

# 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 2026 年第 2 季度报告

2026 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

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 20 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 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |                                                                                                                           |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 大成有色金属期货 ETF 联接                                                                                                           |
| 基金主代码      | 007910                                                                                                                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                    |
| 基金合同生效日    | 2019 年 10 月 30 日                                                                                                          |
| 报告期末基金份额总额 | 956,264,213.18 份                                                                                                          |
| 投资目标       | 通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即上海期货交易所有色金属期货价格指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                             |
| 投资策略       | 本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。 |
| 业绩比较基准     | 上海期货交易所有色金属期货价格指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%                                                                                    |
| 风险收益特征     | 本基金属于 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上海期货交易所有色金属期货价格指数及目标 ETF 的表现密切相关，其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。   |
| 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                                                                                                              |

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 下属分级基金的基金简称     | 大成有色金属期货 ETF 联接 A | 大成有色金属期货 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 007910            | 007911            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 558,159,914.30 份  | 398,104,298.88 份  |

2.1.1 目标基金基本情况

|              |                        |
|--------------|------------------------|
| 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 |
| 基金主代码        | 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       |
| 基金管理人名称      | 大成基金管理有限公司             |
| 基金托管人名称      | 中国农业银行股份有限公司           |

2.1.2 目标基金产品说明

|        |                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 上海期货交易所所有有色金属期货价格指数收益率                                                    |
| 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。                                |

§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（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |                   |
|-----------------|---------------------------------------|-------------------|
|                 | 大成有色金属期货 ETF 联接 A                     | 大成有色金属期货 ETF 联接 C |
| 1. 本期已实现收益      | 6,057,948.42                          | 4,603,812.79      |
| 2. 本期利润         | 11,585,235.42                         | 18,003,712.34     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0203                                | 0.0357            |
| 4. 期末基金资产净值     | 629,508,055.88                        | 437,070,011.39    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1278                                | 1.0979            |

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

大成有色金属期货 ETF 联接 A

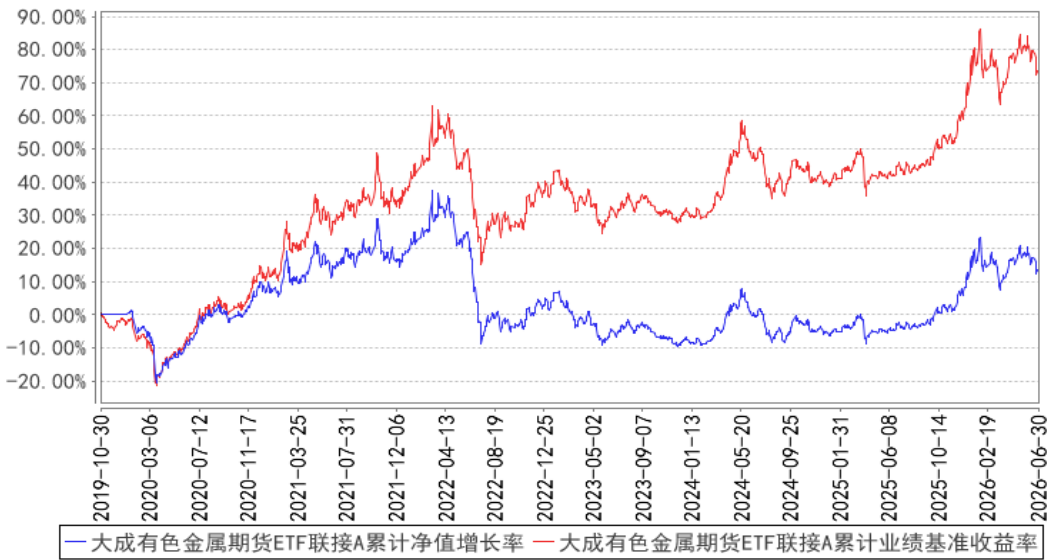
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | 1.57%  | 0.76%     | 2.16%      | 0.75%         | -0.59%  | 0.01%  |
| 过去六个月      | 0.83%  | 1.12%     | 2.72%      | 1.12%         | -1.89%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 16.21% | 0.89%     | 19.44%     | 0.90%         | -3.23%  | -0.01% |
| 过去三年       | 20.48% | 0.71%     | 33.35%     | 0.73%         | -12.87% | -0.02% |
| 过去五年       | -1.26% | 0.83%     | 34.60%     | 0.86%         | -35.86% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.78% | 0.84%     | 72.84%     | 0.91%         | -60.06% | -0.07% |

