

天弘医疗健康混合型证券投资基金  
(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)

2018年半年度报告

2018年06月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2018年08月27日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

2018年1月18日天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金正式更名为“天弘医疗健康混合型证券投资基金”。原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金本报告期自2018年1月1日起至2018年1月17日止，天弘医疗健康混合型证券投资基金本报告期自2018年1月18日起至2018年6月30日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标(转型后)	7
3.2	主要会计数据和财务指标(转型前)	8
3.3	基金净值表现(天弘医疗健康混合型证券投资基金)	9
3.4	基金净值表现(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)	11
§4	管理人报告	13
4.1	基金管理人及基金经理情况	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6	半年度财务报表(天弘医疗健康混合型证券投资基金)(未经审计)	19
6.1	资产负债表(转型后)	19
6.2	利润表(转型后)	21
6.3	所有者权益(基金净值)变动表(转型后)	22
6.4	报表附注(转型后)	23
§7	半年度财务报表(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)(未经审计)	44
7.1	资产负债表(转型前)	44
7.2	利润表(转型前)	46
7.3	所有者权益(基金净值)变动表(转型前)	48
7.4	报表附注(转型前)	49
§8	投资组合报告(天弘医疗健康混合型证券投资基金)	72
8.1	期末基金资产组合情况	72
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	72
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	73
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	77
8.6	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	77
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	77
8.8	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	77

8.9	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	77
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	77
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12	本报告期投资基金情况	77
8.13	投资组合报告附注	77
§9	投资组合报告(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)	79
9.1	期末基金资产组合情况	79
9.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	79
9.3	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	81
9.4	报告期内股票投资组合的重大变动	84
9.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	86
9.6	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	86
9.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	87
9.8	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	87
9.9	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	87
9.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	87
9.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
9.12	本报告期投资基金情况	87
9.13	投资组合报告附注	87
§10	基金份额持有人信息(天弘医疗健康混合型证券投资基金)	88
10.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
10.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	89
10.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	89
§11	基金份额持有人信息(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)	89
11.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
11.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	90
11.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	90
11.4	发起式基金发起资金持有份额情况	91
§12	开放式基金份额变动	91
12.1	开放式基金份额变动(转型后)	91
12.2	开放式基金份额变动(转型前)	92
§13	重大事件揭示	92
13.1	基金份额持有人大会决议	92
13.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	93
13.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	93
13.4	基金投资策略的改变	93
13.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	93
13.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	93
13.7	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	93
13.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
13.9	其他重大事件	95
§14	影响投资者决策的其他重要信息	98
14.1	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	98
14.2	影响投资者决策的其他重要信息	99
§15	备查文件目录	99
15.1	备查文件目录	99
15.2	存放地点	99
15.3	查阅方式	100

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘医疗健康混合型证券投资基金（转型后）		
基金名称	天弘医疗健康混合型证券投资基金	
基金简称	天弘医疗健康	
基金主代码	001558	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01月18日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	173,690,195.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘医疗健康A	天弘医疗健康C
下属分级基金的交易代码	001558	001559
报告期末下属分级基金的份 额总额	65,172,643.74份	108,517,551.85份
2.1.2 天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金（转型前）		
基金名称	天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证大宗商品股票	
基金主代码	001558	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年06月30日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,922,808.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C
下属分级基金的交易代码	001558	001559
报告期末下属分级基金的份 额总额	14,349,581.95份	35,573,226.47份

## 2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘医疗健康混合型证券投资基金（转型后）	
投资目标	本基金通过优选医疗健康行业相关的优质股票，在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值，并力争实现超越业绩基准的投资回报。
投资策略	通过对宏观经济运行规律的研究，结合政策变化，综合运用定性与定量工具，判断经济周期运行位置及未来发展方向，合理调整组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
2.2.2 天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金（转型前）	
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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证大宗商品股票指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
天弘医疗健康混合型证券投	天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司

资基金（转型后）			
天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金(转型前)		天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	郭杰
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		95046	95565
传真		022-83865569	0755-82960794
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38层至45层
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38层至45层
邮政编码		300203	518026
法定代表人		井贤栋	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月18日-2018年6月30日）	
	天弘医疗健康A	天弘医疗健康C
本期已实现收益	1,388,412.64	2,498,803.59
本期利润	-1,436,247.53	1,306,470.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0501	0.0237
本期基金加权平均净值利润率	-5.46%	2.62%
本期基金份额净值增长率	10.04%	9.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-5,785,077.45	-10,460,772.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0888	-0.0964
期末基金资产净值	59,387,566.29	98,056,779.52
期末基金份额净值	0.9112	0.9036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.04%	9.85%

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金自2018年1月18日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。新基金合同生效日，指《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》生效日，即2018年1月18日，下同。

### 3.2 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.2.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日-2018年1月17日）	
	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C
本期已实现收益	601,906.01	1,944,663.89
本期利润	224,373.00	2,239,095.35
加权平均基金份额本期利润	0.0151	0.0418



本期基金加权平均净值利润率	1.80%	5.04%
本期基金份额净值增长率	1.57%	1.57%
3.2.2 期末数据和指标	报告期末(2018年1月17日)	
期末可供分配利润	-2,466,165.71	-6,310,519.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1719	-0.1774
期末基金资产净值	11,883,416.24	29,262,707.04
期末基金份额净值	0.8281	0.8226
3.2.3 累计期末指标	报告期末(2018年1月17日)	
基金份额累计净值增长率	-17.19%	-17.74%

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金自2018年1月18日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。

### 3.3 基金净值表现(天弘医疗健康混合型证券投资基金)

#### 3.3.1 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（转型后）

阶段 (天弘医疗健康A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-6.59%	1.89%	-6.20%	1.50%	-0.39%	0.39%
过去三个月	3.03%	1.59%	-0.06%	1.29%	3.09%	0.30%
自基金转型日起至今 (2018年1月18日 -2018年6月30日)	10.04%	1.34%	4.68%	1.28%	5.36%	0.06%
阶段 (天弘医疗健康C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④

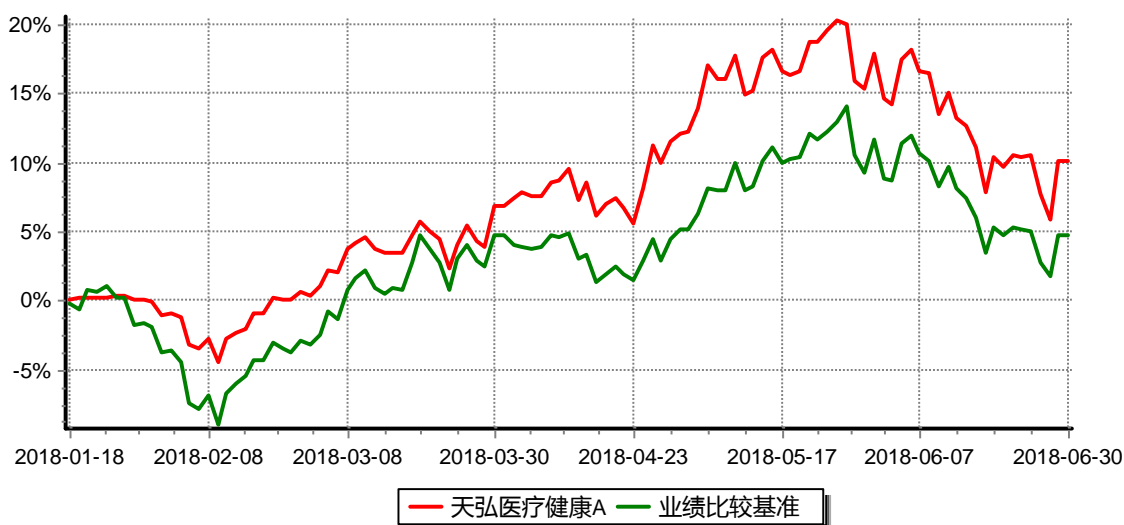
		差②	③	标准差 ④		
过去一个月	-6.61%	1.89%	-6.20%	1.50%	-0.41%	0.39%
过去三个月	2.94%	1.59%	-0.06%	1.29%	3.00%	0.30%
自基金转型日起至今 (2018年1月18日 -2018年6月30日)	9.85%	1.34%	4.68%	1.28%	5.17%	0.06%

