

泰信天天收益开放式证券投资基金 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 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：2013 年 3 月 29 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 2013 年 3 月 26 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 审计报告 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 16 |
| §7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表..... | 17 |
| 7.2 利润表..... | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 7.4 报表附注..... | 20 |
| §8 投资组合报告 | 39 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 8.2 债券回购融资情况..... | 39 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 39 |
| 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 8.5 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..... | 41 |
| 8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 41 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 8.8 投资组合报告附注..... | 41 |

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| §9 基金份额持有人信息 | 42 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 42 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 42 |
| §10 开放式基金份额变动 | 43 |
| §11 重大事件揭示 | 43 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 43 |
| 11.2 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..... | 43 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 44 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 44 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 45 |
| 11.9 其他重大事件..... | 45 |
| §12 备查文件目录 | 47 |
| 12.1 备查文件目录..... | 47 |
| 12.2 存放地点..... | 47 |
| 12.3 查阅方式..... | 48 |

§ 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 |
| 基金主代码 | 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 532,774,681.83份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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 | 唐国培 | 唐州徽 |
| | 联系电话 | 021-20899032 | 010-66594855 |
| | 电子邮箱 | xxpl@ftfund.com | tgxxpl@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-5988 | 95566 |
| 传真 | | 021-20899008 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区浦东南路256号37层 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区浦东南路256号 华夏银行大厦36-37层 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100818 |
| 法定代表人 | | 孟凡利 | 肖钢 |

2.4 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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ftfund.com |
| 基金年度报告报告备置地点 | 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 |
| 注册登记机构 | 泰信基金管理有限公司 | 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2012 年 | 2011 年 | 2010 年 |
|---------------|----------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 22,474,550.29 | 18,716,702.62 | 18,517,112.74 |
| 本期利润 | 22,474,550.29 | 18,716,702.62 | 18,517,112.74 |
| 本期净值收益率 | 3.9848% | 3.4587% | 1.7597% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012 年末 | 2011 年末 | 2010 年末 |
| 期末基金资产净值 | 532,774,681.83 | 577,261,979.90 | 1,029,632,170.05 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2012 年末 | 2011 年末 | 2010 年末 |
| 累计净值收益率 | 25.9360% | 21.1102% | 17.0615% |

注：1、本基金合同于 2004 年 2 月 10 日正式生效。本基金收益分配按月结转份额。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|-----|-----|

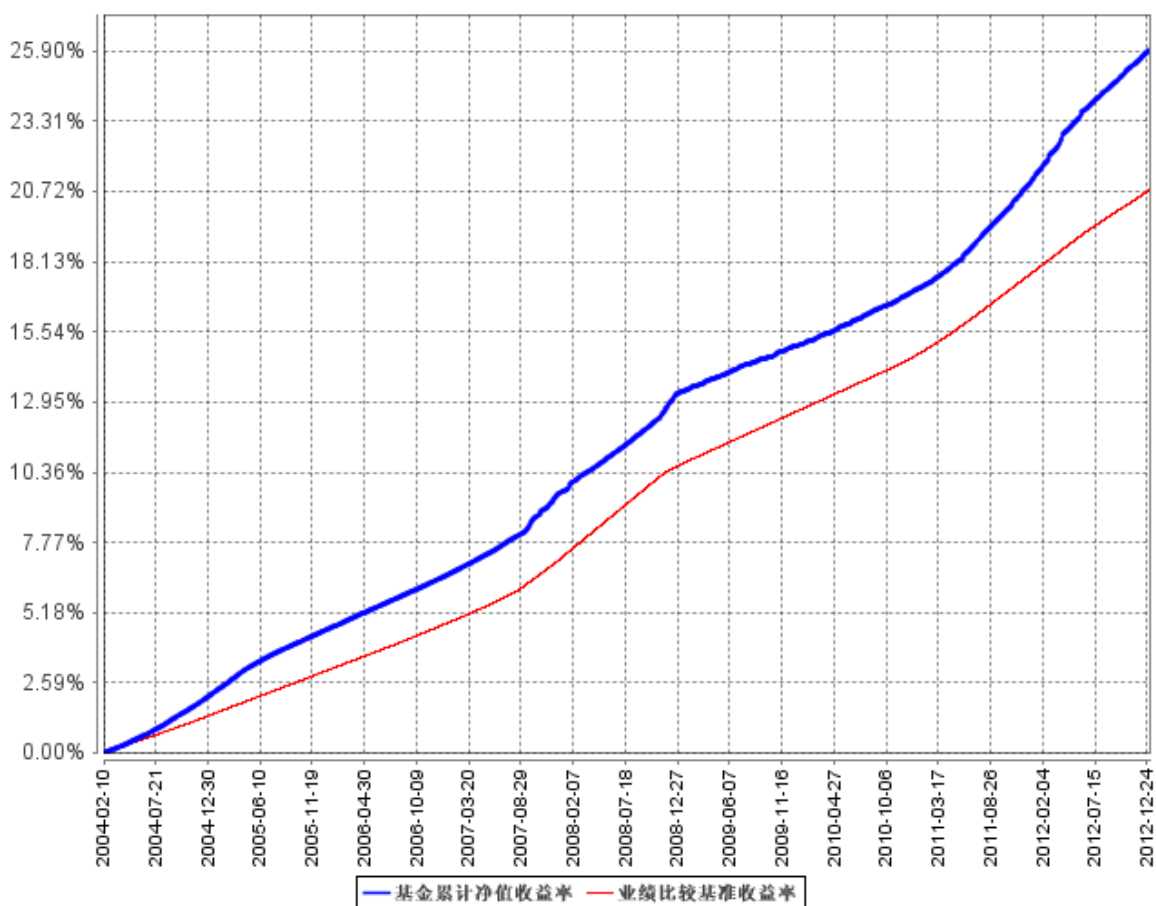
| | 收益率① | 收益率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|-------------|----------|---------|----------|-----------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.8241% | 0.0055% | 0.7156% | 0.0000% | 0.1085% | 0.0055% |
| 过去六个月 | 1.6232% | 0.0050% | 1.4340% | 0.0001% | 0.1892% | 0.0049% |
| 过去一年 | 3.9848% | 0.0090% | 3.0637% | 0.0006% | 0.9211% | 0.0084% |
| 过去三年 | 9.4741% | 0.0070% | 8.1675% | 0.0015% | 1.3066% | 0.0055% |
| 过去五年 | 14.9428% | 0.0068% | 13.5815% | 0.0018% | 1.3613% | 0.0050% |
| 自基金合同生效日起至今 | 25.9360% | 0.0056% | 20.7665% | 0.0020% | 5.1695% | 0.0036% |

