
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
截至二零二六年六月三十日止期間





大成投資信託基金

截至二零二六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
基金單位持有人應佔資產淨值變動報表（未經審計）	7-8
大成中國靈活配置基金	9-38
- 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（未經審計）	40

大成投資信託基金
截至二零二六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
許自傑先生

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
3513-3519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。截至二零二六年六月三十日，累計總資產規模為人民幣7,954,489,087元。

市場回顧

2026年上半年A股震盪向上，上證指數、滬深300收漲，延續2025年以來的強勢。風險偏好的階段性切換，是主導上半年A股運行節奏的核心變數。年初至2月，穩增長政策預期持續升溫，市場風險偏好穩步修復，滬深300指數小幅收漲；3月至4月上旬，受美伊衝突擾動，風險偏好階段性回落，滬深300指數震盪調整；4月中旬至年中，地緣衝突邊際緩和，風險偏好步入修復通道，滬深300指數震盪回升。從風格來看，上半年中小盤優於大盤。行業層面，表現極度分化，科技板塊漲幅領先，消費相關板塊跌幅居前。

上半年國內經濟內生增長動力持續增強，總體平穩、向新向優的發展態勢不斷鞏固，新動能快速成長壯大，物價水準溫和回升，微觀流動性持續改善。基本方面，一季度GDP同比增長5%，物價溫和回升，出口超預期增長；二季度GDP增速有所回落，但出口延續高增長，新舊動能接續轉換節奏明顯加快，以高端製造、數位經濟、現代服務業為代表的新動能成為經濟增長核心拉動力，AI產業鏈與電力新能源領域需求表現超預期，新經濟的引領支撐地位進一步夯實，充分彰顯出國內經濟強勁的韌性與活力。企業盈利修復節奏同步加快，工業企業利潤增速回升，上市公司業績整體呈現邊際向好趨勢。流動性方面，杠杆資金活躍，融資融券餘額處於歷史高位，偏股型基金發行回暖，市場成交熱度處於歷史較高水準。

展望

展望下半年，國內經濟有望延續向好向優的發展勢頭，宏觀政策加力提效，企業盈利修復空間持續打開，A股市場有望延續平穩健康發展態勢，市場風格趨於再平衡，科技與傳統行業的估值分化或將收斂，投資策略上關注景氣主線。政策方面，下半年宏觀政策逆週期調節力度有望加大，切實鞏固拓展經濟穩中向好的發展基礎，財政政策或將提質增效，貨幣政策或將繼續“精準滴灌”，有望提供充裕流動性、穩定宏觀預期，為經濟穩增長、高品質發展與金融市場平穩運行營造適宜的貨幣金融環境。經濟方面，AI產業革命將帶動新一輪資本開支擴張與生產效率躍升，推動新舊動能加速轉換，新動能對經濟增長的拉動效應持續釋放；隨著政策效能逐步顯現，固定資產投資增速有望企穩回升，消費修復節奏有望加快；與此同時，中東地緣局勢仍存不確定性，傳統能源供給的脆弱性將進一步凸顯電力與新能源行業的戰略競爭優勢，推動相關產業鏈盈利、產能與出口份額快速擴張；依託供應鏈穩定性與能源成本優勢，國內出口有望維持高增態勢，全球市場份額進一步提升，進而支撐人民幣匯率重估，預計下半年人民幣匯率將保持強勢。整體而言，新動能對經濟增長的拉動作用或將持續增強，國內經濟有望延續平穩健康發展格局。企業盈利方面，價格回升有望重塑上市公司盈利格局，疊加政策加力提效，預計企業盈利將進一步改善。海外方面，下半年全球經濟“K型”復蘇格局或仍將延續，美聯儲內部對於未來利率路徑存在明顯分歧，後續經濟資料或是決定政策路徑的關鍵變數，預計年內美聯儲加息概率較低。

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(續)

關於A股市場的下半年展望，企業盈利穩步回升將為A股市場提供中長期基本面錨點，疊加微觀流動性保持合理充裕，A股市場有望邁向更加穩健的新發展格局。市場風格方面，上半年科技與傳統行業估值分化顯著，預計下半年將有所收斂，市場風格或趨於均衡。投資策略上，聚焦高景氣主線，關注受益於產業升級與技術反覆運算的AI主線，同時佈局儲能、有色金屬、創新藥、非銀金融與金融IT等景氣度有望邊際回升的板塊。

大成國際資產管理有限公司

二零二六年八月三十一日

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)
 截至二零二六年六月三十日

	二零二六年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零二五年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	3,454,584	2,820,840
流動資產		
按公平價值透過損益記帳的金融資產	7,799,442,836	5,711,000,111
應收利息	17,144,201	11,588,964
應收股息	7,168,191	3,412,765
應收申購款	42,109,487	13,589,796
出售投資項目應收款	33,795,981	140,397,737
現金及現金等價物	144,485,683	126,884,979
總資產	8,047,600,963	6,009,695,192
負債		
非流動負債		
遞延所得稅負債	-	-
流動負債		
應付管理費用	9,212,754	7,196,739
應付受託人費用	781,042	617,550
應付贖回款	34,084,851	47,638,636
購入投資項目應付款	47,042,983	68,494,247
預提費用及其他應付款	1,408,225	1,708,117
預提稅款準備金	582,021	490,280
總負債	93,111,876	126,145,569
基金單位持有人應佔資產淨值	7,954,489,087	5,883,549,623

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)
截至二零二六年六月三十日

	二零二六年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零二五年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
已發行單位		
- 人民幣 A 類單位	204,258,005.31	163,667,670
- 人民幣 P 類 (累算) 單位	456,385.97	255,851
- 人民幣 P 類 (派息) 單位	182.92	183
- 美元 A 類單位	19,535,012.79	16,402,317
- 美元 P 類 (累算) 單位	127,926.91	143,720
- 美元 P 類 (派息) 單位	102.95	103
- 港元 A 類單位	425,557,243.80	292,718,633
- 港元 P 類 (累算) 單位	1,203,461.72	1,398,335
- 港元 P 類 (派息) 單位	200.00	200
- 新加坡元 A 類單位	10.00	10
- 新加坡元 P 類 (派息) 單位	10.00	10
- 新加坡元 P 類 (累算) 單位	10.00	10
每單位資產淨值		
- 人民幣 A 類單位	12.59	12.36
- 人民幣 P 類 (累算) 單位	13.53	12.79
- 人民幣 P 類 (派息) 單位	12.23	11.56
- 美元 A 類單位	10.54	10.08
- 美元 P 類 (累算) 單位	16.26	14.94
- 美元 P 類 (派息) 單位	12.86	11.81
- 港元 A 類單位	10.71	10.16
- 港元 P 類 (累算) 單位	16.03	14.62
- 港元 P 類 (派息) 單位	12.92	11.78
- 新加坡元 A 類單位	13.64	12.46
- 新加坡元 P 類 (派息) 單位	13.64	12.46
- 新加坡元 P 類 (累算) 單位	13.78	12.59

