

泰信天天收益
开放式证券投资基金 2009 年半年度报告
2009 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2009 年 8 月 25 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 20 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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	1
2	基金简介.....	1
2.1	基金基本情况.....	1
2.2	基金产品说明.....	1
2.3	基金管理人和基金托管人.....	1
2.5	信息披露方式.....	2
2.6	其他相关资料.....	2
3	主要财务指标、基金净值表现.....	2
3.1	主要会计数据和财务指标.....	2
3.2	基金净值表现.....	2
4	管理人报告.....	3
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	3
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	5
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	5
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.....	5
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	6
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	6
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	6
§5	托管人报告.....	7
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	7
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	7
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	7
§6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	8
6.1	资产负债表.....	8
6.2	利润表.....	9
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	10
6.4	报表附注.....	10

§7 投资组合报告	22
7.1 期末基金资产组合情况	22
7.2 债券回购融资情况	22
7.3 基金投资组合平均剩余期限	23
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	23
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	24
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	24
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	24
7.8 投资组合报告附注	24
8 基金份额持有人信息	25
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	25
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	25
9 开放式基金份额变动	25
10 重大事件揭示	26
10.1 基金份额持有人大会决议	26
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	26
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	26
10.4 基金投资策略的改变	26
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	26
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	26
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	27
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	27
10.9 其他重大事件	27
§11 备查文件目录	28

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信天天收益开放式证券投资基金
基金简称	泰信天天收益货币
交易代码	290001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 2 月 10 日
报告期末基金份额总额	2, 423, 452, 594. 08

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金安全和资产的充分流动性, 追求超过业绩比较基准的现金收益
投资策略	运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略追求低风险稳定收益并保持基金资产的最佳流动性
业绩比较基准	半年期银行定期存款税后利率： (1-利息税率)*半年期银行定期存款利率
风险收益特征	属于风险较低、预期收益率较低、流动性较强的证券投资基金品种

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		泰信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴胜光	宁敏
	联系电话	021-50372168	010-66594977
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-50372197	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F	中国北京市复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F	中国北京市复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		孟凡利	肖钢

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F

2.6 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	泰信基金管理有限公司
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42 F

3 主要财务指标、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（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	19,185,255.24
本期利润	19,185,255.24
本期净值收益率	0.7672%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
期末基金资产净值	2,423,452,594.08
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
累计净值收益率	14.1722%

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用（例如基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

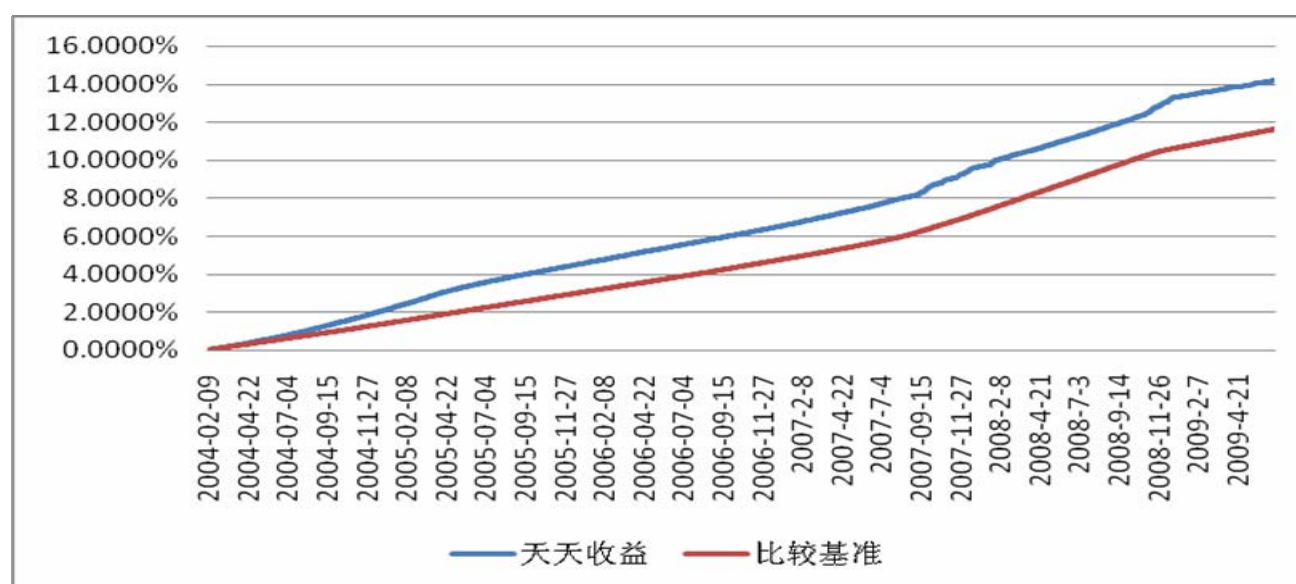
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1340%	0.0075%	0.1627%	0.0000%	-0.0287%	0.0075%

