国泰中证2000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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 国泰
基金主代码	561370
交易代码	561370
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 13 日
报告期末基金份额总额	34,356,000.00 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、基金规模不足等）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，基金管理人可以采取替代性策略等方式对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本等因素，可以采用抽样复制的策略。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；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 2000 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，跟踪标的指数，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	中信建投证券股份有限公司

§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	71,760.96
2.本期利润	-1,172,009.02

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0393
4.期末基金资产净值	48,579,772.98
5.期末基金份额净值	1.4140

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

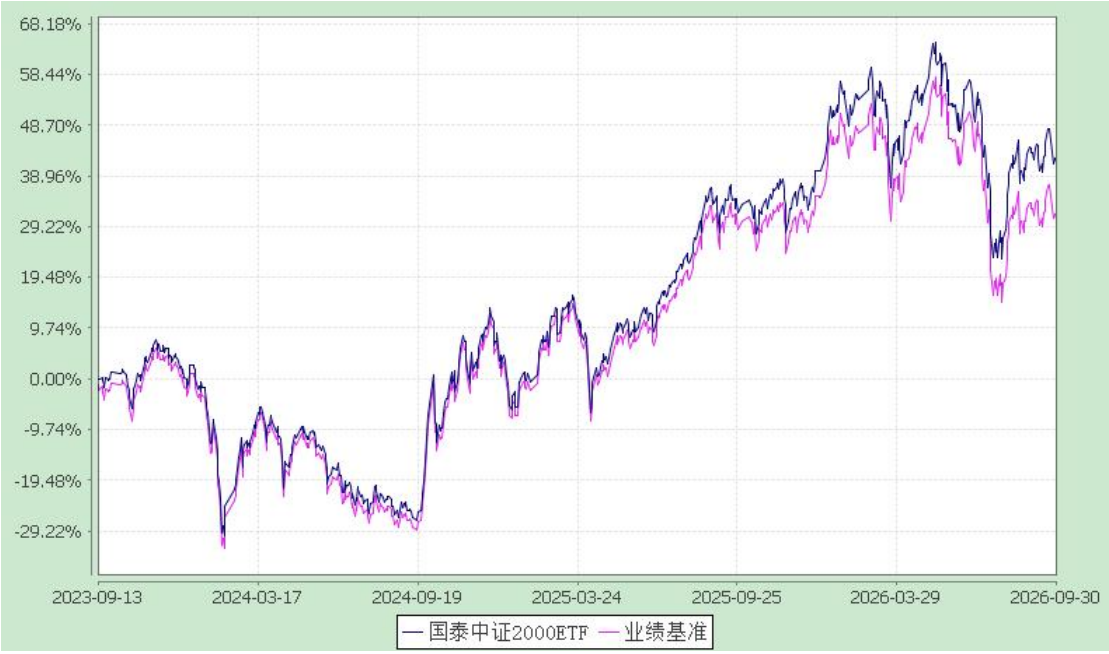
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.34%	2.09%	-11.08%	2.12%	3.74%	-0.03%
过去六个月	-1.74%	1.86%	-4.16%	1.90%	2.42%	-0.04%
过去一年	5.98%	1.68%	0.45%	1.71%	5.53%	-0.03%
过去三年	39.60%	1.88%	31.99%	1.94%	7.61%	-0.06%
自基金合同生效起至今	41.40%	1.87%	30.79%	1.93%	10.61%	-0.06%

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 2000 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

（2023 年 9 月 13 日至 2026 年 9 月 30 日）



注：本基金的合同生效日为2023年9月13日，本基金在六个月建仓期结束时，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		
麻绎文	国泰中证有色金属 ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰中证 2000ETF、国泰中证全指集成	2023-09-13	-	6 年	硕士研究生。2020 年 6 月加入国泰基金，历任助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理。2023 年 8 月起兼任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 10 月起兼任国泰中证全指集成电路交易型开

	电路ETF、国泰上证科创板100ETF发起联接、国泰中证沪深港黄金产业股票ETF、国泰上证国有企业红利ETF、国泰中证港股通高股息投资ETF、国泰沪深300增强策略ETF发起联接、国泰创业板50ETF、国泰富时中国A股自由现金流聚焦ETF、国泰上证科创板综合ETF、国泰创业板人工智能ETF、国				放式指数证券投资基金的基金经理，2023年11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发起式联接基金的基金经理，2024年4月起兼任国泰中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024年7月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024年9月起兼任国泰沪深300增强策略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，2024年12月起兼任国泰创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年2月起兼任国泰富时中国A股自由现金流聚焦交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年3月起兼任国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年4月起兼任国泰创业板医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年5月起兼任国泰创业板新能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年7月起兼任国泰上证科创板创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025年9月起兼任国泰上证科创

