

---

大成中國靈活配置基金  
(大成投資信託基金的子基金)

中期報告  
截至二零二六年六月三十日止期間





大成投資信託基金  
截至二零二六年六月三十日止期間

## 中期報告

### 目錄

### 頁碼

|                         |      |
|-------------------------|------|
| 基金管理和基金行政               | 1    |
| 基金經理致基金單位持有人報告          | 2-3  |
| 財務狀況報表（未經審計）            | 4-5  |
| 全面收入報表（未經審計）            | 6    |
| 基金單位持有人應佔資產淨值變動報表（未經審計） | 7-8  |
| 大成中國靈活配置基金              | 9-38 |
| - 投資組合（未經審計）            |      |
| - 投資組合變動報表（未經審計）        |      |
| - 表現紀錄（未經審計）            |      |
| 財務報表附注（未經審計）            | 40   |

**大成投資信託基金**  
**截至二零二六年六月三十日止期間**

**基金管理和基金行政**

**基金經理董事**

譚曉岡先生  
肖劍先生  
姚余棟先生  
趙冰女士  
許自傑先生

**基金經理**

大成國際資產管理有限公司  
香港中環  
康樂廣場1號  
怡和大廈35樓  
3513-3519室

**託管人**

中國銀行(香港)有限公司  
香港中環花園道1號  
中銀大廈14樓

**中國分託管人**

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

**受託人及過戶登記處**

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

**基金經理法律顧問**

西盟斯律師行  
香港英皇道979號  
太古坊一座30樓

**中國投資顧問**

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

**核數師**

羅兵咸永道會計師事務所  
香港中環太子大廈22樓

## 基金經理致基金單位持有人報告

### 大成中國靈活配置基金 (大成投資信託基金的子基金)

#### 基金表現

大成中國靈活配置基金旨在尋求資本及收入長遠增長。截至二零二六年六月三十日，累計總資產規模為人民幣7,954,489,087元。

#### 市場回顧

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

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

#### 展望

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

## 基金經理致基金單位持有人報告

### 大成中國靈活配置基金 (大成投資信託基金的子基金)

#### 展望(續)

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

大成國際資產管理有限公司

二零二六年八月三十一日

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

財務狀況報表 (未經審計)  
 截至二零二六年六月三十日

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

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

財務狀況報表 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

全面收入報表 (未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

大成中國靈活配置基金

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

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

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

|                  | 自二零二六年一月一日至<br>二零二六年六月三十日止期間<br>(未經審計)<br>人民幣 | 自二零二五年一月一日至<br>二零二五年十二月三十一日止期間<br>(經審計)<br>人民幣 |
|------------------|-----------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 期初基金單位持有人應佔資產淨值  | 5,883,549,623                                 | 4,764,625,908                                  |
| 發行單位所得款項         | 3,543,569,943                                 | 2,623,354,529                                  |
| 贖回單位所得款項         | (1,581,197,012)                               | (1,880,948,147)                                |
| 來自單位持有人交易的增加淨額   | 1,962,372,931                                 | 742,406,382                                    |
| 基金單位持有人應佔資產淨值之增加 | 108,566,533                                   | 376,517,333                                    |
| 期末基金單位持有人應佔資產淨值  | 7,954,489,087                                 | 5,883,549,623                                  |

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

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

可贖回單位的變動

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

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

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

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
 截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

|             | 持股量       | 市值<br>人民幣   | 佔資產淨值<br>百分比% |
|-------------|-----------|-------------|---------------|
| 上市/報價投資 (續) |           |             |               |
| 股本證券 (續)    |           |             |               |
| 中國 (續)      |           |             |               |
| 江鎬裝備        | 2,450,000 | 66,713,500  | 0.84          |
| 普洛藥業        | 1,200,000 | 19,992,000  | 0.25          |
| 鵬鼎控股        | 200,000   | 21,076,000  | 0.26          |
| 中航光電        | 399,976   | 18,478,891  | 0.23          |
| 中航沈飛        | 531,736   | 21,854,350  | 0.27          |
| 南京銀行        | 1,200,000 | 11,868,000  | 0.15          |
| 寧波銀行        | 1,130,000 | 33,549,700  | 0.42          |
| 昊華能源        | 1,098,300 | 11,598,048  | 0.15          |
| 昂瑞微         | 2,319     | 310,352     | 0.00          |
| 維通利         | 387       | 20,766      | 0.00          |
| 比亞迪         | 727,000   | 57,941,900  | 0.73          |
| 寒武紀         | 87,765    | 140,033,446 | 1.76          |
| 電科藍天        | 1,717     | 127,316     | 0.00          |
| 星宇股份        | 221,911   | 20,109,575  | 0.25          |
| 巨集明電子       | 714       | 125,728     | 0.00          |
| 赤峰黃金        | 380,000   | 10,001,600  | 0.13          |
| 建設銀行        | 3,149,990 | 30,334,404  | 0.38          |
| 中國船舶        | 619,993   | 20,949,563  | 0.26          |
| 海南橡膠        | 2,000,000 | 9,840,000   | 0.12          |
| 中國巨石        | 580,000   | 42,270,400  | 0.53          |
| 招商銀行        | 3,040,000 | 107,920,000 | 1.36          |
| 北方稀土        | 709,996   | 34,115,308  | 0.43          |
| 中國太保        | 2,089,000 | 59,578,280  | 0.75          |

