

---

大成中國靈活配置基金  
( 大成投資信託基金的子基金 )

中期報告  
截至二零二四年六月三十日止期間





大成投資信託基金  
截至二零二四年六月三十日止期間

中期報告

目錄

頁碼

基金管理和基金行政	1
基金經理致基金單位持有人報告	2-3
財務狀況報表（未經審計）	4-5
全面收入報表（未經審計）	6
基金單位持有人應占資產淨值變動報表（未經審計）	7-8
大成中國靈活配置基金	9-33
- 投資組合（未經審計）	
- 投資組合變動報表（未經審計）	
- 表現紀錄（未經審計）	
財務報表附注	34

**大成投資信託基金**  
**截至二零二四年六月三十日止期間**

**基金管理和基金行政**

**基金經理董事**

譚曉岡先生  
肖劍先生  
姚余棟先生  
趙冰女士  
吳萍女士(於二零二四年八月十二日離任)  
許自杰先生(於二零二四年八月十二日上任)

**基金經理**

大成國際資產管理有限公司  
香港中環  
康樂廣場1號  
怡和大廈35樓  
3516-3519室

**託管人**

中國銀行(香港)有限公司  
香港中環花園道1號  
中銀大廈14樓

**中國分託管人**

中國銀行股份有限公司  
中國北京(郵遞區號: 100818)  
復興門內大街1號

**受託人及過戶登記處**

中銀國際英國保誠信託有限公司  
香港太古城 英皇道1111號15樓  
1501-1507 & 1513-1516室

**基金經理法律顧問**

西盟斯律師行  
香港英皇道979號  
太古坊一座30樓

**中國投資顧問**

大成基金管理有限公司  
廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號  
大成基金總部大廈 5 層、27-33 層

**核數師**

羅兵咸永道會計師事務所  
香港中環太子大廈22樓

## 基金經理致基金單位持有人報告

### 大成中國靈活配置基金 (大成投資信託基金的子基金)

## 基金表現

大成中國靈活配置基金旨在尋求資本及收入長遠增長。截至二零二四年六月三十日，累計總資產規模為人民幣4,782,965,314元。

## 市場回顧

2024年上半年A股跌宕起伏。上半年上證指數(-0.25%)小幅收跌，滬深300(0.89%)小幅收漲。從影響因素來看，政策預期和微觀流動性是影響上半年A股走勢的重要因素，年初至2月初，權益市場微觀流動性承壓，滬深300指數震盪回落，2月初至5月中旬，政策引導中長期資金加速流入，微觀流動性改善，疊加地產政策持續優化，市場政策預期升溫，推動滬深300指數震盪上行，5月下旬至年中，逐步進入政策效果觀察期，市場情緒回落，滬深300指數震盪調整。從風格來看，出口超預期、資源品漲價以及政策預期分別推動A股“出海”、上游資源品以及“科特估”方向出現階段性的強勢表現，但拉長時間維度，上半年紅利板塊仍占優，大盤優於中小盤。行業層面，上半年銀行、煤炭漲幅靠前，電腦、商貿零售跌幅靠前。

基本面方面，上半年經濟穩中有進，物價溫和改善，企業盈利波折修復，流動性邊際改善。一季度，製造業PMI震盪回升，出口超預期，製造業投資保持高增，CPI同比轉正，經濟復蘇進程加快，二季度出口延續增長，PPI同比降幅收窄，消費修復弱於預期，房地產市場逐步探底，經濟保持平穩運行。整體來看，上半年經濟延續回升向好態勢，積極因素累積增多。企業盈利方面，工業企業利潤增速邊際回落，整體保持正增，上市公司盈利再度探底，或反映當前A股處於新一輪盈利復蘇週期起點。流動性方面，宏觀流動性穩中偏松，因為政策積極發力，救市資金流入，加上收緊融券業務和大股東減持，微觀流動性改善。

## 基金經理致基金單位持有人報告

### 大成中國靈活配置基金

(大成投資信託基金的子基金)

## 展望

下半年國內經濟修復動能有望增強，政策或將加力提效，企業盈利有望開啟新一輪上行週期，A股或將重拾升勢，市場風格或仍偏大盤，關注週期和科技板塊。政策方面，二十屆三中全會或將擘畫進一步全面深化改革的宏偉藍圖，新一輪財稅體制改革、資本市場改革、發展新質生產力等政策動向值得期待，隨著改革進一步深化，有望為經濟增長提供新動能。新一輪財稅體制改革或將進一步完善中央與地方財政事權和支出責任劃分，減輕地方的支出責任和財政壓力，加強地方財力並提升地方積極性，財稅體制改革持續深化將進一步完善現代財政制度框架，為促進經濟高品質發展、推進國家治理體系和治理能力現代化提供有力支撐。此外，資本市場“1+N”政策體系正加速成型，未來將更加注重投融資動態平衡，資本市場生態有望迎來質變，A股長期投資價值凸顯。經濟方面，下半年出口有望保持韌性，政府債券加速發行或將支撐投資保持高增，居民消費需求有望持續恢復，此外，政策有望助力新舊動能加速轉換，物價或將延續溫和改善趨勢，逐步彌合宏觀資料與微觀感受的“溫差”，整體來看，下半年經濟或將延續回升向好趨勢。企業盈利方面，物價溫和回升或將助力企業盈利小幅改善，外需保持韌性有望為企業盈利改善提供額外動力，A股或將開啟新一輪盈利復蘇週期。海外流動性方面，上半年加拿大央行、歐洲央行等相繼宣佈降息，隨著美國就業市場降溫、通脹放緩，美聯儲有望在下半年開啟降息，全球新一輪貨幣寬鬆週期或將逐步開啟。展望下半年，國內經濟有望開啟週期性復蘇，各項改革政策落地或將改善市場預期，全球貨幣寬鬆有望推動資金再度流入新興市場，市場風險偏好或將持續提升，A股有望拾級而上。市場風格方面，經濟有望週期性復蘇的背景下，龍頭企業業績或相對占優，預計市場風格或仍偏大盤。全球經濟有望逐步復蘇的背景下，上游資源品價格上漲或具有較強的持續性，疊加國內地產政策持續優化，上游週期板塊景氣度或將持續上行，預計週期板塊或將有較好的表現。此外，海內外AI產業化加速落地，國內發展新質生產力的政策體系不斷完善，政策支持與產業週期雙輪驅動下，科技板塊或將迎來較好的配置機會。因此，關於配置方向，下半年關注週期和科技板塊。

