

**华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
(原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型)**

**2018 年第 3 季度报告**

**2018 年 9 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十六日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

基金管理人以通讯方式同时召开 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金份额持有人大会，审议将标的指数变更为“MSCI 中国 A 股国际通指数”，并相应变更基金名称并修订基金合同等相关事宜，审议议案于 2018 年 9 月 12 日获得通过，基金份额持有人大会决议自同日起生效。根据决议生效公告，MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金自 2018 年 9 月 17 日正式变更为华夏 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，并继续以变更后的华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金作为目标 ETF。

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。

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金报告期自 2018 年 9 月 17 日起至 2018 年 9 月 30 日止，原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 16 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金。

## §2 基金产品概况

### 2.1 华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	MSCIA 股
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 17 日
报告期末基金份额总额	562,903,247.00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最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### 2.2 原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	MSCIA 股
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式

基金合同生效日	2015 年 2 月 12 日
报告期末基金份额总额	602,503,247.00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最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股在岸指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### §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	转型后	转型前
	报告期(2018年9月17日至2018年9月30日)	报告期(2018年7月1日至2018年9月16日)
1.本期已实现收益	-5,371,171.41	-53,777,876.43
2.本期利润	34,398,256.52	-32,323,274.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0592	-0.0542
4.期末基金资产净值	568,479,618.99	572,949,813.22
5.期末基金份额净值	1.0099	0.9509

注：①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。

②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。

③自 2018 年 9 月 17 日起, 由《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

##### 3.2.1.1 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

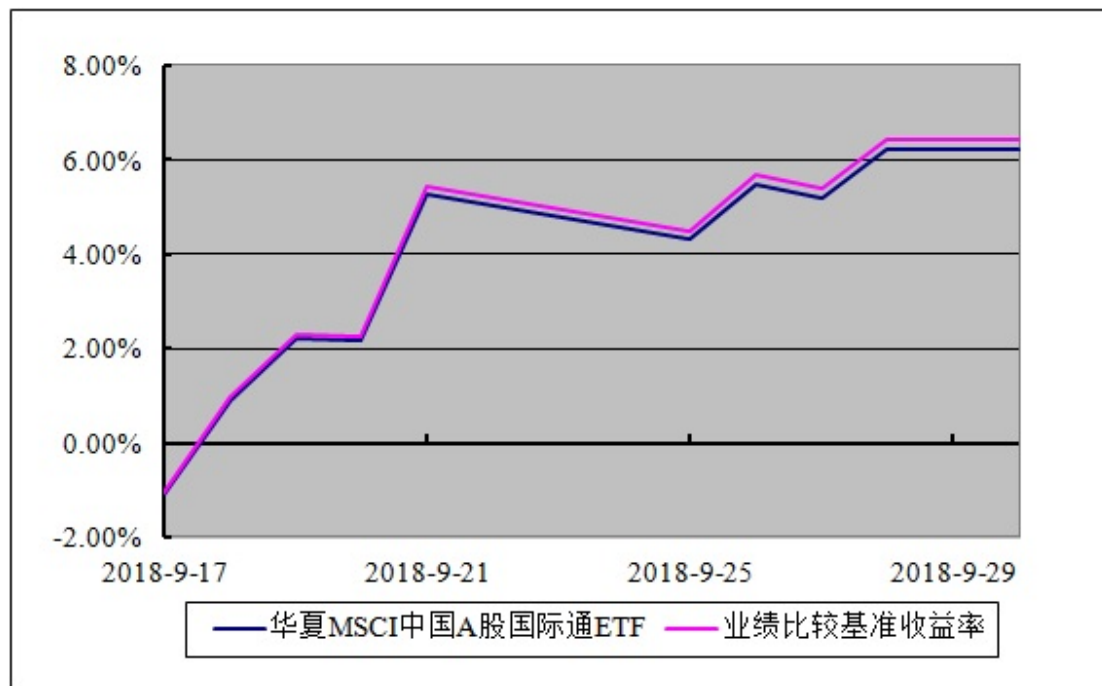
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金转型起至今	6.20%	1.31%	6.45%	1.34%	-0.25%	-0.03%

##### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

华夏 MSCI 中国 A 股国际通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

(2018 年 9 月 17 日至 2018 年 9 月 30 日)



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变更为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金。

②根据华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

### 3.2.2 原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.2.2.1 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

