

# 泰信天天收益货币市场基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 24 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。

经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通过，并报中国证监会备案。自 2016 年 5 月 17 日起修订后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》生效，原《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》失效。本次持有人大会对《基金合同》的相关内容进行修改，包括变更基金名称、根据最新法律法规、证监会规范性文件要求修改原合同中部分条款及措辞、调整组合的投资范围和投资比例、对基金份额进行分类等。

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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 债券回购融资情况.....	51
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	51
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	53
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	53
8.8 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.....	53

8.9 投资组合报告附注.....	54
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
9.3 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.....	55
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	58
11.9 其他重大事件.....	58
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
13.1 备查文件目录.....	62
13.2 存放地点.....	62
13.3 查阅方式.....	63

## § 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	2,058,835,008.40 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	125,746,750.82 份	1,933,085,386.07 份	2,871.51 份

注：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。

### 2.2 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	王小林	田国立

## 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
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 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(特殊普通合伙)	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易实验区浦东南路 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	2016 年			2015 年	2014 年
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E	泰信天天收益 A	泰信天天收益 A
本期已实现收益	17,787,975.76	24,014,697.10	489.76	62,741,279.10	21,754,017.43
本期利润	17,787,975.76	24,014,697.10	489.76	62,741,279.10	21,754,017.43
本期净值收益率	2.1878%	1.5909%	1.4002%	4.2815%	3.9132%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末			2015 年末	2014 年末
	期末基金资产净值	125,746,750.82	1,933,085,386.07	2,871.51	5,209,544,242.80
期末基金份额净值	1	1	1	1	1
3.1.3 累计期末指	2016 年末			2015 年末	2014 年末

标					
累计净值 收益率	44.5513%	1.5909%	1.4002%	41.4567%	36.4663%

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
过去三个月	0.6147%	0.0020%	0.3450%	0.0000%	0.2697%	0.0020%
过去六个月	1.1653%	0.0027%	0.6900%	0.0000%	0.4753%	0.0027%
过去一年	2.1878%	0.0035%	1.3535%	0.0001%	0.8343%	0.0034%
过去三年	10.4597%	0.0083%	6.1076%	0.0018%	4.3521%	0.0065%
过去五年	19.3553%	0.0084%	12.0103%	0.0019%	7.3450%	0.0065%
自基金合同 生效起至今	44.5513%	0.0067%	29.7130%	0.0019%	14.8383%	0.0048%

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
过去三个月	0.6752%	0.0020%	0.3450%	0.0000%	0.3302%	0.0020%
过去六个月	1.2873%	0.0027%	0.6900%	0.0000%	0.5973%	0.0027%
自基金合同 生效起至今	1.5909%	0.0039%	0.8588%	0.0000%	0.7321%	0.0039%

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

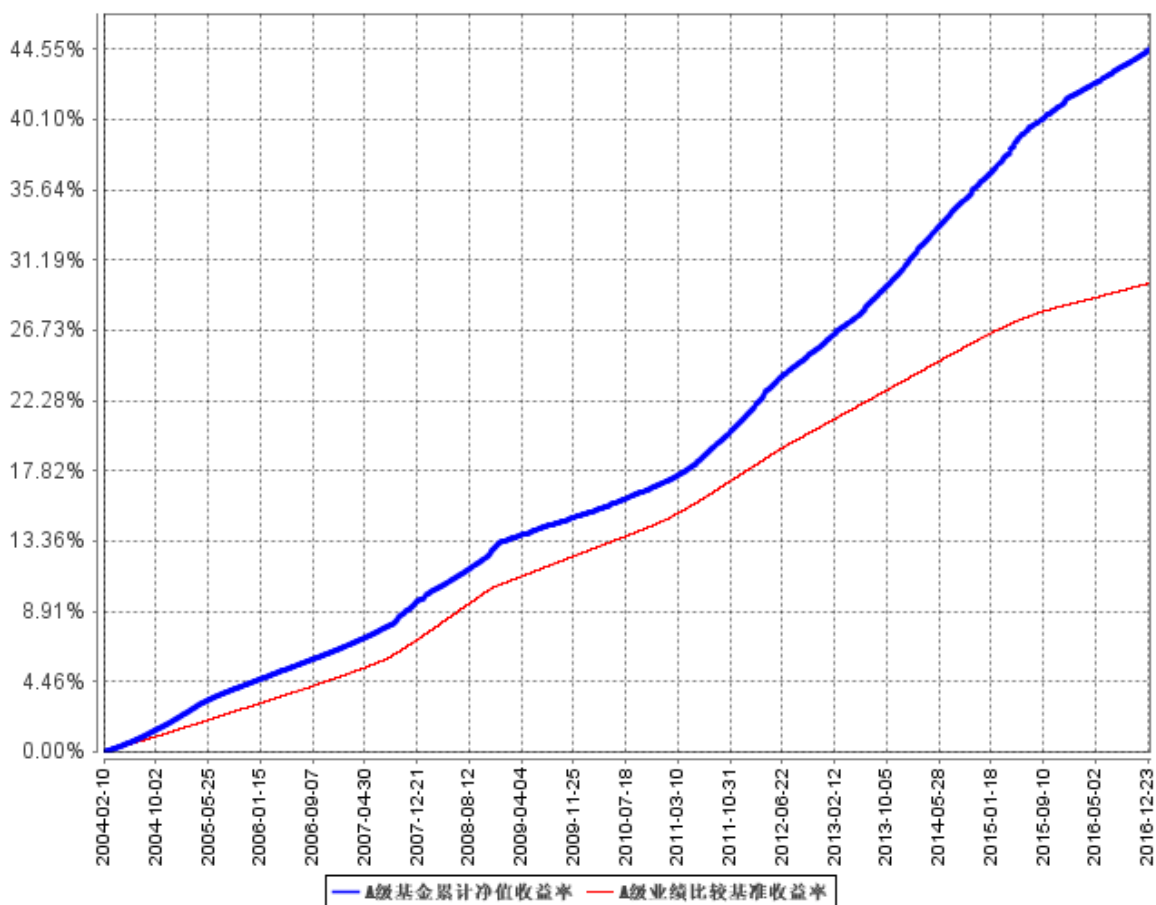
过去三个月	0.5884%	0.0021%	0.3450%	0.0000%	0.2434%	0.0021%
过去六个月	1.1276%	0.0028%	0.6900%	0.0000%	0.4376%	0.0028%
自基金合同生效起至今	1.4002%	0.0040%	0.8588%	0.0000%	0.5414%	0.0040%

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、本基金业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。