大成國際資產管理有限公司

二零二四年八月二十九日

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

財務狀況報表 (未經審計)  
截至二零二四年六月三十日

	二零二四年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零二三年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
<b>資產</b>		
<b>非流動資產</b>		
存款準備金	3,542,621	3,219,760
<b>流動資產</b>		
投資	4,715,529,684	4,764,558,866
應收利息	13,133,528	21,261,046
應收股息	6,454,630	94
應收申購款	9,771,187	3,819,019
應收出售投資款	99,653,929	61,877,695
現金及現金等價物	62,718,290	380,965,764
	4,907,261,248	5,232,482,484
<b>總資產</b>	4,910,803,869	5,235,702,244
<b>負債</b>		
<b>非流動負債</b>		
遞延所得稅負債	-	-
<b>流動負債</b>		
應付管理費用	5,020,631	5,681,932
應付受託人費用	435,781	492,485
應付購買投資款	94,290,345	230,256,637
應付贖回款	26,216,296	13,286,170
預提費用及其他應付款	1,306,873	2,010,365
預提稅款準備金	568,629	139,990
<b>總負債</b>	127,838,555	251,867,579
<b>基金單位持有人應占資產淨值</b>	4,782,965,314	4,983,834,665

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

財務狀況報表(未經審計)(續)  
截至二零二四年六月三十日

	二零二四年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零二三年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
<b>已發行單位</b>		
- 人民幣 A 類單位	153,740,168	155,189,061
- 人民幣 P 類(累算)單位	280	41
- 美元 A 類單位	16,456,793	17,676,543
- 美元 P 類(累算)單位	211,094	152,165
- 港元 A 類單位	230,681,117	235,510,784
- 港元 P 類(累算)單位	3,015,600	3,160,138
- 新加坡元 A 類單位	10	N/A
- 新加坡元 P 類(派息)單位	10	N/A
- 新加坡元 P 類(累算)單位	10	N/A
<b>每單位資產淨值</b>		
- 人民幣 A 類單位	11.24	11.37
- 人民幣 P 類(累算)單位	10.21	9.84
- 美元 A 類單位	8.90	9.27
- 美元 P 類(累算)單位	11.42	11.28
- 港元 A 類單位	8.99	9.36
- 港元 P 類(累算)單位	11.22	11.08
- 新加坡元 A 類單位	10.04	N/A
- 新加坡元 P 類(派息)單位	10.04	N/A
- 新加坡元 P 類(累算)單位	10.09	N/A

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

全面收入報表 (未經審計)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

		自二零二四年一月一日至 二零二四年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零二三年一月一日至 二零二三年十二月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
	注		
<b>收益</b>			
股息收入		51,376,064	75,504,663
銀行存款產生的利息收入		198,683	370,864
投資產生的利息收入		19,447,623	48,314,834
投資淨損失		140,972,923	(549,658,074)
匯兌(損失)/利得淨額		(150,386)	(981,552)
其他收入		2,561	5,801
<b>總投資收益</b>		<b>211,847,468</b>	<b>(426,443,464)</b>
<b>開支</b>			
管理費用		31,801,293	70,675,233
受託人費用		2,762,045	6,105,150
託管費		1,648,467	3,454,088
交易手續費	1	170,150	312,175
交易成本		7,422,955	15,914,929
核數師酬金		170,852	279,127
法律及專業服務費用		61,208	41,981
其他費用	2	15,523	52,794
<b>總經營支出</b>		<b>44,052,493</b>	<b>96,835,477</b>
<b>利潤分派前及稅前收益/(損失)</b>		<b>167,794,975</b>	<b>(523,278,941)</b>
對基金單位持有人的分派		(240,527,337)	(465,097,466)
<b>利潤分派後及稅前收益/(損失)</b>		<b>(72,732,362)</b>	<b>(988,376,407)</b>
稅項		(4,814,347)	(7,184,157)
<b>基金單位持有人應占資產淨值之減少</b>		<b>(77,546,709)</b>	<b>(995,560,564)</b>

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

基金單位持有人應占資產淨值變動報表 (未經審計)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	自二零二四年一月一日至 二零二四年六月三十日止期 間 (未經審計) 人民幣	自二零二三年一月一日至 二零二三年十二月三十一日 止期間 (經審計) 人民幣
期初基金單位持有人應占資產淨值	4,983,834,665 -----	3,926,454,874 -----
发行单位	499,502,000	3,127,269,371
赎回单位	(622,824,642) -----	(1,074,329,016) -----
基金單位交易導致的淨增加	(123,322,642) -----	2,052,940,355 -----
基金單位持有人應占資產淨值之增加/(減少)	(77,546,709) -----	(995,560,564) -----
期末基金單位持有人應占資產淨值	4,782,965,314 =====	4,983,834,665 =====

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

基金單位持有人應占資產淨值變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

可贖回單位的變動

	二零二四年								
	人民幣A類	美元A類	港元A類	美元P類 (累算)	港元P類 (累算)	人民幣P類 (累算)	新加坡元 A類	新加坡元 P類(派息)	新加坡元 P類(累算)
年初已發行單位數目	155,189,062	17,676,541	235,510,784	152,166	3,160,137	41	-	-	-
已發行單位	16,869,776	1,129,559	23,415,806	95,190	112,259	239	10	10	10
重投資(附注)	777,573	95,956	593,648	-	-	-	-	-	-
已贖回單位	(19,096,243)	(2,445,263)	(28,839,121)	(36,262)	(256,796)	-	-	-	-
年末已發行單位數目	153,740,168	16,456,793	230,681,117	211,094	3,015,600	280	10	10	10

	二零二三年					
	人民幣A類	美元A類	港元A類	美元P類(累算)	港元P類(累算)	人民幣P類(累算)
年初已發行單位數目	87,690,593	13,571,583	159,591,418	194,689	1,936,637	-
已發行單位	89,182,443	8,753,163	118,476,905	22,038	2,188,808	61
重投資(附注)	1,281,539	184,278	1,073,877	-	-	-
已贖回單位	(22,965,514)	(4,832,481)	(43,631,417)	(64,562)	(965,308)	(20)
年末已發行單位數目	155,189,061	17,676,543	235,510,783	152,165	3,160,137	41

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值 百分比
上市/報價投資			
上市股本證券			
中國			
中微公司	119,879	16,934,108	0.35
中國航發動力	300,000	10,965,000	0.23
愛迪特	202	15,594	0.00
安邦護衛	88	2,419	0.00
鴻路鋼構	800,000	13,576,000	0.28
華恒生物	114,000	8,708,460	0.18
容知日新	342,222	8,011,417	0.17
普洛藥業	1,799,986	24,425,810	0.51
鵬鼎控股	210,000	8,349,600	0.17
中航光電	199,888	7,605,738	0.16
中航瀋飛	279,964	11,226,556	0.23
寧波銀行	745,579	16,447,473	0.34
百濟神州	100,000	11,584,000	0.24
中科江南	378,000	10,682,280	0.22
京儀裝備	416	16,261	0.00
金山辦公	133,000	30,257,500	0.63
伯特利	224,000	8,713,600	0.18
京東方 A	15,630,000	63,926,700	1.34
燦芯股份	247	13,215	0.00
比亞迪	140,000	35,035,000	0.73
中科寒武紀科技	45,000	8,940,150	0.19
中瑞股份	306	9,073	0.00
成都華微	1,045	20,189	0.00
中國船舶工業	290,000	11,805,900	0.25
中國巨石	1,500,000	16,575,000	0.35
中國人壽	550,000	17,077,500	0.36
中機認檢	419	15,486	0.00
招商銀行	2,880,000	98,467,200	2.06
招商證券	2,199,990	30,601,861	0.64
招商蛇口	1,500,000	13,185,000	0.28
洛陽鉬業	4,000,000	34,000,000	0.71
中郵科技	303	6,618	0.00
中國神華	300,000	13,311,000	0.28
長江電力	1,599,955	46,270,699	0.97
長安汽車	1,450,000	19,473,500	0.41
川儀股份	440,000	10,344,400	0.22
國際複材	9,723	32,378	0.00
渝農商行	6,160,400	30,925,208	0.65
中集車輛 (集團)	2,199,974	18,919,776	0.40
星德勝	182	4,326	0.00
中信證券	1,972,100	35,951,383	0.75

