国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	国泰创业板指数（LOF）
场内简称	创业板 LOF
基金主代码	160223
交易代码	160223
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日
报告期末基金份额总额	113,713,978.40 份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、固定收益类投资工具投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、权证投资策略。

业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，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。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰创业板指数（LOF）A	国泰创业板指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	160223	015600
报告期末下属分级基金的份额总额	91,685,932.32 份	22,028,046.08 份

§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)	
	国泰创业板指数（LOF）A	国泰创业板指数（LOF）C
1.本期已实现收益	8,428,040.17	1,815,741.75
2.本期利润	-55,776,806.79	-10,439,990.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6209	-0.5304
4.期末基金资产净值	161,705,914.01	38,543,757.81
5.期末基金份额净值	1.7637	1.7498

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

1、国泰创业板指数（LOF）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	-26.27%	2.59%	-26.53%	2.61%	0.26%	-0.02%
过去六个月	-0.23%	2.42%	-1.28%	2.43%	1.05%	-0.01%
过去一年	-1.69%	2.06%	-2.74%	2.07%	1.05%	-0.01%
过去三年	62.61%	1.98%	54.28%	2.04%	8.33%	-0.06%
过去五年	9.43%	1.76%	-2.12%	1.81%	11.55%	-0.05%
过去七年	126.00%	1.75%	89.35%	1.80%	36.65%	-0.05%
自基金合同生效起至今	76.37%	1.67%	46.43%	1.70%	29.94%	-0.03%

2、国泰创业板指数（LOF）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	-26.30%	2.59%	-26.53%	2.61%	0.23%	-0.02%
过去六个月	-0.33%	2.42%	-1.28%	2.43%	0.95%	-0.01%
过去一年	-1.88%	2.06%	-2.74%	2.07%	0.86%	-0.01%
过去三年	61.63%	1.98%	54.28%	2.04%	7.35%	-0.06%
自新增 C 类份额起至今	42.29%	1.78%	29.30%	1.83%	12.99%	-0.05%

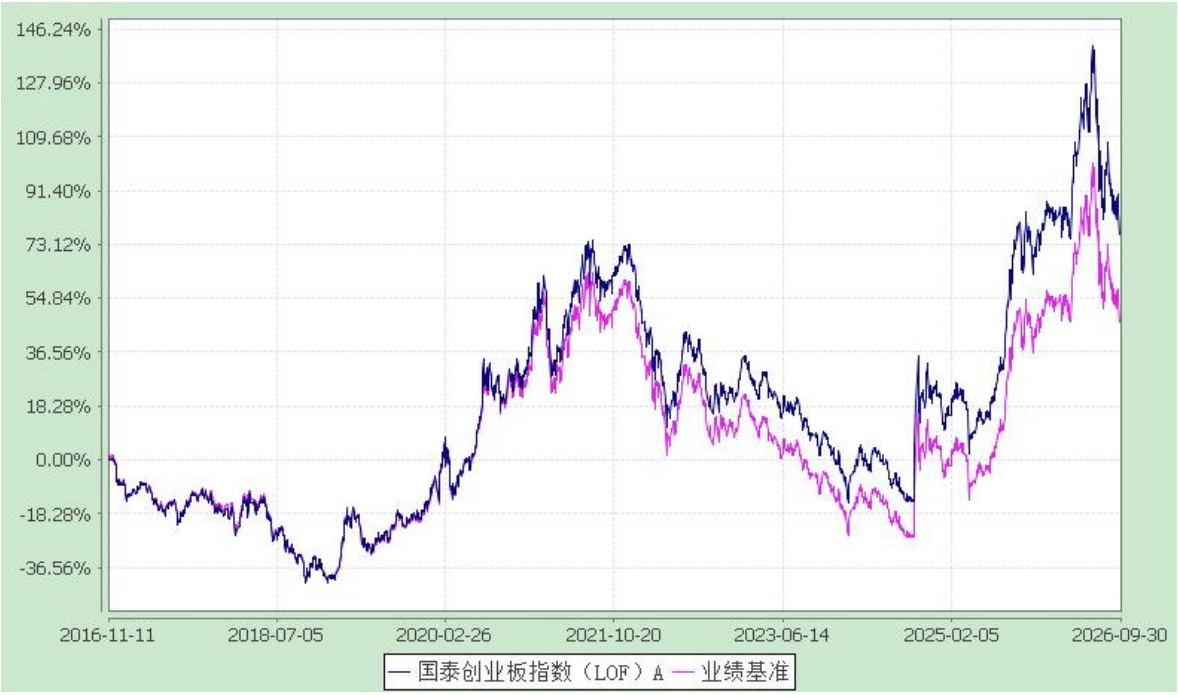
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰创业板指数证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