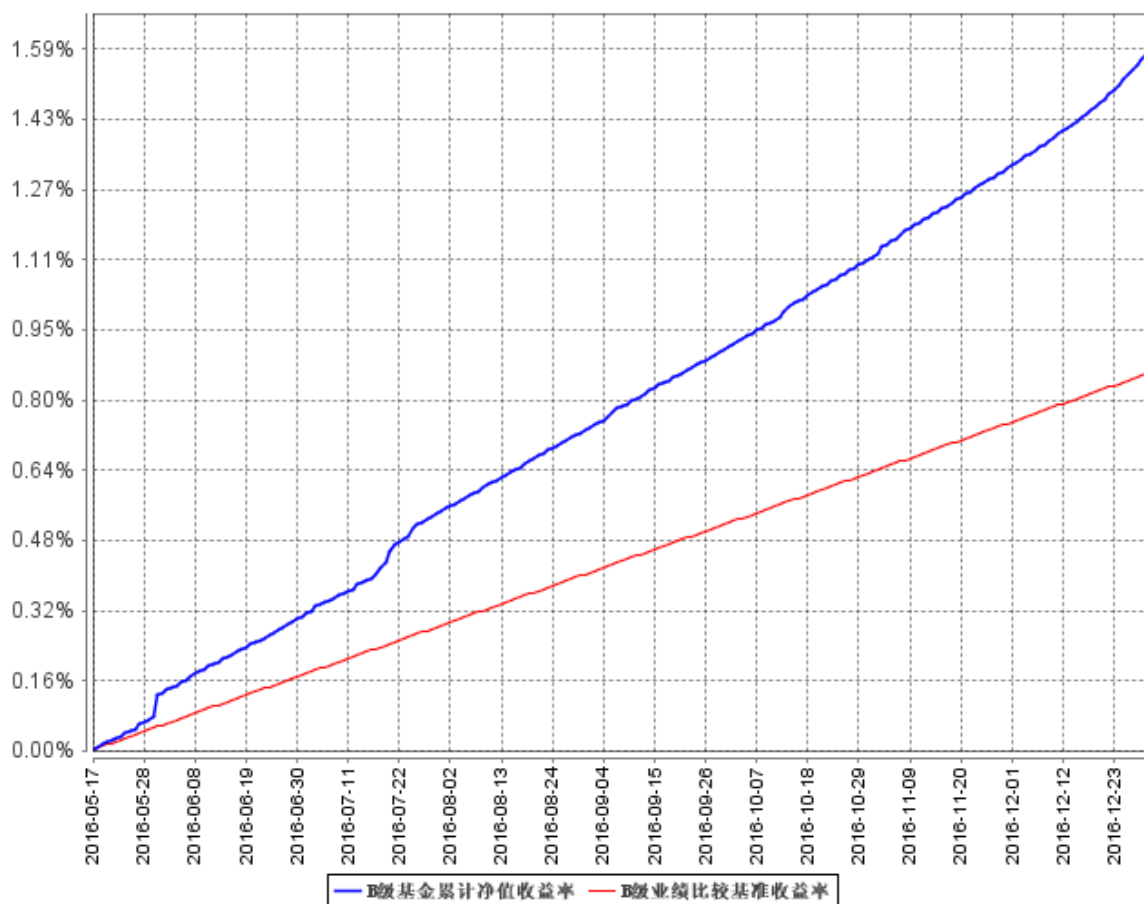
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A 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**