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
 截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
 自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

**非上市/報價投資**

**債務證券**

**香港**

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

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二六年一月一日至二零二六年六月三十日止期間

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

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

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

資產淨值

| 截至下列日期止的財務年度結束時 | 資產淨值<br>(人民幣) | 每單位資產淨值        |              |              |                      |                      |                        |
|-----------------|---------------|----------------|--------------|--------------|----------------------|----------------------|------------------------|
|                 |               | 人民幣A類<br>(人民幣) | 美元A類<br>(美元) | 港元A類<br>(港元) | 美元P類<br>(累算)<br>(美元) | 港元P類<br>(累算)<br>(港元) | 人民幣P類<br>(累算)<br>(人民幣) |
| 二零二六年六月三十日      | 7,954,489,087 | 12.59          | 10.54        | 10.71        | 16.26                | 16.03                | 13.53                  |
| 二零二五年十二月三十一日    | 5,883,549,623 | 12.36          | 10.08        | 10.16        | 14.94                | 14.62                | 12.79                  |
| 二零二四年十二月三十一日    | 4,764,625,908 | 11.48          | 8.99         | 9.03         | 12.17                | 11.88                | 10.95                  |
| 二零二三年十二月三十一日    | 4,983,834,665 | 11.37          | 9.27         | 9.36         | 11.28                | 11.08                | 9.84                   |

| 截至下列日期止的財務年度結束時 | 資產淨值<br>(人民幣) | 每單位資產淨值          |                          |                          |                      |                        |                      |
|-----------------|---------------|------------------|--------------------------|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|
|                 |               | 新加坡元A類<br>(新加坡元) | 新加坡元P類<br>(派息)<br>(新加坡元) | 新加坡元P類<br>(累算)<br>(新加坡元) | 港元P類<br>(派息)<br>(港元) | 人民幣P類<br>(派息)<br>(人民幣) | 美元P類<br>(派息)<br>(美元) |
| 二零二六年六月三十日      | 7,954,489,087 | 13.64            | 13.64                    | 13.78                    | 12.92                | 12.23                  | 12.86                |
| 二零二五年十二月三十一日    | 5,883,549,623 | 12.46            | 12.46                    | 12.59                    | 11.78                | 11.56                  | 11.81                |
| 二零二四年十二月三十一日    | 4,764,625,908 | 10.75            | 10.75                    | 10.87                    | 9.59                 | 9.91                   | 9.60                 |
| 二零二三年十二月三十一日    | 4,983,834,665 | -                | -                        | -                        | -                    | -                      | -                    |

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

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值

| 截至下列日期止的財務年度 | 每基金單位最高發行價值    |              |              | 每基金單位最低贖回價值    |              |              |
|--------------|----------------|--------------|--------------|----------------|--------------|--------------|
|              | 人民幣A類<br>(人民幣) | 美元A類<br>(美元) | 港元A類<br>(港元) | 人民幣A類<br>(人民幣) | 美元A類<br>(美元) | 港元A類<br>(港元) |
| 二零二六年六月三十日   | 13.00          | 10.85        | 11.01        | 11.82          | 9.72         | 9.86         |
| 二零二五年十二月三十一日 | 12.82          | 10.26        | 10.34        | 10.73          | 8.39         | 8.44         |
| 二零二四年十二月三十一日 | 12.34          | 10.07        | 10.13        | 10.38          | 8.41         | 8.49         |
| 二零二三年十二月三十一日 | 14.22          | 12.31        | 12.46        | 11.07          | 8.99         | 9.07         |
| 二零二二年十二月三十一日 | 16.68          | 15.38        | 15.47        | 12.70          | 10.15        | 10.29        |
| 二零二一年十二月三十一日 | 18.61          | 17.14        | 17.14        | 16.67          | 15.11        | 15.15        |
| 二零二零年十二月三十一日 | 17.46          | 15.87        | 15.87        | 12.49          | 10.40        | 10.40        |
| 二零一九年十二月三十一日 | 14.32          | 12.60        | 12.75        | 11.57          | 10.10        | 10.20        |
| 二零一八年十二月三十一日 | 15.41          | 14.68        | 14.79        | 11.65          | 10.17        | 10.26        |
| 二零一七年十二月三十一日 | 15.02          | 13.69        | 13.78        | 12.45          | 10.89        | 10.89        |
| 二零一六年十二月三十一日 | 13.25          | 11.93        | 11.93        | 11.60          | 10.71        | 10.75        |
| 二零一五年十二月三十一日 | 17.90          | 17.62        | 17.60        | 11.96          | 11.28        | 11.26        |
| 二零一四年十二月三十一日 | 13.17          | 12.94        | 12.93        | 9.50           | 9.30         | 9.29         |

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

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值(續)

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

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

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

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二六年六月三十日

最高及最低每單位資產淨值(續)

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

**財務報表附注 (未經審計)**

編制基礎和會計政策

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

所採用的會計政策與截至 2025 年 12 月 31 日止年度財務報表附注 2 所述的一致。

注1：截至2026年6月30日及2025年12月31日止期間，支付給受託人關聯人的交易手續費如下

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

注2：截至2026年6月30日及2025年12月31日止期間，支付給受託人關聯人的其他費用（銀行手續費）如下

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