

大成有色金属期货交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 28 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 28 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 29 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 29 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 29 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 30 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 30 |

| | |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 30 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 30 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 30 |
| 7.10 报告期末本基金投资的商品期货交易情况说明 | 30 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 31 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 31 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 32 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 32 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 33 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 33 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 34 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 34 |
| § 10 重大事件揭示 | 34 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 34 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 34 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 34 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 34 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 34 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 35 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 35 |
| 10.8 其他重大事件 | 37 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 38 |
| 11.1 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 | 38 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 38 |
| § 12 备查文件目录 | 38 |
| 12.1 备查文件目录 | 38 |
| 12.2 存放地点 | 38 |
| 12.3 查阅方式 | 39 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|------------------------|
| 基金名称 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 大成有色金属期货 ETF |
| 场内简称 | 有色 ETF |
| 基金主代码 | 159980 |
| 交易代码 | 159980 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 10 月 24 日 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 211,824,777.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2019 年 12 月 24 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制法进行投资，按照标的指数的成份期货合约组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份期货合约及其权重的变动对投资组合进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 上海期货交易所有色金属期货价格指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为商品期货基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------------------------------|------------------------------|
| 名称 | 大成基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 赵冰 |
| | 联系电话 | 0755-83183388 |
| | 电子邮箱 | office@dcfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4008885558 | 95599 |
| 传真 | 0755-83199588 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |
| 办公地址 | 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 518040 | 100031 |
| 法定代表人 | 吴庆斌 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.dcfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日-2021年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 35,517,006.15 |
| 本期利润 | 41,551,062.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1646 |
| 本期加权平均净值利润率 | 12.69% |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 55,019,773.51 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2597 |
| 期末基金资产净值 | 285,310,354.44 |
| 期末基金份额净值 | 1.3469 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 34.69% |

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、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

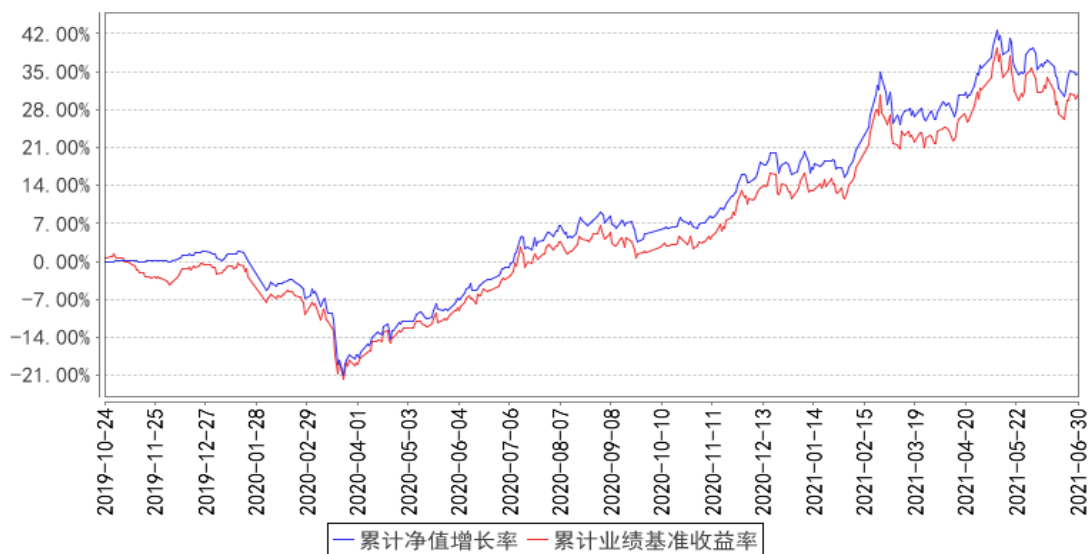
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长 | 份额净值增长率标 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|----------|------------|--------------|-----|-----|
|----|--------|----------|------------|--------------|-----|-----|

| | 率① | 准差② | | ④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | -3.24% | 0.90% | -3.13% | 1.13% | -0.11% | -0.23% |
| 过去三个月 | 6.70% | 1.04% | 7.56% | 1.22% | -0.86% | -0.18% |
| 过去六个月 | 15.98% | 1.10% | 17.44% | 1.27% | -1.46% | -0.17% |
| 过去一年 | 37.49% | 0.93% | 36.31% | 1.09% | 1.18% | -0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.69% | 0.96% | 31.02% | 1.09% | 3.67% | -0.13% |