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

大成中國靈活配置基金

		自二零二六年一月一日至 二零二六年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零二五年一月一日至 二零二五年十二月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
	注		
收益			
股息收益		59,812,451	109,178,402
銀行存款產生的利息收入		305,925	418,560
投資產生的利息收入		20,593,839	31,987,598
投資淨收益		372,951,214	798,430,063
匯兌損失淨額		(6,062,446)	(3,649,691)
其他收入		—	1,134
總投資收益		447,600,983	936,366,066
開支			
管理費用		45,860,255	70,665,328
受託人費用		3,908,611	6,100,703
託管費		1,830,232	2,460,816
成立費用		—	—
交易手續費	1	164,050	325,650
交易成本		12,794,526	19,124,458
核數師酬金		99,335	125,555
法律及專業服務費用		16,658	8,698
其他費用	2	18,879	34,259
總經營支出		64,692,546	98,845,467
利潤分派前及稅前收益		382,908,437	837,520,599
對基金單位持有人的分派利潤		(268,618,352)	(450,522,621)
利潤分派後及稅前收益		114,290,085	386,997,978
稅項		(5,723,552)	(10,480,645)
基金單位持有人應佔資產淨值之增加		108,566,533	376,517,333

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)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 (未經審計)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	自二零二六年一月一日至 二零二六年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零二五年一月一日至 二零二五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佔資產淨值	5,883,549,623	4,764,625,908
發行單位所得款項	3,543,569,943	2,623,354,529
贖回單位所得款項	(1,581,197,012)	(1,880,948,147)
來自單位持有人交易的增加淨額	1,962,372,931	742,406,382
基金單位持有人應佔資產淨值之增加	108,566,533	376,517,333
期末基金單位持有人應佔資產淨值	7,954,489,087	5,883,549,623

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)

基金單位持有人應佔資產淨值變動報表(未經審計)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

可贖回單位的變動

二零二六年						
	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	163,667,670	16,402,317	292,718,633	143,720	1,398,335	255,851
已發行單位	67,341,623	8,842,990	218,099,669	66,032	441,664	721,680
重投資(附註)	576,549	92,612	782,160	-	-	-
已贖回單位	(27,327,837)	(5,802,906)	(86,043,218)	(81,825)	(636,537)	(521,145)
年末已發行單位數目	204,258,005	19,535,013	425,557,244	127,927	1,203,462	456,386

二零二六年						
	港元P類 (派息)	人民幣P類 (派息)	新加坡元A類	新加坡元P類 (累算)	新加坡元P類 (派息)	美元P類 (派息)
年初已發行單位數目	200	183	10	10	10	103
已發行單位	-	-	-	-	-	-
重投資(附註)	-	-	-	-	-	-
已贖回單位	-	-	-	-	-	-
年末已發行單位數目	200	183	10	10	10	103

二零二五年						
	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	157,815,275	15,358,490	223,921,584	124,238	1,596,407	4,796
已發行單位	46,109,376	5,639,591	184,649,479	66,069	1,640,541	284,294
重投資(附註)	1,262,293	149,630	1,126,356	-	-	-
已贖回單位	(41,519,274)	(4,745,394)	(116,978,786)	(46,587)	(1,838,613)	(33,239)
年末已發行單位數目	163,667,670	16,402,317	292,718,633	143,720	1,398,335	255,851

二零二五年						
	港元P類 (派息)	人民幣P類 (派息)	新加坡元A類	新加坡元P類 (累算)	新加坡元P類 (派息)	美元P類 (派息)
年初已發行單位數目	200	183	10	10	10	103
已發行單位	-	-	-	-	-	-
重投資(附註)	-	-	-	-	-	-
已贖回單位	-	-	-	-	-	-
年末已發行單位數目	200	183	10	10	10	103

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資			
債務證券			
中國			
鴻路轉債	246,420	28,898,388	0.36
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD 5.5% A 14MAR2028 SHCH	20,000,000	21,304,700	0.27
26國債01	4,720,000	472,429,992	5.96
24特國01	530,000	56,465,617	0.71
CHINA POST GROUP CO LTD 2.13% A 28AUG2027 SHCH	30,000,000	30,212,400	0.38
22國新控股MTN002(能源保供特別債)	1,100,000	111,460,360	1.41
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD S+0.95% Q 18JAN2027	200,000	1,362,161	0.02
康醫轉債	150,000	17,233,050	0.22
申昊轉債	17,540	2,112,949	0.03
江山轉債	284,710	32,546,794	0.41
裕興轉債	60,000	7,082,952	0.09
壘知轉債	202,543	24,260,398	0.30
靈康轉債	188,590	22,321,418	0.28
華陽轉債	145,320	15,956,339	0.20
23深投05	100,000	10,032,000	0.13
康泰轉2	119,992	14,127,738	0.18
仙樂轉債	332,611	37,371,839	0.47
天23轉債	80,000	9,661,352	0.12
溫氏轉債	80,000	8,840,632	0.11
聞泰轉債	560,850	50,942,679	0.64

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)
 截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
債務證券 (續)			
中國 (續)			
衛寧轉債	246,770	30,997,446	0.39
XIAMEN STATE OWNED CAPITAL OPERATION CO LTD 1.86% A 23APR2031 SHC	50,000,000	50,071,300	0.63
三角轉債	80,001	10,309,401	0.13
雙箭轉債	60,190	7,276,526	0.09
偉22轉債	13,150	1,672,408	0.02
冠宇轉債	60,000	7,732,956	0.10
香港			
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 3.4% S/A 14JAN2055 REGS	140,000,000	153,906,200	1.93
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.7% S/A 14MAY2056	38,000,000	38,741,380	0.49
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.7% S/A 14MAY2056	200,000,000	203,406,000	2.56
MTR CORP LTD 5.25% S/A 01APR2055	5,000,000	33,769,859	0.42
存託憑證			
美國			
知乎股份有限公司	8,396	178,446	0.00
集體投資計劃			
中國			
華寶添益	333	33,297	0.00
股本證券			
中國			
中微公司	139,716	65,456,946	0.82
航發動力	370,000	14,185,800	0.18
安琪酵母	1,139,967	41,266,805	0.52
銅冠銅箔	230,000	37,966,100	0.48