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

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2004 年 2 月 10 日正式生效。

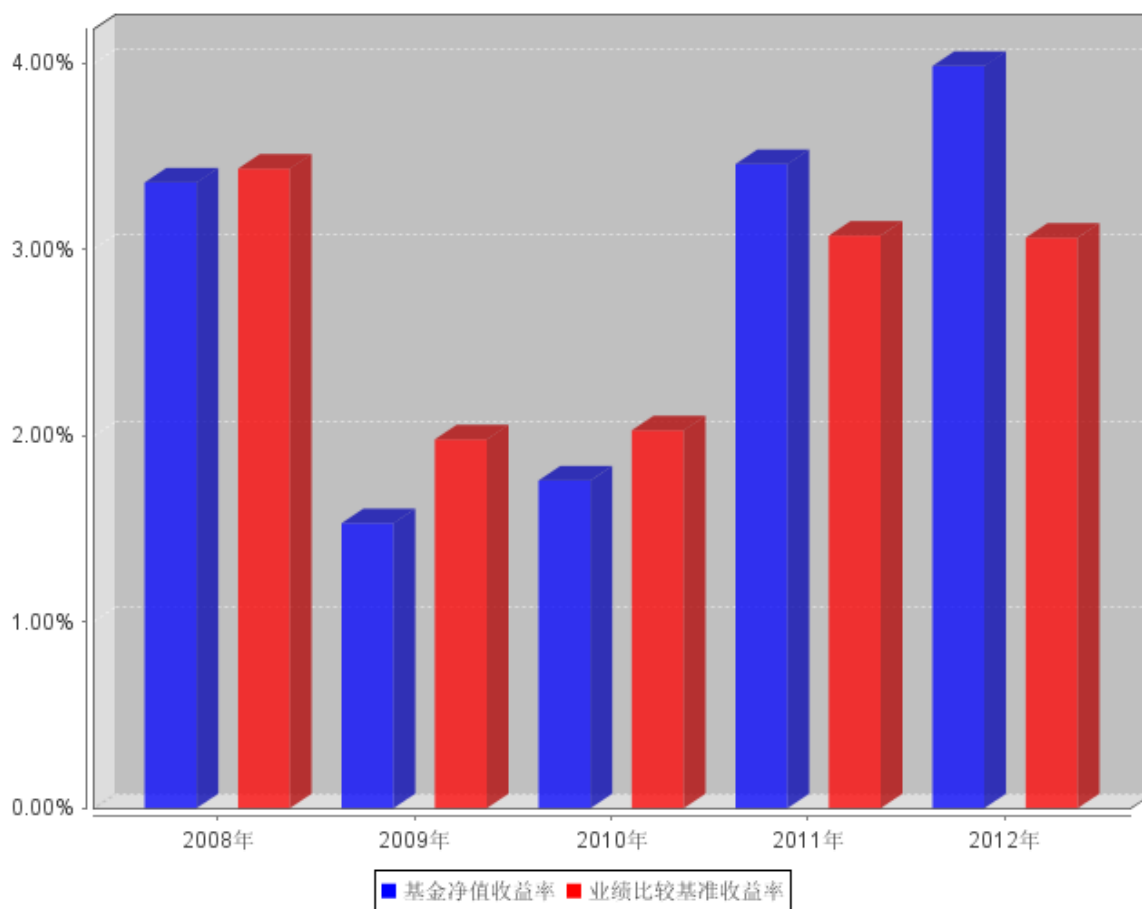
2、本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同规定的比例。各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为，短期债券 20%-60%，