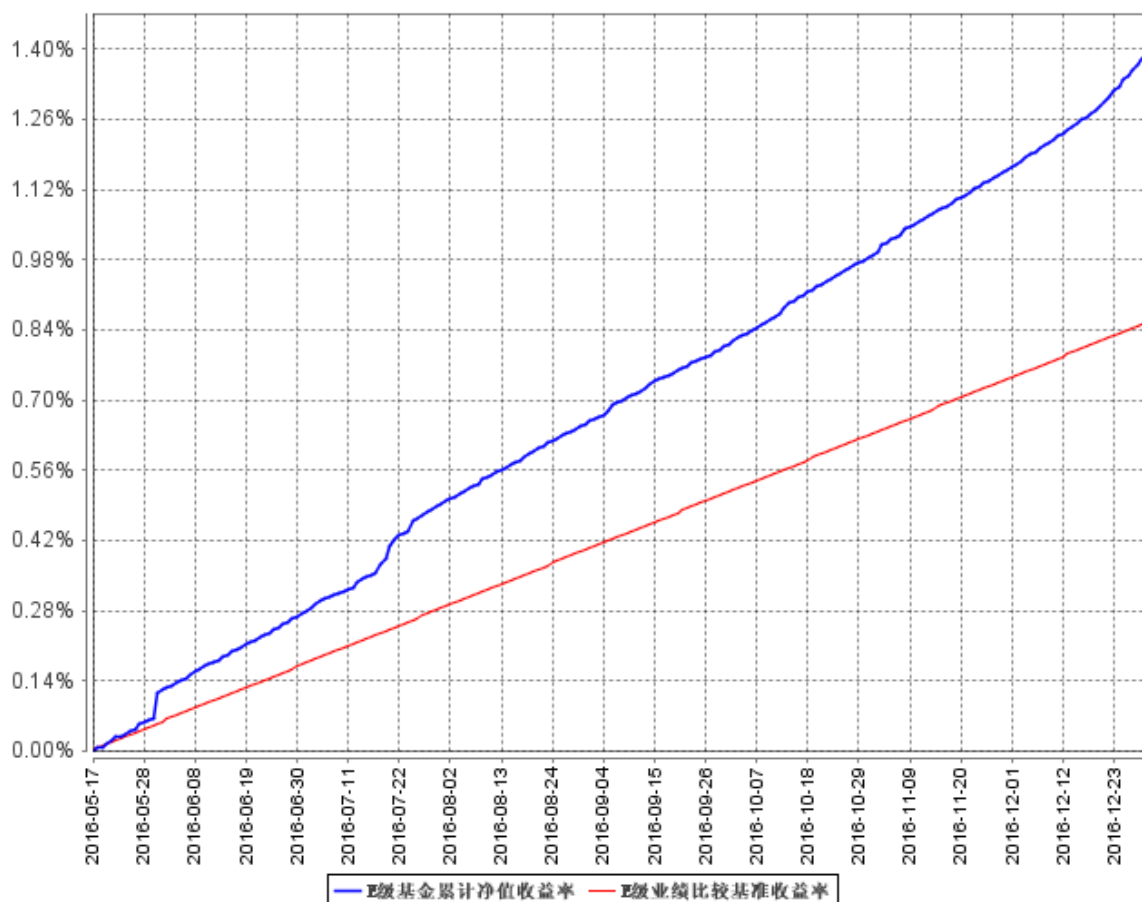




B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



E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



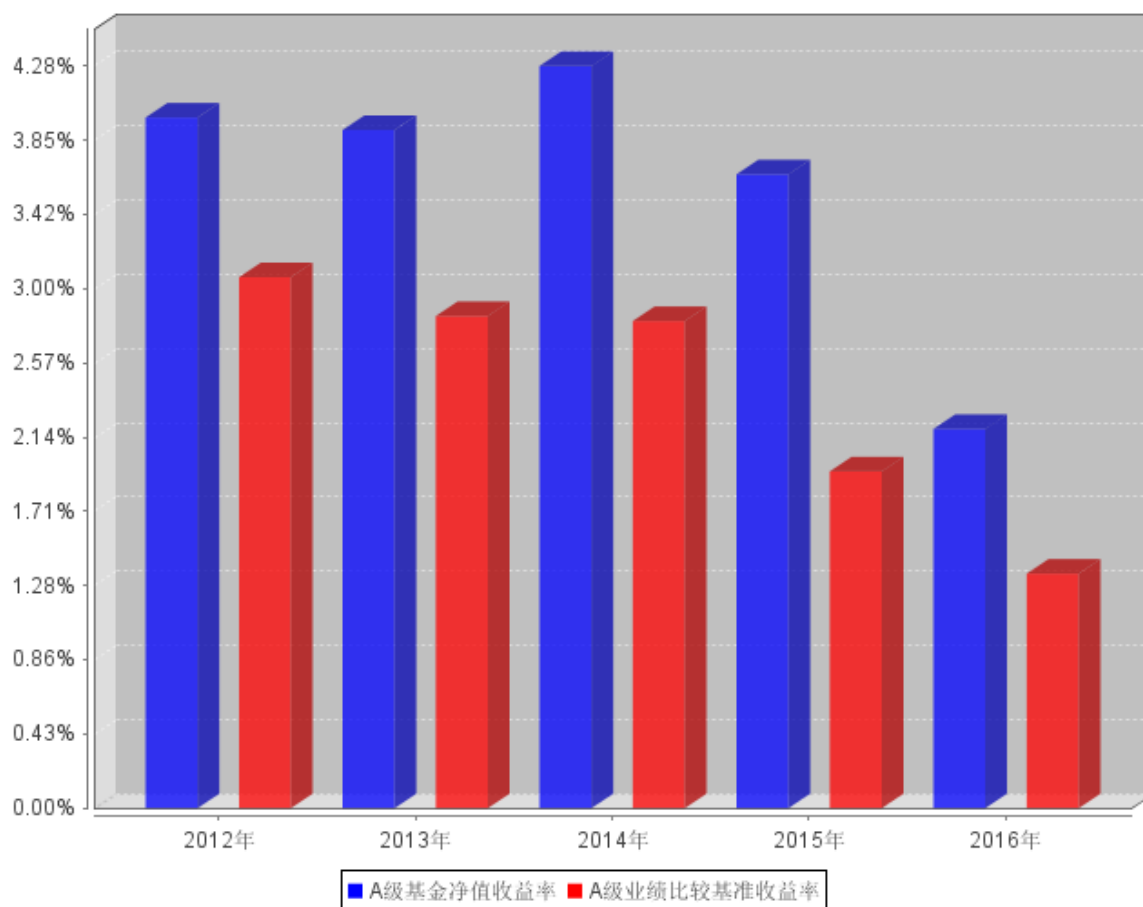
注：1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于2004年2月10日正式生效，于2016年5月17日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加B类、E类份额。

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)。

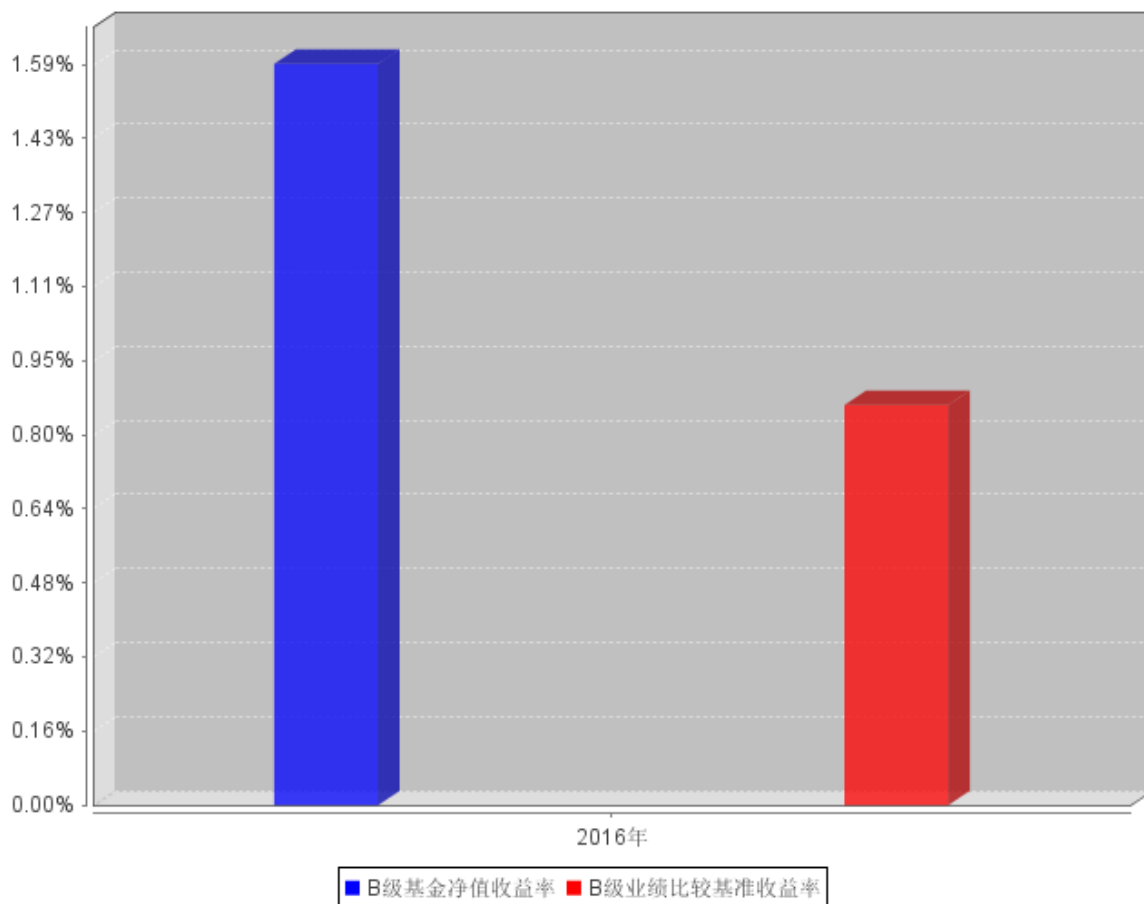
3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由何俊春女士担任本基金基金经理，邱庆东先生不再管理本基金。具体详情请见2016年10月11日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益货币市场基金经理变更的公告》。

