浦银中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：浦银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	浦银中证证券公司 30ETF 联接
基金主代码	017778
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 28 日
报告期末基金份额总额	142,538,682.22 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
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。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。 在正常市场情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金的资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、债券投资策略、股指期货交易策略、资产支持证券投资策略、转融通证券出借业务投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证证券公司 30 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，

	其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	浦银基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银中证证券公司 30ETF 联接 A	浦银中证证券公司 30ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	017778	017779
报告期末下属分级基金的份额总额	78,443,206.39 份	64,095,475.83 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	516730
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 11 月 12 日
基金管理人名称	浦银基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以紧密跟踪标的指数，获取指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下，构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中证证券公司 30 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	浦银中证证券公司 30ETF 联接 A	浦银中证证券公司 30ETF 联接 C
1.本期已实现收益	-348,494.16	-383,778.43
2.本期利润	-8,051,013.25	-8,199,259.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1044	-0.1215
4.期末基金资产净值	82,129,489.96	66,409,477.91
5.期末基金份额净值	1.0470	1.0361

注：1、上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。

2、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。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

浦银中证证券公司 30ETF 联接 A

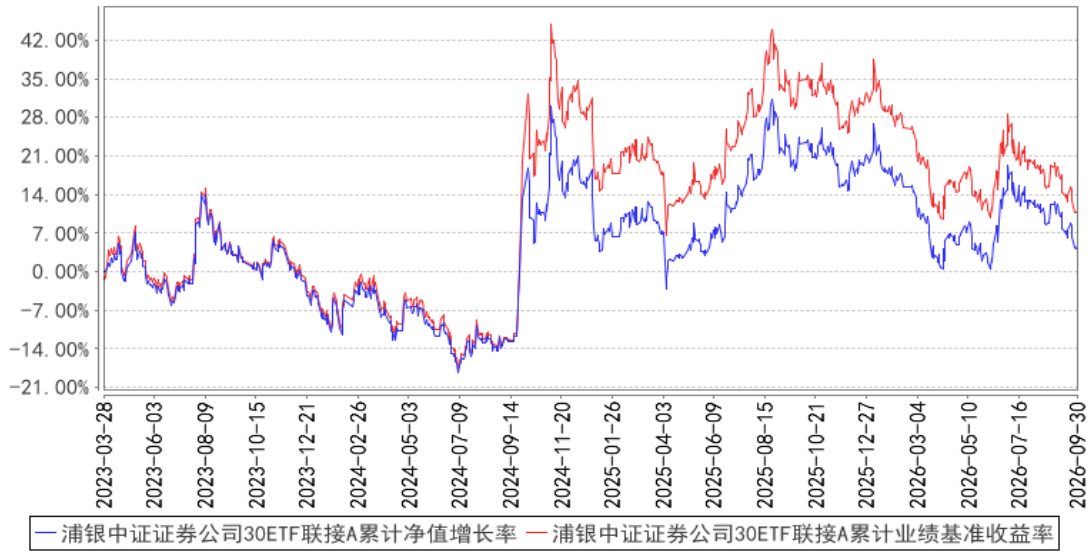
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-8.78%	1.26%	-9.71%	1.33%	0.93%	-0.07%
过去六个月	3.06%	1.47%	0.24%	1.54%	2.82%	-0.07%
过去一年	-14.93%	1.32%	-17.50%	1.36%	2.57%	-0.04%
过去三年	2.87%	1.51%	8.92%	1.62%	-6.05%	-0.11%
自基金合同生效起至今	4.70%	1.50%	11.09%	1.60%	-6.39%	-0.10%

浦银中证证券公司 30ETF 联接 C

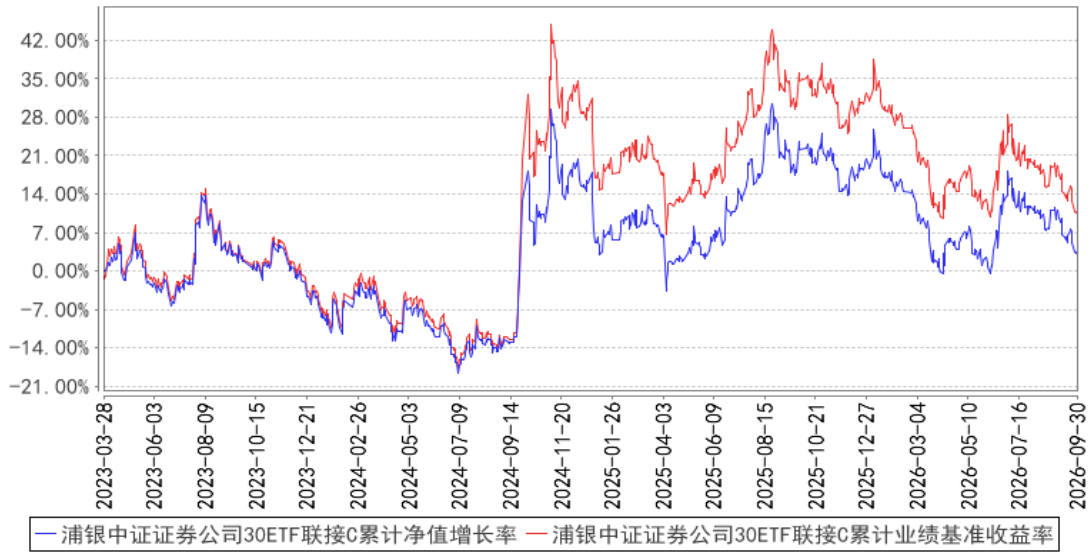
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-8.85%	1.26%	-9.71%	1.33%	0.86%	-0.07%
过去六个月	2.91%	1.47%	0.24%	1.54%	2.67%	-0.07%
过去一年	-15.19%	1.32%	-17.50%	1.36%	2.31%	-0.04%
过去三年	1.96%	1.51%	8.92%	1.62%	-6.96%	-0.11%
自基金合同生效起至今	3.61%	1.50%	11.09%	1.60%	-7.48%	-0.10%

