01	171,724.02
000625	长安汽车	重大事项	11.45	200,000	2,294,526.46	2,290,000.00

九、风险管理

1. 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

2. 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划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。

本集合计划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；本集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

3. 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，集合计划管理人可能无法迅速、低成本地调整集合计划投资组合，从而对集合计划收益造成不利影响。

本集合计划管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本集合计划所投资的大部分证券具有良好的流动性，因此无重大流动性风险。

4. 市场风险

市场风险是指集合计划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。

(1) 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金以及交易性债券投资等，基于本集合计划的经营性质，生息资产受利率变动的影响较小，且本集合计划无计息负债，因此本集合计划并不存在重大的利率风险。

(2) 外汇风险

本集合计划持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

九、风险管理

4. 市场风险（续）

(3) 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人对本集合计划所持有的股票、基金等价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

十、或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

十一、承诺事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的承诺事项。

十二、资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无需做披露的资产负债表日后事项。

十三、其他重要事项

截至财务报表批准日，本集合计划无其他需要披露的重要事项。

十四、财务报表的批准

本财务报表已于2014年2月25日经本集合计划管理人批准。

六、投资组合报告

1、资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
买入返售资产	102,002,550.00	59.83%
股票	43,939,544.72	25.77%
债券	15,110,560.00	8.86%
基金	4,754,959.11	2.79%
银行存款	3,315,639.47	1.94%
其他资产	1,354,232.48	0.79%
合计	170,477,485.78	100.00%

注：1. 其他资产包括：结算备付金、存出保证金、应收利息；
2. 因四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

2、期末股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值
1	601318	中国平安	118,820	4,958,358.60	2.94%
2	601628	中国人寿	215,253	3,256,777.89	1.93%
3	000625	长安汽车	200,000	2,290,000.00	1.36%
4	600016	民生银行	290,814	2,245,084.08	1.33%
5	000951	中国重汽	149,968	1,715,633.92	1.02%
6	000581	威孚高科	50,000	1,540,000.00	0.91%
7	000006	深振业A	300,000	1,479,000.00	0.88%
8	601668	中国建筑	433,972	1,362,672.08	0.81%
9	600000	浦发银行	141,153	1,331,072.79	0.79%
10	601166	兴业银行	125,843	1,276,048.02	0.76%
11	002202	金风科技	150,000	1,264,500.00	0.75%
12	600050	中国联通	336,300	1,079,523.00	0.64%
13	601328	交通银行	249,104	956,559.36	0.57%
14	601398	工商银行	265,371	950,028.18	0.56%
15	000002	万科A	110,832	889,980.96	0.53%
16	601088	中国神华	54,255	858,314.10	0.51%
17	600030	中信证券	67,034	854,683.50	0.51%
18	601288	农业银行	342,154	848,541.92	0.50%
19	600104	上汽集团	56,442	798,089.88	0.47%
20	600028	中国石化	175,551	786,468.48	0.47%

21	601939	建设银行	156,203	646,680.42	0.38%
22	601006	大秦铁路	79,661	588,694.79	0.35%
23	601601	中国太保	31,168	577,543.04	0.34%
24	000651	格力电器	17,519	572,170.54	0.34%
25	601818	光大银行	211,184	561,749.44	0.33%
26	600837	海通证券	46,085	521,682.20	0.31%
27	601169	北京银行	68,777	516,515.27	0.31%
28	601857	中国石油	62,084	478,667.64	0.28%
29	600015	华夏银行	55,735	477,648.95	0.28%
30	600048	保利地产	48,034	396,280.50	0.24%
31	000001	平安银行	30,431	372,779.75	0.22%
32	600011	华能国际	72,970	369,228.20	0.22%
33	600900	长江电力	57,735	364,885.20	0.22%
34	600383	金地集团	53,913	360,138.84	0.21%
35	000157	中联重科	65,184	355,252.80	0.21%
36	600519	贵州茅台	2,565	329,294.70	0.20%
37	600795	国电电力	137,961	324,208.35	0.19%
38	601988	中国银行	115,247	301,947.14	0.18%
39	600690	青岛海尔	15,402	300,339.00	0.18%
40	000858	五粮液	17,834	279,280.44	0.17%
41	600585	海螺水泥	16,210	274,921.60	0.16%
42	000063	中兴通讯	19,873	259,740.11	0.15%
43	601899	紫金矿业	105,991	244,839.21	0.15%
44	601299	中国北车	43,971	216,337.32	0.13%
45	000776	广发证券	17,293	215,816.64	0.13%
46	601009	南京银行	26,293	212,710.37	0.13%
47	000402	金融街	40,439	211,495.97	0.13%
48	600362	江西铜业	14,479	205,312.22	0.12%
49	601989	中国重工	33,728	189,214.08	0.11%
50	000568	泸州老窖	8,633	173,868.62	0.10%
51	000562	宏源证券	20,891	171,724.02	0.10%
52	600348	阳泉煤业	23,690	167,251.40	0.10%
53	600887	伊利股份	4,185	163,549.80	0.10%
54	601998	中信银行	40,789	157,853.43	0.09%
55	600309	万华化学	6,975	144,382.50	0.09%
56	002142	宁波银行	15,471	142,797.33	0.08%
57	601117	中国化学	15,916	127,328.00	0.07%
58	600547	山东黄金	6,879	118,662.75	0.07%
59	600066	宇通客车	6,735	118,266.60	0.07%
60	600489	中金黄金	13,737	117,451.35	0.07%
61	000895	双汇发展	2,250	105,930.00	0.06%