过去三个月	0.3850%	0.0065%	0.4936%	0.0000%	-0.1086%	0.0065%
过去六个月	0.7672%	0.0052%	0.9819%	0.0000%	-0.2147%	0.0052%
过去一年	2.6640%	0.0073%	2.6253%	0.0020%	0.0387%	0.0053%
过去三年	8.2122%	0.0060%	7.7480%	0.0021%	0.4642%	0.0039%
自基金合同生效起至今	14.1722%	0.0050%	11.6009%	0.0021%	2.5713%	0.0029%

注：本基金业绩比较基准为：半年期银行定期存款税后利率

半年期银行定期存款税后利率=（1-利息税率）*半年期银行定期存款利率

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



注：

1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同的“十七、基金的投资”部分中“（四）投资对象与范围”和“（八）投资组合”所规定的各项比例。

各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为，短期债券 20-60%，债券回购 0-80%，央行票据 0-70%，现金 5-80%。

2、因业务发展需要，经基金管理人第二届董事会2009年第2次（通讯）会议审议通过，同意何俊春女士不再兼任泰信天天收益基金基金经理，由现任基金经理之一马成先生继续管理该基金。详细情况请见2009年4月18日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司关于调整泰信天天收益基金基金经理的临时公告》。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：高清海

电话：(021) 50372168

传真：(021) 50372197

联系人：王伟毅

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是国内实施“好人举手制”以来第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设市场营销团队（分华东、华北、华南三个业务部）、营销策划及基金事务团队（分基金事务、客户服务、营销策划）、新业务团队（分理财顾问部、新业务销售）、基金投资部、研究部、金融工程部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部及北京分公司、深圳分公司。截至 2009 年 6 月 30 日，公司共管理泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票等 6 只开放式基金，基金资产规模 141.96 亿元。

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		
何俊春女士	本基金基金经理兼泰信双息双利基金经理	2007 年 2 月 9 日	2009 年 4 月 18 日	11	工商管理硕士，曾在齐鲁证券任职。2002 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任交易员、交易主管。2008 年 10 月起兼任泰信双息双利基金基金经理。
马成先生	本基金基金经理	2008 年 10 月 10 日	-	6	经济学硕士。2003 年加入泰信基金管理公司，先后担任理财顾问部高级经理，投资管理部经理助理，集中交易室交易主管，泰信双息双利基金经理助理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金管理暂行办法》等法律法规和《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人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，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008] 9 号），公司制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由金融工程部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下管理的其他基金中不存在与本基金风格相似的情形，相互之间的业绩表现不具有可比性。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在本报告期内不存在异常交易行为。

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 基金业绩表现

截至报告期末，本报告期基金净值收益率为 0.7672%，同期业绩比较基准收益率为 0.9819%。

4.4.2 行情回顾及运作分析

一季度，虽然国际经济环境形势不明朗，但是随着国内外一系列振兴经济措施的出台以及部分经济指标的回升，特别是在贷款超预期的增长下，引发了市场对通胀上升的担忧，最明显的就是对继续降息的预期大大降低。加之 A 股反弹所造成的资金分流效应使得债市在 1 月份出现一波较大幅度的回调，收益率曲线进一步陡峭化，信用债利差显著缩小。随后，债券价又开始小幅反弹。

二季度，国际、国内经济形势逐步好转，央行继续维持适度宽松的货币政策，信贷规模超预期增长，上半年新增贷款达到创纪录的 7.4 万亿。PMI 从 3 月份开始，连续四个月位于临界点 50%以上，6 月全月发电

量同比实现 3.6% 的正增长，是自 2008 年 10 月以来首次实现月发电量正增长。基准利率和存款准备金率没有调整，但是银行超储率比第一季度有较大幅度所回落。市场流动性依然充裕，贸易数据仍然没有明显好转。随着大宗商品价格的上涨，市场对通货膨胀的预期加大。5 月下旬，IPO 的恢复，对债券市场产生了较大的影响，货币市场收益率显著上行。