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

大成有色金属期货ETF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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准，于 1999 年 4 月 12 日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本 2 亿元人民币，注册地广东省深圳市。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。主要业务是公募基金的募集、销售和管理，还具有全国社保基金投资管理、基本养老保险投资管理、受托管理保险资金、保险保障基金投资管理、特定客户资产管理和 QDII 业务资格。

经过二十二年的稳健发展，公司形成了强大稳固的综合实力。公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 9 只 ETF 及 3 只 ETF 联接基金，8 只 QDII 基金及 107 只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李绍 | 本基金基金经理，期货投资部总监 | 2019 年 10 月 24 日 | - | 21 年 | 经济学硕士。曾先后任职于大连商品交易所、中国金融期货交易所和中国期货市场监控中心，曾负责中国证监会期货市场运行监测监控系统建设，获证券期货科技进步评比一等奖；主持编制发布中国商品期货指数、农产品期货指数等系列指数。2015 年 5 月加入大成基金管理有限公司，现任期货投资部总监。2019 年 10 月 24 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019 年 10 月 30 日起任大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国 |

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人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 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析。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，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，但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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易不存在同日反向交易。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要。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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，有色金属期货价格整体继续保持上涨势头，但 5 月中旬及 6 月份以来受有色金属抛储等国家宏观调控政策的实施以及美国议息会议的影响，有色金属期货价格承压，出现了短暂的回调。本报告期，本基金跟踪指数上期有色金属期货价格指数（IMCI）收于 3852.43 点，较年初上涨 17.44%。IMCI 指数构成的 6 个成份期货合约铜、铝、铅、锌、镍、锡均上涨。按结算价统计，其中沪锡上涨 39.37%，沪铝上涨 21.68%，沪铜上涨 17.73%，位居涨幅前三。报告期本基金净值较去年末上涨 15.98%，同期沪深 300 指数上涨 0.24%，大宗商品资产与股票权益市场低相关性特点表现明显，有色金属期货 ETF 对丰富大类资产配置诠释了直观意义。

本报告期有色期货 ETF 投资组合比例严格遵循基金合同约定，持有指数成份商品期货合约的

价值合计（买入、卖出轧差计算）不低于基金资产净值的 90%、不高于基金资产净值的 110%。本基金为商品期货 ETF，紧密跟踪有色金属成份期货合约价格的走势，并不参与有色金属类股票的投资，基金资产在支付商品期货合约保证金外，均投资于货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本报告期有色期货 ETF 严格按照跟踪指数编制方案和品种权重进行 6 次展期操作，确保投资组合密切跟踪最新指数权重和成份期货合约。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3469 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.98%，业绩比较基准收益率为 17.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5 月底以来，随着我国针对大宗商品宏观调控的展开和美国议息会议的启动，包括有色金属在内的前期大幅上涨的大宗商品价格短期受到了一定的遏制和调整，调控取得了较好的成效。但从历次大宗商品完整周期的时间维度看，单就有色金属而言，本轮大宗商品周期的时间窗口和价格窗口并未完全走完，而且两个维度都还有较长距离。从外围环境看，美国从议息到最终是否真正加息尚待时日，变数较大。确定性的因素是，随着全球新冠疫苗注射的不断普及，疫情在局部地区的升级、反复和全球经济复苏步伐的显著加快，史无前例的货币超发引致的全球通胀预期依然显性存在，各国对经济的干预、刺激措施也更为复杂。参考过往大宗商品完整周期的走势特点，随着后期各种扰动因素的加大，有色金属价格高位波动将加大，但趋势一时难以改变。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、交易管理部、风险管理部、基金运营部、监察稽核部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括五名投资组合经理。

股票投资部、研究部、固定收益总部、数量与指数投资部、大类资产配置部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负

责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人将严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披

露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 283,364.35 | 1,643,151.94 |
| 结算备付金 | | 265,845,460.69 | 214,865,881.60 |
| 存出保证金 | | 29,011,080.50 | 18,554,215.60 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.3.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.3.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 239,874.10 | - |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 294,161.85 | 210,796.75 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | - |
| 资产总计 | | 295,673,941.49 | 235,274,045.89 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 80,595.42 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 147,295.28 | 108,490.09 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付托管费 | | 24,549.20 | 18,081.69 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 10,191,742.57 | 1,849,406.56 |
| 负债合计 | | 10,363,587.05 | 2,056,573.76 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 211,824,777.00 | 200,824,777.00 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | 73,485,577.44 | 32,392,695.13 |
| 所有者权益合计 | | 285,310,354.44 | 233,217,472.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 295,673,941.49 | 235,274,045.89 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3469 元，基金份额总额 211,824,777.00 份。