大成有色金属期货 ETF 联接 C

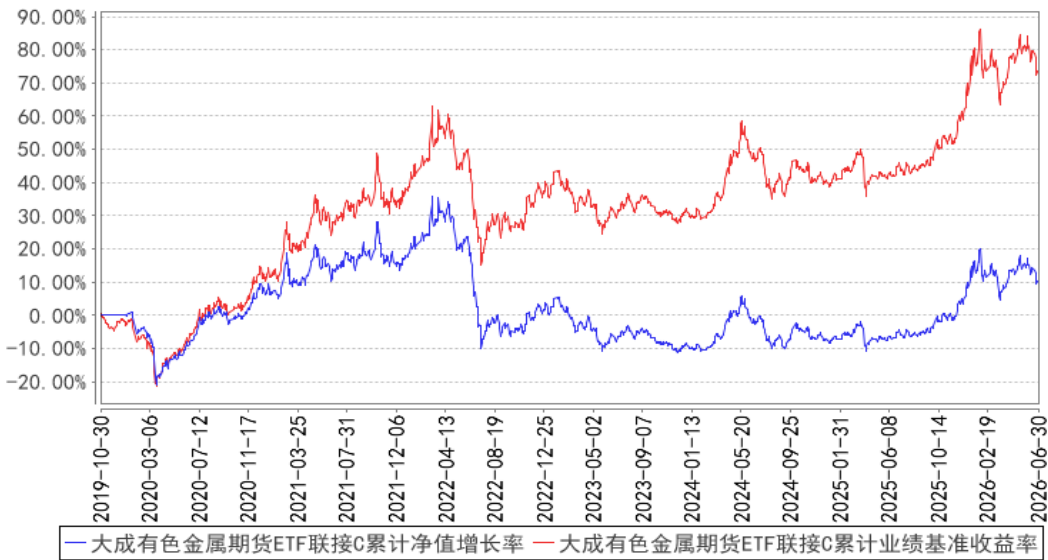
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | 1.47%  | 0.76%     | 2.16%      | 0.75%         | -0.69%  | 0.01%  |
| 过去六个月      | 0.63%  | 1.12%     | 2.72%      | 1.12%         | -2.09%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 15.75% | 0.89%     | 19.44%     | 0.90%         | -3.69%  | -0.01% |
| 过去三年       | 19.03% | 0.71%     | 33.35%     | 0.73%         | -14.32% | -0.02% |
| 过去五年       | -3.24% | 0.83%     | 34.60%     | 0.86%         | -37.84% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.79%  | 0.84%     | 72.84%     | 0.91%         | -63.05% | -0.07% |

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变动的比较

大成有色金属期货ETF联接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



大成有色金属期货ETF联接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 |        |                                                                             |
| 刘淼 | 本基金基金经理 | 2023年3月20日  | —    | 18年    | 北京大学工商管理硕士。2008年4月至2011年5月就职于招商基金管理有限公司，任基金核算部基金会计。2011年5月加入大成基金管理有限公司，先后担任 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>基金运营部基金会计、股票投资部投委会秘书兼风控员、数量与指数投资部数量分析师、指数与期货投资部基金经理、指数与期货投资部总监助理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 5 月 30 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2023 年 6 月 14 日任大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2025 年 12 月 19 日任深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020 年 6 月 29 日至 2022 年 11 月 30 日任大成中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 30 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 17 日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2022 年 12 月 8 日任中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金（更名前为大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金）基金经理。2021 年 9 月 2 日至 2025 年 12 月 19 日任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 28 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证电池主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2025 年 3 月 17 日任大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022 年 10 月 13 日至 2023 年 10 月 20 日任大成动态量化配置策略混合型证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日起任大成有色金属期货交易所型开放式指数证券投资基金、大成有色金属期货交易所型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2023 年 4 月 14 日起任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至</p> |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |                 |                  |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----|-----------------|------------------|---|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                 |                  |   |      | <p>2025 年 7 月 29 日任大成中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 23 日起任大成中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2024 年 5 月 24 日至 2025 年 2 月 18 日任大成中证芯片产业指数型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 5 月 28 日至 2025 年 7 月 29 日任大成中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 12 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(转型前为大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金)基金经理。2024 年 11 月 22 日起任大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 2 日起任大成深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 23 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月 2 日起任大成中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2025 年 7 月 16 日起担任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 8 月 29 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起任大成创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型前为大成创业板 50 指数型证券投资基金)基金经理。2025 年 10 月 21 日起任大成创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2026 年 2 月 12 日起任大成国证石油天然气指数型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起任大成上证科创板 50 成份指数型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国</p> |
| 李绍 | 本基金基金经理，首席指数投资官 | 2019 年 10 月 30 日 | - | 26 年 | <p>东北财经大学经济学硕士。证券、期货从业年限 26 年。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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 2015 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾任指数与期货投资部总监，现任指数与期货投资部首席指数投资官。2019 年 10 月 24 日起任大成有色金属期货交易所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所型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 10 月 21 日至 2024 年 12 月 12 日任大成绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 18 日至 2023 年 6 月 14 日任大成上海金交易所型开放式证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日至 2025 年 11 月 4 日任大成中证红利指数证券投资基金、大成中证全指医疗保健设备与服务交易所型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 3 月 20 日至 2025 年 3 月 10 日任大成中证上海环交所碳中和交易所型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 4 月 14 日至 2024 年 12 月 9 日任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理。2024 年 3 月 6 日至 2025 年 11 月 4 日任大成中证 A50 交易所型开放式指数证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 8 日至 2025 年 11 月 4 日任大成中证红利低波动 100 交易所型开放式指数证券投资基金基金经理。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