报告期内本基金规模总体保持稳定，继续维持低久期策略，降低利率风险，充分保证了基金的流动性。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对国内而言，经济复苏已经得到确认。虽然当前市场上流动性仍然充裕，但是随着 IPO 的恢复，以及央行对宽松的货币政策进行微调，将对货币市场利率产生较大的影响，中短期利率的波动性必将加大，而且将出现逐步上行的趋势。虽然央行将继续维持适度宽松的货币政策，但是进一步释放流动性并没有太多的空间。央行使用最频繁的手段可能仍然是公开市场业务，而且公开市场操作的利率将逐步上行。

我们认为未来一段时间债券收益率曲线可能会进一步平坦然后再继续陡峭。泰信天天收益基金将继续坚持稳健投资策略，采取短久期策略，以保证本基金良好的流动性、灵活性和安全性，积极把握各种交易机会，为持有人继续创造安全稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

按照相关法律法规，本公司制定了《泰信基金管理有限公司证券投资基金估值政策与程序》，成立了估值委员会，由主管基金运营的公司总经理助理负责，成员包括清算会计、金融工程、基金投资、监察稽核等业务骨干，所有成员均具有较为丰富的证券投资基金从业经验。估值委员会负责制定、修订估值政策与程序、定期对估值政策和程序进行评价，负责确定估值模型、估值流程，对特殊投资品种给出估值价格，及对外信息披露工作等。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突，本基金基金经理不参与估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、基金合同关于利润分配的约定：

(1) 本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。投资者当日收益的精度为 0.01 元，第三位采用去尾的方式。因去尾形成的余额进行再次分配。

(2) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。

(3) 本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累

计收益恰好为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者全部赎回基金份额时，其收益将立即结清，若收益恰好为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除。

(4) T 日申购的基金份额不享有当日分红权益，赎回的基金份额享有当日分红权益。

(5) 本基金收益每月固定日期集中支付一次，成立不满一个月不支付。每一基金份额享有同等分配权。

2、报告期内已实施的利润分配情况：

本报告期内，本基金以累计收益转份额的形式进行了 6 次收益支付，金额总计 21,713,183.99 元。进行的收益支付包括上年度最后一个收益结转日之后未结转的收益，不包括当前会计期间最后一个结转日之后实现的收益。

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信天天收益开放式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。
(注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

中国银行股份有限公司

2009 年 8 月 20 日

§ 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：泰信天天收益开放式证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6. 4. 7. 1	328, 469, 937. 44	732, 006, 454. 75
结算备付金		4, 888, 888. 89	1, 500, 000. 00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	1, 329, 735, 503. 69	3, 487, 978, 977. 76
其中：股票投资		-	-
债券投资		1, 329, 735, 503. 69	3, 487, 978, 977. 76
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	790, 000, 000. 00	-
应收证券清算款		-	100, 028, 000. 00
应收利息	6. 4. 7. 5	13, 050, 523. 12	6, 091, 017. 49
应收股利		-	-
应收申购款		140, 410, 439. 17	-
其他资产	6. 4. 7. 6	-	-
资产总计		2, 606, 555, 292. 31	4, 327, 604, 450. 00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 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		179, 983, 900. 00	-
应付赎回款		40, 694. 08	9, 920. 10
应付管理人报酬		538, 660. 69	859, 381. 71
应付托管费		163, 230. 50	260, 418. 70
应付销售服务费		408, 076. 32	651, 046. 73
应付交易费用	6. 4. 7. 7	11, 075. 60	47, 938. 05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		1, 659, 148. 02	7, 267, 513. 88
其他负债	6. 4. 7. 8	297, 913. 02	294, 500. 00
负债合计		183, 102, 698. 23	9, 390, 719. 17

所有者权益：			
实收基金	6. 4. 7. 9	2, 423, 452, 594. 08	4, 318, 213, 730. 83
未分配利润	6. 4. 7. 10	-	-
所有者权益合计		2, 423, 452, 594. 08	4, 318, 213, 730. 83
负债和所有者权益总计		2, 606, 555, 292. 31	4, 327, 604, 450. 00