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值 百分比
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>上市股本證券(續)</b>			
<b>中國(續)</b>			
中國海油	1,535,000	50,655,000	1.06
寧德時代	596,517	107,390,955	2.25
新諾威	500,000	12,615,000	0.26
達利凱普	576	9,775	0.00
廣合科技	222	9,939	0.00
福萊特玻璃集團	200,000	4,020,000	0.08
分眾傳媒	3,800,000	23,028,000	0.48
方正證券	2,400,000	18,552,000	0.39
福耀玻璃	670,000	32,093,000	0.67
康希通信	648	8,346	0.00
格力電器	2,209,863	86,670,827	1.81
匯成真空	219	13,315	0.00
凌霄泵業	1,685,900	32,369,280	0.68
辰奕智能	154	6,094	0.00
廣東塔牌集團	2,599,948	19,005,620	0.40
廣深鐵路	9,000,000	29,160,000	0.61
貴州航太電器股份有限公司	210,000	9,739,800	0.20
福斯特	503,702	7,404,419	0.15
海康威視	1,165,000	36,010,150	0.75
吳華科技	820,000	23,698,000	0.50
老白乾酒	250,000	4,545,000	0.10
雪祺電氣	173	2,682	0.00
雙匯發展	360,000	8,557,200	0.18
同花順	140,000	14,518,000	0.30
宏盛華源	3,918	16,025	0.00
華利集團	250,000	15,212,500	0.32
華勤技術	462,000	25,516,260	0.53
菲利華	440,000	13,530,000	0.28
工商銀行	2,299,861	13,109,208	0.27
興業銀行	3,120,000	54,974,400	1.15
內蒙華電	9,499,950	44,079,768	0.92
伊利股份	1,300,000	33,592,000	0.70
遠興能源	3,299,942	22,802,599	0.48
艾森股份	274	11,108	0.00
長海股份	1,909,979	19,348,087	0.40
恒立液壓	435,500	20,285,590	0.42
恒瑞醫藥	499,998	19,229,923	0.40
華陽智能	138	5,405	0.00

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值百 分比
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>上市股本證券(續)</b>			
<b>中國(續)</b>			
江蘇龍蟠科技	1,299,920	10,126,377	0.21
江蘇洋河酒廠	109,920	8,874,941	0.19
魚躍醫療	960,000	36,096,000	0.75
貴州茅臺	66,000	96,847,740	2.02
立訊精密	1,030,000	40,489,300	0.85
麥加芯彩	126	4,184	0.00
南微醫學	214,000	13,173,840	0.28
美的集團	938,050	60,504,224	1.26
肯特股份	219	8,918	0.00
北方華創科技集團	59,975	19,185,403	0.40
新華保險	500,000	15,015,000	0.31
美新科技	257	5,980	0.00
東方電纜	110,000	5,369,100	0.11
興瑞科技	1,999,965	46,619,184	0.97
歐萊新材	345	7,090	0.00
平安電工	184	4,098	0.00
中國平安	1,790,000	74,034,400	1.55
平煤股份	900,000	10,080,000	0.21
百洋醫藥	639,917	15,057,247	0.31
海泰新光	323,215	12,679,724	0.27
青海鹽湖工業	580,000	10,121,000	0.21
北自科技	107	3,236	0.00
賽輪輪胎	2,071,500	29,001,000	0.61
三一重工	1,399,901	23,098,367	0.48
陝西煤業	900,000	23,193,000	0.48
中創股份	186	6,372	0.00
豪邁科技	490,000	18,703,300	0.39
鍵邦股份	1,287	24,003	0.00
騰達科技	213	2,927	0.00
安乃達	1,051	21,609	0.00
寶信軟體	960,000	30,652,800	0.64
錦江航運	1,263	12,074	0.00
龍旗科技	298	11,616	0.00
滬農商行	4,900,000	32,928,000	0.69
山煤國際	1,000,000	14,620,000	0.31
山西汾酒	130,000	27,414,400	0.57
興欣新材	122	2,503	0.00
安培龍	214	8,849	0.00
深圳市匯川技術	459,944	23,595,127	0.49

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值百 分比
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>上市股本證券(續)</b>			
<b>中國(續)</b>			
駿鼎達	150	15,342	0.00
邁瑞醫療	99,000	28,800,090	0.60
路維光電	260,000	6,812,000	0.14
聯域股份	99	3,550	0.00
中遠通	604	11,253	0.00
川投能源	1,030,000	19,312,500	0.40
四川路橋	1,300,000	10,257,000	0.21
星辰科技	481	16,859	0.00
中倫新材	711	17,896	0.00
中材國際	2,820,000	34,009,200	0.71
中礦資源集團	549,816	14,735,069	0.31
索寶蛋白	161	2,743	0.00
陽光電源	252,000	15,631,560	0.33
偉創電氣	540,000	14,563,800	0.30
西典新能	130	3,341	0.00
七一二	580,000	10,550,200	0.22
匯成股份	2,430,237	20,608,410	0.43
紫光股份	720,000	16,092,000	0.34
上海合晶	8,659	142,441	0.00
萬華化學	484,928	39,211,278	0.82
天罡股份	200,000	2,792,000	0.06
溫氏股份	1,189,943	23,584,670	0.49
達夢數據	175	39,267	0.00
五糧液	328,000	41,997,120	0.88
特寶生物	567,434	30,386,091	0.64
思泰克	246	7,828	0.00
諾瓦星雲	1,243	241,764	0.01
中熔電氣	170,000	13,974,000	0.29
永達股份	189	2,623	0.00
永臻股份	383	10,724	0.00
圓通速遞	870,000	13,615,500	0.28
雲南白藥集團	294,880	15,083,112	0.32
錫業股份	950,000	14,715,500	0.31
正泰電器	950,000	18,107,000	0.38
鼎龍科技	195	3,305	0.00
豐茂股份	208	8,260	0.00
宏鑫科技	361	9,509	0.00
潔美科技	850,000	17,068,000	0.36
浙江龍盛	2,600,000	22,334,000	0.47

