

---

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  
截至二零二三年六月三十日止期間





大成投資信託基金  
二零二三年一月一日截至二零二三年六月三十日止期間

## 中期報告

### 目錄

### 頁碼

基金管理和基金行政	1
基金經理致基金單位持有人報告	2-3
財務狀況報表 (未經審計)	4-5
全面收入報表 (未經審計)	6
基金單位持有人應占資產淨值變動報表 (未經審計)	7-8
大成中國靈活配置基金	9-34
- 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	35

**大成投資信託基金**  
**截至二零二三年六月三十日止期間**

**基金管理和基金行政**

**基金經理董事**

譚曉岡先生  
肖劍先生  
姚余棟先生  
趙冰女士  
吳萍女士

**基金經理**

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

**託管人**

中國銀行(香港)有限公司  
香港中環花園道1號  
中銀大廈14樓

**中國分託管人**

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

**受託人及過戶登記處**

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

**基金經理法律顧問**

西盟斯律師行  
香港英皇道979號  
太古坊一座30樓

**中國投資顧問**

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

**核數師**

羅兵咸永道會計師事務所  
香港中環太子大廈22樓

## 基金經理致基金單位持有人報告

### 大成中國靈活配置基金 (大成投資信託基金的子基金)

## 基金表現

大成中國靈活配置基金旨在尋求資本及收入長遠增長。截至二零二三年六月三十日，累計總資產規模為人民幣 5,746,638,236 元。

## 市場回顧

上半年A股整體震盪上行，中小盤風格占優。23年1月市場延續自去年10月底以來的上漲趨勢，背後的支撐來自疫情政策優化後經濟復蘇預期強化，海外通脹放緩後流動性寬鬆，此外疊加ChatGPT催化的人工智慧投資熱潮。2-3月市場轉為震盪，前期驅動市場上漲的因素弱化，國內經濟復蘇斜率放緩，美聯儲加息預期升溫，美國銀行業危機衝擊全球市場風險偏好。4月中下旬市場開始回檔，主要由於國內經濟資料環比下行，“強預期，弱現實”的矛盾凸顯，基本面預期下修；同時美債上限危機、地緣政治緊張等因素進一步衝擊全球流動性環境和風險偏好。進入6月，市場預期經濟已經處於底部，央行超預期降息意味著穩增長政策開始發力，A股企穩回升。風格層面，2023年上半年中小盤跑贏大盤，上證50、中證500分別下跌5.43%、上漲2.29%。行業層面，受人工智慧和“中特估”行情催化，TMT、建築、金融板塊漲幅顯著，順週期的地產鏈和資源品板塊則表現較弱。

上半年經濟復蘇動能趨於弱化，A股盈利或已觸及低點。基本面方面，上半年經濟呈弱復蘇態勢，內需修復動能不足。具體來看，4月以來PMI再度跌至枯榮線以下，CPI、PPI持續下滑引發市場對“通縮”擔憂，1-5月社零同比增長9.3%，消費對需求修復起主要支撐作用，商品房銷售面積同比下滑0.9%，房地產持續走弱，5月出口同比增速轉負，外需壓力有抬升可能。經濟弱復蘇反映至A股盈利上，一季度A股歸母淨利潤同比增長1.4%，盈利增長主要由金融企業貢獻，而非金融上市公司歸母淨利潤則同比下滑5.9%，盈利仍在探底中。流動性方面，宏觀流動性整體合理充裕，上半年M2增速維持高位，6月央行實施降息使流動環境進一步寬鬆。

## 展望

下半年政策加碼有望驅動經濟復蘇，A股盈利或將步入上行週期，關注消費和科技。展望下半年經濟形勢，政策層面，當前中國經濟內生動力還不強，亟需穩增長政策推動。6月16日國常會研究推動經濟持續回升向好的一批政策措施，後續有望在7月政治局會議上落地，就政策側重點而言，消費、投資有望成為政策下一步發力的重點；其次，近期央行降息充分體現了貨幣政策逆週期調節意圖，下半年寬鬆的貨幣政策有望延續，重點提振企業信心，引導超額儲蓄回流實體經濟，助力經濟動能復蘇；此外，財政政策有望進一步加力提效，或發力基建投資和緩解地方債務壓力。企業盈利層面，宏觀上，本輪庫存週期始於2019年3季度末4季度初，或將於23Q3見底，同時PPI有望隨經濟復蘇而企穩回升，賦予企業盈利更大彈性；微觀上，當前A股盈利底部逐漸顯現，預計Q2盈利增速有望回升，2023年全年A股利潤增速有望達10%左右，在盈利逐季度改善的趨勢下，下半年A股復蘇彈性更大。然而需要注意的是，當前居民消費意願、企業支出和投資意願仍待改善，同時地方債務壓力、國際政治波動和海外貨幣政策緊縮等風險事件也可能對中國經濟動能修復造成一定不確定性。展望下半年A股表現，基本面、資金面有望雙雙改善，帶動股市整體上行。風格上，下半年經濟大概率延續弱復蘇態勢，以TMT為代表的需求恢復彈性更大的成長股有望表現更優。行業配置上，消費和科技板塊值得重視。消費板塊來看，當前中國經濟仍在修復軌道中，下半年經濟修復將推動居民收入和消費意願的回升，有效拉動消費需求；此外，近期高層會議陸續提及優化消費環境、恢復擴大消費，因此下半年政策有望發力消費，以大宗消費作為切入點拉動消費大盤增長，並帶動A股各消費行業盈利改善，其中醫藥和基本消費部分子行業的盈利有望實現較快增長。科

## 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)

技板塊來看，未來數位經濟板塊或將進入基本面驅動階段，政策端、技術端的邏輯都在逐漸強化，可以尋找數位經濟中訂單好轉、業績顯現的領域，如政策發力的數字基建、信創等領域業績有望改善，同時技術變革下，企業加大資本開支，人工智慧及上游半導體等領域將受益。

