

# 国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## § 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰中证新能源汽车 ETF
场内简称	新能源车 ETF
基金主代码	159806
交易代码	159806
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 10 日
报告期末基金份额总额	2,926,089,446.00 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；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率

风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，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。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证新能源汽车指数，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。</p>
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

### § 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
	(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-79,985,528.39
2. 本期利润	-312,168,027.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1056
4. 期末基金资产净值	1,629,834,301.43
5. 期末基金份额净值	0.5570

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

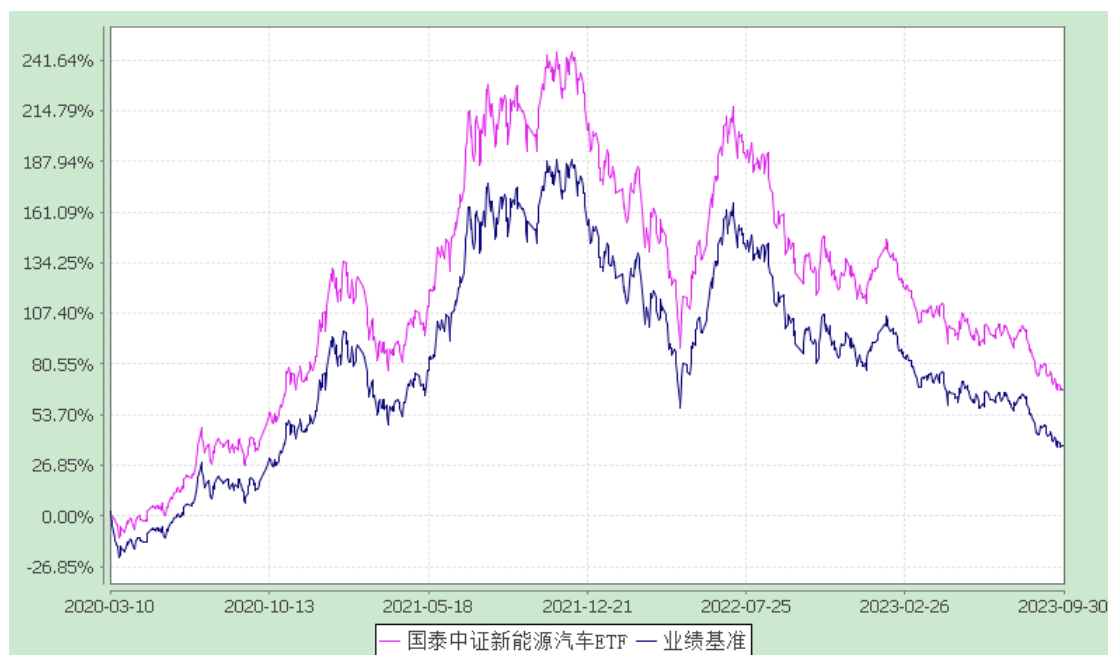
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差		
				④		
过去三个月	-15.92%	1.17%	-16.20%	1.17%	0.28%	0.00%
过去六个月	-20.55%	1.43%	-21.75%	1.43%	1.20%	0.00%
过去一年	-26.95%	1.53%	-28.34%	1.54%	1.39%	-0.01%
过去三年	19.76%	2.18%	16.27%	2.21%	3.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	67.10%	2.17%	36.95%	2.22%	30.15%	-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

国泰中证新能源汽车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

(2020 年 3 月 10 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：本基金的合同生效日为2020年3月10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		
黄岳	国泰中证生物医药ETF、国泰中证医疗ETF、国泰中证全指建筑材料ETF、国泰中证科创创业50ETF、国泰中证全指建筑材料ETF发起联接、国泰中证500ETF、国泰中证科创创业50ETF发起联接、国泰中证智能汽车主题ETF、国泰中证500ETF发起联接、国	2023-05-23	-	8年	硕士研究生。曾任职于北京中科江南信息技术股份有限公司等。2015年2月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2021年2月起任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年2月至2023年9月任国泰中证生物医药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6月起兼任国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年8月起兼任国泰中证全指建筑材料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500交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证科创创业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，2021年9月起兼任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年10月起兼任国泰中证500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月起兼任国泰中证消费电子主题交易型开放式指数

	<p>泰中证消费电子主题ETF、国泰中证消费电子主题ETF发起联接、国泰中证沪港深动漫游戏ETF、国泰中证动漫游戏ETF、国泰中证港股通50ETF、国泰富时中国国企开放共赢ETF、国泰中证港股通50ETF发起联接、国泰中证新能源汽车ETF、国泰中证800汽车与零部件ETF、国泰中证光伏产业ETF</p>				<p>证券投资基金的基金经理，2022年2月起兼任国泰中证消费电子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，2022年3月起兼任国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023年4月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理，2023年5月起兼任国泰中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证800汽车与零部件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的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

	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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《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，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

三季度利好政策频出，7月政治局会议在地产、平台经济的表述上更加积极。8月一系列利好政策出台，金融方面印花税减半征收，减持和再融资门槛提升；地产方面一线城市实

施认房不认贷，二线城市加速松绑限购，存量房贷利率下调；产业方面，民营经济发展局成立，数字经济等产业政策纷纷出台。

中美关系方面有所改善，部长级会议重启，美国国务卿、财政部长、美国总统气候问题特使、商务部长先后访华。

但三季度美债收益率大幅上行，美元走强，非美货币纷纷承压。人民币汇率压力较大，8 月以来北向资金大幅净流出。

A 股三季度市场整体承压，对政策面利好反应平淡，成交额显著缩量。上证指数一度跌破 3100 点大关，创业板指创出 2021 年以来新低。

作为行业指数基金，本基金旨在为看好新能源车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-15.92%，同期业绩比较基准收益率为-16.20%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新能源车 ETF 跟踪中证新能源汽车指数，覆盖锂电池、充电桩、新能源整车等等新能源汽车上中下游全产业链。

全球汽车产业在近十年经历了从无到有的电动化浪潮，新能源汽车渗透率快速提升，汽车电动化趋势已经势不可挡。我国的新能源汽车产业幸运的抓住了产业升级的机遇，在政策的大力支持下，现已初步具备全球竞争力，极大缩小了汽车产业与老牌汽车强国的差距，全球市场份额不断扩大。后续来看，新能源汽车购置税减免得以延续，国内新能源车渗透率有望进一步提升。从 2021 年以来，新能源汽车板块经历了较大幅度的调整，估值水平更加合理，配置价值凸显。

#### 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	1,623,096,663.28	99.46
	其中：股票	1,623,096,663.28	99.46
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	7,887,265.63	0.48
7	其他各项资产	935,010.93	0.06
8	合计	1,631,918,939.84	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为122,370,101.00元，占基金资产净值比例为7.51%。

## 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	3,518,662.63	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00

E	建筑业	11,369.83	0.00
F	批发和零售业	302,577.74	0.02
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	85,571.74	0.01
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	14,669.76	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,659.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,185.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,007,261.02	0.25

### 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	26,140,231.95	1.60
C	制造业	1,566,620,091.45	96.12
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	26,329,078.86	1.62
	合计	1,619,089,402.26	99.34

### 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	300750	宁德时代	874,716	177,593,589.48	10.90
2	002594	比亚迪	747,085	176,835,019.50	10.85
3	300124	汇川技术	2,279,171	151,542,079.79	9.30
4	002050	三花智控	2,633,149	78,204,525.30	4.80
5	002466	天齐锂业	1,259,618	69,190,816.74	4.25
6	300014	亿纬锂能	1,497,576	67,570,629.12	4.15
7	002460	赣锋锂业	1,385,094	61,775,192.40	3.79
8	603799	华友钴业	1,558,749	58,468,674.99	3.59
9	002812	恩捷股份	651,376	39,017,422.40	2.39
10	002709	天赐材料	1,413,981	38,219,906.43	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	688347	华虹公司	50,886	2,232,877.68	0.14
2	301558	三态股份	14,578	270,771.02	0.02
3	688719	爱科赛博	1,939	126,707.61	0.01
4	688249	晶合集成	7,405	122,700.85	0.01
5	688472	阿特斯	6,261	85,149.60	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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“亿纬锂能、赣锋锂业”违规外）没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。

亿纬锂能公司本身因 2022 年 11 月以来，与关联方曲靖市德枋亿纬有限公司、常州市贝特瑞新材料有限公司发生多笔关联交易，交易金额合计 23.1 亿元，但未按规定及时履行关联交易审议程序和信息披露义务，直至 2023 年 4 月 17 日、5 月 18 日才分别召开董事会和股东大会补充审议和披露相关关联交易等原因，受到深交所、当地证监局出具监管函、警示函等处罚。

赣锋锂业因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易；对外投资中未及时履行信息披露义务；对外收购事项收购完成后未及时披露有关交付或者过户事宜等问题，受到深交所监管关注、江西证监局罚款、没收违法所得等处罚。

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规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	288,150.79
2	应收证券清算款	523,734.18
3	应收股利	29,683.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	93,442.96
9	合计	935,010.93

### 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

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	002050	三花智控	11,894,850.00	0.73	转融通证券出借业务的股票

2	603799	华友钴业	11,695,618.00	0.72	转融通证券出借业务的股票
3	300124	汇川技术	10,784,678.00	0.66	转融通证券出借业务的股票
4	002812	恩捷股份	7,930,760.00	0.49	转融通证券出借业务的股票
5	002594	比亚迪	5,207,400.00	0.32	转融通证券出借业务的股票
6	002709	天赐材料	5,097,858.00	0.31	转融通证券出借业务的股票
7	002466	天齐锂业	3,109,038.00	0.19	转融通证券出借业务的股票
8	002460	赣锋锂业	2,863,320.00	0.18	转融通证券出借业务的股票
9	300014	亿纬锂能	1,502,496.00	0.09	转融通证券出借业务的股票

#### 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	688347	华虹公司	2,232,877.68	0.14	新股锁定
2	688249	晶合集成	122,700.85	0.01	新股锁定
3	688472	阿特斯	85,149.60	0.01	新股锁定
4	301558	三态股份	22,147.02	0.00	新股锁定
5	688719	爱科赛博	12,287.96	0.00	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	2,865,089,446.00
报告期期间基金总申购份额	637,000,000.00

减：报告期期间基金总赎回份额	576,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,926,089,446.00

## § 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

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
国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2023年07月01日至2023年09月30日	1,208,697,599.00	-	60,000,000.00	1,148,697,599.00	39.26%
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、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 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 16 层-19 层。

基金托管人住所。

## 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  
二〇二三年十月二十五日