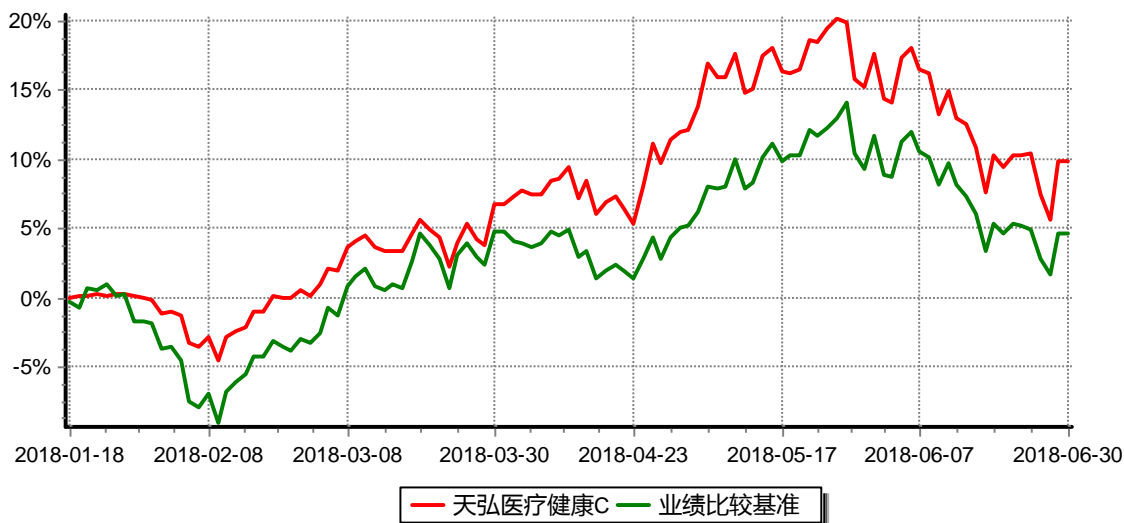
注：1、天弘医疗健康基金业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制，成份股包括中证 800 指数全部样本股（含沪深 300 指数和中证 500 指数的成份股）中属于医药卫生行业的上市公司，可以较好地反映沪深两市医疗健康领域上市公司股票的整体表现，适合作为本基金权益投资部分的业绩比较基准；中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛，适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

2、基金转型日，指天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金的日期，即2018年1月18日，下同。

### 3.3.2 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（转型后）

天弘医疗健康混合型证券投资基金  
份额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01月18日-2018年06月30日)





注：1、本基金于2018年1月18日由天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘医疗健康混合型证券投资基金”，自本基金转型起至披露时点不满一年。  
2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当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基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2018年1月18日-2018年7月17日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

### 3.4 基金净值表现(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)

#### 3.4.1 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(转型前)

阶段 (天弘中证大宗商品股票A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去六个月(2018年1月1日-2018年1月17日)	1.57%	1.16%	1.37%	1.20%	0.20%	-0.04%
过去一年(2017年7月1日-2018年1月17日)	11.71%	1.29%	12.82%	1.30%	-1.11%	-0.01%
过去三年(2015年7月1日-2018年1月17日)	-17.19%	1.99%	-10.98%	1.91%	-6.21%	0.08%
自基金合同生效日(2015年6月30日)起至2018年1月17日	-17.19%	1.99%	-6.84%	1.92%	-10.35%	0.07%

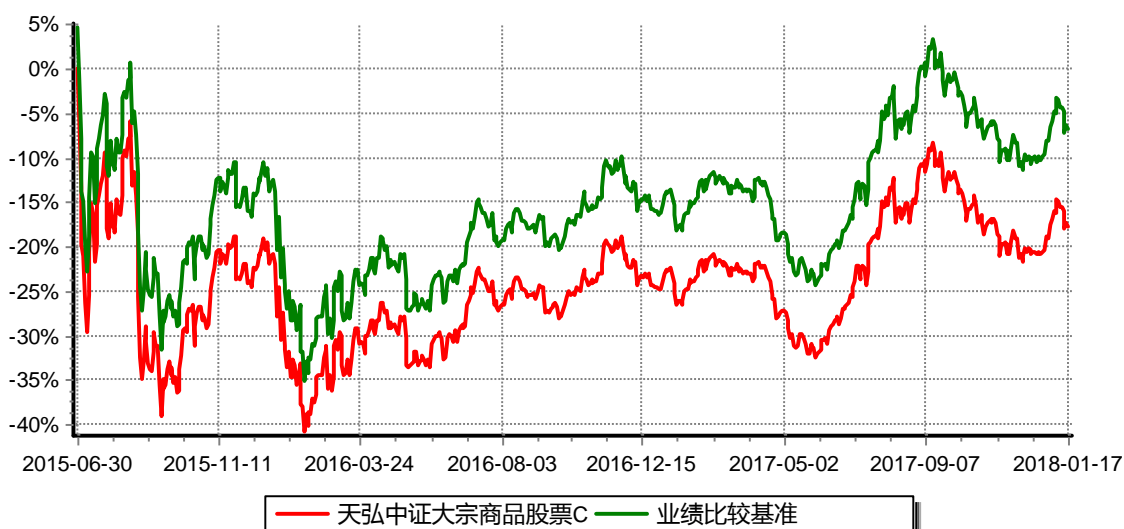
阶段 (天弘中证大宗商品股票C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去六个月(2018年1月1日-2018年1月17日)	1.57%	1.16%	1.37%	1.20%	0.20%	-0.04%
过去一年(2017年7月1日-2018年1月17日)	11.57%	1.29%	12.82%	1.30%	-1.25%	-0.01%
过去三年(2015年7月1日-2018年1月17日)	-17.74%	1.99%	-10.98%	1.91%	-6.76%	0.08%
自基金合同生效日(2015年6月30日)起至2018年1月17日	-17.74%	1.99%	-6.84%	1.92%	-10.90%	0.07%

注：1、天弘中证大宗商品基金业绩比较基准：中证大宗商品股票指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。中证大宗商品股票指数以中证800为样本空间，选取总市值最大的100家大宗商品类公司股票组成，采取等权重加权方式，用以反映大宗商品类股票的整体表现，并为指数化产品提供新的标的。

2、上述表格中的基金合同生效日，指《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日，即2015年6月30日。

### 3.4.2 自基金合同生效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（转型前）

天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金  
份额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06月30日-2018年01月17日)



注：天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同于2015年6月30日生效，于2018年1月18日成功转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%

天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2018年6月30日,本基金管理人共管理54只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金(原“天弘安康养老混合型证券投资基金”)、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金(LOF)、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金(原“天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金”)、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘量化驱动股票型证券投资基金(原“天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金”)、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起

式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	2018年01月	16年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。
刘盟盟	本基金基金经理。	2018年01月	—	15年	女，工商管理硕士。历任中财国企投资有限公司总裁助理，葛兰素史客（中国）投资有限公司销售行政主管，嘉实基金管理有限公司助理研究员。2012年2月加盟本公司，历任股票研究部研究员。
郭相博	本基金基金经理。	2018年01月	—	5年	男，技术管理硕士。历任北京同仁堂科技发展股份有限公司部门主管。2014年2月加盟本公司，历任股票研究部研究员。

注：1、上述任职日期为转型后基金合同生效日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

3、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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关

法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金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；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对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

报告期内，国内金融去杠杆的影响进一步显现，中美贸易摩擦升级，A股继续剧烈



波动,出现了较大幅度的向下调整。指数表现上,3月份表现突出的创业板指在2季度出现大幅调整,下跌了15.46%,而之前一直表现稳定的上证50、沪深300进入6月下旬也出现了明显的下挫。报告期内,上证综指下跌13.9%,深成指下跌15.04%,上证50下跌10.76%,沪深300指数下跌12.9%,中证500下跌16.53%。

报告期内,分行业来看,28个申万一级行业中仅有3个取得正收益,分别是休闲服务(+8.98%)、医药生物(+3.11%)、食品饮料(+0.14%),其中食品饮料2季度表现尤为突出,通信、综合和电气设备排名靠后。

报告期内,申万生物医药指数共上涨3.11个百分点,在28个申万一级行业中排名第二,医药行业经历了两年的调整,相对估值回到了有吸引力的水平,加之各细分领域龙头公司业绩加速,在2-3月份受到市场资金青睐出现快速拉升,之后2季度经历了一轮较大幅度的调整。从行业内部看,生物制品(+8.28%)、医疗服务(+14.85%)、化学制剂(+8.1%)跑赢医药指数,中药(-1.76%)、化学原料药(-4.10%)、医药商业(1.04%)、医疗器械(-3.52%)跑输医药指数。行业热点上,创新药主题继续延伸,外包服务类公司(CRO/CMO)表现突出,此外,景气度高的领域,如:疫苗、连锁药房等涨幅靠前。