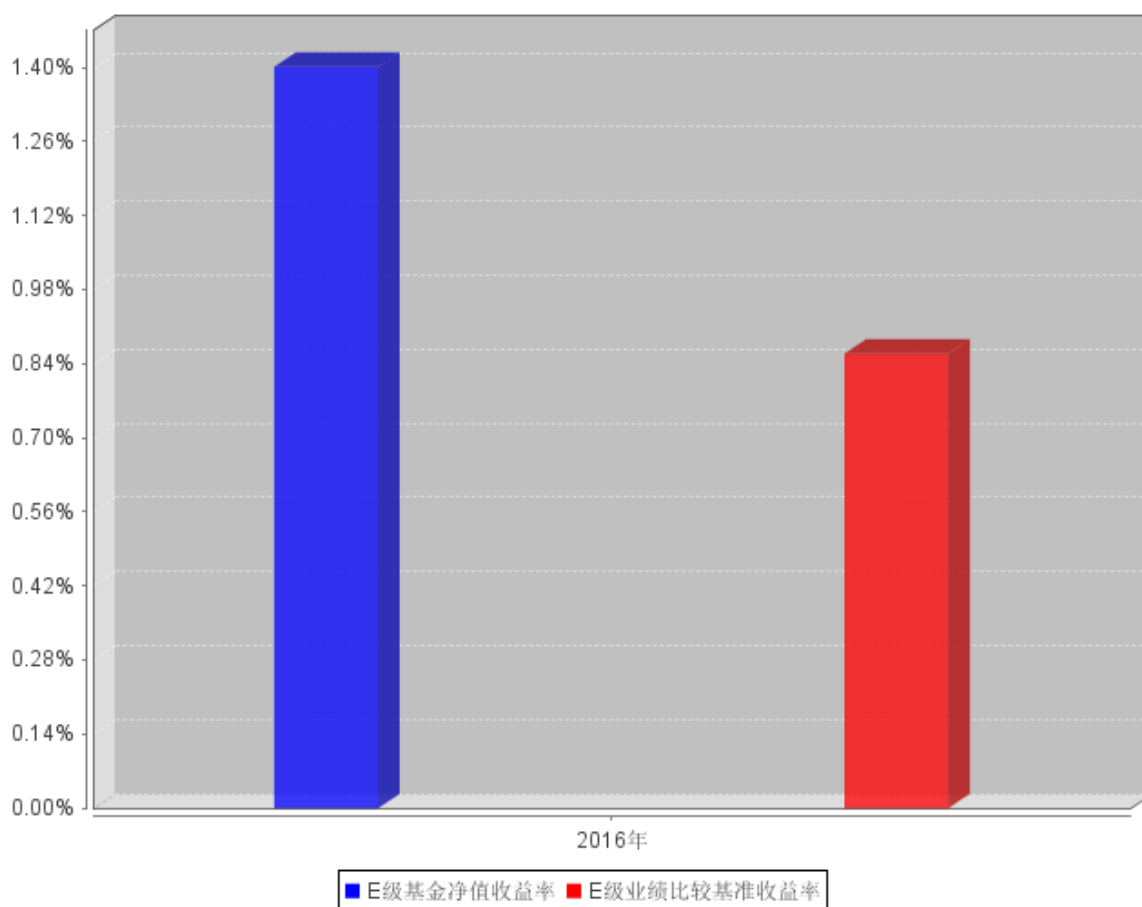
## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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



B级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



**E级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**

注：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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

泰信天天收益 A					
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
2016	21,004,602.59	2,714,658.30	-5,931,285.13	17,787,975.76	
2015	52,136,688.85	6,283,123.79	4,321,466.46	62,741,279.10	
2014	18,567,803.69	2,245,385.46	940,828.28	21,754,017.43	
合计	91,709,095.13	11,243,167.55	-668,990.39	102,283,272.29	

单位：人民币元

泰信天天收益 B					
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
2016	19,735,329.83	1,666,811.38	2,612,555.89	24,014,697.10	
合计	19,735,329.83	1,666,811.38	2,612,555.89	24,014,697.10	

单位：人民币元

泰信天天收益 E					
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
2016	207.05	280.43	2.28	489.76	
合计	207.05	280.43	2.28	489.76	

注：泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同于 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。

## § 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：王小林

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

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 2016 年 12 月底，公司有正式员工 108 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 2016 年 12 月 31 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、泰信智选成长共 19 只开放式基金及泰信乐利 5 号、泰信鲁信 1 号、泰信磐晟稳健 1 号、泰信价值 1 号、泰信添盈债券分级 1 号、泰信添盈债券分级 2 号、泰信中行新时代 6 号、泰信财达添利 1 号、泰信财达添利 2 号、泰信-合信一号、泰信合信三号、泰信融昇保本 1 号、泰信融昇保本 2 号、泰信融昇 3 号保本、泰信融昇 4 号保本、泰信融嘉 1 号保本、泰信融嘉 2 号保本、泰信中融景诚旭诚一期、泰信洛肯 1 号、泰信洛肯 2 号、泰信易享一号、泰信融鑫 2 号、泰信中融景诚旭诚固收 1 号、泰信融昇 5 号、泰信财达添利 3 号共 25 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基金经理	2016 年 10 月 11 日	-	20 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。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。
于瑞女士	基金经理助理	2016 年 9 月 6 日	-	5 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，现任研究部研究员兼泰信天天收益、周期回报基金经理助理。
邱庆东先生	本基金经理	2016年5月17日	-	9年	2007年7月至2012年12月先后任职于国都证券、海通证券、申万菱信基金管理公司担任债券研究员。2012年12月进入泰信基金管理有限公司，在集中交易部担任债券交易员，2013年9月至2014年9月担任研究部高级债券研究员兼泰信天天收益、泰信鑫益定期开放基金经理助理。

注：1、以上日期均是指公司公告的日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由何俊春女士担任本基金基金经理，邱庆东先生不再管理本基金。具体详情请见2016年10月11日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》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市场基金经理变更的公告》。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》、《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同时反向交易，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

本公司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。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