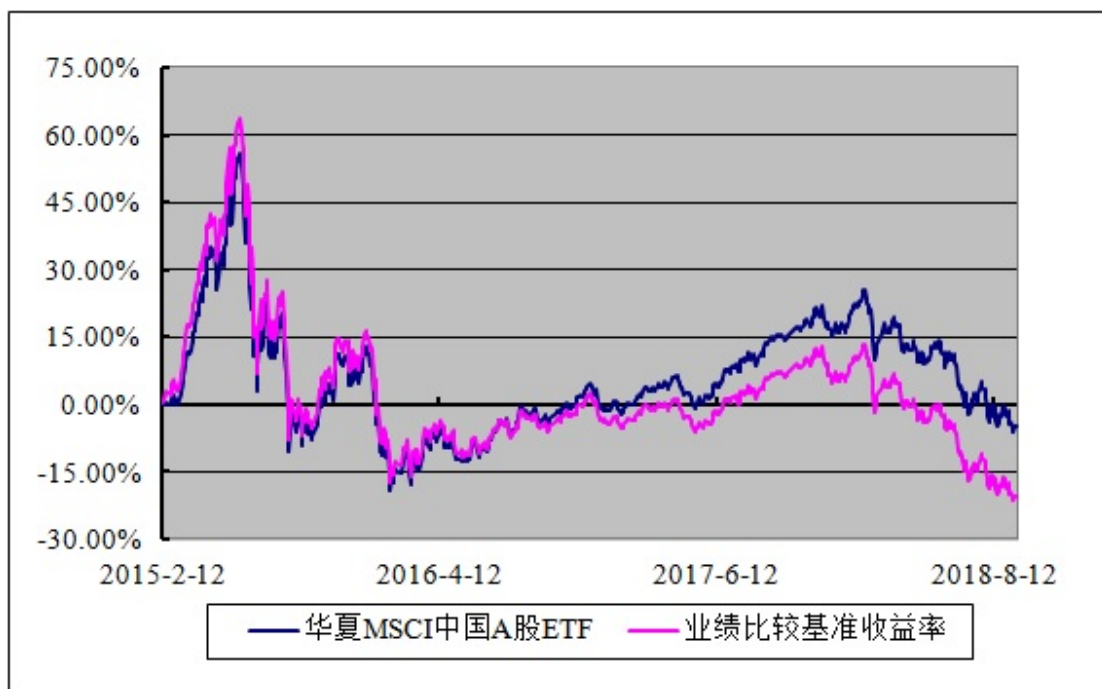
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018 年 7 月 1 日-2018 年 9 月 16 日	-7.18%	1.31%	-9.35%	1.35%	2.17%	-0.04%

#### 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

#### MSCI 中国 A 股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

(2015 年 2 月 12 日至 2018 年 9 月 16 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

#### 4.1.1 华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2018-09-17	-	8 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。 2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.2 原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-20	2018-09-16	8 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。 2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

### 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

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金由 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更注册而来，跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数。MSCI 中国 A 股国际通指数（MSCI China A Inclusion RMB Index）由 MSCI 公司于 2017 年 10 月 23 日发布，其成份股为 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index）的部分，该指数能够完整反映 A 股逐步纳入 MSCI 新兴市场指数的进程。截至 2018 年 9 月 30 日，MSCI 中国 A 股国际通指数成份股 235 只。华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

3 季度，国际方面，美国经济扩张尚未结束，商品价格持续上涨，失业率降至较低水平；欧元区就业市场仍有缓慢改善，但经济增长动能减弱，日本经济增长同样出现增速回调；在美元流动性持续收紧的背景下，新兴市场经济体之间分化加剧，前期加杠杆较快，外债比例较高的国家受到较大冲击；整体而言，全球贸易摩擦持续升级，对未来全球经济和企业盈利增长带来较大不确定性，并推升物价上涨。货币市场上，美联储 9 月再次提高联邦基金利率，美元期限利差继续收窄，收益率曲线明显扁平化。国内方面，供给侧结构性改革深入推进，新兴动能不断成长，企业利润增长趋势延续，但贸易摩擦和流动性趋紧使得市场对未来经济前景的顾虑提升。货币方面，人民币对美元小幅贬值，央行维持稳健中性的货币政策。9 月国务院金融稳定发展委员会召开第三次会议，在充分考虑经济金融形势和外部环境新变化的基础上，做好政策预调微调。



