（上接B189版）

无。

7.1.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.1.4.4.2 关联方报酬

7.1.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年9月17日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,621.11
其中：支付销售机构的客户维护费	69,209.14

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取0)的0.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝(前一日的基金资产净值－前一日基金资产中目标ETF份额所对应资产净值)×0.5%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按0计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.1.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年9月17日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,124.28

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取0)的0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝（前一日的基金资产净值－前一日基金资产中目标ETF份额所对应资产净值）×0.1%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按0计算。

7.1.4.4.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年9月17日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏MSCI中国A股国际通ETF联接A	华夏MSCI中国A股国际通ETF联接C	合计
华夏基金管理有限公司	–	3,569.41	3,569.41
华夏财富	–	126.37	126.37
合计	–	3,695.78	3,695.78

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华夏基金管理有限公司，再由华夏基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C类日基金销售服务费＝前一日C类基金资产净值×0.30%/当年天数。

7.1.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.1.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.1.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.1.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年9月17日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	10,636,286.57	23,301.59

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.1.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.1.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

截至2018年12月31日止，本基金持有目标ETF基金份额166,957,581份，占其总份额的比例为27.71%。

7.1.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.1.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	–	–	929	12,792.00	13,554.11	–

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

7.1.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.1.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.1.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.1.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.1.4.6.2各层次金融工具公允价值

截至2018年12月31日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为149,061,048.67元，第二层次的余额为0元，第三层次的余额为0元。

7.1.4.6.3公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

7.1.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.2 原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

7.2.1资产负债表

会计主体：原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018年9月16日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年9月16日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		9,068,437.29	7,149,455.43
结算备付金		4,311,914.68	773,873.78
存出保证金		854,297.65	16,552.83
交易性金融资产		143,112,741.04	124,605,963.09
其中：股票投资		27,581.51	3,731,763.50
基金投资		143,085,159.53	120,874,199.59
债券投资		–	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		–	–
应收利息		43,723.32	2,114.68
应收股利		–	–
应收申购款		302,367.98	95,105.07
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	4,530.00
资产总计		157,693,481.96	132,647,594.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年9月16日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		40,289.22	532,512.89
应付管理人报酬		3,056.58	4,524.78
应付托管费		611.30	904.97
应付销售服务费		518.49	–
应付交易费用		117,708.59	19,386.97
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		85,292.78	41,932.04
负债合计		247,476.96	599,261.65
所有者权益：			
实收基金		172,203,686.71	118,425,513.15
未分配利润		-14,757,681.71	13,622,820.08
所有者权益合计		157,446,005.00	132,048,333.23
负债和所有者权益总计		157,693,481.96	132,647,594.88

注：①自2018年9月17日起，原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

②报告截止日2018年9月16日，华夏MSCI中国A股ETF联接A基金份额净值0.914元，华夏MSCI中国A股ETF联接C基金份额净值0.917元；华夏MSCI中国A股ETF联接基金份额总额172,203,686.71份（其中A类167,800,294.81份，C类4,403,391.90份）。

7.2.2 利润表

会计主体：原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018年1月1日至2018年9月16日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年9月16日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		-26,122,852.40	19,018,895.91
1.利息收入		85,935.98	73,801.81
其中：存款利息收入		82,165.77	61,949.08
债券利息收入		–	73.28
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		3,770.21	11,779.45
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,253,729.77	1,500,880.46
其中：股票投资收益		-545,928.08	26,838.94
基金投资收益		-3,674,306.64	1,194,923.08
债券投资收益		–	157.95
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		-71,280.00	258,540.00
股利收益		37,784.95	20,420.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-22,040,671.36	17,380,428.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）		85,612.75	63,785.33
减：二、费用		413,827.28	202,718.52
1.管理人报酬		43,590.18	45,488.00
2.托管费		8,718.02	9,097.58
3.销售服务费		16,421.12	–
4.交易费用		255,944.03	25,169.27
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.税金及附加		408.00	–
7.其他费用		88,745.93	122,963.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-26,536,679.68	18,816,177.39
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-26,536,679.68	18,816,177.39