债券回购 0%-80%，央行票据 0%-70%，现金 5%-80%。

3、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，决定胡哲先生担任泰信天天收益货币基金基金经理，与刘兴旺先生共同管理该基金。后刘兴旺先生离职，胡哲先生继续管理该基金。详情请参见先后于 2012 年 9 月 17 日、10 月 25 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益货币基金基金经理变更的公告》。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2012 | 17,697,950.56 | 4,734,727.75 | 41,871.98 | 22,474,550.29 | |
| 2011 | 17,408,078.38 | 1,498,101.43 | -189,477.19 | 18,716,702.62 | |
| 2010 | 16,929,433.33 | 1,712,706.85 | -125,027.44 | 18,517,112.74 | |
| 合计 | 52,035,462.27 | 7,945,536.03 | -272,632.65 | 59,708,365.65 | |

注：上述各年度的再投资形式转实收基金包括上年度最后一个收益结转日之后未结转的收益，不包括当年度最后一个结转日之后实现的收益。

§ 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：上海市浦东新区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：孟凡利

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

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。

公司目前下设市场部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部）、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、计划财务部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至 2012 年 12 月底，公司有正式员工 115 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2012 年 12 月，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、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、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选股票、泰信

保本混合、泰信中证基本面 400 指数分级共 13 只开放式基金及泰信财富分级 2 号、泰信财富分级 3 号、泰信财富分级 4 号、泰信乐享分级 1 号、泰信恒益高息债分级共 5 个资产管理计划。

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（助理） 期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|-----------|--|---------------------|-----------------|----------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 胡哲 先生 | 本基金经理 | 2012年9月17 日 | - | 5 | 经济学硕士。具有基金从业资格。2007年5月加入泰信基金管理有限公司，担任交易室交易员。自2010年12月28日至2012年9月16日担任泰信天天收益货币基金、泰信双息双利债券基金经理助理。 |
| 刘兴旺 先生 | 本基金基金 经理兼泰信 债券周期回 报基金基金 经理 | 2011年4月27 日 | 2012年10月 25日 | 6 | 管理学硕士。具有基金从业资格。曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部研究员；华宝兴业基金固定收益部研究员兼基金经理助理。2010年加入泰信基金管理有限公司，于投资部任职。自2011年2月9日起担任泰信债券周期回报基金基金经理。已于2012年10月25日离职。 |

注：1、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

2、基金经理的任职日期和离职日期以公司公告为准。

3、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，决定胡哲先生担任泰信天天收益货币基金基金经理，与刘兴旺先生共同管理该基金。后刘兴旺先生离职，胡哲先生继续管理该基金。详情请参见先后于2012年9月17日、10月25日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益货币基金基金经理变更的公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《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、取信于投资者”的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，交易室应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的双日反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司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，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期基金同向交易价差专项分析：

本公司截至 2012 年 12 月 31 日，共有 13 只公募基金，5 只专户产品。剔除 2 只指数基金（被动指数在交易过程中采用自动化交易），对其余投资组合进行两两分组，进行同向交易价差分析。

我们采用连续样本计算方法，对 2012 年连续 4 个季度的同向价差数据，分别进行时间窗口在 1 天、3 天、5 天内的数据 T 检验分析，结果表明：

- 1) 通过 T 检验的和正溢价次数占比在 45%~55%的数据符合公平公正原则；
- 2) 未通过 T 检验的数据的溢价金额占基金净值比均在 1%以内，连续四个季度的溢价金额不足以对基金净值造成显著影响，各基金之间不存在利益输送；
- 3) 未发现其他异常。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年受外围经济影响，中国经济经历出口的下滑、产能的过剩，以及消费的疲软，经济整体开始放缓。随着央行两次下调存款准备金率和两次降息，以及通过持续的逆回购注入流动性，经济经历年初的通货膨胀，年中 CPI 开始持续下行，直至年末的小幅回升，经济整体企稳回暖。本年度央票发行暂停，央行主要通过短期逆回购的方式调整货币供应量。资金市场整体比较稳定，只是在月底、季度底和年底的时候出现过短暂的紧张状态。债券市场全年一波三折，收益率陡峭化下行后又出现大幅反弹，大致可以分为四个阶段。第一阶段 1-4 月份，中债收益率曲线平行上移。第二阶段 5-7 月份，中债收益率曲线陡峭化大幅下行。第三阶段 7-9 月份中债收益率曲线平坦化上移。第四阶段 9-12 月份，中债收益率曲线继续平坦化小幅上行。