大成資產管理有限公司

二零二三年八月二十八日

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)  
 截至二零二三年六月三十日

	大成中國靈活配置基金	
	二零二三年六月三十日 (未經審計) 人民幣	二零二二年十二月三十一日 (經審計) 人民幣
<b>資產</b>		
<b>非流動資產</b>		
存款準備金	4,029,399	2,063,496
<b>流動資產</b>		
按公平價值透過損益記帳的金融資產	5,634,662,509	3,646,017,707
應收利息	22,723,424	15,673,338
應收股息	1,959,512	170
應收申購款	25,833,378	11,572,879
出售投資項目應收款	45,045,036	163,323,152
現金及現金等價物	65,170,844	333,761,150
	<u>5,795,394,703</u>	<u>4,170,348,396</u>
<b>總資產</b>	<u>5,799,424,102</u>	<u>4,172,411,892</u>
<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	6,285,422	4,451,621
應付受託人費用	540,444	392,079
購入投資項目應付款	31,605,524	234,568,197
應付贖回款	12,557,080	4,881,029
預提費用及其他應付款	1,545,014	1,529,270
預提稅款準備金	252,382	134,822
	<u>52,785,866</u>	<u>245,957,018</u>
<b>總負債</b>	<u>52,785,866</u>	<u>245,957,018</u>
<b>基金單位持有人應占資產淨值</b>	<u>5,746,638,236</u>	<u>3,926,454,874</u>
<b>已發行單位</b>		
- 人民幣 A 類單位	148,835,082	87,690,593
- 美元 A 類單位	19,386,665	13,571,583
- 美元 P (Acc) 類單位	157,411	194,689
- 港元 A 類單位	242,134,920	159,591,418
- 港元 P (Acc) 類單位	1,988,706	1,936,637

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)  
截至二零二三年六月三十日

每單位資產淨值

- 人民幣 A 類單位	12.85	13.52
- 美元 A 類單位	10.29	11.42
- 美元 P (Acc) 類單位	11.93	12.69
- 港元 A 類單位	10.42	11.50
- 港元 P (Acc) 類單位	11.75	12.44
	<hr/>	<hr/>

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)  
 自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

大成中國靈活配置基金

		自二零二三年一月一日至 二零二三年六月三十日止期 間 (未經審計) 人民幣	自二零二二年一月一日至 二零二二年十二月三十一日止期間 (經審計) 人民幣
	注		
<b>收益</b>			
股息收益		39,157,895	63,857,542
銀行存款產生的利息收入		189,175	154,831
投資產生的利息收入		22,269,288	27,702,015
投資淨(損失)/收益		(116,092,273)	(453,639,823)
匯兌利得/(損失)淨額		(590,864)	2,010,553
其他收入		4,976	790
<b>總投資收益</b>		<b>(55,061,803)</b>	<b>(359,914,092)</b>
<b>開支</b>			
管理費用		33,817,072	43,773,864
受託人費用		2,926,523	3,914,938
託管費		1,694,321	2,058,238
交易手續費	1	135,425	270,675
交易成本		7,117,984	10,598,388
核數師酬金		149,078	227,030
法律及專業服務費用		1,497	10,866
其他費用	2	27,008	48,334
<b>總經營支出</b>		<b>45,868,908</b>	<b>60,902,333</b>
<b>利潤分派前及稅前收益/(損失)</b>		<b>(100,930,711)</b>	<b>(420,816,425)</b>
對基金單位持有人的分派利潤		(209,055,323)	(254,995,255)
<b>利潤分派後及稅前收益/(損失)</b>		<b>(309,986,034)</b>	<b>(675,811,680)</b>
稅項		(3,666,833)	(5,747,864)
<b>基金單位持有人應占資產淨值之減少</b>		<b>(313,652,867)</b>	<b>(681,559,544)</b>



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

基金單位持有人應占資產淨值變動報表 (未經審計)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	自二零二三年一月一日至 二零二三年六月三十日止期 間 (未經審計) 人民幣	自二零二二年一月一日至 二零二二年十二月三十一日 止期間 (經審計) 人民幣
期初基金單位持有人應占資產淨值	3,926,454,874	2,700,926,436
發行單位所得款項	2,536,414,041	2,311,118,747
贖回單位所得款項	(402,577,812)	(404,030,765)
來自單位元持有人交易的增加/(減少)淨額	2,133,836,229	1,907,087,982
基金單位持有人應占資產淨值之增加/(減少)	(313,652,867)	(681,559,544)
期末基金單位持有人應占資產淨值	5,746,638,236	3,926,454,874

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

基金單位持有人應占資產淨值變動報表(未經審計)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

可贖回單位的變動

	二零二三年			美元P類 (累算)	港元P類 (累算)
	人民幣A類	美元A類	港元A類		
年初已發行單位數目	87,690,593	13,571,583	159,591,418	194,689	1,936,637
已發行單位	67,297,655	7,707,536	96,274,085	10,315	706,050
重投資(附注)	543,549	84,627	483,183	-	-
已贖回單位	(6,696,715)	(1,977,081)	(14,213,766)	(47,593)	(653,981)
年末已發行單位數目	148,835,082	19,386,665	242,134,920	157,411	1,988,706

  

	二零二二年			美元P類 (累算)	港元P類 (累算)
	人民幣A類	美元A類	港元A類		
年初已發行單位數目	45,226,975	8,538,874	80,896,677	250,098	2,772,323
已發行單位	48,686,077	6,162,451	93,071,282	91,202	930,139
重投資(附注)	817,318	154,284	766,189	-	-
已贖回單位	(7,039,777)	(1,284,026)	(15,142,730)	(146,611)	(1,765,825)
年末已發行單位數目	87,690,593	13,571,583	159,591,418	194,689	1,936,637

