
大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

年度報告

截至二零二一年十二月三十一日止年度

[以英文為基準的中文翻譯本]

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

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 |
| 受託人致基金單位持有人報告 | 4 |
| 獨立核數師報告 | 5 - 7 |
| 財務狀況報表 | 8 |
| 全面收入報表 | 9 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表 | 10 - 11 |
| 現金流量報表 | 12 - 13 |
| 財務報表附註 | 14 - 33 |
| 投資組合(未經審計) | 34 -39 |
| 投資組合變動報表(未經審計) | 40 - 54 |
| 表現記錄(未經審計) | 55 |



大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

基金管理和基金行政

基金經理董事

譚曉岡先生
肖劍先生
溫智敏先生
姚余棟先生
趙冰女士
吳萍女士

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 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

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港中環
中環太子大廈 22 樓

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
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

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

基金經理致基金單位持有人報告

基金表現

大成中國靈活配置基金(「子基金」)旨在提供資本和收益的長期增長。截至二零二一年十二月三十一日，子基金的每單位資產淨值為人民幣 16.83 元(人民幣 A 類)，15.59 美元(美元 A 類)，15.68 港元(港元 A 類)，15.97 美元(美元 P 類(累算))以及 15.66 港元(港元 P 類(累算))累計總資產規模約為人民幣 2,700,926,436 元。

以下載列子基金的表現概要(截至二零二一年十二月三十一日)

| | 二零二一年 | 二零二零年 | 二零一九年 | 二零一八年 | 二零一七年 | 二零一六年 | 自成立以來 |
|-----------------------------------|-------|--------|--------|---------|--------|--------|----------------------|
| 大成中國靈活配置基金 - 人民幣 A 類資產淨值增長率 | 2.35% | 31.79% | 26.15% | -15.50% | 23.05% | -1.60% | 147.74% ¹ |
| 大成中國靈活配置基金 - 美元 A 類資產淨值增長率 | 4.90% | 40.98% | 24.75% | -19.99% | 31.64% | -7.25% | 140.56% ¹ |
| 大成中國靈活配置基金 - 港元 A 類資產淨值增長率 | 5.48% | 40.39% | 23.88% | -19.77% | 32.71% | -7.19% | 140.15% ¹ |
| 大成中國靈活配置基金 - 美元 P 類(累算)資產淨值增長率 | 4.86% | 40.89% | - | - | - | - | 59.70% ² |
| 大成中國靈活配置基金 - 港元 P 類(累算)資產淨值增長率 | 5.45% | 40.36% | - | - | - | - | 56.60% ² |

資料來源：大成國際資產管理有限公司、彭博。

本子基金的表現不參考某一預選基準。

市場回顧

2021 年 7 月中上旬，超預期降準推動寬基指數震盪上行，較寬裕的流動性支撐五月以來以成長製造板塊、中小盤風格的行情延續。7 月下旬，“雙減”政策對教培行業的瓦解引發投資者對“共同富裕”政策不確定性的擔憂，外資短期大幅流出、恐慌情緒傳導至其他板塊，消費醫藥和傳媒遭遇大量拋售。9 月中旬，隨著針對大宗商品炒作的一系列“保供穩價”政策持續加碼，2021 年以來受益於供需缺口而領漲的資源品週期行情急轉直下。進入 12 月，機構開始歲末調倉佈局來年，“穩增長”預期疊加地產風險邊際改善，資金從高估值的光伏、新能源車產業鏈中抽離，流向相對低估值的消費、基建和地產鏈。整體看，下半年風格延續中小盤優於大盤，雙創板塊和大盤藍籌均表現不佳，創業板 50、創業板指分別下跌 5.1%、4.4%，上證 50、中證 100 則分別下跌 6.4%、7.9%。行業層面，有色金屬、國防軍工漲幅較高，消費者服務、醫藥則表現較弱。

基本面方面，散點疫情和居民可支配收入增長承壓使消費需求疲弱、復甦緩慢，社融增速放緩信貸少增反映企業投資擴產有限融資需求不足，2021 年下半年經濟始終面臨需求收縮的壓力。反映在盈利結構上，下半年 A 股低基數優勢不復，增速顯著放緩，而上游原材料和設備上的供需缺口突出，造成資源價格的上漲並帶動利潤進一步向上游集中。流動性方面，儘管北向資金短期大幅流出時有發生，下半年配置型資金仍不改持增持 A 股趨勢，下半年公募基金發行整體偏暖，並在 7 月錄得單月發行新高。整體而言，盈利趨緩、高景氣品種有限和主線的快速切換，使下半年市場處於持續震盪中。

¹ 成立日期為二零一四年三月三日。

² 成立日期為二零一九年八月十五日。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

基金經理致基金單位持有人報告(續)

展望

2022 年上半年的 A 股投資策略依然應該圍繞“高切低”的特徵來配置，避開內資機構目前倉位依然偏重的成長賽道板塊。我們預計今年上半年 A 股市場風格依然由短線資金主導，所謂短線資金指得是個人投資者以及小型公募私募等高換手的靈活資金。此類資金近期已經開始參與穩增長政策落地預期下的金融、傳統週期和服務消費板塊，近期相關個股的反彈都屬於短期資金在中央不斷強調穩定經濟的背景下提前開始佈局。但是對於中長線投資者，如大型公募私募和長線外資而言，目前中國的宏觀經濟狀況依然存在較大的不確定性，此時佈局傳統經濟板塊的風險較高，有可能一季度的宏觀經濟數據和上市公司財務數據都無法支持這一投資方向，導致穩經濟預期的炒作再次落空。例如，基建方面，雖然各地方專項債額度已提前下達且地方政府也表態要加速基建項目落地，但 1-2 月受春節假期影響屬於基建和地產施工的傳統淡季，因此可能根本沒有宏觀經濟數據驗證基建和地產穩定經濟的真實效果，此外，部分中長線投資者也擔心地方政府隱形債務終身追責制可能會繼續壓制地方政府官員提高本地槓桿去拉動基建投資的動力。再比如，消費方面，作為中國經濟的主要貢獻部門，消費一直受居民收入增速修復偏慢和散點疫情擾動的影響，居民收入增速不及預期與就業狀況有一定關係，而疫情的擾動也阻礙了服務產業吸納就業的能力，目前中國在疫情的控製商仍然採用“零容忍”的嚴格管控措施，可能繼續壓制機構投資者對於消費復甦的信心。因此，短線資金和中長線資金對於經濟復甦並未形成共識和合力，短線資金博弈的穩經濟的預期，而中長線資金需要更多宏觀經濟穩的政策落地或者數據驗證，這樣的分歧可能會成為主導上半年（至少一季度）A 股市場的核心因素。在經濟企穩信號確定之前，中長線資金或繼續堅守近期調整幅度較大、長期成長空間確定、但估值依然偏高的成長賽道板塊，而短線資金將繼續圍繞金融、傳統週期和消費等政策鼓勵的方向佈局，從市場漲跌反應的結果來看，順經濟周期且價格處於低位的個股可能在股價上的正向反饋更明顯，而高位的成長賽道會受到海外金融條件收緊、國內經濟復甦等負面因素的壓制，可能在二三季度才再此迎來轉機。

大成國際資產管理有限公司代表

二零二二年四月二十五日



大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

受託人致基金單位持有人報告

我們謹此確認，我們認為，截至二零二一年十二月三十一日止年度，大成中國靈活配置基金(為大成投資信託基金的子基金，以下簡稱為「子基金」)的基金經理在各大方面，已根據日期為二零一一年十二月三十日所訂立之信託契據及補充契據的條文管理子基金。

中銀國際英國保誠信託有限公司代表

二零二二年四月二十五日

獨立核數師報告
致大成中國靈活配置基金單位持有人
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表審計報告

意見

我們已審計的內容

大成中國靈活配置基金(為大成投資信託基金的子基金，以下簡稱為「子基金」)列載於第8至33頁的財務報表，包括：

- 於二零二一年十二月三十一日的財務狀況報表；
- 截至該日止年度的全面收入報表；
- 截至該日止年度的基金單位持有人應佔資產淨值變動報表；
- 截至該日止年度的現金流量報表；及
- 財務報表附註，包括重要會計政策及其他附註解釋資料

我們的意見

我們認為，該等財務報表已根據《國際財務報告準則》真實而中肯地反映了子基金於二零二一年十二月三十一日的財務狀況以及截至該日止年度的財務交易及現金流量。

意見的基礎

我們已根據《國際審計準則》進行審計。我們在該等準則下承擔的責任已在本報告「核數師就審計財務報表承擔的責任」部份中作進一步闡述。

我們相信，我們所獲得的審計憑證能充足及適當地為我們的審計意見提供基礎。

獨立性

根據國際會計師道德準則委員會頒布的《國際會計師專業操守守則》(包括國際獨立性準則)(以下簡稱「守則」)，我們獨立於子基金，並已履行守則中的其他專業道德責任。

其他信息

子基金的受託人及經理(以下統稱「管理層」)對其他信息負責。其他信息包括年報內的所有信息，但不包括財務報表及我們的核數師報告。

我們對財務報表的意見並不涵蓋其他信息，我們亦不對該等其他信息發表任何形式的鑒證結論。

結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他信息，在此過程中，考慮其他信息是否與財務報表或我們在審計過程中所了解的情況存在重大抵觸或者似乎存在重大錯誤陳述的情況。

基於我們已執行的工作，如果我們認為其他信息存在重大錯誤陳述，我們需要報告該事實。在這方面，我們沒有任何報告。

獨立核數師報告

致大成中國靈活配置基金單位持有人

(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

管理層就財務報表須承擔的責任

子基金的管理層須負責根據《國際財務報告準則》擬備真實而中肯的財務報表，並對其認為為使財務報表的擬備不存在由於欺詐或錯誤而導致的重大錯誤陳述所需的內部控制負責。

在擬備財務報表時，子基金的管理層負責評估子基金的持續經營能力，並在適用情況下披露與持續經營有關的事項，以及使用持續經營為會計基礎，除非管理層有意將子基金清盤或停止經營，或別無其他實際的替代方案。

此外，子基金的管理層須確保財務報表已根據二零一一年十二月三十日訂立的信託契據及補充契據(「信託契據」)的有關條文及香港證券及期貨事務監察委員會頒布的《單位信託及互惠基金守則》(簡稱「證監會守則」)附錄E的有關披露規定適當地擬備。

核數師就審計財務報表承擔的責任

我們的目標，是對財務報表整體是否不存在由於欺詐或錯誤而導致的重大錯誤陳述取得合理保證，並出具包括我們意見的核數師報告。我們僅向閣下(作為整體)報告，除此之外本報告別無其他目的。我們不會就本報告的內容向任何其他人士負上或承擔任何責任。合理保證是高水平的保證，但不能保證按照《國際審計準則》進行的審計，在某一重大錯誤陳述存在時總能發現。錯誤陳述可以由欺詐或錯誤引起，如果合理預期它們單獨或滙總起來可能影響財務報表使用者依賴財務報表所作出的經濟決定，則有關的錯誤陳述可被視作重大。此外，我們需要評估子基金的財務報表在所有重大方面是否已根據信託契約的有關條文及證監會守則附錄E的有關披露規定適當地擬備。

在根據《國際審計準則》進行審計的過程中，我們運用了專業判斷，保持了專業懷疑態度。我們亦：

- 識別和評估由於欺詐或錯誤而導致財務報表存在重大錯誤陳述的風險，設計及執行審計程序以應對這些風險，以及獲取充足和適當的審計憑證，作為我們意見的基礎。由於欺詐可能涉及串謀、偽造、蓄意遺漏、虛假陳述，或凌駕於內部控制之上，因此未能發現因欺詐而導致的重大錯誤陳述的風險高於未能發現因錯誤而導致的重大錯誤陳述的風險。
- 了解與審計相關的內部控制，以設計適當的審計程序，但目的並非對子基金內部控制的有效性發表意見。
- 評價管理層所採用會計政策的恰當性及作出會計估計和相關披露的合理性。

獨立核數師報告
致大成中國靈活配置基金單位持有人
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

核數師就審計財務報表承擔的責任(續)

- 對管理層採用持續經營會計基礎的恰當性作出結論。根據所獲取的審計憑證，確定是否存在與事項或情況有關的重大不確定性，從而可能導致對子基金的持續經營能力產生重大疑慮。如果我們認為存在重大不確定性，則有必要在核數師報告中提請使用者注意財務報表中的相關披露。假若有關的披露不足，則我們應當發表非無保留意見。我們的結論是基於核數師報告日止所取得的審計憑證。然而，未來事項或情況可能導致子基金不能持續經營。
- 評價財務報表的整體列報方式、結構和內容，包括披露，以及財務報表是否中肯反映交易和事項。

除其他事項外，我們與管理層溝通了計劃的審計範圍、時間安排、重大審計發現等，包括我們在審計中識別出內部控制的任何重大缺陷。

就信託契約的有關條文及證監會守則附錄E的有關披露規定之事項作出的報告

我們認為，該等財務報表在各重大方面已根據信託契約的有關條文及證監會守則附錄E的有關披露規定適當地擬備。

羅兵咸永道會計師事務所
執業會計師

香港，二零二二年四月二十五日

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務狀況報表
 於二零二一年十二月三十一日

| | 附註 | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|------------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 資產 | | | |
| 非流動資產 | | | |
| 存款準備金 | | 959,880 | 226,044 |
| 流動資產 | | | |
| 投資 | 3.1, 3.4 | 2,638,137,301 | 2,238,065,685 |
| 應收利息 | | 9,565,419 | 13,603,143 |
| 應收股息 | | 642,761 | 151 |
| 應收申購款 | | 6,144,433 | 4,584,468 |
| 應收出售投資款 | | 98,139,750 | - |
| 現金及現金等價物 | 3.4, 7.3 | 62,107,631 | 17,785,496 |
| | | <u>2,814,737,295</u> | <u>2,274,038,943</u> |
| 總資產 | | <u>2,815,697,175</u> | <u>2,274,264,987</u> |
| 負債 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 應付管理費用 | 7.1 | 3,109,158 | 2,458,775 |
| 應付受託人費用 | 7.2 | 283,457 | 229,612 |
| 應付購買投資款 | | 94,633,913 | - |
| 應付贖回款 | | 7,968,128 | 32,265,268 |
| 預提費用及其他應付款 | | 963,621 | 796,726 |
| 應付派息 | | - | 46,592,232 |
| 預提稅款準備金 | 8 | 7,812,462 | 7,703,081 |
| | | <u>114,770,739</u> | <u>90,045,694</u> |
| 總負債(不包括基金單位持有人應佔資產淨值) | | <u>114,770,739</u> | <u>90,045,694</u> |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | 6 | <u>2,700,926,436</u> | <u>2,184,219,293</u> |

中銀國際英國保誠信託有限公司代表

大成國際資產管理有限公司代表

授權簽署人

授權簽署人

董事

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

全面收入報表
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 附註 | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|------------------------------|-----|----------------------|--------------------|
| 收入 | | | |
| 股息收入 | | 27,520,851 | 21,868,107 |
| 銀行存款產生的利息收入 | 7.3 | 136,452 | 122,195 |
| 投資產生的利息收入 | | 26,527,861 | 17,527,877 |
| 投資淨收益/(損失) | 5 | 50,648,570 | 538,070,922 |
| 匯兌淨損失 | | (934,937) | (50,869) |
| 其他收入 | | 293 | 395 |
| 總投資收入/(開支) | | 103,899,090 | 577,538,627 |
| 開支 | | | |
| 管理費用 | 7.1 | 36,326,583 | 25,822,815 |
| 受託人費用 | 7.2 | 3,314,371 | 2,436,452 |
| 託管費 | 7.3 | 2,086,109 | 1,463,739 |
| 交易手續費 | 7.4 | 389,275 | 216,125 |
| 交易成本 | 11 | 10,096,397 | 5,735,270 |
| 核數師酬金 | | 194,802 | 394,573 |
| 其他費用 | | 377,553 | 89,746 |
| 總經營開支 | | 52,785,090 | 36,158,720 |
| 利潤分配前及稅前收益 | | 51,114,000 | 541,379,907 |
| 對基金單位持有人的分派 | 10 | (168,459,405) | (122,171,657) |
| 利潤分配後及稅前(損失)/收益 | | (117,345,405) | 419,208,250 |
| 稅項 | 8 | (2,808,054) | (2,189,831) |
| 基金單位持有人應佔資產淨值之(減少)/增加 | | (120,153,459) | 417,018,419 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|
| 年初基金單位持有人應佔資產淨值 | 2,184,219,293 | 2,044,691,912 |
| 發行單位 | 1,833,294,348 | 1,177,793,785 |
| 贖回單位 | (1,196,433,746) | (1,455,284,823) |
| 基金單位交易導致的淨增加/(減少) | 636,860,602 | (277,491,038) |
| 基金單位持有人應佔資產淨值之(減少)/增加 | (120,153,459) | 417,018,419 |
| 年末基金單位持有人應佔資產淨值 | 2,700,926,436 | 2,184,219,293 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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
截至二零二一年十二月三十一日止年度

可贖回單位的變動

| | 二零二一年 | | | 美元 P 類 | 港元 P 類 |
|-----------|--------------|-------------|--------------|-----------|-------------|
| | 人民幣 A 類 | 美元 A 類 | 港元 A 類 | (累算) | (累算) |
| 年初已發行單位數目 | 29,762,159 | 6,766,257 | 69,209,259 | 190,175 | 2,014,990 |
| 已發行單位 | 32,029,833 | 4,388,810 | 53,605,812 | 235,414 | 2,998,678 |
| 重投資(附註) | 701,188 | 94,143 | 681,566 | - | - |
| 已贖回單位 | (17,266,205) | (2,710,336) | (42,599,960) | (175,491) | (2,241,345) |
| 年末已發行單位數目 | 45,226,975 | 8,538,874 | 80,896,677 | 250,098 | 2,772,323 |

| | 二零二零年 | | | 美元 P 類 | 港元 P 類 |
|-----------|--------------|-------------|--------------|-----------|-------------|
| | 人民幣 A 類 | 美元 A 類 | 港元 A 類 | (累算) | (累算) |
| 年初已發行單位數目 | 29,415,678 | 7,864,025 | 90,027,077 | 26,229 | 123,930 |
| 已發行單位 | 24,933,865 | 3,528,039 | 29,997,944 | 269,829 | 3,607,259 |
| 重投資(附註) | 383,437 | 62,273 | 430,692 | - | - |
| 已贖回單位 | (24,970,821) | (4,688,080) | (51,246,454) | (105,883) | (1,716,199) |
| 年末已發行單位數目 | 29,762,159 | 6,766,257 | 69,209,259 | 190,175 | 2,014,990 |

附註： 該金額為向本年內後續重投資子基金之基金單位持有人分派利潤。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

現金流量報表
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 經營活動的現金流量 | | |
| 基金單位持有人應佔資產淨值之(減少)/增加 | (120,153,459) | 417,018,419 |
| 調整： | | |
| 銀行存款產生的利息收入 | (136,452) | (122,195) |
| 投資產生的利息收入 | (26,527,861) | (17,527,877) |
| 股息收入 | (27,520,851) | (21,868,107) |
| 對基金單位持有人的分派 | 168,459,405 | 122,171,657 |
| 稅項 | 2,808,054 | 2,189,831 |
| 營運資本變動前經營活動之(損失)/收益 | (3,071,164) | 501,861,728 |
| 投資之淨增加 | (400,071,616) | (165,559,967) |
| 存款準備金之淨(增加)/減少 | (733,836) | 52,662 |
| 應收出售投資款之淨增加 | (98,139,750) | - |
| 應付購買投資款之淨增加 | 94,633,913 | - |
| 應付管理費用之淨增加 | 650,383 | 52,814 |
| 應付受託人費用之淨增加 | 53,845 | 4,539 |
| 預提費用及其他應付款之淨增加 | 166,895 | 337,725 |
| 經營活動(所用)/產生的現金 | (406,511,330) | 336,749,501 |
| 已收股息收入 | 26,878,241 | 21,868,138 |
| 已收銀行存款產生的利息收入 | 136,452 | 122,195 |
| 已收投資產生的利息收入 | 30,565,585 | 19,733,973 |
| 支付稅項 | (2,698,673) | (2,189,212) |
| 經營活動產生的現金淨(流出)/流入 | (351,629,725) | 376,284,595 |
| 融資活動的現金流量 | | |
| 發行基金單位所得款項 | 1,801,113,417 | 1,159,404,883 |
| 贖回基金單位所付款項 | (1,220,730,886) | (1,448,993,209) |
| 分派給基金單位持有人款項 | (184,430,671) | (100,874,972) |
| 籌資活動產生的現金淨流入/(流出) | 395,951,860 | (390,463,298) |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