## 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

2016 年一季度，经济继续低位波动，但 PMI 指数经过持续下滑后在 3 月份出现回升，再度升至荣枯分界线以上。央行降低货币政策宽松的节奏，未进行降息操作，仅降准 1 次。资金面整体中性偏宽松，但部分时点如季末，资金极为紧张。债券市场方面，受通胀等因素影响，长债收益率回升，而短端收益率在偏宽松的资金面背景下，继续低位波动，收益率曲线呈现一定程度的陡峭化。信用利差方面，在较高的配置压力下，短期信用债尤其是中高信用等级信用债的信用利差持续压缩，但部分低评级信用债的违约风险仍是市场关注重点。2016 年二季度，债券市场走势明显分为两段。4 月份，受信用风险加剧及营改增政策影响，债券市场投资者的违约担忧增大及资金成本上升，最终导致债券收益率大幅上扬，短期的 1 年国开债收益率一度上升至 2.9% 左右。5-6 月份债券市场整体走好。首先是管理层修订了营改增政策，消除对债市的负面影响；另一方面宏观经济数据仍较低迷，通胀走势略有回落，基本面仍对债市有所呵护。英国脱欧派赢得公投，导致金融市场波动，拖累全球经济复苏，作为避险资产，债券市场成为较好的投资标的。1 年国开债收益率至季末回落至 2.6% 附近。受配置力量和资金面的交互作用，2016 年三季度债券市场收益率呈现分段波动走势，第一个阶段为七月到八月中旬，债券收益率在配置资金追逐下出现一波明显下行。一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融分别下行 28bp、27bp 和 46bp。8 月中旬央行公开市场操作陆续释放出去杠杆信号，资金面趋紧；高频经济数据也开始出现企稳迹象，各期限债券收益率和资金利率均出现显著反弹。9 月进入中旬后资金面难言乐观，短端收益率呈现出小幅整荡上行。四季度债券市场的主要影响因素为央行货币政策转向和经济基本面数据不断改善。10 月至 11 月，央行货币政策重心仍是去杠杆，并继续维持稳中偏紧的货币政策，临近年末叠加跨年因素、银行 MPA 考核因素和节前现金漏损因素，资金面紧平衡局面未得到显著改善，机构投资者情绪明显转向谨慎，债券二级市场抛压较大。受资金面因素制约，短端债券收益率在这一阶段震荡上行。12 月初公布的 11 月中采 PMI 指数 51.7%，为 2012 年 7 月以来最高点，经济基本面改善短期内无法证伪；银行理财监管的重量级文件逐步出台；年底信用风险出现回升；市场情绪跌至谷底，国债期货出现跌停；海外方面，美国大选尘埃落定、在 12 月进行了年内加息，并预计 2017 年加息 3 次，美元指数持续走高，人民币汇率持续受到贬值压力，进一步制约货币政策宽松，资金面进一步承压。多重因素共同导致 11 月底至 12 月中旬债券市场发生剧烈调整，收益率快速蹿升至近两年高点。此轮调整中一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融分别上行 174bp、169bp 和 175bp。12 月下旬央行及时通过公开市场操作投放流动性，市场悲观情绪才得以缓解，债券止跌，估值有所修复。

2016 年一季度，本基金平均剩余期限保持在 80 天左右，未进行杠杆操作，较好控制流动性风险和信用风险。天天收益基金于二季度完成基金合同修改，与时俱进扩大部分投资品种范围。大部分时间保持较为中性的组合久期，至季末为防范流动性风险，有所缩短。资产配置方面，增加同业存单的配置比例，考虑到信用风险频发，本基金严控信用风险，配置大量 AAA 级短期债券。天天收益基金在三季度继续维持适中偏短的组合久期，短融配置比例在 27%左右，且所持短融信用评级较高。另外配置了较高比例的政策性金融债和逆回购资产，使得基金组合在面临资金面波动时具有较好的流动性。天天收益基金在四季度继续维持适中偏短的组合久期，短融配置比例在 20%左右，且所持短融信用评级较高。另外配置了较高比例的政策性金融债和逆回购资产，使得基金在面临资金面波动和市场剧烈调整时仍具有较好的流动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 份额净值收益率为 2.1878%，业绩比较基准收益率为 1.3535%；B 份额净值收益率为 1.5909%，业绩比较基准收益率为 0.8588%；E 份额净值收益率为 1.4002%，业绩比较基准收益率为 0.8588%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年末的中央经济工作会议为 17 年货币政策定调，延续中性稳健，货币政策转向中性偏紧；央行继续通过“锁短放长”间接提高杠杆资金成本来达到“去杠杆、防风险”的目的；人民银行将于 2017 年第一季度评估时正式将表外理财纳入 MPA 广义信贷范围，将限制理财规模扩张速度，导致配置资金边际减少。1 月底 MLF6 月、1 年利率上调 10bp 分别达到 2.95%、3.1%，春节后 SLF、公开市场操作利率各期限也同步上调 10bp，市场回购加权利率中枢随之抬升。预计资金成本抬升将进一步向现券传导，收益率曲线恐进一步走陡；金融去杠杆对信用债尤其低等级信用债的冲击会逐步体现，信用利差会趋于扩大。一季度各类监管政策集中落地，建议保持谨慎，等待配置机会。其次，基本面考虑到 1 月气温下降猪价菜价上升、春节较早导致需求上升，预计食品类 CPI 有望回暖，带动整体 CPI 季节性走高，对年初债市形成一定的压力。海外方面，美国在 12 月进行了年内加息，并预计 2017 年加息 3 次，美元指数持续走高，人民币汇率在美联储加息下将持续受到贬值压力，进一步制约货币政策宽松，资金面进一步承压。

展望全年，需要重点关注的是宏观因素出现的潜在变化，主要关注点为央行货币政策及相关监管办法、美国货币政策对国内货币政策的传导影响；关注中下游产品价格持续上涨、企业盈利稳步恢复等经济基本面因素。本基金投资展望：整体而言，今年是否开启加息周期尚待观察，但

短期限债券收益率已初具配置价值，未来投资组合仍以中性配置为主，信用风险控制继续加强，维持目前组合较高的信用评级。今年债券市场将会充满波动，波动中也蕴藏投资机会，需要跟随市场的预期及时调整投资策略。

#### 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，本基金管理人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。

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估，确保风险控制的有效性，不断提升内部控制水平。

##### 2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制。

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集，提示投研部门注意潜在风险。

(2) 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，新增了基金间同日同向交易。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。

3、日常监察与专项稽核相结合，深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4、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。

5、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，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：

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。

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，泰信优势增长基金基金经理。

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。

#### 4.8 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 A 类份额收益分配共 17,787,975.76 元；B 类份额收益分配共 24,014,697.10 元；E 类份额收益分配共 489.76 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”）在泰信天天收益货币市场基金（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 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(2017)第 21005 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	泰信天天收益货币市场基金(原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天天收益货币市场基金(以下简称“泰信天天收益基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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、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,公允反映了泰信天天收益基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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	傅琛慧
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	