进入2季度组合完成建仓,由于对2018年医药行业的投资机会判断相对乐观,但考虑到前期板块上涨过快,组合在报告期内保持了中性略高的仓位,结构上依然主要配置内生增长强劲、创新意愿和能力强以及行业变革期受益领域的标的,子行业上超配了化学制药、医疗器械,低配了中药。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日(2018年1月18日至2018年6月30日),天弘医疗健康A基金份额净值为0.9112元,天弘医疗健康C基金份额净值为0.9036元。报告期内份额净值增长率天弘医疗健康A为10.04%,天弘中证医疗健康C为9.85%,同期业绩比较基准增长率均为4.68%。

截至2018年1月17日(2018年1月1日至2018年1月17日),天弘中证大宗商品股票A基金份额净值为0.8281元,天弘中证大宗商品股票C基金份额净值为0.8226元。报告期内份额净值增长率天弘中证大宗商品股票A为1.57%,天弘中证大宗商品股票C为1.57%,同期业绩比较基准增长率均为1.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,医药行业虽然经历了疫苗事件的影响,但行业内在的增长逻辑并未发生改变。随着改革的深入,行业准入门槛提高、监管趋严,一场广泛的供给侧改革正在行业内部展开,企业的优胜劣汰加速进行,优质公司仍然具备较大的上升空间,因此我们维持下半年医药板块仍然以结构性行情为主的判断,投资方向上我们仍然看好:1)创新药及其相关产业(CRO/CMO),随着审批加速,过去数年的新药研发投入进入收获期,

业绩呈现加速增长；2) 慢病相关的优质仿制药，随着一致性评价推进市场格局有望重塑，相关公司有望获得更多的市场份额；3) 分级诊疗、处方外流、限制药占比等因素共同推动院外消费，零售连锁药房将持续受益；4) 消费升级以及居民健康意识提升带来的传统公立医疗机构以外的医疗服务需求受益的民营连锁医疗机构，如：民营眼科、体检等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自2018年1月18日至2018年4月13日止，本基金连续20个工作日以上基金资产净值低于人民币5000万元，但并未连续60个工作日出现上述情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## § 6 半年度财务报表(天弘医疗健康混合型证券投资基金)(未经审计)

转型后:

报告期(2018年01月18日-2018年06月30日)

### 6.1 资产负债表(转型后)

会计主体: 天弘医疗健康混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	27,911,647.09
结算备付金		734,791.61
存出保证金		221,927.49
交易性金融资产	6.4.7.2	130,833,267.41
其中: 股票投资		130,833,267.41
基金投资		—

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	13,739.77
应收股利		—
应收申购款		1,002,540.18
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		160,717,913.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		2,886,492.97
应付管理人报酬		185,618.07
应付托管费		30,936.36
应付销售服务费		29,799.47
应付交易费用	6.4.7.7	60,735.80
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	79,985.07
负债合计		3,273,567.74

<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	173,690,195.59
未分配利润	6.4.7.10	-16,245,849.78
所有者权益合计		157,444,345.81
负债和所有者权益总计		160,717,913.55

注：1、报告截止日2018年6月30日，天弘医疗健康混合型证券投资基金A类基金份额净值0.9112元，天弘医疗健康混合型证券投资基金C类基金份额净值0.9036元；基金份额总额173,690,195.59份，其中天弘医疗健康混合型证券投资基金A类基金份额65,172,643.74份，天弘医疗健康混合型证券投资基金C类基金份额108,517,551.85份。

2、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金于2018年1月18日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。本财务报表的实际编制期间为2018年1月18日(新基金合同生效日)至2018年6月30日，上年度完整期间的数据将在转型前表格中一并披露。

## 6.2 利润表（转型后）

会计主体：天弘医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月18日(新基金合同生效日)至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年01月18日(新基金合同生效日)至 2018年06月30日
一、收入		815,518.16
1. 利息收入		153,021.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	141,466.74
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		11,555.02
其他利息收入		—
2. 投资收益(损失以“-”填列)		4,156,517.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,407,206.38
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—

资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	749,310.88
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.117	-4,016,993.28
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	522,972.42
<b>减：二、费用</b>		945,295.21
1. 管理人报酬		498,161.76
2. 托管费		83,026.95
3. 销售服务费		87,139.93
4. 交易费用	6.4.7.19	204,024.15
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 税金及附加		—
7. 其他费用	6.4.7.20	72,942.42
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-129,777.05
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-129,777.05

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表(转型后)

会计主体：天弘医疗健康混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月18日(新基金合同生效日)至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月18日(新基金合同生效日)至2018年06月30

	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)	49,922,808.42	-8,776,685.14	41,146,123.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-129,777.05	-129,777.05
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)	123,767,387.17	-7,339,387.59	116,427,999.58
其中：1. 基金申购款	245,908,080.19	-18,171,089.68	227,736,990.51
2. 基金赎回款	-122,140,693.02	10,831,702.09	-111,308,990.93
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)	173,690,195.59	-16,245,849.78	157,444,345.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

-----  
基金管理人负责人

-----  
主管会计工作负责人

-----  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注(转型后)

### 6.4.1 基金基本情况

天弘医疗健康混合型证券投资基金系由天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金于本报告期内转型而来。新基金合同生效日为2018年1月18日，合同生效日的基金份额总额为48,848,618.04份基金份额；基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式通过的《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，基金管理人天弘基金管理有限公司于2018年1月18日发布了《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天

弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，基金管理人已将《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金托管协议》修订为《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》、《天弘医疗健康混合型证券投资基金托管协议》，并据此更新了《天弘医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》，上述文件已经中国证监会变更注册。《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和《天弘医疗健康混合型证券投资基金托管协议》自《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》发布之日，即2018年1月18日起生效，原《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金托管协议》将自同日失效。

根据《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》和《天弘医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的差异，将基金份额分为不同的类别。收取申购费用的，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘医疗健康混合型证券投资基金A类(以下简称“A类基金”)；不收取申购费用的，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘医疗健康混合型证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于本基金合同界定的医疗健康相关的股票资产不低于非现金基金资产的80%。投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率\*80%+中证综合债券指数收益率\*20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则



一基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月18日(新基金合同生效日)至2018年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月18日(新基金合同生效日)至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%和1%缴纳城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加和防洪工程维护费。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	27,911,647.09
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—

合计	27,911,647.09
----	---------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	134,296,499.75	130,833,267.41	-3,463,232.34
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	134,296,499.75	130,833,267.41	-3,463,232.34

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
应收活期存款利息	13,309.27
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—

应收结算备付金利息	330.60
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	99.90
合计	13,739.77

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	60,735.80
银行间市场应付交易费用	—
合计	60,735.80

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	643.72
预提费用	79,341.35
合计	79,985.07

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘医疗健康A)	本期2018年01月18日(新基金合同生效日)至2018年 06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

基金转型日	14,349,581.95	14,349,581.95
本期申购	89,118,889.51	89,118,889.51
本期赎回(以“-”号填列)	-38,295,827.72	-38,295,827.72
本期末	65,172,643.74	65,172,643.74

项目 (天弘医疗健康C)	本期2018年01月18日(新基金合同生效日)至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金转型日	35,573,226.47	35,573,226.47
本期申购	156,789,190.68	156,789,190.68
本期赎回(以“-”号填列)	-83,844,865.30	-83,844,865.30
本期末	108,517,551.85	108,517,551.85

注:1、根据《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》、《天弘医疗健康混合型证券投资基金招募说明书》、《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》的相关规定,自《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》发布之日起,原天弘中证大宗商品股票基金份额持有人转为天弘医疗健康混合型证券投资基金基金份额持有人,基金转型前后均正常办理日常赎回业务,根据《天弘基金管理有限公司关于天弘医疗健康混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资及转换业务的公告》,本基金自2018年1月24日起开放日常申购、定期定额投资及转换业务。

2、申购含转换转入份额;赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目 (天弘医疗健康A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型日	-1,070,895.04	-1,395,270.67	-2,466,165.71
本期利润	1,388,412.64	-2,824,660.17	-1,436,247.53
本期基金份额交易产生的变动数	-2,271,513.65	388,849.44	-1,882,664.21
其中:基金申购款	-3,895,266.01	-647,361.65	-4,542,627.66
基金赎回款	1,623,752.36	1,036,211.09	2,659,963.45
本期已分配利润	-	-	-

