

泰信天天收益
开放式证券投资基金 2009 年年度报告摘要
2009 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：2010 年 3 月 31 日

1 重要提示

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 2010 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰信天天收益货币
基金主代码	290001
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
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	2,657,384,657.07
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： $(1 - \text{利息税率}) \times \text{半年期银行定期存款利率}$
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	021-50372168	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		021-50372197	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 42F

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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	31,624,867.29	80,994,665.43	49,417,372.58
本期利润	31,624,867.29	80,994,665.43	49,417,372.58
本期净值收益率	1.5308%	3.3593%	2.9256%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末基金资产净值	2,657,384,657.07	4,318,213,730.83	3,669,627,758.73
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
累计净值收益率	15.0373%	13.3030%	9.6207%

注：

- 1、本基金收益分配按月结转份额。
- 2、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。本基金为货币市场基金，按摊余成本法估值，不存在公允价值变动收益。本期利润与本期已实现收益相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

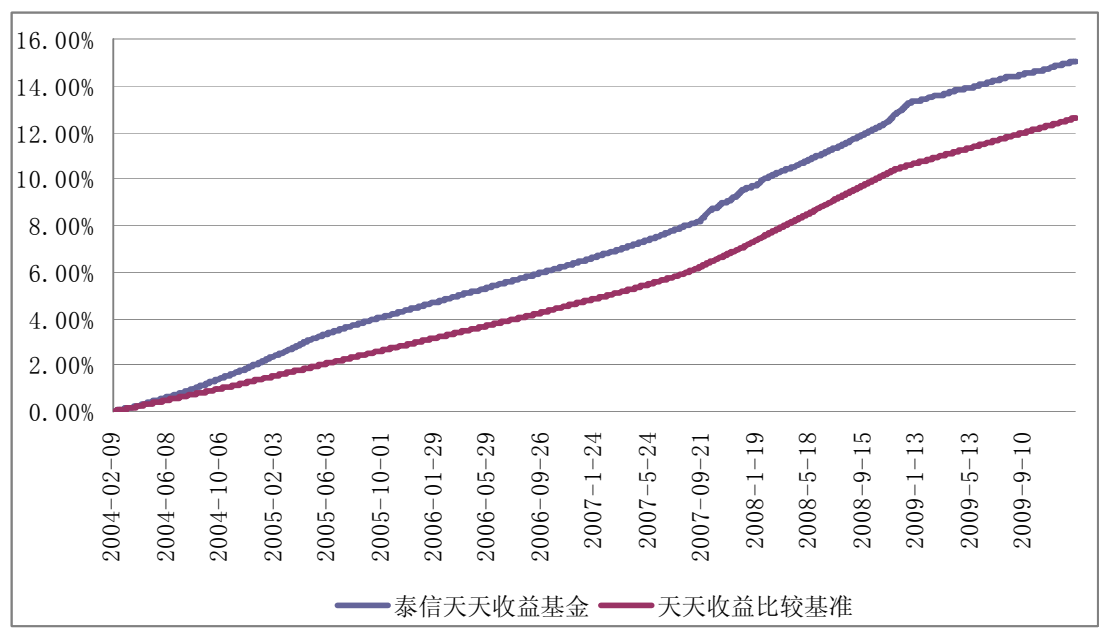
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.3936%	0.0055%	0.4991%	0.0000%	-0.1055%	0.0055%
过去六个月	0.7578%	0.0059%	0.9981%	0.0000%	-0.2403%	0.0059%
过去一年	1.5308%	0.0056%	1.9800%	0.0000%	-0.4492%	0.0056%
过去三年	8.0114%	0.0062%	7.8581%	0.0020%	0.1533%	0.0042%
过去五年	12.6823%	0.0051%	11.2234%	0.0020%	1.4589%	0.0031%
自基金合同 生效起至今	15.0373%	0.0047%	12.5991%	0.0020%	2.4382%	0.0027%

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增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