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,423,452,594.08 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信天天收益开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期金额 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间金额 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
一、收入		28, 309, 157. 53	38, 867, 720. 78
1. 利息收入		22, 299, 574. 24	38, 648, 261. 27
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	549, 873. 77	1, 316, 114. 78
债券利息收入		20, 086, 288. 03	23, 204, 263. 19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1, 663, 412. 44	14, 127, 883. 30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6, 009, 583. 29	218, 584. 51
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 13	6, 009, 583. 29	218, 584. 51
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 14	-	-
股利收益	6. 4. 7. 15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 16	-	-
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	-	875. 00
二、费用		-9, 123, 902. 29	-8, 131, 289. 19
1. 管理人报酬		-4, 210, 516. 92	-3, 754, 095. 77
2. 托管费		-1, 275, 914. 14	-1, 137, 604. 73
3. 销售服务费		-3, 189, 785. 65	-2, 844, 012. 04
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	-	-
5. 利息支出		-229, 256. 97	-280, 068. 33
其中：卖出回购金融资产支出		-229, 256. 97	-280, 068. 33
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	-218, 428. 61	-115, 508. 32
三、利润总额		19, 185, 255. 24	30, 736, 431. 59
四、净利润		19, 185, 255. 24	30, 736, 431. 59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信天天收益开放式证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 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）	4,318,213,730.83	-	4,318,213,730.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,185,255.24	19,185,255.24
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）	-1,894,761,136.75	-	-1,894,761,136.75
其中：1. 基金申购款	4,416,085,214.77	-	4,416,085,214.77
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-6,310,846,351.52	-	-6,310,846,351.52
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）	-	-19,185,255.24	-19,185,255.24
五、期末所有者权益（基金净值）	2,423,452,594.08	-	2,423,452,594.08
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 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）	3,669,627,758.73	-	3,669,627,758.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,736,431.59	30,736,431.59
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）	-1,324,414,224.45	-	-1,324,414,224.45
其中：1. 基金申购款	8,314,063,473.68	-	8,314,063,473.68
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-9,638,477,698.13	-	-9,638,477,698.13
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）	-	-30,736,431.59	-30,736,431.59
五、期末所有者权益（基金净值）	2,345,213,534.28	-	2,345,213,534.28

6.4 报表附注**6.4.1 基金基本情况**

泰信天天收益开放式证券投资基金(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”)证监基金字[2003]147 号《关于同意泰信天天收益开放式证券投资基金设立的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《泰信天天收益开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2004 年 2 月 10 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,020,966,560.32 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道(中天)验字(2004)第 004 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为流动性良好的短期金融工具,包括到期期限在一年以内的国债、金融债、央行票据、AAA 级企业债、债券回购、同业存款以及中国证监会、中国人民银行等部门批准基金投资的商业票据及其他流动性良好的短期金融工具。本基金投资组合的平均剩余期限不超过 180 天。各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为,短期债券 20-60%,债券回购 0-80%,央行票据 0-70%,现金 5-80%。本基金的业绩比较基准为半年期银行定期存款税后利率。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年半年度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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年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一致的说明。

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	328,469,937.44
定期存款	-
其他存款	-
合计	328,469,937.44

6.4.7.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,329,735,503.69	1,334,042,060.00	4,306,556.31	0.1777%
资产支持证券		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,329,735,503.69	1,334,042,060.00	4,306,556.31	0.1777%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；

偏离度=偏离金额/基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	790,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	790,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
应收活期存款利息	26,009.71
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,711.10
应收债券利息	12,943,830.87
应收买入返售证券利息	78,971.44
应收申购款利息	-
其他	-
合计	13,050,523.12

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	11,075.60
合计	11,075.60

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	297,823.61

其他	89.41
合计	297,913.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,318,213,730.83	4,318,213,730.83
本期申购	4,416,085,214.77	4,416,085,214.77
本期赎回	-6,310,846,351.52	-6,310,846,351.52
本期末	2,423,452,594.08	2,423,452,594.08

注：(a) 本期申购包含红利再投以及转换入的份额，本期赎回包含本期转换出的份额。

(b) 本期申购包含红利再投资 21,713,183.99 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	19,185,255.24	-	19,185,255.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-19,185,255.24	-	-19,185,255.24
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	505,576.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	44,296.89
其他	-
合计	549,873.77

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

卖出债券及债券到期兑付成交金额	5,581,984,958.87
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-5,558,629,321.02
应收利息总额	-17,346,054.56
债券投资收益	6,009,583.29

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行汇划手续费	16,105.00
债券托管帐户维护费	8,926.92
合计	218,428.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

	宣告日	分配收益所属期间
2009 年 7 月 1 日至 2009 年 8 月 25 日		
一第 1 号收益支付公告	2009/07/10	2009/06/10-2009/07/09
一第 2 号收益支付公告	2009/08/10	2009/07/10-2009/08/09

