泰信天天收益货币市场基金
2018 年半年度报告

2018 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：2018 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 2018 年 8 月 23 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 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.....3

§2 基金简介.....6

2.1 基金基本情况.....6

2.2 基金产品说明.....6

2.3 基金管理人和基金托管人.....6

2.4 信息披露方式.....7

2.5 其他相关资料.....7

§3 主要财务指标和基金净值表现.....8

3.1 主要会计数据和财务指标.....8

3.2 基金净值表现.....8

3.3 其他指标.....**错误！未定义书签。**

§4 管理人报告.....13

4.1 基金管理人及基金经理情况.....13

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....15

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....15

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.....15

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....16

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....16

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....17

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....17

§5 托管人报告.....18

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....18

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.....18

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.....18

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....19

6.1 资产负债表.....19

6.2 利润表.....20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
6.4 报表附注 22
§7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 债券回购融资情况 42
7.3 基金投资组合平均剩余期限 42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 44
7.9 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 47
§9 开放式基金份额变动 48
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
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 49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 50
10.9 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....53
§12 备查文件目录.....54
12.1 备查文件目录.....54
12.2 存放地点.....54
12.3 查阅方式.....54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信天天收益货币市场基金		
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	2016 年 5 月 17 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	419,801,252.04 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称：	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
下属分级基金的交易代码：	290001	002234	002235
报告期末下属分级基金的份额总额	110,749,401.90 份	309,048,991.07 份	2,859.07 份

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	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	胡囡	王永民
	联系电话	021-20899098	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-5988	95566
传真		021-20899008	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验	北京西城区复兴门内大街 1 号

	区浦东南路 256 号 华夏银行大厦 36-37 层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	万众	陈四清

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	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36-37 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 36、37 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 ）	报告期（2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日）	报告期（2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,143,642.12	12,363,793.61	69.80
本期利润	2,143,642.12	12,363,793.61	69.80
本期净值收益率	1.8557%	1.9769%	1.8439%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（ 2018 年 6 月 30 日 ）		
期末基金资产净值	110,749,401.90	309,048,991.07	2,859.07
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（ 2018 年 6 月 30 日 ）		
累计净值收益率	52.5569%	7.6019%	6.9693%

注：1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于 2004 年 2 月 10 日正式生效，于 2016 年 5 月 17 日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加 B 类、E 类份额。

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，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。

3、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。

4、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

泰信天天收益 A

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	0.2936%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.1811%	0.0037%
过去三个月	0.8859%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.5446%	0.0024%
过去六个月	1.8557%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.1769%	0.0023%

过去一年	3.8031%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.4344%	0.0025%
过去三年	9.4477%	0.0047%	4.1842%	0.0003%	5.2635%	0.0044%
自基金合同生效起至今	52.5569%	0.0064%	31.7605%	0.0020%	20.7964%	0.0044%

泰信天天收益 B

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	0.3133%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.2008%	0.0037%
过去三个月	0.9461%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.6048%	0.0024%
过去六个月	1.9769%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.2981%	0.0023%
过去一年	4.0517%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.6830%	0.0025%
自基金合同生效起至今	7.6019%	0.0035%	2.9062%	0.0000%	4.6957%	0.0035%