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市场价格 人民币	占资产净值 百分比
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>上市股本證券(續)</b>			
<b>中國(續)</b>			
偉星新材	900,000	13,878,000	0.29
夏廈精密	64	3,455	0.00
浙江浙能電力	2,000,000	14,220,000	0.30
浙商證券	1,350,000	14,472,000	0.30
紫金礦業	5,319,965	93,471,784	1.95
		<hr/>	
		2,772,653,630	
<b>香港</b>			
中國銀行	7,000,000	25,168,605	0.53
中國建設銀行	5,000,000	26,943,015	0.56
中國大唐集團新能源	6,700,000	12,639,403	0.26
中國銀河証券	8,480,000	32,390,640	0.68
龍源電力集團	1,900,000	12,456,358	0.26
中國移動	533,000	38,328,189	0.80
中國太平洋保險 (集團)	1,230,000	21,894,165	0.46
華潤啤酒 (控股)	340,000	8,335,058	0.17
華潤電力控股	2,680,000	59,943,303	1.25
中國神華能源	510,000	17,122,590	0.36
中國電信	2,984,000	12,902,688	0.27
中國聯合網絡通信 (香港)	2,500,000	16,740,158	0.35
重慶農村商業銀行	6,640,000	23,750,198	0.50
長江和記實業	710,000	24,798,781	0.52
中遠海運能源運輸	1,100,000	10,416,721	0.22
中遠海運控股	2,100,000	26,789,855	0.56
協鑫科技控股	10,000,000	10,833,240	0.23
華泰證券	1,100,000	8,865,513	0.19
中國工商銀行	6,560,000	28,426,422	0.59
信達生物製藥	260,000	8,935,555	0.19
新華人壽保險	165,000	22,959,932	0.48
中國石油天然氣	380,000	28,035,678	0.59
中芯國際集成電路製造	859,500	13,742,002	0.29
廈門燕之屋生物工程	1,140,400	9,510,625	0.20
金風科技	4,000,000	11,879,208	0.25
信義光能控股	4,096,000	15,033,250	0.31
招金礦業	2,153,500	26,346,113	0.55
中聯重科	1,100,000	5,187,815	0.11
中興通訊	1,750,000	28,241,136	0.59
中通快遞 (開曼)	79,950	12,260,043	0.26
		<hr/>	
		600,876,259	

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合 (未經審計) (續)  
 截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值 百分比
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>上市債務證券</b>			
<b>中國</b>			
中國農業發展銀行 3.37% A 26-02-2026 CDC	50,000,000	51,249,000	1.07
北陸轉債	100,991	10,098,494	0.21
強力轉債	84,970	9,208,428	0.19
中國國家開發銀行 2.59% A 11-01-2026 CDC	150,000,000	151,809,450	3.17
中國國家開發銀行 C-0.85% Q 16-01-2026 CDC	50,000,000	50,490,900	1.06
24 國債 09	1,090,000	109,049,158	2.28
23 招證 C6	300,000	30,614,400	0.64
22 安信 05	200,000	20,159,180	0.42
21 華集 01	299,010	29,921,871	0.63
22 廣發 C1	200,000	20,178,600	0.42
22 華創 C1	320,000	32,447,648	0.68
瀛通轉債	69,300	7,436,916	0.16
家悅轉債	185,530	19,681,134	0.41
靈康轉債	188,590	18,821,471	0.39
美諾轉債	43,500	4,556,007	0.10
龍大轉債	285,320	26,074,682	0.55
雪榕轉債	40,690	3,522,362	0.07
23 深投控 MTN002	100,000	10,137,330	0.21
23 深投 05	100,000	10,183,580	0.21
科達轉債	275,280	26,348,233	0.55
天風證券股份有限公司 6.5% S/A 05-03-2026	7,000,000	50,095,268	1.05
天創轉債	269,850	24,441,475	0.51
塞力轉債	283,300	24,224,360	0.51
22 廈貿 K1	100,000	10,132,950	0.21
22 義市 01	300,000	30,195,390	0.63
遊族轉債	52,550	5,734,471	0.12
震安轉債	20,977	2,200,351	0.05
		789,013,109	
<b>香港</b>			
交銀租賃管理香港有限公司 S+0.68% Q 26-06-2027	4,000,000	29,154,399	0.61
香港政府綠色債券計劃 5.25% S/A 11-01-2053	9,000,000	68,019,104	1.42
		97,173,503	

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)  
截至二零二四年六月三十日

	持股量	市場價格 人民幣	佔資產淨值百 分比
上市/報價投資(續)			
集體投資計劃			
中國			
華寶添益	325	32,503	0.00
		<u>32,503</u>	
上市/報價投資的總額		4,259,749,004	89.03
非上市/報價債務證券			
澳大利亞			
中國工商銀行/悉尼 3.45% A 18-07-2024 FXCD	100,000,000	100,038,000	2.09
		<u>100,038,000</u>	
中國			
交通銀行(香港)有限公司 0% A 24-07-2024	50,000,000	49,925,500	1.04
22 碧桂園 MTN002	500,000	50,925,250	1.06
中國進出口銀行 2.06% A 18-03-2026 CDC	50,000,000	50,174,300	1.05
中國工商銀行/首爾 0% 19-07-2024 CD	100,000,000	99,890,000	2.09
中國工商銀行/悉尼 0% 10-07-2024 CD	74,000,000	73,967,440	1.55
23 今世緣 MTN001	300,000	30,860,190	0.65
		<u>355,742,680</u>	
非上市/報價債務證券的總額		455,780,680	9.53
總投資		4,715,529,684	98.56
其他淨資產		<u>67,435,630</u>	1.44
於二零二四年十二月三十一日的淨資產總額		<u>4,782,965,314</u>	100.00
以成本計量的總投資		<u><u>4,675,358,761</u></u>	

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資					
股票					
中國					
光迅科技	-	390,000	-	(390,000)	-
中微公司	-	119,879	-	-	119,879
中國航發動力	-	300,000	-	-	300,000
愛迪特	-	2,018	-	(1,816)	202
中國國航	-	800,000	-	(800,000)	-
安邦護衛	88	-	-	-	88
安琪酵母	450,000	-	-	(450,000)	-
海螺水泥	1,340,000	-	-	(1,340,000)	-
鴻路鋼構	-	800,000	-	-	800,000
華恒生物	262,619	-	-	(148,619)	114,000
九華旅遊	-	480,000	-	(480,000)	-
容知日新	140,000	322,222	-	(120,000)	342,222
芯動聯科	648	-	-	(648)	-
普洛藥業	-	1,799,986	-	-	1,799,986
鵬鼎控股	680,000	400,000	-	(870,000)	210,000
中航光電	1,159,888	-	-	(960,000)	199,888
中航瀋飛	-	279,964	-	-	279,964
北汽藍谷	-	3,399,979	-	(3,399,979)	-
江蘇銀行	3,699,957	-	-	(3,699,957)	-
寧波銀行	-	745,579	-	-	745,579
蘇州銀行	3,799,950	-	-	(3,799,950)	-
寶鋼股份	5,499,837	-	-	(5,499,837)	-
百濟神州	-	100,000	-	-	100,000
中科江南	409,822	-	248,000	(279,822)	378,000
京儀裝備	416	-	-	-	416
金山辦公	83,000	50,000	-	-	133,000
伯特利	-	160,000	64,000	-	224,000
京東方A	13,200,000	2,430,000	-	-	15,630,000
燦芯股份	-	2,461	-	(2,214)	247
比亞迪	-	140,000	-	-	140,000
財通證券	2,800,000	-	-	(2,800,000)	-
中科寒武紀科技	-	45,000	-	-	45,000