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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資			
股票			
中國			
中微公司	269,815	42,212,557	0.73
中國國航	4,430,000	36,503,200	0.64
晶晨股份	200,000	16,864,000	0.29
安琪酵母	580,000	21,001,800	0.37
金種子酒	1,560,000	37,034,400	0.64
華恒生物	184,500	16,693,560	0.29
芯動聯科	6,476	303,401	0.01
安集科技	92,300	15,213,809	0.26
鵬鼎控股	200,000	4,858,000	0.08
中航光電	1,019,958	46,255,095	0.80
成都銀行	4,850,000	59,218,500	1.03
寧波銀行	1,836,859	46,472,533	0.81
中科江南	249,822	18,726,657	0.33
太北農	1,350,000	8,910,000	0.16
金山辦公	50,000	23,611,000	0.41
東方雨虹	720,000	19,627,200	0.34
京滬高鐵	1,000,000	5,260,000	0.09
京東方A	9,100,000	37,219,000	0.65
採納股份	669,000	23,829,780	0.41
華測檢測	368,500	7,185,750	0.13
星宇股份	92,000	11,371,200	0.20

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)  
 截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
<b>股票 (續)</b>			
三環集團	1,625,000	47,693,750	0.83
招商銀行	3,498,230	114,602,015	1.99
洛陽鉬業	1,999,905	10,659,494	0.19
中國太保	900,000	23,382,000	0.41
中國南方航空股份	2,000,000	12,060,000	0.21
中國中免	311,400	34,419,042	0.60
萬科A	900,000	12,618,000	0.22
中國海油	2,769,912	50,190,805	0.87
寧德時代	399,980	91,511,424	1.59
道道全	1,830,000	23,661,900	0.41
大秦鐵路	650,000	4,829,500	0.08
怡合達	725,544	32,417,306	0.56
東方財富	4,012,103	56,971,863	0.99
電連技術	300,000	9,915,000	0.17
分眾傳媒	3,000,000	20,430,000	0.36
工業富聯	1,100,000	27,720,000	0.48
頂點軟體	100,000	5,542,000	0.10
海通發展	304	5,183	0.00
聖農發展	1,709,700	32,740,755	0.57
撫順特鋼	600,000	6,120,000	0.11
福耀玻璃	970,000	34,774,500	0.61
金地集團	1,100,000	7,931,000	0.14
廣聯達	420,000	13,645,800	0.24
長城汽車	140,000	3,523,800	0.06
鼎泰高科	770	17,710	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)  
截至二零二三年六月三十日

上市/報價投資(續)	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
<b>股票 (續)</b>			
皮阿諾	691,400	11,961,220	0.21
廣匯能源	3,500,000	24,010,000	0.42
海爾智家	949,965	22,305,178	0.39
鈞達股份	187,342	28,575,275	0.50
漢得信息	2,400,000	27,696,000	0.48
長川科技	320,000	15,196,800	0.26
格林達	910,000	27,709,500	0.48
海康威視	975,000	32,282,250	0.56
杭氧股份	600,000	20,616,000	0.36
天元寵物	588	14,018	0.00
泰格醫藥	365,800	23,608,732	0.41
昊華科技	520,000	19,572,800	0.34
工大科雅	168	4,049	0.00
新天地	636	12,408	0.00
平高電氣	2,350,000	29,116,500	0.51
同花順	260,000	45,572,800	0.79
宏發股份	1,031,700	32,859,645	0.57
華利集團	475,000	23,151,500	0.40
菲利華	635,600	31,271,520	0.54
濟川藥業	500,000	14,520,000	0.25
湖南裕能	1,965	86,480	0.00
興業銀行	1,960,000	30,674,000	0.53
固德威	100,800	16,819,488	0.29
恒瑞醫藥	1,976,800	94,688,720	1.65
吉貝爾	1,165,220	45,455,232	0.79

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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
<b>股票 (續)</b>			
景津裝備	818,760	25,676,314	0.45
晶科能源	2,600,000	36,556,000	0.64
中炬高新	1,139,999	41,940,563	0.73
傑華特	290,000	11,339,000	0.20
絕味食品	327,000	12,148,050	0.21
貴州茅臺	120,400	203,596,401	3.54
麗珠集團	500,000	19,455,000	0.34
隆基綠能	329,000	9,432,430	0.16
立訊精密	1,170,000	37,966,500	0.66
棲霞建設	5,200,000	16,016,000	0.28
北方華創	48,000	15,247,200	0.27
紐威數控	200,000	5,166,000	0.09
東方電纜	420,000	20,592,600	0.36
興瑞科技	1,900,000	46,740,000	0.81
歐派家居	100,000	9,580,000	0.17
中國平安	2,600,000	120,640,000	2.10
保利發展	1,049,941	13,680,731	0.24
銳捷網路	1,077	66,472	0.00
順豐控股	565,000	25,475,850	0.44
賽輪輪胎	2,829,982	32,233,495	0.56
中芯國際	560,000	28,291,200	0.49
聖邦股份	169,000	13,879,970	0.24
豪邁科技	820,000	28,806,600	0.50
艾為電子	168,000	9,937,200	0.17
寶信軟體	636,000	32,315,160	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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
股票 (續)			
海優新材	115,000	14,009,300	0.24
上海機場	260,000	11,809,200	0.21
山西汾酒	164,920	30,521,744	0.53
新宙邦	320,000	16,604,800	0.29
德方納米	170,000	18,739,100	0.33
華寶新能	284	22,467	0.00
匯川技術	839,944	53,932,804	0.94
邁瑞醫療	80,000	23,984,000	0.42
華僑城	4,000,000	17,600,000	0.31
傳音控股	345,000	50,715,000	0.88
以嶺藥業	553,600	14,221,984	0.25
賽諾醫療	500,000	5,280,000	0.09
陽光電源	310,000	36,155,300	0.63
春秋電子	3,000,000	25,680,000	0.45
瑞可達	448,000	27,843,200	0.48
萬華化學	474,928	41,717,676	0.73
溫氏股份	1,739,943	31,927,954	0.56
韋爾股份	287,885	28,224,245	0.49
衛甯健康	1,680,000	18,177,600	0.32
元道通信	433	12,509	0.00
五糧液	508,000	83,093,560	1.45
藥明康德	200,000	12,462,000	0.22
特寶生物	640,000	28,102,400	0.49
派瑞股份	920,000	12,134,800	0.21
鑫磊股份	341	9,200	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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
<b>股票 (續)</b>			
長盈通	1,841	69,406	0.00
龍源技術	2,483,300	16,662,943	0.29
泰和新材	1,630,000	39,886,100	0.69
片仔癀	98,000	28,063,280	0.49
盾安環境	800,000	11,064,000	0.19
花園生物	2,200,000	25,564,000	0.44
杭可科技	480,000	14,625,600	0.25
華友鈷業	1,010,000	46,369,100	0.81
九洲藥業	1,310,000	35,867,800	0.62
濤濤車業	2,652	126,527	0.00
偉星新材	876,900	18,011,526	0.31
仙琚製藥	1,000,000	13,250,000	0.23
珠城科技	330	11,801	0.00
旗濱集團	3,970,000	34,221,400	0.60
紫金礦業	6,020,000	68,447,400	1.19
		<hr/>	
		3,565,534,866	
<b>香港</b>			
康方生物	530,000	17,412,774	0.30
百濟神州	125,000	12,477,195	0.22
嗶哩嗶哩 - CL Z	90,000	9,761,488	0.17
中國移動	913,000	54,349,128	0.95
中國電信	6,700,000	23,351,175	0.41
吉利汽車	3,600,000	31,986,230	0.56
長城汽車	2,400,000	20,008,123	0.35