現金流量報表(續)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|-------------------|--------------|--------------|
| 現金及現金等價物淨增加/(減少) | 44,322,135 | (14,178,703) |
| 年初現金及現金等價物 | 17,785,496 | 31,964,199 |
| 年末現金及現金等價物，代表銀行存款 | 62,107,631 | 17,785,496 |

非現金交易

截至二零二一年十二月三十一日止年度，子基金新發行了人民幣 A 類 701,188 個基金單位，計人民幣 12,082,361 元，美元 A 類 94,143 個基金單位，計 1,484,159 美元，港元 A 類 681,566 個基金單位，計 10,752,067 港元(二零二零年：發行了人民幣 A 類 383,437 個基金單位，計人民幣 5,848,228 元，美元 A 類 62,273 個基金單位，計 789,326 美元，港元 A 類 430,692 個基金單位，計 5,476,675 港元)，作為向基金單位持有人分派利潤的一部分，總計人民幣 21,142,617 元(二零一九年：人民幣 16,262,616 元)。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

1 一般資料

大成投資信託基金(「信託基金」)是一個根據香港法律成立的傘型開放式單位信託基金，通過與大成國際資產管理有限公司在二零一一年十二月三十日所簽署的信託契約(「信託契約」)，指定大成國際資產管理公司為基金經理(「基金經理」)以及由中銀國際英國保誠信託有限公司作為受託機構(「受託人」)。截至二零二一年十二月三十一日，信託基金擁有六個子基金，大成中國靈活配置基金(「子基金」)、大成短期債券基金、大成海外中國概念基金、大成貨幣市場基金、大成全收益債券基金和大成港元貨幣市場基金(以下統稱「子基金」)。子基金於二零一四年三月三日開始運作。

信託基金和子基金是由香港證券及期貨事務監察委員會(「證監會」)根據香港證券及期貨條例第104(1)條法令認可的，並須遵守證監會所訂定的單位信託基金及互惠基金守則。

子基金的投資目標是通過直接投資在中國發行的固定收益產品和股本證券而達到。子基金將會憑藉基金經理的特殊資格，即經中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)核准的人民幣合格境外機構投資者(「RQFII」)，及通過滬港通及深港通(「滬深港通」)，直接投資於中國的本地證券市場。子基金以人民幣計值及結算。

根據目前中國的規定，一般而言，外國投資者僅能通過由中國證監會核准的境外合格機構投資者(「QFII」)，或者RQFII投資國內證券市場，並須獲得國家外匯管理局(「外管局」)的額度後，方可把自由兌換的外幣(如屬「QFII」)或人民幣(如屬「RQFII」)以投資中國國內證券市場為目的或通過債券通匯入中國境內，或者通過債券通。外國投資者還能通過滬深港通投資中國國內證券市場的部份股本證券。此子基金可透過RQFII計劃投資中國境內發行的證券。

本財務報表僅為子基金截至二零二一年十二月三十一日止年度編制。

2 重要會計政策摘要

編製本財務報表採納的主要會計政策載於下文。除另有說明外，此等政策在所列報之年度內貫徹應用。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

2 重要會計政策摘要(續)

2.1 編制基礎

子基金的財務報表乃根據國際財務報告準則(「國際財務準則」)編製。財務報表已根據歷史成本慣例編製，並就按公允價值透過損益記賬的金融資產和負債的重估作出修訂。

編製符合國際財務報告準則的財務報表需要使用若干關鍵會計估計，亦需要受託人和經理(「管理層」)在應用子基金的會計政策過程中行使其判斷。

新訂準則及現有準則之修訂於二零二一年一月一日起生效

並無自二零二一年一月一日開始的年度期間生效的準則、準則之修訂或詮釋會對子基金產生重大影響。

新訂準則、修訂和詮釋於二零二一年一月一日後生效

多項新訂準則、準則之修訂及詮釋將於二零二一年一月一日或之後開始的年度期間生效，且並未提前用於編製該等財務報表。預計該等資訊不會對子基金的財務報表有重大影響。

2.2 外幣換算

(i) 功能及呈報貨幣

在財務報表中所列出的各個項目是根據子基金運作的主要經濟環境的貨幣計值(「功能貨幣」)。子基金所投資的中國國內證券與子基金呈報給基金單位持有人的表現報告都是以人民幣計值。基金經理認為用人民幣作為計值呈報貨幣最能真實地反映相關交易、事件和情況的經濟效應。財務報表以人民幣(也是子基金的功能及呈報貨幣)呈列。

(ii) 交易及結餘

匯兌損益都包含在全面收入報表內。

外幣交易均按交易當日之現行匯率換算為功能貨幣。外幣資產及負債均按報告日期匯率折算為功能貨幣。

按公允價值透過損益記賬的金融資產和金融負債相關的匯兌損益在全面收入報表中「投資淨收益」中列示。

與現金及現金等價物有關的匯兌利得和損失在綜合收益表內的「匯兌虧損淨額」中列報。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

2 重要會計政策摘要(續)

2.3 投資

(i) 分類

子基金根據子基金管理該等金融資產的業務模式以及金融資產的合同現金流量特徵對其投資進行分類。金融資產的投資組合按照公允價值進行管理，其表現亦按照公允價值進行評估。子基金主要關注公允價值信息，利用該等信息評估資產的表現，並做出決策。子基金並未選擇將任何股本證券不可撤銷地指定為按公允價值透過其他綜合收益記賬。子基金債務證券的合同現金流量僅包括本金和利息。然而，持有該等證券既不是為了收取合同現金流量，亦不是為了收取合同現金流量及持有待售。收取合同現金流量不是達成。收取合同現金流量只是在實現子基金業務模式目標時附帶實現的。因此，所有投資均以公允價值透過損益計量。

子基金的政策需要經理和董事用公允價值連同其他相關財務資料作為評估的基礎。

(ii) 確認，取消確認及計值方法

投資買賣於交易日確認 - 子基金於該交易日購買或出售投資。按公允價值透過損益記賬的金融資產按公允價值進行初始確認。交易成本於全面收入報表內列作開支。

當自投資收取現金流量之權利已屆滿或子基金已將所有權之所有風險及回報大部分轉移時，該項金融資產即終止確認。

初始確認後，所有按公允價值透過損益記賬的金融資產都按公允價值計值。「按公允價值透過損益記賬的金融資產」類別下的公允價值變動產生的利得和損失，於其產生的期間在全面收入報表中以「投資淨收益/(損失)」列報。

按公允價值透過損益記賬的金融資產的股息收入，當子基金收取該等款項的權利確定時在全面收入報表中確認為股息收入。按公允價值透過損益記賬的債務證券的利息，按照實際利率法在全面收入報表中確認為投資的利息收入。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

2 重要會計政策摘要(續)

2.3 投資(續)

(iii) 公允價值估計

在交易所上市或買賣的投資的公允價值是根據交易報告日期結束時的市場報價。就上市債務證券而言，其公允價值採用中國證券指數有限公司(一家由上海證券交易所和深圳證券交易所共同成立的公司，專門從事指數及指數相關服務的創立和管理)提供的估值。

在銀行同業之間市場內交易的金融資產(例如，非上市債務證券)的公允價值採用中國中央國債登記結算有限責任公司(一家由中國人民銀行和財政部共同成立的公司，提供銀行間債券市場集中存管和結算的功能)提供的估值。

(iv) 公允價值各層級之間的轉換

公允價值各層級之間的轉換視為在報告期初已發生。

2.4 現金及現金等價物

現金及現金等價包括銀行存款，以及原到期日為三個月或以下的存款。

2.5 按公允價值透過損益記賬的金融資產之利息收入和利息

利息採用實際利率法按時間比例基準確認。利息收入包括現金及現金等價物與存款準備金之利息。按公允價值透過損益記賬的金融資產之利息包括債務證券之利息。

實際利息法乃計算附息資產的攤余成本以及按有關期間攤分利息收入的方法。實際利率是指在金融工具的預計期限或更短的期間(如適用)內將估計的未來現金流入準確地折現至金融工具淨賬面價值的比率。計算實際利率時，子基金會根據金融工具的所有合約條款(例如提早還款選擇權)估計現金流量，但不會考慮未來信貸虧損。計算範圍包括訂約方所支付或收取的一切款項(即實際利率的整體組成部分)、交易成本和所有其他溢價或折讓。

2.6 股息收入

股息收入在收取款項的權利確定時確認。

2.7 預提費用

預提費用以公允價值為初始確認，其後利用實際利率法按攤余成本計量。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

2 重要會計政策摘要(續)

2.8 可贖回單位

子基金發行了多類特徵不同的可贖回單位。子基金將其可賣回金融工具分類為金融負債。基金單位的發行和贖回按持有人的選擇，並以發行或贖回時子基金各類單位資產淨值計價。子基金各類單位資產淨值乃通過單位持有人應佔資產淨值除以已發行單位數目而釐定。

倘若基金單位持有人行使權利將持有單位放回子基金，則可贖回單位以報告日期應付贖回金額對應的攤銷成本計量。

根據子基金的招股章程，為確定子基金成立和贖回時之每單位資產淨值，其投資狀況按最近交易的市場價格估值。

2.9 對基金單位持有人的分派

基金經理批准對基金單位持有人分派後才可在全面收入報表中確認分派。

2.10 交易成本

交易成本指因收購按公允價值透過損益記賬之金融資產或負債所引發的成本。交易成本包括支付給代理、顧問、經紀及交易商的費用及佣金。交易成本於發生時在全面收益表中列作開支。

2.11 稅項

子基金目前因中國就投資收入而徵收的預提稅款列為產生稅項。在全面收益表內，該等收益列作預提稅款毛利。預提稅款在全面收益表中列作稅項。

遞延所得稅使用負債法就資產及負債之稅基與其在財務報表中所列賬面值之間之暫時差額作出撥備。然而，如遞延所得稅乃源自業務合併以外的交易中初步確認資產或負債，而在交易時並不影響會計或應課稅溢利或虧損，則不會入賬處理。

當有關遞延所得稅資產已變現或遞延所得稅負債已結算時，遞延所得稅以於結算日前已制定或大致上已制定及預期獲應用至稅率(及法例)釐定。

2.12 應收款項

應收款項以公允價值進行初始確認，其後利用實際利率法按攤銷成本扣除減值撥備計量。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理

子基金面臨各種風險，包括但不限於子基金所投資市場相關的市場價格風險、現金流量和公允價值利率風險、信貸及託管風險、流動性風險和貨幣風險。

以下是主要風險和風險管理政策匯總。

3.1 市場價格風險

市場價格風險指某金融工具的價值因市場價格變動(因利率風險或貨幣風險產生的變動除外)而波動的風險，無論該等變動是否因個別工具的特有因素或影響市場上所有工具的因素而引起。所有投資均有發生資本損失的風險。

下表披露了按產品類型分類的子基金投資：

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 投資 | | |
| 上市股份 | 1,952,223,584 | 1,521,144,592 |
| 債券 | 303,057,900 | 716,690,361 |
| 上市債券 | 382,824,607 | - |
| 集體投資計劃 (附註) | 31,210 | 230,732 |
| 投資總計 | 2,638,137,301 | 2,238,065,685 |

附註

| 基金名稱 | 投資策略 | 二零二一年 | | |
|-----------------|-----------|----------------------------|----------------|-------|
| | | 集體投資計劃 的資產淨值 人民幣(百萬) | 投資的公允價值 人民幣 | 資產淨值% |
| 華寶興業現金添益型貨幣市場基金 | 現金；銀行定期存款 | 144,694 | 31,210 | 0.00 |

| 基金名稱 | 投資策略 | 二零二零年 | | |
|-----------------|-----------|----------------------------|----------------|-------|
| | | 集體投資計劃 的資產淨值 人民幣(百萬) | 投資的公允價值 人民幣 | 資產淨值% |
| 華寶興業現金添益型貨幣市場基金 | 現金；銀行定期存款 | 135,350 | 230,732 | 0.00 |

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.1 市場價格風險(續)

於十二月三十一日，投資的公允價值按行業分類如下：

| 投資 | 二零二一年 | | 二零二零年 | |
|----------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|----------------------|
| | 投資的公允價值 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 | 投資的公允價值 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
| 股票和債務證券 | | | | |
| 基礎材料 | 169,374,905 | 6.27 | 65,682,324 | 3.01 |
| 通訊 | 165,398,712 | 6.12 | 59,885 | 0.00 |
| 消費品和服務 | 673,524,938 | 24.94 | 618,573,556 | 28.32 |
| 能源 | 85,075,575 | 3.15 | 22,685,442 | 1.04 |
| 金融 | 731,241,861 | 27.07 | 827,762,670 | 37.91 |
| 政府 | 163,168,699 | 6.04 | 217,371,358 | 9.95 |
| 工業 | 418,252,213 | 15.49 | 344,711,997 | 15.78 |
| 技術 | 188,047,520 | 6.96 | 121,100,621 | 5.54 |
| 公用事業 | 44,021,668 | 1.63 | 19,887,100 | 0.91 |
| | <u>2,638,106,091</u> | <u>97.67</u> | <u>2,237,834,953</u> | <u>102.46</u> |
| 集體投資計劃 | <u>31,210</u> | <u>0.00</u> | <u>230,732</u> | <u>0.01</u> |
| 投資總計 | <u><u>2,638,137,301</u></u> | <u><u>97.67</u></u> | <u><u>2,238,065,685</u></u> | <u><u>102.47</u></u> |

子基金證券的市場價格風險管理通過多元化不同行業投資組合比例分散風險。於二零二一年和二零二零年十二月三十一日，子基金未有任何對個別投資超過子基金資產淨值的 10%。

以下為子基金淨資產和於報告日期持有的金融工具的價格變動的敏感性分析摘要。該等分析是基於滬深 300 指數上升/下降 15%(二零二零年：15%)，而所有其他可變因素維持不變，且子基金之股本證券投資組合之公允價值人民幣 1,952,223,584 元(二零二零年：人民幣 1,521,144,592 元)基於該等指數歷史關聯而變動。該等假設將使子基金淨資產增加/減少約為人民幣 245,663,236 元(二零二零年：人民幣 156,616,555 元)。此代表管理層考慮到指數歷史波動規律而對於滬深 300 指數之可能合理變動的最佳估計。

子基金受託人和基金經理並未追蹤任何指數或外部基準以管理子基金的投資策略。此處列示的敏感性分析基於報告日期投資組合的組成部分及組成該等投資組合的證券與指數的歷史聯繫。投資組合的組成部分及組成該等投資組合的證券與指數的歷史聯繫預計將隨時變動。截至報告日期的敏感性分析在上述指數層面並未預示子基金淨資產的未來變動。

上市及報價之債券的利率風險，請參閱附註 3.2。

3.2 現金流及公允價值利率風險

利率風險是指金融工具的價值因市場利率變動而發生波動的風險。

利率風險由現行市場利率的波動對金融資產及負債的公允價值以及未來現金流量產生的影響而引致。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.2 現金流及公允價值利率風險(續)

下表總結了子基金截至報告日期所承受的利率風險。表中子基金的金融資產和金融負債的公允價值，通過合同重新定價日或到期日(以較早者為準)分類。

| 於二零二一年十二月三十一日 | 1 年內到期 人民幣 | 1-5 年內到期 人民幣 | 超過 5 年到期 人民幣 | 不計息 人民幣 | 總計 人民幣 |
|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| 資產 | | | | | |
| 投資 | | | | | |
| - 人民幣債券 | - | 124,483,582 | 258,341,025 | - | 303,057,900 |
| - 人民幣上市股份 | - | - | - | 1,952,223,584 | 1,952,223,584 |
| - 人民幣上市債券 | - | 303,057,900 | - | - | 382,824,607 |
| - 人民幣集體投資計劃 | - | - | - | 31,210 | 31,210 |
| 存款準備金 | - | - | 959,880 | - | 959,880 |
| 應收利息 | - | - | - | 9,565,419 | 9,565,419 |
| 應收股息 | - | - | - | 642,761 | 642,761 |
| 應收申購款 | - | - | - | 6,144,433 | 6,144,433 |
| 應收出售投資款 | - | - | - | 98,139,750 | 98,139,750 |
| 現金及現金等價物 | 62,107,631 | - | - | - | 62,107,631 |
| 總資產 | <u>62,107,631</u> | <u>427,541,482</u> | <u>259,300,905</u> | <u>2,066,747,157</u> | <u>2,815,697,175</u> |
| | | | | | |
| | 1 年內到期 人民幣 | 1-5 年內到期 人民幣 | 超過 5 年到期 人民幣 | 不計息 人民幣 | 總計 人民幣 |
| 負債 | | | | | |
| 應付管理費用 | - | - | - | 3,109,158 | 3,109,158 |
| 應付受託人費用 | - | - | - | 283,457 | 283,457 |
| 應付贖回款 | - | - | - | 7,968,128 | 7,968,128 |
| 預提費用及其他應付款 | - | - | - | 963,621 | 963,621 |
| 應付派息 | - | - | - | 94,633,913 | 94,633,913 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | - | - | - | 2,700,926,436 | 2,700,926,436 |
| 總負債 | <u>-</u> | <u>-</u> | <u>-</u> | <u>2,807,884,713</u> | <u>2,807,884,713</u> |
| 利率敏感度缺口總額 | <u>62,107,631</u> | <u>427,541,482</u> | <u>259,300,905</u> | | |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.2 現金流及公允價值利率風險(續)

| 於二零二零年十二月三十一日 | 1 年內到期 人民幣 | 1-5 年內到期 人民幣 | 超過 5 年到期 人民幣 | 不計息 人民幣 | 總計 人民幣 |
|------------------|--------------------|-------------------|--------------------|----------------------|----------------------|
| 資產 | | | | | |
| 投資 | | | | | |
| - 人民幣債券 | 214,573,453 | 85,120,378 | 416,996,530 | - | 716,690,361 |
| - 人民幣上市股份 | - | - | - | 1,521,144,592 | 1,521,144,592 |
| - 人民幣集體投資計劃 | - | - | - | 230,732 | 230,732 |
| 存款準備金 | - | - | 226,044 | - | 226,044 |
| 應收利息 | - | - | - | 13,603,143 | 13,603,143 |
| 應收股息 | - | - | - | 151 | 151 |
| 應收申購款 | - | - | - | 4,584,468 | 4,584,468 |
| 現金及現金等價物 | 17,785,496 | - | - | - | 17,785,496 |
| 總資產 | 232,358,949 | 85,120,378 | 417,222,574 | 1,539,563,086 | 2,274,264,987 |
| 負債 | | | | | |
| 應付管理費用 | - | - | - | 2,458,775 | 2,458,775 |
| 應付受託人費用 | - | - | - | 229,612 | 229,612 |
| 應付贖回款 | - | - | - | 32,265,268 | 32,265,268 |
| 預提費用及其他應付款 | - | - | - | 796,726 | 796,726 |
| 應付派息 | - | - | - | 46,592,232 | 46,592,232 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | - | - | - | 2,184,219,293 | 2,184,219,293 |
| 總負債 | - | - | - | 2,266,561,906 | 2,266,561,906 |
| 利率敏感度缺口總額 | 232,358,949 | 85,120,378 | 417,222,574 | | |

