# 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

# 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

### 2.1 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 |
| 基金主代码 | 012362 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 5 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,235,856,982.76 份 |
| 投资目标 | 通过主要投资于目标 ETF，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、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、股指期货投资策略；9、融资与转融通证券出借投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指证券公司指数收益率*95%+银行活期存款利率 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | (税后)*5% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 | | |
| 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 | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 A | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 C | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 012362 | 012363 | 022509 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 267,557,356.14 份 | 811,875,227.11 份 | 156,424,399.51 份 |

**2.1.1 目标基金基本情况**

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 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 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2016 年 8 月 8 日 |
| 基金管理人名称 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国建设银行股份有限公司 |

**2.1.2 目标基金产品说明**

| | |
|---|---|
| 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。 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。 |

## §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) | | |
|---|---|---|---|
| | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 A | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 C | 国泰中证全指证券公司 ETF 联接 E |
| 1.本期已实现收益 | -699,073.74 | -2,762,052.99 | -205,065.17 |
| 2.本期利润 | -23,256,257.23 | -70,326,094.89 | -6,514,001.46 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0884 | -0.0869 | -0.1072 |
| 4.期末基金资产净值 | 268,124,250.52 | 800,674,513.53 | 155,903,697.51 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0021 | 0.9862 | 0.9967 |

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、国泰中证全指证券公司 ETF 联接 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 | -7.86% | 1.32% | -8.48% | 1.33% | 0.62% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.20% | 1.52% | -0.90% | 1.53% | 1.10% | -0.01% |
| 过去一年 | -17.43% | 1.34% | -18.69% | 1.35% | 1.26% | -0.01% |
| 过去三年 | 14.66% | 1.59% | 5.03% | 1.63% | 9.63% | -0.04% |
| 过去五年 | -5.44% | 1.53% | -15.13% | 1.57% | 9.69% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.21% | 1.53% | -9.24% | 1.57% | 9.45% | -0.04% |

**2、国泰中证全指证券公司 ETF 联接 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 | -7.93% | 1.32% | -8.48% | 1.33% | 0.55% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.05% | 1.52% | -0.90% | 1.53% | 0.95% | -0.01% |
| 过去一年 | -17.68% | 1.34% | -18.69% | 1.35% | 1.01% | -0.01% |
| 过去三年 | 13.63% | 1.59% | 5.03% | 1.63% | 8.60% | -0.04% |
| 过去五年 | -6.85% | 1.53% | -15.13% | 1.57% | 8.28% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.38% | 1.53% | -9.24% | 1.57% | 7.86% | -0.04% |

**3、国泰中证全指证券公司 ETF 联接 E：**

| 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 | -7.93% | 1.32% | -8.48% | 1.33% | 0.55% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.06% | 1.52% | -0.90% | 1.53% | 0.96% | -0.01% |
| 过去一年 | -17.67% | 1.34% | -18.69% | 1.35% | 1.02% | -0.01% |
| 自新增 E 类份额起至今 | -18.49% | 1.46% | -20.68% | 1.47% | 2.19% | -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发起式联接基金

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

(2021 年 5 月 19 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．国泰中证全指证券公司 ETF 联接 A：




注：本基金的合同生效日为 2021 年 5 月 19 日。在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2．国泰中证全指证券公司 ETF 联接 C：




注：本基金的合同生效日为 2021 年 5 月 19 日。在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3．国泰中证全指证券公司 ETF 联接 E：




注：（1）本基金的合同生效日为 2021 年 5 月 19 日。在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（2）自 2024 年 11 月 11 日起，本基金新增 E 类基金份额并设置对应的基金代码。自 2024 年 11 月 14 日起，E 类基金开始有份额并计算净值。

## §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 | | |
| 艾小军 | 国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 | 2021-05-19 | - | 25 年 | 硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数（LOF）、国泰中证申万证券行业指数（LOF）、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 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 | | | | 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（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 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | | | | 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。 |

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 股震荡调整。科技板块受估值与交易拥挤度调整影响，电子、通信回撤显

著；周期板块内部表现分化，煤炭、石油石化受能源价格回升和盈利改善预期支撑，表现占优；金融板块中，银行凭借经营韧性和股息回报相对较强。市场经历 7 月调整、8 月修复和 9 月走弱，风格向价值与红利再平衡。

总体而言，估值调整和交易拥挤度下降是本轮回撤的重要因素，市场也在重新评估盈利持续性。海外利率上行持续压缩成长资产的估值空间，稳定现金流与股息回报受到更多关注。国内经济方面，生产端保持韧性，消费需求修复偏慢；价格回升部分来自能源和原材料涨价，对上下游利润的影响并不一致。后续修复能否延续，仍然需要内需改善和企业盈利共同验证。

在相对复杂的市场环境下，2026 年三季度上证指数、深证成指、创业板指、科创 50 分别下跌 6.16%、20.47%、27.80%、30.70%。从申万一级各行业表现看，银行、医药生物涨幅居前，分别上涨 7.48%、6.50%；电力设备、通信跌幅居前，分别下跌 28.11%、20.64%。