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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
<b>上市/報價投資(續)</b>			
<b>股票 (續)</b>			
香港交易所	313,500	86,011,509	1.50
海吉亞醫療	586,000	23,092,244	0.40
京東集團	132,000	16,242,938	0.28
美團-CLASS B	98,400	11,184,697	0.19
諾輝健康	700,000	17,793,363	0.31
中芯國際	2,000,000	37,919,520	0.66
騰訊控股	279,000	85,984,742	1.50
藥明生物	470,000	16,402,516	0.29
		<hr/>	
		463,977,642	
<b>美國</b>			
FUTU HLDGS LTD-SPONSORED ADR	30,000	8,681,839	0.15
		<hr/>	
		8,681,839	
<b>上市債務證券</b>			
<b>英屬維爾京群島</b>			
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3% S/A 20JAN2031	6,950,000	41,565,028	0.72
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3.25% S/A 28JAN2027	2,000,000	13,425,610	0.23
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS V LTD 2.375% S/A 18AUG2030	4,000,000	20,994,583	0.37
CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD 2.25% S/A 21JUL2031	1,000,000	5,997,838	0.10
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 2014 LTD 4.85% S/A 07MAY2044 REGS	1,980,000	14,509,594	0.25
		<hr/>	
		96,492,653	
<b>中國</b>			
杭銀轉債	28,500	3,272,057	0.06

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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
上市債務證券(續)			
22財通C2	500,000	49,689,350	0.86
22長江01	200,000	20,087,260	0.35
21誠通控股MTN002A	300,000	30,226,380	0.53
CHINA CONSTRUCTION BANK 0% A 16FEB2024 SHCH	50,000,000	48,826,600	0.85
22國債14	250,000	24,996,775	0.43
22安信05	200,000	19,905,020	0.35
22安信01	300,000	30,107,970	0.52
21華集01	299,010	30,051,641	0.52
22廣發C1	200,000	19,920,260	0.35
長汽轉債	53,440	6,081,445	0.11
22桂投資MTN002	300,000	30,356,760	0.53
宏發轉債	155,140	17,556,263	0.31
22華創C1	320,000	32,261,024	0.56
興業轉債	1,260,000	127,897,812	2.23
常銀轉債	36,120	4,115,534	0.07
晶能轉債	22,000	2,790,073	0.05
22開源債	400,000	40,141,880	0.70
立訊轉債	319,591	35,895,087	0.62
22東資03	300,000	29,923,860	0.52
22東資01	400,000	40,037,200	0.70
21華僑城MTN003A	300,000	30,131,310	0.52
19安租01	200,000	20,112,760	0.35
賽輪轉債	15,260	2,090,100	0.04
雪榕轉債	168,050	18,741,810	0.33
仙樂轉債	6,576	701,988	0.01

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

投資組合 (未經審計)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
上市債務證券(續)			
春23轉債	39,750	4,774,448	0.08
22天風01	200,000	20,223,180	0.35
21天風05	200,000	20,278,460	0.35
22廈貿K1	500,000	50,060,450	0.87
22義市01	300,000	30,145,200	0.52
花園轉債	47,912	5,526,208	0.10
華友轉債	141,450	15,407,979	0.27
三花轉債	5,109	731,357	0.01
		<hr/>	
		863,065,501	
香港			
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 12JAN2033 REGS	23,900,000	177,311,397	3.09
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4% S/A 07JUN2033	500,000	3,589,105	0.06
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.45% S/A 25MAY2024	69,500,000	68,378,270	1.19
		<hr/>	
		249,278,772	
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3% S/A 11SEP2029 REGS	3,000,000	19,308,899	0.34
BOC AVIATION LTD 5.5% S/A 26FEB2024	8,200,000	8,323,902	0.14
		<hr/>	
		27,632,801	
英國			
HSBC HLDGS PLC 3.4% A 29JUN2027	19,000,000	18,882,010	0.33
		<hr/>	
		18,882,010	