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
江鎬裝備	2,450,000	66,713,500	0.84
普洛藥業	1,200,000	19,992,000	0.25
鵬鼎控股	200,000	21,076,000	0.26
中航光電	399,976	18,478,891	0.23
中航沈飛	531,736	21,854,350	0.27
南京銀行	1,200,000	11,868,000	0.15
寧波銀行	1,130,000	33,549,700	0.42
昊華能源	1,098,300	11,598,048	0.15
昂瑞微	2,319	310,352	0.00
維通利	387	20,766	0.00
比亞迪	727,000	57,941,900	0.73
寒武紀	87,765	140,033,446	1.76
電科藍天	1,717	127,316	0.00
星宇股份	221,911	20,109,575	0.25
巨集明電子	714	125,728	0.00
赤峰黃金	380,000	10,001,600	0.13
建設銀行	3,149,990	30,334,404	0.38
中國船舶	619,993	20,949,563	0.26
海南橡膠	2,000,000	9,840,000	0.12
中國巨石	580,000	42,270,400	0.53
招商銀行	3,040,000	107,920,000	1.36
北方稀土	709,996	34,115,308	0.43
中國太保	2,089,000	59,578,280	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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
中國動力	1,780,000	58,384,000	0.73
長江電力	1,999,886	52,936,982	0.67
臻寶科技	2,070	1,428,528	0.02
渝農商行	6,600,000	40,326,000	0.51
至信股份	112	2,915	0.00
中國海油	625,000	16,968,750	0.21
寧德時代	498,497	195,914,306	2.46
阿特斯	838,369	9,071,153	0.11
德力佳	567,250	30,614,482	0.38
東鵬飲料	78,536	9,693,698	0.12
新易盛	278,600	169,110,200	2.13
工業富聯	200,000	14,430,000	0.18
萬辰集團	94,967	16,468,227	0.21
元力股份	400,000	11,688,000	0.15
福耀玻璃	624,938	31,521,873	0.40
甘李藥業	782,846	44,434,339	0.56
廣發證券	1,150,000	26,910,000	0.34
聚辰股份	190,000	40,394,000	0.51
固德電材	117	14,156	0.00
有研複材	834	25,854	0.00
海大集團	420,000	18,736,200	0.24
慧穀新材	96	13,424	0.00
天賜材料	239,926	12,339,394	0.16

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
川恆股份	670,000	19,564,000	0.25
國泰海通	2,799,977	50,959,581	0.64
福斯特	1	17	0.00
福恩股份	134	2,566	0.00
高特電子	546	22,457	0.00
恒鑫生活	1	26	0.00
飛龍股份	500,000	23,590,000	0.30
新恒匯	149,985	11,824,817	0.15
惠科股份	6,488	247,712	0.00
宏發股份	879,976	30,350,372	0.38
華泰證券	2,280,000	47,013,600	0.59
海光信息	191,000	70,727,300	0.89
工商銀行	5,999,861	42,419,017	0.53
雙欣材料	897	12,127	0.00
興業銀錫	400,000	13,184,000	0.17
包鋼股份	9,000,000	20,070,000	0.25
北芯生命	1,500	55,920	0.00
合合信息	1	113	0.00
奕瑞科技	365,200	45,284,800	0.57
易思維	177	10,427	0.00
恒瑞醫藥	725,840	37,772,714	0.47
恩華藥業	1,209,795	22,683,656	0.29
紅板科技	330	37,029	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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
正邦科技	6,000,000	16,860,000	0.21
德福科技	230,000	33,085,500	0.42
貴州茅臺	130,022	154,139,781	1.94
龍佰集團	1,100,000	18,128,000	0.23
羅萊生活	3,800,000	37,582,000	0.47
盛龍股份	1,743	48,421	0.00
立訊精密	985,000	69,344,000	0.87
聯芸科技	330,000	28,482,300	0.36
沐曦股份	3,994	3,308,230	0.04
美的集團	1,252,872	94,629,422	1.19
瀾起科技	281,000	87,081,900	1.09
摩爾執行緒	10,828	7,758,154	0.10
牧原股份	419,970	14,694,750	0.18
三瑞智能	216	25,525	0.00
北方華創	113,000	99,955,280	1.26
惠康科技	285	20,440	0.00
健信超導	265	12,447	0.00
聯瑞新材	120,000	29,328,000	0.37
中國平安	1,890,000	90,228,600	1.13
齊魯銀行	9,500,000	54,815,000	0.69
青島港	2,100,000	16,905,000	0.21
鹽湖股份	1,089,950	32,905,590	0.41
嘉德利	104	7,099	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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
睿創微納	300,000	46,407,000	0.58
納百川	151	10,920	0.00
順豐控股	310,000	9,690,600	0.12
賽輪輪胎	1,200,000	13,836,000	0.17
思看科技	1	86	0.00
聯訊儀器	163	378,540	0.00
博苑新材	1	59	0.00
春光集團	290	21,747	0.00
愛旭股份	3,089,783	42,793,495	0.54
百潤股份	1,989,964	33,670,191	0.42
漢鐘精機	714,000	26,475,120	0.33
譽帆科技	69	2,444	0.00
尚水智能	138	9,587	0.00
山西汾酒	1,800	196,866	0.00
生益科技	457,800	79,382,520	1.00
深南電路	102,910	47,122,489	0.59
恒運昌	116	56,147	0.00
興森科技	520,000	26,494,000	0.33
匯川技術	819,999	54,390,534	0.68
傑美特	100,000	14,671,000	0.18
世盟股份	57	1,614	0.00
川投能源	2,699,983	38,258,759	0.48
科倫藥業	1,149,937	44,295,573	0.56

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
思源電氣	149,989	25,948,097	0.33
盛合晶微	2,391	462,922	0.01
陽光電源	437,831	69,623,886	0.88
東山精密	222,000	58,241,700	0.73
天孚通信	82,180	24,874,242	0.31
新廣益	195	15,167	0.00
唐山港	4,500,000	18,675,000	0.23
天海電子	719	28,257	0.00
唯捷創芯	1,050,000	33,726,000	0.42
芯原股份	119,000	44,165,660	0.56
萬華化學	439,901	30,093,627	0.38
濰柴動力	1,140,000	31,065,000	0.39
長進光子	128	58,176	0.00
帝爾鐳射	193,000	41,487,280	0.52
埃泰克	72	2,961	0.00
滬電股份	345,979	52,865,591	0.66
滬電股份	5,000	764,000	0.01
藥明康德	325,000	40,465,750	0.51
理奇智能	433	19,563	0.00
廈門銀行	5,821,400	39,760,162	0.50
西安奕材	44,370	2,747,390	0.03
泰金新能	234	49,140	0.00
傑瑞股份	170,000	25,925,000	0.33