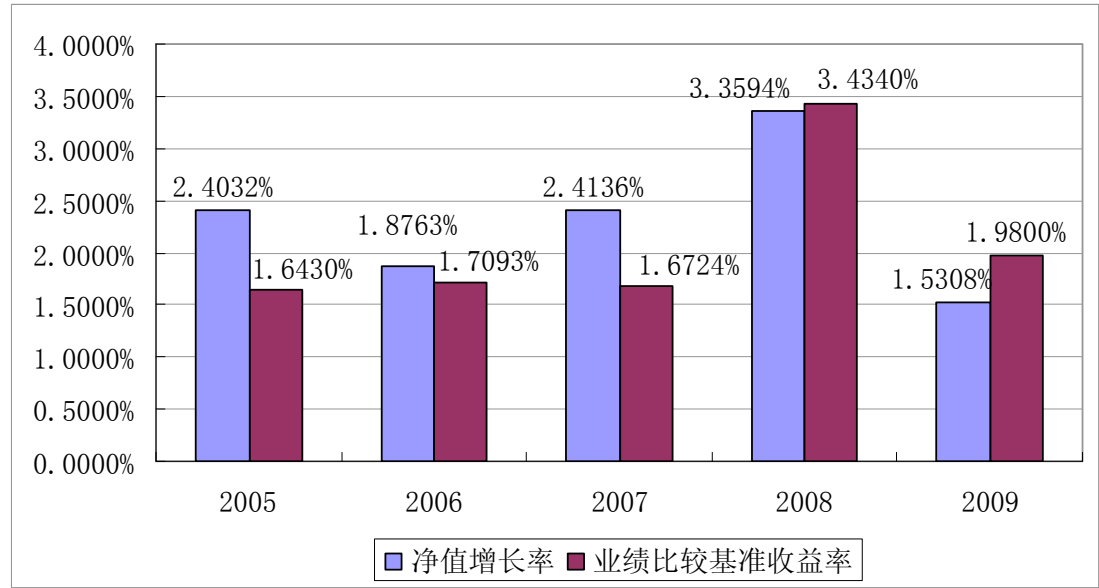
较



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、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2009年第2次（通讯）会议审议通过，决定何俊春女士不再担任泰信天天收益基金经理职务，由现任基金经理马成先生继续管理该基金。详细情况请见刊登在2009年4月18日《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》。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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
2009年	33,044,685.32	4,449,462.96	-5,869,280.99	31,624,867.29	
2008年	71,099,693.59	5,920,415.28	3,974,556.56	80,994,665.43	
2007年	44,392,434.41	3,595,849.86	1,429,088.31	49,417,372.58	
合计	148,536,813.32	13,965,728.10	-465,636.12	162,036,905.30	

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：高海鸥

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。

公司目前下设市场营销团队 (分华东、华北、华南三个业务团队)、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、风险管理部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部。截止 2009 年 12 月 31 日，公司共管理泰信天天收益、泰信先行策略、泰信双息双利、泰信优质生活、泰信优势增长、泰信蓝筹精选、泰信债券增强收益等 7 只开放式基金，基金资产规模 136.27 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马成	本基金基金经理兼泰信债券增强收益基金基金经理	2008年10月10日	-	7	经济学硕士。2003年7月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、交易室交易主管、泰信双息双利基金基金经理助理。
何俊春	本基金基金经理兼泰信双息双利基金、泰信债券增强收益基金基金经理	2007年2月9日	2009年4月18日	12	工商管理硕士。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限责任公司。2002年12月加入泰信基金管理有限公司，先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管，泰信天天收益基金基金经理助理。

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。

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 公平交易制度的执行情况

《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)自2008年3月20日起执行。公司相应地制定了《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，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

4.3.2 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

本基金与本公司旗下其他基金不存在风格相似的情形。

4.3.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2009年全年，债券总体表现为价格下跌、收益率抬升的态势，收益率曲线平坦上移，特别是IPO以及一年央票的恢复发行导致各期限品种收益率明显上升。十年期国债收益率从年初的2.6%上升到年末的3.7%，一年期国债的收益率从1.1%抬升到2.0%。值得注意的是随着宏观经济形势逐步好转，信用债价格上涨，信用利差明显缩小。

