

泰达宏利全球新格局证券投资基金清算报告

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

信息披露日期：2016年1月26日

§1 重要提示

泰达宏利全球新格局证券投资基金（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[2010]1810号文核准，由基金管理人泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司或管理人”）向社会公开发行募集，基金合同于2011年7月20日生效。基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《泰达宏利全球新格局证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了《关于终止泰达宏利全球新格局证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本公司于2015年9月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了《泰达宏利基金管理有限公司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暨决议生效的公告》。依据生效的基金份额持有人大会决议，本基金从2015年9月25日起进入清算期，由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、普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见。

§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证券投资基金
基金简称	泰达宏利全球新格局（QDII-FOF）
基金代码	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
最后运作日（2015年9月24日）基金份额总额	9,899,517.68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。主动选股与基金投资相结合，在降低组合波动性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，确定权益类产品、商品类基金、现金及货币市场工具等大类资产配置比例。然后通过量化模型及主要经济体宏观经济分析，在全球进行有效的国家/地区配置。自下而上精选股票、基金，挖掘具有良好成长性且价值被低估的上市公司和具有潜力的低成本基金。
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) 总收益。
风险收益特征	本基金为基金中的基金，属于中高风险收益的基金品种，预期风险高于全球债券型证券投资基金，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	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 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利全球新格局证券投资基金

报告截止日：2015年9月24日（基金最后运作日）

（除特别注明外，金额单位为人民币

元）

资 产	本期末 2015年9月24日(基 金最后运作日)	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	5,353,556.27	5,054,839.89
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,218,240.04	43,237,864.88
其中：股票投资	-	1,267,670.79
基金投资	3,218,240.04	41,970,194.09
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	-	-
应收利息	511.21	215.42
应收股利	-	26,138.47
应收申购款	-	1,192.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,572,307.52	48,320,251.51

3.1 资产负债表(续)

会计主体：泰达宏利全球新格局证券投资基金

报告截止日：2015年9月24日（基金最后运作日）

负债和所有者权益	本期末 2015年9月24日(基 金最后运作日)	上年度末 2014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	56,767.76	232,377.59
应付管理人报酬	10,051.85	74,015.15
应付托管费	1,954.51	14,391.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	36,787.60	72,022.58
负债合计	105,561.72	392,807.14
所有者权益：		
实收基金	9,899,517.68	48,632,652.32
未分配利润	-1,432,771.88	-705,207.95
所有者权益合计	8,466,745.80	47,927,444.37
负债和所有者权益总计	8,572,307.52	48,320,251.51

3.2 利润表

会计主体：泰达宏利全球新格局证券投资基金

报告期间：2015年1月1日至2015年9月24日（基金最后运作日）

（除特别注明外，金额单位为人民币

元）

项目	本期 2015年1月1日至 2015年9月24日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2014年度
一、收入	149,627.97	-8,388.01
利息收入	7,333.08	16,314.79
其中：存款利息收入	7,333.08	16,314.79
投资收益(损失以“-”填列)	920,678.04	3,126,197.32
其中：股票投资收益	-65,014.30	274,806.92
基金投资收益	919,040.60	2,394,606.20
股利收益	66,651.74	456,784.20
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,420,097.99	-3,170,831.60
汇兑收益(损失以“-”号填列)	582,609.75	9,318.22
其他收入(损失以“-”号填列)	59,105.09	10,613.26
减：二、费用	277,701.85	1,034,292.94
管理人报酬	139,796.25	555,255.24
托管费	27,182.59	107,966.29
交易费用	71,691.76	165,091.52
其他费用	39,031.25	205,979.89
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-128,073.88	-1,042,680.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-128,073.88	-1,042,680.95

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利全球新格局证券投资基金

报告期间：2015年1月1日至2015年9月24日（基金最后运作日）

（除特别注明外，金额单位为人民币

元）

项目	本期 2015年1月1日至2015年9月24日(基金最后开放日的确认日)		
	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)	48,632,652.32	-705,207.95	47,927,444.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-128,073.88	-128,073.88
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)	-38,733,134.64	-599,490.05	-39,332,624.69
其中：1. 基金申购款	13,961,400.90	-201,057.56	13,760,343.34
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-52,694,535.54	-398,432.49	-53,092,968.03
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)	9,899,517.68	-1,432,771.88	8,466,745.80
项目	上年度可比期间 2014年度		
	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)	35,408,110.99	1,782,038.50	37,190,149.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,042,680.95	-1,042,680.95
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)	13,224,541.33	-1,444,565.50	11,779,975.83
其中：1. 基金申购款	40,429,342.86	-421,582.02	40,007,760.84
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-27,204,801.53	-1,022,983.48	-28,227,785.01
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)	48,632,652.32	-705,207.95	47,927,444.37
-----------------	---------------	-------------	---------------

注：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§4 清盘事项说明

4.1 清算起始日及资产支付日

根据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暨决议，2015年9月24日为本基金的运作终止日。本基金的清算期间为2015年9月25日至资产支付日。根据本基金合同和相关法规规定，管理人将于证监会备案并且清算报告公告后（资产支付日）向基金份额持有人分配截至前一日の本基金全部剩余财产。

4.2 清算费用

按照泰达宏利全球新格局证券投资基金基金合同第二十部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

4.3 清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2015 年 9 月 24 日基金净资产	8,466,745.80
加：清算期间（2015-9-25 至 2015-11-30）收入	8,746.50
利息收入	8,369.62
投资收益	-1,027,733.78
公允价值变动损益	1,039,289.86
汇兑损益	-11,179.42
其他收入	0.22

减：基金净赎回金额（于 2015 年 9 月 25 日确认的投资者赎回申请）	177.18
减：清算期间（2015-9-25 至 2015-11-30）费用	6,263.58
二、2015 年 11 月 30 日（清算报告出具日）基金净资产	8,469,051.54

4.4 清算报告出具日（2015-11-30）至资产支付日的资金变动情况说明

2015年11月30日(清算报告出具日)至资产支付日前的银行存款利息归基金份额持有人所有，本报告不做具体说明，结息金额以银行结息的实际金额为准。

如果银行存款利息在清算款划出日未能结息，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，本管理人将先行垫付该笔资金（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。管理人将垫付清算期间产生的应收利息（如有），管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。

4.5 清算资产的支付

管理人预计于收到证监会备案函并公告后的三个工作日内下达指令给托管人，将可供分配剩余财产总额划付给基金份额持有人。

基金份额持有人获取的金额=（可供分配剩余财产总额/合同截止日总份额）*每个基金份额持有人持有份额。

4.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§5 备查文件目录

5.1 备查文件目录

- 1、泰达宏利全球新格局证券投资基金2015年9月24日资产负债表及审计报告
- 2、《泰达宏利全球新格局证券投资基金清算报告》的法律意见

5.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

5.3 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址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

泰达宏利全球新格局证券投资基金基金财产清算小组

2016年1月26日