国泰中证新材料主题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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰中证新材料主题 ETF
场内简称	新材料 ETF 国泰
基金主代码	159761
交易代码	159761
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	195,734,117.00 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的最小化。
投资策略	1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股

	权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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。 指数基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证新材料主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证新材料主题指数，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。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司

§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	4,054,725.04
2.本期利润	-58,682,049.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2930
4.期末基金资产净值	144,283,462.08
5.期末基金份额净值	0.7371

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本报告期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	-27.71%	2.35%	-28.49%	2.35%	0.78%	0.00%
过去六个月	-0.47%	2.24%	-2.30%	2.25%	1.83%	-0.01%
过去一年	4.10%	2.00%	1.26%	2.01%	2.84%	-0.01%
过去三年	30.71%	1.85%	18.82%	1.86%	11.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-26.29%	1.76%	-38.24%	1.77%	11.95%	-0.01%

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

国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021 年 11 月 24 日至 2026 年 9 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为2021年11月24日，本基金在6个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
王玉	国泰上证 5 年期国债 ETF、上证 10 年期国债 ETF、国泰信用互利债券、国泰中债 1-3 年国开	2021-11-24	-	10 年	硕士研究生。曾任职于光大银行上海分行。2016 年 1 月加入国泰基金，历任交易员、基金经理助理。2019 年 12 月起任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）的基金经理，2020 年 3 月至 2024

	债、国泰中证细分化工产业主题ETF、国泰中证环保产业50ETF、国泰中证光伏产业ETF发起联接、国泰中证影视主题ETF、国泰中证新材料主题ETF、国泰上证科创板100ETF、国泰中证AAA科技创新公司债ETF、国泰农盈债券的基金经理				年8月任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，2020年4月至2021年7月任国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理，2020年6月至2021年7月任国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020年8月至2021年8月任国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金和国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2020年8月起兼任国泰中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理，2021年3月起兼任国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证环保产业50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年6月至2023年5月任国泰中证环保产业50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021年10月起兼任国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021年11月起兼任国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年12月至2023年5月任国泰中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022

					年 2 月至 2023 年 5 月任国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2026 年 7 月起兼任国泰农盈债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 9 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。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年三季度 A 股整体回调，成长股领跌，科技板块受到估值与交易拥挤度的影响调整幅度较大，周期板块内部分化，受能源价格抬升和盈利改善支撑，煤炭和石油石化表现亮眼。中证新材料主题指数下跌超 28%，弱于沪深 300 等宽基指数，回吐上半年全部涨幅。三季度的回调主要是上半年 AI 与材料行情的高估值回吐，跌幅主要来源在电子和电力设备板块。

中证新材料主体指数既包含半导体材料，锂电材料，光伏材料也覆盖化工新材料以及军工材料等方向。

作为跟踪标的指数的被动型基金，本基金紧密跟踪标的指数，在追求跟踪偏离度和跟踪误差的同时，也会精细化操作以更好的跟踪市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为-27.71%，同期业绩比较基准收益率为-28.49%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，海外利率高企，国内基本面延续弱复苏态势，可能会对市场修复高度有所制约。但是国内政策预计会对基本面修复更加积极，中期来看，AI 产业链的发展对于国内算力建设和半导体自主可控等需求有持续的拉动作用，随着估值和筹码压力的逐步释放，四季度伴随产业内部不断催化，对于增长明确以及盈利明显改善的板块的表现有所期待。

新材料广泛应用于制造业的诸多细分领域，既包括半导体、新能源汽车、光伏等高新技术产业，也包括钢铁、化工等传统产业，很多领域具有国产替代、自主可控的核心竞争力。在中国制造业转型升级以及碳中和政策的背景下，新材料领域具有长期的配置价值。

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	143,058,776.06	98.99
	其中：股票	143,058,776.06	98.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	1,348,567.86	0.93
7	其他各项资产	106,936.97	0.07
8	合计	144,514,280.89	100.00

注：上述股票投资包括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积极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	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	207,432.39	0.14
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	-	-
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	-	-
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	207,432.39	0.14

5.2.2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	-	-
B	采矿业	716,618.00	0.50
C	制造业	142,134,725.67	98.51
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	-	-
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	-	-
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	142,851,343.67	99.01

5.3报告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 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	002371	北方华创	26,905	16,572,672.85	11.49
2	300750	宁德时代	40,200	11,702,622.00	8.11
3	300408	三环集团	95,725	11,231,414.25	7.78
4	600309	万华化学	134,000	9,232,600.00	6.40
5	600176	中国巨石	171,400	6,754,874.00	4.68
6	601012	隆基绿能	432,500	4,848,325.00	3.36
7	603799	华友钴业	108,330	3,791,550.00	2.63
8	300054	鼎龙股份	54,400	3,669,280.00	2.54
9	600989	宝丰能源	156,900	3,523,974.00	2.44
10	300666	江丰电子	15,200	3,386,256.00	2.35

5.3.2 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前五名股票投资明细

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	688781	视涯科技	1,403	51,700.55	0.04
2	301660	粤芯半导体	3,441	41,326.41	0.03
3	301569	联亚药业	4,093	28,651.00	0.02
4	688828	国仪公司	400	23,460.00	0.02
5	001246	力勤资源	249	12,472.41	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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未发现有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,110.84

2	应收证券清算款	48,826.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	106,936.97

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688781	视涯科技	51,700.55	0.04	新股锁定
2	301660	粤芯半导体	41,326.41	0.03	网下中签
3	301569	联亚药业	28,651.00	0.02	网下中签
4	688828	国仪公司	23,460.00	0.02	新股锁定
5	001246	力勤资源	12,472.41	0.01	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	211,734,117.00
报告期期间基金总申购份额	48,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	64,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	195,734,117.00

§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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的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

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、关于准予国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

2、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所或办公场所。

9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日