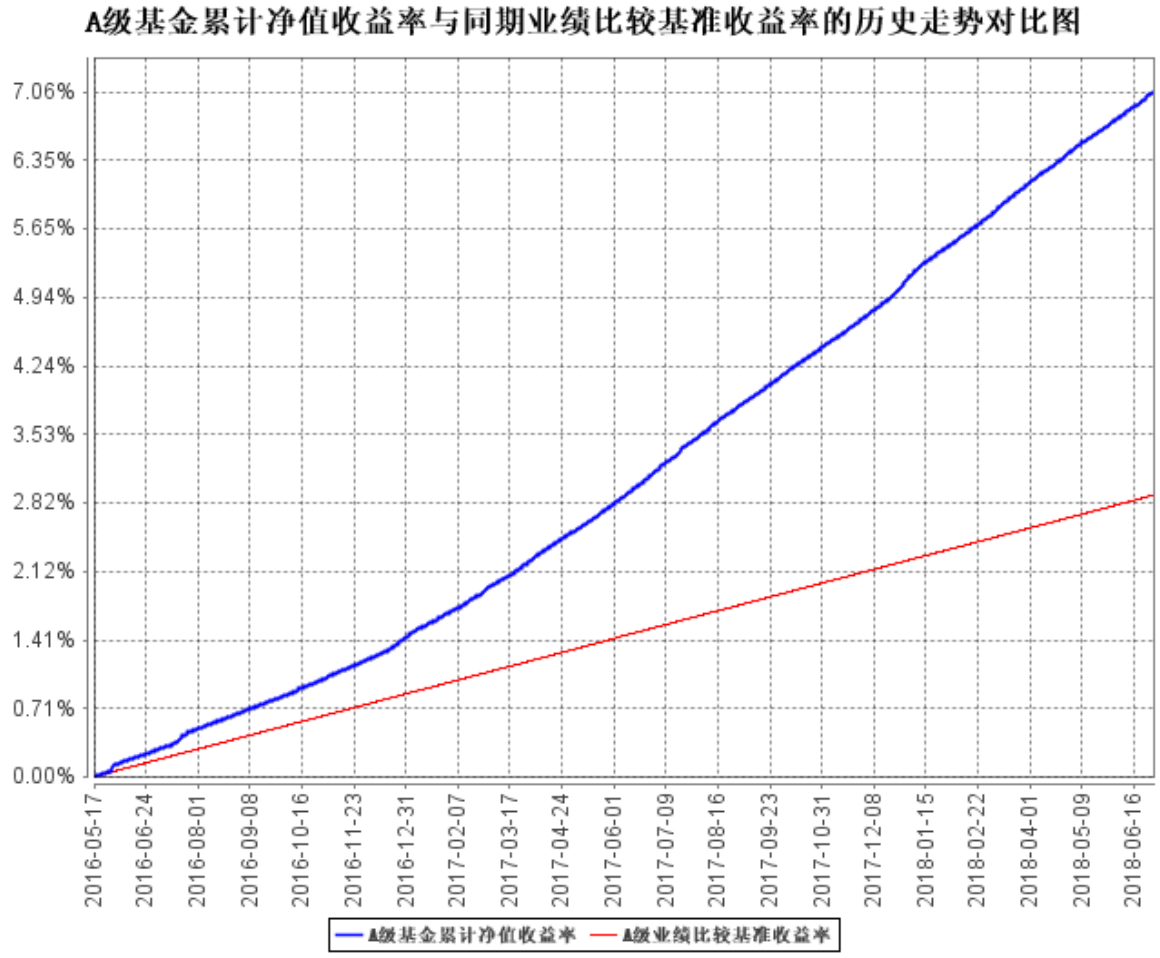
泰信天天收益 E

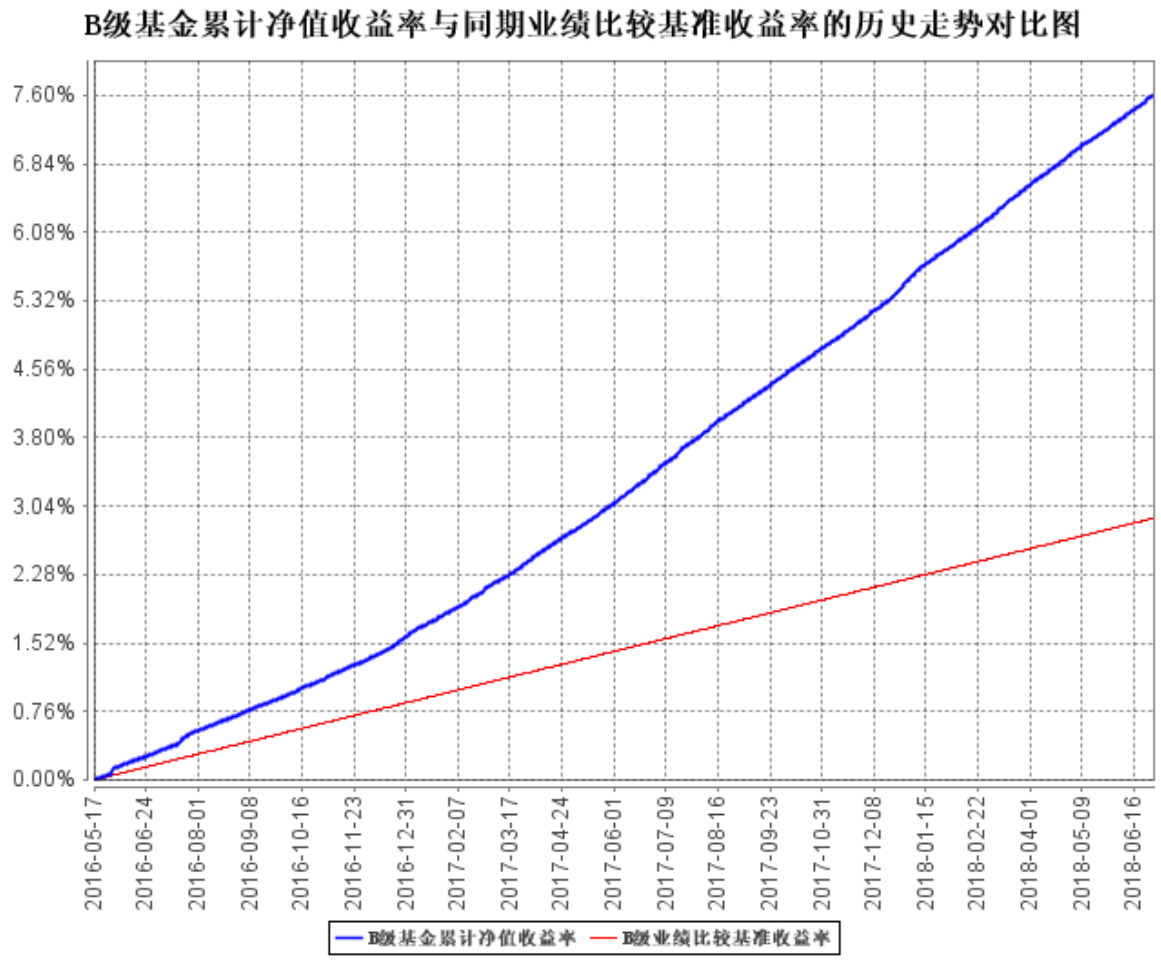
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.2918%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.1793%	0.0037%
过去三个月	0.8798%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.5385%	0.0024%
过去六个月	1.8439%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.1651%	0.0023%
过去一年	3.7725%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.4038%	0.0025%
自基金合同生效起至今	6.9693%	0.0036%	2.9062%	0.0000%	4.0631%	0.0036%

