

大成港股精选混合型证券投资基金  
(QDII)  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	大成港股精选混合（QDII）
基金主代码	011583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年5月6日
报告期末基金份额总额	485,875,968.55份
投资目标	本基金主要投资于港股，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争超越业绩比较基准，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>股票投资策略</p> <p>（1）港股投资策略</p> <p>本基金主要投资于受益于香港证券市场上具有主题性投资机会的优质上市公司，在扎实的基本面研究的基础上，发掘企业价值。主要选股标准有：本基金将采取定量分析与定性分析相结合的分析方式，以选择具有持续竞争优势的上市公司。</p> <p>（2）内地及全球其他市场股票投资策略</p> <p>本基金可在对内地及全球其他证券市场投资价值进行综合评估</p>

	<p>的基础上，通过对不同证券市场上市公司经营情况、盈利能力、财务状况等因素的研究和分析，进行股票选择。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。</p> <p>（3）股票组合的构建与调整</p> <p>在以上分析的基础上，本基金将建立投资组合。当行业与公司的基本面、股票的估值水平等因素发生变化时，本基金将对股票组合适时进行调整。</p>	
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*70%+中证综合债指数收益率*30%	
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>此外，本基金主要投资于境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的投资风险。</p>	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	大成港股精选混合（QDII）A	大成港股精选混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	011583	011584
报告期末下属分级基金的份额总额	336,180,967.90份	149,695,000.65份
境外投资顾问	英文名称：Da Cheng International Asset Management Co., Ltd	
	中文名称：大成国际资产管理有限公司	
境外资产托管人	英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司	

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年7月1日-2024年9月30日）	
	大成港股精选混合（QDII）A	大成港股精选混合（QDII）C
1. 本期已实现收益	-4,763,477.13	-2,146,740.25
2. 本期利润	24,162,868.49	10,013,000.89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0747	0.0704
4. 期末基金资产净值	290,761,038.30	126,914,251.92
5. 期末基金份额净值	0.8649	0.8478

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成港股精选混合（QDII）A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.75%	1.33%	12.72%	0.97%	-3.97%	0.36%
过去六个月	14.78%	1.30%	19.60%	0.96%	-4.82%	0.34%
过去一年	24.25%	1.21%	14.06%	0.99%	10.19%	0.22%
过去三年	-1.22%	1.29%	1.17%	1.10%	-2.39%	0.19%
自基金合同 生效起至今	-13.51%	1.26%	-8.48%	1.08%	-5.03%	0.18%

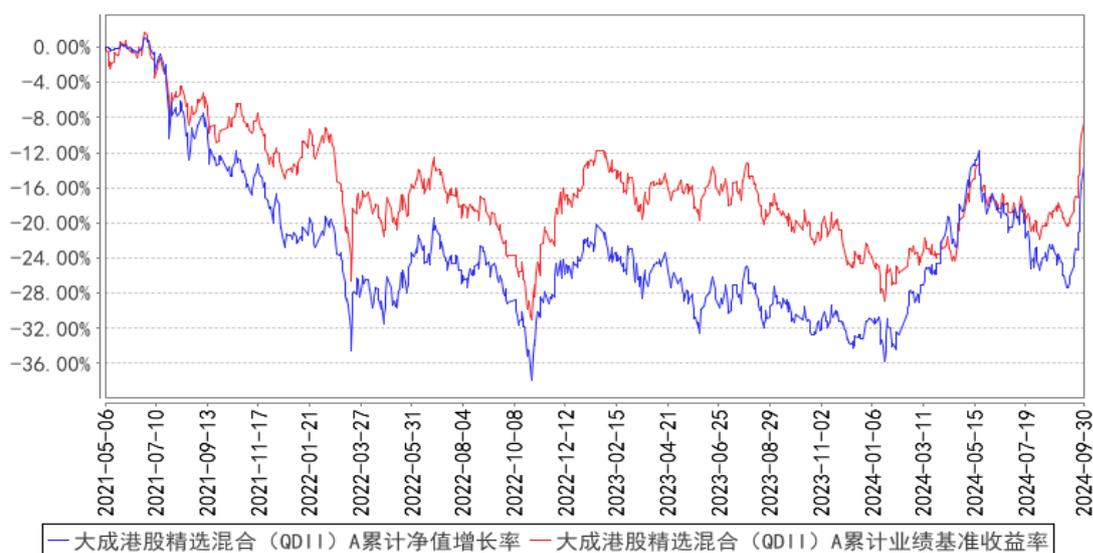
大成港股精选混合（QDII）C

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.66%	1.33%	12.72%	0.97%	-4.06%	0.36%
过去六个月	14.49%	1.29%	19.60%	0.96%	-5.11%	0.33%

