

(上接 B46 版)

## 2、报告期内银河稳健基金累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
600036	G 招 行	56,707,635.88	12.80%
600028	中国石化	56,484,841.80	12.85%
000063	G 中 兴	52,951,812.20	12.24%
000097	G 新大陆	40,216,026.42	9.21%
000060	G 中 金	39,131,026.91	9.06%
600456	G 宝 钛	32,074,477.06	7.41%
600320	G 振 华	28,536,300.44	6.61%
600172	G 炭 凤	26,337,180.96	6.10%
600592	G 龙 溪	25,983,480.48	6.02%
600566	G 新 安	25,399,520.80	5.87%
000061	G 格 力	24,536,072.13	5.68%
000528	G 柳 工	24,250,301.10	5.62%
000089	G 华侨城	23,371,134.06	5.41%
000792	G 胖 肥	21,936,560.19	5.08%
600331	G 宏 达	21,469,109.62	4.97%
600438	G 通 威	19,858,327.98	4.60%
600497	G 德 宏	18,593,662.05	4.30%
600415	小商品城	18,534,193.70	4.29%
600567	G 康 隆	16,560,149.55	3.83%
600309	G 万 华	16,157,065.00	3.74%
600183	G 生 益	15,797,123.60	3.66%
600016	G 民 生	13,012,165.46	3.01%
000237	久联发展	12,807,867.60	2.97%
600271	G 航 信	12,718,338.00	2.96%
600439	G 瑞凯卡	12,637,697.84	2.93%
600211	西藏药业	12,516,474.26	2.89%
600761	G 合 力	11,802,185.90	2.76%
600799	G 火 箭	11,467,494.19	2.69%
600151	G 航 天	10,790,899.29	2.50%
600405	G 动力源	10,382,329.05	2.40%
000538	G 云铝股	8,773,136.82	2.03%

## 3、报告期内银河收益基金累计买入前二十名股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初基金资产净值比例
600036	G 招 行	5,894,009.50	55.1%
600219	G 南 山	2,934,568.37	2.84%
600028	中国石化	2,114,820.92	2.05%
000560	G 江 铃	1,773,139.51	1.72%
000060	G 中 金	1,716,081.02	1.66%
000528	G 柳 工	1,653,699.11	1.60%
600196	G 复 星	1,531,989.41	1.48%
600016	G 食 品	1,506,184.71	1.46%
600085	G 同仁堂	1,396,853.10	1.34%
600489	G 中黄金	1,321,146.44	1.28%
600660	G 福 耀	1,281,192.46	1.24%
000024	G 招商局	1,261,382.66	1.22%
000089	G 华侨城	1,153,722.89	1.12%
000729	G 燕 啤	1,106,864.68	1.07%
600761	G 合 力	1,056,882.90	1.02%
600351	G 亚 宝	1,044,354.67	1.01%
600418	G 江 汽	1,032,641.17	1.00%
600016	G 民 生	962,325.64	0.93%
000061	G 格 力	886,043.00	0.86%
600569	G 安 钢	729,105.04	0.71%

## 4、报告期内银河收益基金累计卖出前二十名股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
600036	G 招 行	6,575,361.23	6.37%
600080	G 长 电	3,965,494.40	3.94%
600219	G 南 山	3,380,388.05	3.28%
000560	G 江 铃	2,763,511.60	2.70%
600028	中国石化	2,025,467.96	1.98%
000729	G 燕 啤	1,694,790.81	1.64%
000569	G 老 窖	1,684,942.51	1.63%
000061	G 农产品	1,589,147.79	1.55%
000060	G 中 金	1,581,763.67	1.53%
600888	G 众 和	1,513,564.57	1.47%
600616	G 食 品	1,510,464.96	1.46%
600016	G 民 生	1,422,853.21	1.39%
000528	G 柳 工	1,379,710.96	1.34%
600085	G 同仁堂	1,370,625.58	1.33%
000911	G 南 糖	1,275,470.74	1.24%
000024	G 招商局	1,228,338.62	1.19%
000094	G 华侨城	1,210,560.75	1.17%
600489	G 中黄金	1,196,218.68	1.16%
600080	G 马 钢	1,127,112.01	1.09%
600007	G 汾 酒	1,119,564.87	1.08%

