

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 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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:2019 年 03 月 27 日

## § 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2019年03月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

2018年01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01月01日起至2018年01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01月18日起至2018年12月31日止。

## § 2 基金简介(转型后)

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 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      | 124,614,750.41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 | 49,997,921.36份  | 74,616,829.05份 |

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人      | 基金托管人      |
|----|------------|------------|
| 名称 | 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       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 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 基金简介(转型前)

### 2.1 基金基本情况

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

|      |  |
|------|--|
| 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                 |
|---------|--------------|-----------------------|
| 名称      | 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                   |
|         | 联系电话         | 022-83310208          |
|         | 电子邮箱         | service@thfund.com.cn |
| 客户服务电话  | 95046        | 95565                 |
| 传真      | 022-83865569 | 0755-82960794         |

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018年01月18日（新基金合同生效日） - 2018年12月31日 |                |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
|               | 天弘医疗健康A                             | 天弘医疗健康C        |
| 本期已实现收益       | -9,700,605.36                       | -12,503,735.56 |
| 本期利润          | -15,169,126.01                      | -17,273,476.75 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3483                             | -0.2582        |
| 本期基金份额净值增长率   | -19.10%                             | -19.40%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末                              |                |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3301                             | -0.3370        |
| 期末基金资产净值      | 33,494,567.35                       | 49,468,646.21  |
| 期末基金份额净值      | 0.6699                              | 0.6630         |

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、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01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01月18日，下同。天弘医疗健康混合型证券投资基金报告期为2018年01月18日至2018年12月31日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

天弘医疗健康A

| 阶段    | 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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -15.96%  | 1.92%       | -16.30%    | 1.53%         | 0.34%  | 0.39% |
| 过去六个月 | -26.48%  | 1.88%       | -24.78%    | 1.45%         | -1.70% | 0.43% |

|                                    |         |       |         |       |       |       |
|------------------------------------|---------|-------|---------|-------|-------|-------|
| 自基金转型日起至今（2018年01月18日-2018年12月31日） | -19.10% | 1.66% | -21.26% | 1.38% | 2.16% | 0.28% |
|------------------------------------|---------|-------|---------|-------|-------|-------|

天弘医疗健康C

| 阶段                                 | 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   |
|------------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月                              | -16.03%  | 1.92%       | -16.30%    | 1.53%         | 0.27%  | 0.39% |
| 过去六个月                              | -26.63%  | 1.88%       | -24.78%    | 1.45%         | -1.85% | 0.43% |
| 自基金转型日起至今（2018年01月18日-2018年12月31日） | -19.40%  | 1.66%       | -21.26%    | 1.38%         | 1.86%  | 0.28% |

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 01 月 18 日。

### 3.2.2 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

天弘医疗健康A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



天弘医疗健康C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



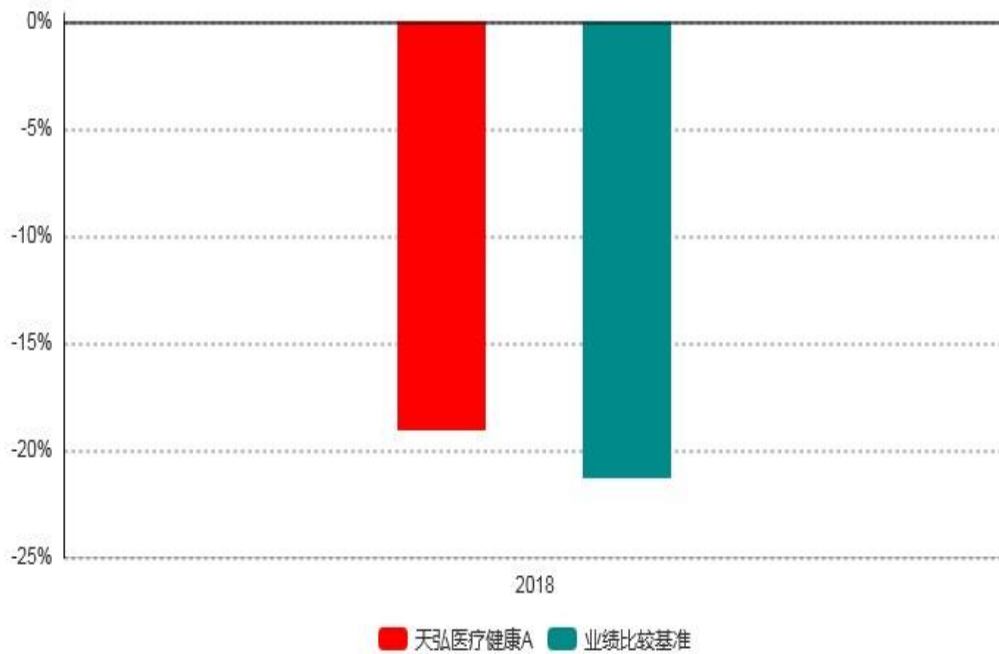
注：1、本基金合同于2018年01月18日生效，本基金于2018年01月18日由天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘医疗健康混合型证券