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)  
 截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
上市/報價投資(續)			
上市債務證券(續)			
美國			
BOC AVIATION USA CORP 4.875% S/A 03MAY2033 REGS	6,000,000	42,489,452	0.74
		<hr/>	
		42,489,452	
集體投資計畫			
中國			
華寶添益	320	31,999	0.00
		<hr/>	
		31,999	
上市/報價投資的總額		5,336,067,535	92.85
非上市/報價投資			
非上市債務證券			
開曼群島			
AZURE ORBIT IV INTL FINANCE LTD 4% S/A 25JAN2028	2,000,000	13,836,034	0.24
LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD 3.25% A 27OCT2024	13,000,000	13,044,720	0.23
		<hr/>	
		26,880,754	0.47
中國			
22東方債01BC	100,000	10,036,730	0.17
20信達地產MTN003	500,000	50,268,600	0.87
22碧桂園MTN002	500,000	50,372,150	0.88
22河鋼集MTN008	200,000	19,990,220	0.35
23今世緣MTN001	300,000	30,230,850	0.53

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)  
截至二零二三年六月三十日

	持股量	市值 人民幣	占資產淨值 百分比%
非上市/報價投資(續)			
非上市債務證券(續)			
22保利發展MTN003A	400,000	40,235,960	0.70
22電建地產MTN003A	200,000	20,085,460	0.35
19財金MTN001	200,000	20,213,440	0.35
21台州金融MTN001	200,000	20,140,340	0.35
21華髮集團MTN007	100,000	10,140,470	0.18
		<hr/>	
		271,714,220	
非上市/報價債務證券的總額		298,594,974	
總投資		5,634,662,509	
其他淨資產		<hr/>	
		111,975,727	
於二零二三年六月三十日的淨資產總額		<hr/>	
		5,746,638,236	
以成本計量的總投資		<hr/>	
		6,063,829,900	

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資					
股票					
中國					
中微公司	0	309,815	0	(40,000)	269,815
中國國航	2,830,000	1,600,000	0	0	4,430,000
晶晨股份	0	200,000	0	0	200,000
安琪酵母	580,000	0	0	0	580,000
金種子酒	450,000	1,110,000	0	0	1,560,000
華恒生物	0	135,000	49,500	0	184,500
山河藥輔	1,208,200	0	0	(1,208,200)	0
芯動聯科	0	6,476	0	0	6,476
安集科技	0	106,000	21,300	(35,000)	92,300
鵬鼎控股	0	200,000	0	0	200,000
中航光電	0	839,968	179,990	0	1,019,958
成都銀行	3,120,000	1,730,000	0	0	4,850,000
寧波銀行	1,836,859	0	0	0	1,836,859
中科江南	0	249,822	0	0	249,822
大北農	1,350,000	0	0	0	1,350,000
金山辦公	0	155,054	0	(105,054)	50,000
東方雨虹	580,000	140,000	0	0	720,000
京滬高鐵	0	1,000,000	0	0	1,000,000

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
貝達藥業	0	100,000	0	(100,000)	0
佰維存儲	4,613	0	0	(4,613)	0
京東方A	4,800,000	5,500,000	0	(1,200,000)	9,100,000
播恩集團	0	196	0	(196)	0
採納股份	0	630,000	39,000	0	669,000
首創證券	988	0	0	(988)	0
華測檢測	368,500	0	0	0	368,500
星宇股份	92,000	0	0	0	92,000
三環集團	1,365,000	260,000	0	0	1,625,000
康弘藥業	0	1,303,900	0	(1,303,900)	0
招商銀行	1,838,231	1,659,999	0	0	3,498,230
洛陽鉬業	0	1,999,905	0	0	1,999,905
中國太保	0	900,000	0	0	900,000
中國南方航空股份	0	2,000,000	0	0	2,000,000
中國中免	291,400	20,000	0	0	311,400
萬科A	900,000	0	0	0	900,000
多利科技	0	100,163	0	(100,163)	0
信達證券	0	1,609	0	(1,609)	0
中國重汽	780,000	270,000	0	(1,050,000)	0
中國海油	0	3,069,912	0	(300,000)	2,769,912
寧德時代	50,000	299,980	120,000	(70,000)	399,980
道道全	1,830,000	0	0	0	1,830,000
大秦鐵路	0	1,300,000	0	(650,000)	650,000
東阿阿膠	460,000	0	0	(460,000)	0
怡合達	0	604,620	120,924	0	725,544

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)  
 自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
<b>股票 (續)</b>					
東方財富	2,243,479	1,649,940	618,684	(500,000)	4,012,103
東鵬飲料	64,000	0	0	(64,000)	0
易點天下	985	0	0	(985)	0
電連技術	300,000	0	0	0	300,000
億道信息	0	204	0	(204)	0
華大九天	1,168	0	0	(1,168)	0
新易盛	0	1,260,000	10,000	(1,270,000)	0
分眾傳媒	3,000,000	0	0	0	3,000,000
工業富聯	0	1,850,000	0	(750,000)	1,100,000
頂點軟體	0	100,000	0	0	100,000
海通發展	0	205	99	0	304
聖農發展	1,709,700	0	0	0	1,709,700
撫順特鋼	600,000	0	0	0	600,000
福耀玻璃	0	970,000	0	0	970,000
金地集團	1,100,000	0	0	0	1,100,000
廣聯達	0	400,000	120,000	(100,000)	420,000
長城汽車	0	1,139,995	0	(999,995)	140,000
格力電器	1,800,000	0	0	(1,800,000)	0
鼎泰高科	770	0	0	0	770
海大集團	320,000	0	0	(320,000)	0
皮阿諾	0	691,400	0	0	691,400
廣匯能源	0	3,500,000	0	0	3,500,000
高瀾股份	0	330,000	0	(330,000)	0
金域醫學	347,960	0	0	(347,960)	0
賽意信息	436,000	0	0	(436,000)	0



