

泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金

[illegible]

泰达宏利全球新格局证券投资基金

2015

第 三 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10月24日

基金管理人及董事会对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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核数字不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本基金会保持有以关于2015年9月22日表决通过的《关于终止泰达宏利全球新格局证券投资基金有关事项的议案》，本基金已于2015年9月25日进行清算。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资有风险，投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金招募说明书及其更新。
本报告期内未发生涉及基金财产的诉讼。
本报告期间为2015年7月1日至2015年9月24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（QDII-FOF）
基金代码	220001
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	9,899,517,691份

投资目标

通过全球大类资产配置和国家配置，有效地分散投资风险，精选优势区域、主动管理与基金投资组合，在降低组合波动性的同时实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金采用自上而下和自下而上相结合的资产配置策略，利用定量与定性分析方式进行大类资产配置，确定权益类资产、固定收益类资产及商品类资产占基金总资产的大致比例范围，并在该范围内根据宏观经济及主要经济体宏观经济形势，在全球进行有效的跨境资产配置，自下而上精选优质股票、基金、大宗商品等良好成长性且价格被低估的上市公司和具有潜力的投资品种。

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 总指）

风险收益特征

本基金为基金中基金，属于中低风险收益的基金品种，预期风险高于全球债券型基金投资品种，低于全球股票型基金。

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：2015年7月1日 - 2015年9月30日
1.本期已实现收益	-329,018.67
2.本期净利润	-846,853.36
3.本期公允价值变动损益	-13,346
4.本期基金净亏损	8,460,740.29
5.本期基金份额净值	0.826

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（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的金额，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，计入费用后实际收益水平要低于所收数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	业绩比较基准标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-④	
自2015年7月1日至2015年9月24日	-14.33%	2.06%	-12.03%	1.14%	-15.0%	0.91%

本基金业绩比较基准：摩根士丹利资本国际全球GDP加权指数（MSCI ALL Country World Index GDP 总指）。本基金投资于全球GDP加权指数权重较大的国家或地区，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国家的经济实力和波动性也较小。目前全球发达经济体共40个国家和地区，是跟踪全球成熟市场新兴市场的全球性投资指数。

3.2.2 本报告期基金份额净值增长率与其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金业绩比较基准增长率与基金净值增长率涨跌幅对比走势图

1.本基金股票、ETF及其它类别的公募基金投资比例为基金资产的60%-95%，其中投资于基金的即不低于本基金基金资产的60%；权益类产品的配置比例不低于基金资产的90%；现金、债券及券型货币基金和中国证监会允许投资的其它金融工具投资比例为基金资产的3%-40%；其中现金或者到期日在本基金合同约定范围内的基金资产净值比例。本基金基金资产的主要投资于与中国证监会备案对监管合作谅解备忘录签署国家或地区、投资其他国家或地区的证券资产不超过基金资产净值的10%。根据基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

2.报告期末，由于基金规模变化等原因，本基金个别资产的比例未达到基金合同约定的要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘威	本基金基金经理	2013年4月9日	2015年9月11日	8	2005年1月至2006年1月就职于美国Pioneer Trading Ltd.,从事欧洲股指期货分析与套利工作。 2006年4月至2008年4月就职于美国Fundamental Data Ltd.,从事数据分析和研究工作。 2008年4月至2010年6月就职于美国Creditly Financial Partners,从事研究工作。 2008年7月至2008年8月就职于美国ODJ Securities,从事研究工作。
					2009年4月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任泰达宏利基金基金经理助理。 2013年4月9日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
刘欣	本基金基金经理	2015年9月21日	-	8	清华大学工学硕士，2007年7月至2008年12月就职于广发银行股份有限公司，从事基金业务管理工作； 2008年12月至2010年12月就职于广发基金管理有限公司； 2011年7月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任产品及金融工程助理研究员，现任任金融工程助理研究员、基金风控，具有证券投资基金从业资格，8年证券基金投资管理经验，具有基金从业资格。

正：证券从业的含通过行业协会《证券市场从业人员资格管理的规定》的相关规定。表中的任职日期指离任日期指由相关公司公告中披露的日期。

4.2 境外投资顾问对本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 报告期末本基金运作合规性情况说明

本报告期末，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管

理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会，严格执行投资管理制度和交易执行流程的隔离，在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部通过交易系统设置的公平交易功能按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令；对于部分债券一致行动申购、非公开发售申购等以公司名义进行的交易，交易部按照接收指令、分配比例的原则对交易结果进行统计，确保各投资组合享有公平的投资机会。