基金經理和受託人通過量化(a)市場風險百分比；(b)不同國家風險期間來監控利率風險。截至二零二一年十二月三十一日，子基金已投資人民幣 685,882,507 元(二零二零年：人民幣 716,690,361 元)於附息證券，投資組合加權平均修正期為 3.72(二零二零年：4.43)。

於二零二一年十二月三十一日，倘子基金持有的債務證券的利率變動 100 個基點，而所有其他變量保持不變，資產淨值變動的百分比將是總投資組合加權平均修正期乘以 1%，即人民幣 25,514,829 元(二零二零年：人民幣 31,749,383 元)。

3.3 貨幣風險

貨幣風險指金融資產價值由於匯率變動而波動而產生的風險。子基金主要以人民幣作為其資產及負債的功能及呈報的貨幣，所以無因外幣結餘及交易而產生的貨幣風險。因此，基金經理認為沒有必要做出貨幣風險的敏感性分析。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.4 信貸及交易對手風險

信貸及交易對手風險是指發行人或交易對手未能或不願履行其與子基金訂立的合約責任的風險。

所有上市證券的交易，都通過經核准及知名的經紀公司進行結算或支付後的交付。只有當託管人收到付款後才會將出售的證券的交付給買方，因此違約的風險被認為不大。在執行購買時，證券經紀公司在收到證券後才付款。如果任何一方未能履行其責任時會致使交易失敗。

子基金的風險源於子基金主要集中投資的債券。子基金對其可持有的債券的最低信用評級沒有明確的限制。基金經理將積極管理子基金投資組合。倘若信用評級降低，基金經理將使用設計用於管理信用風險的信用分析和評級系統對投資組合狀況進行調整。

下表總結了子基金在二零二一年及二零二零年十二月三十一日的債務組合的信貸資質，該等資產佔基金資產淨值的 25.39%(二零二零年：32.81%)。

| 信用評級機構 | 評級範圍 | 二零二一年 佔資產淨值百分比 | 二零二零年 佔資產淨值百分比 |
|------------|------|-------------------|-------------------|
| 誠信 | AAA | 5.01% | 3.93% |
| | AA+ | 0.04% | - |
| | A-1 | - | 0.91% |
| 東方金誠 聯合 | AAA | 1.12% | - |
| | AAA | 3.35% | 1.82% |
| | AA+ | 0.01% | 0.01% |
| 穆迪 | AA | - | 0.04% |
| | Aa3 | 0.48% | - |
| | A1 | 5.47% | - |
| | A2 | 3.64% | - |
| | A3 | 1.37% | - |
| | Baa2 | 0.96% | - |
| 鵬元 | AA+ | 0.03% | - |
| | AA- | 0.03% | - |
| 標普 | AA+ | 0.98% | - |
| | A+ | - | 18.40% |
| | A- | 1.72% | - |
| 上海新世纪 | AAA | 1.12% | - |
| | AA | 0.06% | - |
| 中債資信評估 | A+ | - | 7.54% |
| | A | - | 0.16% |
| 總計 | | <u>25.39%</u> | <u>32.81%</u> |

基金經理在發行人性質以及發行人違約率歷史信息的基礎上，對以人民幣計價債券的信用質量進行了評估。

子基金也涉及現金及現金等價物的交易對手信用風險。

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.4 信貸及交易對手風險(續)

下表總結了子基金在二零二一年和二零二零年十二月三十一日的交易對手淨風險及其信用評級。

| 於二零二一年十二月三十一日 | 人民幣 | 信用評級 | 信用評級來源 |
|-----------------|---------------|------|--------|
| 投資 | | | |
| 中國銀行(香港)有限公司 | 765,147,238 | Aa3 | 穆迪 |
| 中國銀行股份有限公司 | 1,872,990,063 | A1 | 穆迪 |
| 現金及現金等價物 | | | |
| 中國銀行(香港)有限公司 | 57,482,285 | Aa3 | 穆迪 |
| 中國銀行股份有限公司 | 4,625,346 | A1 | 穆迪 |
| 存款準備金 | | | |
| 中國證券登記結算有限責任公司 | 959,880 | A1 | 穆迪 |
| 於二零二零年十二月三十一日 | 人民幣 | 信用評級 | 信用評級來源 |
| 投資 | | | |
| 中國銀行(香港)有限公司 | 792,796,891 | Aa3 | 穆迪 |
| 中國銀行股份有限公司 | 1,445,268,794 | A1 | 穆迪 |
| 現金及現金等價物 | | | |
| 中國銀行(香港)有限公司 | 16,170,895 | Aa3 | 穆迪 |
| 中國銀行股份有限公司 | 1,614,601 | A1 | 穆迪 |
| 存款準備金 | | | |
| 中國證券登記結算有限責任公司 | 226,044 | A1 | 穆迪 |

子基金使用違約機會率、違約風險和違約產生的損失來計量信貸風險及預期信貸損失。管理層在確定任何預期信貸損失時會考慮歷史分析和前瞻性信息。於二零二一年及二零二零年十二月三十一日，所有應收申購款、應收出售投資款、現金及現金等價物及存款準備金均由信用評級為 A1 或以上的交易對手持有，並將於一個月內結清。由於交易對手充分具備在短期內履約的能力，管理層認為違約機會率接近於零。由於任何該等減值對子基金而言均為非重大，因此，並無根據 12 個月預期信貸損失確認損失撥備。

截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日所承受的最大信貸風險為資產的賬面值(如財務狀況報表所示)，不包括非債權投資。

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.5 流動性風險

流動性風險指子基金或不能於到期時產生充足現金資源以完全履行其責任，或只能按重大不利的條款履行其責任的風險。

子基金面臨每日基金單位的贖回。子基金將大部份資產投資於可以即時在活躍的市場上出售和交易的證券。

下表根據於財務報表截止日至合同到期日間的剩餘期限將子基金的非衍生金融負債歸總為不同的到期組別。表中披露的金額為合約未貼現現金流量。由於折現的影響不重大，12 個月內到期的結餘與其賬面金額相近。

| | 二零二一年 不超過 三個月 人民幣 | 二零二零年 不超過 三個月 人民幣 |
|---------------|----------------------------|----------------------------|
| 應付管理費用 | 3,109,158 | 2,458,775 |
| 應付受託人費用 | 283,457 | 229,612 |
| 應付贖回款 | 7,968,128 | 32,265,268 |
| 應付購買投資款 | 94,633,913 | - |
| 預提費用及其他應付款 | 963,621 | 796,726 |
| 應付派息 | - | 46,592,232 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | 2,700,926,436 | 2,184,219,293 |
| | <u>2,807,884,713</u> | <u>2,266,561,906</u> |

基金單位依照基金單位持有人的選擇進行贖回。

截至二零二一年十二月三十一日，子基金總資產為人民幣 2,815,697,175 元(二零二零年：人民幣 2,274,264,987 元)。子基金通過投資於能於 7 日或以內變現的證券來管理其流動性風險。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.6 公允價值估計

在活躍市場交易的金融資產(如公開交易的衍生工具及交易性證券)以年末收盤時的市場報價確定其公允價值。子基金使用最後交易的市場價格作為金融資產的公允估值輸入。

活躍市場是指通過足夠頻率和數量的資產或負債交易從而持續提供定價信息的市場。

當報價可即時和定期從證券交易所、交易商、經紀、行業組織、定價服務方或監管機構獲得，而該等報價代表按公平交易基準進行的實際和常規市場交易時，則視為金融工具在活躍市場中具有報價。

子基金使用反映作出計量輸入參數重要性的公允價值計量分級機制分類公允價值計量。公允價值計量機制之分級如下：

- 相同資產或負債在活躍市場的報價(未經調整)(第1層)。
- 除了第1層所包括的報價外，該資產和負債的可觀察的其他輸入，可為直接(即例如價格)或間接(即源自價格)(第2層)。
- 資產和負債並非依據可觀察市場數據的輸入(即非可觀察輸入)(第3層)。

整體公允價值計量在公允價值等級的分類取決於對整體公允價值計量而言屬重要的輸入數據的最低等級。就此而言，輸入數據的重要性根據整體公允價值計量進行評估。倘公允價值計量使用的是需要根據非可觀察輸入作出重大調整的可觀察輸入，則該計量屬於第3層計量。評估特定輸入對公允價值計量整體的重要性需要作出判斷，並考慮資產或負債的特定因素。

測定何謂「可觀察」需要子基金作出重大判斷。子基金認為可觀察數據指由獨立活躍於相關市場內之來源所提供，並可即時獲得、定期分發或更新、可靠和可核實、不是專有的市場數據。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.6 公允價值估計(續)

下表分析在公允價值層級的子基金的金融資產按二零二一年及二零二零年十二月三十一日的公允價值：

| 於二零二一年十二月三十一日 | 第 1 層 | 第 2 層 | 第 3 層 | 總計 |
|---------------|----------------------|--------------------|----------|----------------------|
| 資產 | 人民幣 | 人民幣 | 人民幣 | 人民幣 |
| 投資 | | | | |
| - 人民幣債券 | - | 303,057,900 | - | 303,057,900 |
| - 人民幣上市債券 | 382,824,607 | - | - | 382,824,607 |
| - 人民幣上市股份 | 1,952,223,584 | - | - | 1,952,223,584 |
| - 人民幣集體投資計劃 | 31,210 | - | - | 31,210 |
| 總計 | 2,335,079,401 | 303,057,900 | - | 2,638,137,301 |

| 於二零二零年十二月三十一日 | 第 1 層 | 第 2 層 | 第 3 層 | 總計 |
|---------------|----------------------|--------------------|----------|----------------------|
| 資產 | 人民幣 | 人民幣 | 人民幣 | 人民幣 |
| 投資 | | | | |
| - 人民幣債券 | - | 716,690,361 | - | 716,690,361 |
| - 人民幣上市股份 | 1,521,144,592 | - | - | 1,521,144,592 |
| - 人民幣集體投資計劃 | 230,732 | - | - | 230,732 |
| 總計 | 1,521,375,324 | 716,690,361 | - | 2,238,065,685 |

根據活躍市場所報市價計算價值的投資分類為第 1 層，包括交易所買賣的債務證券及交易所買賣的基金。子基金不對報價作出調整。

於並非認為是活躍市場買賣並有市場報價、市場莊家定價及可觀察輸入數據支持的報價系統報價的投資分類為第 2 層。未上市人民幣債券投資參考中國中央國債登記結算有限責任公司提供的估值進行估值。

於並非認為是活躍市場買賣並因其交易的不頻繁而根據非可觀察輸入數據定價的投資分類為第 3 層。截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日，子基金未持有分類至第 3 層的投資。

年內各層級之間並無轉換(二零二零年：無轉換)。

應收利息、應收股息、現金及現金等價物、存款準備金、應收申購款、應收出售投資款、其他資產、應付管理費、應付贖回款、應付購買投資款、預提費用及其他應付款、應付派息及基金單位持有人應佔資產淨值的賬面值與其公允價值相近，並在財務狀況報表中列示。概無未以公允價值計量的金融資產和金融負債，且其公允價值已披露。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

3 財務風險管理(續)

3.7 資本風險管理

子基金的資本表示基金單位持有人應佔淨資產淨值。子基金不但要滿足投資目標，同時保持足夠的流動性，以應對基金持有人的贖回行為。

基金經理可：

- 根據子基金的組成檔贖回及發行新基金單位；
- 於釐定子基金向基金單位持有人的分派金額時行使酌情。

4 金融工具分類

金融資產

除了在財務狀況報表中披露的按公允價值透過損益記賬的歸類為金融資產的投資，其他金融資產，包括存款準備金、應收利息、應收股息、應收申購款、應收出售投資款、其他資產、現金及現金等價物，被歸類為「以攤餘成本計量的金融資產」。

金融負債

除了在財務狀況報表中披露的按公允價值透過損益記賬的金融負債，其他金融負債，包括應付管理費、應付贖回款、應付購買投資款、應付購買投資款、預提費用及其他應付款、應付派息，被歸類為「以攤餘成本計量的金融負債」。

5 投資淨收益

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|---------------|-------------------|--------------------|
| 出售投資之已變現收益淨額 | 191,361,771 | 348,633,388 |
| 投資價值未實現收益的淨變動 | (140,713,201) | 189,437,534 |
| | <u>50,648,570</u> | <u>538,070,922</u> |

6 已發行基金單位及單位持有人應佔資產淨值

單位持有人應佔資產淨值以可贖回價值報表。如基金單位持有人行使權利贖回子基金單位，則該淨值將計為應付贖回款。

A 類單位向零售投資者公開發售。I 類單位向機構投資者發售。P 類單位可供零售投資者進行投資，但需通過經分銷渠道提交交易訂單的分銷商或管理人指定的分銷商。M 類單位可供管理賬戶和管理人或其關聯實體管理的其他基金進行投資。截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止年度，子基金已發行人民幣 A 類、美元 A 類、港幣 A 類、美元 P 類(累算)和港幣 P 類(累算)單位。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

6 已發行基金單位及單位持有人應佔資產淨值(續)

下表披露各類基金單位於報告日期的每單位的淨資產值：

| | 二零二一年 | | | | |
|------------------------------------|------------------|----------------|----------------|------------------------|------------------------|
| | 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) |
| 於二零二一年十二月三十一日 單位持有人應佔單位資產淨 值 | 16.83 | 15.59 | 15.68 | 15.97 | 15.66 |

| | 二零二零年 | | | | |
|------------------------------------|------------------|----------------|----------------|------------------------|------------------------|
| | 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) |
| 於二零二零年十二月三十一日 單位持有人應佔單位資產淨 值 | 17.46 | 15.87 | 15.87 | 15.23 | 14.85 |

經理可酌情決定，收取不超過申購款 5% 的認購費用。

7 與受託人及其關聯公司、基金經理及關連人士的交易

下文概述子基金與基金經理、獲轉授投資職能者、該計劃的董事、受託人 / 保管人，或以上各方的任何關連人士於年內訂立的重大關聯方交易。關連人士為香港證券及期貨事務監察委員會制定的單位信託及互惠基金守則(「證監會守則」)所界定的關連人士。子基金與基金經理及其關連人士於年內進行的所有交易，均於日常業務過程中按正常商業條款進行。就經理人盡其所知，除下文所披露者外，子基金概無與關連人士進行任何其他交易。

7.1 管理費用

基金經理有權收取管理費用，每年收取的管理費用最高不超過子基金資產淨值的 2%。截至二零二一年十二月三十一日，基金經理按子基金 A 類單位和 P 類單位的資產淨值的年率 1.35%(二零二零年：年率 1.35%)收取，於每個交易日每日累計及計算，並於每月月底支付。

本年度收取的管理費用為人民幣 36,326,583 元(二零二零年：人民幣 25,822,815 元)。尚未支付的管理費用為人民幣 3,109,158 元(二零二零年：人民幣 2,458,775 元)。

7.2 受託人費用

受託人有權收取受託人費用，每年收取的受託人費用最高不超過子基金資產淨值的 0.5%。目前按子基金資產淨值的年率不高於 0.15%(二零二零年：年率不高於 0.15%)收取，最低每月受託人費用為人民幣 40,000 元(二零二零年：人民幣 40,000 元)，受託人費用於每個交易日每日累計及計算，並於每月月底支付。

本年度受託人費用為人民幣 3,314,371 元(二零二零年：人民幣 2,436,452 元)。尚未支付的受託人費用為人民幣 283,457 元(二零二零年：人民幣 229,612 元)。

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

7 與受託人及其關聯公司、基金經理及關連人士的交易(續)

7.3 託管費，銀行結餘及投資結餘

託管人有權按市場慣例收取交易買賣費用及不同費率的託管費。該等收費每月計算，並於每月月底支付。託管人每年收取的費用最高不超過子基金資產淨值的 0.10%(二零二零年：年率不高於 0.10%)。本財務年度內收取的託管費為人民幣 2,086,109 元(二零二零年：人民幣 1,463,739 元)。截至二零二一年十二月三十一日和二零二零年十二月三十一日，所有應付託管費已全部結清。

銀行結餘總額為人民幣 57,482,285 元(二零二零年：人民幣 16,170,895 元)與人民幣 4,625,346 元(二零二零年：人民幣 1,614,601 元)，分別為人民幣 1,872,990,063 元(二零二零年：人民幣 1,445,268,794 元)存放在中國銀行(香港)有限公司和人民幣 765,147,238 元(二零二零年：人民幣 792,796,891 元)存放在中國銀行股份有限公司。此外，子基金的投資均由託管人中國銀行(香港)有限公司和中國銀行股份有限公司託管。中國銀行(香港)有限公司和中國銀行股份有限公司為受託人的關連公司。

本年度銀行結餘所產生之利息收入為人民幣 117,673 元(二零二零年：人民幣 118,535 元)，而費用為人民幣 19,638 元(二零二零年：人民幣 12,565 元)。

7.4 交易成本

子基金在買賣投資時，利用受託人及其關聯公司的投資交易服務和經紀服務。子基金在下表披露了子基金與受託人及其關聯公司的投資交易：

| 公司名稱 | 年度交易手續費 人民幣 | 平均交易手續費百分比 % | 相關交易淨額 人民幣 | 佔年度交易淨額百分比 % |
|----------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 二零二一年 | | | | |
| 中國銀行股份有限公司 | 165,825 | 0.01% | 2,916,452,791 | 23.87% |
| 中銀國際英國保誠信託有限公司 | 223,450 | 0.00% | 12,217,617,413 | 100% |
| 二零二零年 | | | | |
| 中國銀行股份有限公司 | 75,375 | 0.01% | 1,348,759,792 | 21.79% |
| 中銀國際英國保誠信託有限公司 | 140,750 | 0.00% | 6,189,554,040 | 100.00% |

7.5 子基金單位持有

子基金允許經理及其關連人士以及該經理管理的其他基金申購和贖回子基金單位。截至二零二一年十二月三十一日和二零二零年十二月三十一日，經理及其關連人士於子基金的單位持有情況如下：

受託人中銀國際英國保誠信託有限公司的董事所持有的單位：

| 二零二一年 | 年初持有單位 | | | 年末持有行單位數目 | |
|--------|--------|--------|--------|-----------|--|
| | 數目 | 年內發行單位 | 年內贖回單位 | 位數目 | |
| 港幣 A 類 | - | 45,110 | - | 45,110 | |

截至二零二零年十二月三十一日，中銀國際英國保誠信託有限公司的董事沒有持有單位。

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

8 稅項

香港利得稅

因為子基金是根據香港證券及期貨條例第104條獲認可的集體投資計劃，因此根據香港稅務條例第26A(1A)條豁免繳納利得稅，故並無就香港利得稅作出撥備。

中國預扣稅

截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止年度，子基金投資於人民幣計值的中華人民共和國（「中國」）股票和債務證券。該年度內A股和H股產生的股息收入和存款產生的利息收入已繳付預扣稅。

子基金投資在香港聯交所上市的中國證券公司的 H 股。根據中國企業所得稅法，子基金可能須就買賣該等股份所實現的資本收益繳納中國稅項。因為董事相信子基金可以維持現有稅務法規及其對中國資本收益徵稅對此類股份轉讓所產生的影響尚未確定或澄清，子基金的財務報表中沒有或已經就該等收益作出中國稅項撥備。

子基金截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止年度的稅項如下所示：

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|---------|------------------|------------------|
| 股息收入預扣稅 | 2,799,357 | 2,183,979 |
| 利息收入預扣稅 | 8,697 | 5,852 |
| 稅項 | <u>2,808,054</u> | <u>2,189,831</u> |