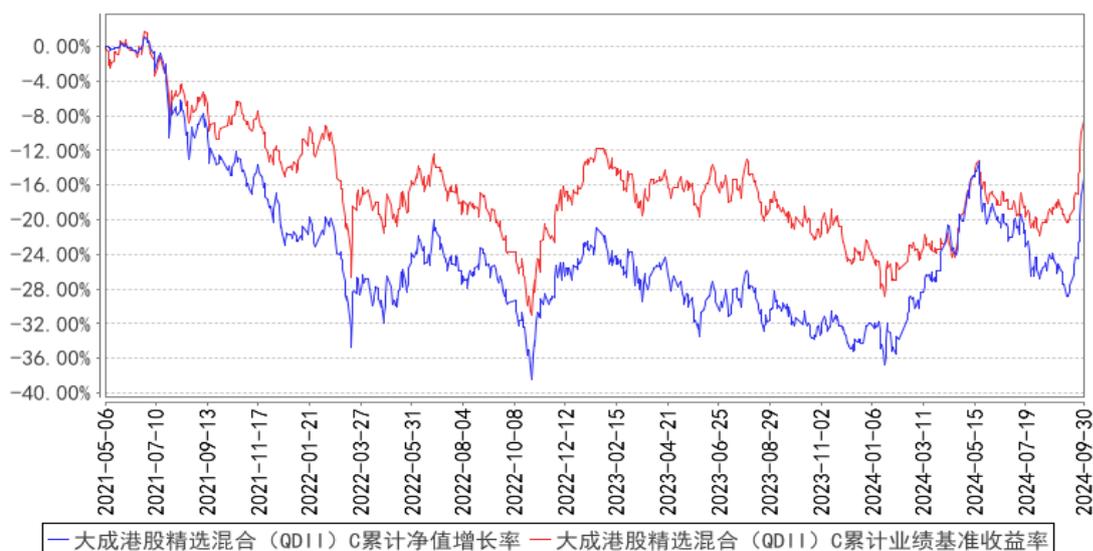
过去一年	23.57%	1.21%	14.06%	0.99%	9.51%	0.22%
过去三年	-2.94%	1.29%	1.17%	1.10%	-4.11%	0.19%
自基金合同生效起至今	-15.22%	1.26%	-8.48%	1.08%	-6.74%	0.18%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率率变动的比较

大成港股精选混合（QDII）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成港股精选混合（QDII）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柏杨	本基金基金经理，国际业务部总监	2021年5月6日	-	17年	香港大学商学院金融学博士。曾任摩根士丹利（香港）研究部亚洲与新兴市场策略师。现任大成国际资产管理公司董事总经理、研究部总监。2017年8月至2018年11月在大成基金管理有限公司国际业务部主持部门工作。2017年8月起担任大成基金管理有限公司投资经理。2018年11月起担任大成基金管理有限公司国际业务部总监。2021年5月6日起兼任大成港股精选混合型证券投资基金（QDII）基金经理。2022年9月21日起兼任大成中国优势混合型证券投资基金（QDII）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国香港

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
柏杨	公募基金	2	445,258,320.43	2021年5月6日
	私募资产管理计划	4	1,061,714,255.19	2017年9月28日
	其他组合	1	6,401,153,256.17	2018年3月27日
	合计	7	7,908,125,831.79	-

### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Feilong He	研究员	14	中央财经大学硕士、吉林大学博士在读。现任大成国际研究部研究员，投委会秘书。曾就职于金元证券股份有限公司投资银行总部，担任