因为 2012 年货币市场较少出现 2011 年的流动性骤紧情况，货币基金在投资操作上的困难不大。我们以合理规模来配置较长期限信用债券和同业定存的规模，用来提高收益。剩余的资产配置则首要考虑流动性和安全性的基础上，根据市场行情配置在收益率较高的短期资产上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金净值收益率为 3.9848%，同期业绩比较基准收益率为 3.0637%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于货币市场，近期使得资金面收紧的因素来自于存款准备金的上缴、较大规模的央行逆回购到期以及年初的财政存款上升，另一方面缓解资金面的因素则主要是外汇占款和央行灵活的逆回购操作。我们预计近期除了农历新年之前的短暂阶段，资金面整体是较为宽松的。

在第四季度报告中，我们判断“近期收益率曲线将出现陡峭化下行，短期利率的降幅大于中长期利率”。这个下行的过程在 2013 年 1 月基本以出人意料的速度实现了。在经济企稳回升的背景下，加上目前债券整体收益率不高，债券大机会难寻；但从另一个角度来看，目前债市整体风险也不大，所以投资收益仍然以持有期的票息收入为主。货币基金将继续遵循安全和流动性优先、兼顾收益的投资原则，在保持组合安全操作的前提下继续为持有人创造价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，公司内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。主要工作情况如下：

1、加强公司制度体系建设。公司根据监管部门规定和要求，及时对公司原有制度流程修改审定，促进了业务的合规开展。主要包括《公司公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》、《公司员工直系亲属股票投资管理办法》、《基金参与上市公司股东大会管理办法》、《系统操作权限管理办法》等，完善了内部风险控制和管理。

2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。2012 年度，证券市场表现不佳，投资者的申购赎回行为对投资组合的影响较大。风险管理部专人负责指标的跟踪、监控与提示工作，对于因申购赎回或者个股大幅波动导致的被动局面，经投资组合经理申请、相关人员批准后及时修正，确保投资监控指标的控制效果。

3、规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

4、针对重点业务环节开展专项检查，查漏补缺，做好事后环节督促改进工作。公司于年初制定了《2012 年度专项稽核工作计划》，稽查工作覆盖主要业务板块，突出了核查重点。全年完成

了清算会计、销售业务和研究、投资、交易相关环节、公平交易相关环节、一级市场申购相关环节的专项稽核，对稽核中发现的问题通过书面报告的形式及时通报部门总监、报告督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

5、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

6、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽，对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理，对基金经理集中区域进行录像监控，对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽，对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理，并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、泰信基金管理有限公司估值程序等事项的说明

委员会主席

韩波先生，大学本科。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。2002 年加入泰信基金管理公司，现任公司副总经理。

委员会成员：

唐国培先生，硕士，2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部总监。

庞少华先生，硕士，会计师。2005 年 1 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司清算会计部总监。

朱志权先生，经济学学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任投资部总监兼投资总监，泰信先行策略、泰信优势增长基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，曾任泰信先行策略混合基金经理。现任研究部副总监兼研究副总监。

2、本基金基金经理不参与本基金估值。

3、参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 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，以每万分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 12 次收益支付共 22,474,550.29 元，包括 2011 年最后一次收益结转份额之后未结转的收益 1,125,600.24 元。

§ 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，完全尽职尽责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

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2013)第 21245 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|--------------|--|
| 审计报告收件人 | 泰信天天收益开放式证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的泰信先行策略开放式证券投资基金(以下简称“泰信先行策略基金”)的财务报表,包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是泰信天天收益基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总 |

| | |
|-----------|---|
| | 体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 审计意见段 | 我们认为，上述泰信天天收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰信天天收益基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 张晓艺 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 |
| 审计报告日期 | 2013 年 3 月 26 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012 年 12 月 31 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 180,291,045.65 | 283,042,462.98 |
| 结算备付金 | | - | 540,909.09 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 319,590,637.25 | 289,131,813.60 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 319,590,637.25 | 289,131,813.60 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 30,000,165.00 | 11,700,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 5,338,844.96 | 6,848,008.18 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 535,220,692.86 | 591,263,193.85 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |

| | | 2012 年 12 月 31 日 | 2011 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 11,700,000.00 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 147,131.44 | 131,599.49 |
| 应付托管费 | | 44,585.32 | 39,878.63 |
| 应付销售服务费 | | 111,463.20 | 99,696.59 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 20,830.83 | 10,310.98 |
| 应交税费 | | 582,900.00 | 491,500.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 1,125,600.24 | 1,083,728.26 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 413,500.00 | 444,500.00 |
| 负债合计 | | 2,446,011.03 | 14,001,213.95 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 532,774,681.83 | 577,261,979.90 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 532,774,681.83 | 577,261,979.90 |
| 负债和所有者权益总计 | | 535,220,692.86 | 591,263,193.85 |