作为被动指数基金的基金经理，我们的工作重点在于紧密跟踪标的指数，力求实现与指数表现相匹配的投资回报。在 2026 年三季度，我们的基金严格按照既定的投资策略，依据标的指数的成分股及其权重构建投资组合，以最小化跟踪误差。

在实际操作中，我们对指数的成分股变化保持密切关注，及时进行相应的调整，确保基金持仓与指数成分的一致性。同时，利用量化分析和风险评估模型，对投资组合进行动态监控，以控制跟踪误差在合理范围内。尽管面临市场的大幅波动和成分股的调整，基金整体较好地实现了对标的指数的跟踪，在多数时间段内，净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度和年跟踪误差均控制在较低水平。

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-7.86%，同期业绩比较基准收益率为-8.48%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-7.93%，同期业绩比较基准收益率为-8.48%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为-7.93%，同期业绩比较基准收益率为-8.48%。

**4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望后市，海外利率较高、同时内需恢复偏慢，短期仍制约 A 股风险偏好与估值扩张，震荡整固或将持续。但是，国内政策托底有助于稳定盈利预期，中期维度来看，资金有望向需求持续增长、业绩兑现较强的行业集中，市场可能呈现结构性修复。

AI 产业链方面，模型升级与应用拓展持续拉动算力需求，国内算力建设和自主可控需求支撑芯片、设备及通信环节的景气度。三季度调整缓解了部分估值与交易拥挤压力，伴随 AI 相关产品持续放量，订单增长明确、收入与现金流同步改善的板块有望率先修复。

其中，科创 50 作为中国科技产业的典型代表，当前处在"产业趋势向上、交易结构待修复"的组合中，其盈利与估值对全球 AI 资本开支、国产替代与海外利率高度敏感，本质是对"科技自立自强＋AI 产业周期"的高 Beta 表达。发展空间大，方向不悲观、但是短期仍需谨慎面对波动风险。

国防军工方面，“十五五”开局与国防现代化建设支持中长期需求，军贸和商业航天有望带来增量空间。但采购、交付与验收节奏仍制约短期业绩释放，行业整体盈利拐点尚需验证。订单执行较好、回款改善的环节有望先于行业整体迎来景气修复，板块机会仍以结构性为主。

此外，大金融板块目前整体处于历史估值的相对低位区间，具备较高的安全边际与修复空间。头部证券公司通过行业内部的并购重组实现做优做强的预期正在逐步升温。伴随资本市场制度的不断完善，财富管理业务的深化转型与投行资本化业务的拓展，将有助于逐步改善证券行业的盈利结构与资产质量。银行板块的防御属性或可与高波动资产形成一定对冲，可考虑作为组合的“压舱石”进行配置。

### 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 | 237,020.00 | 0.02 |
| | 其中：股票 | 237,020.00 | 0.02 |
| 2 | 基金投资 | 1,157,270,625.78 | 93.72 |
| 3 | 固定收益投资 | 5,066,853.42 | 0.41 |
| | 其中：债券 | 5,066,853.42 | 0.41 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 68,986,362.21 | 5.59 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,222,749.70 | 0.26 |
| 9 | 合计 | 1,234,783,611.11 | 100.00 |

**5.2期末投资目标基金明细**

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 股票型 | 交易型开放式(ETF) | 国泰基金管理有限公司 | 1,157,270,625.78 | 94.49 |

**5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 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 | 237,020.00 | 0.02 |
| 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 | 237,020.00 | 0.02 |

## 5.4 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 | 601198 | 东兴证券 | 11,000 | 143,660.00 | 0.01 |
| 2 | 601059 | 信达证券 | 6,000 | 93,360.00 | 0.01 |

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 5,066,853.42 | 0.41 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 5,066,853.42 | 0.41 |

**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五名债券投资明细**

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 019792 | 25 国债 19 | 50,000 | 5,066,853.42 | 0.41 |

**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。

**5.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.9 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。

**5.10 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。

**5.11 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。

**5.12投资组合报告附注**

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，东兴证券股份有限公司、信达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。

5.12.2 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。

**5.12.3其他资产构成**

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 70,910.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,151,838.86 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,222,749.70 |

**5.12.4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。

**5.12.5报告期末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 | 601198 | 东兴证券 | 143,660.00 | 0.01 | 重大事项 |
| 2 | 601059 | 信达证券 | 93,360.00 | 0.01 | 重大事项 |

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国泰中证全指证券公司ETF联接A | 国泰中证全指证券公司ETF联接C | 国泰中证全指证券公司ETF联接E |
|---|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 233,356,077.15 | 747,349,170.27 | 41,197,386.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 77,224,881.67 | 352,362,510.43 | 156,439,422.99 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 43,023,602.68 | 287,836,453.59 | 41,212,410.30 |
| 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 | 267,557,356.14 | 811,875,227.11 | 156,424,399.51 |

## §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注册的批复

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发起式联接基金基金合同

3、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**