注：自2018年9月17日起，原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本期指2018年1月1日至2018年9月16日。

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018年1月1日至2018年9月16日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月16日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	118,425,513.15	13,622,820.08	132,048,333.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-26,536,679.68	-26,536,679.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	53,778,173.56	-1,843,822.11	51,934,351.45
其中：1.基金申购款	354,621,083.18	-12,114,764.21	342,506,318.97
2.基金赎回款	-300,842,909.62	10,270,942.10	-290,571,967.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	172,203,686.71	-14,757,681.71	157,446,005.00
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	107,803,577.10	-5,801,393.12	102,002,183.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	18,816,177.39	18,816,177.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	10,621,936.05	608,035.81	11,229,971.86
其中：1.基金申购款	94,992,535.02	6,190,563.81	101,183,098.83
2.基金赎回款	-84,370,598.97	-5,582,528.00	-89,953,126.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	118,425,513.15	13,622,820.08	132,048,333.23

注：自2018年9月17日起，原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本期指2018年1月1日至2018年9月16日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.2.1至7.2.4财务报表由下列负责人签署：

杨明辉　　汪贵华　　汪贵华

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.2.4 报表附注

7.2.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.2.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.2.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	本基金是该基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.2.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.4.1.1 股票交易

无。

7.2.4.4.1.2 权证交易

无。

7.2.4.4.1.3 债券交易

无。

7.2.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.2.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.2.4.4.2 关联方报酬

7.2.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月16日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	43,590.18	45,488.00
其中：支付销售机构的客户维护费	147,176.19	164,169.82

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取0)的0.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝(前一日的基金资产净值－前一日基金资产中目标ETF份额所对应资产净值)×0.5%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按0计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.2.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年9月16日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,718.02	9,097.58

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取0)的0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝（前一日的基金资产净值－前一日基金资产中目标ETF份额所对应资产净值）×0.1%/当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按0计算。

7.2.4.4.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年9月16日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏MSCI中国A股ETF联接A	华夏MSCI中国A股ETF联接C	合计
华夏基金管理有限公司	–	16,352.08	16,352.08
华夏财富	–	68.99	68.99
合计	–	16,421.07	16,421.07

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华夏基金管理有限公司，再由华夏基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C类日基金销售服务费＝前一日C类基金资产净值×0.30%/当年天数。

7.2.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.2.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.2.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.2.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年9月16日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	9,068,437.29	66,072.46	7,149,455.43	51,358.77

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.2.4.4.8 其他关联交易事项的说明

7.2.4.4.8.1 其他关联交易事项的说明

截至2018年9月16日止，本基金持有目标ETF基金份额150,457,581份(2017年12月31日：102,932,981份)，占其总份额的比例为24.97%（2017年12月31日：29.62%）。

7.2.4.5 期末（2018年9月16日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.2.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	–	–	929	12,792.00	13,554.11	–
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大事项	4.56	2018-10-31	4.10	1,040	4,744.00	4,742.40	–
600751	海航科技	2018-01-12	重大事项	6.49	2018-9-25	5.84	600	3,967.85	3,894.00	–
600122	宏图高科	2018-06-18	重大事项	7.40	2018-11-2	6.66	300	2,403.00	2,220.00	–
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项	21.67	2018-10-10	19.50	100	2,171.00	2,167.00	–
600986	东方金钰	2018-01-19	重大事项	10.04	2018-11-2	9.04	100	1,076.75	1,004.00	–

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。7.2.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.2.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.2.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.2.4.6.2各层次金融工具公允价值

截至2018年9月16日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为143,112,741.04元，第二层次的余额为0元，第三层次的余额为0元。（截至2017年12月31日止：第一层次的余额为124,596,198.09元，第二层次的余额为9,765.00元，第三层次的余额为0元。）

7.2.4.6.3公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

7.2.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§8 投资组合报告

8.1华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期末为2018年12月31日，报告期间为2018年9月17日至2018年12月31日）

8.1.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	18,016.11	0.01
	其中：股票	18,016.11	0.01
2	基金投资	149,043,032.56	91.49
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	13,305,936.57	8.17
8	其他各项资产	545,764.84	0.34
9	合计	162,912,750.08	100.00