62	002304	洋河股份	2,257	92,130.74	0.05%
63	000792	盐湖股份	5,156	86,259.88	0.05%
64	600518	康美药业	4,430	79,740.00	0.04%
65	600111	包钢稀土	3,454	76,920.58	0.05%
66	000538	云南白药	620	63,233.80	0.04%
67	600208	新湖中宝	19,470	62,304.00	0.04%
68	600406	国电南瑞	3,020	44,907.40	0.03%
69	600315	上海家化	1,036	43,750.28	0.03%
70	600276	恒瑞医药	1,131	42,955.38	0.03%
71	601633	长城汽车	1,043	42,940.31	0.03%
72	002081	金螳螂	1,741	38,267.18	0.02%
73	600340	华夏幸福	1,435	29,030.05	0.02%
74	000046	泛海建设	6,106	27,415.94	0.02%
75	002236	大华股份	416	17,006.08	0.01%
76	002353	杰瑞股份	213	16,905.81	0.01%

3、期末债券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值%
1	139907	13 贴现国债 07	100,000	9,909,000.00	5.88%
2	019302	13 国债 02	52,000	5,201,560.00	3.08%

4、期末基金投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值%
1	150018	银华稳进	4,999,957	4,754,959.11	2.82%

5、期末权证投资明细

本集合计划报告期末未持有权证。

6、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

七、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	339,461,238.93
报告期内总参与份额	231,984.17
红利再投资份额	0
报告期内总退出份额	54,785,084.99
报告期末份额总额	284,908,138.11

八、重要事项提示

1、本集合计划管理人及托管人相关事项

1) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2) 本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

3) 中国银河证券股份有限公司2013年1月16日发布《关于明确公司领导人员工作分工的通知》（银河证券[2013]33号），根据2013年1月5日公司执行委员会会议关于经营管理层成员分工调整的有关决定，由尹岩武分管资产管理总部。

4) 从2013年4月22日起，宫德先生不再担任本产品投资主办人，投资主办人由赵胜利先生担任。

5) 中国银河证券股份有限公司H股于2013年5月22日成功上市发行，已完成《企业法人营业执照》的变更工作，变更后公司类型为“股份有限公司（上市）”，注册资本及实收资本为“人民币柒拾伍亿叁仟柒佰贰拾伍万捌仟柒佰伍拾柒元整”。

以上事项，管理人已按照相关规定进行了公告。

2、本集合计划相关事项

除上述重大事项外，报告期间，本集合计划未出现其他可能对本集合计划的持续运作产生重大影响的情形。

九、备查文件目录

1、本集合计划备查文件目录

- 1) 中国证监会《关于核准银河证券股份有限公司设立银河金星 1 号集合资产管理计划的批复》
- 2) 《银河金星 1 号集合资产管理计划说明书》
- 3) 《银河金星 1 号集合资产管理计划合同》
- 4) 《银河金星 1 号集合资产管理计划成立的公告》
- 5) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 6) 《关于银河金星 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》
- 7) 《银河金星 1 号集合资产管理计划开放公告》
- 8) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2009 年第二季度公告》
- 9) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2009 年第三季度公告》
- 10) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 11) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2009 年第四季度公告》
- 12) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 13) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2009 年年度报告》
- 14) 《银河“金星 1 号”集合资产管理计划分红公告》
- 15) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 16) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2010 年第一季度报告》
- 17) 《关于银河金星 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》
- 18) 《“金星 1 号”集合资产管理计划获配农业银行首发 A 股的公告》
- 19) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2010 年第二季度报告》
- 20) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2010 年第三季度报告》
- 21) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2010 年第四季度报告》
- 22) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2010 年年度报告》
- 23) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2011 年第一季度报告》
- 24) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2011 年第二季度报告》

- 25) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2011 年第三季度报告》
- 26) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2011 年第四季度报告》
- 27) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 28) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2011 年年度报告》
- 29) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2012 年第一季度报告》
- 30) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2012 年第二季度报告》
- 31) 《关于银河金星 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》
- 32) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 33) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2012 年第三季度报告》
- 34) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2012 年第四季度报告》
- 35) 《银河金星 1 号集合资产管理计划重大事项公告》
- 36) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2012 年年度报告》
- 37) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2013 年第一季度报告》
- 38) 《关于银河金星 1 号集合资产管理计划投资主办人变更的公告》
- 39) 《银河金星 1 号集合资产管理计划 2013 年第二季度报告》
- 40) 《关于银河证券股份有限公司管理的集合资产管理计划重大事项公告》
- 41) 《银河金星 1 号集合资产管理计划季度报告（2013 年第三季度）》
- 42) 《银河金星 1 号集合资产管理计划季度报告（2013 年第四季度）》

2、查阅方式

网址：<http://www.chinastock.com.cn>

热线电话：4008-888-888

中国银河证券股份有限公司

二〇一四年二月二十八日