本年內預提稅項變動如下：

| | 二零二一年 人民幣 | 二零二零年 人民幣 |
|--------------|--------------------|--------------------|
| 年初 | 7,703,081 | 7,702,462 |
| 於全面收入報表扣除的稅項 | 2,808,054 | 2,189,831 |
| 支付稅項 | <u>(2,698,673)</u> | <u>(2,189,212)</u> |
| 年末 | <u>7,812,462</u> | <u>7,703,081</u> |

9 非金錢佣金安排

截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止年度，基金經理確認，子基金在這段時期並無透過經紀商或交易商指示交易而作出非金錢佣金安排。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

10 對基金單位持有人的分派

子基金在二零二一年度執行過下述分派：

| | 二零二一年 人民幣 |
|---------------------------------------------------------------|----------------------|
| <u>中期分派</u> | |
| 二零二一年三月二十三日每單位分派人民幣 0.17 元，共有 46,730,405 個單位，並於二零二一年四月十二日支付 | (7,944,169) |
| 二零二一年三月二十三日每單位分派 0.17 港元，共有 86,285,626 個單位，並於二零二一年四月十二日支付 | (12,295,184) |
| 二零二一年三月二十三日每單位分派 0.17 美元，共有 7,662,516 個單位，並於二零二一年四月十二日支付 | (8,481,019) |
| 二零二一年六月三十日每單位分派人民幣 0.22 元，共有 49,135,521 個單位，並於二零二一年七月十九日支付 | (10,809,815) |
| 二零二一年六月三十日每單位分派 0.22 港元，共有 78,471,871 個單位，並於二零二一年七月十九日支付 | (14,368,670) |
| 二零二一年六月三十日每單位分派 0.22 美元，共有 7,652,757 個單位，並於二零二一年七月十九日支付 | (10,882,665) |
| 二零二一年九月二十八日每單位分派人民幣 0.28 元，共有 45,814,140 個單位，並於二零二一年十月十三日支付 | (12,827,959) |
| 二零二一年九月二十八日每單位分派 0.28 港元，共有 76,415,244 個單位，並於二零二一年十月十三日支付 | (17,771,740) |
| 二零二一年九月二十八日每單位分派 0.28 美元，共有 8,118,510 個單位，並於二零二一年十月十三日支付 | (14,694,081) |
| 二零二一年十月十八日每單位分派人民幣 0.12 元，共有 45,602,144 個單位，並於二零二一年十月二十五日支付 | (5,472,257) |
| 二零二一年九月十八日每單位分派 0.12 港元，共有 76,608,591 個單位，並於二零二一年十月二十五日支付 | (7,598,040) |
| 二零二一年九月十八日每單位分派 0.12 美元，共有 8,220,317 個單位，並於二零二一年十月二十五日支付 | (6,342,106) |
| 二零二一年十一月十六日每單位分派人民幣 0.12 元，共有 44,861,965 個單位，並於二零二一年十一月二十五日支付 | (5,383,436) |
| 二零二一年十一月十六日每單位分派 0.12 港元，共有 76,933,250 個單位，並於二零二一年十一月二十五日支付 | (7,568,385) |
| 二零二一年十一月十六日每單位分派 0.12 美元，共有 8,253,452 個單位，並於二零二一年十一月二十五日支付 | (6,322,903) |
| <u>年末分派</u> | |
| 二零二一年九月十六日每單位分派人民幣 0.12 元，共有 44,595,777 個單位，並於二零二一年十二月二十四日支付 | (5,351,493) |
| 二零二一年九月十六日每單位分派 0.12 港元，共有 80,289,874 個單位，並於二零二一年十二月二十四日支付 | (7,874,510) |
| 二零二一年九月十六日每單位分派 0.12 美元，共有 8,456,022 個單位，並於二零二一年十二月二十四日支付 | (6,470,972) |
| | <u>(168,459,404)</u> |

二零二一年度利潤分配前收益為人民幣 189,953,791 元。截至二零二一年一月一日，子基金沒有結轉的未分配收入。二零二一年十二月三十一日沒有未分配收入結轉至下個年度。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

財務報表附註
截至二零二一年十二月三十一日止年度

10 對基金單位持有人的分派(續)

子基金在二零二零年度執行過下述分派：

| | 二零二零年 人民幣 |
|------------------------------------------------------------|----------------------|
| <u>中期分派</u> | |
| 二零二零年三月十九日每單位分派人民幣 0.14 元，共有 84,965,733 個單位，並於二零二零年四月七日支付 | (10,786,570) |
| 二零二零年三月十九日每單位分派 0.14 港元，共有 24,906,550 個單位，並於二零二零年四月七日支付 | (3,486,917) |
| 二零二零年三月十九日每單位分派 0.14 美元，共有 7,135,079 個單位，並於二零二零年四月七日支付 | (7,034,532) |
| 二零二零年六月三十日每單位分派人民幣 0.15 元，共有 80,434,868 個單位，並於二零二零年七月二十日支付 | (11,014,349) |
| 二零二零年六月三十日每單位分派 0.15 港元，共有 27,351,832 個單位，並於二零二零年七月二十日支付 | (4,102,775) |
| 二零二零年六月三十日每單位分派 0.15 美元，共有 7,005,480 個單位，並於二零二零年七月二十日支付 | (7,434,565) |
| 二零二零年九月十五日每單位分派人民幣 0.25 元，共有 66,927,346 個單位，並於二零二零年十月十三日支付 | (14,613,586) |
| 二零二零年九月十五日每單位分派 0.25 港元，共有 26,510,477 個單位，並於二零二零年十月十三日支付 | (6,627,619) |
| 二零二零年九月十五日每單位分派 0.25 美元，共有 6,100,547 個單位，並於二零二零年十月十三日支付 | (10,323,956) |
| <u>年末分派</u> | |
| 二零二零年十二月十五日每單位分派人民幣 0.35 元，共有 70,463,069 個單位，並於二零二零年一月六日支付 | (20,787,662) |
| 二零二零年十二月十五日每單位分派 0.35 港元，共有 29,190,966 個單位，並於二零二零年一月六日支付 | (10,216,838) |
| 二零二零年十二月十五日每單位分派 0.35 美元，共有 6,883,575 個單位，並於二零二零年一月六日支付 | (15,742,288) |
| | <u>(122,171,657)</u> |

二零二零年度利潤分配前收益為人民幣 349,803,016 元。截至二零二零年一月一日，子基金沒有結轉的未分配收入。二零二零年十二月三十一日沒有未分配收入結轉至下個年度。

11 交易成本

該金額為支付給經紀或其他服務提供商的投資買賣佣金或其他費用。

12 財務報表批准

財務報表已於二零二二年四月二十五日經受託人及基金經理批准。

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)
於二零二一年十二月三十一日

| 上市/報價投資 | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|----------------------|-----------|-------------|--------------|
| 股票 | | | |
| 中國 | | | |
| 炬芯科技股份有限公司-A | 3,028 | 184,738 | 0.01 |
| 爱尔眼科医院集团股份有限公司-A | 279,901 | 11,834,214 | 0.44 |
| 中国国际航空股份有限公司-A | 3,300,000 | 30,129,000 | 1.12 |
| 安徽超越环保科技股份有限公司-A | 195 | 6,735 | 0.00 |
| 安徽华恒生物科技股份有限公司-A | 80,000 | 10,340,000 | 0.38 |
| 安徽华塑股份有限公司-A | 1,698 | 12,973 | 0.00 |
| 安徽英力电子科技股份有限公司-A | 201 | 4,316 | 0.00 |
| 普洛药业股份有限公司-A | 500,000 | 17,545,000 | 0.65 |
| 成都银行股份有限公司-A | 2,290,000 | 27,480,000 | 1.02 |
| 宁波银行股份有限公司-A | 2,086,859 | 79,884,963 | 2.96 |
| 北京建工环境修复股份有限公司-A | 300 | 8,103 | 0.00 |
| 北京万泰生物药业股份有限公司-A | 196,890 | 43,611,135 | 1.61 |
| 倍杰特集团股份有限公司-A | 438 | 9,636 | 0.00 |
| 江西百胜智能科技股份有限公司-A | 298 | 5,123 | 0.00 |
| 华测检测认证集团股份有限公司-A | 620,000 | 16,659,400 | 0.62 |
| 长春百克生物科技股份公司-A | 3,485 | 239,071 | 0.01 |
| 长春致远新能源装备股份有限公司-A | 236 | 11,569 | 0.00 |
| 科美诊断技术股份有限公司-A | 3,918 | 70,211 | 0.00 |
| 成都雷电微力科技股份有限公司-A | 233 | 56,808 | 0.00 |
| 招商银行股份有限公司-A | 1,826,300 | 88,959,073 | 3.29 |
| 中国神华能源股份有限公司-A | 880,000 | 19,817,600 | 0.73 |
| 中国电信股份有限公司-A | 59,111 | 255,951 | 0.01 |
| 中国旅游集团中免股份有限公司-A | 163,400 | 35,851,594 | 1.33 |
| 重庆长江造型材料(集团)股份有限公司-A | 83 | 4,920 | 0.00 |
| 宁德时代新能源科技股份有限公司-A | 84,956 | 49,954,128 | 1.85 |
| 大连德迈仕精密科技股份有限公司-A | 303 | 6,036 | 0.00 |
| 东阿阿胶股份有限公司-A | 329,965 | 16,085,794 | 0.60 |
| 东莞市鼎通精密科技股份有限公司-A | 161,082 | 11,353,059 | 0.42 |
| 读客文化股份有限公司-A | 390 | 8,502 | 0.00 |
| 青岛德固特节能装备股份有限公司-A | 106 | 4,426 | 0.00 |
| 迪阿股份有限公司-A | 5,401 | 687,439 | 0.03 |
| 东方财富信息股份有限公司-A | 1,963,300 | 72,858,063 | 2.70 |
| 东鹏饮料(集团)股份有限公司-A | 129 | 23,457 | 0.00 |
| 电连技术股份有限公司-A | 340,000 | 17,850,000 | 0.66 |
| 西安炬光科技股份有限公司-A | 2,012 | 440,628 | 0.02 |
| 惠州市华阳集团股份有限公司-A | 150,000 | 8,244,000 | 0.31 |
| 佛山市海天调味食品股份有限公司-A | 125,999 | 13,243,755 | 0.49 |
| 福建省招标股份有限公司-A | 7,172 | 75,449 | 0.00 |
| 中兰环保科技股份有限公司-A | 95 | 2,772 | 0.00 |
| 金鹰重型工程机械股份有限公司-A | 664 | 9,077 | 0.00 |
| 金地(集团)股份有限公司-A | 1,700,000 | 22,049,000 | 0.82 |
| 广联达科技股份有限公司-A | 313,400 | 20,051,332 | 0.74 |
| 歌尔股份有限公司-A | 300,000 | 16,230,000 | 0.60 |
| 长城汽车股份有限公司-A | 300,000 | 14,562,000 | 0.54 |
| 广东和胜工业铝材股份有限公司-A | 500,000 | 22,685,000 | 0.84 |
| 广东奇德新材料股份有限公司-A | 151 | 4,184 | 0.00 |



大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)
於二零二一年十二月三十一日

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|--------------------|-----------|-------------|--------------|
| 股票(續) | | | |
| 广东万年青制药股份有限公司-A | 2,631 | 126,946 | 0.00 |
| 广汇能源股份有限公司-A | 2,700,000 | 17,658,000 | 0.65 |
| 广州赛意信息科技股份有限公司-A | 720,000 | 21,009,600 | 0.78 |
| 广州华立科技股份有限公司-A | 129 | 7,766 | 0.00 |
| 贵州航天电器股份有限公司-A | 167,000 | 14,019,650 | 0.52 |
| 成都国光电气股份有限公司-A | 1,445 | 282,396 | 0.01 |
| 海尔智家股份有限公司-A | 1,699,874 | 50,809,234 | 1.88 |
| 杭州可靠护理用品股份有限公司-A | 801 | 14,779 | 0.00 |
| 杭州大地海洋环保股份有限公司-A | 103 | 3,155 | 0.00 |
| 杭州万事利丝绸文化股份有限公司-A | 265 | 6,670 | 0.00 |
| 河南百川畅银环保能源股份有限公司-A | 198 | 9,504 | 0.00 |
| 宏发科技股份有限公司-A | 511,964 | 38,212,993 | 1.41 |
| 徐州浩通新材料科技股份有限公司-A | 162 | 10,353 | 0.00 |
| 中山华利实业集团股份有限公司-A | 9,176 | 817,123 | 0.03 |
| 欢乐家食品集团股份有限公司-A | 928 | 16,082 | 0.00 |
| 湖北菲利华石英玻璃股份有限公司-A | 160,000 | 10,518,400 | 0.39 |
| 湖北共同药业股份有限公司-A | 286 | 11,732 | 0.00 |
| 汇通建设集团股份有限公司-A | 440 | 1,078 | 0.00 |
| 湖南达嘉维康医药产业股份有限公司-A | 5,405 | 122,640 | 0.00 |
| 湖南恒光科技股份有限公司-A | 226 | 14,023 | 0.00 |
| 深水海纳水务集团股份有限公司-A | 331 | 6,736 | 0.00 |
| 爱美客技术发展股份有限公司-A | 1 | 536 | 0.00 |
| 兴业银行股份有限公司-A | 1,000,000 | 19,040,000 | 0.70 |
| 内蒙古新华发行集团股份有限公司-A | 388 | 10,038 | 0.00 |
| 内蒙古远兴能源股份有限公司-A | 800,000 | 5,840,000 | 0.22 |
| 英诺激光科技股份有限公司-A | 146 | 6,104 | 0.00 |
| 杰克科技股份有限公司-A | 705,100 | 16,534,595 | 0.61 |
| 嘉亨家化股份有限公司-A | 183 | 6,015 | 0.00 |
| 江苏常熟农村商业银行股份有限公司-A | 3,550,000 | 23,465,500 | 0.87 |
| 江苏恒辉安防股份有限公司-A | 285 | 6,669 | 0.00 |
| 江苏华兰药用新材料股份有限公司-A | 403 | 21,037 | 0.00 |
| 江苏晶雪节能科技股份有限公司-A | 198 | 4,748 | 0.00 |
| 江苏泰慕士针纺科技股份有限公司-A | 90 | 1,488 | 0.00 |
| 江苏扬电科技股份有限公司-A | 130 | 6,583 | 0.00 |
| 江西志特新材料股份有限公司-A | 207 | 13,250 | 0.00 |
| 金三江(肇庆)硅材料股份有限公司-A | 258 | 5,312 | 0.00 |
| 绝味食品股份有限公司-A | 220,000 | 15,032,600 | 0.56 |
| 西安凯立新材料股份有限公司-A | 1,046 | 130,750 | 0.00 |
| 孩子王儿童用品股份有限公司-A | 739 | 12,290 | 0.00 |
| 昆山东威科技股份有限公司-A | 1,553 | 105,759 | 0.00 |
| 贵州茅台酒股份有限公司-A | 67,070 | 137,493,500 | 5.09 |
| 立高食品股份有限公司-A | 341 | 45,039 | 0.00 |
| 立讯精密工业股份有限公司-A | 811,968 | 39,948,826 | 1.48 |
| 泸州老窖股份有限公司-A | 92,920 | 23,589,600 | 0.87 |
| 江苏宏微科技股份有限公司-A | 1,303 | 161,455 | 0.01 |
| 广州迈普再生医学科技股份有限公司-A | 98 | 5,990 | 0.00 |
| 梦天家居集团股份有限公司-A | 224 | 5,665 | 0.00 |
| 迈拓仪表股份有限公司-A | 5,050 | 121,655 | 0.00 |
| 迈赫机器人自动化股份有限公司-A | 2,227 | 78,279 | 0.00 |
| 牧原食品股份有限公司-A | 340,000 | 18,142,399 | 0.67 |



大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)
於二零二一年十二月三十一日

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|-------------------------|-----------|-------------|--------------|
| 股票(續) | | | |
| 能科科技股份有限公司-A | 757,900 | 30,081,051 | 1.11 |
| 南京雷尔伟新技术股份有限公司-A | 134 | 3,473 | 0.00 |
| 南京商络电子股份有限公司-A | 363 | 6,327 | 0.00 |
| 南京诺唯赞生物科技股份有限公司-A | 35,595 | 3,773,070 | 0.14 |
| 宁波方正汽车模具股份有限公司-A | 109 | 3,633 | 0.00 |
| 宁波富佳实业股份有限公司-A | 147 | 2,909 | 0.00 |
| 宁波家联科技股份有限公司-A | 1,922 | 61,216 | 0.00 |
| 宁波乐惠国际工程装备股份有限公司-A | 516,680 | 18,765,818 | 0.69 |
| 宁波震裕科技股份有限公司-A | 155 | 20,238 | 0.00 |
| 宁夏宝丰能源集团股份有限公司-A | 599,947 | 10,415,080 | 0.39 |
| 宁夏晓鸣农牧股份有限公司-A | 264 | 7,038 | 0.00 |
| 普联软件股份有限公司-A | 334 | 10,551 | 0.00 |
| 保利发展控股集团股份有限公司-A | 812,001 | 12,691,576 | 0.47 |
| 重庆博腾制药科技股份有限公司-A | 269,900 | 24,142,555 | 0.89 |
| 上海概伦电子股份有限公司-A | 3,433 | 125,957 | 0.00 |
| 青岛百洋医药股份有限公司-A | 313 | 9,484 | 0.00 |
| 青岛海容商用冷链股份有限公司-A | 425,864 | 20,207,247 | 0.75 |
| 青岛云路先进材料技术股份有限公司-A | 3,022 | 358,047 | 0.01 |
| 瑞纳智能设备股份有限公司-A | 100,000 | 8,468,000 | 0.31 |
| 顺丰控股股份有限公司-A | 310,000 | 21,365,200 | 0.79 |
| 三羊马(重庆)物流股份有限公司-A | 63 | 5,402 | 0.00 |
| 深信服科技股份有限公司-A | 147,000 | 28,077,000 | 1.04 |
| 山东凯盛新材料股份有限公司-A | 4,990 | 243,362 | 0.01 |
| 山东玲珑轮胎股份有限公司-A | 330,000 | 12,061,500 | 0.45 |
| 山东力诺特种玻璃股份有限公司-A | 459 | 11,291 | 0.00 |
| 山东隆华新材料股份有限公司-A | 1,107 | 23,468 | 0.00 |
| 山东国瓷功能材料股份有限公司-A | 560,000 | 23,839,200 | 0.88 |
| 山东潍坊润丰化工股份有限公司-A | 624 | 36,192 | 0.00 |
| 山东威高骨科材料股份有限公司-A | 2,610 | 166,309 | 0.01 |
| 山东玉马遮阳科技股份有限公司-A | 410 | 11,771 | 0.00 |
| 上海艾录包装股份有限公司-A | 523 | 9,430 | 0.00 |
| 上海澳华内镜股份有限公司-A | 3,495 | 132,006 | 0.00 |
| 上海保立佳化工股份有限公司-A | 193 | 4,850 | 0.00 |
| 上海港湾基础建设(集团)股份有限公司-A | 150 | 2,390 | 0.00 |
| 上海能辉科技股份有限公司-A | 213 | 10,799 | 0.00 |
| 上海优宁维生物科技股份有限公司-A | 2,093 | 215,579 | 0.01 |
| 上海中洲特种合金材料股份有限公司-A | 218 | 5,306 | 0.00 |
| 邵阳维克液压股份有限公司-A | 103 | 3,270 | 0.00 |
| 深圳奥尼电子股份有限公司-A | 334 | 20,047 | 0.00 |
| 深圳市创益通技术股份有限公司-A | 234 | 7,701 | 0.00 |
| 深圳市长盈精密技术股份有限公司-A | 1,099,960 | 21,823,206 | 0.81 |
| 深圳市利和兴股份有限公司-A | 422 | 10,845 | 0.00 |
| 深圳市泛海统联精密制造股份有限公司-A | 2,039 | 84,537 | 0.00 |
| 深圳市特发服务股份有限公司-A | 1 | 33 | 0.00 |
| 深圳市崧盛电子股份有限公司-A | 142 | 7,640 | 0.00 |
| 深圳市三利谱光电科技股份有限公司-A | 550,000 | 34,364,000 | 1.27 |
| 深圳通业科技股份有限公司-A | 231 | 5,759 | 0.00 |
| 深圳传音控股股份有限公司-A | 216,936 | 34,037,258 | 1.26 |
| 深圳市城市交通规划设计研究中心股份有限公司-A | 427 | 14,074 | 0.00 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)
於二零二一年十二月三十一日