年初，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。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。上半年，投资小组基本维持短久期策略，较好地降低了利率风险。从三季度开始主要宏观经济数据显示国际、国内经济形势继续好转。虽然央行继续维持适度宽松的货币政策，但是7月份新增信贷规模出现明显拐点，由6月份新增15300亿，下滑至3560亿，受此影响，A股市场出现近30%的调整，债券收益率在经历了7月份的上升后，随之企稳，并小幅下行，一年央票的发行利率也在8月11日企稳，达到1.76%。投资小组抓住有力时机，适当延长组合久期，有效提高了基金的收益水平。国内CPI已经见底，随着石油等大宗商品价格的上涨，市场对通货膨胀的预期加大，澳大利亚已经开始加息，美元贬值预期加剧，商品价格继续上涨。从11月开始，国内CPI同比开始转正，为0.6%。央行继续维持适度宽松的货币政策，央票发行利率维持不变，一、二级市场利率持续倒挂，同时央行开始对通胀的预期进行管理，适度控制贷款规模。随着美元指数的走高，全球通胀预期得到一定缓解。

全年，基准利率和存款准备金率没有调整，市场流动性依然充裕。基金规模总体保持稳定，适时适当调整组合久期策略，降低利率风险，充分保证了基金的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本报告期基金净值收益率为1.5308%，同期业绩比较基准收益率为1.9800%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据统计局初步核算的数据，全年国内生产总值 335,353 亿元，比上年增长 8.7%。全年全社会固定资产投资 224,846 亿元，比上年增长 30.1%。全年货物进出口总额 22,072 亿美元，比上年下降 13.9%。其中，货物出口 12,017 亿美元，下降 16.0%；货物进口 10,056 亿美元，下降 11.2%。年末广义货币供应量（M2）余额为 60.6 万亿元，比上年末增长 27.7%；狭义货币供应量（M1）余额为 22.0 万亿元，增长 32.4%；流通中现金（M0）余额为 3.8 万亿元，增长 11.8%。人民币各项贷款余额 40.0 万亿元，增加 9.6 万亿元。对国内而言，经济复苏已经得到确认。央行已经开始对通胀预期进行管理，最通常的调控手段依然是公开市场的操作、存款准备金率的调整和对银行信贷的窗口指导，我们已经开始进入加息周期。我们认为未来一段时间债券市场的机会可能来源于利率政策的“真空期”，以及银行信贷规模的收缩导致的配置性需求增强，再就是信用利差的持续收窄。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，灵活配置资产久期，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

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，本科学历。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，7 年基金从业经验，2002 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部经理。

高伟女士，本科，英国牛津大学 Catalysts 公司风险投资方向访问学者，高级会计师，11 年金融业、7 年其他行业从业经验，曾在大型商贸公司、证券公司、资产管理公司担任财务部门、业务部门负责人并兼任所属公司财务总监、监事等职务。现任公司监察稽核部副经理。

庞少华先生，硕士，会计师，14 年证券从业经验。曾供职于天一证券有限责任公司稽核部内部稽核、营业部财务会计、总公司计划财务部。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经理。

刘强先生，工商管理硕士。2002 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资副总监兼泰信优质生活股票基金基金经理。

梁剑先生，硕士，具有 11 年证券从业经验，曾历任期货交易所研究员、券商研究员。2004 年 7 月加入泰信基金，现任研究部副总监兼泰信先行策略混合基金基金经理。

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。

4.7 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，本基金实现收益共计 31,624,867.29 元，其中，投资者赎回基金份额时带走的收益为 4,449,462.96 元，以累计收益转份额的形式进行了 12 次收益支付共 33,044,685.32 元，包括 2008 年最后一次收益结转份额之后未结转的收益，不包括 2009 年最后一次收益结转份额之后未结转的收益。

§ 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。

中国银行
2010 年 3 月 26 日

6 审计报告

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。
投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	670,371,860.99	732,006,454.75
结算备付金		9,095,238.10	1,500,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	793,516,689.40	3,487,978,977.76
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		793,516,689.40	3,487,978,977.76
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	1,270,000,000.00	-
应收证券清算款		-	100,028,000.00
应收利息	7.4.7.5	3,939,587.11	6,091,017.49
应收股利		-	-
应收申购款		113,194,075.71	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,860,117,451.31	4,327,604,450.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		199,938,332.02	-
应付赎回款		-	9,920.10
应付管理人报酬		456,290.07	859,381.71
应付托管费		138,269.75	260,418.70
应付销售服务费		345,674.31	651,046.73
应付交易费用	7.4.7.7	8,595.20	47,938.05
应交税费		72,900.00	-
应付利息		-	-
应付利润		1,398,232.89	7,267,513.88
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	374,500.00	294,500.00
负债合计		202,732,794.24	9,390,719.17
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,657,384,657.07	4,318,213,730.83
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,657,384,657.07	4,318,213,730.83
负债和所有者权益总计		2,860,117,451.31	4,327,604,450.00

