

## 泰达宏利全球新格局证券投资基金

## [2013] 第四季度报告

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年1月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的合规性、准确性、完整性承担责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年1月17日复核了本报告中的财务数据，复核结果表明该报告的财务指标、净值表现等数据符合基金合同和事实。

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他资料。

本报告财务数据未经审计。

本报告期间为2014年10月1日至2014年12月31日。

## § 2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

基金名称 泰达宏利全球新格局(FOH-FOF)

交易代码 229001

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2013年10月21日

报告期末基金份额总额 35,408,109.99份

投资目标 通过全球大资产配置和固定配置，有效分散投资风险，精选优质区域，主动选股与基金投资相结合，在最低波动的前提下实现基金资产长期稳定增值。

投资策略 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，利用定量与定性分析方法进行大类资产配置，通过深入研究，甄别行业，精选个股，把握投资机会，实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准 摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)总收益。

风险收益特征 本基金属于中高风险收益的基金品种，预期风险高于全球配置型证券投资基金，低于股票基金、基金连带型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目 境外投资顾问 境外资产托管人

名称 英文 The Bank of New York Mellon Corporation

中文 纽约梅隆银行股份有限公司

注册地址 One Wall Street, New York, NY 10286

办公地址 One Wall Street, New York, NY 10286

邮政编码 NY 10286

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

1.本期已实现收益 35,708.50

2.本期利润 2,071,306.96

3.加权平均基金份额本期利润 0.0544

4.期末基金资产净值 37,190,149.49

5.期末基金份额净值 1.050

1.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。

2.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.4 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.5 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.6 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.7 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.8 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.9 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.10 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.11 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.12 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.13 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.14 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.15 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.16 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 5.32% 0.48% 5.96% 0.56% -0.64% -0.08%

本基金的业绩比较基准:摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数(MSCI All Country World Index GDP)。

摩根士丹利资本国际GDP加权指数指称国家权重是基于GDP占比，而不是基于传统的市值占比。相对于股市市值，GDP占比能够更好地反映各国的经济实力，波动性也较小。目前该指数涵盖全球45个国家和地区，是跟踪全球成熟市场和新兴市场的全球性投资指数。

3.2.17 本报告期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