
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

截至二零一七年六月三十日止期間





大成投資信託基金
二零一七年一月一日截至二零一七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
財務狀況報表（未經審計）	3
全面收入報表（未經審計）	4
基金單位持有人應佔資產淨值變動報表（未經審計）	5
大成中國靈活配置基金	6-27
- 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）	

大成投資信託基金
截至二零一七年六月三十日止期間

基金管理和基金行政

基金經理董事

羅登攀先生
周健男先生
溫智敏先生
譚曉岡先生
許自傑先生
吳萍女士
梁仲昆先生

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
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(郵政編碼：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
香港銅鑼灣威非路道18號
萬國寶通銀行中心12及25樓

基金經理法律顧問

西盟斯律師行
香港中環金鐘道88號
太古廣場一期13樓

中國投資顧問

大成基金管理有限公司
中國深圳市(郵政編碼：518040)
福田區深南大道7088號
招商銀行大廈32樓

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港中環皇后大道中15號
公爵大廈21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。截至二零一七年六月三十日，大成中國靈活配置基金的RMB Class A每單位資產淨值為人民幣13.81元，USD Class A每單位資產淨值為美元12.34元，HKD Class A每單位資產淨值為港幣12.41元，累計總資產規模為人民幣908,288,818元。

市場回顧

回顧2017年上半年，A股的表現不俗，滬深300指數回報率為10.78%，但相對恒生指數同期漲幅17.11%的表現相對滯後。展望下半年，我們預計在企業盈利回升、流動性緩解、以及海外資金回流等因素的共同推動下，A股市場有望後來居上。

我們預計下半年經濟增長保持韌性，企業盈利有望進一步回升。雖然下半年經濟增長可能受到基數效應影響有所放緩，但在房地產投資穩健、企業資本開支觸底回升、以及外需改善的情形下，經濟增長可能較市場預期更具韌性。6月份的PMI資料強於預期可能就是先兆。企業盈利有望在經濟保持韌性的背景下繼續改善，中報預計將在7月13日開始披露，目前1241家公司披露中報預告，業績向好的比例在75%左右。

流動性存在繼續緩解的空間。預計下半年短期收益率將明顯下行、收益率曲線有望重新陡峭化，主要考慮到債券通的開通，以及金融去杠杆更多是依靠升級規則而非持續的緊縮流動性。近期債市短期、長期的收益率已經有所下跌，短端下行更多。除此之外，海外資金有望持續流入A股。受MSCI指數納入A股的長期利好帶動，疊加美元維持弱勢的預期，海外資金有望持續流入A股市場。

在大類資產配置的策略方面，基於對下半年短期收益率下行的預測，我們在短期債券的配置將也會相應提升。在選股方面，我們將積極配置符合消費升級趨勢的家電、醫藥、家居家裝等行業；受益於流動性改善的金融板塊；以及受益於企業資本開支回升的機械板塊。

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)
截至二零一七年六月三十日

	大成中國靈活配置基金	
	二零一七年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零一六年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	153,490	191,534
流動資產		
按公平價值透過損益記賬的金融資產	875,702,405	607,491,887
應收利息	8,849,848	3,286,702
應收申購款	15,133,086	-
出售投資項目應收款	447,695	-
預付款與其他資產	-	50
現金及現金等價物	40,652,854	88,256,688
總資產	<u>940,939,378</u>	<u>699,226,861</u>
負債		
非流動負債		
遞延所得稅負債	35,356	34,620
流動負債		
應付管理費用	920,222	819,096
應付贖回款	9,398,878	3,572,455
購入投資項目應付款	9,176,800	-
預提費用及其他應付款	1,180,481	716,620
應付派息	10,403,973	12,833,270
預提稅款準備金	1,534,850	545,478
總負債	<u>32,650,560</u>	<u>18,521,539</u>
基金單位持有人應佔資產淨值	<u>908,288,818</u>	<u>680,705,322</u>
已發行單位		
- 人民幣 A 類單位	11,965,806	14,174,909
- 美元 A 類單位	4,191,116	2,959,272
- 港元 A 類單位	36,418,030	28,884,171
每單位資產淨值		
- 人民幣 A 類單位	13.81	12.43
- 美元 A 類單位	12.34	10.83
- 港元 A 類單位	12.41	10.82