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

本期末	-1,953,996.05	-3,831,081.40	-5,785,077.45
-----	---------------	---------------	---------------

单位：人民币元

项目 (天弘医疗健康C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型日	-2,840,457.00	-3,470,062.43	-6,310,519.43
本期利润	2,498,803.59	-1,192,333.11	1,306,470.48
本期基金份额交易产生的变动数	-3,677,664.31	-1,779,059.07	-5,456,723.38
其中：基金申购款	-8,170,313.45	-5,458,148.57	-13,628,462.02
基金赎回款	4,492,649.14	3,679,089.50	8,171,738.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,019,317.72	-6,441,454.61	-10,460,772.33

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月 30日
活期存款利息收入	137,488.84
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,504.37
其他	1,473.53
合计	141,466.74

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月 30日
卖出股票成交总额	83,315,335.39

减：卖出股票成本总额	79,908,129.01
买卖股票差价收入	3,407,206.38

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得股票投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月 30日
股票投资产生的股利收益	749,310.88
基金投资产生的股利收益	—
合计	749,310.88

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月 30日
1. 交易性金融资产	-4,016,993.28
——股票投资	-4,016,993.28
——债券投资	—

—资产支持证券投资	—
—基金投资	—
—贵金属投资	—
—其他	—
2. 衍生工具	—
—权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-4,016,993.28

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月 30日
基金赎回费收入	501,213.81
基金转换费收入	21,758.61
合计	522,972.42

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金对持续持有任一类基金份额少于30天的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入基金财产。本基金对持有A类基金份额超过30天但少于3个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持有A类基金份额超过3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产；对持有A类基金份额超过6个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费，本基金对持续持有任一类基金份额少于30天的投资人收取的赎回费，将赎回费全额计入基金财产。本基金对持有A类基金份额超过30天但少于3个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持有A类基金份额超过3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产；对持有A类基金份额超过6个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日
交易所市场交易费用	204,024.15
银行间市场交易费用	—
合计	204,024.15

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日
审计费用	26,958.32
信息披露费	44,931.08
指数使用费	1,053.02
合计	72,942.42

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份 有限公司	76,736,599.44	29.33%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券股份 有限公司	17,751.07	18.21%	17,751.07	29.23%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	498,161.76

其中：支付销售机构的客户维护费	107,907.00
-----------------	------------

注：1. 支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	83,026.95

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 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01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日		
	天弘医疗健康A	天弘医疗健康C	合计
天弘基金管理有限公司	—	46,197.61	46,197.61
招商证券股份有限公司	—	47.33	47.33
合计	—	46,244.94	46,244.94

注：基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值X0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日	
	天弘医疗健康A	天弘医疗健康C
基金转型日（2018年1月18日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.88%	2.88%

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5 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01月18日（新基金合同生效日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	27,911,647.09	137,488.84

注：本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 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	期末 成本总额	期末 估值总额
000693	*ST华泽	2018-05-02	暂停上市	1.36	-	-	6400	113,888.66	8,704.00

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括权益类和固定收益类金融工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是力求通过资产配置和灵活运用多种投资策略，把握市场机会，在严格控制风

险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、审计部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制于可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年6月30日，本基金无债券投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或基金持仓资产在市场出现剧烈波动的情况下难以以合理价格变现。

为防范无法支付赎回款而产生的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。此外,基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2018年6月30日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度，要求根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
------------------------	------	------	------	-----	----



资产					
银行存款	27,911,647.09	—	—	—	27,911,647.09
结算备付金	734,791.61	—	—	—	734,791.61
存出保证金	221,927.49	—	—	—	221,927.49
交易性金融资产	—	—	—	130,833,267.41	130,833,267.41
应收利息	—	—	—	13,739.77	13,739.77
应收申购款	—	—	—	1,002,540.18	1,002,540.18
资产总计	28,868,366.19	—	—	131,849,547.36	160,717,913.55
负债					
应付赎回款	—	—	—	2,886,492.97	2,886,492.97
应付管理人报酬	—	—	—	185,618.07	185,618.07
应付托管费	—	—	—	30,936.36	30,936.36
应付销售服务费	—	—	—	29,799.47	29,799.47
应付交易费用	—	—	—	60,735.80	60,735.80
其他负债	—	—	—	79,985.07	79,985.07
负债总计	—	—	—	3,273,567.74	3,273,567.74
利率敏感度缺口	28,868,366.19	—	—	128,575,979.62	157,444,345.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于本基金合同界定的医疗健康相关的股票资产不低于非现金基金资产的 80%。投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	130,833,267.41	83.10
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—

衍生金融资产 —权证投资	—	—
其他	—	—
合计	130,833,267.41	83.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末2018年06月30日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	8,096,784.41
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-8,096,784.41

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次 金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为130,824,563.41元,无属于第二层次的余额,属于第三层次的余额为8,704.00元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具余额为8,704.00元。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产	合计
	权益工具投资	
2018年1月18日	-	-
购买	-	-
出售	-	-
转入第三层级	80,000.00	80,000.00
当期利得或损失总额	-71,296.00	-71,296.00
计入损益的利得或损失	-71,296.00	-71,296.00
2018年6月30日	8,704.00	8,704.00
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-71,296.00	-71,296.00

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动收益等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 半年度财务报表(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)(未经审计) 转型前：

报告期(2018年01月01日-2018年01月17日)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年01月17日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

		2018年01月17日	2017年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,523,853.97	11,035,158.02
结算备付金		769,798.73	102,369.85
存出保证金		149,059.30	94,913.43
交易性金融资产	7.4.7.2	36,434,684.47	110,404,462.64
其中: 股票投资		36,434,684.47	110,404,462.64
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	30,354.37	17,973.63
应收股利		—	—
应收申购款		654,688.28	5,576,775.00
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		43,562,439.12	127,231,652.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年01月17日</b>	<b>上年度末 2017年06月30日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	2,065,213.93
应付赎回款		2,214,587.91	3,753,333.90
应付管理人报酬		13,110.93	32,356.48
应付托管费		2,622.20	6,471.27

应付销售服务费		5,104.88	13,371.73
应付交易费用	7.4.7.7	34,615.96	56,201.87
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	146,273.96	139,756.04
负债合计		2,416,315.84	6,066,705.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	49,922,808.42	149,487,387.19
未分配利润	7.4.7.10	-8,776,685.14	-28,322,439.84
所有者权益合计		41,146,123.28	121,164,947.35
负债和所有者权益总计		43,562,439.12	127,231,652.57

注：1、报告截止日2018年1月17日，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.8281元，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.8226元；基金份额总额49,922,808.42份，其中天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金A类基金份额14,349,581.95份，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金C类基金份额35,573,226.47份。

2、本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年1月17日。

## 7.2 利润表（转型前）

会计主体：天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年01月17日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年01月01日至 2018年01月17日	上年度可比期间 2017年01月01日至 2017年06月30日
一、收入		2,612,454.07	22,443.85
1. 利息收入		12,380.74	11,149.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	12,380.74	11,149.21
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收		—	—

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

入			
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益(损失以“-”填列)		2,675,718.46	4,772.05
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	2,675,905.38	-68,650.11
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收 益	7.4.7.13. 2	—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	-186.92	73,422.16
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	-83,101.55	-1,549.16
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.18	7,456.42	8,071.75
<b>减: 二、费用</b>		148,985.72	170,777.51
1. 管理人报酬		13,110.93	43,161.45
2. 托管费		2,622.20	8,632.24
3. 销售服务费		5,104.88	8,566.51
4. 交易费用	7.4.7.19	120,148.78	29,952.35
5. 利息支出		—	—
其中: 卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		—	—
7. 其他费用	7.4.7.20	7,998.93	80,464.96
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		2,463,468.35	-148,333.66
减: 所得税费用		—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,463,468.35	-148,333.66
-------------------	--	--------------	-------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型前）

会计主体：天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年01月17日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年01月17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）	149,487,387.19	-28,322,439.84	121,164,947.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	2,463,468.35	2,463,468.35
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）	-99,564,578.77	17,082,286.35	-82,482,292.42
其中：1. 基金申购款	22,291,999.21	-3,698,986.70	18,593,012.51
2. 基金赎回款	-121,856,577.98	20,781,273.05	-101,075,304.93
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）	49,922,808.42	-8,776,685.14	41,146,123.28
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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）	24,085,420.45	-5,936,095.94	18,149,324.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-148,333.66	-148,333.66