6.2 利润表

会计主体：大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 43,059,712.45 | -32,092,651.36 |
| 1. 利息收入 | | 1,827,255.07 | 2,885,112.15 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 1,827,255.07 | 2,885,112.15 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 27,362,738.22 | -44,580,335.21 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.3.13 | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.3.14 | - | - |

| | | | |
|------------------------|-----------|---------------|----------------|
| 衍生工具收益 | 6.4.3.15 | 27,362,738.22 | -44,580,335.21 |
| 股利收益 | 6.4.3.16 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.17 | 6,034,056.78 | 6,433,740.21 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.18 | 7,835,662.38 | 3,168,831.49 |
| 减：二、费用 | | 1,508,649.52 | 1,570,165.89 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 958,481.78 | 987,905.93 |
| 2. 托管费 | 6.4.6.2.2 | 159,746.87 | 164,651.02 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.3.19 | 233,171.71 | 252,990.89 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.3.20 | 157,249.16 | 164,618.05 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 41,551,062.93 | -33,662,817.25 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 41,551,062.93 | -33,662,817.25 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 200,824,777.00 | 32,392,695.13 | 233,217,472.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 41,551,062.93 | 41,551,062.93 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 11,000,000.00 | -458,180.62 | 10,541,819.38 |
| 其中：1. 基金申 | 494,000,000.00 | 146,684,057.04 | 640,684,057.04 |

| | | | |
|--|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 购款 | | | |
| 2. 基金赎回款 | -483,000,000.00 | -147,142,237.66 | -630,142,237.66 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 211,824,777.00 | 73,485,577.44 | 285,310,354.44 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 364,824,777.00 | 5,371,304.15 | 370,196,081.15 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -33,662,817.25 | -33,662,817.25 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -57,000,000.00 | 22,012,001.19 | -34,987,998.81 |
| 其中：1. 基金申购款 | 525,000,000.00 | -30,067,521.30 | 494,932,478.70 |
| 2. 基金赎回款 | -582,000,000.00 | 52,079,522.49 | -529,920,477.51 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 307,824,777.00 | -6,279,511.91 | 301,545,265.09 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

周立新

刘亚林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(3) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 283,364.35 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 283,364.35 |

6.4.3.2 交易性金融资产

无。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | | 备注 |
|--------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | |
| 货币衍生工具 | - | - | - | |
| 权益衍生工具 | - | - | - | |
| 其他衍生工具 | 286,904,902.56 | - | - | |
| 合计 | 286,904,902.56 | - | - | |

注：衍生金融资产项下的其他衍生工具为商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持商品期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的商品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为 0。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,295.10 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 292,866.75 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |

| | |
|----|------------|
| 其他 | - |
| 合计 | 294,161.85 |

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

无。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 89,260.15 |
| 应付指数使用费 | 29,918.07 |
| 应退替代款 | 8,666,099.35 |
| 可退替代款 | 1,406,465.00 |
| 合计 | 10,191,742.57 |

注：应退替代款指投资者申赎本基金时，替代价格与实际成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 200,824,777.00 | 200,824,777.00 |
| 本期申购 | 494,000,000.00 | 494,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -483,000,000.00 | -483,000,000.00 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 211,824,777.00 | 211,824,777.00 |

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 27,993,150.43 | 4,399,544.70 | 32,392,695.13 |

| | | | |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期利润 | 35,517,006.15 | 6,034,056.78 | 41,551,062.93 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,490,383.07 | 8,032,202.45 | -458,180.62 |
| 其中：基金申购款 | 99,388,149.94 | 47,295,907.10 | 146,684,057.04 |
| 基金赎回款 | -107,878,533.01 | -39,263,704.65 | -147,142,237.66 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 55,019,773.51 | 18,465,803.93 | 73,485,577.44 |

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|--------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 43,389.28 |
| 定期存款利息收入 | | - |
| 其他存款利息收入 | | - |
| 结算备付金利息收入 | | 1,783,865.79 |
| 其他 | | - |
| 合计 | | 1,827,255.07 |