审计报告日期	2017 年 3 月 24 日
--------	-----------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰信天天收益货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	87,220,186.75	1,530,793,676.12
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	737,926,380.07	1,446,854,506.81
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		737,926,380.07	1,446,854,506.81
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,229,266,283.91	2,030,507,925.75
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	8,968,626.24	9,090,672.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	201,000,006.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,063,381,476.97	5,218,246,787.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		9,852.22	3,114.08
应付管理人报酬		404,849.23	674,261.02
应付托管费		122,681.59	204,321.51



应付销售服务费		32,683.52	510,803.80
应付交易费用	7.4.7.7	31,229.91	46,246.64
应交税费		628,500.00	628,500.00
应付利息		-	-
应付利润		2,967,524.32	6,286,251.28
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	349,147.78	349,046.61
负债合计		4,546,468.57	8,702,544.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,058,835,008.40	5,209,544,242.80
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,058,835,008.40	5,209,544,242.80
负债和所有者权益总计		2,063,381,476.97	5,218,246,787.74

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,058,835,008.40 份。其中天天收益货币 A 类基金份额净值为 1.00 元，基金份额为 125,746,750.82 份；天天收益货币 B 类基金份额净值为 1.00 元，基金份额为 1,933,085,386.07 份；天天收益货币 E 类基金份额净值为 1.00 元，基金份额为 2,871.51 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信天天收益货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		52,764,290.21	77,184,204.23
1.利息收入		50,596,699.34	60,551,303.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,894,544.87	23,033,274.40
债券利息收入		26,178,791.18	29,736,252.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,523,363.29	7,781,776.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,167,590.87	16,632,900.67
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	2,167,590.87	16,632,900.67
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		10,961,127.59	14,442,925.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,149,287.85	6,237,301.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,863,420.54	1,890,091.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,354,543.40	4,725,228.19
4. 交易费用	7.4.7.19	125.00	75.00
5. 利息支出		165,866.02	1,155,696.81
其中：卖出回购金融资产支出		165,866.02	1,155,696.81
6. 其他费用	7.4.7.20	427,884.78	434,532.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		41,803,162.62	62,741,279.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		41,803,162.62	62,741,279.10

### 7.3 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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	5,209,544,242.80	-	5,209,544,242.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,803,162.62	41,803,162.62
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）	-3,150,709,234.40	-	-3,150,709,234.40
其中：1. 基金申购款	7,337,262,297.86	-	7,337,262,297.86
2. 基金赎回款	-10,487,971,532.26	-	-10,487,971,532.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-41,803,162.62	-41,803,162.62

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,058,835,008.40	-	2,058,835,008.40
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	2,078,354,314.15	-	2,078,354,314.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,741,279.10	62,741,279.10
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）	3,131,189,928.65	-	3,131,189,928.65
其中：1. 基金申购款	11,481,584,714.56	-	11,481,584,714.56
2. 基金赎回款	-8,350,394,785.91	-	-8,350,394,785.91
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）	-	-62,741,279.10	-62,741,279.10
五、期末所有者权益（基金净值）	5,209,544,242.80	-	5,209,544,242.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
葛航

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
韩波

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
蔡海成

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泰信天天收益货币市场基金(原名为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 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)。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)。

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 2017 年 3 月 24 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》、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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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。

本基金目前以交易目的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其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

### 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，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的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，以避免债券投资的账面价值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。

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账面价值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 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，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值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。

#### 7.4.4.9 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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值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

本基金每一类别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，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

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[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,220,186.75	5,793,676.12
定期存款	80,000,000.00	1,525,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	80,000,000.00	200,000,000.00
存款期限 1 个月以内	-	1,235,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-	90,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	87,220,186.75	1,530,793,676.12

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。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	737,926,380.07	736,850,000.00	-1,076,380.07	-0.0523%
	合计	737,926,380.07	736,850,000.00	-1,076,380.07	-0.0523%
项目		上年度末 2015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	1,446,854,506.81	1,447,256,000.00	401,493.19	0.0077%
	合计	1,446,854,506.81	1,447,256,000.00	401,493.19	0.0077%

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

本基金本报告期末及上年度末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 2016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	1,229,266,283.91	-
合计	1,229,266,283.91	-
项目	上年度末 2015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	2,030,507,925.75	-
合计	2,030,507,925.75	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	880.93	3,392.79
应收定期存款利息	175,222.35	2,533,221.77
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	6,805,342.55	4,855,331.36
应收买入返售证券利息	1,987,180.41	1,698,726.17
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	8,968,626.24	9,090,672.09

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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	31,229.91	46,246.64
合计	31,229.91	46,246.64

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	147.78	46.61
预提费用	349,000.00	349,000.00
合计	349,147.78	349,046.61

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

泰信天天收益 A

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,209,544,242.80	5,209,544,242.80
本期申购	1,671,388,425.82	1,671,388,425.82
本期赎回(以“-”号填列)	-6,755,185,917.80	-6,755,185,917.80
- 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	125,746,750.82	125,746,750.82

金额单位：人民币元

泰信天天收益 B		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	5,665,707,222.57	5,665,707,222.57
本期赎回(以“-”号填列)	-3,732,621,836.50	-3,732,621,836.50
- 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	1,933,085,386.07	1,933,085,386.07

金额单位：人民币元

泰信天天收益 E		
项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	166,649.47	166,649.47
本期赎回(以“-”号填列)	-163,777.96	-163,777.96
- 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	2,871.51	2,871.51

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 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》并经中国证监会批准，本基金于 2016 年 5 月 17 日分为 A、B、E 三类，原有的基金份额以 300 万份额为界限划分，单一持有人持有 300 万份基金份额以下的为 A 类份额，达到或超过 300 万份的为 B 类份额。

#### 7.4.7.10 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	17,787,975.76	-	17,787,975.76
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	-17,787,975.76	-	-17,787,975.76
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	24,014,697.10	-	24,014,697.10
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	-24,014,697.10	-	-24,014,697.10
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	489.76	-	489.76
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	-489.76	-	-489.76
本期末	-	-	-

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	105,374.90	232,963.03
定期存款利息收入	10,769,528.36	22,781,937.05
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,641.61	18,374.32
其他	-	-
合计	10,894,544.87	23,033,274.40

**7.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	2,167,590.87	16,632,900.67
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	2,167,590.87	16,632,900.67

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,707,068,217.39	5,694,276,274.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,659,895,430.45	5,558,110,105.62
减：应收利息总额	45,005,196.07	119,533,268.29
买卖债券差价收入	2,167,590.87	16,632,900.67

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本报告期末及上年度末本基金未投资资产支持证券。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	125.00	75.00
合计	125.00	75.00

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
上清所账户维护费	18,200.00	18,200.00
银行划款手续费	41,684.78	58,332.65

其他	10,000.00	-
合计	427,884.78	434,532.65

## 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

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截止 2016 年 12 月 31 日止年度/期间的财务状况和经营成果无影响。

## 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
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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。