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)	-142,270.93	-146,560.51	-288,831.44
其中：1. 基金申购款	38,443,290.23	-9,575,337.69	28,867,952.54
2. 基金赎回款	-38,585,561.16	9,428,777.18	-29,156,783.98
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)	23,943,149.52	-6,230,990.11	17,712,159.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注（转型前）

### 7.4.1 基金基本情况

天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1297号《关于准予天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定，首次募集期间为2015年6月29日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第860号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年6月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取申购费用的，而不是从本类别基

金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金 A类(以下简称“A类基金”);不收取申购费用的,而是在本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金 C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金为发起式基金,基金募集份额总额不少于1,000万份,基金募集金额不少于1,000万元,其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,以中证大宗商品股票指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证大宗商品股票指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准: : 中证大宗商品股票指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,发起式基金的基金合同生效三年后,若基金资产净值低于人民币两亿元的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年1月17日,本基金的基金资产净值为人民币41,146,123.28元,且本基金的基金合同将于未来6个月内生效满三年。基金管理人天弘

基金管理有限公司根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，自2018年1月18日起，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年1月17日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年1月17日的财务状况以及2018年1月1日至2018年1月17日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一年度会计报告所采用的会计政策一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以

后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%和1%缴纳城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加和防洪工程维护费。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年01月17日
活期存款	5,523,853.97
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	5,523,853.97

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年01月17日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,880,923.53	36,434,684.47	553,760.94
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	35,880,923.53	36,434,684.47	553,760.94

注：截至2018年1月17日，股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2018年01月17日
应收活期存款利息	29,618.81
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	579.40
应收债券利息	—

应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	156.16
合计	30,354.37

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2018年01月17日
交易所市场应付交易费用	34,615.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	34,615.96

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年01月17日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	275.03
预提费用	137,451.95
其他应付	8,546.98
合计	146,273.96

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证大宗商品股票A)	本期 2018年01月01日至2018年01月17日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,951,640.83	16,951,640.83

本期申购	1,680,883.73	1,680,883.73
本期赎回(以“-”号填列)	-4,282,942.61	-4,282,942.61
本期末	14,349,581.95	14,349,581.95
项目 (天弘中证大宗商品股票C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	132,535,746.36	132,535,746.36
本期申购	20,611,115.48	20,611,115.48
本期赎回(以“-”号填列)	-117,573,635.37	-117,573,635.37
本期末	35,573,226.47	35,573,226.47

注:申购含转换转入份额;赎回含转换转出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目 (天弘中证大宗商品股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,960,292.09	-1,171,309.08	-3,131,601.17
本期利润	601,906.01	-377,533.01	224,373.00
本期基金份额交易产生的变动数	287,491.04	153,571.42	441,062.46
其中:基金申购款	-130,179.17	-129,548.77	-259,727.94
基金赎回款	417,670.21	283,120.19	700,790.40
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-1,070,895.04	-1,395,270.67	-2,466,165.71

单位:人民币元

项目 (天弘中证大宗商品股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,966,639.25	-9,224,199.42	-25,190,838.67
本期利润	1,944,663.89	294,431.46	2,239,095.35
本期基金份额交易产生的变	11,181,518.36	5,459,705.53	16,641,223.89

动数			
其中：基金申购款	-1,781,404.85	-1,657,853.91	-3,439,258.76
基金赎回款	12,962,923.21	7,117,559.44	20,080,482.65
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-2,840,457.00	-3,470,062.43	-6,310,519.43

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年01月17日
活期存款利息收入	11,742.75
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	528.80
其他	109.19
合计	12,380.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年01月17日
卖出股票成交总额	78,409,490.64
减：卖出股票成本总额	75,733,585.26
买卖股票差价收入	2,675,905.38

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得股票投资收益。

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。



#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年01月17日
股票投资产生的股利收益	-186.92
基金投资产生的股利收益	—
合计	-186.92

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年01月17日
1. 交易性金融资产	-83,101.55
——股票投资	-83,101.55
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-83,101.55

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年01月17日
基金赎回费收入	6,872.74
基金转换费收入	583.68
合计	7,456.42

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金对持续持有A类基金份额少于7天的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金资产，C类基金份额的赎回费总额全部归入基金资产。  
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中对持续持有A类基金份额少于7天的投资人，转出A类基金份额的赎回费总额的不低于25%归入基金资产，转出C类基金份额的赎回费总额全部归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年01月17日
交易所市场交易费用	120,148.78
银行间市场交易费用	—
合计	120,148.78

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年01月17日
审计费用	2,794.46
信息披露费	4,657.49
指数使用费	546.98
合计	7,998.93

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，自2018年1月18日起，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。具体信息请参见基金管理人于2018年1月18日在指定媒介披露的《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年01月 17日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
招商证券股份 有限公司	—	—	19,618,225.63	100.00%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年01月17日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	18,270.85	100.00%	8,684.64	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年01月17日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	13,110.93
其中：支付销售机构的客户维护费	3,400.94	6,315.85

注：1. 支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保

有量提取一定比例的客户维护费,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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年01月17日	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,622.20	8,632.24

注:支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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01月01日至2018年01月17日		
	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C	合计
天弘基金管理有限公司	—	486.13	486.13
招商证券股份有限公司	—	0.68	0.68
合计	—	486.81	486.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日		
	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C	合计
天弘基金管理有限公司	—	4609.48	4609.48
招商证券股份有限公司	—	—	—
合计	—	4609.48	4609.48

注:基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给天弘基金管理有限公司,再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年01 月17日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06 月30日	
	天弘中证大 宗商品股票A	天弘中证大 宗商品股票C	天弘中证大 宗商品股票A	天弘中证大 宗商品股票C
期初持有的基金份额	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0	5,000,000.0 0
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.02%	10.02%	20.88%	20.88

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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01月01日至2018 年01月17日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份	5,523,853.97	11,742.75	1,120,380.65	10,802.50

有限公司				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2018年01月17日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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	期末成本总额	期末估值总额
600614	鹏起科技	2017-12-26	重大资产重组	10.16	2018-04-26	9.14	99,102	1,083,930.68	1,006,876.32
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	2018-06-04	40.08	24,584	925,623.98	932,716.96
002470	金正大	2017-10-25	筹划发行股份购买资产	9.15	2018-02-09	8.24	69,900	572,601.43	639,585.00
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34	2018-05-14	12.01	46,700	610,820.56	622,978.00
600277	亿利洁能	2018-01-16	重大资产重组	6.94	2018-01-30	6.35	52,700	338,390.47	365,738.00
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.41	2018-02-26	7.28	56,801	343,239.19	364,094.41
002200	华邦健康	2017-12-14	筹划非公开发行股票事宜	6.73	2018-03-17	7.30	52,100	396,391.09	350,633.00
60015	永泰	2017-	重大资产	3.36	2018-	3.03	99,50	367,202.6	334,320.0

7	能源	11-21	重组		04-04		0	5	0
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-01-29	5.70	45,302	284,289.72	260,486.50
000693	*ST华泽	2016-03-01	重大资产重组	12.50	2018-03-21	11.88	6,400	113,888.66	80,000.00

注：本基金截至2018年1月17日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年1月17日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年1月17日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证大宗商品指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、审计部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部负责，



对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;内控合规部对公司总经理负责,并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置,保证各投资组合的投资比例合规;参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估,保证各投资组合场外交易的事中合规控制;负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年1月17日,本基金无债券投资(2017年12月31日:同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或基金持仓资产在市场出现剧烈波动的情况下难以以合理价格变现。

为防范无法支付赎回款而产生的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。此外,基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,

可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2018年1月17日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度,要求根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年01月17 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,523,853.97	—	—	—	5,523,853.97
结算备付金	769,798.73	—	—	—	769,798.73
存出保证金	149,059.30	—	—	—	149,059.30
交易性金融资产	—	—	—	36,434,684.47	36,434,684.47
应收利息	—	—	—	30,354.37	30,354.37
应收申购款	—	—	—	654,688.28	654,688.28
资产总计	6,442,712.00	—	—	37,119,727.12	43,562,439.12