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《中华人民共和国证券投资基金法》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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

#### 4.3.2 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。公司旗下投资组合间存在证券同日反向交易，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证券当日成交量 5% 的情形。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，上期有色金属期货价格指数（IMCI）整体呈“修复—冲高一高位回落”走势。四月初，地缘冲突引发的悲观情绪逐步消退，市场对一季度滞胀预期有所修正，叠加国内经济数据延续向好、制造业景气重返扩张，宏观环境边际改善推动指数底部修复。四月下旬至五月中旬，占比超一半的铜因供应矛盾集中发酵主导指数冲高，铜价突破前期高点。五月中旬之后，交易逻辑发生切换：美国通胀数据连续超预期，联储政策周期从“暂停降息”转向“讨论加息”，市场对年内加息的定价快速升温，美元持续走强；六月中旬美联储新主席沃什首次公开表态偏鹰，利率路径的不确定性放大了资产价格波动，有色金属金融属性全面承压，指数在六月下旬加速回落。不过，供应端的结构性约束为跌幅提供了一定缓冲。报告期内，IMCI 的 6 个成份合约表现分化——铜、锡受供应约束和新兴需求共振支撑涨幅居前；铝、镍在需求疲软与美元走强的双重压力下表现不佳；锌、铅相对平淡。三季度，加息路径与供应约束的博弈将持续主导板块定价逻辑。

本基金以大成有色金属期货 ETF 作为其主要投资标的，业绩比较基准为上海期货交易所有色金属期货价格指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款税后利率 $\times 5\%$ 。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。为更好的跟踪标的指数，本基金也根据运作需要和法律文件中的比例限制等投资于指数成份商品期货合约。运作层面上，本基金在报告期内各项操作符合基金合同的要求。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成有色金属期货 ETF 联接 A 的基金份额净值为 1.1278 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.57%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；截至本报告期末大成有色金属期货 ETF 联接 C 的基金份额净值为 1.0979 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

#### 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（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | —                | —            |
|    | 其中：股票             | —                | —            |
| 2  | 基金投资              | 999,461,551.57   | 90.47        |
| 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      | 91,725,005.56    | 8.30         |
| 8  | 其他资产              | 13,540,466.40    | 1.23         |
| 9  | 合计                | 1,104,727,023.53 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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投资明细

无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 5.5 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债券投资明细

无。

5.6 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资产支持证券投资  
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序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

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

| 序号 | 基金名称                | 基金类型 | 运作方式       | 管理人                | 公允价值（元）        | 占基金资产<br>净值比例(%) |
|----|---------------------|------|------------|--------------------|----------------|------------------|
| 1  | 大成有色<br>金属期货<br>ETF | 期货型  | 交易型开<br>放式 | 大成基金<br>管理有限<br>公司 | 999,461,551.57 | 93.71            |

5.10 报告期末本基金投资的商品期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的商品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<br>（元） | 风险说明       |
|-------------------|--------|----------|--------------|---------------|------------|
| AL2609            | AL2609 | 6        | 678,000.00   | 1,350.00      | -          |
| CU2609            | CU2609 | 6        | 3,077,400.00 | 9,000.00      | -          |
| NI2609            | NI2609 | 3        | 379,110.00   | 3,720.00      | -          |
| PB2609            | PB2609 | 3        | 240,975.00   | 375.00        | -          |
| SN2609            | SN2609 | 3        | 1,169,730.00 | 6,360.00      | -          |
| ZN2609            | ZN2609 | 3        | 364,425.00   | 1,125.00      | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |              |               | 21,930.00  |
| 商品期货投资本期收益（元）     |        |          |              |               | 920,828.07 |
| 商品期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |              |               | -5,365.00  |

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。

5.10.2 本基金投资商品期货的投资政策

为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份商品期货合约、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，其目的是为了本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,136,796.66  |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | —             |
| 5  | 应收申购款   | 12,403,669.74 |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 其他      | —             |
| 8  | 合计      | 13,540,466.40 |

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 大成有色金属期货 ETF 联接 A | 大成有色金属期货 ETF 联接 C |
|----|-------------------|-------------------|
|----|-------------------|-------------------|

|                           |                |                |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 576,717,141.24 | 586,240,074.31 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 236,606,323.30 | 230,664,673.99 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 255,163,550.24 | 418,800,449.42 |
| 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               | 558,159,914.30 | 398,104,298.88 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 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

经大成基金管理有限公司 2026 年第一次临时股东会及公司九届四次监事会审议通过，同意选举郭向东先生为公司第九届监事会股东代表监事，监事会主席，任期自 2026 年 4 月 30 日之日起计算，与公司第九届监事会剩余任期一致。自郭向东先生的监事任职生效之日起，陈勇先生将不再担任公司监事、监事会主席职务。

## §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有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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。

### 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.dcfund.com.cn> 进行查

阅。

大成基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日