

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

2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 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：二〇二五年一月二十二日

§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 01 月 20 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。

为了更好地满足投资人的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和本基金基金合同的有关约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，决定自 2024 年 11 月 11 日起对本基金增加 E 类基金份额，并相应修改基金合同和托管协议的部分条款。具体可查阅本基金管理人于 2024 年 11 月 11 日发布的《关于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增加 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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 | 509,822,332.19 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 | 105,826,683.55 份 | 400,254,064.26 份 | 3,741,584.38 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 (2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 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 | 3,039,818.70 | 12,621,815.06 |
| 2.本期利润 | 1,693,335.07 | 6,423,386.12 | -125,220.22 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0173 | 0.0156 | -0.1248 |
| 4.期末基金资产净值 | 118,684,274.55 | 444,073,305.12 | 4,194,876.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1215 | 1.1095 | 1.1211 |

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 | 6.53% | 2.40% | 3.51% | 2.66% | 3.02% | -0.26% |
| 过去六个月 | 52.09% | 2.32% | 44.32% | 2.43% | 7.77% | -0.11% |
| 过去一年 | 33.70% | 1.92% | 26.06% | 2.00% | 7.64% | -0.08% |
| 过去三年 | 4.60% | 1.62% | -3.98% | 1.66% | 8.58% | -0.04% |
| 自基金合同 生效起至今 | 12.15% | 1.57% | 4.42% | 1.63% | 7.73% | -0.06% |

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 | 6.45% | 2.40% | 3.51% | 2.66% | 2.94% | -0.26% |
| 过去六个月 | 51.86% | 2.32% | 44.32% | 2.43% | 7.54% | -0.11% |
| 过去一年 | 33.31% | 1.92% | 26.06% | 2.00% | 7.25% | -0.08% |
| 过去三年 | 3.66% | 1.62% | -3.98% | 1.66% | 7.64% | -0.04% |
| 自基金合同 生效起至今 | 10.95% | 1.57% | 4.42% | 1.63% | 6.53% | -0.06% |

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 |
|------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 自新增 E 类 份额起至今 | -8.32% | 1.70% | -8.75% | 1.73% | 0.43% | -0.03% |

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

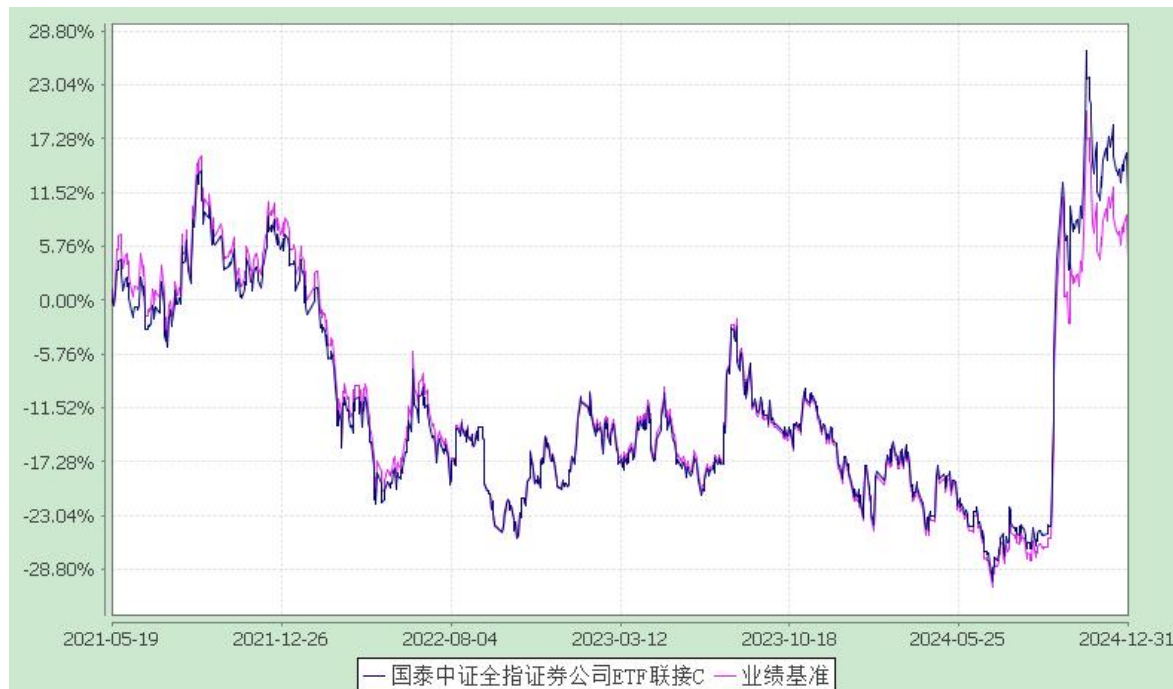
国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021 年 5 月 19 日至 2024 年 12 月 31 日)

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 | - | 24 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 |

| | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|
| <p>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、国泰国防军工指数（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</p> | | | | | <p>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 月起兼任国泰国防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</p> |
|---|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|---|--|--|---|
| | <p>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</p> | | | <p>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</p> |
|--|---|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---------------------|
| | | | | | 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