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

浦银中证证券公司**30ETF**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



浦银中证证券公司**30ETF**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



§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		
高钢杰	公司指数与量化投资部业务主管，公司旗下部分基金基金经理。	2023 年 3 月 28 日	-	15 年	高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010 年 10 月至 2014 年 3 月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014 年 3 月至 2018 年 10 月在中国工商银行总行贵金属业务部工作，历任产品研发经理、代客交易经理。2018 年 10 月加盟本公司，参与 ETF 业务

					筹备工作。2023年6月起任指数与量化投资部业务主管兼基金经理。2019年3月至2023年1月担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年6月至2023年1月担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年3月至2023年1月担任浦银安盛中华交易服务沪深港300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月至2024年3月担任浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年4月至2024年3月担任浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年1月至2024年11月担任浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年6月至2025年2月担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年9月至2025年2月担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年9月至2026年5月担任浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年7月起担任浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月起担任浦银中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年11月起担任浦银中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起担任浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年6月起担任浦银中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起担任浦银中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内不存在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

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他投资组合参与的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的 5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期初，算力硬件、光模块等上半年表现较为突出的人工智能基建板块普遍处于拥挤度较高的位置，而内需层面依然处在弱复苏阶段，增量资金面临入市的难题。外部环境也并不友好。美伊冲突持续延宕，霍尔木兹海峡石油运输一直不通畅，甚至不时被美伊双重封锁。在此背景下，原油价格持续走高，布伦特原油价格陆续突破 90 美元/桶、100 美元/桶等重要关口，给通胀高位

的美国经济雪上加霜，进而推高市场对于美联储的加息预期。而急需资金扩张的人工智能大模型公司以及高债务的美国政府同样以高利率在全球范围内攫取流动性，确保 AI 公司的扩张以及美国政府的运转。在此背景下，A 股中前期拥挤的 AI 硬件科技股不得不面对增量资金缺失以及海外高利率压制、流动性反向虹吸的压力，高位板块出现一定的筹码松动与回撤在所难免。但从产业层面看，人工智能浪潮仍处在初期阶段，而国产算力不论在供应层面的技术突破还是需求层面的 AI 基建前景依然广阔，对此应该报以坚定的信心。从历次流动性冲击来看，往往市场都给出了很好的建仓入局的机会，这一点值得投资者跟踪关注。

展望下一季度，我们预计流动性冲击或仍将延续一段时间，毕竟美国经济数据仍表现得较为正常。这种高利率环境对于内需型经济的冲击迟早会出现，扛着高利率的 AI 头部公司也必将面临融资成本的拖累与阶段性 ARR 增速放缓的双重夹击。美债利率拐点是我们下一阶段重点应该关注的变量，而且距离拐点出现的时间应该不会太长。对于 A 股市场而言，当前及今后一段时间，我们主要关注点是挖掘并等待好的机会出现。报告期内，本基金保持对标的指数收益率的紧密跟踪，将跟踪误差控制在较低水平，较好地实现了基金的投资目标。

在投资策略方面，本基金主要通过交易所买卖或申购赎回方式投资于浦银中证证券公司 30ETF，或通过买卖中证证券公司 30 指数成份股来实现基金的投资目标。基金业绩比较基准为：中证证券公司 30 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%。本基金跟踪标的中证证券公司 30 指数是从沪深两市证券公司中选取业务排名靠前、市值规模大、营业收入高、盈利能力与成长能力相对较强的 30 只上市公司证券作为指数样本，以反映证券公司行业相关上市公司证券的整体表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银中证证券公司 30ETF 联接 A 的基金份额净值为 1.0470 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.78%，同期业绩比较基准收益率为-9.71%，截至本报告期末浦银中证证券公司 30ETF 联接 C 的基金份额净值为 1.0361 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.85%，同期业绩比较基准收益率为-9.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

3、自本报告期初至 2026 年 7 月 23 日，由本基金管理人承担本基金信息披露费、审计费等固定费用。

§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	139,908,489.63	93.49
3	固定收益投资	1,412,119.78	0.94
	其中：债券	1,412,119.78	0.94
	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	7,871,023.28	5.26
8	其他资产	451,788.87	0.30
9	合计	149,643,421.56	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,412,119.78	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,412,119.78	0.95

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	14,000	1,412,119.78	0.95

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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）	占基金资产净值比例(%)
1	浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	浦银基金管理有限公司	139,908,489.63	94.19

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,936.17
2	应收证券清算款	232,490.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	187,361.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	451,788.87

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银中证证券公司 30ETF 联接 A	浦银中证证券公司 30ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	58,223,698.84	25,891,455.28
报告期期间基金总申购份额	24,688,344.24	110,799,889.41
减:报告期期间基金总赎回份额	4,468,836.69	72,595,868.86
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	78,443,206.39	64,095,475.83

§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

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

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（%）
个人	1	20260701-20260930	46,939,760.08	18,078,661.45	0.00	65,018,421.53	45.61
产品特有风险							
基金管理人提示投资者注意：当特定的投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 9 月 29 日，汪献华先生离任公司副总经理。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 9 月 30 日在规定媒介披露的《浦银基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准本基金募集的文件

2、 浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同

3、 浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书

4、 浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程

6、 基金托管人业务资格批件和营业执照

7、 本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告

8、 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层　基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.spdbfunds.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999　或　021-33079999。

浦银基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日