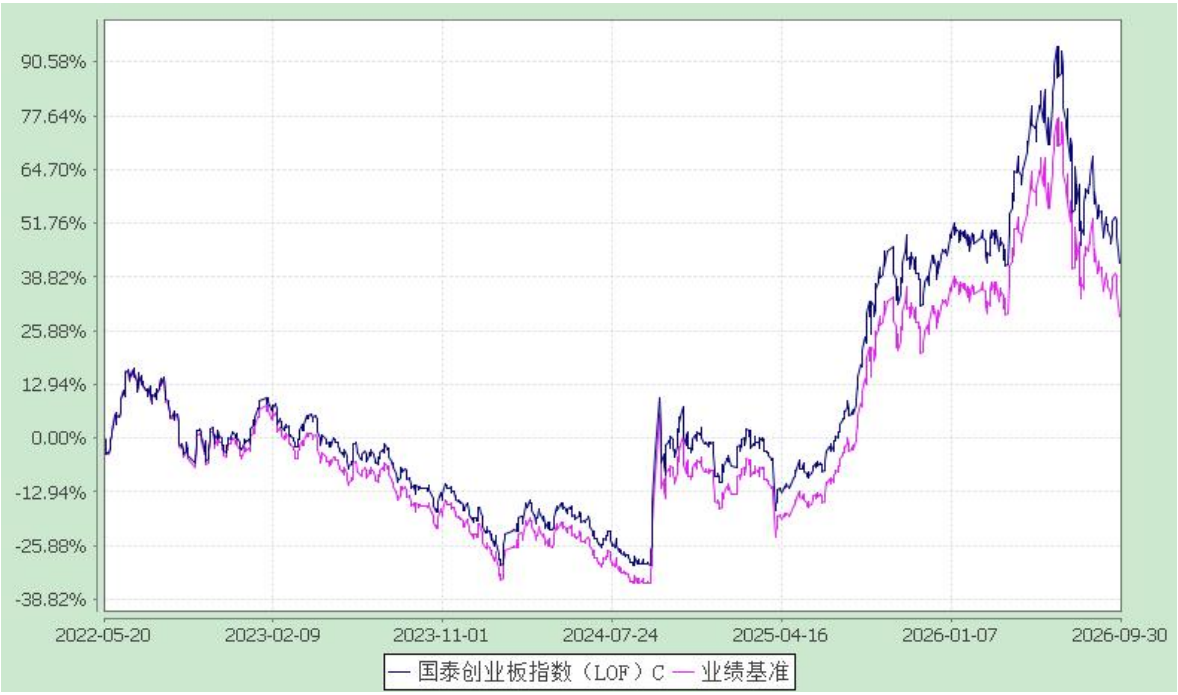
(2016 年 11 月 11 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．国泰创业板指数（LOF）A：



注：本基金的合同生效日为 2016 年 11 月 11 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。

2．国泰创业板指数（LOF）C：



注：（1）本基金的合同生效日为 2016 年 11 月 11 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。

（2）自 2022 年 5 月 20 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

§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		
吴中昊	国泰中证500指数增强、国泰中证内地运输主题ETF、国泰沪深300指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合ETF、国泰	2023-06-14	-	11 年	硕士研究生。曾任职于Arrowstreet Capital(美国)。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深300指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投

	沪深300指数、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深300增强策略ETF、国泰中证1000增强策略ETF、国泰中证钢铁ETF、国泰中证煤炭ETF、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证香港内地国有企业ETF（QDII）、国泰中证机				资基金（QDII）的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 11 月起兼任国泰北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金和国泰恒生A股电网设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