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,657,384,657.07 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：2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 12 月 31 日
一、收入		46,783,060.79	99,318,303.00
1. 利息收入		35,730,747.45	87,015,665.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,046,613.62	1,783,516.43
债券利息收入		28,793,189.43	62,357,593.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,890,944.40	22,874,555.77
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		11,052,313.34	12,301,762.07
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	11,052,313.34	12,301,762.07
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	-	875.00
减：二、费用		15,158,193.50	18,323,637.57
1. 管理人报酬		6,926,357.86	8,310,796.67
2. 托管费		2,098,896.32	2,518,423.28
3. 销售服务费		5,247,240.90	6,296,058.13
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		471,298.57	824,872.99
其中：卖出回购金融资产支出		471,298.57	824,872.99
6. 其他费用	7.4.7.19	414,399.85	373,486.50
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		31,624,867.29	80,994,665.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		31,624,867.29	80,994,665.43

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：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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)	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)	-	31,624,867.29	31,624,867.29
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)	-1,660,829,073.76	-	-1,660,829,073.76
其中：1.基金申购款	8,567,479,037.25	-	8,567,479,037.25
2.基金赎回款	-10,228,308,111.01	-	-10,228,308,111.01
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)	-	-31,624,867.29	-31,624,867.29
五、期末所有者权益(基金净值)	2,657,384,657.07	-	2,657,384,657.07
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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)	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)	-	80,994,665.43	80,994,665.43

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)	648,585,972.10	-	648,585,972.10
其中：1. 基金申购款	15,770,799,273.54	-	15,770,799,273.54
2. 基金赎回款	-15,122,213,301.44	-	-15,122,213,301.44
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)	-	-80,994,665.43	-80,994,665.43
五、期末所有者权益(基金净值)	4,318,213,730.83	-	4,318,213,730.83

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分

基金管理公司负责人：高清海 主管会计工作的负责人：韩波 会计机构负责人：庞少华

7.4 报表附注

7.4.1 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》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2010年3月29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》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009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

12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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相一致的说明

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相一致。

7.4.5 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》及其他相关税务法规和实务操作，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。

7.4.6 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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,926,357.86	8,310,796.67
其中：支付销售机构的客户维护费	871,576.15	436,094.65

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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,098,896.32	2,518,423.28

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：

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

7.4.7.2.3 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 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	3,083,559.81
中国银行	1,010,270.77
合计	4,093,830.58
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 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	5,251,274.35
中国银行	668,430.39
合计	5,919,704.74

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 $\times$ 0.25% / 当年天数。

7.4.7.3 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	403,749,478.76	443,490,807.53	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	934,471,060.79	1,224,747,362.97	-	-	193,500,000.00	10,369.35

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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12月31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
山东国投	-	-	100,036,217.52	2.32%

7.4.7.5 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12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至 2008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	670,371,860.99	927,903.67	732,006,454.75	1,687,029.60

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。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2009年1月1日至2009年12月31日					
关联方 名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日					
关联方 名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张)	总金额
中国银行	0881265	08 申能股 CP01	新债分销	2,000,000	200,000,000.00
中国银行	0881259	08 粤交通 CP01	新债分销	200,000	20,058,000.00
中国银行	0881257	08 中石化 CP01	新债分销	100,000	10,014,810.00

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末(2009 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	793,516,689.40	27.74
	其中: 债券	793,516,689.40	27.74
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,270,000,000.00	44.40
	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	679,467,099.09	23.76
4	其他各项资产	117,133,662.82	4.10