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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
海爾智家	949,965	0	0	0	949,965
鈞達股份	104,000	30,000	53,342	0	187,342
漢得信息	0	4,650,000	0	(2,250,000)	2,400,000
長川科技	0	420,000	0	(100,000)	320,000
螢石網路	17,599	0	0	(17,599)	0
福斯達	0	247	0	(247)	0
格林達	0	910,000	0	0	910,000
海康威視	0	1,100,000	0	(125,000)	975,000
杭氧股份	0	600,000	0	0	600,000
天元寵物	420	0	168	0	588
泰格醫藥	425,930	365,800	0	(425,930)	365,800
昊華科技	819,972	0	0	(299,972)	520,000
工大科雅	168	0	0	0	168
新天地	424	0	212	0	636
平高電氣	0	4,550,000	0	(2,200,000)	2,350,000
同花順	0	290,000	0	(30,000)	260,000
宏發股份	851,700	180,000	0	0	1,031,700
華利集團	225,000	250,000	0	0	475,000
菲利華	0	710,000	0	(74,400)	635,600
江瀚新材	0	347	0	(347)	0
濟川藥業	0	500,000	0	0	500,000
湖南裕能	0	19,641	0	(17,676)	1,965
慧博雲通	322	0	0	(322)	0
愛柯迪	1,000,000	200,000	0	(1,200,000)	0
興業銀行	1,000,000	960,000	0	0	1,960,000

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
股票 (續)					
長電科技	0	890,000	0	(890,000)	0
固德威	54,000	42,000	28,800	(24,000)	100,800
恒瑞醫藥	1,546,800	2,070,000	0	(1,640,000)	1,976,800
吉貝爾	0	1,165,220	0	0	1,165,220
聯合水務	0	212	0	(212)	0
蘇能股份	0	2,080	0	(2,080)	0
景津裝備	618,760	400,000	0	(200,000)	818,760
晶科能源	1,800,000	800,000	0	0	2,600,000
中炬高新	939,999	200,000	0	0	1,139,999
傑華特	0	500,000	0	(210,000)	290,000
絕味食品	327,000	0	0	0	327,000
貴州茅臺	115,474	57,500	0	(52,574)	120,400
麗珠集團	0	500,000	0	0	500,000
隆基綠能	329,000	0	0	0	329,000
立訊精密	1,040,000	130,000	0	0	1,170,000
瀘州老窖	182,000	0	0	(182,000)	0
芒果超媒	0	600,000	0	(600,000)	0
卓勝微	0	197,800	0	(197,800)	0
美好醫療	342	0	0	(342)	0
明陽智能	200,000	0	0	(200,000)	0
北路智控	266	0	0	(266)	0
棲霞建設	4,000,000	1,200,000	0	0	5,200,000
北方華創	0	60,000	0	(12,000)	48,000
紐威數控	0	600,000	0	(400,000)	200,000
東方電纜	0	630,000	0	(210,000)	420,000

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
興瑞科技	1,300,000	800,000	0	(200,000)	1,900,000
一彬科技	0	150	0	(150)	0
歐派家居	100,000	111,000	0	(111,000)	100,000
中國平安	1,100,000	1,740,000	0	(240,000)	2,600,000
保利發展	1,049,941	0	0	0	1,049,941
銳捷網路	1,077	0	0	0	1,077
順豐控股	165,000	400,000	0	0	565,000
賽輪輪胎	2,330,000	499,982	0	0	2,829,982
三一重工	1,920,000	0	0	(1,920,000)	0
中芯國際	0	660,000	0	(100,000)	560,000
廣立微	700	0	0	(700)	0
聖邦股份	0	426,982	61,494	(319,476)	169,000
豪邁科技	0	820,000	0	0	820,000
華魯恒升	0	360,000	0	(360,000)	0
坤泰股份	0	103	0	(103)	0
陽谷華泰	0	800,000	0	(800,000)	0
艾為電子	0	120,000	48,000	0	168,000
寶信軟體	460,000	400,000	106,000	(330,000)	636,000
漠鐘精機	0	510,000	0	(510,000)	0
海優新材	0	115,000	0	0	115,000
上海機場	0	260,000	0	0	260,000
山西汾酒	0	164,920	0	0	164,920
新宙邦	0	320,000	0	0	320,000
德方納米	0	299,980	0	(129,980)	170,000
華寶新能	219	0	65	0	284

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
股票 (續)					
匯川技術	0	839,944	0	0	839,944
科達利	110,000	270,000	0	(380,000)	0
江波龍	610	0	0	(610)	0
邁瑞醫療	162,000	0	0	(82,000)	80,000
華僑城	0	4,000,000	0	0	4,000,000
三利譜	553,900	0	0	(553,900)	0
傳音控股	255,000	140,000	0	(50,000)	345,000
唯特偶	98	0	0	(98)	0
以嶺藥業	0	553,600	0	0	553,600
尚太科技	236	0	0	(236)	0
百利天恒	12,284	0	0	(12,284)	0
四川黃金	0	271	0	(271)	0
捨得酒業	80,000	0	0	(80,000)	0
賽諾醫療	0	500,000	0	0	500,000
思特威	292,500	193,570	0	(486,070)	0
陽光電源	280,000	30,000	0	0	310,000
宿遷聯盛	0	215	0	(215)	0
春秋電子	0	3,000,000	0	0	3,000,000
瑞可達	0	320,000	128,000	0	448,000
天孚通信	0	1,479,500	0	(1,479,500)	0
天士力	0	1,800,000	0	(1,800,000)	0
TCL科技	0	9,500,000	830,000	(10,330,000)	0
天潤工業	0	6,000,000	0	(6,000,000)	0
通達創智	0	169	0	(169)	0
萬華化學	429,928	45,000	0	0	474,928