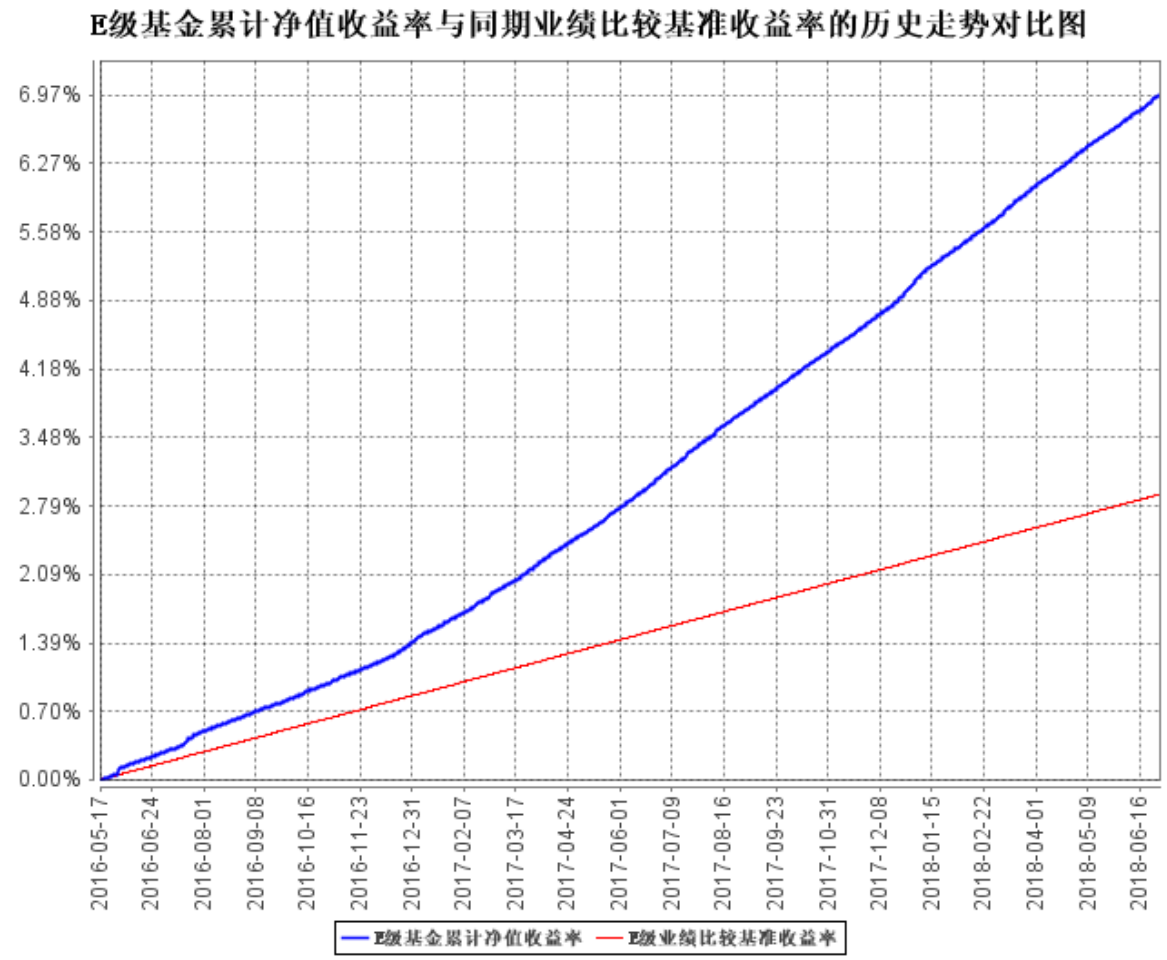
注：1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于 2004 年 2 月 10 日正式生效，于 2016 年 5 月 17 日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加 B 类、E 类份额。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具（但须符合中国证监会的有关规定）。