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
中國 (續)			
新洋豐	1,900,000	21,964,000	0.28
永興材料	329,930	18,687,235	0.23
圓通速遞	2,239,792	35,276,724	0.44
源傑科技	12,000	22,632,000	0.28
雲鋁股份	1,131,000	25,040,340	0.31
海亮股份	2,150,000	49,127,500	0.62
浙江龍盛	1,440,000	17,438,400	0.22
振石股份	775	14,128	0.00
中際旭創	256,710	326,021,700	4.11
中金黃金	480,000	8,664,000	0.11
紫金礦業	3,439,893	86,478,910	1.09
香港			
凱萊英	202,000	19,032,602	0.24
建發國際集團	1,191,000	13,923,981	0.18
建設銀行	8,560,000	59,822,587	0.75
中國黃金國際	395,000	41,903,575	0.53
中國太保	520,000	12,104,602	0.15
中國電信	5,800,000	21,447,356	0.27
重慶農村商業銀行	4,200,000	21,023,016	0.26
芯碁微裝	2,150	968,188	0.01
中偉新材	951,800	20,969,144	0.26
中國海洋石油	2,980,000	52,439,418	0.66
可孚醫療	684,700	17,492,031	0.22

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)
 截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
香港 (續)			
映恩生物－B	95,000	14,907,324	0.19
東鵬飲料	88,400	8,206,632	0.10
海天味業	1,050,000	27,169,884	0.34
吉利汽車	1,380,000	20,149,049	0.25
廣發証券	1,500,000	22,070,010	0.28
國泰海通	1,000,000	12,860,100	0.16
鰐龍科技	487,800	48,157,567	0.61
華虹宏力	151,000	28,140,843	0.35
工商銀行	13,430,000	74,783,343	0.94
貝殼－W	470,000	15,287,671	0.19
建滔積層板	498,000	42,760,222	0.54
領益智造	9,314,580	86,068,768	1.08
天辰生物-B	262,050	34,244,537	0.43
毛戈平	210,000	9,429,441	0.12
MINIMAX-W	19,500	7,041,879	0.09
豪威集團	2,600	176,413	0.00
中芯國際	1,322,000	102,349,769	1.30
順豐控股	720,000	18,792,893	0.24
聖邦股份	299,800	31,518,694	0.40
兆威機電	436,300	18,649,975	0.23
瑞博生物-B	1,111,800	45,156,202	0.57
匯聚科技	1,000,000	14,652,720	0.18
長飛光纖光纜	145,000	32,070,578	0.40

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)
截至二零二六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
上市/報價投資 (續)			
股本證券 (續)			
香港 (續)			
兗礦能源	1,000,000	9,569,300	0.12
中興通訊	900,000	17,801,496	0.22
非上市/報價投資			
債務證券			
香港			
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 2.7% A 19MAR2027	150,000,000	150,001,500	1.89
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 2.75% A 12MAR2027	100,000,000	100,002,000	1.26
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 3% A 30DEC2026	150,000,000	150,000,000	1.89
英屬維京群島			
CSCIF HONG KONG LTD 0% 25NOV2026	210,000,000	208,714,800	2.62
總投資		7,799,442,836	98.05
其他淨資產		155,046,251	1.95
於二零二六年六月三十日的淨資產總額		7,954,489,087	100.00
以成本計量的總投資		7,045,060,298	

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/ 股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資					
債務證券					
中國					
鴻路轉債	280,000	-	-	(33,580)	246,420
本鋼轉債	280,000	140,000	-	(420,000)	-
強力轉債	-	80,000	-	(80,000)	-
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD 5.5% A 14MAR2028 SHCH	20,000,000	-	-	-	20,000,000
26國債09	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
26國債01	-	6,750,000	-	(2,030,000)	4,720,000
25國債08	460,000	-	-	(460,000)	-
24特國01	4,460,000	600,000	-	(4,530,000)	530,000
CHINA POST GROUP CO LTD 2.13% A 28AUG2027 SHCH	30,000,000	-	-	-	30,000,000
22國新控股MTN002 (能源保供特別債)	1,100,000	-	-	-	1,100,000
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD S+0.95% Q 18JAN2027	200,000	-	-	-	200,000
康醫轉債	-	150,000	-	-	150,000
弘亞轉債	59,030	-	-	(59,030)	-
萬孚轉債	-	99,820	-	(99,820)	-
申昊轉債	17,540	-	-	-	17,540
江山轉債	215,450	69,260	-	-	284,710
裕興轉債	-	60,000	-	-	60,000
壘知轉債	102,550	99,993	-	-	202,543
靈康轉債	188,590	-	-	-	188,590
龍大轉債	324,320	-	-	(324,320)	-
風語轉債	-	61,590	-	(61,590)	-
華陽轉債	155,320	50,000	-	(60,000)	145,320
23深投05	100,000	-	-	-	100,000
康泰轉2	-	119,992	-	-	119,992

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/ 股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
債務證券(續)					
中國(續)					
仙樂轉債	-	332,611	-	-	332,611
綠茵轉債	57,062	-	-	(57,062)	-
天23轉債	-	80,000	-	-	80,000
威唐轉債	93,930	-	-	(93,930)	-
溫氏轉債	-	80,000	-	-	80,000
聞泰轉債	340,850	220,000	-	-	560,850
衛寧轉債	-	246,770	-	-	246,770
XIAMEN STATE OWNED CAPITAL OPERATION CO LTD 1.86% A 23APR2031 SHC	-	50,000,000	-	-	50,000,000
三角轉債	69,991	80,000	-	(69,990)	80,001
艾迪轉債	106,810	-	-	(106,810)	-
雙箭轉債	-	60,190	-	-	60,190
偉22轉債	-	13,150	-	-	13,150
冠宇轉債	-	60,000	-	-	60,000
香港					
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 3.4% S/A 14JAN2055 REGS	140,000,000	50,000,000	-	(50,000,000)	140,000,000
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.7% S/A 14MAY2056	38,000,000	-	-	-	38,000,000
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.7% S/A 14MAY2056	-	200,000,000	-	-	200,000,000
MTR CORP LTD 5.25% S/A 01APR2055	-	11,000,000	-	(6,000,000)	5,000,000
英屬維京群島					
CSI MTN LTD 3.1% A 13JUL2026	30,000,000	-	-	(30,000,000)	-
存託憑證					
美國					
富途控股有限公司	19,100	4,300	-	(23,400)	-
HUYA INC-ADR	950,000	-	-	(950,000)	-
知乎股份有限公司	8,396	-	-	-	8,396