### 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,149,287.85	6,237,301.25
其中：支付销售机构的客户维护费	463,516.64	409,536.99

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,863,420.54	1,890,091.23

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年12月31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	1,650,159.42	81,536.83	53.12	1,731,749.37
中国银行	128,981.88	444.73	-	129,426.61
合计	1,779,141.30	81,981.56	53.12	1,861,175.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	3,686,633.60	-	-	3,686,633.60
中国银行	363,454.09	-	-	363,454.09
合计	4,050,087.69	-	-	4,050,087.69

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

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

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，A 类和 E 类的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；B 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01%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=前一日基金资产净值 0.25%/当年天数。

B 类基金销售服务费=前一日基金资产净值 0.01%/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 2016年1月1日至2016年12月31日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

易的各关联方名称	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	-	60,593,932.39	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	20,628,210.96	20,127,135.74	-	-	-	-

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	6,812,704.21	-
期间申购/买入总份额	-	61,745,362.79	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	68,558,067.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.3300%	-

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	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）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	15,537,898.86	-	-
期间申购/买入总份额	41,274,805.35	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	50,000,000.00	-	-
期末持有的基金份额	6,812,704.21	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1300%	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含转换入份额。

2. 基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托泰信直销办理，转换入通过中国银行、工商银行和光大银行办理，无费用。

#### 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

泰信天天收益 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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	-	-	53,476,998.02	1.0300%

#### 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	7,220,186.75	105,374.90	5,793,676.12	232,963.03

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

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
21,004,602.59	2,714,658.30	-5,931,285.13	17,787,975.76	-

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

19,735,329.83	1,666,811.38	2,612,555.89	24,014,697.10	-
---------------	--------------	--------------	---------------	---

## 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
207.05	280.43	2.28	489.76	-

注：1. 本基金在本年度累计分配收益 41,803,162.62 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 40,740,139.47 元，计入应付收益科目-3,318,726.96 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 期末（2016 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末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证券。

##### 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。本基金的活期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。定期银行存款存放在具有基金托管资格的上海银行股份有限公司、广发银行股份有限公司和宁波银行股份有限公司，与上述银行存款相关的信用风险均不重大。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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	220,022,270.53	399,944,507.26
A-1 以下	-	-
未评级	517,904,109.54	1,046,909,999.55
合计	737,926,380.07	1,446,854,506.81

注：未评级债券为短期融资券、同业存单和政策性金融债。

### 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 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。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%。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担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，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 2016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	87,220,186.75	-	-	-	-	87,220,186.75
交易性金融资产	618,036,369.10	119,890,010.97	-	-	-	737,926,380.07
买入返售金融资产	1,229,266,283.91	-	-	-	-	1,229,266,283.91
应收利息	-	-	-	-	8,968,626.24	8,968,626.24
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,934,522,839.76	119,890,010.97	-	-	8,968,626.24	2,063,381,476.97
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	9,852.22	9,852.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	404,849.23	404,849.23
应付托管费	-	-	-	-	122,681.59	122,681.59
应付销售服务费	-	-	-	-	32,683.52	32,683.52
应付交易费用	-	-	-	-	31,229.91	31,229.91
应交税费	-	-	-	-	628,500.00	628,500.00
应付利润	-	-	-	-	2,967,524.32	2,967,524.32
其他负债	-	-	-	-	349,147.78	349,147.78
负债总计	-	-	-	-	4,546,468.57	4,546,468.57
利率敏感度缺口	1,934,522,839.76	119,890,010.97	-	-	4,422,157.67	2,058,835,008.40
上年度末 2015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	1,530,793,676.12	-	-	-	-	1,530,793,676.12
交易性金融资产	1,106,714,273.46	340,140,233.35	-	-	-	1,446,854,506.81
买入返售金融资产	2,030,507,925.75	-	-	-	-	2,030,507,925.75
应收利息	-	-	-	-	9,090,672.09	9,090,672.09
应收申购款	-	-	-	-	201,000,006.97	201,000,006.97
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,668,015,875.33	340,140,233.35	-	-	210,090,679.06	5,218,246,787.74



负债						
应付赎回款					3,114.08	3,114.08
应付管理人报酬					674,261.02	674,261.02
应付托管费					204,321.51	204,321.51
应付销售服务费					510,803.80	510,803.80
应付交易费用					46,246.64	46,246.64
应付税费					628,500.00	628,500.00
应付利润					6,286,251.28	6,286,251.28
其他负债					349,046.61	349,046.61
负债总计					8,702,544.94	8,702,544.94
利率敏感度缺口	4,668,015,875.33	340,140,233.35			-201,388,134.12	5,209,544,242.80

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	560,000.00	1,140,000.00
市场利率上升 25 个基点	-560,000.00	-1,140,000.00	

#### 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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次的余额为 737,926,380.07 元，无属于第一或第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第二层次 1,446,854,506.81 元，无属于第一或第三层次的余额）。

##### (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次未发生重大变动。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2015 年 12 月 31 日：同）。

##### (d) 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。

(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	737,926,380.07	35.76
	其中: 债券	737,926,380.07	35.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,229,266,283.91	59.58
	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	87,220,186.75	4.23
4	其他各项资产	8,968,626.24	0.43
5	合计	2,063,381,476.97	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	0.44	
	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%。

### 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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

注：本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 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	60.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	16.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	5.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.78	-

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

### 8.5 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	119,947,995.07	5.83
	其中：政策性金融债	119,947,995.07	5.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	409,846,677.75	19.91
6	中期票据	-	-
7	同业存单	208,131,707.25	10.11
8	其他	-	-
9	合计	737,926,380.07	35.84
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

**8.6 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	111612188	16 北京银行 CD188	600,000	59,389,333.19	2.88
2	041673003	16 中信重工 CP001	500,000	50,064,536.51	2.43
3	160304	16 进出 04	500,000	50,030,964.89	2.43
4	041659015	16 义乌国资 CP002	500,000	49,980,585.85	2.43
5	111607123	16 招行 CD123	500,000	49,924,926.11	2.42
6	111610591	16 兴业 CD591	500,000	49,496,077.55	2.40
7	111681046	16 杭州银行 CD193	500,000	49,321,370.40	2.40
8	160401	16 农发 01	400,000	40,000,376.34	1.94
9	041652004	16 京能投 CP001	300,000	29,997,911.85	1.46
10	041659013	16 福州城投 CP001	300,000	29,996,825.04	1.46

**8.7 “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	0.0939%
报告期内偏离度的最低值	-0.2470%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0518%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本报告期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。

**8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

(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。

### 8.9.2

本基金投资的前十名证券本期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。

### 8.9.3 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	8,968,626.24
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,968,626.24