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




B级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
7.60%
6.84%
6.08%
5.32%
4.56%
3.80%
3.04%
2.28%
1.52%
0.76%
0.00%
2016-05-17
2016-06-24
2016-08-01
2016-09-08
2016-10-16
2016-11-23
2016-12-31
2017-02-07
2017-03-17
2017-04-24
2017-06-01
2017-07-09
2017-08-16
2017-09-23
2017-10-31
2017-12-08
2018-01-15
2018-02-22
2018-04-01
2018-05-09
2018-06-16
B级基金累计净值收益率
B级业绩比较基准收益率



注：1、泰信天天收益货币市场基金基金合同于 2016 年 5 月 17 日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具（但须符合中国证监会的有关规定）。

§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：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华夏银行大厦 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 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：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.，Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）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。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至 2018 年 6 月底，公司有正式员工 100 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 2018 年 6 月 30 日，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、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合、泰信

竞争优选共 21 只开放式基金及 9 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		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理兼泰信双息双利债券、泰信债券增强收益、泰信债券周期回报、泰信鑫益定期开放债券、泰信鑫利混合基金经理	2016 年 10 月 11 日	-	22 年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券上海斜土路营业部。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，泰信天天收益基金经理。自 2008 年 10 月 10 日起担任泰信双息双利债券基金经理；自 2009 年 7 月 29 日起担任泰信债券增强收益基金经理；自 2012 年 10 月 25 日起担任泰信债券周期回报基金经理；自 2013 年 7 月 17 日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理；自 2017 年 5 月 25 日起任泰信鑫利混合基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。
于瑞女士	本基金经理	2017 年 12 月 14 日	-	7 年	复旦大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利管理服务有限公司，2013 年加入泰信基金管理有限公司，历任交易员、交易部总监助理、研究部研究员兼泰信天天收益、周期回报基金经理助理。

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为公告日。

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循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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和基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金无异常交易行为。

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

2018 年一季度是债券供给传统淡季，监管也并无继续加码；中美贸易摩擦升级，市场对经济基本面和出口增速放缓有所担忧，一季度各期限债券收益率下行阻力较小，尤其短端债券收益率下行较快。货币政策真正转为稳健中性，在松紧适度、合理稳定的流动性背景下，债券市场情绪迎来了一波修复。一季度末一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融较 2017 年年底分别下行 67bp、47bp 和 53bp。二季度六月份的降准，使货币政策边际宽松得到确认，在流动性环境进一步改善的主线下，债券收益率迎来快速下行行情；经济基本面方面中美贸易摩擦有所反复，5 月社融、固定资产投资、进出口等经济数据小幅走弱、6 月 PMI 数据也较弱，经济基本面对收益率下行形成一定

支撑，各期限债券收益率本季度以下行为主。二季度债市信用风险事件时有发生，导致市场风险偏好走低，利率债、高等级信用债和中低等级信用债走势出现显著分化，信用利差有所走扩。二季度内的两次降准操作后，短端收益率出现较为的明显下行，二季度末较一季度末一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融分别下行 33bp、21bp 和 7bp。