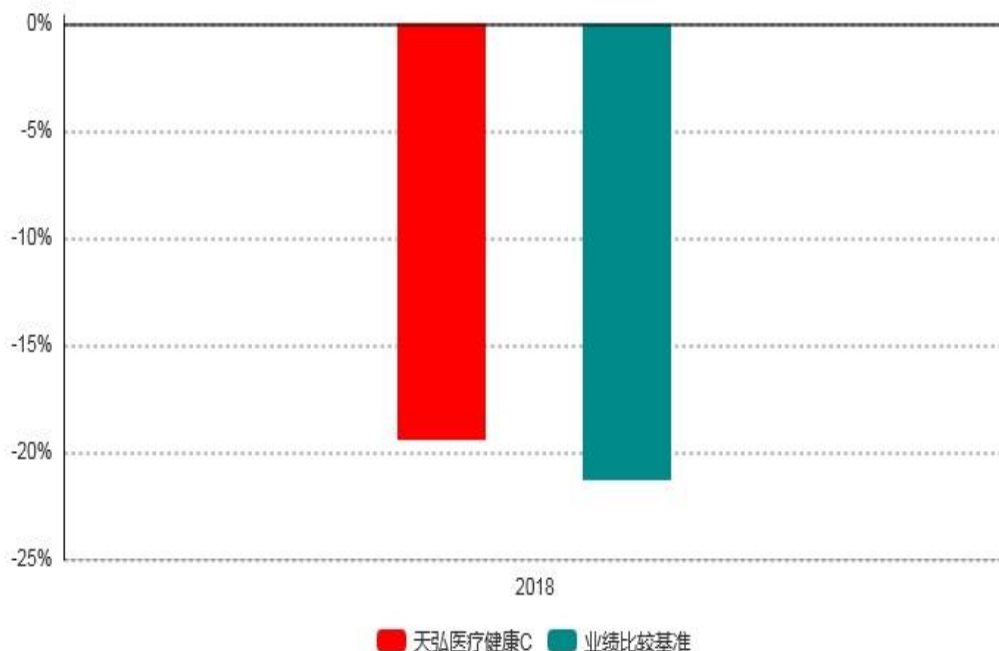


投资基金”。

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01月18日-2018年07月17日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：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 01 月 18 日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。本图所列示 2018 年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期（2018 年 01 月 18 日至 2018 年 12 月 31 日）计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2018 年 01 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，自新基金合同生效日以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年01月01日-2018年01月17日) |              | 2017年       |             | 2016年       |             |
|---------------|------------------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|               | 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 | 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 | 266,167.32  | 150,582.86  | -950,262.43 | -387,928.70 |

|                      |                   |               |               |                |               |              |
|----------------------|-------------------|---------------|---------------|----------------|---------------|--------------|
| 本期利润                 | 224,373.00        | 2,239,095.35  | 780,700.24    | 648,436.59     | -137,054.29   | -239,951.53  |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0151            | 0.0418        | 0.0540        | 0.0261         | -0.0103       | -0.0392      |
| 本期基金份额净值增长率          | 1.57%             | 1.57%         | 8.02%         | 7.76%          | -3.47%        | -3.72%       |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末(2018年01月17日) |               | 2017年末        |                | 2016年末        |              |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.1719           | -0.1774       | -0.1847       | -0.1901        | -0.2452       | -0.2484      |
| 期末基金资产净值             | 11,883,416.24     | 29,262,707.04 | 13,820,039.66 | 107,344,907.69 | 10,834,832.64 | 7,314,491.87 |
| 期末基金份额净值             | 0.8281            | 0.8226        | 0.8153        | 0.8099         | 0.7548        | 0.7516       |

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、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01月18日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

天弘中证大宗商品股票A

| 阶段  | 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 | 1.57%    | 1.16%       | 1.37%      | 1.20%         | 0.20% | -0.04% |

|                                    |         |       |        |       |         |        |
|------------------------------------|---------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 年（2018年01月01日-2018年01月17日）         |         |       |        |       |         |        |
| 过去三年（2016年01月01日-2018年01月17日）      | 5.91%   | 1.50% | 8.03%  | 1.54% | -2.12%  | -0.04% |
| 自基金合同生效日（2015年06月30日）起至2018年01月17日 | -17.19% | 1.99% | -6.84% | 1.92% | -10.35% | 0.07%  |

天弘中证大宗商品股票C

| 阶段                            | 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    |
|-------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一年（2018年01月01日-2018年01月17日） | 1.57%    | 1.16%       | 1.37%      | 1.20%         | 0.20%  | -0.04% |
| 过去三年（2016年01月01日-2018年01月17日） | 5.38%    | 1.50%       | 8.03%      | 1.54%         | -2.65% | -0.04% |

|                                    |         |       |        |       |         |       |
|------------------------------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 18年01月17日)                         |         |       |        |       |         |       |
| 自基金合同生效日（2015年06月30日）起至2018年01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 06 月 30 日。

### 3.2.2 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

天弘中证大宗商品股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



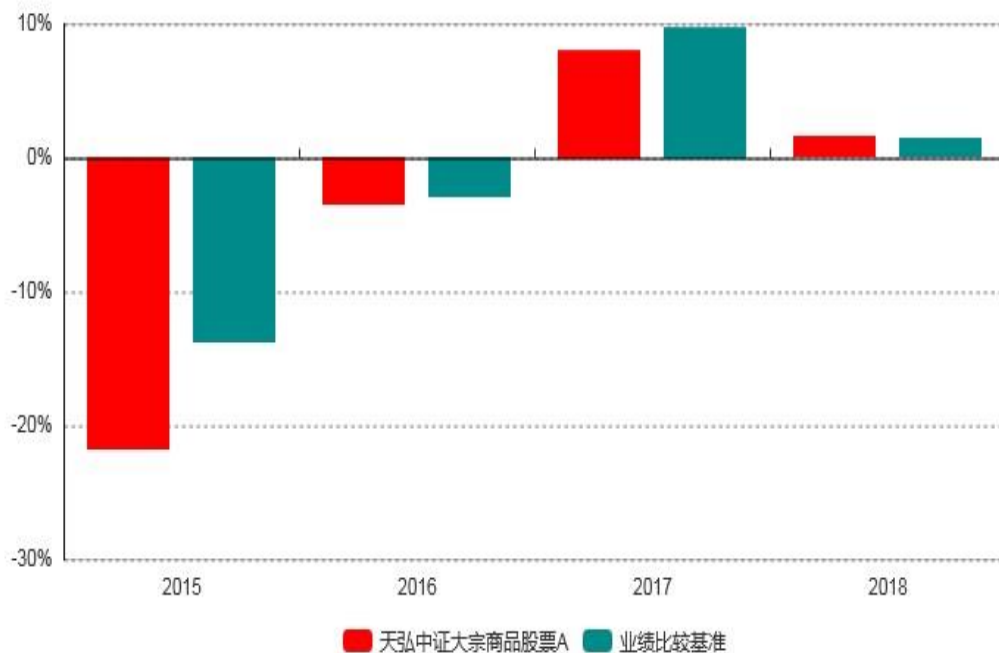
天弘中证大宗商品股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、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 06 月 30 日生效，且本基金已于 2018 年 01 月 18 日成功转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本基金合同于 2015 年 06 月 30 日生效。基金合同生效当年 2015 年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。  
 2、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 01 月 18 日转型为天弘医疗健康混合型证券投资基金。本图所列示 2018 年的净值增长率按照基金合同转型前

当年的实际存续期（2018年01月01日至2018年01月17日）计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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12月31日，本基金管理人共管理45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、天弘上证50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、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金（原“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、天弘信利债券型证券投资基金、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（助理）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或本基金管理人对外披露的任职日期。  
 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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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；针对非公开发行业股票申购、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的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场经历了贸易战冲击以及金融去杠杆的影响，市场全年下行趋势明显，沪深300指数全年下跌25.31%，创业板指全年下跌28.65%，全部A股截至到2018年底共上市3569只股票，全年下跌超过30%的共2090只股票，占比58.55%，整个市场的赚钱效应较差。

报告期内，医药行业全年走势跌宕起伏，2018年申万医药指数下跌27.67%，跑输沪深300指数2.36%，跑赢创业板0.98%，在中信27个子行业中排名第9位。回顾板块全年，一月份以来行业基本延续了上一年开始的龙头白马行情，在短暂的急跌和市场贸易战逐渐升温的背景下，1月底市场资金开始涌入显著低配的医药行业，尤其是叠加了中国在18年一季度遭遇了严重的流感袭击，医药板块公司一季度业绩纷纷超预期，上半年医药行业上演了一波波澜壮阔的大牛市。短短68个交易日行业上涨了28.31%，同期上证综指下跌3.89%，医药结构性牛市已经确立。18年下半年开始，医药行业发生了“疫苗事件”

等严重公共卫生事件，行业逐渐走弱，高点回调超过30%，而伴随着医药行业体制结构与行业政策发生较大改变，医药板块的估值体系也出现了明显分化，尤其是“4+7带量采购”试点出台后，以仿制药为代表的传统医药板块个股下跌幅度较大。

报告期内，天弘医疗健康基金总体通过对医药行业各个子行业做小幅偏离，依靠行业内的选股跑赢子行业，对于长期趋势明确向好的细分领域进行了超配，如创新药/慢性病/创新器械/商业板块，下半年随着行业政策逐渐发生变化，抗癌药降价以及带量采购预期的逐渐加强，天弘医疗健康基金降低了化学药中仿制药板块的配置比例，增加了生物制药以及器械创新板块的配置比例，全年天弘医疗健康基金比较好的跟随并且跑赢了基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年01月17日（2018年01月01日至2018年01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%。

截至2018年12月31日（2018年01月18日至2018年12月31日），天弘医疗健康A基金份额净值为0.6699元，天弘医疗健康C基金份额净值为0.6630元，报告期内份额净值增长率天弘医疗健康A为-19.10%，天弘医疗健康C为-19.40%，同期业绩比较基准增长率均为-21.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去一年A股市场经历了中美贸易战冲击、国内经济下行压力，金融市场风险暴露，随着风险的逐步释放，目前A股整体的估值水平可能已经到达底部区域，配置价值逐步显现。最新数据显示，PMI仍处于荣枯线以下，房地产投资趋势性向下，基建投资面临地方政府债务制约反弹乏力，外部需求面临中美贸易争端以及全球经济增长放缓的拖累，汽车销量下滑，社零增速较低，2019年国内经济增长仍然面临较大的下行压力，稳增长也面临着较大的考验。但另一方面，宏观经济政策已经发生较大的转变，货币政策保持宽松，财政减税降费将继续推进，力促金融支持实体经济尤其是支持小微企业、民营企业的配套政策措施加速出台，政策底已清晰进入右侧。展望2019年，我们预期货币政策保持宽松，持续降准仍然值得期待，加大专项债供给力保基建平稳，另外，制造业投资企稳回升的趋势将延续，中国经济结构调整正在取得积极进展，虽然实际GDP增速保持平稳，但经济结构将更加优化，减税降费刺激消费，推进国资国企、财税金融、土地、市场准入、社会管理等领域的改革持续推进，都将是中国经济增长新的支点。

在目前时点，我们认为影响医药行业未来持续增长的长期逻辑没有发生变化，随着社会的老龄化和疾病谱变化，医药行业发展的长期驱动力正在逐渐加强，中长期而言，

医药行业增长的确性仍然较高。而随着2018年市场和行业的回调，报告期末医药板块的绝对估值与相对估值均处于历史较低水平，目前时点上我们认为19年医药行业仍然具有显著的结构机会。投资方向上，我们看好创新药配套产业链等景气度较高的新兴行业（CRO/CMO），非药领域中受益于进口替代和基层放量的国产优质医疗设备行业，以及受益于消费升级的优质生物药与中药标的，另外，对于拥有良好的品种梯队和研发能力的仿制药龙头，我们认为随着市场对于政策预期逐渐纠偏也将会有估值修复的机会。

#### 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

本基金本报告期末进行利润分配，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 审计报告(转型后)

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，该所出具了“标准无保留意见的审计报告”，且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 6 审计报告(转型前)

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，该所出具了“标准无保留意见的审计报告”，且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表(转型后)

转型后：

报告期（2018 年 01 月 18 日—2018 年 12 月 31 日）

### 7.1 资产负债表

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12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 |
|----|-----|-----|
|----|-----|-----|

|                 |            | 2018年12月31日                |
|-----------------|------------|----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                            |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 14,330,209.15              |
| 结算备付金           |            | 99,929.96                  |
| 存出保证金           |            | 88,683.10                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 70,461,097.01              |
| 其中：股票投资         |            | 70,461,097.01              |
| 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    | 7,526.82                   |
| 应收股利            |            | -                          |
| 应收申购款           |            | 271,186.00                 |
| 递延所得税资产         |            | -                          |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          |
| 资产总计            |            | 85,258,632.04              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年12月31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         |            | 1,332,658.98               |
| 应付赎回款           |            | 448,283.15                 |
| 应付管理人报酬         |            | 103,774.18                 |
| 应付托管费           |            | 17,295.68                  |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付销售服务费       |          | 15,237.97      |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 37,976.24      |
| 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  | 340,192.28     |
| 负债合计          |          | 2,295,418.48   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 124,614,750.41 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -41,651,536.85 |
| 所有者权益合计       |          | 82,963,213.56  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 85,258,632.04  |

注：1、报告截止日2018年12月31日，天弘医疗健康混合型证券投资基金A类基金份额净值0.6699元，天弘医疗健康混合型证券投资基金C类基金份额净值0.6630元；基金份额总额124,614,750.41份，其中天弘医疗健康混合型证券投资基金A类基金份额49,997,921.36份，天弘医疗健康混合型证券投资基金C类基金份额74,616,829.05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01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01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31日，上年度完整期间的数据将在转型前表格中一并披露。

## 7.2 利润表

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12月31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12月31日 |
|-----------|----------|-------------------------------------|
| 一、收入      |          | -30,006,866.14                      |
| 1. 利息收入   |          | 284,911.80                          |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 273,356.78                          |



|                            |            |                |
|----------------------------|------------|----------------|
| 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）          |            | -20,977,714.24 |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | -22,052,759.66 |
| 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                 |            | -              |
| 贵金属投资收益                    |            | -              |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | -              |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 1,075,045.42   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16   | -10,238,261.84 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.17   | 924,198.14     |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,435,736.62   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,284,183.25   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 214,030.47     |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 207,831.32     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 396,090.51     |
| 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                    | 7.4.7.19   | 333,601.07     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -32,442,602.76 |
| 减：所得税费用                    |            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -32,442,602.76 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

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12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31日 |                |                 |
|--|---|----------------|-----------------|
|  | 实收基金                                    | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益<br>(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)               | -                                       | -32,442,602.76 | -32,442,602.76  |
| 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)      | 74,691,941.99                           | -432,248.95    | 74,259,693.04   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 390,229,300.09                          | -50,401,321.71 | 339,827,978.38  |
| 2. 基金赎回款                               | -315,537,358.10                         | 49,969,072.76  | -265,568,285.34 |
| 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<br>(基金净值)                    | 124,614,750.41                          | -41,651,536.85 | 82,963,213.56   |

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

薄贺龙

肖慧敏

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

### 7.4.1 基金基本情况

天弘医疗健康混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原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“原基金”)转型而来。本基金合同生效日为2018年1月18日,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。

根据原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招募说明书》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%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 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》、《天弘医疗健康混合型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。

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18日（新基金合同生效日）至2018年12月31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12月31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12月31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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。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12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映

公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证

券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加、地方教育费附加和防洪工程维护费等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

| 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、注册登记机构 |
| 招商证券股份有限公司（“招商证券”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司 | 基金管理人的股东            |

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| 天津信托有限责任公司           | 基金管理人的股东    |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 基金管理人的股东    |
| 芜湖高新投资有限公司           | 基金管理人的股东    |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 天弘创新资产管理有限公司(“天弘创新”) | 基金管理人的全资子公司 |

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31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 | 161,794,925.51                          | 35.77%       |

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31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 | 37,426.04 | 23.00%     | 10,261.89 | 27.02%       |

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年<br>12月31日 |
|-----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,284,183.25                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 322,919.60                                  |

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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12<br>月31日 |
|----|---|
|----|---|

|                |            |
|----------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 214,030.47 |
|----------------|------------|

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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。

#### 7.4.8.2.3 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<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31日 |           |           |
|----------------|---|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                        |           |           |
|                | 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     | -                                       | 89,341.51 | 89,341.51 |
| 招商证券股份有限公司     | -                                       | 209.99    | 209.99    |
| 合计             | -                                       | 89,551.50 | 89,551.50 |

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 X 0.40%/当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

天弘医疗健康A

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12月31日 |
|    |                                   |

|                             |              |
|-----------------------------|--------------|
| 基金合同生效日（2018年01月18日）持有的基金份额 | 5,000,000.00 |
| 报告期初持有的基金份额                 | -            |
| 报告期间申购/买入总份额                | -            |
| 报告期间因拆分变动份额                 | -            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | -            |
| 报告期末持有的基金份额                 | 5,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 10.00%       |

天弘医疗健康C

份额单位：份

| 项目                          | 本期<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31日 |
|-----------------------------|---|
| 基金合同生效日（2018年01月18日）持有的基金份额 | 5,000,000.00                            |
| 报告期初持有的基金份额                 | -                                       |
| 报告期间申购/买入总份额                | -                                       |
| 报告期间因拆分变动份额                 | -                                       |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | -                                       |
| 报告期末持有的基金份额                 | 5,000,000.00                            |
| 报告期末持有的基金份额                 | 6.70%                                   |

|           |  |
|-----------|--|
| 额占基金总份额比例 |  |
|-----------|--|

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用A、C类各自级别的份额总额计算。

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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<br>2018年01月18日（新基金合同生效日）至2018年12月31日 |            |
|------------|---|------------|
|            | 期末余额                                    | 当期利息收入     |
| 招商证券股份有限公司 | 14,330,209.15                           | 267,003.02 |

注：本基金的银行存款由本基金托管人招商证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值 | 复牌日期 | 复牌开盘 | 数量（股） | 期末成本 | 期末估值 | 备注 |
|----|------|------|------|------|------|------|-------|------|------|----|
|    |      |      |      |      |      |      |       |      |      |    |

| 代码     |        |            |      | 单价   |   | 单价 |       | 总额         | 总额       |   |
|--------|--------|------------|------|------|---|----|-------|------------|----------|---|
| 000693 | *ST 华泽 | 2016-03-01 | 暂停上市 | 0.55 | - | -  | 6,400 | 113,888.66 | 3,520.00 | - |

注：本基金截至2018年12月31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。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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。

#### 7.4.10 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12月31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70,457,577.01元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为3,520.00元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

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 1 日  | -         | -         |
| 购买  | -         | -         |
| 出售  | -         | -         |
| 转入第三层级  | 8,704.00  | 8,704.00  |
| 转出第三层级  | -         | -         |
| 当期利得或损失总额   | -5,184.00 | -5,184.00 |
| ——计入损益的利得或损失  | -5,184.00 | -5,184.00 |
| 2018 年 12 月 31 日  | 3,520.00  | 3,520.00  |
| 2018 年 12 月 31 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(从转入第三层次起算)——公允价值变动损益 | -5,184.00 | -5,184.00 |

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

|                 | 2018 年 12 月 31 日公允价值 | 估值技术 | 不可观察输入值名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
|-----------------|----------------------|------|-----------|----------|------------|
| 交易性金融资产——*ST 华泽 | 3,520.00             | 成本法  | 市净率       | 0.4059   | 正相关        |

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31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 年度财务报表(转型前)

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

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<br>2018年01月17日         | 上年度末<br>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<br/>2018年01月17日</b> | <b>上年度末<br/>2017年12月31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01月17日（基金转型前一日），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01月01日至2018年01月17日止期间。

## 7.2 利润表

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 | 上年度可比期间 |
|----|-----|--------------|---------|
|----|-----|--------------|---------|

|                        |                | 日至2018年01月17<br>日 | 2017年01月01日至201<br>7年12月31日 |
|------------------------|----------------|-------------------|-----------------------------|
| <b>一、收入</b>            |                | 2,612,454.07      | 2,022,666.31                |
| 1. 利息收入                |                | 12,380.74         | 72,543.24                   |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11       | 12,380.74         | 72,543.24                   |
| 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             |                | -                 | -                           |
| 其他利息收入                 |                | -                 | -                           |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |                | 2,675,718.46      | 807,727.88                  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12       | 2,675,905.38      | 636,184.11                  |
| 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                     |                | -                 | -                           |
| 贵金属投资收益                |                | -                 | -                           |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.14       | -                 | -                           |
| 股利收益                   | 7.4.7.15       | -186.92           | 171,543.77                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16       | -83,101.55        | 1,012,386.65                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |                | -                 | -                           |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17       | 7,456.42          | 130,008.54                  |
| <b>减：二、费用</b>          |                | 148,985.72        | 593,529.48                  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.<br>1 | 13,110.93         | 155,097.05                  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.<br>2 | 2,622.20          | 31,019.32                   |

|                     |            |              |              |
|---------------------|------------|--------------|--------------|
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | 5,104.88     | 48,952.91    |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.18   | 120,148.78   | 196,460.20   |
| 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             | 7.4.7.19   | 7,998.93     | 162,000.00   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 2,463,468.35 | 1,429,136.83 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 2,463,468.35 | 1,429,136.83 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

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<br>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<br>(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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |                |                 |
|  | 实收基金                               | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 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)               | -                                  | 1,429,136.83   | 1,429,136.83    |
| 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)      | 125,401,966.74                     | -23,815,480.73 | 101,586,486.01  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 461,518,334.65                     | -81,086,985.83 | 380,431,348.82  |
| 2. 基金赎回款                               | -336,116,367.91                    | 57,271,505.10  | -278,844,862.81 |
| 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)                        | 149,487,387.19                     | -28,322,439.84 | 121,164,947.35  |

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

薄贺龙

肖慧敏

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

### 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》核准，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。认购/申购、赎回基金时收取认/申购费用、赎回费用，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”)；认购/申购、赎回基金时不收取认/申购费用、赎回费用，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。

根据本基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《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》，本基金的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，本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司将《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》，并已经中国证监会证监许可[2017]1296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变更注册的批复》变更注册。《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》将自《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》公告发布之日，即2018年1月18日起生效，《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基金托管协议》自同日失效。

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招募说明书》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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 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、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

#### 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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际



买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)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。

(3)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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加、地方教育费附加和防洪工程维护费等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

| 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、注册登记机构 |
| 招商证券股份有限公司（“招商证券”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司   | 基金管理人的股东            |
| 天津信托有限责任公司           | 基金管理人的股东            |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 基金管理人的股东            |
| 芜湖高新投资有限公司           | 基金管理人的股东            |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东            |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东            |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东            |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东            |

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| 天弘创新资产管理有限公司（“天弘创新”） | 基金管理人的全资子公司 |
|----------------------|-------------|

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年<br>01月17日 |                  | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年12月<br>31日 |                  |
|------------|-----------------------------------|------------------|--|------------------|
|            | 成交<br>金额                          | 占当期股票成交<br>总额的比例 | 成交金额                                   | 占当期股票成交<br>总额的比例 |
| 招商证券股份有限公司 | -                                 | -                | 146,848,7<br>66.23                     | 58.55%           |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年01月01日至2018年01月17日      |                |              |                  |
|------------|------------------------------------|----------------|--------------|------------------|
|            | 当期佣<br>金                           | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣<br>金余额 | 占期末应付佣金<br>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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |                |              |                  |
|            | 当期佣<br>金                           | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣<br>金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 招商证券股份有限公司 | 49,73<br>1.91                      | 52.59%         | 11,360.33    | 20.21%           |

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年01月01日至2018年01月17日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,110.93                     | 155,097.05                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,400.94                      | 38,546.57                          |

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 X 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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年01月01日至2018年01月17日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,622.20                      | 31,019.32                          |

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司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。

##### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|          |    |
|----------|----|
| 获得销售服务费的 | 本期 |
|----------|----|

| 各关联方名称         | 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1月1日至2017年12月31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     | -                            | 9,844.47    | 9,844.47 |
| 招商证券股份有限公司     | -                            | 4.35        | 4.35     |
| 合计             | -                            | 9848.82     | 9848.82  |

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。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末及上年度末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

天弘中证大宗商品股票A

份额单位：份

| 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12月31日 |
| 报告期初持有的基金份额 | 5,000,000.00            | 5,000,000.00            |
| 报告期间申购/买入总  | -                       | -                       |

|                     |              |              |
|---------------------|--------------|--------------|
| 份额                  |              |              |
| 报告期间因拆分变动份额         | -            | -            |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -            | -            |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 34.84%       | 29.50%       |

天弘中证大宗商品股票C

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2018年01月01日至2018年01月17日 | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |
|---------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | 5,000,000.00                  | 5,000,000.00                       |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                             | -                                  |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                             | -                                  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                             | -                                  |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,000.00                  | 5,000,000.00                       |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 14.06%                        | 3.77%                              |

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用A、C类各自级别的份额总额计算。

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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<br>2018年01月01日至2018年01月17日 |           | 上年度可比期间<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |           |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 招商证券股份有限公司 | 5,523,853.97                  | 11,742.75 | 11,035,158.02                      | 70,726.92 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，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。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

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

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量（股）  | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 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   | -  |
| 002    | 金正   | 2017-      | 筹划     | 9.15   | 2018-      | 8.24   | 69,900 | 572,6        | 639,5        | -  |

|        |       |            |             |       |            |       |        |            |            |   |
|--------|-------|------------|-------------|-------|------------|-------|--------|------------|------------|---|
| 470    | 大     | 10-25      | 发行股份购买资产    |       | 02-09      |       |        | 01.43      | 85.00      |   |
| 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 | - |
| 002004 | 华邦健康  | 2017-12-14 | 筹划非公开发行股票事宜 | 6.73  | 2018-03-14 | 7.30  | 52,100 | 396,391.09 | 350,633.00 | - |
| 600157 | 永泰能源  | 2017-11-21 | 重大资产重组      | 3.36  | 2018-04-04 | 3.03  | 99,500 | 367,202.65 | 334,320.00 | - |
| 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 | 暂停上市        | 12.50 | -          | -     | 6,400  | 113,888.66 | 80,000.00  | - |

注：本基金截至2018年01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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年01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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年01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。

#### 7.4.10 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(基金转型前一日)，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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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(基金转型前一日)，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(转型后)

转型后：

报告期(2018年01月18日—2018年12月31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              | 70,461,097.01 | 82.64         |
|    | 其中：股票             | 70,461,097.01 | 82.64         |
| 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      | 14,430,139.11 | 16.93         |
| 8  | 其他各项资产            | 367,395.92    | 0.43          |
| 9  | 合计                | 85,258,632.04 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 3,520.00      | 0.00          |
| C  | 制造业              | 64,335,518.45 | 77.55         |
| 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           | 4,194,258.56  | 5.06          |
| 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    | 1,927,800.00  | 2.32  |
| 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            | 70,461,097.01 | 84.93 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600867 | 通化东宝 | 438,000 | 6,088,200.00 | 7.34         |
| 2  | 603707 | 健友股份 | 264,080 | 4,956,781.60 | 5.97         |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药 | 85,380  | 4,503,795.00 | 5.43         |
| 4  | 300009 | 安科生物 | 323,604 | 4,323,349.44 | 5.21         |
| 5  | 002821 | 凯莱英  | 60,100  | 4,077,785.00 | 4.92         |
| 6  | 300702 | 天宇股份 | 185,669 | 4,056,867.65 | 4.89         |
| 7  | 600055 | 万东医疗 | 448,616 | 3,893,986.88 | 4.69         |
| 8  | 300357 | 我武生物 | 93,898  | 3,473,287.02 | 4.19         |
| 9  | 600529 | 山东药玻 | 180,517 | 3,429,823.00 | 4.13         |
| 10 | 600085 | 同仁堂  | 98,502  | 2,708,805.00 | 3.27         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

### 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 | 占期初基金资产 |
|----|------|------|----------|---------|
|----|------|------|----------|---------|

|    |        |      |               | 净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|---------|
| 1  | 603707 | 健友股份 | 12,804,956.15 | 15.43   |
| 2  | 600329 | 中新药业 | 11,061,365.00 | 13.33   |
| 3  | 600521 | 华海药业 | 9,995,142.60  | 12.05   |
| 4  | 600867 | 通化东宝 | 9,806,122.97  | 11.82   |
| 5  | 000513 | 丽珠集团 | 8,480,923.00  | 10.22   |
| 6  | 000661 | 长春高新 | 7,692,561.00  | 9.27    |
| 7  | 300630 | 普利制药 | 7,052,251.00  | 8.50    |
| 8  | 002262 | 恩华药业 | 6,595,665.81  | 7.95    |
| 9  | 002773 | 康弘药业 | 6,448,519.00  | 7.77    |
| 10 | 300009 | 安科生物 | 6,429,299.72  | 7.75    |
| 11 | 000963 | 华东医药 | 6,234,884.17  | 7.52    |
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,851,268.54  | 7.05    |
| 13 | 300357 | 我武生物 | 5,348,012.03  | 6.45    |
| 14 | 002019 | 亿帆医药 | 5,252,270.19  | 6.33    |
| 15 | 300558 | 贝达药业 | 5,210,514.40  | 6.28    |
| 16 | 601607 | 上海医药 | 5,149,058.00  | 6.21    |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 4,908,304.00  | 5.92    |
| 18 | 600196 | 复星医药 | 4,726,504.00  | 5.70    |
| 19 | 603520 | 司太立  | 4,719,652.76  | 5.69    |
| 20 | 000538 | 云南白药 | 4,707,530.00  | 5.67    |
| 21 | 603387 | 基蛋生物 | 4,651,668.40  | 5.61    |
| 22 | 600529 | 山东药玻 | 4,550,623.80  | 5.49    |
| 23 | 600055 | 万东医疗 | 4,281,577.96  | 5.16    |
| 24 | 600998 | 九州通  | 4,191,713.00  | 5.05    |
| 25 | 002007 | 华兰生物 | 4,187,794.13  | 5.05    |
| 26 | 002370 | 亚太药业 | 4,121,080.08  | 4.97    |
| 27 | 002821 | 凯莱英  | 4,062,684.00  | 4.90    |
| 28 | 000028 | 国药一致 | 4,047,795.47  | 4.88    |
| 29 | 300702 | 天宇股份 | 4,038,701.20  | 4.87    |
| 30 | 300642 | 透景生命 | 3,946,123.50  | 4.76    |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 600062 | 华润双鹤 | 3,847,986.40 | 4.64 |
| 32 | 600085 | 同仁堂  | 3,769,746.00 | 4.54 |
| 33 | 300482 | 万孚生物 | 3,689,512.92 | 4.45 |
| 34 | 600771 | 广誉远  | 3,394,151.24 | 4.09 |
| 35 | 300685 | 艾德生物 | 3,326,411.88 | 4.01 |
| 36 | 600380 | 健康元  | 3,216,414.80 | 3.88 |
| 37 | 002524 | 光正集团 | 3,163,722.55 | 3.81 |
| 38 | 002332 | 仙琚制药 | 3,089,540.50 | 3.72 |
| 39 | 600511 | 国药股份 | 2,819,861.94 | 3.40 |
| 40 | 600535 | 天士力  | 2,745,618.00 | 3.31 |
| 41 | 002020 | 京新药业 | 2,696,892.00 | 3.25 |
| 42 | 300633 | 开立医疗 | 2,383,549.78 | 2.87 |
| 43 | 603127 | 昭衍新药 | 2,313,071.00 | 2.79 |
| 44 | 600518 | 康美药业 | 2,274,205.00 | 2.74 |
| 45 | 300529 | 健帆生物 | 2,244,856.00 | 2.71 |
| 46 | 002390 | 信邦制药 | 2,160,630.00 | 2.60 |
| 47 | 600420 | 现代制药 | 1,910,372.41 | 2.30 |
| 48 | 600211 | 西藏药业 | 1,902,627.00 | 2.29 |
| 49 | 603367 | 辰欣药业 | 1,822,670.00 | 2.20 |

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     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600329 | 中新药业 | 8,685,173.26 | 10.47          |
| 2  | 600521 | 华海药业 | 6,606,423.06 | 7.96           |
| 3  | 603707 | 健友股份 | 6,201,122.13 | 7.47           |
| 4  | 000513 | 丽珠集团 | 6,185,541.20 | 7.46           |
| 5  | 002262 | 恩华药业 | 5,880,949.08 | 7.09           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6  | 300630 | 普利制药 | 5,247,051.00 | 6.32 |
| 7  | 000661 | 长春高新 | 5,085,015.60 | 6.13 |
| 8  | 002019 | 亿帆医药 | 4,334,213.68 | 5.22 |
| 9  | 601607 | 上海医药 | 4,264,004.00 | 5.14 |
| 10 | 000963 | 华东医药 | 4,109,264.50 | 4.95 |
| 11 | 600062 | 华润双鹤 | 3,755,535.00 | 4.53 |
| 12 | 000538 | 云南白药 | 3,676,535.08 | 4.43 |
| 13 | 002773 | 康弘药业 | 3,521,188.00 | 4.24 |
| 14 | 600998 | 九州通  | 3,483,876.00 | 4.20 |
| 15 | 603259 | 药明康德 | 3,462,518.14 | 4.17 |
| 16 | 603520 | 司太立  | 3,387,855.04 | 4.08 |
| 17 | 600771 | 广誉远  | 3,283,838.90 | 3.96 |
| 18 | 603387 | 基蛋生物 | 2,943,922.39 | 3.55 |
| 19 | 002020 | 京新药业 | 2,863,495.80 | 3.45 |
| 20 | 002370 | 亚太药业 | 2,822,294.20 | 3.40 |
| 21 | 300685 | 艾德生物 | 2,739,035.65 | 3.30 |
| 22 | 300642 | 透景生命 | 2,583,118.00 | 3.11 |
| 23 | 300482 | 万孚生物 | 2,536,289.25 | 3.06 |
| 24 | 002524 | 光正集团 | 2,488,481.60 | 3.00 |
| 25 | 600196 | 复星医药 | 2,480,576.00 | 2.99 |
| 26 | 600535 | 天士力  | 2,386,139.45 | 2.88 |
| 27 | 002007 | 华兰生物 | 2,352,692.00 | 2.84 |
| 28 | 600518 | 康美药业 | 2,186,977.34 | 2.64 |
| 29 | 600867 | 通化东宝 | 2,181,330.20 | 2.63 |
| 30 | 002332 | 仙琚制药 | 2,149,659.00 | 2.59 |
| 31 | 002390 | 信邦制药 | 2,093,558.50 | 2.52 |
| 32 | 600211 | 西藏药业 | 1,985,874.60 | 2.39 |
| 33 | 600420 | 现代制药 | 1,935,303.98 | 2.33 |
| 34 | 300357 | 我武生物 | 1,916,499.00 | 2.31 |
| 35 | 300601 | 康泰生物 | 1,891,476.12 | 2.28 |
| 36 | 603367 | 辰欣药业 | 1,754,244.00 | 2.11 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 37 | 600511 | 国药股份 | 1,714,565.40 | 2.07 |
|----|--------|------|--------------|------|

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。

#### 8.4.3 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 | 259,531,979.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 193,214,545.68 |

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。

#### 8.5 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。

#### 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 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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   | 88,683.10  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 7,526.82   |
| 5  | 应收申购款   | 271,186.00 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 367,395.92 |

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 投资组合报告（转型前）

转型前：

报告期（2018 年 01 月 01 日—2018 年 01 月 17 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 | 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 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末（指数投资）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         | 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 |

### 8.2.2 报告期末（积极投资）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         | -         | -            |
| 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    | -         | -            |

|   |               |           |      |
|---|---------------|-----------|------|
| 0 | 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）。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（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         |

#### 8.3.2 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股） | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 000693 | *ST华泽 | 6,400 | 80,000.00 | 0.19         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

## 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。

### 8.4.2 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。

#### 8.4.3 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。

#### 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。

#### 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 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值     | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|---------------|----------|
| 1  | 600614 | 鹏起科技 | 1, 006, 876. 32 | 2. 45         | 重大资产重组   |
| 2  | 600309 | 万华化学 | 932, 716. 96    | 2. 27         | 重大资产重组   |
| 3  | 002470 | 金正大  | 639, 585. 00    | 1. 55         | 重大资产重组   |
| 4  | 000930 | 中粮生化 | 622, 978. 00    | 1. 51         | 重大资产重组   |

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 流通受限部分公允价值  | 占基金净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|-------------|-------------|----------|
| 1  | 000693 | *ST华泽 | 80, 000. 00 | 0. 19       | 暂停上市     |

注：\*ST华泽被调出成分股后停牌，故以积极投资股票列示。

#### 8.12.6 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 基金份额持有人信息(转型后)

转型后:

报告期（2018 年 01 月 18 日—2018 年 12 月 31 日）

### 9.1 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 | 10,521   | 4,752.20  | 5,000,000.00  | 10.00% | 44,997,921.36  | 90.00% |
| 天弘医疗健康C | 9,716    | 7,679.79  | 5,000,000.00  | 6.70%  | 69,616,829.05  | 93.30% |
| 合计      | 20,237   | 6,157.77  | 10,000,000.00 | 8.02%  | 114,614,750.41 | 91.98% |

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）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别    | 持有份额总数(份)    | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 天弘医疗健康A | 557,352.47   | 1.11%    |
|                  | 天弘医疗健康C | 4,143,584.03 | 5.55%    |
|                  | 合计      | 4,700,936.50 | 3.77%    |

### 9.3 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<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 天弘医疗健康A | 10~50 |
|  | 天弘医疗健康C | >100  |
|  | 合计      | >100  |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 天弘医疗健康A | —     |
|  | 天弘医疗健康C | —     |
|  | 合计      | —     |

## § 9 基金份额持有人信息(转型前)

转型前:

报告期（2018年01月01日—2018年01月17日）

### 9.1 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<br>别                | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有<br>的基金份<br>额 | 持有人结构             |            |                   |            |
|-------------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
|                         |                  |                   | 机构投资者             |            | 个人投资者             |            |
|                         |                  |                   | 持有份额              | 占总份额<br>比例 | 持有份额              | 占总份额<br>比例 |
| 天弘中<br>证大宗<br>商品股<br>票A | 3,593            | 3,993.76          | 5,000,00<br>0.00  | 34.84%     | 9,349,58<br>1.95  | 65.16%     |
| 天弘中<br>证大宗<br>商品股<br>票C | 2,845            | 12,503.77         | 5,000,00<br>0.00  | 14.06%     | 30,573,22<br>6.47 | 85.94%     |
| 合计                      | 6,438            | 7,754.40          | 10,000,00<br>0.00 | 20.03%     | 39,922,80<br>8.42 | 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）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 | 占基金总份额比 |
|----|------|--------|---------|
|----|------|--------|---------|



|                  |             | (份)      | 例     |
|------------------|-------------|----------|-------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 天弘中证大宗商品股票A | 791.27   | 0.01% |
|                  | 天弘中证大宗商品股票C | 3,608.85 | 0.01% |
|                  | 合计          | 4,400.12 | 0.01% |

### 9.3 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          | —                 |

### 9.4 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。

### § 10 开放式基金份额变动(转型后)

转型后：

报告期（2018年01月18日—2018年12月31日）

单位：份

|                             | 天弘医疗健康A        | 天弘医疗健康C        |
|-----------------------------|----------------|----------------|
| 新基金合同生效日(2018年01月18日)基金份额总额 | 14,349,581.95  | 35,573,226.47  |
| 新基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 129,724,863.94 | 260,504,436.15 |
| 减：新基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 94,076,524.53  | 221,460,833.57 |
| 新基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                | 49,997,921.36  | 74,616,829.05  |

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、总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

### § 10 开放式基金份额变动(转型前)

转型前：

报告期（2018年01月01日—2018年01月17日）

单位：份

|                            | 天弘中证大宗商品股票<br>A | 天弘中证大宗商品股票<br>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  |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,680,883.73    | 20,611,115.48   |

|               |               |                |
|---------------|---------------|----------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,282,942.61  | 117,573,635.37 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 14,349,581.95 | 35,573,226.47  |

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。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》、《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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费60,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年7个月。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

报告期2018年01月18日（新基金合同生效日） - 2018年12月31日

### 11.7.1 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的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华泰证券   | 1      | 56,497,290.80  | 12.49%       | 24,368.15  | 14.97%     | -  |
| 海通证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 天风证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 兴业证券   | 1      | 234,062,159.37 | 51.74%       | 100,952.31 | 62.03%     | -  |
| 招商证券   | 2      | 161,794,925.51 | 35.77%       | 37,426.04  | 23.00%     | -  |
| 东方财富证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

### 11.7.2 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 |      | 基金交易 |      |
|------|------|------|--------|------|------|------|------|------|
|      | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额   | 占当期债 | 成交   | 占当期权 | 成交   | 占当期基 |

|        |   | 券成交总额的比例 |               | 券回购成交总额的比例 | 金额 | 证成交总额的比例 | 金额 | 金成交总额的比例 |
|--------|---|----------|---------------|------------|----|----------|----|----------|
| 华泰证券   | - | -        | 10,500,000.00 | 100.00%    | -  | -        | -  | -        |
| 海通证券   | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |
| 天风证券   | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |
| 兴业证券   | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |
| 招商证券   | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |
| 东方财富证券 | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |
| 光大证券   | - | -        | -             | -          | -  | -        | -  | -        |

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：4个，其中包括光大证券上海交易单元2个，海通证券上海交易单元1个，天风证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

报告期2018年01月01日 - 2018年01月17日

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 股票交易 |      | 应支付该券商的佣金 |      | 备注 |
|------|----|------|------|-----------|------|----|
|      |    | 成交金额 | 占当期股 | 佣金        | 占当期佣 |    |

|        | 单元数量 |               | 票成交总额的比<br>例 |           | 金总量的比<br>例 |   |
|--------|------|---------------|--------------|-----------|------------|---|
| 华泰证券   | 1    | 23,862,172.29 | 29.73%       | 10,292.01 | 29.73%     | - |
| 海通证券   | 1    | -             | -            | -         | -          | - |
| 天风证券   | 1    | -             | -            | -         | -          | - |
| 兴业证券   | 1    | 21,845,153.72 | 27.22%       | 9,422.22  | 27.22%     | - |
| 招商证券   | 2    | -             | -            | -         | -          | - |
| 东方财富证券 | 2    | 34,549,073.27 | 43.05%       | 14,901.73 | 43.05%     | - |
| 光大证券   | 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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2018/01/01-2018/01/03            | 50,588,086.51 | -    | 50,588,086.51 | -             | -     |
|  | 2              | 2018/01/15;2018/01/17-2018/03/12 | 10,000,000.00 | -    | -             | 10,000,000.00 | 8.02% |
| <b>产品特有风险</b>  |                |                                  |               |      |               |               |       |
| <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> |                |                                  |               |      |               |               |       |

## 12.2 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》。

天弘基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十七日