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				
	二零二四年 一月一日	增加	紅利/股利	減少	二零二四年六月 三十日
上市/報價投資（續）					
股票（續）					
中國（續）					
洽洽食品	1,269,956	-	-	(1,269,956)	-
中瑞股份	-	3,056	-	(2,750)	306
三環集團	799,993	-	-	(799,993)	-
成都華微	-	10,448	-	(9,403)	1,045
中信銀行	-	3,900,000	-	(3,900,000)	-
建設銀行	7,699,984	3,099,890	-	(10,799,874)	-
中國船舶工業	-	450,000	-	(160,000)	290,000
中國巨石	-	1,500,000	-	-	1,500,000
中國人壽	1,779,910	-	-	(1,229,910)	550,000
中機認檢	419	-	-	-	419
招商銀行	2,180,000	700,000	-	-	2,880,000
招商證券	1,800,000	799,990	-	(400,000)	2,199,990
招商蛇口	-	2,100,000	-	(600,000)	1,500,000
洛陽鉬業	8,999,943	-	-	(4,999,943)	4,000,000
中國太保	600,000	-	-	(600,000)	-
中郵科技	303	-	-	-	303
中國鐵建	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
中國神華	-	300,000	-	-	300,000
中國船舶重工	-	2,200,000	-	(2,200,000)	-
萬科 A	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
長江電力	-	1,599,955	-	-	1,599,955
浙商銀行	9,800,000	-	-	(9,800,000)	-
長安汽車	-	2,450,000	-	(1,000,000)	1,450,000
川儀股份	400,000	640,000	-	(600,000)	440,000
國際複材	9,723	-	-	-	9,723
渝農商行	-	6,160,400	-	-	6,160,400
中集環科	1,315	-	-	(1,315)	-
中集車輛（集團）	-	2,199,974	-	-	2,199,974
信達證券	-	600,000	-	(600,000)	-
星德勝	-	1,813	-	(1,631)	182
中信證券	2,900,000	200,000	-	(1,127,900)	1,972,100
中國海油	2,535,000	-	-	(1,000,000)	1,535,000

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資 (續)					
股票 (續)					
中國 (續)					
寧德時代	91,600	504,917	-	-	596,517
新諾威	-	500,000	-	-	500,000
達利凱普	576	-	-	-	576
廣合科技	-	2,219	-	(1,997)	222
德邦股份	-	1,980,700	-	(1,980,700)	-
東方電氣	-	799,920	-	(799,920)	-
福萊特玻璃集團	-	200,000	-	-	200,000
分眾傳媒	3,000,000	800,000	-	-	3,800,000
海天味業	499,946	-	-	(499,946)	-
方正證券	-	3,600,000	-	(1,200,000)	2,400,000
工業富聯	-	900,000	-	(900,000)	-
安井食品	100,000	-	-	(100,000)	-
福耀玻璃	730,000	310,000	-	(370,000)	670,000
歌爾股份	899,979	-	-	(899,979)	-
固高科技	396	-	-	(396)	-
康希通信	648	-	-	-	648
格力電器	2,359,863	-	-	(150,000)	2,209,863
廣東海大集團	359,827	-	-	(359,827)	-
匯成真空	-	2,189	-	(1,970)	219
凌霄泵業	1,885,900	-	-	(200,000)	1,685,900
辰奕智能	118	-	36	-	154
廣東塔牌集團	-	2,599,948	-	-	2,599,948
天嶽先進	1,000,000	2,300,000	-	(3,300,000)	-
廣深鐵路	-	9,000,000	-	-	9,000,000
廣州白雲山醫藥集團	-	300,000	-	(300,000)	-
天賜材料	-	474,800	-	(474,800)	-
貴州航太電器股份有限公司	-	210,000	-	-	210,000
永吉股份	-	30,400	-	(30,400)	-
巨星科技	1,020,000	-	-	(1,020,000)	-
福斯特	-	909,487	143,915	(549,700)	503,702
熱威股份	352	-	-	(352)	-

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
中國(續)					
海康威視	1,615,000	-	-	(450,000)	1,165,000
泰格醫藥	-	250,000	-	(250,000)	-
昊華科技	820,000	-	-	-	820,000
老白乾酒	-	250,000	-	-	250,000
埃科光電	275	-	-	(275)	-
雪祺電氣	-	1,330	40	(1,197)	173
雙匯發展	-	560,000	-	(200,000)	360,000
思維列控	-	900,000	-	(900,000)	-
海興電力	-	821,380	-	(821,380)	-
同花順	200,000	-	-	(60,000)	140,000
宏發股份	1,550,000	-	-	(1,550,000)	-
宏盛華源	3,918	-	-	-	3,918
華虹公司	57,825	-	-	(57,825)	-
華利集團	300,000	-	-	(50,000)	250,000
華能國際電力	2,099,989	-	-	(2,099,989)	-
華勤技術	-	330,000	132,000	-	462,000
華域汽車	1,799,857	-	-	(1,799,857)	-
菲利華	640,000	-	-	(200,000)	440,000
崇德科技	136	-	-	(136)	-
湖南裕能	-	650,000	-	(650,000)	-
恒生電子	-	500,000	-	(500,000)	-
工商銀行	10,699,861	500,000	-	(8,900,000)	2,299,861
興業銀行	3,059,920	2,120,000	-	(2,059,920)	3,120,000
內蒙華電	15,799,950	-	-	(6,300,000)	9,499,950
伊利股份	1,300,000	-	-	-	1,300,000
遠興能源	-	3,299,942	-	-	3,299,942
晶澳太陽能科技	-	499,920	-	(499,920)	-
艾森股份	274	-	-	-	274
長海股份	-	1,909,979	-	-	1,909,979
恒立液壓	593,000	200,000	-	(357,500)	435,500
恒瑞醫藥	1,249,998	100,000	-	(850,000)	499,998
華蘭股份	698,400	-	-	(698,400)	-

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資（續）					
股票（續）					
中國（續）					
華陽智能	-	1,375	-	(1,237)	138
江蘇今世緣酒業	340,000	-	-	(340,000)	-
江蘇立華牧業	-	499,930	-	(499,930)	-
江蘇龍蟠科技	-	1,799,920	-	(500,000)	1,299,920
江蘇洋河酒廠	-	109,920	-	-	109,920
魚躍醫療	960,000	-	-	-	960,000
晶科能源	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
健康元	-	800,000	-	(800,000)	-
中炬高新	600,000	-	-	(600,000)	-
科達製造	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
貴州茅臺	145,400	32,400	-	(111,800)	66,000
立訊精密	2,430,000	-	-	(1,400,000)	1,030,000
瀘州老窖	160,000	235,000	-	(395,000)	-
麥加芯彩	126	-	-	-	126
南微醫學	410,000	-	-	(196,000)	214,000
美的集團	1,038,050	-	-	(100,000)	938,050
肯特股份	-	2,184	-	(1,965)	219
北方華創科技集團	59,975	-	-	-	59,975
新華保險	-	500,000	-	-	500,000
美新科技	-	2,568	-	(2,311)	257
東方電纜	260,000	110,000	-	(260,000)	110,000
興瑞科技	-	1,999,965	-	-	1,999,965
海洋石油工程	-	3,800,000	-	(3,800,000)	-
歐萊新材	-	3,437	-	(3,092)	345
平安電工	-	1,833	-	(1,649)	184
中國平安	2,100,000	-	-	(310,000)	1,790,000
平煤股份	-	900,000	-	-	900,000
中國郵政儲蓄銀行	5,715,300	-	-	(5,715,300)	-
齊魯銀行	3,604,200	-	-	(3,604,200)	-
百洋醫藥	369,917	270,000	-	-	639,917