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|---------------------|-----------|-------------|--------------|
| 股票(續) | | | |
| 森赫电梯股份有限公司-A | 411 | 4,738 | 0.00 |
| 中密控股股份有限公司-A | 300,000 | 13,401,000 | 0.50 |
| 舍得酒业股份有限公司-A | 70,000 | 15,911,000 | 0.59 |
| 深圳市鼎阳科技股份有限公司-A | 3,492 | 342,146 | 0.01 |
| 广东中旗新材料股份有限公司-A | 103 | 3,328 | 0.00 |
| 阳光电源股份有限公司-A | 120,000 | 17,496,000 | 0.65 |
| 双乐颜料股份有限公司-A | 143 | 4,372 | 0.00 |
| 苏文电能科技股份有限公司-A | 317 | 23,328 | 0.00 |
| 苏州纳微科技股份有限公司-A | 3,476 | 277,454 | 0.01 |
| 苏州仕净科技股份有限公司-A | 222 | 7,177 | 0.00 |
| 苏州天华超净科技股份有限公司-A | 218,000 | 17,658,000 | 0.65 |
| 苏州天孚光通信股份有限公司-A | 400,000 | 14,640,000 | 0.54 |
| 苏州万祥科技股份有限公司-A | 340 | 10,027 | 0.00 |
| 苏州苏大维格科技集团股份有限公司-A | 300,000 | 9,999,000 | 0.37 |
| 中科创达软件股份有限公司-A | 213,977 | 29,618,696 | 1.10 |
| 青岛啤酒股份有限公司-A | 220,000 | 21,780,000 | 0.81 |
| 紫光国芯微电子股份有限公司-A | 127,000 | 28,575,000 | 1.06 |
| 上海唯赛勃环保科技有限公司-A | 2,996 | 85,266 | 0.00 |
| 温氏食品集团股份有限公司-A | 889,943 | 17,140,302 | 0.63 |
| 上海韦尔半导体股份有限公司-A | 21,100 | 6,557,247 | 0.24 |
| 广东东箭汽车科技股份有限公司-A | 593 | 10,710 | 0.00 |
| 武汉光庭信息技术股份有限公司-A | 2,497 | 238,389 | 0.01 |
| 宜宾五粮液股份有限公司-A | 189,000 | 42,082,740 | 1.56 |
| 无锡药明康德新药开发股份有限公司-A | 292,076 | 34,634,372 | 1.28 |
| 厦门东亚机械工业股份有限公司-A | 733 | 10,093 | 0.00 |
| 襄阳博亚精工装备股份有限公司-A | 232 | 9,268 | 0.00 |
| 新乡拓新药业股份有限公司-A | 154 | 12,382 | 0.00 |
| 烟台石川密封科技股份有限公司-A | 275 | 8,511 | 0.00 |
| 营口风光新材料股份有限公司-A | 4,868 | 180,359 | 0.01 |
| 远信工业股份有限公司-A | 155 | 4,635 | 0.00 |
| 永安期货股份有限公司-A | 547 | 20,523 | 0.00 |
| 永兴特种材料科技股份有限公司-A | 105,000 | 15,542,100 | 0.58 |
| 圆通速递股份有限公司-A | 950,000 | 15,846,000 | 0.59 |
| 韵达控股股份有限公司-A | 920,000 | 18,823,200 | 0.70 |
| 云南贝泰妮生物科技集团股份有限公司-A | 8,416 | 1,618,229 | 0.06 |
| 张小泉股份有限公司-A | 333 | 7,572 | 0.00 |
| 张家港海锅新能源装备股份有限公司-A | 87 | 3,410 | 0.00 |
| 张家港中环海陆高端装备股份有限公司-A | 240 | 9,600 | 0.00 |
| 浙江正泰电器股份有限公司-A | 281,876 | 15,190,298 | 0.56 |
| 浙江华友钴业股份有限公司-A | 287,924 | 31,760,896 | 1.18 |
| 浙江汇隆新材料股份有限公司-A | 119 | 2,362 | 0.00 |
| 浙江镇洋发展股份有限公司-A | 223 | 5,165 | 0.00 |
| 浙江泰福泵业股份有限公司-A | 106 | 2,624 | 0.00 |
| 浙江我武生物科技股份有限公司-A | 359,998 | 20,627,885 | 0.76 |
| 浙江争光实业股份有限公司-A | 258 | 10,013 | 0.00 |
| 江苏中捷精工科技股份有限公司-A | 136 | 5,175 | 0.00 |
| 中金辐照股份有限公司-A | 576 | 11,422 | 0.00 |
| 株洲旗滨集团股份有限公司-A | 1,921,800 | 32,862,780 | 1.22 |
| 紫金矿业集团股份有限公司-A | 3,149,829 | 30,553,341 | 1.13 |
| 浙江物产环保能源股份有限公司-A | 480 | 12,125 | 0.00 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)
於二零二一年十二月三十一日

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|-----------------------------------------------------------|------------|---------------|--------------|
| 股票(續) | | | |
| 廣州中望龍騰軟件股份有限公司-A | 151 | 52,824 | 0.00 |
| | | 1,882,370,555 | |
| 香港 | | | |
| 香港交易及結算所有限公司 | 38,000 | 14,098,546 | 0.52 |
| 申洲國際集團控股有限公司 | 100,000 | 12,212,353 | 0.45 |
| 騰訊控股有限公司 | 117,000 | 43,542,130 | 1.61 |
| | | 69,853,029 | |
| 報價債務證券 | | | |
| 英屬維爾京群島 | | | |
| 青山發電有限公司 3.25% S/A 2027.07.25 | 1,100,000 | 7,441,300 | 0.28 |
| CHINA CINDA (2020) I MANAGEMENT LIMITED 3% S/A 2031.01.20 | 4,250,000 | 26,813,424 | 0.99 |
| CHINA CINDA FINANCE(2017)I LIMITED 4.375% S/A 2025.02.08 | 1,000,000 | 6,709,426 | 0.25 |
| 中華電力有限公司 2.25% S/A 2031.07.21 | 1,000,000 | 6,318,315 | 0.23 |
| INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD 1.6% S/A 2026.09.01 | 5,000,000 | 31,054,171 | 1.15 |
| 中國建投致信有限公司 3.5% S/A 2027.11.24 | 1,400,000 | 9,485,242 | 0.35 |
| | | 87,821,878 | |
| 中國 | | | |
| 杭州銀行股份有限公司 0.2% A 2027.03.29 | 28,500 | 3,548,470 | 0.13 |
| 中華人民共和國財政部 1.75% S/A 2031.10.26 | 10,000,000 | 64,034,995 | 2.37 |
| 中華人民共和國財政部 2.5% S/A 2051.10.26 | 3,000,000 | 19,141,894 | 0.71 |
| 中華人民共和國財政部 3.94% S/A 2045.07.27 | 70 | 7,785 | 0.00 |
| 福建省華興集團有限責任公司 3.4% A 2024.07.27 | 300,000 | 30,156,180 | 1.12 |
| 廣發證券股份有限公司 4% A 2023.09.07 | 200,000 | 20,362,280 | 0.75 |
| 長城汽車股份有限公司 0.2% A 2027.06.10 | 3,440 | 526,553 | 0.02 |
| 宏發科技股份有限公司 0.3% A 2027.10.28 | 11,280 | 1,565,964 | 0.06 |
| 立訊精密工業股份有限公司 0.1% A 2026.11.03 | 1,916 | 241,848 | 0.01 |
| 仙樂健康科技股份有限公司 0.4% A 2027.04.19 | 6,576 | 787,268 | 0.03 |
| 天風證券股份有限公司 4.12% A 2023.06.28 | 100,000 | 10,103,020 | 0.37 |
| 江蘇省吳中經濟技術發展集團有限公司 0.2% A 2027.06.10 | 5,636 | 1,106,841 | 0.04 |
| 浙江三花智能控制股份有限公司 0.2% A 2027.06.01 | 5,109 | 724,981 | 0.03 |
| | | 152,308,079 | |
| 香港 | | | |
| 中華人民共和國香港特別行政區政府 1.75% S/A 2031.11.24 | 4,200,000 | 26,495,304 | 0.98 |
| 中華人民共和國香港特別行政區政府 2.375% S/A 2051.02.02 REGS | 2,200,000 | 12,921,201 | 0.48 |
| 工銀國際租賃財務有限公司 2.65% S/A 2031.08.02 | 9,200,000 | 57,890,644 | 2.14 |
| 萬科地產(香港)有限公司 3M L+1.55% Q 2023.05.25 | 2,000,000 | 12,631,294 | 0.47 |
| 萬科地產(香港)有限公司 4.2% S/A 2024.06.07 | 2,000,000 | 13,225,362 | 0.49 |
| | | 123,163,805 | |
| 新加坡 | | | |
| 中銀航空租賃有限公司 3% S/A 2029.09.11 REGS | 3,000,000 | 19,530,845 | 0.72 |
| | | 19,530,845 | |
| 集體投資計劃 | | | |
| 中國 | | | |
| 華寶興業現金添益型貨幣市場基金 | 312 | 31,210 | 0.00 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合(未經審計)(續)
於二零二一年十二月三十一日

| 報價債務證券(續) | 持股量 | 市場價格 人民幣 | 佔資產淨 值百分比 |
|-----------------------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 上市/報價投資的總額 | | 2,335,079,401 | 86.45 |
| 報價債務證券 | | | |
| 集體投資計劃 | | | |
| 安徽省交通控股集团有限公司 3.38% A 2026.08.24 | 300,000 | 30,201,300 | 1.12 |
| 中銀集團投資有限公司 2.7% A 2023.05.08 | 300,000 | 29,920,560 | 1.11 |
| 中銀集團投資有限公司 3.64% A 2024.06.24 | 300,000 | 30,478,680 | 1.13 |
| 中國投資有限責任公司 3.15% A 2023.01.14 | 200,000 | 20,088,400 | 0.74 |
| 中國東方資產管理股份有限公司 3.25% A 2024.11.05 | 100,000 | 10,027,020 | 0.37 |
| 中國南方電網有限責任公司 2.9% A 2023.03.06 | 100,000 | 10,019,160 | 0.37 |
| 中國進出口銀行 3.28% A 2024.02.11 | 400,000 | 40,567,520 | 1.50 |
| 佛燃能源集團股份有限公司 3.67% A 2024.04.21 | 100,000 | 10,133,360 | 0.38 |
| 廣州越秀集團股份有限公司 5.15% A 2023.03.26 | 300,000 | 30,825,780 | 1.14 |
| 招聯消費金融有限公司 3.55% A 2024.05.18 | 200,000 | 20,203,100 | 0.75 |
| 招聯消費金融有限公司 3.68% A 2024.06.16 | 100,000 | 10,133,330 | 0.38 |
| 山東省財金投資集團有限公司 3.78% A 2024.08.16 | 200,000 | 20,289,520 | 0.75 |
| 深圳市資本運營集團有限公司 3.2% A 2024.09.03 | 300,000 | 30,075,900 | 1.11 |
| 國家電網有限公司 3.32% A 2023.03.30 | 100,000 | 10,094,270 | 0.37 |
| 上市/報價投資的總額 | | 303,057,900 | 11.22 |
| 總投資 | | 2,638,137,301 | |
| 其他資產 | | 62,789,135 | 2.32 |
| 於二零二一年十二月三十一日的淨資產 | | 2,700,926,436 | 100.00 |
| 以成本計量的總投資 | | 2,410,928,628 | |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

投資組合變動報表(未經審計)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資 | 持股量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|---------------------------|--------------|-------------|---------|---------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 股票 | | | | | |
| 深圳市三旺通信股份有限公司-A | 1, 116 | — | — | (1, 116) | — |
| 南京大学环境规划设计研究院集团股份公司-A | 163 | — | — | (163) | — |
| 炬芯科技股份有限公司-A | — | 3, 028 | — | — | 3, 028 |
| 友邦保险控股有限公司 | — | 225, 000 | — | (225, 000) | — |
| 爱尔眼科医院集团股份有限公司-A | — | 399, 901 | — | (120, 000) | 279, 901 |
| 爱玛科技集团股份有限公司-A | — | 288 | — | (288) | — |
| 爱慕股份有限公司-A | — | 158 | — | (158) | — |
| 中国国际航空股份有限公司-A | 4, 679, 980 | 2, 649, 986 | — | (4, 029, 966) | 3, 300, 000 |
| 奥精医疗科技股份有限公司-A | — | 2, 603 | — | (2, 603) | — |
| 杭州联德精密机械股份有限公司-A | — | 276 | — | (276) | — |
| 安徽金春无纺布股份有限公司-A | 560 | — | — | (560) | — |
| 安徽超越环保科技股份有限公司-A | — | 1, 950 | — | (1, 755) | 195 |
| 安徽壹石通材料科技股份有限公司-A | — | 102, 571 | — | (102, 571) | — |
| 安徽华尔泰化工股份有限公司-A | — | 310 | — | (310) | — |
| 安徽华恒生物科技股份有限公司-A | — | 81, 791 | — | (1, 791) | 80, 000 |
| 安徽华骐环保科技股份有限公司-A | — | 1, 161 | — | (1, 161) | — |
| 安徽华塑股份有限公司-A | — | 1, 698 | — | — | 1, 698 |
| 安徽华业香料股份有限公司-A | 127 | — | — | (127) | — |
| 安徽金禾实业股份有限公司-A | — | 900, 000 | — | (900, 000) | — |
| 安徽蓝盾光电子股份有限公司-A | 5, 583 | — | — | (5, 583) | — |
| 安徽容知日新科技股份有限公司-A | — | 556 | — | (556) | — |
| 安徽英力电子科技股份有限公司-A | — | 2, 008 | — | (1, 807) | 201 |
| 安徽省通源环境节能股份有限公司-A | 2, 271 | — | — | (2, 271) | — |
| 安徽鑫铂铝业股份有限公司-A | — | 142 | — | (142) | — |
| 安徽元琛环保科技股份有限公司-A | — | 2, 072 | — | (2, 072) | — |
| 普洛药业股份有限公司-A | — | 1, 150, 000 | — | (650, 000) | 500, 000 |
| 深圳惠泰医疗器械股份有限公司-A | 1, 672 | — | — | (1, 672) | — |
| 江苏中信博新能源科技股份有限公司-A | — | 37, 692 | — | (37, 692) | — |
| 杭州安旭生物科技股份有限公司-A | — | 3, 894 | — | (3, 894) | — |
| 凯莱英医药集团(天津)股份有限公司-A | — | 128, 000 | — | (128, 000) | — |
| 深圳市道通科技股份有限公司-A | — | 220, 000 | — | (220, 000) | — |
| 爱威科技股份有限公司-A | — | 867 | — | (867) | — |
| 成都银行股份有限公司-A | — | 5, 820, 000 | — | (3, 530, 000) | 2, 290, 000 |
| 重慶銀行股份有限公司-A | — | 1, 920 | — | (1, 920) | — |
| 杭州银行股份有限公司-A | — | 750, 000 | — | (750, 000) | — |
| 宁波银行股份有限公司-A | 559, 940 | 1, 526, 919 | — | — | 2, 086, 859 |
| 宁波银行股份有限公司 (EX 24NOV2021) | — | 176, 990 | — | (176, 990) | — |
| 北京建工环境修复股份有限公司-A | — | 2, 993 | — | (2, 693) | 300 |
| 北京菜市口百货股份有限公司-A | — | 304 | — | (304) | — |
| 北京富吉瑞光电科技股份有限公司-A | — | 1, 116 | — | (1, 116) | — |
| 北京信安世纪科技股份有限公司-A | — | 1, 600 | — | (1, 600) | — |
| 北京凯因科技股份有限公司-A | — | 5, 353 | — | (5, 353) | — |
| 北京金房暖通节能技术股份有限公司-A | — | 84 | — | (84) | — |
| 北京东方雨虹防水技术股份有限公司-A | — | 280, 000 | — | (280, 000) | — |
| 北京顺鑫农业股份有限公司-A | 399, 913 | 447, 200 | — | (847, 113) | — |
| 北京阳光诺和药物研究股份有限公司-A | — | 1, 224 | — | (1, 224) | — |
| 北京天坛生物制品股份有限公司-A | — | 769, 921 | — | (769, 921) | — |
| 北京同益中新材料科技股份有限公司-A | — | 3, 676 | — | (3, 676) | — |
| 北京万泰生物药业股份有限公司-A | — | 172, 922 | 23, 968 | — | 196, 890 |
| 北京煜邦电力技术股份有限公司-A | — | 2, 882 | — | (2, 882) | — |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 持 股 量 | | | | |
|------------------------|-----------|-----------|-------|-------------|-----------|
| | 二零二零年十二 | | | | 二零二一年十二 |
| 上市/報價投資(續) | 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 北京正和恒基滨水生态环境治理股份有限公司-A | - | 152 | - | (152) | - |
| 恒玄科技(上海)股份有限公司-A | 4,145 | - | - | (4,145) | - |
| 倍杰特集团股份有限公司-A | - | 4,376 | - | (3,938) | 438 |
| 江西百胜智能科技股份有限公司-A | - | 2,972 | - | (2,674) | 298 |
| 兰剑智能科技股份有限公司-A | 1,670 | - | - | (1,670) | - |
| 海程邦达供应链管理股份有限公司-A | - | 249 | - | (249) | - |
| 创业慧康科技股份有限公司-A | 1,049,872 | - | - | (1,049,872) | - |
| 财达证券股份有限公司-A | - | 2,081 | - | (2,081) | - |
| 沧州明珠塑料股份有限公司-A | - | 2,649,965 | - | (2,649,965) | - |
| 康希诺生物股份公司-H | - | 30,800 | - | (30,800) | - |
| 江苏康众数字医疗科技股份有限公司-A | - | 1,889 | - | (1,889) | - |
| 华测检测认证集团股份有限公司-A | - | 620,000 | - | - | 620,000 |
| 长春百克生物科技股份公司-A | - | 3,485 | - | - | 3,485 |
| 长春英利汽车工业股份有限公司-A | - | 667 | - | (667) | - |
| 长春致远新能源装备股份有限公司-A | - | 2,353 | - | (2,117) | 236 |
| 常州银河世纪微电子股份有限公司-A | - | 3,247 | - | (3,247) | - |
| 福建创识科技股份有限公司-A | - | 3,423 | - | (3,423) | - |
| 科美诊断技术股份有限公司-A | - | 3,918 | - | - | 3,918 |
| 成都圣诺生物科技股份有限公司-A | - | 1,267 | - | (1,267) | - |
| 成都纵横自动化技术股份有限公司-A | - | 2,395 | - | (2,395) | - |
| 成都欧林生物科技股份有限公司-A | - | 3,376 | - | (3,376) | - |
| 成都雷电微力科技股份有限公司-A | - | 2,328 | - | (2,095) | 233 |
| 成都极米科技股份有限公司-A | - | 1,170 | - | (1,170) | - |
| 成都智明达电子股份有限公司-A | - | 872 | - | (872) | - |
| 气派科技股份有限公司-A | - | 1,911 | - | (1,911) | - |
| 中国建设银行股份有限公司-A | 3,200,000 | 6,100,000 | - | (9,300,000) | - |
| 中国国际金融股份有限公司-A | 4,056 | - | - | (4,056) | - |
| 招商银行股份有限公司-A | 1,146,300 | 940,000 | - | (260,000) | 1,826,300 |
| 中国黄金集团黄金珠宝股份有限公司-A | - | 913 | - | (913) | - |
| 中国太平洋保险(集团)股份有限公司-A | 381,835 | 2,309,300 | - | (2,691,135) | - |
| 中国铁建重工集团股份有限公司-A | - | 135,214 | - | (135,214) | - |
| 中铁高铁电气装备股份有限公司-A | - | 12,318 | - | (12,318) | - |
| 中铁特货物流股份有限公司-A | - | 2,002 | - | (2,002) | - |
| 华润啤酒(控股)有限公司 | - | 430,000 | - | (430,000) | - |
| 中国神华能源股份有限公司-A | - | 880,000 | - | - | 880,000 |
| 南方电网综合能源股份有限公司-A | - | 3,107 | - | (3,107) | - |
| 中国电信股份有限公司-A | - | 84,444 | - | (25,333) | 59,111 |
| 中国旅游集团中免股份有限公司-A | 85,900 | 188,000 | - | (110,500) | 163,400 |
| 万科企业股份有限公司-A | - | 1,699,838 | - | (1,699,838) | - |
| 重庆长安汽车股份有限公司-A | - | 700,000 | - | (700,000) | - |
| 重庆长江造型材料(集团)股份有限公司-A | - | 83 | - | - | 83 |
| 重庆智飞生物制品股份有限公司-A | - | 253,960 | - | (253,960) | - |
| 楚天龙股份有限公司-A | - | 346 | - | (346) | - |
| 合肥芯碁微电子装备股份有限公司-A | - | 3,396 | - | (3,396) | - |
| 中信证券股份有限公司-A | 814,250 | - | - | (814,250) | - |
| 中伟新材料股份有限公司-A | 5,695 | - | - | (5,695) | - |
| 宁德时代新能源科技股份有限公司-A | - | 84,956 | - | - | 84,956 |
| 碧桂园服务控股有限公司 | - | 600,000 | - | (600,000) | - |
| 明冠新材料股份有限公司-A | 3,234 | 300,000 | - | (303,234) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|---------------------|--------------|-----------|---------|-------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 股票(續) | | | | | |
| 合兴汽车电子股份有限公司-A | - | 192 | - | (192) | - |
| 大连德迈仕精密科技股份有限公司-A | - | 3,021 | - | (2,718) | 303 |
| 杭州安恒信息技术股份有限公司-A | - | 80,000 | - | (80,000) | - |
| 迪哲(江苏)医药股份有限公司-A | - | 8,925 | - | (8,925) | - |
| 厦门狄耐克智能科技股份有限公司-A | 398 | - | 199 | (597) | - |
| 东阿阿胶股份有限公司-A | - | 329,965 | - | - | 329,965 |
| 东莞市鼎通精密科技股份有限公司-A | - | 161,082 | - | - | 161,082 |
| 读客文化股份有限公司-A | - | 3,898 | - | (3,508) | 390 |
| 青岛德固特节能装备股份有限公司-A | - | 1,053 | - | (947) | 106 |
| 迪阿股份有限公司-A | - | 5,401 | - | - | 5,401 |
| 东方财富信息股份有限公司-A | 1,085,440 | 904,372 | 276,488 | (303,000) | 1,963,300 |
| 东方航空物流股份有限公司-A | - | 726 | - | (726) | - |
| 东鹏饮料(集团)股份有限公司-A | - | 129 | - | - | 129 |
| 电连技术股份有限公司-A | - | 1,359,950 | - | (1,019,950) | 340,000 |
| 上海和辉光电股份有限公司-A | - | 257,352 | - | (257,352) | - |
| 中际联合(北京)科技股份有限公司-A | - | 107 | - | (107) | - |
| 西安炬光科技股份有限公司-A | - | 2,012 | - | - | 2,012 |
| 惠州市华阳集团股份有限公司-A | - | 330,000 | - | (180,000) | 150,000 |
| 佛山市海天调味食品股份有限公司-A | - | 202,223 | 22,176 | (98,400) | 125,999 |
| 福立旺精密机电(中国)股份有限公司-A | 3,805 | - | - | (3,805) | - |
| 福建圣农发展股份有限公司-A | - | 1,090,000 | - | (1,090,000) | - |
| 福建省招标股份有限公司-A | - | 7,172 | - | - | 7,172 |
| 中兰环保科技股份有限公司-A | - | 948 | - | (853) | 95 |
| 格科微有限公司-A | - | 22,994 | - | (22,994) | - |
| 甘肃上峰水泥股份有限公司-A | - | 1,859,081 | - | (1,859,081) | - |
| 呈和科技股份有限公司-A | - | 462,065 | - | (462,065) | - |
| 金鹰重型工程机械股份有限公司-A | - | 6,636 | - | (5,972) | 664 |
| 金地(集团)股份有限公司-A | - | 1,700,000 | - | - | 1,700,000 |
| 深圳市振邦智能科技股份有限公司-A | 108 | - | - | (108) | - |
| 北京兆易创新科技股份有限公司-A | - | 150,000 | - | (150,000) | - |
| 广联达科技股份有限公司-A | 213,400 | 100,000 | - | - | 313,400 |
| 歌尔股份有限公司-A | 827,800 | 399,916 | - | (927,716) | 300,000 |
| 长城汽车股份有限公司-A | - | 600,000 | - | (300,000) | 300,000 |
| 格力电器销售有限公司-A | 345,900 | - | - | (345,900) | - |
| 有研粉末新材料股份有限公司-A | - | 1,933 | - | (1,933) | - |
| 广东风华高新科技股份有限公司-A | 640,000 | - | - | (640,000) | - |
| 广东富信科技股份有限公司-A | - | 2,515 | - | (2,515) | - |
| 广东海大集团股份有限公司-A | 26 | 400,000 | - | (400,026) | - |
| 广东洪兴实业股份有限公司-A | - | 118 | - | (118) | - |
| 广东和胜工业铝材股份有限公司-A | - | 1,280,000 | - | (780,000) | 500,000 |
| 广东惠云钛业股份有限公司-A | 703 | - | - | (703) | - |
| 广东炬申物流股份有限公司-A | - | 174 | - | (174) | - |
| 广东科翔电子科技股份有限公司-A | 336 | - | - | (336) | - |
| 广东奇德新材料股份有限公司-A | - | 1,508 | - | (1,357) | 151 |
| 广东莱尔新材料科技股份有限公司-A | - | 2,141 | - | (2,141) | - |
| 广东万年青制药股份有限公司-A | - | 2,631 | - | - | 2,631 |
| 广东利元亨智能装备股份有限公司-A | - | 1,264 | - | (1,264) | - |
| 广东丸美生物技术股份有限公司-A | 431 | - | - | (431) | - |