天天收益基金在一季度适当拉长了组合久期、在二季度维持中性策略；组合集中配置了信用评级较高、流动性好的同业存单和高评级短融，在收益率下行的行情中增厚了资本利得收益。另外根据基金规模和市场环境的变化，动态择时调整正逆回购资产配置比例，使得基金在面临市场波动和规模变化时仍具有较好的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰信天天收益 A 的基金份额净值收益率为 1.8557%，本报告期泰信天天收益 B 的基金份额净值收益率为 1.9769%，本报告期泰信天天收益 E 的基金份额净值收益率为 1.8439%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,货币政策明确转向宽松，流动性环境继续好转，短端收益率或维持低位震荡。贸易战有所反复，市场对下半年经济的担忧也进一步确认，对债券收益率下行形成支撑。监管方面，去杠杆逐步向稳杠杆过渡，市场风险偏好在缓慢提升，信用利差有修复空间。总体而言，下半年在保证基金流动性的前提下兼顾收益，继续维持中性配置策略，在规避信用风险的前提下选取配置高评级、流动性好的投资标的。

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。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：

张敬燕女士，硕士。2017 年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

蔡海成先生，硕士。2013 年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，学士。2008 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，现任基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

梁剑先生，硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，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。

4.7 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 A 类份额收益分配共 2,143,642.12 元;B 类份额收益分配共 12,363,793.61 元；E 类份额收益分配共 69.80 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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”）在泰信天天收益货币市场基金（原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、基金净值收益率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。

§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：泰信天天收益货币市场基金

报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	49,617,347.86	7,648,283.76
结算备付金		522,727.27	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	278,601,807.67	525,790,502.39
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		278,601,807.67	525,790,502.39
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	88,406,558.11	553,691,470.54
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,884,226.90	2,768,803.24
应收股利		-	-
应收申购款		2,751,820.22	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		421,784,488.03	1,089,899,059.93
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 6 月 30 日**	**上年度末 2017 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		171,761.28	215,815.16
应付托管费		52,048.91	65,398.55
应付销售服务费		25,563.01	32,813.33
应付交易费用	6.4.7.7	21,928.63	27,758.76

应交税费		628,500.00	628,500.00
应付利息		-	-
应付利润		910,934.60	2,037,282.83
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	172,499.56	339,000.00
负债合计		1,983,235.99	3,346,568.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	419,801,252.04	1,086,552,491.30
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		419,801,252.04	1,086,552,491.30
负债和所有者权益总计		421,784,488.03	1,089,899,059.93

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，泰信天天收益 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 110,749,401.90 份；泰信天天收益 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 309,048,991.07 份；泰信天天收益 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,859.07 份。泰信天天收益货币份额总额合计为 419,801,252.04 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信天天收益货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		16,562,091.11	27,759,975.63
1.利息收入		16,388,347.47	27,077,655.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	878,868.02	2,049,254.21
债券利息收入		11,106,288.36	15,308,039.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,403,191.09	9,720,361.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		173,743.64	682,319.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	173,743.64	682,319.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	-	-

“-”号填列）			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		2,054,585.58	3,581,306.93
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,224,133.11	2,245,650.74
2．托管费	6.4.10.2.2	370,949.54	680,500.16
3．销售服务费	6.4.10.2.3	175,144.90	195,328.25
4．交易费用	6.4.7.19	134.99	-
5．利息支出		84,318.26	255,458.63
其中：卖出回购金融资产支出		84,318.26	255,458.63
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	199,904.78	204,369.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,507,505.53	24,178,668.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,507,505.53	24,178,668.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰信天天收益货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,086,552,491.30	-	1,086,552,491.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,507,505.53	14,507,505.53
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）	-666,751,239.26	-	-666,751,239.26
其中：1.基金申购款	943,608,209.50	-	943,608,209.50
2.基金赎回款	-1,610,359,448.76	-	-1,610,359,448.76

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）	-	-14,507,505.53	-14,507,505.53
五、期末所有者权益（基金净值）	419,801,252.04	-	419,801,252.04
项目	**上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	2,058,835,008.40	-	2,058,835,008.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,178,668.70	24,178,668.70
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）	-840,192,255.88	-	-840,192,255.88
其中：1.基金申购款	2,350,065,181.85	-	2,350,065,181.85
2.基金赎回款	-3,190,257,437.73	-	-3,190,257,437.73
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）	-	-24,178,668.70	-24,178,668.70
五、期末所有者权益（基金净值）	1,218,642,752.52	-	1,218,642,752.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

葛航	韩波	蔡海成
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信天天收益货币市场基金(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 2016 年 5 月 11 日《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，依据基金份额持有人大会决议，自 2016 年 5 月 17 日起，本基金更名为泰信天天收益货币市场基金，并将基金份额分为 A 类、B 类和 E 类。三类基金份额根据基金份额费率结构、申购(赎回)各类基金份额的最低金额限制及在销售机构保留的各类基金份额的最低份额限制不同而区分，各份额类别基金资产合并运作，单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。本基金 E 类基金份额目前仅限通过直销渠道及公司指定的电子交易平台进行申购、赎回和转换等业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。根据基金管理人 2017 年 9 月 4 日发布的《关于泰信天天收益货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告》及修改后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围修改为：本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金；期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的原业绩比较基准为半年期银行定期存款税后利率；自 2016 年 5 月 17 日起，本基金业绩比较基准变更为七天通知存款利率(税后)。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	9,617,347.86
定期存款	40,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	40,000,000.00
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	49,617,347.86