市场方面,受中美贸易战持续发酵、流动性趋紧、高杠杆部门出现局部风险等影响,A股市场情绪承压,市场成交呈现较为明显的萎缩态势,大盘指数持续下探后于9月下旬出现反弹。9月初,A股实施第二批纳入MSCI新兴市场指数,虽然短期难以成为影响A股的主要驱动力,但长远来看,随着纳入比例的提高,A股市场活力和效率也将随之得到提升。

基金投资运作方面,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对基金标的指数变更、投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

为促进华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的市场流动性和平稳运行,经上海证券交易所同意,部分证券公司被确认为华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的流动性服务商。目前,华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的流动性服务商包括广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司等。

目前华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金已被调入融资融券标的的证券名单。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前,截至2018年9月16日,MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金份额净值为0.9509元,本报告期份额净值增长率为-7.18%,同期业绩比较基准增长率为-9.35%,跟踪偏离度为+2.17%;转型后,截至2018年9月30日,华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金份额净值为1.0099元,本报告期份额净值增长率为6.20%,同期业绩比较基准增长率为5.52%,跟踪偏离度为+0.68%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金

(报告期末为2018年9月30日,报告期间为2018年9月17日至2018年9月30日)

#### 5.1.1 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
----	----	-------	----------

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
(原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型) 2018 年第 3 季度报告

			例(%)
1	权益投资	549,729,611.95	95.95
	其中：股票	549,729,611.95	95.95
2	固定收益投资	21,857.00	0.00
	其中：债券	21,857.00	0.00
	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	20,658,003.24	3.61
7	其他各项资产	2,497,434.33	0.44
8	合计	572,906,906.52	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.1.2.1 报告期末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	1,726,726.00	0.30
B	采矿业	22,776,514.86	4.01
C	制造业	211,469,813.80	37.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,206,574.58	3.55
E	建筑业	19,655,433.66	3.46
F	批发和零售业	13,011,283.00	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	14,571,512.84	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,823,020.27	3.31
J	金融业	184,826,950.26	32.51

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
(原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型) 2018 年第 3 季度报告

K	房地产业	29,148,980.64	5.13
L	租赁和商务服务业	8,017,361.12	1.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	894,320.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,671,999.20	0.29
R	文化、体育和娱乐业	2,448,869.72	0.43
S	综合	480,000.00	0.08
	合计	549,729,359.95	96.70

5.1.3 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	600519	贵州茅台	38,975	28,451,750.00	5.00
2	601318	中国平安	335,638	22,991,203.00	4.04
3	600036	招商银行	639,152	19,615,574.88	3.45
4	601166	兴业银行	643,716	10,267,270.20	1.81
5	600000	浦发银行	909,448	9,658,337.76	1.70
6	601398	工商银行	1,670,600	9,639,362.00	1.70
7	000333	美的集团	230,997	9,309,179.10	1.64
8	601288	农业银行	2,307,800	8,977,342.00	1.58
9	002415	海康威视	285,876	8,216,076.24	1.45
10	000858	五粮液	120,229	8,169,560.55	1.44

5.1.4 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	-	-
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)	21,857.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,857.00	0.00

#### 5.1.5 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

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	110045	海澜转债	220	21,857.00	0.00
2					
3					
4					
5					

#### 5.1.6 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。

#### 5.1.7 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。

#### 5.1.8 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。

#### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.1.9.1 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	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1812	沪深 300 股指期货 IF1812 合约	7	7,220,640.00	295,740.00	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。
IF1810	沪深 300 股指期货 IF1810 合约	6	6,190,920.00	418,560.00	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(元)					714,300.00
股指期货投资本期收益(元)					-587,429.84
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,382,209.84

##### 5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头

寸根据基金合同规定, 投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合, 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。

#### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.1.10.2 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。

##### 5.1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内, 本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求, 未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 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。

##### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,147,183.99
2	应收证券清算款	343,934.66
3	应收股利	-
4	应收利息	6,315.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,497,434.33

##### 5.1.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 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	000333	美的集团	9,309,179.10	1.64	重大事项

5.1.11.6 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。

5.2原MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金

(报告期末为2018年9月16日，报告期间为2018年7月1日至2018年9月16日)