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

负债					
应付赎回款	—	—	—	2,214,587.91	2,214,587.91
应付管理人报酬	—	—	—	13,110.93	13,110.93
应付托管费	—	—	—	2,622.20	2,622.20
应付销售服务费	—	—	—	5,104.88	5,104.88
应付交易费用	—	—	—	34,615.96	34,615.96
其他负债	—	—	—	146,273.96	146,273.96
负债总计	—	—	—	2,416,315.84	2,416,315.84
利率敏感度缺口	6,442,712.00	—	—	34,703,411.28	41,146,123.28
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,035,158.02	—	—	—	11,035,158.02
结算备付金	102,369.85	—	—	—	102,369.85
存出保证金	94,913.43	—	—	—	94,913.43
交易性金融资产	—	—	—	110,404,462.64	110,404,462.64
应收利息	—	—	—	17,973.63	17,973.63
应收申购款	—	—	—	5,576,775.00	5,576,775.00
资产总计	11,232,441.30	—	—	115,999,211.27	127,231,652.57
负债					
应付证券清算款	—	—	—	2,065,213.93	2,065,213.93

应付赎回款	—	—	—	3,753,333.90	3,753,333.90
应付管理人报酬	—	—	—	32,356.48	32,356.48
应付托管费	—	—	—	6,471.27	6,471.27
应付销售服务费	—	—	—	13,371.73	13,371.73
应付交易费用	—	—	—	56,201.87	56,201.87
其他负债	—	—	—	139,756.04	139,756.04
负债总计	—	—	—	6,066,705.22	6,066,705.22
利率敏感度缺口	11,232,441.30	—	—	109,932,506.05	121,164,947.35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年1月17日，本基金未持有交易性债券投资(2017年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证大宗商品指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年01月17日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	36,434,684.47	88.55	110,404,462.64	91.12
交易性金融资产-基金投资	—	—		
交易性金融资产-贵金属投资	—	—		
衍生金融资产-权证投资	—	—		
其他	—	—		
合计	36,434,684.47	88.55	110,404,462.64	91.12

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2018年01月17日	上年度末 2017年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	2,934,170.27	9,027,422.45
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-2,934,170.27	-9,027,422.45

#### 7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次 金融工具公允价值

于2018年1月17日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为31,477,256.28元，属于第二层次的余额为4,957,428.19元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次105,798,004.19元，第二层次4,606,458.45元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年1月17日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告(天弘医疗健康混合型证券投资基金)

转型后:

报告期(2018年01月18日-2018年06月30日)

### 8.1 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	130,833,267.41	81.41
	其中:股票	130,833,267.41	81.41
2	基金投资		
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	28,646,438.70	17.82
8	其他各项资产	1,238,207.44	0.77
9	合计	160,717,913.55	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,704.00	0.01
C	制造业	109,684,519.16	69.67
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	16,765,753.25	10.65
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	3,769,515.00	2.39
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	604,776.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	130,833,267.41	83.10

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600329	中新药业	566,504	10,763,576.00	6.84
2	600521	华海药业	300,366	8,016,768.54	5.09
3	603707	健友股份	240,840	6,533,989.20	4.15
4	000513	丽珠集团	136,370	5,993,461.50	3.81
5	300357	我武生物	142,898	5,697,343.26	3.62
6	000963	华东医药	112,953	5,449,982.25	3.46
7	600867	通化东宝	202,320	4,849,610.40	3.08
8	000538	云南白药	45,300	4,845,288.00	3.08
9	002262	恩华药业	239,361	4,789,613.61	3.04
10	601607	上海医药	194,800	4,655,720.00	2.96
11	600276	恒瑞医药	58,480	4,430,444.80	2.81

12	600196	复星医药	98,200	4,064,498.00	2.58
13	300558	贝达药业	69,870	3,889,662.90	2.47
14	600998	九州通	223,600	3,792,256.00	2.41
15	603259	药明康德	39,700	3,769,515.00	2.39
16	603387	基蛋生物	72,660	3,689,674.80	2.34
17	600529	山东药玻	142,298	3,462,110.34	2.20
18	603520	司太立	160,500	3,437,910.00	2.18
19	002019	亿帆医药	193,700	3,418,805.00	2.17
20	300009	安科生物	184,904	3,409,629.76	2.17
21	600380	健康元	286,100	3,393,146.00	2.16
22	300642	透景生命	55,350	3,304,395.00	2.10
23	002007	华兰生物	100,200	3,222,432.00	2.05
24	002370	亚太药业	212,100	2,880,318.00	1.83
25	600535	天士力	93,400	2,411,588.00	1.53
26	600518	康美药业	94,600	2,164,448.00	1.37
27	002332	仙琚制药	231,100	2,022,125.00	1.28
28	000661	长春高新	8,600	1,958,220.00	1.24
29	002727	一心堂	52,700	1,710,115.00	1.09
30	600062	华润双鹤	53,900	1,323,245.00	0.84
31	300595	欧普康视	29,340	1,315,018.80	0.84
32	002773	康弘药业	22,925	1,192,329.25	0.76
33	000028	国药一致	23,200	1,157,680.00	0.74
34	300529	健帆生物	23,750	1,018,637.50	0.65
35	600771	广誉远	17,600	967,296.00	0.61
36	600436	片仔癀	5,750	643,597.50	0.41
37	002044	美年健康	26,760	604,776.00	0.38
38	300003	乐普医疗	13,100	480,508.00	0.31
39	002020	京新药业	8,050	94,829.00	0.06
40	000693	*ST华泽	6,400	8,704.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600329	中新药业	10,386,759.60	6.60
2	600521	华海药业	9,995,142.60	6.35
3	603707	健友股份	8,495,946.45	5.40
4	000513	丽珠集团	8,480,923.00	5.39
5	300357	我武生物	5,348,012.03	3.40
6	002019	亿帆医药	5,252,270.19	3.34
7	601607	上海医药	5,149,058.00	3.27
8	600867	通化东宝	5,092,339.39	3.23
9	002262	恩华药业	5,017,639.65	3.19
10	000963	华东医药	4,996,408.77	3.17
11	603520	司太立	4,719,652.76	3.00
12	000538	云南白药	4,707,530.00	2.99
13	603259	药明康德	4,688,179.00	2.98
14	300558	贝达药业	4,613,366.40	2.93
15	603387	基蛋生物	4,342,875.40	2.76
16	600196	复星医药	4,213,089.00	2.68
17	600998	九州通	4,191,713.00	2.66
18	002370	亚太药业	4,121,080.08	2.62
19	300642	透景生命	3,946,123.50	2.51
20	600276	恒瑞医药	3,944,263.48	2.51
21	600062	华润双鹤	3,847,986.40	2.44
22	002773	康弘药业	3,578,164.00	2.27
23	300009	安科生物	3,560,601.52	2.26
24	600529	山东药玻	3,352,490.88	2.13
25	002007	华兰生物	3,290,960.13	2.09
26	002524	光正集团	3,163,722.55	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

#### 8.4.2 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	002020	京新药业	2,774,279.30	1.76
2	600062	华润双鹤	2,521,429.00	1.60
3	002524	光正集团	2,488,481.60	1.58
4	603707	健友股份	2,402,660.99	1.53
5	002773	康弘药业	2,341,607.50	1.49
6	002390	信邦制药	2,093,558.50	1.33
7	600211	西藏药业	1,985,874.60	1.26
8	600420	现代制药	1,935,303.98	1.23
9	300601	康泰生物	1,891,476.12	1.20
10	600511	国药股份	1,714,565.40	1.09
11	002019	亿帆医药	1,705,589.68	1.08
12	603233	大参林	1,533,609.01	0.97
13	600521	华海药业	1,455,782.34	0.92
14	600285	羚锐制药	1,399,998.50	0.89
15	000513	丽珠集团	1,390,505.00	0.88
16	000028	国药一致	1,163,809.00	0.74
17	600771	广誉远	1,158,097.90	0.74
18	300630	普利制药	1,153,388.00	0.73
19	600713	南京医药	1,150,354.81	0.73
20	300529	健帆生物	1,136,869.00	0.72

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

#### 8.4.3 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	178,323,705.23
卖出股票收入（成交）总额	83,315,335.39

注：本项“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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末投资基金。

#### 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 8.13.3 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	221,927.49
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	13,739.77
5	应收申购款	1,002,540.18
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,238,207.44

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.13.6 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。

## § 9 投资组合报告(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)

转型前:

报告期(2018年01月01日-2018年01月17日)