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投 (續)					
集體投資計劃					
中國					
華寶添益	331	2	-	-	333
股本證券					
中國					
中微公司	191,769	-	45,947	(98,000)	139,716
航發動力	790,000	-	-	(420,000)	370,000
安琪酵母	969,967	170,000	-	-	1,139,967
古麒絨材	178	-	-	(178)	-
安徽合力	-	650,000	-	(650,000)	-
華爾泰	-	1,147,800	-	(1,147,800)	-
銅冠銅箔	-	230,000	-	-	230,000
江鎢裝備	-	2,450,000	-	-	2,450,000
普洛藥業	1,886,600	1,600,000	-	(2,286,600)	1,200,000
惠泰醫療	104,849	-	-	(104,849)	-
鵬鼎控股	-	200,000	-	-	200,000
中航光電	409,869	399,976	-	(409,869)	399,976
中航沈飛	831,736	-	-	(300,000)	531,736
南京銀行	1,200,000	-	-	-	1,200,000
寧波銀行	900,000	230,000	-	-	1,130,000
屹唐股份	3,505	-	-	(3,505)	-
昊創瑞通	165	-	-	(165)	-
昊華能源	-	2,598,300	-	(1,500,000)	1,098,300
金山辦公	150,000	-	-	(150,000)	-
萊伯泰科	-	200,000	-	(200,000)	-
北新建材	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
昂瑞微	2,319	-	-	-	2,319
維通利	-	1,287	-	(900)	387

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年六月三十日
上市/報價投(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
百奧賽圖	423	-	-	(423)	-
比亞迪	257,000	535,000	-	(65,000)	727,000
寒武紀	51,480	20,000	22,285	(6,000)	87,765
電科藍天	-	17,168	-	(15,451)	1,717
星宇股份	-	221,911	-	-	221,911
三環集團	-	519,913	-	(519,913)	-
巨集明電子	-	2,377	-	(1,663)	714
赤峰黃金	-	510,000	-	(130,000)	380,000
中國汽研	300,000	-	-	(300,000)	-
建設銀行	3,149,990	-	-	-	3,149,990
中國船舶	-	619,993	-	-	619,993
海南橡膠	-	2,000,000	-	-	2,000,000
中集集團	-	2,399,993	-	(2,399,993)	-
中國巨石	1,510,000	570,000	-	(1,500,000)	580,000
招商銀行	3,040,000	-	-	-	3,040,000
招商證券	-	949,974	-	(949,974)	-
洛陽鉬業	2,780,000	300,000	-	(3,080,000)	-
中國鈷業	2,277	-	-	(2,277)	-
北方稀土	-	709,996	-	-	709,996
中國太保	2,089,000	-	-	-	2,089,000
中國動力	-	1,780,000	-	-	1,780,000
長江電力	-	1,999,886	-	-	1,999,886
臻寶科技	-	2,070	-	-	2,070
國際複材	-	1,399,976	-	(1,399,976)	-
渝農商行	5,500,000	1,100,000	-	-	6,600,000
至信股份	-	1,115	-	(1,003)	112
中國海油	765,000	-	-	(140,000)	625,000

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
寧德時代	520,497	91,000	-	(113,000)	498,497
南網數字	2,322	-	-	(2,322)	-
阿特斯	-	1,000,000	-	(161,631)	838,369
石藥創新	-	600,000	-	(600,000)	-
大明電子	111	-	-	(111)	-
晉控煤業	-	700,000	-	(700,000)	-
德力佳	567,396	-	-	(146)	567,250
超穎電子	169	-	-	(169)	-
東鵬飲料	-	194,914	50,674	(167,052)	78,536
新易盛	81,000	118,000	79,600	-	278,600
億緯鋰能	-	399,960	-	(399,960)	-
方大炭素	2,099,906	1,700,000	-	(3,799,906)	-
分眾傳媒	2,700,000	-	-	(2,700,000)	-
工業富聯	-	750,000	-	(550,000)	200,000
萬辰集團	-	94,967	-	-	94,967
元力股份	-	400,000	-	-	400,000
福耀玻璃	185,000	624,938	-	(185,000)	624,938
甘李藥業	562,870	219,976	-	-	782,846
廣發證券	-	1,150,000	-	-	1,150,000
聚辰股份	-	280,000	-	(90,000)	190,000
歌爾股份	600,000	-	-	(600,000)	-
固德電材	-	1,168	-	(1,051)	117
格力電器	219,863	-	-	(219,863)	-
有研複材	-	8,337	-	(7,503)	834
東鵬控股	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
海大集團	-	420,000	-	-	420,000
和勝股份	-	449,941	-	(449,941)	-

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
廣東建科	656	-	-	(656)	-
廣匯能源	-	2,900,000	-	(2,900,000)	-
慧穀新材	-	952	-	(856)	96
瑞立科密	137	-	-	(137)	-
視源股份	469,845	-	-	(469,845)	-
天賜材料	-	1,009,926	-	(770,000)	239,926
川恆股份	-	670,000	-	-	670,000
航太電器	580,000	-	-	(580,000)	-
國泰海通	-	2,799,977	-	-	2,799,977
海安集團	371	-	-	(371)	-
海陽科技	105	-	-	(105)	-
福斯特	1	-	-	-	1
福恩股份	-	1,333	-	(1,199)	134
高特電子	-	5,455	-	(4,909)	546
海康威視	674,998	400,000	-	(1,074,998)	-
漢桑科技	245	-	-	(245)	-
昊華科技	789,851	-	-	(789,851)	-
恒鑫生活	1	-	-	-	1
北大荒	2,700,000	-	-	(2,700,000)	-
飛龍股份	-	500,000	-	-	500,000
新恒匯	382	149,985	-	(382)	149,985
海興電力	1,229,935	-	-	(1,229,935)	-
悍高集團	160	-	-	(160)	-
惠科股份	-	16,218	-	(9,730)	6,488
宏發股份	1,959,976	-	-	(1,080,000)	879,976
合盛砂業	-	410,000	-	(410,000)	-
華電新能	257,912	-	-	(257,912)	-