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

大成中國靈活配置基金

	自二零一七年一月一日至 二零一七年六月三十日止期間	自二零一六年一月一日至 二零一六年十二月三十一日止期間
	(未經審計) 人民幣	(經審計) 人民幣
收益		
股息收益	4,963,099	17,301,233
利息收益	5,775,528	9,380,529
投資淨收益/(損失)	90,874,420	(35,123,033)
匯兌淨損失	(980,350)	(1,650,704)
總投資收益	100,632,697	(10,091,975)
開支		
管理費用	4,755,284	11,162,893
受託人費用	510,325	1,227,918
託管費	443,651	750,460
交易買賣費用	1,526,212	1,990,101
核數師酬金	95,518	222,934
其他費用	140,982	136,392
總經營支出	7,471,972	15,490,698
利潤分派前及稅前收益/(損失)	93,160,725	(25,582,673)
對基金單位持有人的分派利潤	(16,360,886)	(35,833,575)
利潤分派後及稅前收益/(損失)	76,799,839	(61,416,248)
稅項	(1,969,779)	(1,748,395)
基金單位持有人應佔資產淨值之減少	74,830,060	(63,164,643)

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	自二零一七年一月一日至 二零一七年六月三十日止期間 (未經審計) 人民幣	自二零一六年一月一日至 二零一六年十二月三十一日 止期間 (經審計) 人民幣
期初基金單位持有人應佔資產淨值	680,705,322	1,021,165,586
發行單位所得款項	381,721,503	192,454,009
贖回單位所得款項	(228,968,067)	(469,749,630)
來自單位元元元交易的增加/(減少)淨額	152,753,436	(277,295,621)
基金單位持有人應佔資產淨值之增加/(減少)	74,830,060	(63,164,643)
期末基金單位持有人應佔資產淨值	908,288,818	680,705,322



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)
截至二零一七年六月三十日

上市/報價股票	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票			
農業銀行	6,229,840	21,929,037	2.41
中國鋁業	1,000,000	4,520,000	0.50
安徽合力	270,000	3,537,000	0.39
中國銀行	3,600,000	13,320,000	1.47
碧水源	200,500	3,739,325	0.41
長纜科技	348	6,271	0.00
中航光電	274,121	8,549,834	0.94
建設銀行	3,440,510	21,159,137	2.33
中青旅	349,839	7,367,609	0.81
葛洲壩	450,000	5,058,000	0.56
中集集團	345,000	6,220,350	0.68
中國巨石	48,000	527,040	0.06
招商銀行	475,000	11,357,250	1.25
中國太保	360,000	12,193,200	1.34
中國石化	2,309,984	13,698,205	1.51
華潤三九	654,043	20,765,865	2.29
中南傳媒	1,161,658	21,653,305	2.38
中信證券	1,200,000	20,424,000	2.25
大秦鐵路	1,999,938	16,779,480	1.85
峨眉山A	352,542	4,477,283	0.49
金融街	550,574	6,452,727	0.71
睿能申購	340	6,868	0.00
福耀玻璃	400	10,416	0.00
歌爾股份	168,300	3,244,824	0.36
國科微	231	1,959	0.00
格力電器	430,000	17,703,100	1.95

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)
截至二零一七年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票(續)			
迪生力	910	10,147	0.00
白雲機場	400,000	7,384,000	0.81
廣州酒家	401	10,133	0.00
國泰君安	500,000	10,255,000	1.13
巨星科技	350,000	5,453,000	0.60
海康威視	2,423	78,263	0.01
滬寧股份	141	2,456	0.00
神火股份	502,781	3,665,273	0.40
雙匯發展	100,000	2,375,000	0.26
華蘭生物	129,944	4,742,956	0.52
黃山旅遊	239,950	4,103,145	0.45
華泰證券	175,000	3,132,500	0.34
華域汽車	200,000	4,848,000	0.53
工商銀行	2,300,000	12,075,000	1.33
伊利股份	800,000	17,272,000	1.90
大燁智能	211	2,306	0.00
寧滬高速	958,400	9,392,320	1.03
恒瑞醫藥	129,940	6,573,665	0.72
日盈電子	232	3,526	0
洋河股份	50,000	4,340,500	0.48
利源精製	4,000	45,480	0.01
金龍羽	844	5,233	0.00
君禾資本	292	2,608	0.00
金正大	659,225	4,963,964	0.55
五礦資本	319,948	3,874,570	0.43
江豐電子	350	6,682	0.00
貴州茅台	18,988	8,959,488	0.99
老鳳祥	149,962	7,343,639	0.81
美的集團	160,000	6,886,400	0.76
新 希 望	800	6,576	0.00
旭升申購	513	5,776	0.00
中國平安	50,000	22,324,500	2.46
青島海爾	460,200	6,926,010	0.76