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 532,774,681.83 份。

7.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------|---|--|
| 一、收入 | | 27,339,466.40 | 23,305,530.14 |
| 1.利息收入 | | 24,208,513.28 | 21,988,627.53 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 10,205,679.07 | 7,918,135.28 |
| 债券利息收入 | | 11,014,281.17 | 11,641,417.35 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,988,553.04 | 2,429,074.90 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,130,953.12 | 1,316,902.61 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 3,130,953.12 | 1,316,902.61 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | - |
| 减：二、费用 | | 4,864,916.11 | 4,588,827.52 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,966,863.07 | 1,962,583.58 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 596,019.18 | 594,722.28 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 1,490,047.81 | 1,486,805.91 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 250.00 | - |
| 5. 利息支出 | | 438,473.64 | 165,461.83 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 438,473.64 | 165,461.83 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 373,262.41 | 379,253.92 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 22,474,550.29 | 18,716,702.62 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 22,474,550.29 | 18,716,702.62 |

7.3 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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31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） | 577,261,979.90 | - | 577,261,979.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 22,474,550.29 | 22,474,550.29 |
| 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） | -44,487,298.07 | - | -44,487,298.07 |
| 其中：1. 基金申购款 | 4,256,563,808.51 | - | 4,256,563,808.51 |

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》和《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。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于 2013 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。在资产持有期间所取得的利息以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计

算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|----------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 10,291,045.65 | 23,042,462.98 |
| 定期存款 | 170,000,000.00 | 260,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 |
| 存款期限 3-6 个月 | 70,000,000.00 | 160,000,000.00 |
| 其他存款 | 0.00 | 0.00 |
| 合计： | 180,291,045.65 | 283,042,462.98 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年12月31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 | 319,590,637.25 | 320,808,000.00 | 1,217,362.75 | 0.2285% |
| | 合计 | 319,590,637.25 | 320,808,000.00 | 1,217,362.75 | 0.2285% |

| 项目 | | 上年度末 2011 年 12 月 31 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 | 289,131,813.60 | 289,811,000.00 | 679,186.40 | 0.1177% |
| | 合计 | 289,131,813.60 | 289,811,000.00 | 679,186.40 | 0.1177% |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本年度末及上年度末本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2012 年 12 月 31 日 | |
|------------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 30,000,165.00 | - |
| 合计 | 30,000,165.00 | - |
| 项目 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 11,700,000.00 | - |
| 合计 | 11,700,000.00 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012 年 12 月 31 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,413.33 | 2,350.42 |
| 应收定期存款利息 | 342,000.06 | 1,411,277.54 |
| 应收其他存款利息 | - | - |

| | | |
|------------|--------------|--------------|
| 应收结算备付金利息 | - | 267.74 |
| 应收债券利息 | 4,957,040.70 | 5,433,430.93 |
| 应收买入返售证券利息 | 37,390.87 | 681.55 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 5,338,844.96 | 6,848,008.18 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 20,830.83 | 10,310.98 |
| 合计 | 20,830.83 | 10,310.98 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 413,500.00 | 444,500.00 |
| 合计 | 413,500.00 | 444,500.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 577,261,979.90 | 577,261,979.90 |
| 本期申购 | 4,256,563,808.51 | 4,256,563,808.51 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,301,051,106.58 | -4,301,051,106.58 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 532,774,681.83 | 532,774,681.83 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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 | 22,474,550.29 | - | 22,474,550.29 |
| 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 | -22,474,550.29 | - | -22,474,550.29 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 134,065.49 | 179,859.43 |
| 定期存款利息收入 | 10,061,166.46 | 7,704,616.22 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 10,447.12 | 33,659.63 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 10,205,679.07 | 7,918,135.28 |

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期末及上年度可比期间均未投资股票。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
|----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,212,111,691.58 | 1,096,211,160.19 |
| 减：卖出债券（债转股及债 | 1,182,413,990.15 | 1,086,775,789.55 |

| | | |
|-------------|------------------|-----------------|
| 券到期兑付) 成本总额 | | |
| 减: 应收利息总额 | 26, 566, 748. 31 | 8, 118, 468. 03 |
| 债券投资收益 | 3, 130, 953. 12 | 1, 316, 902. 61 |

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本期末及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期末及上年度可比期间均无衍生工具收益余额。