## 5、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

基金名称	买入股票成本总额	卖出股票收入总额
银河稳健基金	597,140,858.68	936,697,202.74
银河收益基金	54,640,290.42	74,688,522.41

注:买入股票成本总额包括因股权分置改革获得现金对价,银河稳健基金获得现金对价 199,073.47 元,银河收益基金获得现金对价 239,881.97 元。

## 五、报告期末按券种分类的债券投资组合

## 1、银河稳健基金债券投资组合

券种	市值	市值占净值比例
国债	19,106,978.00	11.43%
金融债券	21,021,000.00	12.58%
合计	40,127,978.00	24.01%

## 2、银河收益基金债券投资组合

券种	市值	市值占净值比例
国债	22,812,282.00	7.56%
金融债券	39,897,400.00	12.21%
央行票据	198,328,575.48	61.69%
可转债	2,227,200.00	0.77%
合计	261,273,457.48	82.22%

## 六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

## 1、银河稳健基金前五名债券明细

债券名称	市值	市值占净值比例
04国开 16	10,517,400.00	6.29%
05进出 01	10,503,600.00	6.29%
20国债 01	4,016,400.00	2.40%
20国债 01	3,000,000.00	1.80%
02国债 01	2,457,750.00	1.47%

## 2、银河收益基金前五名债券明细

债券名称	市值	市值占净值比例
06央行票据 04	68,456,728.22	22.66%
06农发 17	39,897,400.00	13.21%
06央行票据 15	39,592,906.15	13.11%
06央行票据 122	39,146,833.42	12.96%
06央行票据 01	39,131,107.69	12.95%

## 七、投资组合报告附注

- 一)报告期内银河稳健基金及银河收益基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查的情形,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚的情形。
- 二)报告期内银河稳健基金及银河收益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。
- 三)其他资产主要包括应收证券清算款、应收利息、应收申购款、买入返售证券、待摊费用及其他应收款等,具体金额列示如下(单位:元):

股票简称:G 厦工	股票代码:600815	公告编号:临 2006-024
<b>厦门工程机械股份有限公司</b>		
<b>二〇〇六年第一次临时股东大会决议公告</b>		
特别提示:本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。		
一、会议召开和出席情况		
厦门工程机械股份有限公司 2006 年第一次临时股东大会于 2006 年 8 月 25 日下午 3:00 在厦禾路 668 号公司会议室召开,出席会议的股东及股东代表共 4 名,持有及代表拥有股份 349713766 股,占公司总股本 539296568 股的 64.85%。本次临时股东大会的召开符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。大会由董事长王昆东先生主持,公司全体董事、监事及高级管理人员出席了会议。		
二、提案审议情况		
(一)审议并通过《董事会换届及选举新一届董事会董事的议案》。以记名累积投票方式逐个表决,选举陈玲女士、王昆东、李建勇和黄泽森先生为公司第五届董事会董事,选举陈培塿、赖增荣和刘陆山先生为公司第五届董事会独立董事。		
(二)审议并通过《监事会换届及选举新一届监事会监事的议案》。选举林文俊、郭晓东先生、苏东晖女士为公司第五届监事会监事。上述监事和经公司七届四次职工代表大会选举的职工监事林伟达、许金星先生组成公司第五届监事会。		
具体表决结果如下:		
股东大会表决情况统计表		
议案(一)《董事会换届及选举新一届董事会董事的议案》		
	票数(股)	
陈 玲	349713766	
王昆东	349713766	
李建勇	349713766	
黄泽森	349713766	
陈培塿	349713766	