	器人 ETF、国泰北证 50 成份指数发起、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰恒生 A 股电网设备 ETF 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 股整体回落，前期领涨板块的调整幅度较大。上证指数季度跌幅为 6.16%，创业板指，科创综指分别下跌 27.80%和 27.98%。行业走势分化明显，但与上半年反转。中信银行指数，中信医药指数 分别上涨 16.82%，10.14%，而上半年的热点通信设备指数下跌 30.44%，中华半导体芯片指数下跌 36.55% 。与二季度相比，资金对高成长板块持续降温，估值、股息收益重新受到重视，小微盘股票也出现一定程度的回升。大盘，中盘，小盘的代表性指数沪深 300，中证 500 和中证 1000 涨跌幅分别为-12.49%，-17.67%，-17.15% 。

国内经济方面，外需与内需的差异仍然较为明显。出口对经济增长的贡献较强，但居民消费和房地产需求偏弱，使经济恢复缺乏更广泛的需求基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-26.27%，同期业绩比较基准收益率为-26.53%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-26.30%，同期业绩比较基准收益率为-26.53%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度市场风格已发生明显切换，预计四季度仍将延续这一趋势。内需不足已成为市场共识，但需求端仍缺乏足以扭转预期的政策支持。与此同时，支撑经济增长的AI基建和出口后续也面临一定挑战。海外AI基建投资已显露放缓迹象，同时随着占比的增加，出口在未来可能也面临更多外部阻力。经济能否迎来更广泛、可持续的复苏，很大程度上取决于政策能否在适当的时间离开阻力最小的政策路径，将支持力度更多转向需求端，并切实改善居民和企业的支出意愿。

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	188,879,366.87	92.81
	其中：股票	188,879,366.87	92.81
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	13,805,574.48	6.78
7	其他各项资产	816,480.79	0.40
8	合计	203,501,422.14	100.00

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	370,388.10	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,453.48	0.03
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	437,841.58	0.22

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	2,931,616.80	1.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	155,655,243.36	77.73
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	2,235,113.62	1.12
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	9,848,555.40	4.92
J	金融业	10,895,093.23	5.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,551,198.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	3,239,852.45	1.62
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	1,241,041.62	0.62
R	文化、体育和娱乐业	843,810.81	0.42
S	综合	-	-
	合计	188,441,525.29	94.10

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 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	300750	宁德时代	91,244	26,562,040.84	13.26
2	300308	中际旭创	29,861	24,140,826.84	12.06
3	300502	新易盛	43,092	16,762,788.00	8.37

4	300059	东方财富	448,693	7,982,248.47	3.99
5	300394	天孚通信	21,358	5,569,525.66	2.78
6	300408	三环集团	43,252	5,074,757.16	2.53
7	300476	胜宏科技	20,900	4,395,270.00	2.19
8	300274	阳光电源	51,521	4,249,967.29	2.12
9	300604	长川科技	15,500	3,716,745.00	1.86
10	300124	汇川技术	70,063	3,636,269.70	1.82

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	301666	大普微	288	95,368.32	0.05
2	001248	华润新能源	7,222	67,453.48	0.03
3	301660	粤芯半导体	4,727	56,771.27	0.03
4	301569	联亚药业	5,712	39,984.00	0.02
5	001399	惠科股份	1,174	22,904.74	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名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	45,793.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	770,687.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	816,480.79

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 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	占基金资产	流通受限

			的公允价值（元）	净值比例(%)	情况说明
1	301666	大普微	95,368.32	0.05	新股锁定
2	001248	华润新能源	67,453.48	0.03	新股锁定
3	301660	粤芯半导体	56,771.27	0.03	网下中签
4	301569	联亚药业	39,984.00	0.02	网下中签
5	001399	惠科股份	22,904.74	0.01	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰创业板指数（LOF）A	国泰创业板指数（LOF）C
本报告期期初基金份额总额	90,444,997.41	16,674,610.69
报告期期间基金总申购份额	17,427,920.32	36,512,886.15
减：报告期期间基金总赎回份额	16,186,985.41	31,159,450.76
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	91,685,932.32	22,028,046.08

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	80,547.72
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	80,547.72
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.07

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、关于准予国泰创业板指数证券投资基金（LOF）注册的批复

2、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）基金合同

3、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）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