注：定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 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	278,601,807.67	278,868,000.00	266,192.33	0.0634%

	合计	278,601,807.67	278,868,000.00	266,192.33	0.0634%
资产支持券		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券_银行间	65,406,558.11	-
买入返售证券	23,000,000.00	-
合计	88,406,558.11	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	780.92
应收定期存款利息	244,110.88
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	235.20
应收债券利息	1,595,816.98
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	43,282.92
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	-
合计	1,884,226.90

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	21,928.63
合计	21,928.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	172,499.56
合计	172,499.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰信天天收益 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,739,167.32	157,739,167.32
本期申购	152,813,549.18	152,813,549.18
本期赎回(以"-"号填列)	-199,803,314.60	-199,803,314.60
- 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	110,749,401.90	110,749,401.90

金额单位：人民币元

泰信天天收益 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	928,809,420.75	928,809,420.75
本期申购	790,794,462.43	790,794,462.43
本期赎回(以"-"号填列)	-1,410,554,892.11	-1,410,554,892.11
- 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	309,048,991.07	309,048,991.07

金额单位：人民币元

泰信天天收益 E		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,903.23	3,903.23
本期申购	197.89	197.89
本期赎回(以"-"号填列)	-1,242.05	-1,242.05
- 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	2,859.07	2,859.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

泰信天天收益 A			
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	2,143,642.12	-	2,143,642.12
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	-2,143,642.12	-	-2,143,642.12
本期末	-	-	-

单位：人民币元

泰信天天收益 B			
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	12,363,793.61	-	12,363,793.61
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	-12,363,793.61	-	-12,363,793.61
本期末	-	-	-

单位：人民币元

泰信天天收益 E			
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	69.80	-	69.80
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	-69.80	-	-69.80
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,470.86
定期存款利息收入	854,027.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,369.61
其他	-
合计	878,868.02

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	173,743.64
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	173,743.64

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,063,783,236.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,058,693,512.14
减：应收利息总额	4,915,980.28
买卖债券差价收入	173,743.64

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	134.99
合计	134.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	119,014.74
中债登账户维护费	8,926.92
上清所账户维护费	8,926.92
银行划款手续费	18,405.22
其他	-
合计	199,904.78

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、基金销售机构、注册登记机构
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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
山东省国际信托股份有限公司(“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。

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

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,224,133.11	2,245,650.74
其中：支付销售机构的客户维护费	203,782.72	261,383.74

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： 日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	370,949.54	680,500.16

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 X 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E	合计
泰信基金管理有限公司	5,030.82	23,163.34	5.25	28,199.41
中国银行	34,645.98	593.34	-	35,239.32
合计	39,676.80	23,756.68	5.25	63,438.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E	合计
泰信基金管理有限公司	6,349.28	-	-	6,349.28
中国银行	37,416.68	2,685.36	-	40,102.04
合计	43,765.96	2,685.36	-	46,451.32

注：根据《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，自

2016 年 5 月 17 日起，泰信天天收益开放式证券投资基金更名为泰信天天收益货币市场基金，且分为 A 类、B 类和 E 类，其中 A 类和 E 类销售服务费率为 0.25%，B 类销售服务费费率为 0.01%，调整后，各类别的销售服务费按前一日基金资产净值的适用年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

A 类和 E 类日基金销售服务费＝前一日各类别基金资产净值 × 0.25%/当年天数；

B 类基金销售服务费＝前一日 B 类基金资产净值 × 0.01%/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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-	60,200,000.00	58,861.92	-	-
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	-	-	59,800,000.00	186,169.86	-	-

注：本报告期及上年度可比期间本基金与关联方未发生银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
期初持有的基金份额	-	15,914,495.33	-
期间申购/买入总份额	-	45,905,020.87	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	25,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	36,819,516.20	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	8.7700%	-

项目	上年度可比期间

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
期初持有的基金份额	-	68,558,067.00	-
期间申购/买入总份额	-	1,037,996.98	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	26,098,080.97	-
期末持有的基金份额	-	43,497,983.01	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.5700%	-