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

投資組合變動報表(未經審計)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二 年十二月 三十一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
股票(續)					
溫氏股份	589,943	1,150,000	0	0	1,739,943
韋爾股份	0	287,885	0	0	287,885
衛甯健康	0	4,480,000	0	(2,800,000)	1,680,000
元道通信	433	0	0	0	433
三七互娛	0	600,000	0	(600,000)	0
五糧液	177,000	331,000	0	0	508,000
藥明康德	0	200,000	0	0	200,000
德科立	0	200,000	0	(200,000)	0
特寶生物	520,000	120,000	0	0	640,000
派瑞股份	0	920,000	0	0	920,000
西測測試	181	0	0	(181)	0
鑫磊股份	0	3,406	0	(3,065)	341
長盈通	1,416	1	424	0	1,841
龍源技術	2,483,300	0	0	0	2,483,300
泰和新材	0	1,630,000	0	0	1,630,000
悅康藥業	0	400,000	0	(400,000)	0
片仔癀	98,000	0	0	0	98,000
彩蝶實業	0	103	0	(103)	0
春風動力	0	300,000	0	(300,000)	0
盾安環境	0	800,000	0	0	800,000
花園生物	2,000,000	200,000	0	0	2,200,000
杭可科技	0	480,000	0	0	480,000
華友鈷業	700,000	310,000	0	0	1,010,000
京新藥業	0	800,000	0	(800,000)	0
九洲藥業	0	1,310,000	0	0	1,310,000

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)  
 自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二 年十二月 三十一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
<b>股票 (續)</b>					
中控技術	265,000	0	0	(265,000)	0
濤濤車業	0	2,652	0	0	2,652
偉星新材	876,900	0	0	0	876,900
仙琚製藥	0	1,000,000	0	0	1,000,000
亞光股份	0	198	0	(198)	0
珠城科技	220	0	110	0	330
中際旭創	0	950,000	0	(950,000)	0
珠海冠宇	0	1,000,000	0	(1,000,000)	0
旗濱集團	2,800,000	1,170,000	0	0	3,970,000
紫金礦業	1,169,829	6,020,000	0	(1,169,829)	6,020,000
中興通訊	1,190,000	1,980,000	0	(3,170,000)	0
<b>香港</b>					
中國國航	1,300,000	0	0	(1,300,000)	0
康方生物	0	530,000	0	0	530,000
百濟神州	0	125,000	0	0	125,000
嚶哩嚶哩 - CL Z	67,000	23,000	0	0	90,000
中銀香港	1,480,000	0	0	(1,480,000)	0
中國移動	0	913,000	0	0	913,000
中國電信	0	6,700,000	0	0	6,700,000
吉利汽車	0	3,600,000	0	0	3,600,000
長城汽車	0	2,900,000	0	(500,000)	2,400,000
香港交易所	313,500	0	0	0	313,500
華領醫藥	0	200,000	0	(200,000)	0
海吉亞醫療	0	586,000	0	0	586,000

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
<b>上市/報價投資(續)</b>					
<b>股票(續)</b>					
京東集團	132,000	0	0	0	132,000
美團 - W	156,000	26,400	0	(84,000)	98,400
諾輝健康	0	700,000	0	0	700,000
中芯國際	0	2,000,000	0	0	2,000,000
中國重汽	3,400,000	980,000	0	(4,380,000)	0
騰訊控股	264,000	15,000	0	0	279,000
藥明生物	0	470,000	0	0	470,000
<b>美國</b>					
FUTU HLDGS LTD-SPONSORED ADR	0	30,000	0	0	30,000
<b>報價債務證券</b>					
<b>英屬維京群島</b>					
CASTLE PEAK POWER FINANCE CO LTD 3.25% S/A 25JUL2027	1,100,000	0	0	(1,100,000)	0
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3% S/A 20JAN2031	5,950,000	6,500,000	0	(5,500,000)	6,950,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3.25% S/A 28JAN2027	0	2,000,000	0	0	2,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS V LTD 2.375% S/A 18AUG2030	0	4,000,000	0	0	4,000,000
CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD 2.25% S/A 21JUL2031	1,000,000	0	0	0	1,000,000
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 2014 LTD 4.85% S/A 07MAY2044 REGS	1,980,000	0	0	0	1,980,000
<b>開曼群島</b>					
LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD 2.75% S/A 19JAN2032	5,000,000	0	0	(5,000,000)	0
<b>中國</b>					
杭銀轉債	28,500	0	0	0	28,500

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

投資組合變動報表 (未經審計)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二 年十二月 三十一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資 (續)					
報價債務證券 (續)					
22財通C2	0	500,000	0	0	500,000
22長江01	200,000	0	0	0	200,000
21誠通控股MTN002A	300,000	0	0	0	300,000
CHINA CONSTRUCTION BANK 0% A 16FEB2024 SHCH	0	100,000,000	0	(50,000,000)	50,000,000
22國開02	500,000	0	0	(500,000)	0
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 1.75% S/A 26OCT2031	10,000,000	0	0	(10,000,000)	0
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.5% S/A 26OCT2051	3,000,000	0	0	(3,000,000)	0
22國債14	0	550,000	0	(300,000)	250,000
23融和融資GN001 (碳中和債)	0	500,000	0	(500,000)	0
22安信05	0	200,000	0	0	200,000
22安信01	0	300,000	0	0	300,000
21華集01	299,010	0	0	0	299,010
22廣發C1	0	200,000	0	0	200,000
長汽轉債	53,440	0	0	0	53,440
22桂投資MTN002	300,000	0	0	0	300,000
宏發轉債	102,130	53,010	0	0	155,140
22華創C1	320,000	0	0	0	320,000
愛迪轉債	14,260	0	0	(14,260)	0
興業轉債	0	1,260,000	0	0	1,260,000
常銀轉債	36,120	0	0	0	36,120
晶能轉債	0	22,000	0	0	22,000
22開源債	400,000	0	0	0	400,000
立訊轉債	205,111	114,480	0	0	319,591
22東資03	0	300,000	0	0	300,000
22東資01	0	400,000	0	0	400,000