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
華蘭生物	3,139,808	-	-	(3,139,808)	-
華泰證券	2,090,000	2,280,000	-	(2,090,000)	2,280,000
華域汽車	2,720,000	-	-	(2,720,000)	-
湖南裕能	1,000	-	-	(1,000)	-
海光信息	-	191,000	-	-	191,000
雲漢芯城	110	-	-	(110)	-
工商銀行	5,999,861	-	-	-	5,999,861
中鹽化工	-	3,299,980	-	(3,299,980)	-
雙欣材料	897	-	-	-	897
興業銀錫	660,000	400,000	-	(660,000)	400,000
伊利股份	1,430,000	-	-	(1,430,000)	-
包鋼股份	-	9,000,000	-	-	9,000,000
北芯生命	-	4,998	-	(3,498)	1,500
合合信息	1	-	-	-	1
奕瑞科技	-	318,000	47,200	-	365,200
易思維	-	1,766	-	(1,589)	177
艾森股份	-	100,000	-	(100,000)	-
恒立液壓	97,000	-	-	(97,000)	-
恒瑞醫藥	669,840	260,000	-	(204,000)	725,840
恩華藥業	1,499,795	250,000	-	(540,000)	1,209,795
揚農化工	249,970	-	-	(249,970)	-
紅板科技	-	3,300	-	(2,970)	330
正邦科技	4,000,000	2,000,000	-	-	6,000,000
華新精科	82	-	-	(82)	-
德福科技	-	320,000	-	(90,000)	230,000
東威科技	-	220,000	-	(220,000)	-
貴州茅臺	30,022	142,910	-	(42,910)	130,022

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
龍佰集團	650,000	1,100,000	-	(650,000)	1,100,000
隆基綠能	-	750,000	-	(750,000)	-
羅萊生活	-	3,800,000	-	-	3,800,000
盛龍股份	-	5,807	-	(4,064)	1,743
魯西化工	2,799,988	-	-	(2,799,988)	-
立訊精密	1,195,000	400,000	-	(610,000)	985,000
瀘州老窖	94,998	-	-	(94,998)	-
馬可波羅	1,626	-	-	(1,626)	-
聯芸科技	-	330,000	-	-	330,000
卓勝微	-	149,903	-	(149,903)	-
沐曦股份	3,994	-	-	-	3,994
南微醫學	255,452	65,000	-	(320,452)	-
美的集團	1,057,872	195,000	-	-	1,252,872
瀾起科技	-	281,000	-	-	281,000
摩爾執行緒	10,828	-	-	-	10,828
牧原股份	619,970	-	-	(200,000)	419,970
三瑞智能	-	2,157	-	(1,941)	216
北方華創	74,666	113,000	-	(74,666)	113,000
惠康科技	-	947	-	(662)	285
健信超導	265	-	-	-	265
東方電纜	-	969,998	104,000	(1,073,998)	-
拓普集團	353,100	-	-	(353,100)	-
寶豐能源	-	2,170,000	-	(2,170,000)	-
聯瑞新材	-	120,000	-	-	120,000
歐派家居	-	300,499	-	(300,499)	-
奧瑞金	4,000,000	-	-	(4,000,000)	-
中國平安	1,890,000	-	-	-	1,890,000

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
拓荊科技	-	85,000	-	(85,000)	-
濮耐股份	-	6,900,000	-	(6,900,000)	-
齊魯銀行	7,300,000	2,200,000	-	-	9,500,000
海容冷鏈	2,459,960	-	-	(2,459,960)	-
青島港	-	2,100,000	-	-	2,100,000
鹽湖股份	-	1,089,950	-	-	1,089,950
嘉德利	-	1,031	-	(927)	104
睿創微納	-	300,000	-	-	300,000
中稀有色	-	100,000	-	(100,000)	-
納百川	151	-	-	-	151
順豐控股	110,000	200,000	-	-	310,000
賽輪輪胎	2,921,418	1,200,000	-	(2,921,418)	1,200,000
三一重工	897,301	-	-	(897,301)	-
思看科技	1	-	-	-	1
聯訊儀器	-	1,624	-	(1,461)	163
博苑新材	1	-	-	-	1
春光集團	-	2,898	-	(2,608)	290
山東黃金	600,000	280,000	-	(880,000)	-
豪邁科技	410,000	119,940	114,750	(644,690)	-
信通電子	94	-	-	(94)	-
山大電力	277	-	-	(277)	-
愛旭股份	2,859,783	630,000	-	(400,000)	3,089,783
百潤股份	689,996	1,299,968	-	-	1,989,964
建發致新	447	-	-	(447)	-
電科數字	-	400,000	-	(400,000)	-
漢鐘精機	-	1,360,000	-	(646,000)	714,000
晨光股份	-	780,000	-	(780,000)	-

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
浦發銀行	1,899,911	-	-	(1,899,911)	-
譽帆科技	69	-	-	-	69
友升股份	139	-	-	(139)	-
雅創電子	-	369,943	-	(369,943)	-
尚水智能	-	1,379	-	(1,241)	138
山金國際	600,000	460,000	-	(1,060,000)	-
山推股份	-	3,799,950	-	(3,799,950)	-
山西汾酒	152,000	40,000	-	(190,200)	1,800
生益科技	315,000	335,900	-	(193,100)	457,800
深南電路	141,910	-	-	(39,000)	102,910
中電港	-	1,645,000	-	(1,645,000)	-
恒運昌	-	1,155	-	(1,039)	116
興森科技	-	520,000	-	-	520,000
匯創達	-	320,000	-	(320,000)	-
匯川技術	-	819,999	-	-	819,999
傑美特	-	100,000	-	-	100,000
江波龍	-	58,000	-	(58,000)	-
邁瑞醫療	130,000	-	-	(130,000)	-
菲菱科思	-	115,000	46,000	(161,000)	-
順絡電子	450,000	-	-	(450,000)	-
優優綠能	73	-	-	(73)	-
世盟股份	-	570	-	(513)	57
川投能源	-	2,699,983	-	-	2,699,983
匯宇製藥	1,889,297	-	-	(1,889,297)	-
科倫藥業	599,962	1,149,937	-	(599,962)	1,149,937
中密控股	-	909,980	-	(909,980)	-
思源電氣	-	149,989	-	-	149,989

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
盛合晶微	-	23,902	-	(21,511)	2,391
陽光電源	-	437,831	-	-	437,831
東山精密	-	222,000	-	-	222,000
豐倍生物	88	-	-	(88)	-
華之傑	57	-	-	(57)	-
聯合動力	7,395	-	-	(7,395)	-
天孚通信	-	62,980	19,200	-	82,180
新廣益	195	-	-	-	195
唐山港	-	4,500,000	-	-	4,500,000
道生天合	451	-	-	(451)	-
泰豪科技	-	693,800	-	(693,800)	-
天海電子	-	2,394	-	(1,675)	719
通威股份	520,000	-	-	(520,000)	-
三角輪胎	-	1,620,000	-	(1,620,000)	-
技源集團	155	-	-	(155)	-
紫光國微	255,000	-	-	(255,000)	-
唯捷創芯	-	1,050,000	-	-	1,050,000
芯原股份	161,000	68,000	-	(110,000)	119,000
勝宏科技	38,000	-	-	(38,000)	-
萬華化學	439,901	-	-	-	439,901
濰柴重機	-	820,000	-	(820,000)	-
濰柴動力	-	1,140,000	-	-	1,140,000
光威複材	-	820,000	-	(820,000)	-
長進光子	-	1,271	-	(1,143)	128
帝爾鐳射	-	193,000	-	-	193,000
埃泰克	-	716	-	(644)	72
五糧液	79,000	-	-	(79,000)	-