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資 (續)					
股票 (續)					
中國 (續)					
海泰新光	573,215	-	-	(250,000)	323,215
青海鹽湖工業	-	580,000	-	-	580,000
北自科技	-	1,070	-	(963)	107
賽輪輪胎	3,329,982	800,000	-	(2,058,482)	2,071,500
三一重工	1,000,000	1,399,901	-	(1,000,000)	1,399,901
陝西煤業	1,300,000	-	-	(400,000)	900,000
陝西能源	-	208,100	-	(208,100)	-
中創股份	-	1,856	-	(1,670)	186
金帝股份	195	-	-	(195)	-
豪邁科技	820,000	-	-	(330,000)	490,000
鍵邦股份	-	1,287	-	-	1,287
太陽紙業	-	2,499,932	-	(2,499,932)	-
騰達科技	-	2,128	-	(1,915)	213
安乃達	-	1,051	-	-	1,051
實信軟體	454,903	800,000	160,000	(454,903)	960,000
錦江航運	1,263	-	-	-	1,263
龍旗科技	-	2,978	-	(2,680)	298
儒競科技	266	-	-	(266)	-
滬農商行	-	4,900,000	-	-	4,900,000
眾辰科技	740,193	-	-	(740,193)	-
山煤國際	-	1,000,000	-	-	1,000,000
山西汾酒	-	130,000	-	-	130,000
興欣新材	87	-	35	-	122
安培龍	164	-	50	-	214
新宙邦	640,000	-	-	(640,000)	-
微芯生物	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
和而泰	900,000	400,000	-	(1,300,000)	-
深圳市匯川技術	359,944	100,000	-	-	459,944
駿鼎達	-	1,066	43	(959)	150

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				
	二零二四年 一月一日	增加	紅利/股利	減少	二零二四年六月 三十日
上市/報價投資 (續)					
股票 (續)					
中國 (續)					
科達利	300,000	70,000	-	(370,000)	-
邁瑞醫療	99,000	-	-	-	99,000
路維光電	-	519,038	-	(259,038)	260,000
深圳市捷佳偉創新能源 裝備	-	150,000	-	(150,000)	-
聯域股份	99	-	-	-	99
中遠通	604	-	-	-	604
川投能源	-	1,030,000	-	-	1,030,000
四川路橋	-	1,300,000	-	-	1,300,000
星宸科技	-	4,809	-	(4,328)	481
中倫新材	-	7,103	-	(6,392)	711
中材國際	-	3,320,000	-	(500,000)	2,820,000
中礦資源集團	-	669,816	-	(120,000)	549,816
索寶蛋白	161	-	-	-	161
國能日新	100,000	199,940	-	(299,940)	-
陽光電源	250,000	305,000	132,000	(435,000)	252,000
盛科通信	549	-	-	(549)	-
東山精密	1,199,958	-	-	(1,199,958)	-
偉創電氣	-	540,000	-	-	540,000
西典新能	-	1,296	-	(1,166)	130
太極股份	250,000	100,000	-	(350,000)	-
匯中股份	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
七一二	-	580,000	-	-	580,000
紫光國微	270,000	-	-	(270,000)	-
匯成股份	1,000,000	3,680,237	-	(2,250,000)	2,430,237
紫光股份	-	1,319,990	-	(599,990)	720,000
上海合晶	-	8,659	-	-	8,659
萬達電影	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
萬華化學	244,928	300,000	-	(60,000)	484,928

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
中國(續)					
天罡股份	-	200,000	-	-	200,000
溫氏股份	1,739,943	200,000	-	(750,000)	1,189,943
達夢數據	-	1,745	-	(1,570)	175
逸飛鐳射	200,000	-	-	(200,000)	-
五糧液	510,000	130,000	-	(312,000)	328,000
藥明康德	-	680,000	-	(680,000)	-
德科立	-	320,000	64,000	(384,000)	-
徐工機械	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
特寶生物	397,434	170,000	-	-	567,434
廈門銀行	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
思泰克	246	-	-	-	246
國際醫學	2,700,000	-	-	(2,700,000)	-
諾瓦星雲	-	1,381	552	(690)	1,243
陝鼓動力	1,400,000	600,000	-	(2,000,000)	-
中熔電氣	-	170,000	-	-	170,000
永達股份	189	-	-	-	189
新鋼股份	-	6,599,913	-	(6,599,913)	-
兗礦能源	1,079,950	-	-	(1,079,950)	-
永臻股份	-	3,821	-	(3,438)	383
圓通速遞	-	2,070,000	-	(1,200,000)	870,000
雲鋁股份	1,060,000	-	-	(1,060,000)	-
雲南白藥集團	-	294,880	-	-	294,880
錫業股份	-	950,000	-	-	950,000
片仔癀	61,916	42,000	-	(103,916)	-
正泰電器	-	950,000	-	-	950,000
鼎龍科技	195	-	-	-	195
豐茂股份	208	-	-	-	208
宏鑫科技	-	3,607	-	(3,246)	361

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資（續）					
股票（續）					
中國（續）					
潔美科技	-	850,000	-	-	850,000
浙江龍盛	-	2,600,000	-	-	2,600,000
偉星股份	4,148,475	-	-	(4,148,475)	-
偉星新材	-	900,000	-	-	900,000
仙琚製藥	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
夏廈精密	64	-	-	-	64
浙江浙能電力	-	2,000,000	-	-	2,000,000
浙商證券	-	1,350,000	-	-	1,350,000
紫金礦業	5,719,965	-	-	(400,000)	5,319,965
香港					
中國國際航空	-	2,200,000	-	(2,200,000)	-
中國銀行	-	7,000,000	-	-	7,000,000
百濟神州	-	300,000	-	(300,000)	-
中國廣核電力	-	12,000,000	-	(12,000,000)	-
中國建設銀行	-	5,000,000	-	-	5,000,000
中國大唐集團新能源	-	6,700,000	-	-	6,700,000
中國銀河証券	3,800,000	7,180,000	-	(2,500,000)	8,480,000
龍源電力集團	-	1,900,000	-	-	1,900,000
中國移動	848,000	-	-	(315,000)	533,000
中國太平洋保險（集團）	-	1,230,000	-	-	1,230,000
華潤啤酒（控股）	-	540,000	-	(200,000)	340,000
華潤電力控股	3,030,000	200,000	-	(550,000)	2,680,000
中國神華能源	-	800,000	-	(290,000)	510,000
中國電信	10,684,000	-	-	(7,700,000)	2,984,000
中國聯合網絡通信（香港）	-	3,500,000	-	(1,000,000)	2,500,000
重慶農村商業銀行	-	6,640,000	-	-	6,640,000