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的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)
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持 股 量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|--------------------|--------------|-----------|--------|-------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 股票(續) | | | | | |
| 广东三和管桩股份有限公司-A | - | 279 | - | (279) | - |
| 广东顺控发展股份有限公司-A | - | 383 | - | (383) | - |
| 广汇能源股份有限公司-A | 3,699,976 | 2,700,000 | - | (3,699,976) | 2,700,000 |
| 广联航空工业股份有限公司-A | 879 | - | - | (879) | - |
| 广州禾信仪器股份有限公司-A | - | 915 | - | (915) | - |
| 广州三孚新材料科技股份有限公司-A | - | 1,262 | - | (1,262) | - |
| 广州赛意信息科技股份有限公司-A | - | 1,469,913 | - | (749,913) | 720,000 |
| 广州天赐高新材料股份有限公司-A | - | 339,851 | 39,130 | (378,981) | - |
| 广州华立科技股份有限公司-A | - | 1,285 | - | (1,156) | 129 |
| 贵州航宇科技发展股份有限公司-A | - | 2,029 | - | (2,029) | - |
| 贵州航天电器股份有限公司-A | - | 599,946 | - | (432,946) | 167,000 |
| 贵州振华新材料股份有限公司-A | - | 7,989 | - | (7,989) | - |
| 国邦医药集团股份有限公司-A | - | 310 | - | (310) | - |
| 成都国光电气股份有限公司-A | - | 1,445 | - | - | 1,445 |
| 海尔智家股份有限公司-A | 1,050,000 | 1,899,874 | - | (1,250,000) | 1,699,874 |
| 海南金盘智能科技股份有限公司-A | - | 3,471 | - | (3,471) | - |
| 海天水务集团股份公司-A | - | 382 | - | (382) | - |
| 杭州奥泰生物技术股份有限公司-A | - | 1,576 | - | (1,576) | - |
| 杭州博拓生物科技股份有限公司-A | - | 2,206 | - | (2,206) | - |
| 杭州可靠护理用品股份有限公司-A | - | 8,007 | - | (7,206) | 801 |
| 杭州热电集团股份有限公司-A | - | 145 | - | (145) | - |
| 杭州大地海洋环保股份有限公司-A | - | 1,025 | - | (922) | 103 |
| 杭州迪普科技股份有限公司-A | 756,306 | - | - | (756,306) | - |
| 杭州福莱茵特股份有限公司-A | - | 121 | - | (121) | - |
| 杭州海康威视数字技术股份有限公司-A | - | 567,000 | - | (567,000) | - |
| 杭州宏华数码科技股份有限公司-A | - | 777 | - | (777) | - |
| 杭州华旺新材料科技股份有限公司-A | 229 | - | - | (229) | - |
| 杭州爱科科技股份有限公司-A | - | 1,136 | - | (1,136) | - |
| 杭州柯林电气股份有限公司-A | - | 1,240 | - | (1,240) | - |
| 杭州市园林绿化股份有限公司-A | - | 165 | - | (165) | - |
| 杭州美迪凯光电科技股份有限公司-A | - | 10,621 | - | (10,621) | - |
| 杭州品茗安控信息技术股份有限公司-A | - | 1,128 | - | (1,128) | - |
| 杭州万事利丝绸文化股份有限公司-A | - | 2,646 | - | (2,381) | 265 |
| 杭州西力智能科技股份有限公司-A | - | 2,973 | - | (2,973) | - |
| 河北华通线缆集团股份有限公司-A | - | 302 | - | (302) | - |
| 河北中瓷电子科技股份有限公司-A | 110 | - | - | (110) | - |
| 黑龙江出版传媒股份有限公司-A | - | 172 | - | (172) | - |
| 河南百川畅银环保能源股份有限公司-A | - | 1,980 | - | (1,782) | 198 |
| 河南蓝天燃气股份有限公司-A | - | 312 | - | (312) | - |
| 河南明泰铝业股份有限公司-A | - | 30,000 | - | (30,000) | - |
| 恒盛能源股份有限公司-A | - | 184 | - | (184) | - |
| 江苏海晨物流股份有限公司-A | 481 | - | - | (481) | - |
| 江苏浩欧博生物医药股份有限公司-A | - | 1,045 | - | (1,045) | - |
| 香港交易及结算所有限公司 | - | 38,000 | - | - | 38,000 |
| 宏发科技股份有限公司-A | 378,000 | 799,964 | - | (666,000) | 511,964 |
| 徐州浩通新材料科技股份有限公司-A | - | 1,619 | - | (1,457) | 162 |
| 中山华利实业集团股份有限公司-A | - | 9,176 | - | - | 9,176 |
| 欢乐家食品集团股份有限公司-A | - | 9,278 | - | (8,350) | 928 |
| 华域汽车系统股份有限公司-A | 1,164,431 | - | - | (1,164,431) | - |
| 湖北菲利华石英玻璃股份有限公司-A | - | 680,000 | - | (520,000) | 160,000 |

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | | | | |
|--------------------|------------------|-----------|---------|-------------|------------------|
| | 二零二零年十二 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 二零二一年十二 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 湖北共同药业股份有限公司-A | - | 2,857 | - | (2,571) | 286 |
| 汇通建设集团股份有限公司-A | - | 440 | - | - | 440 |
| 人福医药集团股份有限公司-A | - | 1,499,942 | - | (1,499,942) | - |
| 湖南艾华集团股份有限公司-A | 840,000 | 220,000 | - | (1,060,000) | - |
| 湖南长远锂科股份有限公司-A | - | 359,220 | - | (359,220) | - |
| 湖南达嘉维康医药产业股份有限公司-A | - | 5,405 | - | - | 5,405 |
| 湖南恒光科技股份有限公司-A | - | 2,257 | - | (2,031) | 226 |
| 湖南华联瓷业股份有限公司-A | - | 260 | - | (260) | - |
| 湖南丽臣实业股份有限公司-A | - | 63 | - | (63) | - |
| 湖南松井新材料股份有限公司-A | - | 212,096 | - | (212,096) | - |
| 湖南华菱线缆股份有限公司-A | - | 545 | - | (545) | - |
| 湖南华纳大药厂股份有限公司-A | - | 1,121 | - | (1,121) | - |
| 恒生电子股份有限公司-A | 309,907 | - | - | (309,907) | - |
| 武汉回盛生物科技股份有限公司-A | 617 | 518,200 | - | (518,817) | - |
| 深水海纳水务集团股份有限公司-A | - | 3,301 | - | (2,970) | 331 |
| 科大讯飞股份有限公司-A | - | 100,000 | - | (100,000) | - |
| 爱美客技术发展股份有限公司-A | 28,729 | 1 | 378 | (29,107) | 1 |
| 中国工商银行股份有限公司-A | 7,300,000 | - | - | (7,300,000) | - |
| 兴业银行股份有限公司-A | 2,100,000 | 1,900,000 | - | (3,000,000) | 1,000,000 |
| 昆山龙腾光电股份有限公司-A | 41,469 | - | - | (41,469) | - |
| 内蒙古大中矿业股份有限公司-A | - | 1,306 | - | (1,306) | - |
| 内蒙古新华发行集团股份有限公司-A | - | 388 | - | - | 388 |
| 内蒙古伊利实业集团股份有限公司-A | 428,957 | - | - | (428,957) | - |
| 内蒙古远兴能源股份有限公司-A | - | 800,000 | - | - | 800,000 |
| 英诺激光科技股份有限公司-A | - | 1,452 | - | (1,306) | 146 |
| 杰克科技股份有限公司-A | 1,300,862 | 1,035,100 | - | (1,630,862) | 705,100 |
| 嘉亨家化股份有限公司-A | - | 1,827 | - | (1,644) | 183 |
| 安徽巨一科技股份有限公司-A | - | 5,295 | - | (5,295) | - |
| 佳禾食品工业股份有限公司-A | - | 180 | - | (180) | - |
| 江苏艾迪药业股份有限公司-A | 9,725 | - | - | (9,725) | - |
| 江苏必得科技股份有限公司-A | - | 111 | - | (111) | - |
| 江苏博俊工业科技股份有限公司-A | 2,614 | - | - | (2,614) | - |
| 江苏长龄液压股份有限公司-A | - | 84 | - | (84) | - |
| 江苏常熟农村商业银行股份有限公司-A | - | 3,550,000 | - | - | 3,550,000 |
| 江苏传智播客教育科技股份有限公司-A | - | 162 | - | (162) | - |
| 江苏富淼科技股份有限公司-A | - | 1,982 | - | (1,982) | - |
| 江苏金迪克生物技术股份有限公司-A | - | 2,309 | - | (2,309) | - |
| 江苏恒辉安防股份有限公司-A | - | 2,843 | - | (2,558) | 285 |
| 江苏恒瑞医药股份有限公司-A | 603,701 | 309,920 | 121,140 | (1,034,761) | - |
| 江苏华兰药用新材料股份有限公司-A | - | 4,025 | - | (3,622) | 403 |