	合计	2,860,117,451.31	100.00
--	----	------------------	--------

8.2 债券回购融资情况

金额: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	1.83	
	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%。
- 3、报告期内每个交易日的债券回购融资余额的合计数为10,230,146,680.21元,其中买断式回购融资为0。

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	63
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	33

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。

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	73.36	7.52
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	4.42	-
	其中:剩余存续期超过397	1.03	-

	天的浮动利率债		
5	180 天(含)—397 天(含)	23.94	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		103.22	7.52

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	395,712,700.98	14.89
3	金融债券	80,482,302.80	3.03
	其中：政策性金融债	80,482,302.80	3.03
4	企业债券	27,366,668.72	1.03
5	企业短期融资券	289,955,016.90	10.91
6	其他	—	—
	合计	793,516,689.40	29.86
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	27,366,668.72	1.03

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	0901036	09 央票 36	2,500,000	247,130,349.26	9.30
2	0901027	09 央票 27	1,500,000	148,582,351.72	5.59
3	0981155	09 新奥 CP01	500,000	50,043,674.90	1.88
4	0981145	09 华侨城 CP01	500,000	50,028,718.96	1.88
5	0981116	09 华新 CP01	500,000	49,957,553.59	1.88
6	0981123	09 万向 CP01	500,000	49,955,260.89	1.88
7	0981118	09 华谊 CP01	500,000	49,916,840.79	1.88
8	070310	07 进出 10	400,000	40,527,380.72	1.53
9	0981055	09 云铝 CP01	400,000	40,052,967.77	1.51
10	090404	09 农发 04	400,000	39,954,922.08	1.50

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	59
报告期内偏离度的最高值	0.4086%
报告期内偏离度的最低值	0.1033%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2266%

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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明。

(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	3,939,587.11
4	应收申购款	113,194,075.71
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	117,133,662.82

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
8,230	322,889.99	2,152,929,225.53	81.02%	504,455,431.54	18.98%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

无。

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	4,318,213,730.83
本报告期基金总申购份额	8,567,479,037.25
减：本报告期基金总赎回份额	10,228,308,111.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,657,384,657.07

注：申购中包括转换转入和分红再投，赎回中包括转换转出。

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、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2009年第2次（通讯）会议审议通过，决定何俊春女士不再担任泰信天天收益基金经理职务，由现任基金经理马成先生继续管理该基金。详细情况请见刊登在2009年4月18日《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》。

2、经泰信基金管理有限公司第二届董事会2009年半年度会议审议通过，决定聘任桑维英女士、韩波先生担任公司副总经理。桑维英女士、韩波先生的任职资格已获中国证监会核准。详细情况请见刊登在2009年12月31日《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聘任副总经理的公告》。

3、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所有限公司自2004年2月10日本基金成立日之日起为本基金提供审计服务，本报告期本基金应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9万元。

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

1、上海证监局于2009年6月1日至6月5日对本基金管理人泰信基金管理有限公司对公司2005年以来的经营情况进行了现场检查。并于2009年9月29日向公司出具了《关于泰信基金管理有限公司现场检查的整改意见函》（以下简称《意见函》），认为公司副总经理长期缺位，不符合公司章程对管理层组织架构的规定，过去的部分基金投资中出现异常交

又交易情况，公司自有资金投资未能严格执行公司的自有资金投资管理规定，存在超范围投资于短期融资券的现象等。《意见函》对管理人在公司治理结构、投研管理、风险控制体系和监察稽核工作、人员资格管理等方面提出了整改意见，并对公司有关责任人采取了监管谈话、记入诚信档案和出具警示函等行政监管措施。

根据现场检查情况和《意见函》的要求，公司组成了以董事长为组长的工作领导小组，针对整改意见制定了详尽的整改计划及落实措施。通过全面认真整改，上述问题已基本得到解决，2010年初上海局已对管理人进行了整改验收。

通过本次整改和公司的一系列自我整固措施的逐步落实，公司运营的风控能力和基金管理能力均得到明显提高，使我们更有信心为广大基金投资人提供优质的服务。

2、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

11.7 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	债券交易		债券回购交易	
	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
海通证券	-	-	25,290,900,000.00	100.00%

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。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

泰信基金管理有限公司
2010 年 3 月 31 日