### 9.1 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	36,434,684.47	83.64
	其中:股票	36,434,684.47	83.64
2	基金投资		
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	6,293,652.70	14.45
8	其他各项资产	834,101.95	1.91
9	合计	43,562,439.12	100.00

### 9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 9.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	3,222,937.53	7.83
B	采矿业	11,489,711.36	27.92
C	制造业	20,592,334.32	50.05
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	1,049,701.26	2.55
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	36,354,684.47	88.36

### 9.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	80,000.00	0.19
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	—	—



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	80,000.00	0.19

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

### 9.3 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

#### 9.3.1 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所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600614	鹏起科技	99,102	1,006,876.32	2.45
2	600309	万华化学	24,584	932,716.96	2.27
3	002470	金正大	69,900	639,585.00	1.55
4	000930	中粮生化	46,700	622,978.00	1.51
5	600426	华鲁恒升	26,004	457,930.44	1.11
6	600516	方大炭素	14,120	435,037.20	1.06
7	002714	牧原股份	7,001	429,161.30	1.04
8	002078	太阳纸业	39,600	416,592.00	1.01
9	000792	盐湖股份	25,953	407,202.57	0.99
10	600188	兖州煤业	25,600	406,272.00	0.99
11	600028	中国石化	57,500	404,225.00	0.98
12	002428	云南锗业	31,701	402,285.69	0.98
13	603993	洛阳钼业	49,400	398,658.00	0.97
14	600547	山东黄金	11,902	394,194.24	0.96

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

15	600598	北大荒	32,700	392,727.00	0.95
16	601899	紫金矿业	87,600	390,696.00	0.95
17	601678	滨化股份	45,380	389,814.20	0.95
18	000876	新希望	46,400	387,440.00	0.94
19	000975	银泰资源	26,687	386,427.76	0.94
20	600392	盛和资源	20,757	385,249.92	0.94
21	000807	云铝股份	39,100	383,962.00	0.93
22	600673	东阳光科	49,200	382,776.00	0.93
23	002041	登海种业	29,901	380,639.73	0.93
24	600688	上海石化	55,400	379,490.00	0.92
25	601958	金钼股份	49,601	379,447.65	0.92
26	002155	湖南黄金	39,101	378,497.68	0.92
27	600160	巨化股份	34,002	377,082.18	0.92
28	000983	西山煤电	36,607	376,319.96	0.91
29	601699	潞安环能	33,601	374,651.15	0.91
30	002299	圣农发展	24,600	372,690.00	0.91
31	601857	中国石油	42,200	372,204.00	0.90
32	600489	中金黄金	36,739	371,431.29	0.90
33	000830	鲁西化工	20,200	370,468.00	0.90
34	601225	陕西煤业	41,700	370,296.00	0.90
35	002311	海大集团	16,998	370,046.46	0.90
36	601001	大同煤业	57,100	367,724.00	0.89
37	600348	阳泉煤业	49,202	367,538.94	0.89
38	000878	云南铜业	26,901	366,660.63	0.89
39	600277	亿利洁能	52,700	365,738.00	0.89
40	002221	东华能源	29,802	364,478.46	0.89
41	601600	中国铝业	56,801	364,094.41	0.88
42	000937	冀中能源	60,500	363,605.00	0.88
43	002385	大北农	54,800	362,776.00	0.88
44	601088	中国神华	15,401	362,385.53	0.88
45	601168	西部矿业	44,185	362,317.00	0.88

天弘医疗健康混合型证券投资基金(原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型)  
2018年半年度报告

46	000488	晨鸣纸业	20,200	361,782.00	0.88
47	601898	中煤能源	58,700	359,244.00	0.87
48	600108	亚盛集团	85,600	358,664.00	0.87
49	600362	江西铜业	18,704	358,555.68	0.87
50	000998	隆平高科	13,900	357,647.00	0.87
51	000060	中金岭南	32,401	357,383.03	0.87
52	002092	中泰化学	25,000	356,500.00	0.87
53	000960	锡业股份	27,000	355,050.00	0.86
54	002588	史丹利	51,700	353,111.00	0.86
55	600141	兴发集团	20,600	352,466.00	0.86
56	600811	东方集团	74,490	351,592.80	0.85
57	600618	氯碱化工	30,604	351,333.92	0.85
58	002004	华邦健康	52,100	350,633.00	0.85
59	002002	鸿达兴业	50,301	349,591.95	0.85
60	600395	盘江股份	50,213	346,971.83	0.84
61	000552	靖远煤电	97,000	346,290.00	0.84
62	603077	和邦生物	165,620	346,145.80	0.84
63	600256	广汇能源	71,700	345,594.00	0.84
64	000630	铜陵有色	123,700	343,886.00	0.84
65	600366	宁波韵升	20,200	343,400.00	0.83
66	603799	华友钴业	4,103	343,256.98	0.83
67	000758	中色股份	53,700	342,069.00	0.83
68	600111	北方稀土	24,501	340,318.89	0.83
69	600971	恒源煤电	32,400	339,552.00	0.83
70	600737	中粮糖业	41,600	339,456.00	0.83
71	002477	雏鹰农牧	74,700	339,138.00	0.82
72	002340	格林美	49,714	339,049.48	0.82
73	600219	南山铝业	94,050	338,580.00	0.82
74	600438	通威股份	30,400	336,528.00	0.82
75	600759	洲际油气	73,500	335,895.00	0.82
76	002128	露天煤业	31,100	335,569.00	0.82

77	600549	厦门钨业	13,802	334,836.52	0.81
78	600157	永泰能源	99,500	334,320.00	0.81
79	002018	*ST华信	49,500	333,630.00	0.81
80	002466	天齐锂业	6,627	333,073.02	0.81
81	601020	华钰矿业	17,100	332,937.00	0.81
82	002505	大康农业	123,800	331,784.00	0.81
83	002408	齐翔腾达	26,061	324,459.45	0.79
84	000762	西藏矿业	21,703	323,157.67	0.79
85	002250	联化科技	32,105	321,371.05	0.78
86	600409	三友化工	33,401	320,315.59	0.78
87	601212	白银有色	50,800	319,532.00	0.78
88	600259	广晟有色	8,810	318,305.30	0.77
89	002392	北京利尔	62,800	315,256.00	0.77
90	002407	多氟多	15,808	315,053.44	0.77
91	000426	兴业矿业	32,500	313,625.00	0.76
92	000723	美锦能源	46,800	312,156.00	0.76
93	000612	焦作万方	36,202	301,562.66	0.73
94	600338	西藏珠峰	7,806	289,290.36	0.70
95	002460	赣锋锂业	4,800	285,600.00	0.69
96	000969	安泰科技	33,802	285,288.88	0.69
97	000592	平潭发展	45,302	260,486.50	0.63

### 9.3.2 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所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000693	*ST华泽	6,400	80,000.00	0.19

### 9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 9.4.1 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	603799	华友钴业	35,320.00	0.03
2	600426	华鲁恒升	31,535.00	0.03
3	002466	天齐锂业	30,740.00	0.03
4	000792	盐湖股份	30,049.00	0.02
5	000998	隆平高科	28,757.00	0.02
6	601088	中国神华	28,480.00	0.02
7	000878	云南铜业	28,015.00	0.02
8	002041	登海种业	27,955.00	0.02
9	002428	云南锗业	27,037.00	0.02
10	000488	晨鸣纸业	26,822.00	0.02
11	002078	太阳纸业	26,429.00	0.02
12	600547	山东黄金	26,052.00	0.02
13	002221	东华能源	25,912.00	0.02
14	600489	中金黄金	25,776.00	0.02
15	600366	宁波韵升	25,749.00	0.02
16	601020	华钰矿业	25,635.00	0.02
17	000983	西山煤电	25,426.00	0.02
18	600348	阳泉煤业	25,372.00	0.02
19	000830	鲁西化工	25,300.00	0.02
20	600673	东阳光科	25,292.00	0.02

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 9.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600426	华鲁恒升	1,103,477.00	0.91
2	600516	方大炭素	1,046,800.00	0.86