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)
截至二零一七年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
股票 (續)			
三一重工	799,908	6,503,252	0.72
東阿阿膠	110,000	7,907,900	0.87
山東黃金	80,000	2,314,400	0.25
南山鋁業	1,000,000	3,390,000	0.37
復星醫藥	333,166	10,324,814	1.14
富滿電子	263	2,133	0.00
匯川技術	229,929	5,872,387	0.65
美格智能	313	7,155	0.00
華僑城A	300,000	3,018,000	0.33
華體科技	328	8,692	0.00
外運發展	499,892	9,462,956	1.04
易德龍	529	14,415	0.00
金螳螂	400,000	4,392,000	0.48
三孚股份	466	7,829	0.00
五糧液	137,600	7,658,816	0.84
許繼電氣	200,000	3,592,000	0.40
雲鋁股份	550,000	3,971,000	0.44
志邦股份	518	17,508	0.00
誠邦股份	649	13,798	0.00
航民股份	450,000	5,832,000	0.64
宇通客車	413,650	9,087,891	1.00
浙商證券	4,047	68,839	0.01

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)
截至二零一六年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
報價債務證券			
航信轉債	1,110	114,805	0.01
14長證債	313,405	31,588,748	3.48
15中國信達債01	100,000	9,948,510	1.10
15國債17	70	6,965	0.00
01國債7	200,000	20,510,600	2.26
15五礦股MTN003	100,000	9,912,020	1.09
15中外貿租賃債	100,000	9,983,290	1.10
16華南01	277,710	26,640,720	2.93
16華南02	134,000	13,487,301	1.48
15華南城	63,000	6,216,714	0.68
16萬達01	140,000	13,466,600	1.48
16大連萬達MTN004	200,000	18,789,740	2.07
17福特汽車02	100,000	10,184,470	1.12
08中冶債	500,000	50,724,950	5.59
14京銀債	50,000	5,001,975	0.55
11南鋼債	106,050	10,636,815	1.17
13南山集MTN002	100,000	10,147,210	1.12
15复星醫藥MTN001	100,000	9,887,470	1.09
12科倫01	180,000	18,019,422	1.98
13瑞水泥	84,140	8,224,677	0.91
11廣匯01	58,690	5,901,280	0.65
11吉利債	500,000	50,826,300	5.61



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)
截至二零一七年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	佔資產淨值 百分比%
集體投資計劃			
華寶添益	85,235	8,523,926	0.94
申萬深成	1	1	0.00
銀華日利	410,000	41,717,910	4.60
上市或報價投資		875,702,405	96.41
其他淨資產		32,586,413	3.59
截至二零一七年六月三十日淨資產總額		908,288,818	100
以成本計量的總資產		830,391,064	

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	增加	公司行動	減少	二零一七年六月 三十日
股票					
正裕工業	-	219	-	(219)	-
光庫科技	-	242	-	(242)	-
農業銀行	2,429,840	3,800,000	-	-	6,229,840
中國鋁業	-	1,000,000	-	-	1,000,000
海螺水泥	549,967	269,885	-	(819,852)	-
安徽合力	-	270,000	-	-	270,000
皖天然氣	1,677	-	-	(1,677)	-
安奈兒	-	206	-	(206)	-
安正時尚	-	784	-	(784)	-
白銀有色	-	11,556	-	(11,556)	-
中國銀行	1,900,000	3,600,000	-	(1,900,000)	3,600,000
交通銀行	2,429,928	799,955	-	(3,229,883)	-
科銳國際	-	512	-	(512)	-
碧水源	350,500	-	-	(150,000)	200,500
同仁堂	-	124,225	-	(124,225)	-
海量數據	-	398	-	(398)	-
泰嘉股份	-	263	-	(263)	-
比音勒芬	623	-	-	(623)	-
滄州明珠	125,000	-	-	(125,000)	-
長纜科技	-	348	-	-	348
瑞特股份	-	138	-	(138)	-
中航光電	54,000	219,921	40,200	(40,000)	274,121
中信銀行	528,100	-	-	(528,100)	-
建設銀行	1,640,510	2,800,000	-	(1,000,000)	3,440,510
中青旅	-	349,839	-	-	349,839