注：1、依据《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》相关约定，本基金不收取申购赎回费用。

2、期间申购/买入总份额含红利再投，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

3、基金管理人泰信基金管理有限公司在本期申购、赎回本基金的交易委托泰信直销办理。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	9,617,347.86	20,470.86	6,545,379.33	20,576.64

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

泰信天天收益A

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
2,147,053.96	212,043.88	-215,455.72	2,143,642.12	-

泰信天天收益B

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
11,834,876.19	1,439,805.56	-910,888.14	12,363,793.61	-

泰信天天收益E

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
73.89	0.28	-4.37	69.80	-

6.4.12 期末（ 2018 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

6.4.12.5 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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的 10%。

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。

6.4.12.5.1 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	39,998,214.70	89,995,736.58
A-1 以下	-	-
未评级	238,580,446.36	435,794,765.81
合计	278,578,661.06	525,790,502.39

注：未评级债券为同业存单和政策性金融债。

6.4.12.5.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.12.5.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	198,571,066.52	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	198,571,066.52	-

6.4.12.6 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。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、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，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%。

6.4.12.6.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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 120 天，平均剩余存

续期限在每个交易日均不得超过 240 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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具 占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 69.61%，本基金投资组合的平均剩余期限为 38 天，平均剩余存续期为 38 天，本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为 32.88%。

本基金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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.12.7 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。

6.4.12.7.1 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。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	49,617,347.86	-	-	-	-	49,617,347.86
结算备付金	522,727.27	-	-	-	-	522,727.27
交易性金融资产	278,601,807.67	-	-	-	-	278,601,807.67
买入返售金融资产	88,406,558.11	-	-	-	-	88,406,558.11
应收利息	-	-	-	-	1,884,226.90	1,884,226.90
应收申购款	-	-	-	-	2,751,820.22	2,751,820.22
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	417,148,440.91	-	-	-	4,636,047.12	421,784,488.03
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	171,761.28	171,761.28
应付托管费	-	-	-	-	52,048.91	52,048.91
应付销售服务费	-	-	-	-	25,563.01	25,563.01
应付交易费用	-	-	-	-	21,928.63	21,928.63
应交税费	-	-	-	-	628,500.00	628,500.00
应付利润	-	-	-	-	910,934.60	910,934.60
其他负债	-	-	-	-	172,499.56	172,499.56
负债总计	-	-	-	-	1,983,235.99	1,983,235.99
利率敏感度缺口	417,148,440.91	-	-	-	2,652,811.13	419,801,252.04
上年度末 2017 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	7,648,283.76	-	-	-	-	7,648,283.76
交易性金融资产	525,790,502.39	-	-	-	-	525,790,502.39

买入返售金融资产	553,691,470.54	-	-	-	-	553,691,470.54
应收利息	-	-	-	-	2,768,803.24	2,768,803.24
资产总计	1,087,130,256.69	-	-	-	2,768,803.24	1,089,899,059.93
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	215,815.16	215,815.16
应付托管费	-	-	-	-	65,398.55	65,398.55
应付销售服务费	-	-	-	-	32,813.33	32,813.33
应付交易费用	-	-	-	-	27,758.76	27,758.76
应交税费	-	-	-	-	628,500.00	628,500.00
应付利润	-	-	-	-	2,037,282.83	2,037,282.83
其他负债	-	-	-	-	339,000.00	339,000.00
负债总计	-	-	-	-	3,346,568.63	3,346,568.63
利率敏感度缺口	1,087,130,256.69	-	-	-	-577,765.39	1,086,552,491.30

6.4.12.7.1.2 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（ 2018 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率下降 25 个基点	90,836.74	271,507.61
	2.市场利率上升 25 个基点	-90,580.78	-271,130.16

6.4.12.7.2 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。

6.4.12.7.3 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。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	278,601,807.67	66.05
	其中：债券	278,601,807.67	66.05
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	88,406,558.11	20.96
	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	50,140,075.13	11.89
4	其他各项资产	4,636,047.12	1.10
5	合计	421,784,488.03	100.00

7.2 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	0.88	
	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：1、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。

2、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	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	52
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

注：本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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	44.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	28.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.36	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内本投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 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	-	-
3	金融债券	40,008,821.84	9.53
	其中：政策性金融债	40,008,821.84	9.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	39,998,296.71	9.53
6	中期票据	-	-