8.1.2期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	华夏MSCI中国A股国际通ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	149,043,032.56	91.67

8.1.3 期末按行业分类的股票投资组合

8.1.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	16,927.11	0.01
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	1,089.00	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	–	–
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	18,016.11	0.01

8.1.4 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	929	13,554.11	0.01
2	600226	瀚叶股份	1,040	2,912.00	0.00
3	600122	宏图高科	300	1,089.00	0.00
4	600986	东方金钰	100	461.00	0.00
5	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

8.1.5报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.5.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

8.1.5.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600751	海航科技	2,610.00	0.00
2	600848	上海临港	1,562.00	0.00
3	–	–	–	–
4	–	–	–	–
5	–	–	–	–
6	–	–	–	–
7	–	–	–	–
8	–	–	–	–
9	–	–	–	–
10	–	–	–	–
11	–	–	–	–
12	–	–	–	–
13	–	–	–	–
14	–	–	–	–
15	–	–	–	–
16	–	–	–	–
17	–	–	–	–
18	–	–	–	–
19	–	–	–	–
20	–	–	–	–

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.1.5.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	–
卖出股票收入（成交）总额	4,162.00

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.1.6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。

8.1.7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。

8.1.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.1.9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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.10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。

8.1.11报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.11.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1901	沪深300股指期货IF1901合约	3	2,703,240.00	-97,860.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-97,860.00
股指期货投资本期收益					-418,660.00
股指期货投资本期公允价值变动					125,860.00

8.1.11.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型联接基金，主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股和备选成份股。本基金根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

8.1.12报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.12.1本期国债期货投资策略

本基金本报告期未无国债期货投资。

8.1.12.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.1.12.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期未无国债期货投资。

8.1.13投资组合报告附注

8.1.13.1本基金投资的前十名证券的发行主体中，东方金钰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。本基金为指数型联接基金，主要采取复制策略，东方金钰系目标ETF的原指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.1.13.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.1.13.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	331,980.10
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,998.67
5	应收申购款	209,786.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	545,764.84

8.1.13.4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处于转股期的可转换债券。

8.1.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	13,554.11	0.01	重大事项

8.1.13.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8.2原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期末为2018年9月16日，报告期间为2018年1月1日至2018年9月16日）

8.2.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	27,581.51	0.02
	其中：股票	27,581.51	0.02
2	基金投资	143,085,159.53	90.74
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	13,390,351.97	8.49
8	其他各项资产	1,200,388.95	0.76
9	合计	157,693,481.96	100.00

8.2.2期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	华夏MSCI中国A股ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	143,085,159.53	90.88

8.2.3期末按行业分类的股票投资组合

8.2.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	19,300.51	0.01
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	6,114.00	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	2,167.00	0.00
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	27,581.51	0.02

8.2.4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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	929	13,554.11	0.01
2	600226	瀚叶股份	1,040	4,742.40	0.00
3	600751	海航科技	600	3,894.00	0.00
4	600122	宏图高科	300	2,220.00	0.00
5	600848	上海临港	100	2,167.00	0.00
6	600986	东方金钰	100	1,004.00	0.00
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

8.2.5报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	693,557.00	0.53
2	600036	招商银行	690,957.00	0.52
3	601166	兴业银行	526,366.00	0.40
4	601318	中国平安	489,191.00	0.37
5	600016	民生银行	311,039.00	0.24
6	600000	浦发银行	308,617.00	0.23
7	600887	伊利股份	289,345.00	0.22
8	601328	交通银行	243,396.00	0.18
9	601398	工商银行	219,694.00	0.17
10	601288	农业银行	193,161.00	0.15
11	600048	保利地产	185,976.00	0.14
12	600104	上汽集团	184,436.00	0.14
13	600900	长江电力	166,920.00	0.13
14	601601	中国太保	165,530.00	0.13
15	600030	中信证券	153,659.00	0.12
16	600585	海螺水泥	138,109.00	0.10
17	601229	上海银行	136,661.00	0.10
18	601766	中国中车	133,396.00	0