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
滬電股份	365,979	60,000	—	(80,000)	345,979
滬電股份	—	90,000	—	(85,000)	5,000
藥明康德	—	325,000	—	—	325,000
理奇智能	—	4,325	—	(3,892)	433
特寶生物	—	200,000	—	(200,000)	—
廈門銀行	4,621,400	1,200,000	—	—	5,821,400
恒坤新材	563	—	—	(563)	—
優迅股份	131	—	—	(131)	—
西安奕材	44,370	—	—	—	44,370
泰金新能	—	2,337	—	(2,103)	234
三角防務	1,000,000	—	—	(1,000,000)	—
天富龍	153	—	—	(153)	—
傑瑞股份	330,000	170,000	—	(330,000)	170,000
益豐藥房	—	1,650,000	—	(1,650,000)	—
新洋豐	—	1,900,000	—	—	1,900,000
永興材料	—	329,930	—	—	329,930
圓通速遞	2,239,792	—	—	—	2,239,792
源傑科技	—	12,000	—	—	12,000
雲鋁股份	1,890,000	300,000	—	(1,059,000)	1,131,000
錫業股份	1,830,000	—	—	(1,830,000)	—
海亮股份	—	3,950,000	—	(1,800,000)	2,150,000
浙江龍盛	—	1,440,000	—	—	1,440,000
新和成	1,199,729	—	—	(1,199,729)	—
閏土股份	1,401,300	—	—	(1,401,300)	—
振石股份	—	7,741	—	(6,966)	775
中策橡膠	724	—	—	(724)	—
中際旭創	112,910	143,800	—	—	256,710

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
中金黃金	-	710,000	-	(230,000)	480,000
中曼石油	960,000	600,000	-	(1,560,000)	-
紫金礦業	3,539,957	449,936	-	(550,000)	3,439,893
香港					
三生製藥	1,141,000	-	-	(1,141,000)	-
瑞聲科技	-	400,000	-	(400,000)	-
中國國航	4,200,000	-	-	(4,200,000)	-
阿裡巴巴-W	-	273,000	-	(273,000)	-
凱萊英	102,000	360,000	-	(260,000)	202,000
建發國際集團	-	1,800,000	-	(609,000)	1,191,000
建設銀行	8,560,000	-	-	-	8,560,000
中國黃金國際	-	545,000	-	(150,000)	395,000
中集集團	-	1,750,000	-	(1,750,000)	-
康哲藥業	1,450,000	-	-	(1,450,000)	-
招商證券	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
中國移動	283,000	-	-	(283,000)	-
中國太保	520,000	-	-	-	520,000
中國電信	7,000,000	-	-	(1,200,000)	5,800,000
中國聯通	3,700,000	-	-	(3,700,000)	-
重慶農村商業銀行	-	4,200,000	-	-	4,200,000
芯碁微裝	-	2,150	-	-	2,150
中偉新材	1,131,800	200,000	-	(380,000)	951,800
中國海洋石油	-	2,980,000	-	-	2,980,000
可孚醫療	-	684,700	-	-	684,700
海光芯正	-	11,200	-	(11,200)	-
石藥集團	3,280,000	1,650,000	-	(4,930,000)	-
東嶽集團	-	500,000	-	(500,000)	-

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年六月三十日
上市/報價投資(續)					
股本證券(續)					
中國(續)					
映恩生物-B	-	120,000	-	(25,000)	95,000
東鵬飲料	-	68,000	20,400	-	88,400
海天味業	-	1,050,000	-	-	1,050,000
協鑫科技	12,000,000	-	-	(12,000,000)	-
吉利汽車	-	1,980,000	-	(600,000)	1,380,000
廣發証券	-	1,500,000	-	-	1,500,000
兆易創新	-	5,600	-	(5,600)	-
長城汽車	3,221,000	-	-	(3,221,000)	-
國泰海通	1,650,000	1,000,000	-	(1,650,000)	1,000,000
鈞達股份	-	510,000	-	(510,000)	-
鱈龍科技	-	487,800	-	-	487,800
華虹宏力	343,000	80,000	-	(272,000)	151,000
華勤技術	-	282,400	-	(282,400)	-
工商銀行	10,830,000	2,600,000	-	-	13,430,000
信達生物	162,000	-	-	(162,000)	-
英矽智能	17,000	-	-	(17,000)	-
貝殼-W	-	1,160,000	-	(690,000)	470,000
建滔積層板	-	506,000	-	(8,000)	498,000
智譜	-	33,600	-	(33,600)	-
領益智造	-	9,314,580	-	-	9,314,580
天辰生物-B	-	262,050	-	-	262,050
邁威生物-B	-	1,067,000	-	(1,067,000)	-
毛戈平	-	210,000	-	-	210,000
MINIMAX-W	-	19,500	-	-	19,500
敏實集團	800,000	-	-	(800,000)	-
牧原股份	-	500,000	-	(500,000)	-
赤子城科技	2,054,000	-	-	(2,054,000)	-

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)
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六 年一月一日	增加	持股量 紅利/ 股利	減少	二零二六年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
股本證券 (續)					
中國 (續)					
豪威集團	-	2,600	-	-	2,600
康龍化成	720,000	-	-	(720,000)	-
中芯國際	1,002,000	320,000	-	-	1,322,000
順豐控股	480,000	240,000	-	-	720,000
聖邦股份	-	299,800	-	-	299,800
山東黃金	-	400,000	-	(400,000)	-
曦智科技-P	-	1,365	-	(1,365)	-
兆威機電	-	606,300	-	(170,000)	436,300
天嶽先進	400,000	-	-	(400,000)	-
樂舒適	350,600	500,000	-	(850,600)	-
瑞博生物-B	-	1,111,800	-	-	1,111,800
騰訊控股	141,500	-	-	(141,500)	-
匯聚科技	-	1,000,000	-	-	1,000,000
勝宏科技	-	11,200	-	(11,200)	-
萬國黃金集團	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
新特能源	1,868,000	-	-	(1,868,000)	-
信義玻璃	6,400,000	-	-	(6,400,000)	-
長飛光纖光纜	-	575,000	-	(430,000)	145,000
兗礦能源	-	1,000,000	-	-	1,000,000
時代電氣	750,000	410,000	-	(1,160,000)	-
中興通訊	750,000	900,000	-	(750,000)	900,000