5.2.1 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	554,465,611.25	96.29
	其中：股票	554,465,611.25	96.29
2	固定收益投资	56,894.20	0.00
	其中：债券	56,894.20	0.00
	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	16,579,056.78	2.88
7	其他各项资产	4,717,172.07	0.82
8	合计	575,818,734.30	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末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（%）
----	------	---------	--------------

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
(原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型) 2018 年第 3 季度报告

A	农、林、牧、渔业	1,870,913.80	0.33
B	采矿业	22,595,003.27	3.94
C	制造业	215,791,998.56	37.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,208,775.65	3.53
E	建筑业	19,478,973.73	3.40
F	批发和零售业	13,796,178.76	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	14,658,501.83	2.56
H	住宿和餐饮业	71,665.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,216,607.86	3.53
J	金融业	181,997,970.61	31.77
K	房地产业	30,245,169.31	5.28
L	租赁和商务服务业	7,810,084.50	1.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	964,576.91	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,551,046.60	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,612,825.36	0.46
S	综合	595,223.50	0.10
	合计	554,465,515.25	96.77

5.2.3 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	600519	贵州茅台	39,675	25,507,057.50	4.45
2	601318	中国平安	379,238	24,005,765.40	4.19
3	600036	招商银行	674,252	18,798,145.76	3.28
4	601166	兴业银行	707,916	10,526,710.92	1.84
5	600000	浦发银行	951,148	9,758,778.48	1.70
6	000333	美的集团	230,997	9,309,179.10	1.62
7	601398	工商银行	1,677,000	9,005,490.00	1.57
8	601288	农业银行	2,313,900	8,399,457.00	1.47
9	002415	海康威视	290,776	8,071,941.76	1.41
10	000858	五粮液	125,629	7,729,952.37	1.35

5.2.4 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	-	-
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）	56,894.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,894.20	0.01

5.2.5 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

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	113517	曙光转债	330	35,343.00	0.01
2	110045	海澜转债	220	21,551.20	0.00
3					
4					
5					

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。



## 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.2.9.1 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	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1809	中证 500 股指期货 IC1809 合约	8	7,472,320.00	-420,974.55	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。
IF1809	沪深 300 股指期货 IF1809 合约	7	6,806,520.00	-246,935.29	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(元)					-667,909.84
股指期货投资本期收益(元)					-1,332,810.16
股指期货投资本期公允价值变动(元)					131,090.16

### 5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合，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。

## 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.2.10.2 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。

### 5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 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。

### 5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)

华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金  
(原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金转型) 2018 年第 3 季度报告

1	存出保证金	2,650,891.99
2	应收证券清算款	2,008,403.56
3	应收股利	-
4	应收利息	57,876.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,717,172.07

#### 5.2.11.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 5.2.11.5 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	000333	美的集团	9,309,179.10	1.62	重大事项

#### 5.2.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

### 6.1 华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	602,503,247.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,600,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	43,200,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	562,903,247.00

注：自 2018 年 9 月 17 日起，由《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效。

## 6.2 原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	557,503,247.00
报告期基金总申购份额	660,349,374.00
减：报告期基金总赎回份额	615,349,374.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	602,503,247.00

## §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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §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

#### 8.1.1 华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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
华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接	1	2018-09-17至2018-09-30	150,457,581.00	2,300,000.00	-	152,757,581.00	27.14%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 8.1.1 原 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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
华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	1	2018-07-01至2018-09-16	143,415,281.00	223,608,800.00	216,566,500.00	150,457,581.00	26.26%

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

本基金本报告期无已披露的重大事项。

#### 2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之

一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中小板 ETF、华夏中证 500ETF、华夏创业板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏快线货币 ETF 和华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF 等，初步形成了覆盖宽基指数、行业指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、A 股市场指数、海外市场指数、信用债指数等较为完整的产品线。

在客户服务方面，3 季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金网上交易平台上线闪购业务，为客户提供了更便捷的基金交易方式；（2）对在线智能服务进行全新升级，将机器人小夏全面升级为理财小助手，帮助投资人一搜即达，让投资理财更加便捷、高效；（3）与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作，为客户提供了更多理财渠道；（4）开展“世界那么大，定投华夏基金再出发”、“揭秘‘团长与团员默契度’”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 9.1.2 中国证监会准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更注册的文件；
- 9.1.3 《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 9.1.4 《华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 9.1.5 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 9.1.6 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 9.1.7 法律意见书；
- 9.1.8 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 9.1.9 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司  
二〇一八年十月二十六日