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				
	二零二四年 一月一日	增加	紅利/股利	減少	二零二四年六月 三十日
上市/報價投資（續）					
股票（續）					
香港（續）					
長江和記實業	-	710,000	-	-	710,000
中遠海運能源運輸	-	3,400,000	-	(2,300,000)	1,100,000
中遠海運控股	-	3,100,000	-	(1,000,000)	2,100,000
東方電氣	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
協鑫科技控股	-	10,000,000	-	-	10,000,000
華泰證券	-	1,100,000	-	-	1,100,000
中國工商銀行	-	6,560,000	-	-	6,560,000
信達生物製藥	-	660,000	-	(400,000)	260,000
京東集團	-	244,000	-	(244,000)	-
金蝶國際軟件集團	1,200,000	-	-	(1,200,000)	-
快手科技	-	210,000	-	(210,000)	-
新華人壽保險	-	1,650,000	-	-	1,650,000
耐世特汽車系統集團	3,200,000	1,900,000	-	(5,100,000)	-
中國人民保險集團	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
中國石油天然氣	-	3,800,000	-	-	3,800,000
中國人民財產保險	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
中芯國際集成電路製造	2,630,000	-	-	(1,770,500)	859,500
廈門燕之屋生物工程	2,385,200	2,000	-	(1,246,800)	1,140,400
金風科技	-	4,000,000	-	-	4,000,000
信義光能控股	-	4,096,000	-	-	4,096,000
招金礦業	-	4,053,500	-	(1,900,000)	2,153,500
浙江零跑科技	-	360,000	-	(360,000)	-
中聯重科	-	1,100,000	-	-	1,100,000
中興通訊	-	1,750,000	-	-	1,750,000
中通快遞（開曼）	-	79,950	-	-	79,950

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資 (續)					
報價債務證券 (續)					
开曼					
CDBL 融資 2 2.75% S/A 02-03-2025	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
中國					
中國農業發展銀行 3.37% A 26-02-2026 CDC	-	50,000,000	-	-	50,000,000
北陸轉債	-	100,991	-	-	100,991
20 匯金 MTN006	500,000	-	-	(500,000)	-
23 匯金 MTN001	300,000	-	-	(300,000)	-
22 長江 01	200,000	-	-	(200,000)	-
強力轉債	-	135,000	-	(50,030)	84,970
21 誠通控股 MTN002A	300,000	-	-	(300,000)	-
中信轉債	-	250,000	-	(250,000)	-
中國國家開發銀行 2.59% A 11-01-2026 CDC	-	150,000,000	-	-	150,000,000
中國國家開發銀行 C--.85% Q 16-01-2026 CDC	-	50,000,000	-	-	50,000,000
24 國債 09	-	1,090,000	-	-	1,090,000
23 國債 24	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
23 招證 C6	300,000	-	-	-	300,000
中金金融 2016 有限公司(香港) S+-.95% Q 18-01-2027	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
22 安信 05	200,000	-	-	-	200,000
22 安信 01	300,000	-	-	(300,000)	-
21 華集 01	299,010	-	-	-	299,010
22 廣發 C1	200,000	-	-	-	200,000
22 華創 C1	320,000	-	-	-	320,000
瀛通轉債	-	287,540	-	(218,240)	69,300
晶澳轉債	-	603,135	-	(603,135)	-
家悅轉債	-	185,530	-	-	185,530
晶能轉債	-	185,520	-	(185,520)	-

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年 一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資(續)					
報價債務證券(續)					
中國(續)					
靈康轉債	-	188,590	-	-	188,590
美諾轉債	-	209,150	-	(165,650)	43,500
19 安租 01	200,000	-	-	(200,000)	-
20 陝投集團 MTN003	300,000	-	-	(300,000)	-
龍大轉債	-	285,320	-	-	285,320
雪榕轉債	-	40,690	-	-	40,690
21 山證 C1	-	500,000	-	(500,000)	-
山鷹轉債	-	454,270	-	(454,270)	-
23 申證 C1	800,000	-	-	(800,000)	-
23 深投控 MTN002	-	100,000	-	-	100,000
23 深投 05	-	100,000	-	-	100,000
科達轉債	-	275,280	-	-	275,280
天風證券股份有限公司 6.5% S/A 05-03-2026	-	12,800,000	-	(5,800,000)	7,000,000
天創轉債	-	269,850	-	-	269,850
天 23 轉債	-	128,000	-	(128,000)	-
塞力轉債	-	388,300	-	(105,000)	283,300
22 廈貿 K1	100,000	-	-	-	100,000
22 義市 01	300,000	-	-	-	300,000
遊族轉債	-	223,220	-	(170,670)	52,550
震安轉債	-	20,977	-	-	20,977
香港					
香港機場管理局 3.25% S/A 12JAN2052 REGS	19,000,000	-	-	(19,000,000)	-
香港機場管理局 3.5% S/A 12-01-2062 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
香港機場管理局 4.875% S/A 12-01- 2033 REGS	8,900,000	15,000,000	-	(23,900,000)	-

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資 (續)					
報價債務證券 (續)					
香港 (續)					
交銀租賃管理香港有限公司 S+- .68% Q 26-06-2027	-	4,000,000	-	-	4,000,000
招銀國際租賃管理有限公司 1.875% S/A 12-08-2025	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
遠東宏信有限公司 6.625% S/A 16-04-2027	-	800,000	-	(800,000)	-
香港政府綠色債券計劃 4% S/A 07-06-2033	5,850,000	-	-	(5,850,000)	-
香港政府綠色債券計劃 5.25% S/A 11-01-2053	3,000,000	16,000,000	-	(10,000,000)	9,000,000
皇權資本有限公司 5.625% S/A 03-11-2024	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
新加坡					
中銀航空航空有限公司 3.25% S/A 29-04-2025 REGS	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
美國					
BOC AVIATION USA CORP 4.875% S/A 03MAY2033 REGS	13,000,000	6,000,000	-	(19,000,000)	-
英屬維京群島					
中國信達 2020 I MNGMN 3% S/A 20-01-2031	6,950,000	-	-	(6,950,000)	-
中國信達 2020 I MNGMN 3.25% S/A 28-01-2027	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
中國信達 2020 I MNGMN 5.75% S/A 28-05-2029	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)(續)  
自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
上市/報價投資(續)					
報價債務證券(續)					
英屬維京群島(續)					
中國長城國際控股 III 有限公司 3.875% S/A 31-08-2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
中國長城國際控股 V 有限公司 2.375% S/A 18-08-2030	5,000,000	-	-	(5,000,000)	-
CSSC CAPITAL 2015 LTD 2.5% S/A 13FEB2025	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
歡樂寶資產控股公司 5.5% S/A 1FEB2027	-	7,000,000	-	(7,000,000)	-
OCEAN LAUREL CO LTD 2.375% S/A 20OCT2025	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
國家電網海外投資(2013)有限公司 4.375% S/A 22MAY2043 REGS	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
國家電網海外投資(2014)有限公司 4.85% S/A 07-05-2044 REGS	1,980,000	-	-	(1,980,000)	-
TFI OVERSEAS INVESTMENT LTD 6.25% S/A 31MAY2026	-	4,800,000	-	(4,800,000)	-
集體投資計劃					
中國					
華寶添益	323	2	-	-	325
非上市/報價投資					
非上市/報價股權					
中國					
播恩集團	-	196	-	(196)	-
四川黃金	-	271	-	(271)	-
彩蝶實業	-	103	-	(103)	-
亞光股份	-	198	-	(198)	-