6.4.3.12 股票投资收益

无。

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 贵金属投资收益

无。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 | |
|----------|----------------------|---------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 商品期货投资收益 | | 27,362,738.22 |

6.4.3.16 股利收益

无。

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | - |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | 6,034,056.78 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | 6,034,056.78 |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 6,034,056.78 |

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 7,835,662.38 |
| 合计 | 7,835,662.38 |

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申赎本基金时，被替代期货合约的实际成本与申赎确认日估值的差额。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 233,171.71 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 233,171.71 |

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| | |

| | |
|---------|------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 8,481.64 |
| 指数使用费 | 59,507.37 |
| 合计 | 157,249.16 |

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，当前一日基金资产净值小于 20 亿元人民币时，当日许可费为 12 万元人民币/当年天数；当前一日基金资产净值大于等于 20 亿元人民币时，当日指数使用费按前日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|----------|
| 大成基金管理有限公司（“大成基金”） | 基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人 |
| 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“大成有色金属期货 ETF 联接”） | 本基金的联接基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 958,481.78 | 987,905.93 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：支付基金管理人大成基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 159,746.87 | 164,651.02 |

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2021年6月30日 | | 上年度末 2020年12月31日 | |
|-------------------|-------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%) |
| 大成有色金属 期货ETF联接 | 122,985,000.00 | 58.0600 | 101,770,000.00 | 50.6800 |

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|--------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 283,364.35 | 43,389.28 | 1,133,497.02 | 64,878.44 |

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为商品期货基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上海期货交易所有色金属期货价格指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行；在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会；在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资。(上年度末：同)。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金主要投资于上海期货交易所期货合约，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|-------|-------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 283,364.35 | - | - | - | 283,364.35 |
| 结算备付金 | 265,845,460.69 | - | - | - | 265,845,460.69 |
| 存出保证金 | - | - | - | 29,011,080.50 | 29,011,080.50 |
| 应收利息 | - | - | - | 294,161.85 | 294,161.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 239,874.10 | 239,874.10 |
| 资产总计 | 266,128,825.04 | - | - | 29,545,116.45 | 295,673,941.49 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 147,295.28 | 147,295.28 |
| 应付托管费 | - | - | - | 24,549.20 | 24,549.20 |
| 其他负债 | - | - | - | 10,191,742.57 | 10,191,742.57 |
| 负债总计 | - | - | - | 10,363,587.05 | 10,363,587.05 |
| 利率敏感度缺口 | 266,128,825.04 | - | - | 19,181,529.40 | 285,310,354.44 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,643,151.94 | - | - | - | 1,643,151.94 |
| 结算备付金 | 214,865,881.60 | - | - | - | 214,865,881.60 |
| 存出保证金 | - | - | - | 18,554,215.60 | 18,554,215.60 |
| 应收利息 | - | - | - | 210,796.75 | 210,796.75 |
| 资产总计 | 216,509,033.54 | - | - | 18,765,012.35 | 235,274,045.89 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 108,490.09 | 108,490.09 |
| 应付托管费 | - | - | - | 18,081.69 | 18,081.69 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 80,595.42 | 80,595.42 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,849,406.56 | 1,849,406.56 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,056,573.76 | 2,056,573.76 |
| 利率敏感度缺口 | 216,509,033.54 | - | - | 16,708,438.59 | 233,217,472.13 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于期货交易所交易的商品期货合约，所面临的其他价格风险来源于所持有的金融工具的价格波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪上海期货交易所所有有色金属期货价格指数，以完全按照标的指数成份商品期货合约组成及其权重构建投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。

本基金投资组合比例为：持有的标的指数成份商品期货合约的价值合计（买入、卖出轧差计算）不低于基金资产净值的 90%，不高于基金资产净值的 110%；除支付商品期货合约保证金以外的基金财产投资于货币市场工具不少于 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

在期货交易所交易的商品期货投资（附注“衍生金融资产/负债”），在当日无负债结算制度下，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为 0。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2021年6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5% | 14,337,149.98 | 11,693,627.64 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -14,337,149.98 | -11,693,627.64 |