(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持 股 量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|----------------------|--------------|-----------|-------|-------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 股票(續) | | | | | |
| 江苏吉贝尔药业股份有限公司-A | 9,604 | - | - | (9,604) | - |
| 江苏晶雪节能科技股份有限公司-A | - | 1,977 | - | (1,779) | 198 |
| 江苏联测机电科技股份有限公司-A | - | 793 | - | (793) | - |
| 江苏利柏特股份有限公司-A | - | 297 | - | (297) | - |
| 江苏迈信林航空科技股份有限公司-A | - | 2,611 | - | (2,611) | - |
| 江苏嵘泰工业股份有限公司-A | - | 136 | - | (136) | - |
| 江苏泰慕士针纺科技股份有限公司-A | - | 90 | - | - | 90 |
| 江苏同力日升机械股份有限公司-A | - | 159 | - | (159) | - |
| 江苏扬电科技股份有限公司-A | - | 1,298 | - | (1,168) | 130 |
| 江苏洋河酒厂股份有限公司-A | - | 190,000 | - | (190,000) | - |
| 江西志特新材料股份有限公司-A | - | 2,070 | - | (1,863) | 207 |
| 江西九丰能源股份有限公司-A | - | 363 | - | (363) | - |
| 江西悦安新材料股份有限公司-A | - | 150,000 | - | (150,000) | - |
| 吉林奥来德光电材料股份有限公司-A | 1,192 | - | - | (1,192) | - |
| 长春吉大正元信息技术股份有限公司-A | 177 | - | - | (177) | - |
| 济南圣泉集团股份有限公司-A | - | 400 | - | (400) | - |
| 精进电动科技股份有限公司-A | - | 15,230 | - | (15,230) | - |
| 景津装备股份有限公司-A | - | 570,000 | - | (570,000) | - |
| 金冠电气股份有限公司-A | - | 2,651 | - | (2,651) | - |
| 金三江(肇庆)硅材料股份有限公司-A | - | 2,580 | - | (2,322) | 258 |
| 中炬高新技术实业(集团)股份有限公司-A | - | 475,000 | - | (475,000) | - |
| 绝味食品股份有限公司-A | 340,000 | 40,000 | - | (160,000) | 220,000 |
| 西安凯立新材料股份有限公司-A | - | 1,046 | - | - | 1,046 |
| 凯龙高科技股份有限公司-A | 3,213 | - | - | (3,213) | - |
| 九州朝日放送株式會社-A | 7,644 | - | - | (7,644) | - |
| 科德数控股份有限公司-A | - | 1,495 | - | (1,495) | - |
| 孩子王儿童用品股份有限公司-A | - | 7,386 | - | (6,647) | 739 |
| 西安康拓医疗技术股份有限公司-A | - | 1,068 | - | (1,068) | - |
| 昆山东威科技股份有限公司-A | - | 381,553 | - | (380,000) | 1,553 |
| 昆山国力电子科技股份有限公司-A | - | 1,480 | - | (1,480) | - |
| 贵州茅台酒股份有限公司-A | 33,370 | 44,000 | - | (10,300) | 67,070 |
| 苏州绿的谐波传动科技股份有限公司-A | 134,000 | - | - | (134,000) | - |
| 立达信物联科技股份有限公司-A | - | 233 | - | (233) | - |
| 联创电子科技股份有限公司-A | - | 200,000 | - | (200,000) | - |
| 辽宁成大生物股份有限公司-A | - | 9,881 | - | (9,881) | - |
| 利尔化学股份有限公司-A | - | 1,170,000 | - | (1,170,000) | - |
| 立高食品股份有限公司-A | - | 3,403 | - | (3,062) | 341 |
| 利华益维远化学股份有限公司-A | - | 542 | - | (542) | - |
| 丽珠医药集团股份有限公司-A | 229,623 | - | - | (229,623) | - |
| 龙岩高岭土股份有限公司-A | - | 119 | - | (119) | - |
| 绿田机械股份有限公司-A | - | 82 | - | (82) | - |
| 立讯精密工业股份有限公司-A | 821,349 | 999,968 | - | (1,009,349) | 811,968 |
| 泸州老窖股份有限公司-A | - | 124,920 | - | (32,000) | 92,920 |
| 江苏宏微科技股份有限公司-A | - | 1,303 | - | - | 1,303 |
| 敏华控股有限公司 | - | 1,910,000 | - | (1,910,000) | - |
| 曼卡龙珠宝股份有限公司-A | - | 4,656 | - | (4,656) | - |
| 广州迈普再生医学科技股份有限公司-A | - | 979 | - | (881) | 98 |
| 美团-CLASS B | - | 188,500 | - | (188,500) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 持股量 | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-------|-------------|---------|
| | 二零二零年十二 | | | | 二零二一年十二 |
| 上市/報價投資(續) | 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 梦天家居集团股份有限公司-A | - | 224 | - | - | 224 |
| 中国冶金科工股份有限公司-A | - | 4,000,000 | - | (4,000,000) | - |
| 迈拓仪表股份有限公司-A | - | 5,050 | - | - | 5,050 |
| 迈赫机器人自动化股份有限公司-A | - | 2,227 | - | - | 2,227 |
| 南微医学科技股份有限公司-A | 55,394 | 30,000 | - | (85,394) | - |
| 美的集团股份有限公司-A | 394,200 | 70,000 | - | (464,200) | - |
| 牧原食品股份有限公司-A | - | 340,000 | - | - | 340,000 |
| 南侨食品集团(上海)股份有限公司-A | - | 254 | - | (254) | - |
| 能科科技股份有限公司-A | - | 1,263,500 | - | (505,600) | 757,900 |
| 南京佳力图机房环境技术股份有限公司-A | - | 400,000 | - | (400,000) | - |
| 南京雷尔伟新技术股份有限公司-A | - | 1,333 | - | (1,199) | 134 |
| 南京盛航海运股份有限公司-A | - | 92 | - | (92) | - |
| 南京商络电子股份有限公司-A | - | 3,624 | - | (3,261) | 363 |
| 南京诺唯赞生物科技股份有限公司-A | - | 35,595 | - | - | 35,595 |
| 南京云海特种金属股份有限公司-A | - | 2,319,948 | - | (2,319,948) | - |
| 南通江天化学股份有限公司-A | 1,628 | - | - | (1,628) | - |
| 南通星球石墨股份有限公司-A | - | 1,554 | - | (1,554) | - |
| 纽威数控装备(苏州)股份有限公司-A | - | 5,762 | - | (5,762) | - |
| 宁波大叶园林设备股份有限公司-A | 448 | - | - | (448) | - |
| 宁波德昌电机股份有限公司-A | - | 187 | - | (187) | - |
| 宁波方正汽车模具股份有限公司-A | - | 1,088 | - | (979) | 109 |
| 宁波富佳实业股份有限公司-A | - | 147 | - | - | 147 |
| 宁波家联科技股份有限公司-A | - | 1,922 | - | - | 1,922 |
| 宁波继峰汽车零部件股份有限公司-A | - | 700,000 | - | (700,000) | - |
| 宁波乐惠国际工程装备股份有限公司-A | - | 516,680 | - | - | 516,680 |
| 宁波世茂能源股份有限公司-A | - | 148 | - | (148) | - |
| 宁波震裕科技股份有限公司-A | - | 1,545 | - | (1,390) | 155 |
| 宁夏宝丰能源集团股份有限公司-A | - | 599,947 | - | - | 599,947 |
| 宁夏晓鸣农牧股份有限公司-A | - | 2,640 | - | (2,376) | 264 |
| 北京诺禾致源科技股份有限公司-A | - | 3,710 | - | (3,710) | - |
| 株洲欧科亿数控精密刀具股份有限公司-A | 2,455 | - | - | (2,455) | - |
| 广东奥普特科技股份有限公司-A | 2,009 | - | - | (2,009) | - |
| 熊猫乳品集团股份有限公司-A | 496 | - | - | (496) | - |
| 普联软件股份有限公司-A | - | 2,081 | 125 | (1,872) | 334 |
| 完美世界股份有限公司-A | - | 1,070,000 | - | (1,070,000) | - |
| 平安银行股份有限公司-A | 1,381,300 | 1,922,706 | - | (3,304,006) | - |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司-A | 1,470,244 | 170,000 | - | (1,640,244) | - |
| 品渥食品股份有限公司-A | 272 | - | - | (272) | - |
| 保利发展控股集团股份有限公司-A | 1,192,055 | 1,299,946 | - | (1,680,000) | 812,001 |
| 谱尼测试集团股份有限公司-A | 201 | - | - | (201) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | | | | |
|----------------------|------------------|---------|-------|-----------|------------------|
| | 二零二零年十二 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 二零二一年十二 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 重庆博腾制药科技股份有限公司-A | - | 350,000 | - | (80,100) | 269,900 |
| 上海概伦电子股份有限公司-A | - | 3,433 | - | - | 3,433 |
| 普冉半导体(上海)股份有限公司-A | - | 703 | - | (703) | - |
| 上海派能能源科技股份有限公司-A | 5,286 | - | - | (5,286) | - |
| 齐鲁银行股份有限公司-A | - | 1,772 | - | (1,772) | - |
| 青岛百洋医药股份有限公司-A | - | 3,127 | - | (2,814) | 313 |
| 青岛征和工业股份有限公司-A | - | 90 | - | (90) | - |
| 青岛达能环保设备股份有限公司-A | - | 1,142 | - | (1,142) | - |
| 青岛食品股份有限公司-A | - | 83 | - | (83) | - |
| 青岛海容商用冷链股份有限公司-A | - | 425,864 | - | - | 425,864 |
| 青岛海泰新光科技股份有限公司-A | - | 1,759 | - | (1,759) | - |
| 青岛云路先进材料技术股份有限公司-A | - | 3,022 | - | - | 3,022 |
| 秦皇岛天泰装备制造股份有限公司-A | 1,669 | - | - | (1,669) | - |
| 深圳瑞华泰薄膜科技股份有限公司-A | - | 2,964 | - | (2,964) | - |
| 荣昌生物制药(烟台)股份有限公司-H | - | 30,000 | - | (30,000) | - |
| 日月重工股份有限公司-A | - | 200,000 | - | (200,000) | - |
| 瑞纳智能设备股份有限公司-A | - | 130,000 | - | (30,000) | 100,000 |
| 顺丰控股股份有限公司-A | - | 310,000 | - | - | 310,000 |
| 三羊马(重庆)物流股份有限公司-A | - | 63 | - | - | 63 |
| 深信服科技股份有限公司-A | 80,000 | 137,000 | - | (70,000) | 147,000 |
| 三友联众集团股份有限公司-A | - | 2,012 | - | (2,012) | - |
| 税友软件集团股份有限公司-A | - | 148 | - | (148) | - |
| 山东百龙创园生物科技股份有限公司-A | - | 166 | - | (166) | - |
| 山东英科环保再生资源股份有限公司-A | - | 100,187 | - | (100,187) | - |
| 山东凯盛新材料股份有限公司-A | - | 4,990 | - | - | 4,990 |
| 山东科汇电力自动化股份有限公司-A | - | 1,515 | - | (1,515) | - |
| 科兴生物制药股份有限公司-A | 2,840 | - | - | (2,840) | - |
| 山东玲珑轮胎股份有限公司-A | - | 790,000 | - | (460,000) | 330,000 |
| 山东联科科技股份有限公司-A | - | 174 | - | (174) | - |
| 山东力诺特种玻璃股份有限公司-A | - | 4,588 | - | (4,129) | 459 |
| 山东隆华新材料股份有限公司-A | - | 11,069 | - | (9,962) | 1,107 |
| 山东南山智尚科技股份有限公司-A | 5,472 | - | - | (5,472) | - |
| 山东国瓷功能材料股份有限公司-A | - | 560,000 | - | - | 560,000 |
| 山东潍坊润丰化工股份有限公司-A | - | 6,240 | - | (5,616) | 624 |
| 山东威高骨科材料股份有限公司-A | - | 2,610 | - | - | 2,610 |
| 山东玉马遮阳科技股份有限公司-A | - | 4,096 | - | (3,686) | 410 |
| 上海行动教育科技股份有限公司-A | - | 330,108 | - | (330,108) | - |
| 上海艾录包装股份有限公司-A | - | 5,224 | - | (4,701) | 523 |
| 艾力斯医药科技公司-A | 10,733 | - | - | (10,733) | - |
| 上海澳华内镜股份有限公司-A | - | 3,495 | - | - | 3,495 |
| 上海艾为电子技术股份有限公司-A | - | 100,000 | - | (100,000) | - |
| 上海保立佳化工股份有限公司-A | - | 1,923 | - | (1,730) | 193 |
| 上海电气风电集团股份有限公司-A | - | 51,237 | - | (51,237) | - |
| 上海复旦微电子集团股份有限公司-A | - | 8,645 | - | (8,645) | - |
| 上海健麾信息技术股份有限公司-A | 116 | - | - | (116) | - |
| 上海港湾基础建设(集团)股份有限公司-A | - | 150 | - | - | 150 |
| 上海皓元医药股份有限公司-A | - | 656 | - | (656) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|---------------------|--------------|-----------|--------|-------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 股票(續) | | | | | |
| 上海海优威新材料股份有限公司-A | - | 52,794 | - | (52,794) | - |
| 上海霍莱沃电子系统技术股份有限公司-A | - | 945 | - | (945) | - |
| 上海君实生物医药科技股份有限公司-A | - | 180,000 | - | (180,000) | - |
| 上海罗曼照明科技股份有限公司-A | - | 99 | - | (99) | - |
| 上海能辉科技股份有限公司-A | - | 2,128 | - | (1,915) | 213 |
| 上海新致软件股份有限公司-A | 2,320 | - | - | (2,320) | - |
| 上海睿昂基因科技股份有限公司-A | - | 1,039 | - | (1,039) | - |
| 上海农村商业银行股份有限公司-A | - | 4,262 | - | (4,262) | - |
| 上海盛剑环境系统科技股份有限公司-A | - | 96 | - | (96) | - |
| 上海卓然工程技术股份有限公司-A | - | 2,601 | - | (2,601) | - |
| 上海优宁维生物科技股份有限公司-A | - | 2,093 | - | - | 2,093 |
| 上海华依科技集团股份有限公司-A | - | 1,100 | - | (1,100) | - |
| 上海谊众药业股份有限公司-A | - | 3,038 | - | (3,038) | - |
| 上海永茂泰汽车科技股份有限公司-A | - | 133 | - | (133) | - |
| 上海中洲特种合金材料股份有限公司-A | - | 2,177 | - | (1,959) | 218 |
| 上海之江生物科技股份有限公司-A | - | 5,062 | - | (5,062) | - |
| 邵阳维克液压股份有限公司-A | - | 1,026 | - | (923) | 103 |
| 深圳市南极光电子科技股份有限公司-A | - | 3,000 | - | (3,000) | - |
| 生益电子股份有限公司-A | - | 12,828 | - | (12,828) | - |
| 广东生益科技股份有限公司-A | - | 1,299,901 | - | (1,299,901) | - |
| 圣元环保股份有限公司-A | 1,491 | - | - | (1,491) | - |
| 神通科技集团股份有限公司-A | - | 345 | - | (345) | - |
| 深圳奥尼电子股份有限公司-A | - | 3,340 | - | (3,006) | 334 |
| 深圳市倍轻松科技股份有限公司-A | - | 924 | - | (924) | - |
| 深圳市创益通技术股份有限公司-A | - | 2,340 | - | (2,106) | 234 |
| 深圳市长盈精密技术股份有限公司-A | - | 1,499,960 | - | (400,000) | 1,099,960 |
| 深圳爱克莱特科技股份有限公司-A | 1,119 | - | - | (1,119) | - |
| 深圳市兴森快捷电路科技股份有限公司-A | - | 1,426,300 | - | (1,426,300) | - |
| 深圳市富安娜家居用品股份有限公司-A | - | 1,679,300 | - | (1,679,300) | - |
| 深圳和而泰智能控制股份有限公司-A | - | 399,940 | - | (399,940) | - |
| 深圳市汇创达科技股份有限公司-A | 282 | - | - | (282) | - |
| 深圳市汇川技术股份有限公司-A | 245,960 | - | - | (245,960) | - |
| 深圳市杰美特科技股份有限公司-A | 577 | - | - | (577) | - |
| 深圳康泰生物制品股份有限公司-A | - | 239,858 | - | (239,858) | - |
| 深圳市利和兴股份有限公司-A | - | 4,220 | - | (3,798) | 422 |
| 深圳市麦捷微电子科技股份有限公司-A | - | 400,000 | - | (400,000) | - |
| 深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司-A | 65,695 | 20,000 | - | (85,695) | - |
| 深圳市泛海统联精密制造股份有限公司-A | - | 2,039 | - | - | 2,039 |
| 深圳市特发服务股份有限公司-A | 2,803 | 1 | 84 | (2,887) | 1 |
| 深圳市正弦电气股份有限公司-A | - | 1,624 | - | (1,624) | - |
| 深圳市深科达智能装备股份有限公司-A | - | 904 | - | (904) | - |
| 深圳市明微电子股份有限公司-A | - | 1,419 | - | (1,277) | 142 |
| 深圳市明微电子股份有限公司-A | 1,827 | - | - | (1,827) | - |
| 深圳市三利谱光电科技股份有限公司-A | - | 1,149,881 | 97,952 | (697,833) | 550,000 |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 二零二零年十二 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 二零二一年十二 月三十一日 |
|-------------------------|------------------|-----------|---------|-------------|------------------|
| 股票(續) | | | | | |
| 深圳通业科技股份有限公司-A | - | 2,310 | - | (2,079) | 231 |
| 深圳传音控股股份有限公司-A | - | 254,936 | - | (38,000) | 216,936 |
| 深圳市城市交通规划设计研究中心股份有限公司-A | - | 4,267 | - | (3,840) | 427 |
| A | | | | | |
| 深圳市翔丰华科技股份有限公司-A | 250 | - | - | (250) | - |
| 深圳市迅捷兴科技股份有限公司-A | - | 1,179 | - | (1,179) | - |
| 深圳市亚辉龙生物科技股份有限公司-A | - | 3,434 | - | (3,434) | - |
| 申洲国际集团控股有限公司 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 森赫电梯股份有限公司-A | - | 4,108 | - | (3,697) | 411 |
| 中密控股股份有限公司-A | - | 400,000 | - | (100,000) | 300,000 |
| 四川天微电子股份有限公司-A | - | 793 | - | (793) | - |
| 舍得酒业股份有限公司-A | - | 70,000 | - | - | 70,000 |
| 四川合纵药易购医药股份有限公司-A | - | 2,391 | - | (2,391) | - |
| 四川省自贡运输机械集团股份有限公司-A | - | 123 | - | (123) | - |
| 深圳市鼎阳科技股份有限公司-A | - | 3,492 | - | - | 3,492 |
| 中自环保科技股份有限公司-A | - | 1,616 | - | (1,616) | - |
| 江苏诺泰澳赛诺生物制药股份有限公司-A | - | 1,860 | - | (1,860) | - |
| 中辰电缆股份有限公司-A | - | 8,954 | - | (8,954) | - |
| 广东中旗新材料股份有限公司-A | - | 103 | - | - | 103 |
| 仙樂健康科技股份有限公司-A | 147,000 | - | - | (147,000) | - |
| 阳光电源股份有限公司-A | - | 222,900 | - | (102,900) | 120,000 |
| 双乐颜料股份有限公司-A | - | 1,425 | - | (1,282) | 143 |
| 西安蓝晓科技新材料股份有限公司-A | 291,375 | 160,000 | - | (451,375) | - |
| 苏文电能科技股份有限公司-A | - | 3,169 | - | (2,852) | 317 |
| 苏州昀冢电子科技有限公司-A | - | 2,198 | - | (2,198) | - |
| 苏州明志科技股份有限公司-A | - | 2,643 | - | (2,643) | - |
| 苏州纳微科技股份有限公司-A | - | 3,476 | - | - | 3,476 |
| 苏州仕净科技股份有限公司-A | - | 2,211 | - | (1,989) | 222 |
| 苏州上声电子股份有限公司-A | - | 3,045 | - | (3,045) | - |
| 苏州天华超净科技股份有限公司-A | - | 440,000 | - | (222,000) | 218,000 |
| 苏州天孚光通信股份有限公司-A | - | 1,639,900 | 672,000 | (1,911,900) | 400,000 |
| 苏州伟创电气科技股份有限公司-A | 4,723 | - | - | (4,723) | - |
| 苏州万祥科技股份有限公司-A | - | 3,392 | - | (3,052) | 340 |
| 苏州市味知香食品股份有限公司-A | - | 108 | - | (108) | - |
| 苏州苏大维格科技集团股份有限公司-A | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 腾讯控股有限公司 | - | 117,000 | - | - | 117,000 |
| 中科创达软件股份有限公司-A | - | 213,977 | - | - | 213,977 |
| 天津市依依卫生用品股份有限公司-A | - | 116 | - | (116) | - |
| 天能电池集团股份有限公司-A | - | 28,381 | - | (28,381) | - |
| 青岛啤酒股份有限公司-A | - | 220,000 | - | - | 220,000 |