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

无。

6.4.9.2 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
泰信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托有限公司（“山东国投”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信实业有限公司（“青岛国信”）	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	4,210,516.92	3,754,095.77
其中：当期已支付	3,671,856.23	3,165,170.73
期末未支付	538,660.69	588,925.04

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 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 * 0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
----	-------------------------------------	--

	日	
当期应支付的托管费	1, 275, 914. 14	1, 137, 604. 73
其中：当期已支付	1, 112, 683. 64	959, 142. 57
期末未支付	163, 230. 50	178, 462. 16

注：支付基金托管人中国银行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 * 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
泰信基金管理有限公司	1, 575, 776. 89	208, 125. 37	1, 783, 902. 26
中国银行	620, 477. 58	137, 404. 18	757, 881. 76
合计	2, 196, 254. 47	345, 529. 55	2, 541, 784. 02
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
泰信基金管理有限公司	2, 096, 935. 17	386, 785. 66	2, 483, 720. 83
中国银行	88, 885. 40	217, 215. 50	306, 100. 90
合计	2, 185, 820. 57	604, 001. 16	2, 789, 821. 73

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泰信基金管理有限公司，再由泰信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 * 0.25 % / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	313, 394, 603. 70	98, 809, 998. 63	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	596, 364, 609. 84	796, 758, 981. 37	-	-	193, 500, 000. 00	10, 369. 35

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
山东省国际信托有限公司	54,950,742.51	2.27%	100,036,217.52	2.32%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	328,469,937.44	505,576.88	134,354,931.05	1,222,634.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金**

单位：人民币元

项目	本期累计分配金额
利润分配合计—再投资形式发放	19,185,255.24

注：本基金在本会计期间累计分配收益 19,185,255.24 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 14,445,670.11 元，包含于赎回款的已分配未支付收益 3,080,437.11 元，计入应付收益科目的变动数 1,659,148.02 元。

6.4.12 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险品种。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会、督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的四道监控防线。督察长全面负责、指导公司的监察稽核工作，对公司经营、基金投资等业务运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，并向公司董事长和中国证监会报告。监察稽核部下设监察稽核岗和法律事务岗，监察稽核岗负责检查、评价相关制度的合理性、完备性和有效性，监督制度的执行情况，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度的有效执行；法律事务岗协调公司经营、基金运作等业务相关的法律事务，检查各项业务的合法、合规性，检查员工行为的合规性，调查违规行为等。公司金融工程部负责运用定量分析模型，根据各基金的投资目标及投资策略，定期对基金的投资组合风险进行评估，并向投资决策委员会提交业绩评估报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2009年6月30日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	328,469,937.44	-	-	-	-	-	328,469,937.44
结算备付金	4,888,888.89	-	-	-	-	-	4,888,888.89
交易性金融资产	150,014,441.97	800,831,880.94	378,889,180.78	-	-	-	1,329,735,503.69
买入返售金融资产	790,000,000.00	-	-	-	-	-	790,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	13,050,523.12	13,050,523.12
应收申购款	-	-	-	-	-	140,410,439.17	140,410,439.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,273,373,268.30	800,831,880.94	378,889,180.78	-	-	153,460,962.29	2,606,555,292.31
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	179,983,900.00	179,983,900.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	40,694.08	40,694.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	538,660.69	538,660.69
应付托管费	-	-	-	-	-	163,230.50	163,230.50
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,075.60	11,075.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	408,076.32	408,076.32
应付利润	-	-	-	-	-	1,659,148.02	1,659,148.02
其他负债	-	-	-	-	-	297,913.02	297,913.02
负债总计	-	-	-	-	-	183,102,698.23	183,102,698.23

利率敏感度缺口	1, 273, 373 , 268. 30	800, 831, 8 80. 94	378, 889, 1 80. 78	-	-	-29, 641, 73 5. 94	2, 423, 452, 594. 0 8
上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	732, 006, 4 54. 75	-	-	-	-	-	732, 006, 454. 75
结算备付金	1, 500, 000 . 00	-	-	-	-	-	1, 500, 000. 00
交易性金融资产		847, 526, 8 47. 55	2, 640, 452 , 130. 21	-	-	-	3, 487, 978, 977. 7 6
应收证券清算款						100, 028, 00 0. 00	100, 028, 000. 00
应收利息	-	-	-	-	-	6, 091, 017. 49	6, 091, 017. 49
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	733, 506, 4 54. 75	847, 526, 8 47. 55	2, 640, 452 , 130. 21	-	-	106, 119, 01 7. 49	4, 327, 604, 450. 0 0
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9, 920. 10	9, 920. 10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	859, 381. 71	859, 381. 71
应付托管费	-	-	-	-	-	260, 418. 70	260, 418. 70
应付交易费用	-	-	-	-	-	47, 938. 05	47, 938. 05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	651, 046. 73	651, 046. 73
应付利润	-	-	-	-	-	7, 267, 513. 88	7, 267, 513. 88
其他负债	-	-	-	-	-	294, 500. 00	294, 500. 00
负债总计	-	-	-	-	-	9, 390, 719. 17	9, 390, 719. 17
利率敏感度缺口	733, 506, 4 54. 75	847, 526, 8 47. 55	2, 640, 452 , 130. 21	-	-	96, 728, 298 . 32	4, 318, 213, 730. 8 3