	泰上证科创板芯片 ETF、国泰创业板医药卫生 ETF、国泰创业板新能源 ETF、国泰上证科创板创新药 ETF、国泰上证科创板人工智能 ETF 的基金经理				板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
刘昉元	国泰中证 2000ETF、国泰上证科创板综合 ETF、国泰中证 A500 增强策略 ETF、国泰上证科创板芯片 ETF 发起联接、国泰中证港股通汽车产	2025-04-11	-	6 年	硕士研究生。曾任职于浙商基金管理有限公司。2022 年 7 月加入国泰基金，历任量化研究员、基金经理助理。2025 年 4 月起任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板医药卫生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，2025

	业主题ETF、国泰创业板医药卫生ETF发起联接、国泰创业板人工智能ETF发起联接的基金经理				年10月起兼任国泰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 股市场整体呈现"先急跌、后震荡筑底"的调整格局，主要指数全线收跌，量能较上半年明显收缩。7 月热门科技赛道在极致抱团后剧烈回调，后续市场震荡筑底并迎来一定结构性修复，9 月又受海外利空冲击转为缩量阴跌。风格上呈现显著再平衡，资金从高位成长转向防御与红利，前期强势赛道领跌。整体来看，三季度是市场消化前期涨幅、完成风格切换的关键调整期。中证 2000 指数受 7 月初大跌影响，虽后续有所反弹，但最终单季度仍录得跌幅 11.08%。

中证 2000 指数选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本，聚焦小盘及微盘股票的整体表现。2026 年三季度，尽管受市场影响绝对收益为负，但由于抱团行情瓦解，大盘风格受到的冲击更大，小微盘风格跑出了一定正超额。从产业趋势、宏观及流动性环境、资本市场建设方向等因素看，小微盘风格仍有望进一步演绎。

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好小微盘股表现的投资者提供投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

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-7.34%，同期业绩比较基准收益率为-11.08%。

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，随着宏观政策逐步落地，提振内需趋势进一步强化，市场风险偏好有望维持在较高位置，为中小盘股票提供流动性支撑。经过三季度回调后，小微盘风格估值有所回落，但短期波动仍维持高位。随着资金面逐步从增量市向存量市转变，指数层面出现系统性估值提升的概率相对不大，缺乏基本面支撑的个股可能面临较大调整压力。

综合来看，小微盘股在新技术爆发时往往能占优，目前全球AI产业如火如荼，国内大力推动新质生产力、专精特新、高端制造等新兴产业，有助于推动小微盘风格表现。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会上海监管局报告本基金的解决方案。

§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	47,989,663.63	98.24
	其中：股票	47,989,663.63	98.24
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	508,495.43	1.04
7	其他各项资产	351,419.13	0.72
8	合计	48,849,578.19	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	358,557.00	0.74
B	采矿业	596,702.00	1.23
C	制造业	35,581,294.00	73.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,187,377.00	2.44
E	建筑业	801,050.00	1.65
F	批发和零售业	1,596,437.02	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	551,429.00	1.14
H	住宿和餐饮业	71,394.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,781,196.03	7.78
J	金融业	29,920.00	0.06
K	房地产业	638,739.00	1.31
L	租赁和商务服务业	795,005.18	1.64
M	科学研究和技术服务业	903,534.00	1.86
N	水利、环境和公共设施管理业	554,519.00	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	225,308.40	0.46
Q	卫生和社会工作	127,665.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	128,884.00	0.27
S	综合	60,653.00	0.12
	合计	47,989,663.63	98.79

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	300903	科翔股份	2,200	203,038.00	0.42
2	300489	光智科技	700	194,845.00	0.40

3	603186	华正新材	800	170,128.00	0.35
4	603629	利通电子	1,520	145,859.20	0.30
5	002491	通鼎互联	6,200	124,248.00	0.26
6	688143	长盈通	697	121,744.99	0.25
7	603061	金海通	390	121,574.70	0.25
8	688257	新锐股份	2,223	119,108.34	0.25
9	300201	海伦哲	9,100	115,752.00	0.24
10	301080	百普赛斯	820	115,677.40	0.24

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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中，江苏利通电子股份有限公司、苏州新锐合金工具股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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	21,681.35
2	应收证券清算款	329,737.78
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	351,419.13

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§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	22,356,000.00
报告期期间基金总申购份额	12,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	34,356,000.00

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	16,245,500.00
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	16,245,500.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	47.29

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

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	2026年07月01日至2026年09月30日	16,245,500.00	-	-	16,245,500.00	47.29%

产品特有风险
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、关于准予国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

2、国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、国泰中证 2000 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