非上市/報價投資

債務證券

香港

HKCG FINANCE LTD 3% A 19JAN2026	5,000,000	-	-	(5,000,000)	-
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 2.7% A 19MAR2027	-	150,000,000	-	-	150,000,000
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 2.75% A 12MAR2027	-	100,000,000	-	-	100,000,000

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)
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

	二零二六年 一月一日	增加	持股量 紅利/股利	減少	二零二六年 六月三十日
非上市/報價投資(續)					
債務證券(續)					
香港(續)					
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 2.85% A 14APR2026	- 100,000,000		- (100,000,000)		-
TF INTERNATIONAL SECURITIES GROUP LTD 3% A 30DEC2026	- 150,000,000		-	- 150,000,000	
新加坡					
SAUDI NATIONAL BANK/SINGAPORE 2.11% 02SEP2026	100,000,000	-	- (100,000,000)		-
英屬維京群島					
CNCBINV 1 BVI LTD 2.7% A 10APR2026	91,000,000	-	- (91,000,000)		-
CSCIF HONG KONG LTD 0% 25NOV2026	- 210,000,000		-	- 210,000,000	
CSCIF HONG KONG LTD 2.5% S/A 24MAR2026	20,000,000	-	- (20,000,000)		-

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)

表現記錄 (未經審計)
截至二零二六年六月三十日

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	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)
		(人民幣)	(美元)	(港元)	(美元)	(港元)	(人民幣)
二零二六年六月三十日	7,954,489,087	12.59	10.54	10.71	16.26	16.03	13.53
二零二五年十二月三十一日	5,883,549,623	12.36	10.08	10.16	14.94	14.62	12.79
二零二四年十二月三十一日	4,764,625,908	11.48	8.99	9.03	12.17	11.88	10.95
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

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					
		新加坡元A類	新加坡元P類 (派息)	新加坡元P類 (累算)	港元P類 (派息)	人民幣P類 (派息)	美元P類 (派息)
		(新加坡元)	(新加坡元)	(新加坡元)	(港元)	(人民幣)	(美元)
二零二六年六月三十日	7,954,489,087	13.64	13.64	13.78	12.92	12.23	12.86
二零二五年十二月三十一日	5,883,549,623	12.46	12.46	12.59	11.78	11.56	11.81
二零二四年十二月三十一日	4,764,625,908	10.75	10.75	10.87	9.59	9.91	9.60
二零二三年十二月三十一日	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)

表現記錄 (未經審計)
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值

截至下列日期止的財務年度	每基金單位最高發行價值			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)	人民幣A類 (人民幣)	美元A類 (美元)	港元A類 (港元)
二零二六年六月三十日	13.00	10.85	11.01	11.82	9.72	9.86
二零二五年十二月三十一日	12.82	10.26	10.34	10.73	8.39	8.44
二零二四年十二月三十一日	12.34	10.07	10.13	10.38	8.41	8.49
二零二三年十二月三十一日	14.22	12.31	12.46	11.07	8.99	9.07
二零二二年十二月三十一日	16.68	15.38	15.47	12.70	10.15	10.29
二零二一年十二月三十一日	18.61	17.14	17.14	16.67	15.11	15.15
二零二零年十二月三十一日	17.46	15.87	15.87	12.49	10.40	10.40
二零一九年十二月三十一日	14.32	12.60	12.75	11.57	10.10	10.20
二零一八年十二月三十一日	15.41	14.68	14.79	11.65	10.17	10.26
二零一七年十二月三十一日	15.02	13.69	13.78	12.45	10.89	10.89
二零一六年十二月三十一日	13.25	11.93	11.93	11.60	10.71	10.75
二零一五年十二月三十一日	17.90	17.62	17.60	11.96	11.28	11.26
二零一四年十二月三十一日	13.17	12.94	12.93	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)

表現記錄 (未經審計)
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值(續)

截至下列日期止的財務年度	每基金單位最高發行價值			每基金單位最低贖回價值		
	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)	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)
二零二六年六月三十日	16.52	16.26	13.75	14.70	14.47	12.46
二零二五年十二月三十一日	14.97	14.63	13.03	11.63	11.36	10.44
二零二四年十二月三十一日	13.29	12.99	11.49	10.99	10.78	9.58
二零二三年十二月三十一日	13.77	13.57	10.06	10.94	10.75	9.57
二零二二年十二月三十一日	15.76	15.45	—	11.12	10.98	—
二零二一年十二月三十一日	16.45	16.06	—	14.65	14.30	—
二零二零年十二月三十一日	15.23	14.85	—	9.48	9.24	—
二零一九年十二月三十一日	10.81	10.58	—	10.00	9.89	—

截至下列日期止的財務年度	每基金單位最高發行價值			每基金單位最低贖回價值		
	新加坡元 A 類 (新加坡元)	新加坡元 P 類 (派息) (新加坡元)	新加坡元 P 類 (累算) (新加坡元)	新加坡元 A 類 (新加坡元)	新加坡元 P 類 (派息) (新加坡元)	新加坡元 P 類 (累算) (新加坡元)
二零二六年六月三十日	13.74	13.74	13.89	12.26	12.26	12.39
二零二五年十二月三十一日	12.63	12.63	12.77	10.16	10.16	10.27
二零二四年十二月三十一日	11.23	11.23	11.33	9.27	9.27	9.36

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)
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值(續)

截至下列日期止的財務年度	每基金單位最高發行價值			每基金單位最低贖回價值		
	港元P類 (派息) (港元)	人民幣P類 (派息) (人民幣)	美元P類 (派息) (美元)	港元P類 (派息) (港元)	人民幣P類 (派息) (人民幣)	美元P類 (派息) (美元)
二零二六年六月三十日	13.11	12.43	13.06	11.66	11.27	11.62
二零二五年十二月三十一日	11.80	11.78	11.83	9.16	9.45	9.18
二零二四年十二月三十一日	10.03	10.12	10.03	9.45	9.64	9.43

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 2025 年 12 月 31 日止年度財務報表附注 2 所述的一致。

注1：截至2026年6月30日及2025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

	30/06/2026	31/12/2025
中銀國際英國保誠信託有限公司	164,050	325,650

注2：截至2026年6月30日及2025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

	30/06/2026	31/12/2025
中國銀行（香港）有限公司	5,759	7,343