8.9.4 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。

## § 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

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	5,272	23,851.81	12,856,698.66	10.22%	112,890,052.16	89.78%
泰信天天收益 B	46	42,023,595.35	1,840,302,919.36	95.20%	92,782,466.71	4.80%
泰信天天收益 E	27	106.35	0.00	0.00%	2,871.51	100.00%
合计	5,345	385,188.96	1,853,159,618.02	90.01%	205,675,390.38	9.99%

## 9.2 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	12,265.15	0.0098%
	泰信天天收益 B	-	-
	泰信天天收益 E	2,635.17	91.7695%
	合计	14,900.32	0.0007%

## 9.3 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。

## § 10 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	6,023,310,189.68	-	-
本报告期期初基金份额总额	5,209,544,242.80	-	-
本报告期基金总申购份额	1,671,388,425.82	5,665,707,222.57	166,649.47
减:本报告期基金总赎回份额	6,755,185,917.80	3,732,621,836.50	163,777.96
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	125,746,750.82	1,933,085,386.07	2,871.51

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

经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通过，并报中国证监会备案。自 2016 年 5 月 17 日起修订后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》生效，原《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》失效。本次持有人大会对《基金合同》的相关内容进行修改，包括变更基金名称、根据最新法律法规、证监会规范性文件要求修改原合同中部分条款及措辞、调整组合的投资范围和投资比例、对基金份额进行分类等。

### 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、2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定，由何俊春女士担任本基金基金经理，邱庆东先生不再管理本基金。具体详情请见 2016 年 10 月 11 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》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市场基金经理变更的公告》。除此以外基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2016 年 7 月万科企业股份有限公司工会委员会诉泰信基金管理有限公司等被告损害股东利益责任纠纷一案，公司已聘请专业律师应诉，目前案件正在审理阶段，法院未作出判决。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。



本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

经原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通过，并报中国证监会备案。自 2016 年 5 月 17 日起修订后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》生效，原《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》失效。本次持有人大会对《基金合同》的相关内容进行修改，包括变更基金名称；根据最新法律法规、证监会规范性文件要求修改原合同中部分条款及措辞；调整组合的投资范围和投资比例；对基金份额进行分类等。

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》的有关规定，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)。业绩比较基准调整为七天通知存款利率(税后)。

#### 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 10 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	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	3,068,000,000.00	100.00%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 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	在兴业证券开通定投转换费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月12日
2	新增北京增财销售为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月20日
3	15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）	2016年1月22日
4	16年春节暂停申购定投转换入业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站（www.ftfund.com）	2016年1月28日

5	在财富证券开通转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 1 日
6	广州证券、德邦证券开定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 1 日
7	提醒投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 24 日
8	工商银行申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 28 日
9	2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 3 月 30 日
10	通讯方式召开份额持有人大会公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 9 日
11	通讯方式召开份额持有人大会第一次提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 11 日
12	通讯方式召开份额持有人大会第二次提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 12 日
13	新增北京钱景财富管理有限公司为销售机构并开通定投转换费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 12 日
14	参加陆金所费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 4 月 15 日
15	2016 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)	2016 年 4 月 21 日
16	中信建投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 5 月 4 日
17	新增鑫鼎盛为销售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)	2016 年 5 月 24 日
18	端午节前暂停申购定投转换入业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 1 日
19	新增深圳新兰德为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网	2016 年 6 月 7 日

		站 (www.ftfund.com)	
20	陆金所开通定投及费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 8 日
21	新增泰诚财富为销售机构并开通定投转换费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 17 日
22	在陆金所开通申购定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 24 日
23	在交通银行开通网上银行、手机银行申购费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 6 月 27 日
24	参加鑫鼎盛申购定定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 7 月 6 日
25	新增北京晟视天下为销售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)	2016 年 7 月 12 日
26	新增武汉市伯嘉销售有限公司为销售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)	2016 年 7 月 16 日
27	16 年 2 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)	2016 年 7 月 19 日
28	参加泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司申购、定投费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 8 月 12 日
29	参加上海联泰资产管理有限公司申购、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)	2016 年 8 月 20 日
30	16 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 8 月 29 日
31	16 年中秋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)	2016 年 9 月 7 日
32	新增华泰证券为销售机构开通定投转换业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 9 月 19 日
33	参加交通银行手机银行申购及定投费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 9 月 20 日
34	16 年国庆节前暂停申购定投转	《中国证券报》、《上海证券	2016 年 9 月 23 日

	换入业务	报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	
35	基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 10 月 11 日
36	参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购、定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 10 月 25 日
37	参加嘉实财富费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 10 月 25 日
38	开通中国工商银行股份有限公司转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 10 月 25 日
39	16 年 3 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)	2016 年 10 月 26 日
40	新增上海万得投资顾问有限公司为销售机构并开通定投、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)	2016 年 11 月 11 日
41	新增上海华信证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 11 月 29 日
42	参加交通银行手机银行申购及定投费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 11 月 29 日
43	新增华福证券为销售机构并开通定投、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)	2016 年 11 月 30 日
44	新增宁波银行为销售机构并开通定投、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)	2016 年 11 月 30 日
45	在上海华信证券开通定投业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 12 月 15 日
46	2017 年元旦节前暂停申购、定投、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)	2016 年 12 月 27 日
47	参加农业银行网上银行掌上银行申购、定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站 (www.ftfund.com)	2016 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

经原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通过，并报中国证监会备案。自 2016 年 5 月 17 日起修订后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》生效，原《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》失效。本次持有人大会对《基金合同》的相关内容进行修改，包括变更基金名称；根据最新法律法规、证监会规范性文件要求修改原合同中部分条款及措辞；调整组合的投资范围和投资比例；对基金份额进行分类等。

本基金基金管理人于 2016 年 10 月 20 日申请申购泰信天天收益货币 20,000,000.00 份。

本基金基金管理人于 2016 年 12 月 27 日申请从泰信蓝筹精选混合、泰信行业精选混合 A 转换出基金份额至泰信天天收益货币，转换入份额共计 41,512,408.76 份。

本基金基金管理人的股东山东省国际信托股份有限公司于 2016 年 5 月 12 日申请从泰信先行策略混合、泰信优质生活混合、泰信蓝筹精选混合、泰信发展主题混合、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信国策驱动混合转换出基金份额至泰信天天收益货币，转换入份额共计 54,635,727.10 份。

本基金基金管理人的股东山东省国际信托股份有限公司于 2016 年 7 月 19 日申请赎回泰信天天收益货币 109,036,574.59 份。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》
- 4、《泰信天天收益开放式证券投资基金招募说明书》
- 5、《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》
- 6、《泰信天天收益开放式证券投资基金托管协议》
- 7、《泰信天天收益货币市场托管协议》
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 13.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人住所、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

### 13.3 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](http://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  
2017年3月30日