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六月 三十日
股票(續)					
中國銀河	-	8,130	-	(8,130)	-
葛洲壩	-	450,000	-	-	450,000
中集集團	500,000	230,000	-	(385,000)	345,000
中國巨石	-	340,000	8,000	(300,000)	48,000
中國人壽	399,932	-	-	(399,932)	-
招商銀行	-	925,000	-	(450,000)	475,000
招商蛇口	250,000	150,000	-	(400,000)	-
中國太保	480,163	-	-	(120,163)	360,000
中國石化	1,310,000	999,984	-	-	2,309,984
中國鐵建	699,990	-	-	(699,990)	-
華潤三九	414,100	239,943	-	-	654,043
中南傳媒	-	1,161,658	-	-	1,161,658
中國建築	200,000	392,000	-	(592,000)	-
萬科A	-	150,000	-	(150,000)	-
長江電力	405,000	-	-	(405,000)	-
重慶建工	-	2,839	-	(2,839)	-
秦安股份	-	763	-	(763)	-
周大生	-	499	-	(499)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六月 三十日
股票(續)					
中信證券	-	1,717,955	-	(517,955)	1,200,000
科藍軟體	-	360	-	(360)	-
中持股份	-	257	-	(257)	-
百傲化學	-	499	-	(499)	-
道道全	-	377	-	(377)	-
大千生態	-	567	-	(567)	-
大秦鐵路	769,983	1,579,955	-	(350,000)	1,999,938
博士眼鏡	-	195	-	(195)	-
捷榮技術	-	498	-	(498)	-
金太陽	-	310	-	(310)	-
恒為科技	-	300	-	(300)	-
峨眉山A	-	352,542	-	-	352,542
法蘭泰克	-	975	-	(975)	-
金融街	399,974	380,600	-	(230,000)	550,574
展鵬科技	-	623	-	(623)	-
安井食品	-	1,283	-	(1,283)	-
頂點軟體	-	192	-	(192)	-
海峽環保	-	2,609	-	(2,609)	-
坤彩科技	-	1,124	-	(1,124)	-
睿能科技	-	340	-	-	340
福耀玻璃	492,000	-	-	(491,600)	400
元祖股份	631	-	-	(631)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
歌爾股份	403,900	-	168,300	(403,900)	168,300
國科微	-	231	-	-	231
高斯貝爾	-	700	-	(700)	-
格力電器	200,000	300,000	-	(70,000)	430,000
達安股份	-	291	-	(291)	-
迪生力	-	910	-	-	910
粵電力A	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
英聯股份	-	425	-	(425)	-
和勝股份	-	231	-	(231)	-
凱普生物	-	155	-	(155)	-
聯泰環保	-	696	-	(696)	-
三雄極光	-	564	-	(564)	-
香山股份	-	270	-	(270)	-
萬里馬	468	-	-	(468)	-
雄塑科技	-	596	-	(596)	-
白雲機場	-	400,000	-	-	400,000
海格通信	-	240,000	-	(240,000)	-
弘亞數控	83	-	-	(83)	-
廣州港	-	10,830	-	(10,830)	-
廣州酒家	-	401	-	-	401