			部门执行董事，独立负责多个 IPO 项目和再融资项目，为公司承揽 2 个 IPO 项目。主要覆盖医疗保健、互联网行业。
Xiaokui Ma	研究员	11	香港中文大学硕士，现任大成国际研究部研究员，大消费小组召集人。曾任职亚洲私募基金 Fundamental Value Partners 及灏信资本，担任投资经理。独立完成若干投资项目，并成功于港交所和纽交所上市。主要覆盖消费、教育行业。
Xi Zhang	研究员	7	香港中文大学哲学硕士、大连理工大学理学学士。现任大成国际研究部研究员，投委会秘书助理。曾就职于深圳恒盈富达资产管理有限公司，担任研究员，负责深度覆盖与跟踪港股与 A 股多家医药上市公司，研究经验丰富。主要覆盖 TMT 硬件、电信、辅助医疗行业。

#### 4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内、5 日内及 10 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投

资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2024 年第三季度港股走势非常具有戏剧性。肉眼可见地能够分为非常具有（非）对称之美的两段：以最具有代表性的恒生指数为例，

从 6 月 30 日收盘到 9 月 23 日收盘，在三季度 90.6% 的时间内贡献了整个三季度 15.5% 的涨幅（17718.61 点到 18247.11 点，）

而从 9 月 23 日收盘到 9 月 30 日收盘，在三季度 9.4% 的时间内贡献了整个三季度 84.5% 的涨幅（18247.11 点到 21133.68 点）。

复盘年初以来的港股市场，经历了一月底二月初的冬去冰洋否极泰来，和四五月份的杂花生树群莺乱飞之后，恒指在 5 月 20 日达到了 19700 点的阶段性高点。然而之后由于各种原因，港股又走了一段纠结的窄幅震荡下行的走势，在 9 月 11 日更是一度跌破了 17000 点大关。似乎又是一次失败的反弹，市场投资情绪再度陷于低迷。

然而，“造物无言却有情，每于寒尽觉春生”，9 月中下旬中央政府出台重磅政策组合拳，叠加美联储超预期降息 50 个基点开启降息周期，港股中概股市场一扫雾霾，不同于先前几次尝试上行中的犹豫和徘徊，而是在此利好共振下果断选择进入了快速上涨模式。10 月 7 日恒生指数更是一度突破 23,000 点大关。

那么，又该怎么去看待和应对巨变下港股中概股市场的行情呢？

大经济学家凯恩斯曾说过：“当事实发生了变化，我的想法也就发生了变化。那您呢，先生？”

尽管预测并是一件不容易的事情，温故而知新，我还是愿意来回顾和剖析一下自己早些时候的一些市场研判，以求总结得失，改进错误，努力提高未来的分析水平：

“我们仍然认为港股 2022 年 10 月的底部十分坚实，应该被视为新一轮周期的起点”（2023 年四季报）——恒生指数 2022 年 10 月 31 日的 14,687 点位迄今再未被跌破；

“数据支持我们 2022 年 10 月和 2024 年 1 月是港股的两个重要底部位置的观点”（2024 年二季报）——恒生指数 2024 年 1 月 31 日的 15,485 点位迄今再未被跌破；

“联储明确指向今年晚些时候的降息，只是幅度多大和何时开始的问题”（2024 年一季报）——美联储 2024 年 9 月议息会议上减息 50 个基点；

“展望今年下半年的港股中概股市场，我们仍持谨慎偏乐观的态度。我们认为，当下对比于今年初，宏观和市场层面有两点朝向积极方面的变化：一是中国近期的一系列经济政策，在坚持以高质量发展引领产业结构调整和先立后破稳定巩固经济总量两者中体现出了更加明确的平衡性、稳定性和长期一致性。笔者对撰稿时尚未召开的二十届三中全会尤其抱有期待。

二是海外机构投资者对中国经济体量的重要性，发展的韧性，挑战与机会共存的两面性的认识程度，经过近期的市场波动，相较以前更加趋于理性和平和”（2024 年二季报）——一个人当时的浅见，目前笔者对宏观和市场的观点较之当时更加乐观；

“在红利策略已得到市场较多关注的当下，整体投资性价比无疑有明显下降，至少在相对收益率层面有见顶的风险”（2024 年一季报）——9 月份恒生高股息指数港币全收益为 12.62%，低于同期恒生指数的 18.32%，且远低于成长风格的恒生科技指数的 33.49%。但当时是根据宏观研判和资产性价比做出的判断，从时间来说还是偏早了些；

