

## 泰达宏利全球新格局证券投资基金管理人

## [2015] 第二季度报告

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：2015年7月20日

## § 1 简要提示

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、误导陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托义务，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期截至为2015年6月30日至2015年6月30日。

## § 2 基金产品概况

基金简称	泰达宏利全球新格局(FOF)
交易代码	229001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月20日
报告期末基金份额总额	7,708,874.55份
投资目标	通过在全球大类资产配置和组合管理，有效分散投资风险，精耕化管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上的综合投资策略，利用定量与定性分析方法进行大类资产配置，确定股票类、商品类、现金类等大类资产在组合中的配置比例，然后通过量化筛选和主题挖掘，精选个股，挖掘具有成长性且价值被低估的上市公司和具有潜力的低成本股。
业绩比较基准	摩根士丹利资本国际GDP指数（MSCI All Country World Index GDP）收益。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的基金品种，预期风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票型基金。
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	-	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
邮编编码	-	NY 10286

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	270,304.90
2.本期利润	-488,185.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0600
4.期末基金份额净值	7,695,196.42
5.期末基金资产净值	0.998

注：本期的利润构成项目为本期收入、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，本期利润即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.述本基金的申购赎回情况的说明项项目，计入申购实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.3 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.4 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.5 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.6 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.7 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.8 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.9 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.10 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.11 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.12 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.13 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.14 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.15 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73% 0.94% 1.30% 0.73% -8.03% 0.21%

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

本基金的资产配置比例：股票占基金总资产的90%-95%，现金、债券及货币市场基金和中国证监会核准的其他金融工具占基金总资产的比例不超过基金总资产的5%；本基金的基金管理人应当按照国家的经济、流动性，目前比例较低，目前数据尚未公布。

3.2.16 本基金报告期份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

价差 净值增长率① 净值增长率标准差② 相比基准收益率③ 相比基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -6.73%