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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二 年十二月 三十一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
上市/報價投資(續)					
報價債務證券(續)					
21華僑城MTN003A	300,000	0	0	0	300,000
19安租01	200,000	0	0	0	200,000
賽輪轉債	15,260	0	0	0	15,260
雪榕轉債	0	168,050	0	0	168,050
仙樂轉債	6,576	0	0	0	6,576
春23轉債	0	39,750	0	0	39,750
22天風01	200,000	0	0	0	200,000
21天風05	200,000	0	0	0	200,000
22廈貿K1	0	500,000	0	0	500,000
22義市01	0	300,000	0	0	300,000
花園轉債	0	47,912	0	0	47,912
華友轉債	141,450	0	0	0	141,450
三花轉債	5,109	0	0	0	5,109
香港					
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.5% S/A 12JAN2032 REGS	5,500,000	0	0	(5,500,000)	0
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 12JAN2033 REGS	0	46,900,000	0	(23,000,000)	23,900,000
BANK OF CHINA LTD/SYDNEY 2.95% S/A 03AUG2025	20,000,000	0	0	(20,000,000)	0
BLOSSOM JOY LTD 2.2% S/A 21OCT2030	0	5,000,000	0	(5,000,000)	0
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 1.75% S/A 24NOV2031	7,200,000	0	0	(7,200,000)	0
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 2.375% S/A 02FEB2051 REGS	4,200,000	0	0	(4,200,000)	0
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4% S/A 07JUN2033	0	4,500,000	0	(4,000,000)	500,000
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 4.625% S/A 11JAN2033 REGS	0	9,000,000	0	(9,000,000)	0
HONG KONG GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 11JAN2053	0	5,000,000	0	(5,000,000)	0

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)  
 自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
<b>上市/報價投資 (續)</b>					
<b>報價債務證券 (續)</b>					
ICBCIL FINANCE CO LTD 2.65% S/A 02AUG2031	9,200,000	9,200,000	0	(18,400,000)	0
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.45% S/A 25MAY2024	39,500,000	30,000,000	0	0	69,500,000
<b>新加坡</b>					
BOC AVIATION LTD 3% S/A 11SEP2029 REGS	3,000,000	0	0	0	3,000,000
BOC AVIATION LTD 5.5% S/A 26FEB2024	0	8,200,000	0	0	8,200,000
<b>集體投資計畫</b>					
華夏恒生科技ETF(QDII)	71,000,000	0	0	(71,000,000)	0
華寶添益	317	3	0	0	320
<b>未上市/報價證券</b>					
<b>股票</b>					
<b>中國</b>					
播恩集團	0	196	0	(196)	0
四川黃金	0	271	0	(271)	0
彩蝶實業	0	103	0	(103)	0
亞光股份	0	198	0	(198)	0

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)  
自二零二三年一月一日至二零二三年六月三十日止期間

	二零二二年 十二月三十 一日	增加	紅利/股利	減少	二零二三年 六月三十日
未上市/報價證券(續)					
報價債務證券					
開曼群島					
AZURE ORBIT IV INTL FINANCE LTD 4% S/A 25JAN2028	0	2,000,000	0	0	2,000,000
LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD 3.25% A 27OCT2024	20,000,000	0	0	(7,000,000)	13,000,000
中國					
21中銀投資MTN002	300,000	0	0	(300,000)	0
21國開08	500,000	0	0	(500,000)	0
22國債23	0	1,100,000	0	(1,100,000)	0
22東方債01BC	100,000	0	0	0	100,000
19東方債03BC	200,000	0	0	(200,000)	0
20信達地產MTN003	500,000	0	0	0	500,000
22碧桂園MTN002	0	500,000	0	0	500,000
19進出05	300,000	0	0	(300,000)	0
22河鋼集MTN008	200,000	0	0	0	200,000
23今世緣MTN001	0	300,000	0	0	300,000
21招聯消費金融債02	200,000	0	0	(200,000)	0
21招聯消費金融債03	100,000	0	0	(100,000)	0
22保利發展MTN003A	400,000	0	0	0	400,000
22電建地產MTN003A	200,000	0	0	0	200,000
19財金MTN001	200,000	0	0	0	200,000
21台州金融MTN001	0	200,000	0	0	200,000
21華髮集團MTN007	100,000	0	0	0	100,000

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

表現記錄 (未經審計)  
截至二零二三年六月三十日

資產淨值

截至下列日期止的財務年度 結束時	每單位資產淨值					
	資產淨值 (人民幣)	人民幣A類 (人民幣)	美元A類 (美元)	港元A類 (港元)	美元P類 (累算) (美元)	港元P類 (累算) (港元)
二零二三年六月三十日	5,746,638,236	12.85	10.29	10.42	11.93	11.75
二零二二年十二月三十一日	3,926,454,874	13.52	11.42	11.50	12.69	12.44
二零二一年十二月三十一日	2,700,926,436	16.83	15.59	15.68	15.97	15.66
二零二零年十二月三十一日	2,184,219,293	17.46	15.87	15.87	15.23	14.85

最高及最低每單位資產淨值

截至下列日期止的財務年度	每基金單位最高發行價值			每基金單位最低贖回價值		
	人民幣A類 (人民幣)	美元A類 (美元)	港元A類 (港元)	人民幣A類 (人民幣)	美元A類 (美元)	港元A類 (港元)
二零二三年六月三十日	14.22	12.31	12.46	12.69	10.26	10.38
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(自成立以來)	13.17	12.94	12.93	9.50	9.30	9.29
	美元P類 (累算) (美元)	港元P類 (累算) (港元)		美元P類 (累算) (美元)	港元P類 (累算) (港元)	
二零二三年六月三十日	13.77	13.57		11.89	11.71	
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	

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

財務報表附注 (未經審計)

編制基礎和會計政策

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

所採用的會計政策與截至 2022 年 12 月 31 日止年度財務報表附注 2 所述的一致。

注 1：截至 2023 年 6 月 30 日及 2022 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：

	30/06/2023	31/12/2022
中國銀行有限公司	23,475	52,625
中銀國際英國保誠信託有限公司	111,950	218,050

注 2：截至 2023 年 6 月 30 日及 2022 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：

	30/06/2023	31/12/2022
中國銀行(香港)有限公司	16,329	31,469