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
尚品宅配	-	370	-	(370)	-
視源股份	-	326	-	(326)	-
貴廣網路	5,211	-	-	(5,211)	-
永吉股份	248	-	-	(248)	-
國泰君安	400,000	270,000	-	(170,000)	500,000
海利爾	-	222	-	(222)	-
普利製藥	-	382	-	(382)	-
萬通智控	-	493	-	(493)	-
巨星科技	-	350,000	-	-	350,000
杭叉集團	674	-	-	(674)	-
海康威視	499,999	-	47,474	(545,050)	2,423
滬寧股份	-	141	-	-	141
諾邦股份	-	726	-	(726)	-
雷迪克	-	251	-	(251)	-
星帥爾	-	177	-	(177)	-
常青股份	-	522	-	(522)	-
神火股份	-	549,981	-	(47,200)	502,781
雙匯發展	100,000	-	-	-	100,000
得邦照明	-	826	-	(826)	-
亨通光電	-	100,000	-	(100,000)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
華蘭生物	-	129,944	-	-	129,944
黃山旅遊	-	239,950	-	-	239,950
華泰證券	-	350,000	-	(175,000)	175,000
華誼兄弟	-	299,930	-	(299,930)	-
華域汽車	223,654	100,000	-	(123,654)	200,000
瀛通通訊	-	260	-	(260)	-
惠達衛浴	-	652	-	(652)	-
華凱創意	-	507	-	(507)	-
恒生電子	-	82,000	-	(82,000)	-
快意電梯	-	840	-	(840)	-
工商銀行	-	2,300,000	-	-	2,300,000
伊利股份	400,000	400,000	-	-	800,000
英飛特	270	-	-	(270)	-
傑克股份	-	941	-	(941)	-
江山歐派	-	210	-	(210)	-
大燁智能	-	211	-	-	211
寧滬高速	958,400	684,910	-	(684,910)	958,400
恒瑞醫藥	130,600	129,940	-	(130,600)	129,940
捷捷微電	-	200	-	(200)	-
江蘇雷利	-	273	-	(273)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
龍蟠科技	-	461	-	(461)	-
美思德	-	202	-	(202)	-
蘇壘農發	-	1,774	-	(1,774)	-
日盈電子	-	232	-	-	232
如通股份	496	-	-	(496)	-
海鷗股份	-	276	-	(276)	-
新泉股份	-	463	-	(463)	-
洋河股份	97,938	35,000	-	(82,938)	50,000
張家港行	-	1,714	-	(1,714)	-
正丹股份	-	600	-	(600)	-
吉大通信	-	343	-	(343)	-
利源精製	-	300,000	-	(296,000)	4,000
金龍羽	-	844	-	-	844
金能科技	-	562	-	(562)	-
絕味食品	-	805	-	(805)	-
君禾股份	-	292	-	-	292
金正大	459,225	200,000	-	-	659,225
五礦資本	-	319,948	-	-	319,948
江豐電子	-	350	-	-	350
科森科技	-	292	-	(292)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
貴州茅台	38,000	6,988	-	(26,000)	18,988
亞翔集成	363	-	-	(363)	-
拉芳家化	-	378	-	(378)	-
老鳳祥	-	219,962	-	(70,000)	149,962
藍思科技	130,000	-	-	(130,000)	-
立昂技術	-	188	-	(188)	-
麗江旅遊	-	119,937	35,980	(155,917)	-
百合花	1,935	-	-	(1,935)	-
美聯新材	153	-	-	(153)	-
美的集團	130,000	100,000	-	(70,000)	160,000
寒銳鋁業	-	457	-	(457)	-
華脈科技	-	265	-	(265)	-
我樂家居	-	480	-	(480)	-
新 希 望	800	-	-	-	800
美諾華	-	387	-	(387)	-
太平鳥	116	-	-	(116)	-
聖龍股份	-	436	-	(436)	-
天龍股份	371	-	-	(371)	-
旭升股份	-	513	-	-	513