“对成长类资产重视逆境下 EPS 有机增长的能力，特别是细分快速增长领域（如出海、极致性价比品类）的佼佼者”（2024 年二季报）——我们近期选择重仓的成长类个股反映了我们的观点；

“下半年港股市场有可能会呈现“上有顶、下有底”的较宽幅箱体式震荡行情，投资端需要重点把握结构性、波段性机会”（2024 年二季报）——目前看个人的判断失之偏保守了。恒生指数在 10 月 7 日一度突破 23,000 点；

“当下港股的投资气氛较之前已有明显回暖，但我们尚未有充分证据敢断言市场已经完全脱离存量博弈的窠臼”（2024 年二季报）——可能还是保守了。当时是有一分证据，只敢说一分话。有七分证据，只敢说七分话，不敢说八分话。

投资收益是认知的变现。基于以上的（有正确也有错误的）认知，我们在三季度总体保持了港股的高仓位，而且在市场有明显回调之后，把总体仓位从二季度末的约 80%提升到了三季度末的 90%。

在投资策略上，我们坚持了（有改进和增强的）哑铃型投资布局。价值类和成长类股票的分

布大致平衡。价值类股票的表现，直到三季度最后一周之前，都还算中规中矩。而我们精挑细选的成长类公司，基本不负重托，以一当多，在近期的市场风格变换时起到了净值拉升急先锋的作用。基于此较为均衡的布局，我们年初至今的表现与大市大致相当，但因成长类股票在组合中的权重还是不够重，在近期的市场急升中并未跑赢港股指数。

那么，我们的想法应该做什么样的改变？这次行情有什么不一样的地方？能走多久？能走多远？

这都是很重要却也很难回答的问题，生活在当下的我们，只能尝试着先来整理出些头绪：

首先是取决于我们对政策的理解。这次果决出台的一系列政策，我们相信会对未来中国乃至世界经济产生深远的影响。经济见底已经基本被金融市场定价成为了共识，后续的政策工具箱会是最坚定的后盾。

我们要坚持完整准确全面理解国家统筹发展和安全，促进高质量发展与高水平安全良性互动这一重要战略。于此同时，也需敏锐地认识到战术上的新变化，乃至过去一段时间内一些发展范式的重要甚至根本性变化，理解新的可能的破局之道。“虽有智慧，不如乘势；虽有镃基，不如待时”，及时认识市场的变化和把握住机会，坚持大胆假设，小心求证，而不是轻易去下断语。因为，傲慢和轻信同样都不可取，都是我们加深认知的障碍。

然后是看对未来境内外宏观经济形势的预期。港股市场短期在边际上显著受益于全球流动性放松与中国政策对发展经济和资本市场的积极定调，估值中枢已经得到明显的修复。但毋庸讳言，全球通胀预期、大国博弈、地缘政治事件和全球供应链安全等在2024年余下的日子里乃至明年初估计仍会不乏新的变数。11月美国大选的结果也将会对不少大类资产价格产生截然不同的影响。这些都是全球市场波动性的重要来源。中短期港股估值迅速回补后，预期资本市场交易主线仍会回到中长期主要矛盾上，即中美经济政策与大国博弈形势的影响。但我们同时也要看到，中国经济走向复苏，美国经济软着陆这一情形出现的概率还是最大的。相应的，对于股票资产的估值中枢，也应该做出合理的定价。另外，知己知彼才能百战不殆，海内外投资者预期和风险偏好的中长期结构性变化和短期周期性变化也非常值得关注。我们会充分利用好团队兼备境内外视野，信息灵通的优势，充分感受市场的水温和参与者的节奏，努力踏好投资的大小节拍。

我们预期会在未来一段时间内坚持高仓位运作，甚至必要时也会不乏倾情投入的热忱。毕竟，当形势比人强的时候，进攻就是最好的防守。具体说来，会加大在优质成长类资产上的投资力度。只要估值上仍有合理空间乃至安全边际，就会积极考虑配置。

在组合阶段性倾向于成长风格的同时，我们也仍会适度保持组合的均衡性。在不同行业，不同风格，不同宏观敏感性的投资标的中精选个股。我们会更注重公司基本面质量和性价比，在整