股票简称:G 厦工	股票代码:600815	公告编号:临 2006-025
<b>厦门工程机械股份有限公司</b>		
<b>董事会五届一次会议决议公告</b>		
特别提示:本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。		
厦门工程机械股份有限公司董事会五届一次会议于 2006 年 8 月 25 日在厦禾路 668 号公司会议室召开,会议应到董事 7 人,出席会议的董事 7 人,公司监事会成员列席会议,符合公司法及公司章程的有关规定。经过认真讨论,会议审议并通过了如下决议:		
一、选举陈玲女士为第五届董事会董事长(相关简历详见于 2006 年 8 月 10 日《中国证券报》、《上海证券报》刊登的厦门工程机械股份有限公司四届十三次董事会决议公告)。		

## 关于博时精选股票证券投资基金投资非公开发行股票的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》要求,我公司公告如下:  
我司管理的博时精选股票证券投资基金参加了 G 国安(000839)非公开发行股票,认购其股份 300 万股,锁定期为本次发行完成后 12 个月。博时精选股票证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 3600 万元,8 月 25 日账面价值为 5016 万元,分别占基金资产净值的 1.28%和 1.79%。  
特此公告。

博时基金管理有限公司  
2006 年 8 月 25 日

## 关于裕隆证券投资基金投资非公开发行股票的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》要求,我公司公告如下:  
我司管理的裕隆证券投资基金参加了 G 国安(000839)非公开发行股票,认购其股份 500 万股,锁定期为本次发行完成后 12 个月。裕隆证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 6000 万元,8 月 25 日账面价值为 8455 万元,分别占基金资产净值的 1.50%和 2.11%。  
裕隆证券投资基金还参加了 G 桐顺(600533)非公开发行股票,认购其股份 300 万股,锁定期为本次发行完成后 12 个月。裕隆证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 3126 万元,8 月 25 日账面价值为 3792 万元,分别占基金资产净值的 0.78%和 0.95%。  
特此公告。

博时基金管理有限公司  
2006 年 8 月 25 日

其他资产项目	银河稳健基金	银河收益基金
交易保证金	910,000.00	660,000.00
应收证券清算款	3,704,203.60	0.00
应收利息	671,603.43	2,318,296.30
应收申购款	3,660,920.63	10,164,701.30
合 计	8,946,727.56	13,142,987.60

(四)报告期末银河稳健基金未持有可转换债券,银河收益基金持有处于转股期的可转换债券明细列示如下:

可转债代码	可转债名称	期末市值	市值占基金资产净值比例
100795	国电转债	1,237,900.00	0.41%
125960	首钢转债	1,099,300.00	0.36%
合计		2,337,200.00	0.77%

## (五)报告期内银河稳健基金因股权分置改革被动持有的权证证明

权证代码	权证名称	数量(份)
580997	招行 CMP1	2,826,962
038003	华夏 JTP1	72
580094	丽东 CTP1	50
580005	万华 HXB1	18,000
580003	万华 HXP1	27,000
600007	长电 CWB1	15
580090	茅台 JCP1	85,760
038008	钢铁 JTP1	40,000
合计		2,996,169

## 报告期内银河稳健基金主动持有的权证证明

权证代码	权证名称	数量(份)	买入成本
000002	五粮 YQC1	60,000	331,833.18

## (六)报告期内银河收益基金因股权分置改革被动持有的权证证明

权证代码	权证名称	数量(份)
580997	招行 CMP1	468,616
580003	邯郸 JTB1	141,124
580094	丽东 CTP1	70,000
合计		679,740

## 报告期内本基金未主动投资权证。

## 第八节 基金份额持有人户数、持有人结构

报告期末银河稳健基金及银河收益基金持有人情况如下:

基金名称	持有人户数	基金持有人份额结构		
		户均持有份数	机构投资者持有份额比例(%)	个人投资者持有份额比例(%)
银河稳健基金	2,231	52,068.00	82.190	17.777
银河收益基金	1,573	159,411.46	226,271,020.67	90.24%

## 第九节 开放式基金份额变动

报告期内银河稳健基金及银河收益基金份额的变动情况如下表:

基金名称	银河稳健基金	银河收益基金
基金合同生效日基金份额总额	1,196,051,618.30	1,802,248,568.23
期初基金份额	465,856,469.17	99,443,110.89
期间总申购份额	38,564,742.86	242,011,383.91
期间总赎回份额	388,268,468.75	90,700,276.31
期末基金份额	116,142,743.28	250,754,219.49

## 第十节 重大事件揭示

- 一、报告期内未召开基金份额持有人大会。
- 二、报告期内基金管理人根据第七次股东会决议,对公司董事进行了相应变更,增加了李锡奎、王林、褚瑞增及熊人杰为公司董事,李庆毅、李培英、朱洪、谭庆中及谢朝华不再担任公司董事,另外,公司法定代表人由刘彭湃变更为李锡奎。
- 三、报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。
- 四、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。
- 五、报告期内基金投资策略无改变。
- 六、报告期内,银河稳健基金进行一次收益分配,每 10 份基金份额派发红利 0.60 元(暂免征收所得税),根据投资者对分红方式的选择,派发现金红利

共计 8,250,899.58 元,红利转投资共计 3,554,881.70 元,权益登记日为 2006 年 5 月 11 日;银河收益基金进行一次收益分配,每 10 份基金份额派发红利 0.30 元(暂免征收所得税),根据投资者对分红方式的选择,派发现金红利共计 958,828.80 元,红利转投资共计 755,189.73 元,权益登记日为 2006 年 5 月 11 日。

## 七、报告期内本基金未改聘会计师事务所。

八、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。

## 九、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

## 1、基金租用席位数量情况

证券公司名称	银河稳健基金租用席位数量	银河收益基金租用席位数量
申银万国	1	1
银河证券	1	2
国泰君安	2	---
招商证券	1	---
华夏证券	1	---
天同证券	1	---
大通证券	1	---
光大证券	---	1

注:报告期内本系类基金无席位变更情况。

## 2、银河稳健基金席位交易量情况

券商名称	股票成交金额	占股票成交总额比例	债券成交金额	占债券成交总额比例	回购成交金额	占回购成交总额比例	权证成交金额	占权证成交总额比例	实付佣金	占佣金总额比例
银河证券	35,210,411.80	21.5%	60,533,636.30	38.2%	96,000,000.00	47.6%	263,374.08	93.0%	265,100.17	21.7%
国泰君安	43,964,598.8	26.7%	34,352,264.42	21.7%	30,200,000.00	15.5%	1,343,937.79	474%	351,490.22	28.8%
招商证券	418,591,087.74	276%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	902,227.32	318%	327,551.47	26.5%
华夏证券	334,377,546.38	221%	62,836,284.34	39.8%	74,000,000.00	37.5%	323,381.65	114%	272,843.11	22.4%
光大证券	1,512,143,285.5	1000%	157,702,189.6	100%	159,200,000.00	100%	2,822,764.84	1000%	1,216,971.19	100%

## 3、银河收益基金席位交易量情况

券商名称	股票成交金额	占股票成交总额比例	债券成交金额	占债券成交总额比例	回购成交金额	占回购成交总额比例	权证成交金额	占权证成交总额比例	实付佣金	占佣金总额比例
光大证券	34,889,240.10	28.5%	10,322,867.48	9.2%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	28,178.11	26.8%
华夏证券	36,272,439.92	29.7%	60,207,046.93	53.9%	15,500,000.00	54.7%	334,527.61	70.8%	32,100.18	30.3%
招商证券	22,408,523.37	18.5%	22,230,364.25	20.1%	0.00	0.00%	137,277.53	29.0%	19,381.71	18.3%
银河证券	27,976,233.10	23.0%	18,711,262.48	16.7%	12,800,000.00	42.2%	0.00	0.00%	25,988.18	24.5%
合计	121,436,436.49	100%	111,571,540.40	100%	28,200,000.00	100%	471,863.14	100%	106,628.19	100%

十、报告期内,本基金在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登公告如下: