

# 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

## 2025 年第 3 季度报告

2025 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：二〇二五年十月二十八日

§ 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 2025 年 10 月 24 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 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                     |
|------------|-----------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰中证全指证券公司 ETF                                      |
| 场内简称       | 证券 ETF                                              |
| 基金主代码      | 512880                                              |
| 交易代码       | 512880                                              |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 7 月 26 日                                     |
| 报告期末基金份额总额 | 43,784,291,482.00 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、权证投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中证全指证券公司指数收益率                                       |
| 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高于                           |

|       |                                                                                                            |
|-------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       | 混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。<br><br>本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证全指证券公司指数，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 | 中国建设银行股份有限公司                                                                                               |

§ 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<br>(2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 2,165,104,764.12                        |
| 2.本期利润         | 3,469,246,935.56                        |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1072                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 55,333,556,100.94                       |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2638                                  |

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

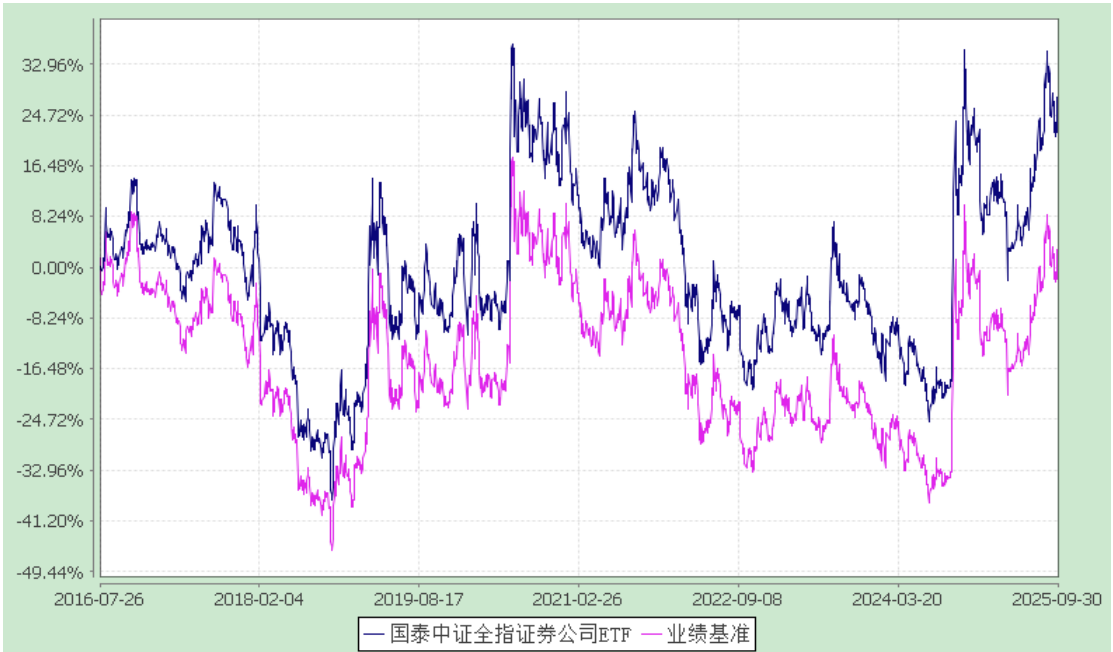
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 11.43% | 1.53%     | 10.83%     | 1.53%         | 0.60% | 0.00% |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月      | 16.40% | 1.69% | 15.57% | 1.69% | 0.83%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 12.88% | 1.99% | 10.95% | 2.00% | 1.93%  | -0.01% |
| 过去三年       | 54.65% | 1.73% | 49.26% | 1.73% | 5.39%  | 0.00%  |
| 过去五年       | 4.56%  | 1.70% | -1.97% | 1.70% | 6.53%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 26.38% | 1.78% | 1.67%  | 1.79% | 24.71% | -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

国泰中证全指证券公司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

（2016 年 7 月 26 日至 2025 年 9 月 30 日）



注：本基金合同生效日为2016年7月26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 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

|     |                                                                                                                                                                                                                                   | 任职日期       | 离任日期 | 限    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 艾小军 | 国泰黄金 ETF 联接、<br>国泰上证 180 金融<br>ETF 联接、国泰上证<br>180 金融<br>ETF、国泰中证<br>计算机主题<br>ETF 联接、国泰黄金<br>ETF、国泰中证<br>军工<br>ETF、国泰中证<br>全指证券公司<br>ETF、国泰国证<br>航天军工指数<br>(LOF)、国泰<br>中证申万证券<br>行业指数<br>(LOF)、芯片<br>ETF、国泰中证<br>计算机主题<br>ETF、国泰中证 | 2016-07-26 | -    | 24 年 | 硕士。2001 年 5 月至 2006<br>年 9 月在华安基金管理有限<br>公司任量化分析师；2006<br>年 9 月至 2007 年 8 月在汇<br>丰晋信基金管理有限公司<br>任应用分析师；2007 年 9<br>月至 2007 年 10 月在平安资<br>产管理有限公司任量化分<br>析师；2007 年 10 月加入国<br>泰基金，历任金融工程分析<br>师、高级产品经理和基金经<br>理助理。2014 年 1 月起任国<br>泰黄金交易型开放式证券<br>投资基金、上证 180 金融交<br>易型开放式指数证券投资基<br>金、国泰上证 180 金融交<br>易型开放式指数证券投资基<br>金联接基金的基金经理，<br>2015 年 3 月至 2020 年 12<br>月任国泰深证 TMT50 指数分<br>级证券投资基金的基金经<br>理，2015 年 4 月至 2021 年<br>1 月任国泰沪深 300 指数证<br>券投资基金的基金经理，<br>2016 年 4 月起兼任国泰黄<br>金交易型开放式证券投资<br>基金联接基金的基金经理，<br>2016 年 7 月起兼任国泰中<br>证军工交易型开放式指数<br>证券投资基金和国泰中证<br>全指证券公司交易型开放<br>式指数证券投资基金的基<br>金经理，2017 年 3 月至 2017<br>年 5 月任国泰保本混合型证<br>券投资基金的基金经理，<br>2017 年 3 月至 2018 年 12<br>月任国泰策略收益灵活配<br>置混合型证券投资基金的<br>基金经理，2017 年 3 月起兼<br>任国泰国证航天军工指数<br>证券投资基金 (LOF) 的基<br>金经理，2017 年 4 月起兼任<br>国泰中证申万证券行业指 |

|  |                                                                                                                |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 全指通信设备ETF、国泰中证全指通信设备ETF联接、国泰中证全指证券公司ETF联接、国泰纳斯达克100（QDII-ETF）、国泰标普500ETF、国泰中证半导体材料设备主题ETF的基金经理、投资总监（量化）、金融工程总监 |  |  |  | 数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 5 月至 2023 年 9 月任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）的基金经理，2019 年 5 月起兼任国泰CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证 |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>券投资基金更名而来)的基金经理,2019 年 7 月至 2021 年 1 月任上证 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,2019 年 7 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备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,2020 年 12 月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来)的基金经理,2021 年 5 月起兼任国泰中证全指证券公司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 5 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理,2023 年 7 月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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《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，本基金与本基金管理人所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

今年以来，中国宏观调控力度加大，在货币政策适度宽松、财政政策刺激需求的宏观背景之下，经济向好环境适宜，投资信心修复明显。2025 年第三季度，中国各项政策效果持续显现，市场自 6 月下旬开始走出慢牛趋势，上证指数等创出十年新高。其中，全球 AI 基本面持续改善推动了通信、芯片、半导体设备行业放量，通过 EPS 扩张推动 PE 上行，是市场进攻的主要方向；此外，在美联储降息、外部冲突等因素刺激之下，有色、黄金等方向亦呈现较强投资机遇。

三季度整体上看，上证指数上涨 12.73%。大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数上涨 10.21%，沪深 300 指数上涨 17.90%，成长性中盘股表征指数如中证 500 指数上涨 25.31%，



小盘股表征指数如中证 1000 上涨 19.17%。行业层面，申万一级通信、电子、电力设备、有色金属领涨，涨幅分别为 48.65%、47.59%、44.67%、41.82%，而红利、防御类板块表现相对落后，其中公用事业、石油石化、交通运输分别微涨 2.15%、1.76%、0.61%，前期涨幅较多的银行板块回调 10.19%。

主要行情方面，总体上投资者信心修复、存款搬家等因素驱动大盘宽基整体上行，而基本面改善幅度较大、业绩释放能力较强的 AI 产业链成为市场主线，代表海外算力的通信板块及代表国产算力的电子板块深度受益。此外，美联储再度开启降息，A 股资产受益于全球流动性宽松，有色、创新药等板块具备一定弹性。

#### 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 11.43%，同期业绩比较基准收益率为 10.83%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面，2025 年第三季度，中国宏观经济韧性较强，需求端持续扩大，就业总体保持稳定。在内外环境向好、部分细分产业取得突破的背景之下，投资者信心同步改善，权益市场量能改善、展现出一定的牛市特征，以通信、芯片半导体等为代表的行业表现强劲。展望后市，稳增长政策空间仍大，四季度宏观经济有望持续稳健，权益市场仍有望呈现结构性机遇。

全球科技之浪潮浩浩汤汤，AI 演绎出更为深刻和广泛的变革。从基础计算芯片到模型、云计算，各类应用产业链同步发展，推理侧的技术突破为 AI 厂商带来了强劲的业务增长，进而衍生出更多的算力需求。近期产业端出现的一个重要变化在于，AI 基础设施建设的投入模式从自有资金投入转向融资投入，计算芯片、云计算、模型和应用厂商之间的合作模式也正向股权端深入。

相关厂商大规模的投资布局，反映出人工智能商业化疾速迈进的步伐。基础模型迭代加速，大模型性能的改善让更多的应用场景落地，越来越多的用户加入到 AI 的大军之中，算力资源的稀缺性凸显。展望后市，人工智能产业的“融资投入-技术创新-业绩兑现”闭环有望保持螺旋上升趋势，算力需求的增长或持续激励基础设施建设，硬件产业链的业绩高增速仍有较大空间。

国内人工智能产业蓬勃发展，半导体产业链迎来新型成长周期。众所周知，人工智能产业“大厦”的基座，是先进的计算芯片。自 2018 年来，在政策扶持加码、市场需求增长等重重利好之下，国产半导体行业已形成综合实力强劲、产业环节完备的产业链条。2023 年

人工智能浪潮爆发之后，相关厂商在算力芯片领域集中攻关，良率持续改善；目前国产计算芯片放量节奏正在加速，国产替代渗透率或在中期达到较高水平。中国是全球第二大计算市场，市场规模庞大，国产半导体产业链有望迎来新一轮成长周期。

此外，军工行业也是一个投资重点。今年是十四五收官之年，十五五规划已开始编制，叠加 2027 年建军百年奋斗目标重要节点，军工行业当下已逐步显露布局良机。今年军队建设需求持续释放，叠加核聚变、商业航天、深海科技等新兴赛道取得突破，军工行业基本面改善明显。此外，外部环境日趋复杂，军贸市场或快速打开。今年以来中东地区爆发了几次冲突，本质上是国际局势复杂化、博弈激烈化的结果。借助中国军械展示出的战斗力，后续军贸板块有望进一步突破。

#### 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              | 55,205,291,094.68 | 99.63        |
|    | 其中：股票             | 55,205,291,094.68 | 99.63        |
| 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      | 172,923,287.58    | 0.31         |

|   |        |                   |        |
|---|--------|-------------------|--------|
| 7 | 其他各项资产 | 34,609,890.59     | 0.06   |
| 8 | 合计     | 55,412,824,272.85 | 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              | 447,615.21 | 0.00         |
| 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           | 21,698.39  | 0.00         |
| 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       | 18,256.34  | 0.00         |
| 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               | 487,569.94 | 0.00         |

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              | -                 | -     |
| C | 制造业              | -                 | -     |
| 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              | 55,204,858,251.23 | 99.77 |
| 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               | 55,204,858,251.23 | 99.77 |

### 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  | 300059 | 东方财富 | 326,703,161 | 8,860,189,726.32 | 16.01        |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 252,226,069 | 7,541,559,463.10 | 13.63        |
| 3  | 601211 | 国泰海通 | 291,987,991 | 5,509,813,390.17 | 9.96         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 130,927,161 | 2,850,284,360.21 | 5.15         |

|    |        |      |             |                  |      |
|----|--------|------|-------------|------------------|------|
|    |        |      | 4           | 8                |      |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 76,280,653  | 1,699,532,948.84 | 3.07 |
| 6  | 600999 | 招商证券 | 95,900,073  | 1,640,850,249.03 | 2.97 |
| 7  | 600958 | 东方证券 | 135,145,142 | 1,546,060,424.48 | 2.79 |
| 8  | 000166 | 申万宏源 | 232,965,750 | 1,241,707,447.50 | 2.24 |
| 9  | 601377 | 兴业证券 | 178,558,777 | 1,167,774,401.58 | 2.11 |
| 10 | 601995 | 中金公司 | 30,209,825  | 1,114,440,444.25 | 2.01 |

### 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  | 301656 | 联合动力 | 7,395 | 184,579.20 | 0.00         |
| 2  | 603049 | 中策橡胶 | 724   | 35,924.88  | 0.00         |
| 3  | 301678 | 新恒汇  | 382   | 28,501.02  | 0.00         |
| 4  | 301662 | 宏工科技 | 143   | 17,806.36  | 0.00         |
| 5  | 603202 | 天有为  | 166   | 16,253.06  | 0.00         |

### 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，中国国际金融股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门立案调查、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   | 4,297,672.21  |
| 2  | 应收证券清算款 | 30,312,218.38 |
| 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 | —             |
| 8 | 其他   | —             |
| 9 | 合计   | 34,609,890.59 |

#### 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<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 301656 | 联合动力 | 184,579.20         | 0.00             | 新股锁定         |
| 2  | 603049 | 中策橡胶 | 35,924.88          | 0.00             | 新股锁定         |
| 3  | 301678 | 新恒汇  | 28,501.02          | 0.00             | 新股锁定         |
| 4  | 301662 | 宏工科技 | 17,806.36          | 0.00             | 新股锁定         |
| 5  | 603202 | 天有为  | 16,253.06          | 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   | 26,270,291,482.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 41,372,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 23,858,000,000.00 |
| 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   | 43,784,291,482.00 |

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证全指证券公司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

### 8.2 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。

### 8.3 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



二〇二五年十月二十八日