大成中國靈活配置基金
 (於香港成立的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)
 截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 持股量 | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|---------|-------------|---------|
| | 二零二零年十二 | | | 二零二一年十二 | |
| 上市/報價投資(續) | 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 紫光国芯微电子股份有限公司-A | - | 268,000 | - | (141,000) | 127,000 |
| 广东九联科技股份有限公司-A | - | 5,410 | - | (5,410) | - |
| 优利德科技股份有限公司-A | - | 2,753 | - | (2,753) | - |
| 中节能万润股份有限公司-A | 1,446,419 | - | - | (1,446,419) | - |
| 芯原微电子(上海)股份有限公司-A | 13,103 | - | - | (13,103) | - |
| 王力安防科技股份有限公司-A | - | 207 | - | (207) | - |
| 万华化学集团股份有限公司-A | 220,026 | - | - | (220,026) | - |
| 上海唯赛勃环保科技股份有限公司-A | - | 2,996 | - | - | 2,996 |
| 温氏食品集团股份有限公司-A | - | 889,943 | - | - | 889,943 |
| 西部矿业股份有限公司-A | - | 500,000 | - | (500,000) | - |
| 威腾电气集团股份有限公司-A | - | 2,692 | - | (2,692) | - |
| 上海韦尔半导体股份有限公司-A | - | 21,100 | - | - | 21,100 |
| 广东东箭汽车科技股份有限公司-A | - | 5,929 | - | (5,336) | 593 |
| 武汉中科通达高新技术股份有限公司-A | - | 2,131 | - | (2,131) | - |
| 武汉科前生物股份有限公司-A | - | 340,000 | - | (340,000) | - |
| 武汉光庭信息技术股份有限公司-A | - | 2,497 | - | - | 2,497 |
| 芜湖富春染织股份有限公司-A | - | 150 | - | (150) | - |
| 宜宾五粮液股份有限公司-A | 117,000 | 189,909 | - | (117,909) | 189,000 |
| 无锡药明康德新药开发股份有限公司-A | 192,227 | 474,320 | 50,259 | (424,730) | 292,076 |
| 药明生物技术有限公司 | - | 310,000 | - | (310,000) | - |
| 无锡德林海环保科技股份有限公司-A | 2,028 | - | - | (2,028) | - |
| 无锡市振华汽车部件股份有限公司-A | - | 195 | - | (195) | - |
| 厦门东亚机械工业股份有限公司-A | - | 7,328 | - | (6,595) | 733 |
| 襄阳博亚精工装备股份有限公司-A | - | 2,311 | - | (2,079) | 232 |
| 河南翔宇医疗设备股份有限公司-A | - | 3,651 | - | (3,651) | - |
| 咸亨国际科技股份有限公司-A | - | 112 | - | (112) | - |
| 新疆大全新能源股份有限公司-A | - | 40,786 | - | (40,786) | - |
| 新乡市瑞丰新材料股份有限公司-A | 3,547 | - | - | (3,547) | - |
| 新乡拓新药业股份有限公司-A | - | 1,535 | - | (1,381) | 154 |
| 新亚电子股份有限公司-A | 134 | - | - | (134) | - |
| 烟台石川密封科技股份有限公司-A | - | 2,748 | - | (2,473) | 275 |
| 烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司-A | 309,927 | - | - | (309,927) | - |
| 益丰大药房连锁股份有限公司-A | 187,260 | 559,470 | 224,017 | (970,747) | - |
| 益海嘉里金龙鱼粮油食品股份有限公司-A | 11,052 | - | - | (11,052) | - |
| 营口风光新材料股份有限公司-A | - | 4,868 | - | - | 4,868 |
| 远信工业股份有限公司-A | - | 1,543 | - | (1,388) | 155 |
| 永安期货股份有限公司-A | - | 547 | - | - | 547 |
| 永兴特种材料科技股份有限公司-A | - | 105,000 | - | - | 105,000 |
| 用友网络科技股份有限公司-A | 200,950 | 560,000 | - | (760,950) | - |
| 悦康药业集团股份有限公司-A | 16,579 | - | - | (16,579) | - |
| 圆通速递股份有限公司-A | - | 950,000 | - | - | 950,000 |
| 韵达控股股份有限公司-A | - | 920,000 | - | - | 920,000 |
| 云南贝泰妮生物科技集团股份有限公司-A | - | 8,416 | - | - | 8,416 |
| 云南驰宏锌锗股份有限公司-A | - | 1,300,000 | - | (1,300,000) | - |
| 云南神农农业产业集团股份有限公司-A | - | 159 | - | (159) | - |
| 宇通客车股份有限公司-A | - | 200,000 | - | (200,000) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| | 持股量 | | | | |
|----------------------|-----------|---------|-------|-------------|---------|
| | 二零二零年十二 | | | | 二零二一年十二 |
| 上市/報價投資(續) | 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 月三十一日 |
| 股票(續) | | | | | |
| 张小泉股份有限公司-A | - | 3,327 | - | (2,994) | 333 |
| 张家港海锅新能源装备股份有限公司-A | - | 864 | - | (777) | 87 |
| 张家港中环海陆高端装备股份有限公司-A | - | 2,393 | - | (2,153) | 240 |
| 浙江李子园食品股份有限公司-A | - | 164 | - | (164) | - |
| 浙江正泰电器股份有限公司-A | 889,876 | 340,000 | - | (948,000) | 281,876 |
| 浙江春晖智能控制股份有限公司-A | - | 2,399 | - | (2,399) | - |
| 浙江福莱新材料股份有限公司-A | - | 126 | - | (126) | - |
| 浙江海盐力源环保科技有限公司-A | - | 2,463 | - | (2,463) | - |
| 浙江和达科技股份有限公司-A | - | 2,122 | - | (2,122) | - |
| 浙江华康药业股份有限公司-A | - | 158 | - | (158) | - |
| 浙江华生科技股份有限公司-A | - | 102 | - | (102) | - |
| 浙江华友钴业股份有限公司-A | - | 287,924 | - | - | 287,924 |
| 浙江汇隆新材料股份有限公司-A | - | 1,185 | - | (1,066) | 119 |
| 浙江捷昌线性驱动科技股份有限公司-A | - | 260,000 | - | (260,000) | - |
| 浙江九洲药业股份有限公司-A | 700,000 | - | - | (700,000) | - |
| 浙江蓝特光学股份有限公司-A | 5,300 | - | - | (5,300) | - |
| 浙江龙盛集团股份有限公司-A | 2,379,934 | 550,000 | - | (2,929,934) | - |
| 浙江中晶科技股份有限公司-A | 152 | - | - | (152) | - |
| 浙江大自然户外用品股份有限公司-A | - | 88 | - | (88) | - |
| 浙江镇洋发展股份有限公司-A | - | 223 | - | - | 223 |
| 浙江省新能源投资集团股份有限公司-A | - | 1,059 | - | (1,059) | - |
| 浙江出版传媒股份有限公司-A | - | 824 | - | (824) | - |
| 浙江三花智能控制股份有限公司-A | 880,000 | - | - | (880,000) | - |
| 浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司-A | - | 528 | - | (528) | - |
| 浙江松原汽车安全系统股份有限公司-A | 258 | - | - | (258) | - |
| 浙江盛泰服装集团股份有限公司-A | - | 212 | - | (212) | - |
| 浙江中控技术股份有限公司-A | 5,112 | - | - | (5,112) | - |
| 浙江泰福泵业股份有限公司-A | - | 1,052 | - | (946) | 106 |
| 浙江泰坦股份有限公司-A | - | 215 | - | (215) | - |
| 浙江真爱美家股份有限公司-A | - | 133 | - | (133) | - |
| 浙江维康药业股份有限公司-A | 376 | - | - | (376) | - |
| 浙江万胜智能科技股份有限公司-A | 405 | - | - | (405) | - |
| 浙江我武生物科技股份有限公司-A | - | 359,998 | - | - | 359,998 |
| 浙江西大门新材料股份有限公司-A | 99 | - | - | (99) | - |
| 浙江新中港热电股份有限公司-A | - | 330 | - | (330) | - |
| 浙江一鸣食品股份有限公司-A | 293 | - | - | (293) | - |
| 浙江迎丰科技股份有限公司-A | - | 422 | - | (422) | - |
| 浙江永和制冷股份有限公司-A | - | 258 | - | (258) | - |
| 浙江甬金金属科技股份有限公司-A | - | 970,000 | - | (970,000) | - |
| 浙江争光实业股份有限公司-A | - | 2,580 | - | (2,322) | 258 |
| 浙江卓锦环保科技有限公司-A | - | 2,339 | - | (2,339) | - |
| 郑州千味央厨食品股份有限公司-A | - | 71 | - | (71) | - |
| 浙江亿田智能厨电股份有限公司-A | 2,942 | - | - | (2,942) | - |
| 智洋创新科技股份有限公司-A | - | 1,897 | - | (1,897) | - |
| 江苏中捷精工科技股份有限公司-A | - | 1,352 | - | (1,216) | 136 |
| 中金辐照股份有限公司-A | - | 5,754 | - | (5,178) | 576 |
| 仲景食品股份有限公司-A | 1,780 | - | - | (1,780) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持 股 量 | | | |
|---------------------------------------------------------|------------------|------------|-------|------------------|
| | 二零二零年十二 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 二零二一年十二 月三十一日 |
| 報價債務證券(續) | | | | |
| 中飲巴比食品股份有限公司-A | 424 | - | - | (424) |
| 珠海冠宇電池股份有限公司-A | - | 8,763 | - | (8,763) |
| 株洲中車時代電氣股份有限公司-A | - | 32,542 | - | (32,542) |
| 株洲華銳精密工具股份有限公司-A | - | 1,000 | - | (1,000) |
| 株洲旗濱集團股份有限公司-A | - | 1,921,800 | - | - |
| 紫金礦業集團股份有限公司-A | - | 3,149,829 | - | - |
| 浙江物產環保能源股份有限公司-A | - | 480 | - | - |
| 祖名豆制品股份有限公司-A | 129 | - | - | (129) |
| 廣州中望龍騰軟件股份有限公司-A | - | 1,818 | - | (1,667) |
| 集體投資計劃 | | | | |
| 華寶興業現金添益型貨幣市場基金 | 2,307 | 41 | - | (2,036) |
| 中國網路產業指數型基金 | - | 94,500 | - | (94,500) |
| 銀華交易型貨幣市場基金 | - | 300,000 | - | (300,000) |
| 報價債務證券 | | | | |
| 中國國際航空股份有限公司 3.08% A 2021.10.20 | - | 64,000 | - | (64,000) |
| 安徽海螺水泥股份有限公司 5.1% A 2022.11.07 | 34,000 | - | - | (34,000) |
| 杭州銀行股份有限公司 0.2% A 2027.03.29 | - | 28,500 | - | - |
| 中銀航空租賃有限公司 3% S/A 2029.09.11 REGS | - | 3,000,000 | - | - |
| 青山發電有限公司 3.25% S/A 2027.07.25 | - | 1,100,000 | - | - |
| CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3% S/A 2031.01.20 | - | 4,250,000 | - | - |
| CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.375% S/A 2025.02.08 | - | 1,000,000 | - | - |
| 國家開發銀行 3.6% A 2021.08.29 | - | 500,000 | - | (500,000) |
| 中華人民共和國財政部 1.75% S/A 2031.10.26 | - | 10,000,000 | - | - |
| 中華人民共和國財政部 2.5% S/A 2051.10.26 | - | 3,000,000 | - | - |
| 中華人民共和國財政部 2.15% A 2021.07.16 | 636,500 | 800,000 | - | (1,436,500) |
| 中華人民共和國財政部 2.25% A 2021.01.09 | 610,000 | - | - | (610,000) |
| 中華人民共和國財政部 2.89% A 2021.11.19 | - | 2,025,790 | - | (2,025,790) |
| 中國政府債券 3.94% S/A 2045.07.27 | 70 | - | - | - |
| 中國中信有限公司 4.59% A 2029.03.19 | 200,000 | - | - | (200,000) |
| 中華電力有限公司 2.25% S/A 2031.07.21 | - | 1,000,000 | - | - |
| 招銀國際租賃管理有限公司 1.75% S/A 2026.09.16 | - | 3,000,000 | - | (3,000,000) |
| 招商證券國際有限公司 1.295% S/A 2024.09.16 | - | 3,000,000 | - | (3,000,000) |
| 東方財富信息股份有限公司 0.2% A 2027.04.07 | - | 8,026 | - | (8,026) |
| 福建省華興集團有限責任公司 3.4% A 2024.07.27 | - | 300,000 | - | - |
| 廣發證券股份有限公司 4% A 2023.09.07 | - | 200,000 | - | - |
| 長城汽車股份有限公司 0.2% A 2027.06.10 | - | 3,440 | - | - |
| 中華人民共和國香港特別行政區政府 1.75% S/A 2031.11.24 | - | 4,200,000 | - | - |
| 中華人民共和國香港特別行政區政府 2.375% S/A 2051.02.02 REGS | - | 2,200,000 | - | - |
| 宏發科技股份有限公司 0.3% A 2027.10.28 | - | 11,280 | - | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) | 持股量 | | | | |
|-------------------------------------------------------------|------------------|------------|-------|--------------|------------------|
| | 二零二零年十二 月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | 二零二一年十二 月三十一日 |
| 報價債務證券(續) | | | | | |
| 工銀國際租賃財務有限公司 2.65% S/A 2031.08.02 | - | 9,200,000 | - | - | 9,200,000 |
| INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LIMITED 1.6% S/A 2026.09.01 | - | 6,000,000 | - | (1,000,000) | 5,000,000 |
| 中國建設致信有限公司 3.5% S/A 2027.11.24 | - | 1,400,000 | - | - | 1,400,000 |
| 立訊精密工業股份有限公司 0.1% A 2026.11.03 | 1,916 | - | - | - | 1,916 |
| 遠洋地產寶財 IV 有限公司 5.25% S/A 2022.04.30 | - | 5,000,000 | - | (5,000,000) | - |
| 仙樂健康科技股份有限公司 0.4% A 2027.04.19 | - | 6,576 | - | - | 6,576 |
| 天風證券股份有限公司 4.12% A 2023.06.28 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 江蘇省吳中經濟技術發展集團有限公司 0.2% A 2027.06.10 | - | 5,636 | - | - | 5,636 |
| 萬科地產(香港)有限公司 3M L+1.55% Q 2023.05.25 | - | 2,000,000 | - | - | 2,000,000 |
| 萬科地產(香港)有限公司 4.2% S/A 2024.06.07 | - | 2,000,000 | - | - | 2,000,000 |
| 益豐大藥房連鎖股份有限公司 0.4% A 2026.06.01 (CALLED) | 6,260 | - | - | (6,260) | - |
| 浙江三花智能控制股份有限公司 0.2% A 2027.06.01 | - | 5,109 | - | - | 5,109 |
| 中國農業銀行股份有限公司 0% A 2022.04.29 | - | 1,000,000 | - | (1,000,000) | - |
| 中國農業發展銀行 2.68% A 2021.10.26 | - | 300,000 | - | (300,000) | - |
| 中國農業發展銀行 2.75% A 2022.02.07 | - | 1,500,000 | - | (1,500,000) | - |
| 中國農業銀行股份有限公司 2.75% A 2022.02.07 CDC | - | 30,000,000 | - | (30,000,000) | - |
| 中國農業銀行股份有限公司 2.96% A 2030.04.17 | 400,000 | - | - | (400,000) | - |
| 中國農業銀行股份有限公司 2.96% A 2030.04.17 CDC | 10,000,000 | - | - | (10,000,000) | - |
| 中國農業發展銀行 3.74% A 2029.07.12 CDC | 10,000,000 | - | - | (10,000,000) | - |
| 中國農業發展銀行 3.95% A 2031.02.26 | 200,000 | - | - | (200,000) | - |
| 中國農業發展銀行 4.45% A 2032.03.15 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 中國農業發展銀行 4.65% A 2028.05.11 | 200,000 | - | - | (200,000) | - |
| 安徽省交通控股集團有限公司 3.38% A 2026.08.24 | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 中銀集團投資有限公司 2.7% A 2023.05.08 | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 中銀集團投資有限公司 3.64% A 2024.06.24 | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 中銀集團投資有限公司 4.13% A 2021.12.19 | - | 500,000 | - | (500,000) | - |
| 中銀集團投資有限公司 4.13% A 2021.12.19 SHCH | - | 20,000,000 | - | (20,000,000) | - |
| 光明食品(集團)有限公司 4.03% A 2021.11.05 SHCH | - | 10,000,000 | - | (10,000,000) | - |
| 中國投資有限責任公司 3.15% A 2023.01.14 | - | 200,000 | - | - | 200,000 |
| 中央匯金投資有限責任公司 3.74% A 2022.04.24 | - | 100,000 | - | (100,000) | - |
| 中央匯金投資有限責任公司 4.38% A 2022.08.30 | 300,000 | - | - | (300,000) | - |
| 國家開發銀行 4.8% S/A 2029.11.04 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 國家開發銀行 5.25% S/A 2028.06.24 | 200,000 | - | - | (200,000) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的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)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

| 上市/報價投資(續) 報價債務證券(續) | 持股量 | | | | 二零二一年十二月三十一日 |
|------------------------------------------|--------------|------------|-------|--------------|--------------|
| | 二零二零年十二月三十一日 | 增加 | 紅利/股利 | 減少 | |
| 國家開發銀行 1 YEAR CNDR+0.85% Q 2021.02.17 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 國家開發銀行 2.97% A 2022.10.25 CDC | - | 20,000,000 | - | (20,000,000) | - |
| 國家開發銀行 2.98% A 2024.01.08 | - | 200,000 | - | (200,000) | - |
| 國家開發銀行 3.09% A 2030.06.18 | 300,000 | 600,000 | - | (900,000) | - |
| 國家開發銀行 3.09% A 2030.06.18 CDC | - | 30,000,000 | - | (30,000,000) | - |
| 國家開發銀行 3.41% A 2031.06.07 | - | 500,000 | - | (500,000) | - |
| 國家開發銀行 3.66% A 2031.03.01 | - | 200,000 | - | (200,000) | - |
| 國家開發銀行 3.66% A 2031.03.01 CDC | - | 20,000,000 | - | (20,000,000) | - |
| 國家開發銀行 3.7% A 2030.10.20 | 500,000 | 1,200,000 | - | (1,700,000) | - |
| 國家開發銀行 3.7% A 2030.10.20 CDC | - | 80,000,000 | - | (80,000,000) | - |
| 國家開發銀行 3.76% A 2023.08.14 | 500,000 | - | - | (500,000) | - |
| 國家開發銀行 3.9% A 2040.08.03 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 國家開發銀行 5.24% A 2029.07.04 | 500,000 | - | - | (500,000) | - |
| 國家開發銀行 2.45% A 2022.01.26 | - | 100,000 | - | (100,000) | - |
| 國家開發銀行 3.68% A 2021.09.07 | - | 100,000 | - | (100,000) | - |
| 國家開發銀行 4.04% A 2028.07.06 | - | 800,000 | - | (800,000) | - |
| 中華人民共和國財政部 2.89% A 2021.11.19 | 400,000 | - | - | (400,000) | - |
| 中國東方資產管理股份有限公司 3.25% A 2024.11.05 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 中國國新控股有限責任公司 4.61% A 2029.07.12 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 華潤股份有限公司 3.58% A 2022.03.01 | - | 300,000 | - | (300,000) | - |
| 中國南方電網有限責任公司 2.9% A 2023.03.06 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 中國南方電網有限責任公司 3.53% A 2022.01.11 SHCH | - | 30,000,000 | - | (30,000,000) | - |
| 中國國家鐵路集團有限公司 5.1% A 2028.01.18 | 500,000 | - | - | (500,000) | - |
| 中華人民共和國財政部 0% A 2021.04.26 | - | 200,000 | - | (200,000) | - |
| 中國進出口銀行 2.25% A 2021.06.08 | 200,000 | - | - | (200,000) | - |
| 中國進出口銀行 2.96% A 2022.02.11 | - | 500,000 | - | (500,000) | - |
| 中國進出口銀行 3.28% A 2024.02.11 | - | 1,300,000 | - | (900,000) | 400,000 |
| 中國進出口銀行 4.89% A 2028.03.26 | 300,000 | - | - | (300,000) | - |
| 佛燃能源集團股份有限公司 3.67% A 2024.04.21 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 廣州越秀集團股份有限公司 5.15% A 2023.03.26 | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 北大荒农垦集團有限公司 5.32% A 永久債券 | 100,000 | - | - | (100,000) | - |
| 興業銀行股份有限公司 3.99% A 2021.11.01 | - | 600,000 | - | (600,000) | - |
| 招聯消費金融有限公司 3.55% A 2024.05.18 | - | 200,000 | - | - | 200,000 |
| 招聯消費金融有限公司 3.68% A 2024.06.16 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 平安銀行股份有限公司 0% A 2022.05.13 SHCH | - | 50,000,000 | - | (50,000,000) | - |
| 平安銀行股份有限公司 0% A 2022.04.14 | - | 500,000 | - | (500,000) | - |
| 山東省財金投資集團有限公司 3.78% A 2024.08.16 | - | 200,000 | - | - | 200,000 |
| 深圳市資本運營集團有限公司 3.2% A 2024.09.03 | - | 300,000 | - | - | 300,000 |
| 國家電網有限公司 1.57% A 2021.06.19 | 200,000 | - | - | (200,000) | - |
| 國家電網有限公司 3.32% A 2023.03.30 | - | 100,000 | - | - | 100,000 |
| 國家電力投資集團有限公司 3.9% A 2022.04.16 SHCH | - | 20,000,000 | - | (20,000,000) | - |

大成中國靈活配置基金
(於香港成立的大成投資信託基金的子基金)

表現記錄(未經審計)
截至二零二一年十二月三十一日止年度

資產淨值(交易資產淨值)

| 截至下列日期止的財務 期間結束時 | 每單位資產淨值 | | | | | |
|---------------------|---------------|------------------|----------------|----------------|--------------------|--------------------|
| | 資產淨值 (人民幣) | 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) |
| 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 |
| 二零二零年十二月三十一日 | 2,184,219,293 | 17.46 | 15.87 | 15.87 | 15.23 | 14.85 |
| 二零一九年十二月三十一日 | 2,044,691,912 | 14.02 | 12.01 | 12.06 | 10.81 | 10.58 |

最高及最低每單位資產淨值

| 截至下列日期止的財務期間 | 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(自 成立以來) | 13.17 | 12.94 | 12.93 | 9.50 | 9.30 | 9.29 |

| | 美元 P 類(累算) (美元) | | 港元 P 類(累算) (港元) | |
|--------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 美元 P 類(累算) (美元) | 港元 P 類(累算) (港元) | 美元 P 類(累算) (美元) | 港元 P 類(累算) (港元) |
| 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 |