体市场回暖的过程中继续努力挖掘兼具成长性、稳固护城河和安全边际的公司。用阿尔法去在一定程度上平滑贝塔的波动。

同时，作为一个在港股市场上摸爬滚打十多年的老兵，我也会时刻注意保持一份惕厉之心，随时注意市场的变动，努力控制回撤。毕竟，即使是大牛市，也不会是一帆风顺的。有时花车变回南瓜可能也只需要一瞬之间。我们很难估计全球二次通胀和美国经济硬着陆的风险哪一个更大。我们也并不知道明天和意外，哪一个先来。就算大牛市真的来了，最终比拼的也是尘埃落定后的收益率。正如体育界所说的：进攻赢得比赛，防守赢得冠军。此时此刻，作为投资人，我最关切的不是短时间内能否跑赢大盘指数，而是还是当一切尘埃落定之后，有多少钱可以带回家，而不是“我自得之，我自失之”般的留在了市场里。

超额收益来源于择时、行业配置和选股。不管是宏观和行业研判，还是个股分析，都不是件容易的事，都充满了我们的尝试和失误。在对未来市场投资策略积极看好的同时，我们会坚持在这三方面扎扎实实下研究功夫，做难而正确的事。日拱一卒无有尽，功不唐捐终入海。我想，这是我们最希望为每一个信任我们的投资者去努力做的，也是我们应该做的。

截至本报告期末大成港股精选混合（QDII）A的基金份额净值为0.8649元，本报告期基金份额净值增长率为8.75%，同期业绩比较基准收益率为12.72%；截至本报告期末大成港股精选混合（QDII）C的基金份额净值为0.8478元，本报告期基金份额净值增长率为8.66%，同期业绩比较基准收益率为12.72%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	382,986,358.11	87.98
	其中：普通股	382,986,358.11	87.98
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	45,514,673.62	10.46
8	其他资产	6,831,349.29	1.57
9	合计	435,332,381.02	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 317,510,754.13 元，占期末基金资产净值的比例为 76.02%。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	361,659,055.91	86.59
美国	21,327,302.20	5.11
合计	382,986,358.11	91.69

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
通讯	76,520,127.94	18.32
非必需消费品	83,148,234.03	19.91
必需消费品	4,594,620.05	1.10
能源	22,766,590.34	5.45
金融	34,106,329.06	8.17
房地产	-	-
医疗保健	25,382,502.77	6.08
工业	13,615,766.49	3.26
材料	94,177,500.80	22.55
科技	23,642,698.43	5.66
公用事业	5,031,988.20	1.20
政府	-	-
合计	382,986,358.11	91.69

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

## 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

### 5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证

## 投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	2,118,000	33,730,444.95	8.08
2	MEITUAN-CLASS B	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	27,919,418.40	6.68
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	66,000	26,461,765.04	6.34
4	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港联合交易所	中国香港	2,038,000	25,325,545.72	6.06
5	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港联合交易所	中国香港	1,300,000	22,766,590.34	5.45
6	TRIP.COM GROUP LTD	携程集团有限	9961 HK	香港	中国香港	50,000	22,138,944.50	5.30

		公司		联合交易所				
7	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	中国香港	300,000	19,059,331.65	4.56
8	PDD HOLDINGS INC	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	20,000	18,893,351.88	4.52
9	CMOC GROUP LTD-H	洛阳栾川钼业集团股份有限公司	3993 HK	香港联合交易所	中国香港	2,388,000	16,431,010.59	3.93
10	POP MART INTERNATIONAL GROUP	泡泡玛特国际集团有限公司	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	280,000	13,445,688.90	3.22

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资

**明细**

无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	期货品种_股指	HTI2410	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：于本期末，本基金持有 20.00 手 HTI2410 合约，合约市值人民币-4,318,672.31 元，公允价值变动人民币-882,040.80 元。

**5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

无。

**5.10 投资组合报告附注****5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	461,800.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,562,877.58
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,806,670.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,831,349.29

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成港股精选混合 (QDII) A	大成港股精选混合 (QDII) C
报告期期初基金份额总额	323,217,520.63	125,507,258.28
报告期期间基金总申购份额	25,273,199.93	58,140,110.12
减:报告期期间基金总赎回份额	12,309,752.66	33,952,367.75
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	336,180,967.90	149,695,000.65

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成港股精选混合型证券投资基金（QDII）的文件；
- 2、《大成港股精选混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《大成港股精选混合型证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；

5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

## 9.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.defund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2024年10月25日