四季度，A股市场在国内外多重因素的影响下，呈现出了较大的波动性。国内来看，10月起制造业PMI回升至荣枯线以上，经济数据出现回暖；M1、M2及社零同比有所改善，显示出一揽子政策作用下金融及消费数据的好转。但12月以来，随着特朗普压倒性胜选、市场开启新一轮

“特朗普交易”，美元走高对于全球风险偏好产生一定压制；特朗普未来对华加征关税等政策主张可能也放大了市场担忧情绪，大盘在四季度整体呈现宽幅震荡态势。

四季度整体来看，上证指数收涨 0.46%。大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 指数跌 2.56%，沪深 300 指数下跌 2.06%，成长性中盘股表征指数如中证 500 下跌 0.3%，小盘股表征指数中证 1000 上涨 4.36%。板块上，新能源汽车、医药医疗科技占比较多的创业板指下跌 1.54%，硬科技占比较高的科创板 50 上涨 13.36%。行业表现上，按照申万一级行业划分，三季度表现靠前的为商贸零售、电子、计算机、通信等，科技成长占优；而有色金属、煤炭等上游资源板块表现相对落后。

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 6.53%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 6.45%，同期业绩比较基准收益率为 3.51%。

本基金 E 类自新增 E 类份额以来的净值增长率为-8.32%，同期业绩比较基准收益率为-8.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面看，当前经济依然面临内需不足、信用扩张缓慢等问题。2025 年随着特朗普任期将至，来自海外的压力也可能进一步放大。不过 12 月的政治局会议明确了 2025 年将采取更为积极的政策立场，以应对经济下行压力。会议的多项新提法，如“超常规逆周期调节”、“适度宽松的货币政策”等，预示着未来将有更多具体的政策措施出台，以确保经济稳定增长。

展望未来，我们认为国内经济将继续稳步恢复，政策层面的支持和市场信心的逐步修复将为 A 股市场提供支撑。海外美联储降息周期开启，国内货币政策有望进一步打开空间；国内政策预期持续向好，PPI（表征名义增长和企业盈利周期）、M1（表征微观活跃度）、社融同比（表征需求）均处于较为底部的位置，基本面改善空间较大。政策层面的支持和市场信心的逐步修复将为 A 股市场提供支撑。量能方面看，当前交投情绪依然较好，2024 年下半年 A 股市场的反弹有望提振证券公司的整体业绩，可适当关注弹性较大的证券板块。证券公司并购重组的趋势也对于证券板块也构成一定利好。

12 月召开的中央经济工作会议将“大力提振消费、扩内需”放在明年九项重点工作之首，指出“促进居民收入增长和经济增长同步”、“着力提振内需，特别是居民消费需求”、“实施提振消费专项行动”等，近期也出台了针对家电、数码产品等消费品的补贴政策，后续或有持续的配套政策落地。消费板块调整后估值相对不高，也可以适当关注如家电、医药等板块。

同时，科技创新仍然是推动经济发展的关键力量，特别是在人工智能、半导体等前沿技术领域，预计将持续吸引投资者的关注。AI 创新持续爆发。AI 领域大语言模型的持续推出以及参数

量的不断增长有望驱动模型训练端、推理端 GPU 芯片需求快速增长。

上游端，半导体自主可控重要性持续凸显，今明年晶圆厂存储厂保持有序扩产，国产化进展仍在加速。未来 3 年国产化仍然是行业最强主线之一。随着 AI 的持续发展，通信在训练/推理中的重要性正在不断提升，产品迭代速度明显加速，国内光通信产业链在众多环节优势均较为明显。下游需求端，全球消费电子需求有望回升，拉动芯片需求触底回暖，芯片及上游制造相关的半导体设备行业也值得关注。此外，军工板块也有望底部反转。当前随着影响行业运行的不利因素逐步消退，需求有望在 2025 迎来全面恢复，在“十四五”任务收官和中上游企业“十五五”需求前置落地的共同作用下，部分公司有望提前兑现订单，加上后续大规模合同持续推进，行业景气度或迎来抬升；近期，多家军工企业已公告新签订单。长期看，“百年未有之大变局”下，国防军工行业作为大国博弈下的必选消费，依然具有较好的景气度。

在全球层面，地缘政治的不确定性仍然是影响市场的重要因素。我们将持续关注全球政治经济形势的变化，以及其对 A 股市场的潜在影响。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 528,654,693.73 | 92.02 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 41,769,453.10 | 7.27 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,096,286.70 | 0.71 |
| 9 | 合计 | 574,520,433.53 | 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 | 528,654,693.73 | 93.24 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 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。

5.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

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规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 | 158,472.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,937,814.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,096,286.70 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

§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 | 45,511,890.94 | 271,104,383.61 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 160,452,244.82 | 755,445,363.29 | 4,690,564.61 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 100,137,452.21 | 626,295,682.64 | 948,980.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 105,826,683.55 | 400,254,064.26 | 3,741,584.38 |

§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 | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.00 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|----------------|------|
| 1 | 赎回 | 2024-11-12 | 10,000,000.00 | -12,515,000.00 | - |
| 合计 | | | 10,000,000.00 | -12,515,000.00 | |

注：本基金管理人于本报告期内赎回本基金的适用费用为0.00元。

§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 | 2024年10月01日至2024年10月08日 | 109,585,282.09 | - | 30,000,000.00 | 79,585,282.09 | 15.61% |
| 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。

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

二〇二五年一月二十二日