3	000807	云铝股份	1,014,582.00	0.84
4	601699	潞安环能	1,013,989.00	0.84
5	601899	紫金矿业	995,607.00	0.82
6	600188	兖州煤业	985,857.00	0.81
7	600392	盛和资源	966,817.50	0.80
8	600438	通威股份	963,010.00	0.79
9	601678	滨化股份	939,047.00	0.78
10	002311	海大集团	938,632.00	0.77
11	002428	云南锗业	935,907.00	0.77
12	002221	东华能源	935,573.00	0.77
13	000983	西山煤电	934,058.00	0.77
14	002466	天齐锂业	934,031.10	0.77
15	002078	太阳纸业	927,937.00	0.77
16	600028	中国石化	924,902.00	0.76
17	600160	巨化股份	923,797.00	0.76
18	002041	登海种业	919,981.00	0.76
19	600256	广汇能源	919,442.00	0.76
20	600547	山东黄金	918,413.16	0.76

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

#### 9.4.3 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	1,846,908.64
卖出股票收入（成交）总额	78,409,490.64

注：本项“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。

#### 9.5 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。

#### 9.6 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。

### 9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 9.8 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。

### 9.9 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。

### 9.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 9.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末投资基金。

### 9.13 投资组合报告附注

9.13.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

9.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 9.13.3 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	149,059.30
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	30,354.37
5	应收申购款	654,688.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	834,101.95

#### 9.13.4 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。

#### 9.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 9.13.5.1 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不存在流通受限情况。

##### 9.13.5.2 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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000693	*ST华泽	80,000.00	0.19	重大资产重组

注：\*ST华泽被调出成分股后停牌，故以积极投资股票列示。

#### 9.13.6 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。

### § 10 基金份额持有人信息(天弘医疗健康混合型证券投资基金)

转型后：

报告期（2018年01月18日-2018年06月30日）

#### 10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘医疗健康A	13,945	4,673.55	15,362,731.89	23.57%	49,809,911.85	76.43%
天弘医疗健康C	11,208	9,682.15	48,348,395.02	44.55%	60,169,156.83	55.45%



合计	25,153	6,905.35	63,711,126 .91	36.68%	109,979,06 8.68	63.32%
----	--------	----------	-------------------	--------	--------------------	--------

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对A、C类分级基金，比例的分母采用A、C类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、C类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 10.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	天弘医疗健康A	149,935.05	0.14%
	天弘医疗健康C	240,321.60	0.37%
	合计	390,256.65	0.22%

### 10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	天弘医疗健康A	10~50
	天弘医疗健康C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘医疗健康A	-
	天弘医疗健康C	-
	合计	-

### § 11 基金份额持有人信息(天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金)

转型前：

报告期（2018年01月01日-2018年01月17日）

#### 11.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
天弘中 证大宗 商品股 票A	3,593	3,993.76	5,000,000. 00	34.84%	9,349,581. 95	65.16%
天弘中 证大宗 商品股 票C	2,845	12,503.77	5,000,000. 00	14.06%	30,573,226 .47	85.94%
合计	6,438	7,754.40	10,000,000 .00	20.03%	39,922,808 .42	79.97%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对A、C类分级基金，比例的分母采用A、C类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、C类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 11.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从 业人员持有本开放式 基金	天弘中证大 宗商品股票 A	3,608.85	0.01%
	天弘中证大 宗商品股票 C	791.27	0.01%
	合计	4,400.12	0.010%

### 11.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证大宗商品股 票A	—
	天弘中证大宗商品股 票C	—

	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证大宗商品股票A	—
	天弘中证大宗商品股票C	—
	合计	—

#### 11.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	20.03%	10,000,000.00	20.03%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,000.00	20.03%	10,000,000.00	20.03%	

注：转型后的天弘医疗健康混合型证券投资基金为非发起式基金。

### § 12 开放式基金份额变动

#### 12.1 开放式基金份额变动(转型后)

报告期：2018年1月18日至2018年6月30日

单位：份

项目	天弘医疗健康A	天弘医疗健康C
基金转型日(2018年01月18日)基金份额总额	14,349,581.95	35,573,226.47
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	89,118,889.51	156,789,190.68
减：基金转型日起至报告期期末基金	38,295,827.72	83,844,865.30

总赎回份额		
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—	—
本报告期期末基金份额总额	65,172,643.74	108,517,551.85

注：1、本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，自2018年1月18日起，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。

2、总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## 12.2 开放式基金份额变动(转型前)

报告期：2018年1月1日至2018年1月18日

单位：份

项目	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C
基金合同生效日(2015年06月30日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	16,951,640.83	132,535,746.36
本报告期期间基金总申购份额	1,680,883.73	20,611,115.48
减：本报告期期间基金总赎回份额	4,282,942.61	117,573,635.37
本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	14,349,581.95	35,573,226.47

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 13 重大事件揭示

### 13.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，基金份额持有人决定的事项自表决通过之日起生效。根据2018年1月16日的计票结果，本次会议议案获得通过，本次大会决议自2018年1月16日起生效。本基金管理人已将表决通过的事项报中国证监会备案。自2018年1月18日起，原《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金合同基金合同》、《天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金托管协议》失效，《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合

同》、《天弘医疗健康混合型证券投资基金托管协议》同日起生效。

### 13.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金的基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 13.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 13.4 基金投资策略的改变

本报告期内，转型后的天弘医疗健康混合型证券投资基金与原天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金相比，在投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等内容均有所调整。调整后的上述内容可查阅本基金管理人于2018年1月18日在指定媒介披露的《天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同》中的相关约定。

### 13.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

### 13.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 13.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内未发现本基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

### 13.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 13.8.1 天弘医疗健康混合型证券投资基金

##### 13.8.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证	2	—	—	—	—	—

券						
光大证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	56,497,290 .80	21.59%	24,368.15	24.99%	—
兴业证券	1	128,405,15 0.38	49.08%	55,381.68	56.80%	—
招商证券	2	76,736,599 .44	29.33%	17,751.07	18.21%	—

### 13.8.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
东方财富证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	10,500,000.00	100.00%	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：2个，其中包括光大证券上海交易单元1个，海通证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 13.8.2 天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东方财富证 券	2	34,549,073 .27	43.05%	14,901.73	43.05%	—
华泰证券	1	23,862,172 .29	29.73%	10,292.01	29.73%	—
兴业证券	1	21,845,153 .72	27.22%	9,422.22	27.22%	—
招商证券	2	—	—	—	—	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营  
状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研  
究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场  
分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证  
券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 13.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于天弘 中证大宗商品股票指数型发起式 证券投资基金暂停申购、定投及 转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-01-16
2	关于天弘中证大宗商品股票指数 型发起式证券投资基金基金份额 持有人大会决议生效的公告	中国证监会指定媒介	2018-01-18
3	天弘医疗健康混合型证券投资基 金招募说明书	中国证监会指定媒介	2018-01-18
4	天弘医疗健康混合型证券投资基	中国证监会指定媒介	2018-01-18

	金托管协议		
5	天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定媒介	2018-01-18
6	天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2018-01-18
7	天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2018-01-19
8	天弘基金管理有限公司关于天弘医疗健康混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-01-23
9	天弘基金管理有限公司关于增加光大证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-01-24
10	天弘基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-02-02
11	天弘基金管理有限公司关于在上海利得基金销售有限公司开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-02-06
12	天弘基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-02
13	天弘基金管理有限公司关于增加恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-15



14	天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2018-03-29
15	天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金2017年年度报告	中国证监会指定媒介	2018-03-29
16	天弘基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
17	天弘基金管理有限公司关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
18	天弘基金管理有限公司关于增加大泰金石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
19	天弘基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
20	天弘基金管理有限公司关于设立四川分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-03
21	天弘医疗健康混合型证券投资基金2018年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2018-04-23
22	天弘基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其费率优	中国证监会指定媒介	2018-05-12

	惠活动的公告		
23	天弘基金管理有限公司关于对旗下基金在网上交易系统的指定支付渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-15
24	天弘基金管理有限公司关于在天弘爱理财APP开展“弘钱包”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-24
25	天弘基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-06-08
26	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2018-06-26
27	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年6月29日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-06-29
28	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-06-30

#### § 14 影响投资者决策的其他重要信息

##### 14.1 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	2018/1/1-2018/1/3	50,588,086.51	-	50,588,086.51	—	—
机构	2	2018/1/4-2018/1/15;2018/1/17-2018/3/12	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	5.76%

### 产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

- (1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；
- (2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；
- (3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；
- (4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；
- (5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

#### 14.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，自2018年1月18日起，天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。具体信息请参见基金管理人于2018年1月18日在指定媒介披露的《关于天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

### § 15 备查文件目录

#### 15.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金 募集的文件
- 2、天弘医疗健康混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘医疗健康混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘医疗健康混合型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

#### 15.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 15.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十七日