海油工程	281,500	-	-	(281,500)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
歐派家居	-	540	-	(540)	-
平安銀行	871,074	-	-	(871,074)	-
中國平安	698,173	470,000	-	(718,173)	450,000
至純科技	-	854	-	(854)	-
保利地產	786,500	-	-	(786,500)	-
中國電建	610,000	-	-	(610,000)	-
青島海爾	200	460,000	-	-	460,200
匯金通	192	-	-	(192)	-
利群股份	-	1,792	-	(1,792)	-
瑞斯康達	-	670	-	(670)	-
日播時尚	-	774	-	(774)	-
榮盛發展	-	300,000	-	(300,000)	-
日月股份	308	-	-	(308)	-
上汽集團	199,800	-	-	(199,800)	-
三一重工	-	799,908	-	-	799,908
康惠製藥	-	309	-	(309)	-
道恩股份	220	-	-	(220)	-
東阿阿膠	192,010	-	-	(82,010)	110,000
山東黃金	80,000	-	-	-	80,000
金麒麟	-	794	-	(794)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
惠發股份	-	390	-	(390)	-
南山鋁業	2,650,000	2,000,000	-	(3,650,000)	1,000,000
賽托生物	441	-	-	(441)	-
數據港	-	835	-	(835)	-
保隆科技	-	256	-	(256)	-
上海建工	-	899,902	-	(899,902)	-
復星醫藥	150,000	350,166	-	(167,000)	333,166
華測導航	-	231	-	(231)	-
上海機場	196,200	100,000	-	(296,200)	-
鳴志電器	-	888	-	(888)	-
菲林格爾	-	216	-	(216)	-
富滿電子	-	263	-	-	263
飛榮達	-	361	-	(361)	-
深圳燃氣	685,188	-	-	(685,188)	-
金溢科技	-	186	-	(186)	-
匯川技術	-	229,929	-	-	229,929
康泰生物	-	649	-	(649)	-
科達利	-	523	-	(523)	-
景旺電子	834	-	-	(834)	-
美芝股份	-	330	-	(330)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
麥格米特	-	330	-	(330)	-
美格智能	-	313	-	-	313
華僑城A	300,000	300,000	-	(300,000)	300,000
同為股份	221	-	-	(221)	-
同興達	-	135	-	(135)	-
衛光生物	-	270	-	(270)	-
維業股份	-	467	-	(467)	-
科林電氣	-	429	-	(429)	-
華體科技	-	328	-	-	328
中材國際	660,000	-	-	(660,000)	-
外運發展	199,977	299,915	-	-	499,892
開立醫療	-	310	-	(310)	-
新雷能	-	477	-	(477)	-
晶瑞股份	-	225	-	(225)	-
易德龍	-	529	-	-	529
金螳螂	646,000	-	-	(246,000)	400,000
三孚股份	-	466	-	-	466
碳元科技	-	461	-	(461)	-
天聖製藥	-	534	-	(534)	-
天域生態	-	687	-	(687)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
華榮股份	-	1,010	-	(1,010)	-
潍柴動力	399,997	280,000	-	(679,997)	-
威孚高科	345,700	-	-	(345,700)	-
匯納科技	-	415	-	(415)	-
五糧液	179,600	68,000	-	(110,000)	137,600
貝斯特	-	381	-	(381)	-
智能自控	-	244	-	(244)	-
信捷電氣	205	-	-	(205)	-
光莆股份	-	345	-	(345)	-
弘信電子	-	261	-	(261)	-
廈門空港	-	250,000	-	(250,000)	-
延江股份	-	192	-	(192)	-
新鳳鳴	-	965	-	(965)	-
金風科技	-	150,000	-	(150,000)	-
許繼電氣	467,600	-	-	(267,600)	200,000
晨化股份	-	319	-	(319)	-
鹽津鋪子	-	433	-	(433)	-
艾迪精密	-	329	-	(329)	-
永悅科技	-	460	-	(460)	-
雲鋁股份	-	550,000	-	-	550,000

