# 浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金
# 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：中泰证券股份有限公司

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。

基金托管人中泰证券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

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 浦银国证粮食产业 ETF |
| 场内简称 | 粮食 ETF 浦银 |
| 基金主代码 | 159060 |
| 前端交易代码 | 159060 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2026 年 5 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 15,483,423.00 份 |
| 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 | 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。<br>本基金通过严格的投资流程和量化风险管理手段，在正常情况下，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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。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。<br>本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及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 | 国证粮食产业指数收益率 |
| 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、债券型基金和混合型基金。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。 |
| 基金管理人 | 浦银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中泰证券股份有限公司 |

# §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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -784,168.88 |
| 2.本期利润 | 8,362,962.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1577 |
| 4.期末基金资产净值 | 15,421,569.78 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9960 |

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。

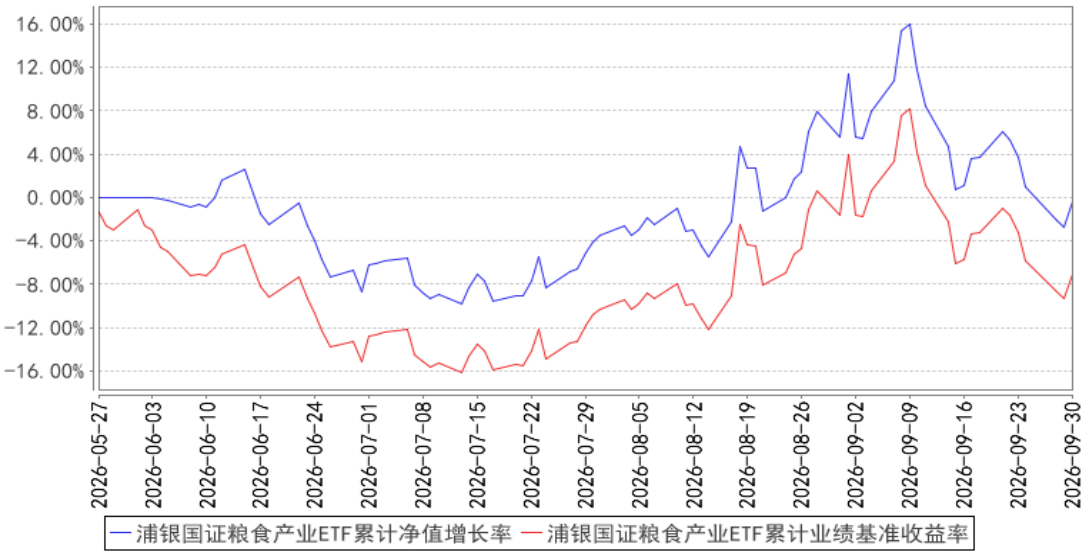
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 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 | 9.10% | 2.32% | 9.48% | 2.34% | -0.38% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.40% | 2.08% | -7.07% | 2.15% | 6.67% | -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

浦银国证粮食产业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：1、本基金合同生效日为 2026 年 5 月 27 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满 1 年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2026 年 5 月 27 日至 2026 年 11 月 26 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

# §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 | | |
| 罗雯 | 本基金的基金经理 | 2026 年 5 月 27 日 | - | 18 年 | 罗雯女士，浙江大学理学院数学系金融数学硕士。2007 年 10 月加盟本公司任金融工程分析师。2011 年 7 月至 2018 年 1 月，担任公司旗下指数基金基金经理助理，现任指数及量化投资部基金经理。2018 年 1 月至 2022 年 12 月担任浦银港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月至 2022 年 12 月担任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月至 2022 年 12 月担任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2022 年 11 月至 2026 年 1 月担任浦银量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 担任浦银中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起担任浦银沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月起担任浦银中证 A50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月起担任浦银上证科创板 100 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银港股通央企红利混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起担任浦银国证港股通科技指数型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月起担任浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起担任浦银中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |

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

国证粮食产业指数在三季度上涨了 9.48%，表现比较亮眼。受益于科技股调整释放的流动性，和厄尔尼诺事件的发酵，粮食行业在近期受到了较高的关注度。国家气候中心监测显示，2026 年 9 月已正式形成一次超强厄尔尼诺事件，当前处于强厄尔尼诺状态，年底前将继续增强，有望成为有系统性监测以来最强厄尔尼诺。从主要粮食作物价格走势来看，近期国内大豆、棕榈油、顺丁橡胶价格有所上涨，价格或受到减产预期明显冲击。

国证粮食产业指数行业配置围绕粮食产业链上游种植、农资投入和农产品加工展开，产业链属性鲜明，对粮食价格、农资成本和农业政策变化较为敏感。进入“十五五”，农粮政策重心由“守住供给底线”转向“抬升产能上限”，产业战略地位持续强化，板块配置逻辑逐步向“安全+成长”双轮驱动演进。当前全球粮食供需紧平衡格局加剧，主产区生产受气候、地缘扰动波动放大，饲用消费刚性扩张推动库存消费比下行，全球粮价中枢具备上行动力。

报告期内，我们保持了对国证粮食指数的紧密跟踪，争取为投资者获取国证粮食产业指数的长期投资价值。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银国证粮食产业 ETF 基金份额净值为 0.9960 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.10%；同期业绩比较基准收益率为 9.48%。

## 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、本基金自 2026 年 8 月 21 日至 2026 年 9 月 30 日存在连续二十个工作日基金资产净值低于

五千万的情形。

# §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 | 15,348,739.40 | 98.78 |
| | 其中：股票 | 15,348,739.40 | 98.78 |
| 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 | 156,250.55 | 1.01 |
| 8 | 其他资产 | 33,761.78 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 15,538,751.73 | 100.00 |

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 7,019,688.40 | 45.52 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 7,497,736.00 | 48.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 614,449.00 | 3.98 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 216,866.00 | 1.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 15,348,739.40 | 99.53 |

### 5.2.2 报告期末积极投资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积极投资境内股票。

### 5.2.3 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 报告期末指数投资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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000998 | 隆平高科 | 152,800 | 1,323,248.00 | 8.58 |
| 2 | 600598 | 北大荒 | 89,900 | 1,135,437.00 | 7.36 |
| 3 | 002215 | 诺 普 信 | 92,100 | 857,451.00 | 5.56 |
| 4 | 600108 | 亚盛集团 | 196,500 | 780,105.00 | 5.06 |
| 5 | 300189 | 神农种业 | 116,900 | 701,400.00 | 4.55 |
| 6 | 600313 | 农发种业 | 91,300 | 614,449.00 | 3.98 |
| 7 | 601952 | 苏垦农发 | 62,500 | 560,625.00 | 3.64 |
| 8 | 002041 | 登海种业 | 48,600 | 497,178.00 | 3.22 |
| 9 | 600354 | 敦煌种业 | 52,200 | 482,328.00 | 3.13 |
| 10 | 600096 | 云天化 | 16,300 | 454,118.00 | 2.94 |

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 33,761.78 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 33,761.78 |

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
| --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 105,483,423.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 90,000,000.00 |
| 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 | 15,483,423.00 |

## §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（%） |
| 机构 | 1 | 20260907-20260929 | 3,649,672.00 | 32,030,075.00 | 32,748,955.00 | 2,930,792.00 | 18.93 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 基金管理人提示投资者注意：当特定的机构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、 浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、 浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

4、 浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议

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**