7	同业存单	198,594,689.12	47.31
8	其他	-	-
9	合计	278,601,807.67	66.37
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	111809170	18 浦发银行 CD170	500,000	49,599,132.56	11.81
2	111895748	18 宁波银行 CD063	300,000	29,939,756.75	7.13
3	111810226	18 兴业银行 CD226	300,000	29,849,411.60	7.11
4	111811134	18 平安银行 CD134	300,000	29,812,279.83	7.10
5	111815263	18 民生银行 CD263	300,000	29,751,137.93	7.09
6	111894956	18 宁波银行 CD054	300,000	29,642,970.45	7.06
7	170410	17 农发 10	200,000	20,005,396.30	4.77
8	170207	17 国开 07	200,000	20,003,425.54	4.76
9	071800013	18 东北证券 CP003	200,000	19,999,425.21	4.76
10	071800014	18 渤海证券 CP005	200,000	19,998,871.50	4.76

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1267%
报告期内偏离度的最低值	0.0062%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0441%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期本基金未发生正偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

（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。

7.9.2

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受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 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	1,884,226.90
4	应收申购款	2,751,820.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,636,047.12

7.9.4 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。

§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

份额级别	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
泰信天天收益 A	5,029	22,022.15	10,891,509.96	9.83%	99,857,891.94	90.17%
泰信天天收益 B	15	20,603,266.07	113,698,725.71	36.79%	195,350,265.36	63.21%
泰信天天收益 E	27	105.89	0.00	0.00%	2,859.07	100.00%
合计	5,071	82,784.71	124,590,235.67	29.68%	295,211,016.37	70.32%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	个人	102,309,670.47	24.37
2	个人	50,201,790.19	11.96
3	基金类机构	36,819,516.20	8.77
4	其他机构	31,568,598.41	7.52
5	保险类机构	20,605,741.02	4.91
6	个人	20,000,000.00	4.76
7	保险类机构	10,302,870.08	2.45
8	个人	10,000,000.00	2.38
9	其他机构	5,400,000.00	1.29
10	其他机构	5,000,000.00	1.19

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泰信天天收益 A	707,537.02	0.6389%
	泰信天天收益 B	-	-

	泰信天天收益 E	2,546.73	89.0755%
	合计	710,083.75	0.1691%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泰信天天收益 A	0
	泰信天天收益 B	0
	泰信天天收益 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泰信天天收益 A	0
	泰信天天收益 B	0
	泰信天天收益 E	0
	合计	0

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
基金合同生效日（2016 年 5 月 17 日）基金份额总额	126,623,432.82	1,420,646,701.74	-
本报告期期初基金份额总额	157,739,167.32	928,809,420.75	3,903.23
本报告期基金总申购份额	152,813,549.18	790,794,462.43	197.89
减:本报告期基金总赎回份额	199,803,314.60	1,410,554,892.11	1,242.05
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,749,401.90	309,048,991.07	2,859.07

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、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

本报告期内，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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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	-	-	789,000,000.00	100.00%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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。

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	新增盈米财富为销售机构并开通转换定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 4 日
2	新增世纪证券为销售机构并开通转换定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 11 日
3	17 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 19 日

4	在嘉实基金开通转换及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 19 日
5	在大泰金石、中泰证券开通申购、定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 30 日
6	新增上海基煜基金为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 1 月 31 日
7	18 年春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）	2018 年 2 月 9 日
8	17 年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 29 日
9	工商银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 30 日
10	交通银行手机银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 3 月 30 日
11	2018 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 4 月 21 日
12	18 年劳动节前暂停申购、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）	2018 年 4 月 25 日
13	新增济安财富（北京）基金为销售机构并开通转换定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 26 日
14	参加银河证券申购定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 5 月 30 日
15	新增天津国美基金销售有限公司为销售机构并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）	2018 年 5 月 30 日
16	参加华宝证券费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 6 日
17	在国金证券开通转换定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 13 日
18	旗下基金终止懒猫金服销售业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网	2018 年 6 月 20 日

		站（www.ftfund.com）	
19	参加交通银行手机银行费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2018 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180620	296,240,879.94	5,901,044.62	302,141,924.56	0.00	0.00%
个人	1	20180625-20180630	-	102,309,670.47	-	102,309,670.47	24.37%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金基金管理人于 2018 年 1 月 25 日申请申购泰信天天收益货币 45,000,000.00 份。
本基金基金管理人于 2018 年 3 月 16 日申请转换出泰信天天收益货币 5,000,000.00 份。
本基金基金管理人于 2018 年 5 月 10 日申请赎回泰信天天收益货币 5,000,000.00 份。
本基金基金管理人于 2018 年 5 月 18 日申请赎回泰信天天收益货币 15,000,000.00 份。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准原泰信天天收益开放式证券投资基金设立的文件

2、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》

3、《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》

4、《泰信天天收益货币市场托管协议》

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。

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

2018 年 8 月 25 日