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|----|--------------|
|----|----|----|--------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 266,128,825.04 | 90.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 29,545,116.45 | 9.99 |
| 9 | 合计 | 295,673,941.49 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代 码 | 名 称 | 持仓量 (买/ 卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|--------|---------|---------------|----------------|---------------|------|
| AL2109 | 沪铝 2109 | 431 | 40,567,875.00 | 63,352.05 | - |
| CU2109 | 沪铜 2109 | 366 | 125,208,600.00 | -353,017.87 | - |
| NI2109 | 沪镍 2109 | 302 | 41,062,940.00 | 1,327,059.63 | - |
| PB2109 | 沪铅 2109 | 230 | 18,256,250.00 | 468,179.64 | - |
| SN2109 | 沪锡 2109 | 142 | 29,659,540.00 | 2,277,289.51 | - |
| ZN2109 | 沪锌 2109 | 322 | 35,355,600.00 | -576,960.52 | - |

| | | | | |
|-------------------|--|--|---|---------------|
| | | | 0 | |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | 3,205,902.44 |
| 商品期货投资本期收益（元） | | | | 27,362,738.22 |
| 商品期货投资本期公允价值变动（元） | | | | 6,034,056.78 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

7.10.2 本基金投资商品期货的投资政策

一般情况下，本基金采用完全复制法进行投资，按照标的指数的成份期货合约组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份期货合约及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

本基金将根据基金资产净值确定所投资的合约数量。通常情形下，本基金将跟随有色金属期货指数成份期货合约调整规则进行展期操作，但也可根据成份期货合约的期限结构、合约流动性状况等因素灵活安排展期窗口。

同时，为了避免在展期期间被市场操纵的风险，本基金可以根据市场的实际情况采用技术性移仓的方式，如换约至远月非主力合约，进而一定程度规避展期过程中被市场操纵的风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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未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。

7.12.2 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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 29,011,080.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 239,874.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 294,161.85 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 29,545,116.45 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 4,700 | 45,069.10 | 152,658,700.00 | 72.07 | 59,166,077.00 | 27.93 |

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目 | 持有份额（份） | 占总份额比例（%） |
|---|----------------|-----------|
| 中国农业银行股份有限公司 -大成有色金属期货交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金 | 122,985,000.00 | 58.06 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|----|---|----------------|-------------|
| 1 | 国盛证券有限责任公司 | 8,966,904.00 | 4.23 |
| 2 | 中信证券股份有限公司 | 4,529,183.00 | 2.14 |
| 3 | 都向琴 | 4,348,500.00 | 2.05 |
| 4 | 招商证券股份有限公司 | 4,235,302.00 | 2.00 |
| 5 | 张冬燕 | 2,922,600.00 | 1.38 |
| 6 | 北京儒忆资产管理有 限公司-儒忆 19 号私 募证券投资基金 | 2,400,000.00 | 1.13 |
| 7 | 上海展弘投资管理有 限公司-展弘量化套 利 1 号私募证券投资基 金 | 2,000,000.00 | 0.94 |
| 8 | 华宝信托有限责任公 司-华宝博识全天候 1 号 TOF 投资运作集合信 托计划 | 1,695,000.00 | 0.80 |
| 9 | 霍凌汉 | 1,668,200.00 | 0.79 |
| 10 | 上海瞰道资产管理有 限公司-益菁汇瞰点 一号私募证券投资基金 | 1,500,000.00 | 0.71 |
| 11 | 中国农业银行股份有 限公司-大成有色金 属期货交易型开放式 指数证券投资基金联 接基金 | 122,985,000.00 | 58.06 |

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 10 月 24 日） 基金份额总额 | 310,824,777.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 200,824,777.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 494,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 483,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 211,824,777.00 |

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

无。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

基金管理人报告期内无重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 爱建证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西 部 | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万和证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证 券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中原证券 | 1 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

注：1、根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：（一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；（二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；（三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；（四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；（五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；（六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

2、报告期内租用交易单元变更情况，新增交易单元：无。退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|-----------------------------------|--------------------------|------------|
| 1 | 关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年6月30日 |
| 2 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金第一季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年4月22日 |
| 3 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年3月30日 |
| 4 | 大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年3月23日 |
| 5 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金第四季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年1月22日 |
| 6 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年1月7日 |
| 7 | 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021年1月7日 |

| | | | |
|---|-----------------------------------|--------------------------|----------------|
| 8 | 关于变更大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金场内简称的公告 | 中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站 | 2021 年 1 月 6 日 |
|---|-----------------------------------|--------------------------|----------------|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 目标基金的联接基金 | 1 | 20210101-20210630 | 101,770,000.00 | 399,292,000.00 | 378,077,000.00 | 122,985,000.00 | 58.06 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险，甚至有可能引起基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|----|
| 无。 |
|----|

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 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。

12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

12.3 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.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日