7.4.7.15 股利收益

本基金本期末及上年度可比期间均无股利收益余额。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期末及上年度可比期间均无公允价值变动收益余额。

7.4.7.17 其他收入

本基金本期末及上年度可比期间均无其他收入余额。

7.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | - | - |
| 银行间市场交易费用 | 250.00 | - |
| 合计 | 250.00 | - |

7.4.7.19 其他费用

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 240,000.00 | 280,000.00 |
| 中债登账户维护费 | 18,000.00 | 18,000.00 |
| 上清所账户维护费 | 19,500.00 | - |
| 银行划款手续费 | 30,362.41 | 21,253.92 |

| | | |
|----|------------|------------|
| 其他 | 5,400.00 | - |
| 合计 | 373,262.41 | 379,253.92 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

| 2013 年度 | 宣告日 | 分配收益所属期间 |
|-------------|------------|-----------------------|
| 第 1 号收益支付公告 | 2013/01/10 | 2012/12/10~2013/01/09 |
| 第 2 号收益支付公告 | 2013/02/18 | 2013/01/10~2013/02/17 |
| 第 3 号收益支付公告 | 2013/03/11 | 2013/02/18~2013/03/10 |

7.4.9 关联方关系

| 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、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 山东省国际信托有限公司（“山东国托”） | 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本期末及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方佣金余额。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,966,863.07 | 1,962,583.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 542,427.58 | 212,655.74 |

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2012年1月1日至 2012年12月31日 | 2011年1月1日至 2011年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 596,019.18 | 594,722.28 |

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期 |
|---------------|-----------------------|
| | 2012年1月1日至2012年12月31日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 泰信基金管理有限公司 | 459,995.06 |
| 中国银行 | 386,120.20 |
| 合计 | 846,115.26 |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间 |
| | 2011年1月1日至2011年12月31日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 泰信基金管理有限公司 | 1,036,688.67 |
| 中国银行 | 223,508.30 |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 1,260,196.97 |
|----|--------------|

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 X0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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 2012年1月1日至2012年12月31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 | - | 19,570,495.85 | - | - | 39,000,000.00 | 5,500.38 |
| 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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 | 40,043,352.35 | 49,921,357.14 | - | - | - | - |

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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 2012年12月31日 | | 上年度末 2011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 |
| 山东国托 | 201,517,340.45 | 37.82% | 203,850,914.31 | 35.31% |

7.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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 | 10,291,045.65 | 134,065.49 | 23,042,462.98 |

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

| 已按再投资形式转实收 基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 17,697,950.56 | 4,734,727.75 | 41,871.98 | 22,474,550.29 | - |

注：1. 本基金在本年度累计分配收益 22,474,550.29 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 17,697,950.56 元，包含于赎回款的已分配未支付收益 4,734,727.75 元，计入应付收益科目 41,871.98 元。

2. 本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见附注 7.4.8.2。

7.4.12 (2012 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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审计、合规与风险控制委员会、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。

监察稽核部对公司经营、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，如有必要则由督察长向公司董事长和中国证监会报告。目前，公司的事前、事中、事后三个控制层次的风险管理体系相对清晰。各业务部门负责事前风险防范；风险管理部负责对公司运营过程中产生或潜在的风险进行事中管理和监控，并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，向投资决策委员会提交业绩评估报告；监察稽核部负责对公司各项业务进行定期、不定期检查，负责事后监督。

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。

7.4.13.2 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，定期银行存款存放在上海银行和平安银行，与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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期

信用评级在 AAA 级以下的债券，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2012 年 12 月 31 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | 190,016,251.07 | 159,974,445.72 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 59,938,993.01 | 119,768,995.74 |
| 合计 | 249,955,244.08 | 279,743,441.46 |

注：未评级债券为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2012 年 12 月 31 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 9,532,677.24 | 9,388,372.14 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 60,102,715.93 | - |
| 合计 | 69,635,393.17 | 9,388,372.14 |