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
雲南白藥	133,693	-	-	(133,693)	-
志邦股份	-	518	-	-	518
誠意藥業	-	224	-	(224)	-
誠邦股份	-	649	-	-	649
大豐實業	-	409	-	(409)	-
大華股份	200,200	-	-	(200,200)	-
迪貝電氣	-	185	-	(185)	-
航民股份	-	450,000	-	-	450,000
華統股份	354	-	-	(354)	-
華正新材	616	-	-	(616)	-
潔美科技	-	228	-	(228)	-
吉華集團	-	1,196	-	(1,196)	-
今飛凱達	-	566	-	(566)	-
康隆達	-	450	-	(450)	-
美力科技	-	299	-	(299)	-
森馬服飾	250,000	90,000	-	(340,000)	-
壽仙穀	-	233	-	(233)	-
三星新材	-	190	-	(190)	-
天鐵股份	423	-	-	(423)	-
鐵流股份	-	309	-	(309)	-



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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六 月三十日
股票(續)					
德創環保	-	666	-	(666)	-
威星智能	-	296	-	(296)	-
浙江仙通	217	-	-	(217)	-
揚帆新材	-	331	-	(331)	-
元成股份	-	206	-	(206)	-
浙能電力	1,000,000	400,000	-	(1,400,000)	-
中馬傳動	-	647	-	(647)	-
宇通客車	413,650	200,000	-	(200,000)	413,650
鎮海股份	-	327	-	(327)	-
浙商證券	-	4,047	-	-	4,047
中孚信息	-	207	-	(207)	-
中金黃金	340,000	-	-	(340,000)	-
紫金礦業	-	1,350,000	-	(1,350,000)	-

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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十 二月三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六月 三十日
債務證券					
航信轉債	1,110	-	-	-	1,110
14長證債	313,405	-	-	-	313,405
15中國信達債01	-	100,000	-	-	100,000
13國債11	394,470	5,530	-	(400,000)	-
13付息國債11	-	400,000	-	(400,000)	-
03國債(3)	316,560	-	-	(316,560)	-
15國債17	70	-	-	-	70
21國債(7)	550,000	24,990	-	(374,990)	200,000
15五礦股MTN003	-	100,000	-	-	100,000
15中外貿租賃債	-	100,000	-	-	100,000
16華南01	45,470	243,240	-	(11,000)	277,710
16華南02	134,000	-	-	-	134,000
15華南城	63,000	-	-	-	63,000
16萬達01	140,000	-	-	-	140,000
16大連萬達MTN004	-	200,000	-	-	200,000
17福特汽車02	-	100,000	-	-	100,000
08中冶債	-	500,000	-	-	500,000
14京銀債	50,000	-	-	-	50,000
11南鋼債	-	106,050	-	-	106,050



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)
自二零一七年一月一日至二零一七年六月三十日止期間

	二零一六年十二月 三十一日	添置	公司行動	出售	二零一七年六月 三十日
債務證券					
13南山集MTN002	-	100,000	-	-	100,000
15复星醫藥MTN001	-	100,000	-	-	100,000
12科倫01	-	180,000	-	-	180,000
13瑞水泥	-	84,140	-	-	84,140
11廣匯01	-	58,690	-	-	58,690
11吉利債	-	500,000	-	-	500,000
集體投資計劃					
華寶添益	12	85,223	-	-	85,235
申萬深成	1	-	-	-	1
銀華日利	-	450,000	-	(40,000)	410,000

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)
截至二零一七年六月三十日

資產淨值

		子基金的淨資產值		
		人民幣 A類單位		
財務期				
二零一七年六月三十日		908,288,818		
二零一六年十二月三十一日		680,705,322		
		每基金單位資產淨值		
		人民幣A類單位	美元A類單位	港幣A類單位
財務期間結束時				
二零一七年六月三十日		13.81	12.34	12.41
二零一六年十二月三十一日		12.43	10.83	10.82

		最高每單位申購價格			最低每單位贖回價格		
		RMB	USD	HKD	RMB	USD	HKD
		A類單位	A類單位	A類單位	A類單位	A類單位	A類單位
財務期間結束時							
二零一七年六月三十日		13.81	12.34	12.41	12.45	10.89	10.89
(自二零一七年一月一日起)							
二零一六年十二月三十一日		13.25	11.93	11.93	11.60	10.71	10.75
(自二零一六年一月一日起)							

分派披露
中期分派

登記日	除淨日	支付日	單位	幣種	每單位股息
二零一七年三月二十日	二零一七年三月二十一日	二零一七年四月十日	人民幣A類單位	人民幣	0.1
二零一七年三月二十日	二零一七年三月二十一日	二零一七年四月十日	美元A類單位	美元	0.1
二零一七年三月二十日	二零一七年三月二十一日	二零一七年四月十日	港幣A類單位	港幣	0.1
二零一七年六月十九日	二零一七年六月二十日	二零一七年七月十日	人民幣A類單位	人民幣	0.15
二零一七年六月十九日	二零一七年六月二十日	二零一七年七月十日	美元A類單位	美元	0.15
二零一七年六月十九日	二零一七年六月二十日	二零一七年七月十日	港幣A類單位	港幣	0.15