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:2017年08月28日

天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年8月24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。

本半年度报告摘要摘编自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金简介

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	23,943,149.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C
下属两级基金的交易代码	001558	001559
报告期末下属两级基金的份额总额	14,730,724.09份	9,212,425.43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	崔建林	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		4007109999	95565
传真		022-83865569	0755-82960794

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年01月01日-2017年06月30日)	
	天弘中证大宗商品股票A	天弘中证大宗商品股票C
本期已实现收益	-84,540.42	-62,244.08
本期利润	-98,081.42	-50,252.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0070	-0.0054
本期基金份额净值增长率	-1.79%	-1.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.2587	-0.2627
期末基金资产净值	10,919,995.51	6,792,163.90
期末基金份额净值	0.7413	0.7373

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.本基金《基金合同》自2015年6月30日起生效。

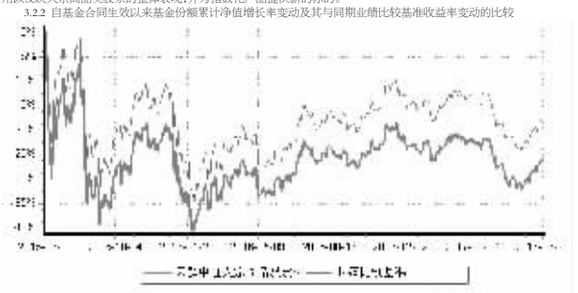
3.2 基金净值表现

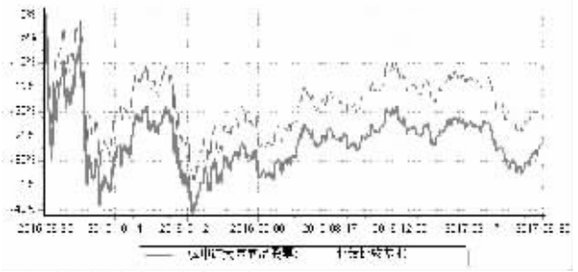
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(天弘中证大宗商品股票A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.47%	0.85%	7.32%	0.86%	0.15%	-0.01%
过去三个月	-3.45%	0.99%	-3.57%	0.99%	0.12%	0.00%
过去六个月	-1.79%	0.90%	-1.38%	0.91%	-0.41%	-0.01%
过去一年	4.28%	0.96%	6.23%	0.98%	-1.95%	-0.02%
自基金合同生效日起至今(2015年06月30日-2017年06月30日)	-25.87%	2.15%	-17.42%	2.06%	-8.45%	0.09%
阶段(天弘中证大宗商品股票C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.45%	0.85%	7.32%	0.86%	0.13%	-0.01%
过去三个月	-3.52%	0.98%	-3.57%	0.99%	0.05%	-0.01%
过去六个月	-1.90%	0.90%	-1.38%	0.91%	-0.52%	-0.01%
过去一年	4.05%	0.96%	6.23%	0.98%	-2.18%	-0.02%
自基金合同生效日起至今(2015年06月30日-2017年06月30日)	-26.27%	2.15%	-17.42%	2.06%	-8.85%	0.09%

注: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。

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





注:1.本基金《基金合同》于2015年6月30日生效。

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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金的经理情况

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%
宏润高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业 (有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盛股权投资合伙企业 (有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业 (有限合伙)	2%
新疆天聚滨兴股权投资合伙企业 (有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2017年6月30日,本基金管理人共管理54只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、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)、天弘端利分级债券型证券投资基金、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、天弘增益宝货币市场基金、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、天弘中证金指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证金指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证商端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘远运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安益灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理。	2015年06月	2017年04月	11年	男,经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司,历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。
张子法	本基金基金经理。	2017年4月	-	15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。

注:1、上述任职日期为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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金在运作过程中严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,对指数基金操作采取被动复制与组合优化相结合的方式。

本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回与成分股停牌因素,当由于申赎变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时,在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下,结合市场趋势预判与量化分析,应用指数复制和其他合理方法优化组合结构,最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差,力争投资回报与所跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日,天弘中证大宗商品股票A类基金份额净值为0.7413元,天弘中证大宗商品股票C类基金份额净值为0.7373元。报告期内份额净值增长率天弘中证大宗商品股票A为-1.79%,天弘中证大宗商品股票C为-1.90%,同期业绩比较基准增长率为-1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,按照全国金融工作会议的精神,经济去杠杆特别是国有企业去杠杆将被作为重点工作,在非金融企业债务偏高,楼市整体仍属偏热的情况下,货币政策预计会保持稳健、短期内难再宽松。再加上固定资产投资、工业生产和PPP在二季度出现了放缓,企业盈利增长的放缓压力可能会逐步显现,市场出现整体性机会的要素尚不充分。但市场上也有不少积极因素,六月底MSCI宣布纳入A股将为股市注入新的资金和活力,政治局会议要求实施好积极的财政政策,结构性减税政策的持续落实也将减轻企业税负,十九大的召开又将释放改革开放想象空间,故市场大概率还是以结构性机会为主。大宗商品受经济周期、货币政策、产业政策的影响较大,在供给侧改革继续深化的背景下,短期内的供需不平衡导致不同种类的大宗商品的价格出现了局部的分化,预期将对相应的上市公司产生不同的影响。

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,确保基金资产的估值的公平、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、风险管理人员及监察稽核人员组成。

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、参与估值方案拟议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

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

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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,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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2017年06月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		1,120,380.65	1,294,714.50
结算备付金		5,864.19	28,499.80
存出保证金		17,032.93	13,150.24
交易性金融资产		16,839,819.49	17,163,240.03
其中:股票投资		16,839,819.49	17,163,240.03
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		205,909.51	-
应收利息		580.02	688.70
应收股利		-	-
应收申购款		60,407.91	77,161.48
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,249,994.70	18,577,454.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		416,253.51	261,836.50
应付管理人报酬		7,350.72	7,834.85
应付托管费		1,470.14	1,566.97
应付销售服务费		1,461.39	1,627.77
应付交易费用		8,684.64	17,196.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		102,614.89	138,067.89
负债合计		537,835.29	428,130.24
所有者权益:			
实收基金		23,943,149.52	24,085,420.45
未分配利润		-6,230,990.11	-5,936,095.94
所有者权益合计		17,712,159.41	18,149,324.51
负债和所有者权益合计		18,249,994.70	18,577,454.75

注:报告截止日2017年6月30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0.7413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0.7373元;基金份额总额23,943,149.52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14,730,724.09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9,212,425.43份。

6.2 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:2017年01月01日-2017年06月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日
一.收入		22,443.85	-799,701.19
1.利息收入		11,149.21	10,043.15
其中:存款利息收入		11,149.21	10,043.15
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		4,772.05	-1,078,548.19
其中:股票投资收益		-68,650.11	-1,130,829.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		73,422.16	52,281.73
3.公允价值变动收益		-1,549.16	262,645.63
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		8,071.75	6,158.22
减:二、费用		170,777.51	150,783.20
1.管理人报酬		43,161.45	32,461.04
2.托管费		8,632.24	6,492.21
3.销售服务费		8,566.51	4,417.05
4.交易费用		29,952.35	28,677.48
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		80,464.96	78,735.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-148,333.66	-950,484.39
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-148,333.66	-950,484.39

6.3 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:2017年01月01日-2017年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	24,085,420.45	-5,936,095.94	18,149,324.51
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-148,333.66	-148,333.66
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-142,270.93	-146,560.51	-288,831.44
其中:1.基金申购款	38,443,290.23	-9,575,337.69	28,867,952.54
2.基金赎回款	-38,585,561.16	9,428,777.18	-29,156,783.98
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	23,943,149.52	-6,230,990.11	17,712,159.41
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	15,495,815.42	-3,385,833.08	12,109,982.34
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-950,484.39	-950,484.39
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,654,272.35	-923,413.92	1,730,858.43
其中:1.基金申购款	29,420,279.78	-9,176,414.86	20,243,864.92
2.基金赎回款	-26,766,007.43	8,253,000.94	-18,513,006.49
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)	18,150,087.77	-5,259,731.39	12,890,356.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

郭利强	韩海潮	薄贺龙		

6.4 报表附注

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度上半年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2017年6月30日的财务状况以及2017上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

6.4.7 关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	19,618,225.63	100.00%	19,473,596.37	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
招商证券	18,270.85	100.00%	8,684.64	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
招商证券	18,136.76	100.00%	10,333.78	100.00%

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

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,161.45	32,461.04
其中:支付销售机构的客户维护费	6,315.85	2,609.61

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,632.24	6,492.21

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	4,609.48	4,609.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	4,244.61	4,244.61

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