注：未评级债券为央票及政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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,除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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,此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产,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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末 2012 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 3 个月-1 年 | 6 个月-1 年 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|----------------|----------|----------------|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 180,291,045.65 | - | - | - | 180,291,045.65 |
| 交易性金融资产 | 99,525,329.75 | - | 220,065,307.50 | - | 319,590,637.25 |
| 买入返售金融资产 | 30,000,165.00 | - | - | - | 30,000,165.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,338,844.96 | 5,338,844.96 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 309,816,540.40 | - | 220,065,307.50 | 5,338,844.96 | 535,220,692.86 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 147,131.44 | 147,131.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 44,585.32 | 44,585.32 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------|----------------|---------------|----------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 111,463.20 | 111,463.20 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 20,830.83 | 20,830.83 |
| 应交税费 | - | - | - | 582,900.00 | 582,900.00 |
| 应付利润 | - | - | - | 1,125,600.24 | 1,125,600.24 |
| 其他负债 | - | - | - | 413,500.00 | 413,500.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,446,011.03 | 2,446,011.03 |
| 利率敏感度缺口 | 309,816,540.40 | - | 220,065,307.50 | 2,892,833.93 | 532,774,681.83 |
| 上年度末 2011 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 3 个月-1 年 | 6 个月-1 年 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 283,042,462.98 | - | - | - | 283,042,462.98 |
| 结算备付金 | 540,909.09 | - | - | - | 540,909.09 |
| 交易性金融资产 | 129,390,207.86 | - | 159,741,605.74 | - | 289,131,813.60 |
| 买入返售金融资产 | 11,700,000.00 | - | - | - | 11,700,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,848,008.18 | 6,848,008.18 |
| 资产总计 | 424,673,579.93 | - | 159,741,605.74 | 6,848,008.18 | 591,263,193.85 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 11,700,000.00 | 11,700,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 131,599.49 | 131,599.49 |
| 应付托管费 | - | - | - | 39,878.63 | 39,878.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 99,696.59 | 99,696.59 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 10,310.98 | 10,310.98 |
| 应交税费 | - | - | - | 491,500.00 | 491,500.00 |
| 应付利润 | - | - | - | 1,083,728.26 | 1,083,728.26 |
| 其他负债 | - | - | - | 444,500.00 | 444,500.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 14,001,213.95 | 14,001,213.95 |
| 利率敏感度缺口 | 424,673,579.93 | - | 159,741,605.74 | -7,153,205.77 | 577,261,979.90 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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：人民币元） | |
| | | 本期末（2012 年 12 月 31 日） | 上年度末（2011 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 520,000.00 | 30,000.00 |
| 市场利率上升 25 个基点 | -520,000.00 | -30,000.00 | |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 319,590,637.25 元，无属于第一或第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第二层级 289,131,813.60 元，无属于第一或第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 319,590,637.25 | 59.71 |
| | 其中：债券 | 319,590,637.25 | 59.71 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 30,000,165.00 | 5.61 |
| | 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 | 180,291,045.65 | 33.69 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,338,844.96 | 1.00 |
| 5 | 合计 | 535,220,692.86 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 2.48 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每个交易日的融资余额的合计数，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基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值比例 (%) | 原因 | 调整期 |
|----|-----------------|-------------------|------|-----|
| 1 | 2012 年 6 月 28 日 | 21.57 | 巨额赎回 | 1 |

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 145 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 148 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 57 |

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。

8.3.2 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 | 26.33 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 1.88 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 16.89 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—180 天 | 13.05 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.79 | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含) | 41.31 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.46 | - |

8.4 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 | 29,974,858.48 | 5.63 |
| 3 | 金融债券 | 90,066,850.46 | 16.91 |
| | 其中：政策性金融债 | 90,066,850.46 | 16.91 |
| 4 | 企业债券 | 9,532,677.24 | 1.79 |
| 5 | 企业短期融资券 | 190,016,251.07 | 35.67 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 319,590,637.25 | 59.99 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 9,532,677.24 | 1.79 |

8.5 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 | 120238 | 12 国开 38 | 400,000 | 39,954,027.74 | 7.50 |
| 2 | 080308 | 08 进出 08 | 300,000 | 30,127,857.45 | 5.65 |
| 3 | 1001037 | 10 央票 37 | 300,000 | 29,974,858.48 | 5.63 |
| 4 | 041259040 | 12 好当家 CP001 | 200,000 | 20,031,277.60 | 3.76 |
| 5 | 041265005 | 12 沁和集 CP001 | 200,000 | 20,000,618.64 | 3.75 |
| 6 | 041265007 | 12 平高 CP001 | 200,000 | 20,000,613.20 | 3.75 |
| 7 | 041252029 | 12 华泰 CP002 | 200,000 | 20,000,516.75 | 3.75 |
| 8 | 120318 | 12 进出 18 | 200,000 | 19,984,965.27 | 3.75 |
| 9 | 041256024 | 12 赣高速 CP002 | 200,000 | 19,961,019.14 | 3.75 |
| 10 | 041260022 | 12 长电科技 CP001 | 100,000 | 10,015,280.11 | 1.88 |

8.6 “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 | 108 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4357% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0762% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2453% |

注：偏离度情况统计只包含交易日，交易所休市银行间有交易也统计在内。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 投资组合报告附注**8.8.1**

(1) 本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值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，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

(2) 本基金持有的回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入。

(3) 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

8.8.2

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。

8.8.3 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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

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 | 5,338,844.96 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,338,844.96 |

8.8.5 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 8,781 | 60,673.58 | 338,693,255.10 | 63.57% | 194,081,426.73 | 36.43% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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基金 | 171,878.48 | 0.0323% |