大成投資信託基金  
 大成中國靈活配置基金  
 (大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表 (未經審計) (續)  
 自二零二四年一月一日至二零二四年六月三十日止期間

	持股量				二零二四年六月三十日
	二零二四年一月一日	增加	紅利/股利	減少	
非上市/報價投資					
非上市債務債券					
澳大利亞					
中國工商銀行/悉尼 3.45% A 18-07-2024 FXCD	-	100,000,000	-	-	100,000,000
中國					
21 中銀投資 MTN002	1,600,000	-	-	(1,600,000)	-
交通銀行 (香港) 有限公司 -% A 24-07-2024	-	50,000,000	-	-	50,000,000
22 匯金 MTN002	200,000	-	-	(200,000)	-
23 國債 16	1,194,000	90,000	-	(1,284,000)	-
23 國債 13	1,201,000	-	-	(1,201,000)	-
22 東方債 01BC	100,000	-	-	(100,000)	-
22 碧桂園 MTN002	500,000	-	-	-	500,000
中國進出口銀行 2.06% A 18-03-2026 CDC	-	50,000,000	-	-	50,000,000
22 河鋼集 MTN008	200,000	-	-	(200,000)	-
中國工商銀行/首爾 -% 19- 07-2024 CD	-	100,000,000	-	-	100,000,000
中國工商銀行/悉尼 -% 10- 07-2024 CD	-	74,000,000	-	-	74,000,000
23 今世緣 MTN001	300,000	-	-	-	300,000
中國人民銀行海外債券 3.04% A 23-05-2024	-	45,000,000	-	(45,000,000)	-
19 財金 MTN001	200,000	-	-	(200,000)	-

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二四年六月三十日

資產淨值

截至下列日期止的 財務年度結束時	資產淨值 (人民幣)	每單位資產淨值								
		人民幣 A類 (人民幣)	美元 A類 (美元)	港元 A類 (港元)	美元 P類 (累算) (美元)	港元 P類 (累算) (港元)	人民幣 P類 (累算) (人民幣)	新加坡元 A類 (新加坡)	新加坡元 P類 (派息) (新加坡)	新加坡元 P類 (累算) (新加坡)
二零二四年 六月三十日	4,784,701,561	11.24	8.90	8.99	11.42	11.22	10.21	10.04	10.04	10.09
二零二三年 十二月三十一日	4,983,834,665	11.37	9.27	9.36	11.28	11.08	9.84			
二零二二年 十二月三十一日	3,926,454,874	13.52	11.42	11.50	12.69	12.44				
二零二一年 十二月三十一日	2,700,926,436	16.83	15.59	15.68	15.97	15.66				

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

表現記錄 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值

截至下列日期止的財務年度 結束時	每基金單位最高發行價值								
	人民幣 A類 (人民幣)	美元 A類 (美元)	港元 A類 (港元)	美元 P類 (累算) (美元)	港元 P類 (累算) (港元)	人民幣 P類 (累算) (人民幣)	新加坡元 A類 (新加坡)	新加坡元 P類 (派息) (新加坡)	新加坡元 P類 (累算) (新加坡)
二零二四年六月三十日	11.87	9.50	9.60	12.04	11.81	10.69	10.52	10.52	10.54
二零二三年十二月三十一日	14.22	12.31	12.46	13.77	13.57	10.06			
二零二二年十二月三十一日	16.68	15.38	15.47	15.76	15.45				
二零二一年十二月三十一日	18.61	17.14	17.14	16.45	16.06				
二零二零年十二月三十一日	17.46	15.87	15.87	15.23	14.85				
二零一九年十二月三十一日	14.32	12.60	12.75	10.81	10.58				
二零一八年十二月三十一日	15.41	14.68	14.79						
二零一七年十二月三十一日	15.02	13.69	13.78						
二零一六年十二月三十一日	13.25	11.93	11.93						
二零一五年十二月三十一日	17.90	17.62	17.60						
二零一四年十二月三十一日	13.17	12.94	12.93						

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

表現記錄 (未經審計) (續)  
截至二零二四年六月三十日

最高及最低每单位资产净值(續)

截至下列日期止的財務年度 結束時	每基金單位最低贖回價值								
	人民幣 A類 (人民幣)	美元 A類 (美元)	港元 A類 (港元)	美元 P類 (累算) (美元)	港元 P類 (累算) (港元)	人民幣 P類 (累算) (人民幣)	新加坡元 A類 (新加坡)	新加坡元 P類 (派息) (新加坡)	新加坡元 P類 (累算) (新加坡)
二零二四年六月三十日	10.58	8.52	8.62	10.47	10.30	9.24	9.96	9.96	9.96
二零二三年十二月三十一日	11.07	8.99	9.07	10.94	10.75	9.57			
二零二二年十二月三十一日	12.70	10.15	10.29	11.12	10.98				
二零二一年十二月三十一日	16.67	15.11	15.15	14.65	14.30				
二零二零年十二月三十一日	12.49	10.40	10.40	9.48	9.24				
二零一九年十二月三十一日	11.57	10.10	10.20	10.00	9.89				
二零一八年十二月三十一日	11.65	10.17	10.26						
二零一七年十二月三十一日	12.45	10.89	10.89						
二零一六年十二月三十一日	11.60	10.71	10.75						
二零一五年十二月三十一日	11.96	11.28	11.26						
二零一四年十二月三十一日	9.50	9.30	9.29						

大成投資信託基金  
大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

財務報表附注 (未經審計)

編制基礎和會計政策

未經審計的中期財務報表根據國際財務報告準則(“國際財務報告準則”)及香港證券及期貨事務監察委員會單位信託及互惠基金守則附錄 E 的相關披露條文編制。

所採用的會計政策與截至 2023 年 12 月 31 日止年度財務報表附注 2 所述的一致。

注1: 截至2024年6月30日及2023年12月31日止期間, 支付給受託人關聯人的交易手續費如下:

	30/06/2024	31/12/2023
中國銀行有限公司	21,600	68,925
中銀國際英國保誠信託有限公司	148,550	243,250

注2: 截至2024年6月30日及2023年12月31日止期間, 支付給受託人關聯人的其他費用(銀行手續費)如下:

	30/06/2024	31/12/2023
中國銀行(香港)有限公司	9,920	28,398