风险管理部对于本报告期的公平交易执行情况进行数据统计、分析，在本报告期内，没有发生利益冲突、不公平对待不同投资组合的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的异常行为进行行评估，向公司风险控制部提交公募基金和特定客户资产组合的异常交易行为分析报告。在本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合同日反向交易成交较少的单边交易量均不超过该证券当日成交量的5%，在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.5 报告期末基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度，全球股票市场均经历大幅波动，其中亚太市场振幅较大。大宗商品持续低迷，黄金原油价格均出现回升。

本基金在操作中，在符合基金合约的前提下，逐渐聚焦于受益于国内经济发展与互联互通政策的香港市场基金与股票。在结构上通过合理的分散降低组合风险。

4.5.2 报告期内基金的投资组合和资产构成

截止2015年9月24日，本基金份额净值为0.826元，本报告期份额净值增长率为-14.33%，同期业绩比较基准增长率为-12.83%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.7 报告期末基金持有人数或基金资产净值情况说明

1.本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人的情形。
2.2014年1月11日至本报告期末（2015年9月24日），本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况，本基金份额持有人大会于2015年9月22日表决通过了《关于终止泰达宏利全球新格局证券投资基金有关事项的议案》，本基金已于2015年9月25日进行清算。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	0.00
其中：股票	-	0.00	0.00
其中：港股	-	0.00	0.00
其中：权证	-	0.00	0.00
其中：资产支持证券	-	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
其中：远期	-	0.00	0.00
期货	-	0.00	0.00
5	固定收益类资产	-	0.00
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00	0.00
6	银行存款	-	0.00
其中：央行票据	-	0.00	0.00
其中：中期票据	-	0.00	0.00
其中：短期融资券	-	0.00	0.00
其中：资产支持证券	-	0.00	0.00
其中：债券回购	-	0.00	0.00
其中：其他	-	0.00	0.00
7	其他资产	-	0.00
8	合计	8,972,307.62	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场投资的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证

5.4 报告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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

5.7 报告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

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	511.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511.21

5.10.4 报告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

5.10.5 报告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未持有流通受限情况。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额	7,708,474.56
报告期内基金总申购份额	5,886,269.65
报告期内基金总赎回份额	3,707,160.62
报告期内基金拆分变动份额	份额减少以“-”填列
报告期末基金份额总额	9,899,517.69

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金投资明细

本基金的管理人在本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 泰达宏利基金管理人于2015年9月15日发布《泰达宏利基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》，聘任刘建先生为公司总经理。
2015年9月24日，基金管理人发布《关于泰达宏利全球新格局证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，公告显示，本基金份额持有人大会于2015年9月22日表决通过了《关于终止泰达宏利全球新格局证券投资基金有关事项的议案》，本基金已于2015年9月25日进行清算。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准泰达宏利全球新格局证券投资基金设立的文件；
2、泰达宏利全球新格局证券投资基金基金合同；
3、《泰达宏利全球新格局证券投资基金招募说明书》；
4、《泰达宏利全球新格局证券投资基金托管协议》。
5、存放地点：基金管理人及基金托管人的住所。
9.2 查阅方式
投资人可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录基金管理人互联网网站（http://www.mfcteda.com）查阅。
泰达宏利基金管理有限公司
2015年10月24日

券型证券投资基金

三 季 度 报 告

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,538,873.00	0.69
其中：股票	5,538,873.00	0.69	
其中：港股	776,993,530.80	96.84	
其中：债券	776,993,530.80	96.84	
资产支持证券	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-
5	固定收益类资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	2,474,503.54	0.31
7	其他资产	17,308,012.80	2.16
8	合计	802,314,002.94	100.00

5.2 报告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

序号	行业类别	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、渔业	-	-	-	-
B	采矿业	-	-	-	-
C	制造业	-	2,140,200.00	0.26	-
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	-	3,396,672.60	0.46	-
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	卫生和社工作	-	-	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-	-	-
S	综合	-	-	-	-
合计	-	-	5,538,873.00	0.73	-

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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	601138	东方银行	786,730	3,396,672.60	0.46
2	600959	东方电气	171,216	2,140,200.00	0.28

注：上述说明均为本基金本报告期末持有的全部股票。

5.4 报告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

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,098,000.00	5.32
其中：政策性金融债	-	40,098,000.00	5.32
4	企业债券	401,752,503.80	53.27
5	金融债融资券	201,429,000.00	26.71
6	中期票据	133,724,000.00	17.73
7	短期融资券	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	776,993,530.80	103.02