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：万元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 324.1	增加约 422
	市场利率上升 25 个基点	下降约 319.5	下降约 411

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,329,735,503.69	51.02
	其中：债券	1,329,735,503.69	51.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	790,000,000.00	30.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	333,358,826.33	12.79
4	其他资产	153,460,962.29	5.88
	合计	2,606,555,292.31	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	6,230,056,796.26	1.78
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：1. 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。对于交易所休市而银行间有交易的情况，也视为交易日统计在内。

2. 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	172
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	52.54	7.43
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	19.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	13.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	6.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.11	-
5	180 天(含)—397 天(含)	9.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.22	7.43

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	688,624,945.24	28.42
3	金融债券	393,044,298.35	16.22
	其中：政策性金融债	210,817,117.77	8.70
4	企业债券	26,900,539.30	1.11
5	企业短期融资券	221,165,720.80	9.13
6	其他	-	-
	合计	1,329,735,503.69	54.87
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	26,900,539.30	1.11

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	0801092	08 央票 92	2,900,000	289,335,480.91	11.94
2	0801104	08 央票 104	2,000,000	199,602,703.78	8.24
3	040705	04 建行 03 浮	1,814,000	182,227,180.58	7.52
4	040214	04 国开 14	1,000,000	100,511,976.97	4.15
5	0901012	09 央票 12	1,000,000	99,977,472.82	4.13
6	0801112	08 央票 112	1,000,000	99,709,287.73	4.11
7	0881167	08 明珠 CP01	800,000	80,453,738.23	3.32
8	0881191	08 北车 CP01	700,000	70,659,809.40	2.92
9	080415	08 农发 15	600,000	60,268,171.65	2.49
10	020208	02 国开 08	500,000	50,036,969.15	2.06

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	58
报告期内偏离度的最高值	0.4086%
报告期内偏离度的最低值	0.1510%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2589%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明：本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

7.8.2 本报告期内无剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动债的摊余成本超过日基金资产净值 20%的情况。

7.8.3 本基金本期末持有的前十名证券中没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,050,523.12
4	应收申购款	140,410,439.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	153,460,962.29

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
10,611	228,390.59	1,375,756,326.34	56.77%	1,047,696,267.74	43.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	269,936.93	0.0111%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 2 月 10 日）基金份额总额	6,023,310,189.68
报告期期初基金份额总额	4,318,213,730.83

报告期期间基金总申购份额	4,416,085,214.77
报告期期间基金总赎回份额	-6,310,846,351.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,423,452,594.08

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因业务发展需要，经基金管理人第二届董事会2009年第2次（通讯）会议审议通过，同意何俊春女士不再兼任泰信天天收益基金基金经理，由现任基金经理之一马成先生继续管理该基金。详细情况请见2009年4月18日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《泰信基金管理有限公司关于调整泰信天天收益基金基金经理的临时公告》。

除此之外，报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为普华永道中天会计师事务所有限公司。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	9,181,800,000.00	100%	-	-	

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2009 年春节长假前暂停申购和转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 1 月 20 日
2	新增宏源证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 2 月 5 日
3	新增恒泰证券为代销机构并开通基金定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 2 月 10 日
4	基金在中信银行开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 2 月 11 日
5	新增江海证券为代销机构并开通基金定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 13 日
6	新增工商银行为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 3 月 28 日
7	新增长城证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 4 月 9 日
8	新增爱建证券为基金代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 7 日

9	继续参与中国银行开展的基金定期定额交易及网银申购费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 7 日
10	新增华宝证券为代销机构	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 14 日
11	在华夏银行开通基金转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 5 月 20 日
12	取消大额申购限制	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2009 年 6 月 11 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信天天收益开放式证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信天天收益开放式证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信天天收益开放式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

11.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

11.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2009年8月25日