注：1、本公司高级管理人员、投资部、研究部负责人持有该基金份额总量的数量区间：10 万份-50 万份（含）

2、本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间：0 万

§ 10 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 577,261,979.90 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,256,563,808.51 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,301,051,106.58 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 532,774,681.83 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，公司副总经理桑维英女士代任公司总经理职务，高清海先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 9 月 22 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

3、经泰信基金管理有限公司第四届董事会 2012 年第一次会议审议通过，聘任葛航先生担任公司总经理职务。根据证监会《关于核准泰信基金管理有限公司葛航基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2012]1745 号），核准葛航先生担任公司总经理职务。具体详情参见 2012 年 12 月 29 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》上的《泰信基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

4、经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2011 年年度会议审议通过，决定胡哲先生担任泰

信天天收益货币基金基金经理，与刘兴旺先生共同管理该基金。详情请参见 2012 年 9 月 17 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益货币基金基金经理变更的公告》。

5、经泰信基金管理有限公司第三届董事会 2012 年半年度会议审议通过，刘兴旺先生不再担任泰信天天收益货币基金经理职务，由胡哲先生继续管理该基金。详情请参见 2012 年 10 月 25 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益货币基金基金经理变更的公告》。

本公司上述人事变动已按相关规定备案并公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

我公司诉华远星海运有限公司房屋租赁合同纠纷一案经浦东新区法院 2011 年 11 月 28 日受理后，于 2012 年 1 月 4 日首次公开开庭进行了审理。法院依法追加了上海宏普实业投资有限公司作为第三人参加诉讼，并组成合议庭于 2012 年 6 月 19 日第二次公开开庭进行了审理，本案现已审理终结。法院支持我公司全部诉求，判决华远星海运有限公司向我公司支付剩余租金及其违约金。本公司认为，上述案件不会对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响。

除此以外，无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币 6 万元。该审计机构从基金合同生效日（2004 年 2 月 10 日）开始为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

| | 数量 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | |
|------|----|------|----------------------|----|----------------|---|
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|----------------------|------------------|----------------------------|------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比 例 | 成交金额 | 占当期债 券回购 成交总额 的比例 | 成交金额 | 占当期权证 成交总额的 比例 |
| 海通证券 | - | - | 2,047,500,000.00 | 100.00% | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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 | 2012 年春节前暂停申购、转换入业务公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 1 月 17 日 |
| 2 | 2011 年 4 季报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 1 月 20 日 |
| 3 | 新增中信证券（浙江）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) | 2012 年 2 月 10 日 |
| 4 | 2011 年年报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 3 月 26 日 |
| 5 | 清明节前暂停申购、转换入业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 3 月 27 日 |
| 6 | 在渤海证券、中航证券、国金证券开通转换业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 3 月 27 日 |
| 7 | 在中信证券、中信万通、中信证券（浙江）、国信证券、平安证券开通定投及转换业 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 3 月 27 日 |

| | 务 | | |
|----|--|--|-------------|
| 8 | 在东方证券、国都证券开通转换及费率优惠业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年3月28日 |
| 9 | 在海通证券、长城证券、华安证券、江海证券、信达证券、中信建投证券开通定投、转换及费率优惠业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年3月28日 |
| 10 | 参加工商银行费率优惠业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年4月7日 |
| 11 | 在华宝证券开通定投、转换、费率优惠业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年4月21日 |
| 12 | 五一节前暂停申购、定投及转换入业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年4月24日 |
| 13 | 2012年1季报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年4月24日 |
| 14 | 在上海证券开通转换、费率优惠业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年6月13日 |
| 15 | 12年2季报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年7月19日 |
| 16 | 新增数米基金销售公司为代销机构 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年8月22日 |
| 17 | 12年半年报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年8月29日 |
| 18 | 基金经理变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年9月17日 |
| 19 | 高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年9月22日 |
| 20 | 12年3季报 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年10月24日 |
| 21 | 新增增量销售为代销机构并开通转换定投 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012年10月24日 |

| | | | |
|----|----------------------|--|------------------|
| 22 | 基金经理变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 10 月 25 日 |
| 23 | 新增众禄销售为代销机构并开通定投转换业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 10 月 27 日 |
| 24 | 新增诺亚正行为代销机构并开通定投转换业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 12 日 |
| 25 | 提醒投资者更新已过期身份证件 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 12 日 |
| 26 | 调整基金转换补差费用计算方法 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 15 日 |
| 27 | 2013 年元旦节前暂停申购转换入业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 25 日 |
| 28 | 中信建投证券开通定投转换及费率优惠业务 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 29 日 |
| 29 | 基金行业高级管理人员变更的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com) | 2012 年 12 月 29 日 |

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的办公场所，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。

12.3 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
2013年3月29日