

# 泰信天天收益货币市场基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 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      | 1, 218, 642, 752. 52 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 | 94, 633, 605. 75 份     | 1, 124, 005, 310. 08 份 | 3, 836. 69 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 | xp1@ftfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-5988   | 95566                |
| 传真      |      | 021-20899008   | 010-66594942         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 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<br>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

| 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（2017 年 1 月<br>1 日 - 2017 年 6 月 30 日<br>） | 报告期（2017 年 1 月<br>1 日 - 2017 年 6 月<br>30 日） | 报告期（2017 年<br>1 月 1 日 -<br>2017 年 6 月<br>30 日） |
| 本期已实现收益       | 1,775,368.86                                 | 22,403,240.90                               | 58.94  |
| 本期利润          | 1,775,368.86                                 | 22,403,240.90                               | 58.94  |
| 本期净值收益率       | 1.6720%                                      | 1.7929%                                     | 1.6574%  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2017 年 6 月 30 日）                        |   |  |
| 期末基金资产净值      | 94,633,605.75                                | 1,124,005,310.08                            | 3,836.69                                       |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                       | 1.0000                                      | 1.0000   |

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<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③      | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.3197%      | 0.0020%             | 0.1125%            | 0.0000%               | 0.2072%  | 0.0020% |
| 过去三个月          | 0.8949%      | 0.0022%             | 0.3413%            | 0.0000%               | 0.5536%  | 0.0022% |
| 过去六个月          | 1.6720%      | 0.0031%             | 0.6788%            | 0.0000%               | 0.9932%  | 0.0031% |
| 过去一年           | 2.8565%      | 0.0032%             | 1.3687%            | 0.0000%               | 1.4878%  | 0.0032% |
| 过去三年           | 9.8351%      | 0.0077%             | 5.3786%            | 0.0016%               | 4.4565%  | 0.0061% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 46.9679%     | 0.0066%             | 30.3918%           | 0.0020%               | 16.5761% | 0.0046% |

## 泰信天天收益 B

| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月          | 0.3396%      | 0.0020%             | 0.1125%            | 0.0000%               | 0.2271% | 0.0020% |
| 过去三个月          | 0.9553%      | 0.0022%             | 0.3413%            | 0.0000%               | 0.6140% | 0.0022% |
| 过去六个月          | 1.7929%      | 0.0031%             | 0.6788%            | 0.0000%               | 1.1141% | 0.0031% |
| 过去一年           | 3.1031%      | 0.0032%             | 1.3687%            | 0.0000%               | 1.7344% | 0.0032% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 3.4122%      | 0.0038%             | 1.5375%            | 0.0000%               | 1.8747% | 0.0038% |

## 泰信天天收益 E

| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月          | 0.3166%      | 0.0020%             | 0.1125%            | 0.0000%               | 0.2041% | 0.0020% |
| 过去三个月          | 0.8863%      | 0.0022%             | 0.3413%            | 0.0000%               | 0.5450% | 0.0022% |
| 过去六个月          | 1.6574%      | 0.0031%             | 0.6788%            | 0.0000%               | 0.9786% | 0.0031% |
| 过去一年           | 2.8036%      | 0.0033%             | 1.3687%            | 0.0000%               | 1.4349% | 0.0033% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 3.0807%      | 0.0039%             | 1.5375%            | 0.0000%               | 1.5432% | 0.0039% |

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。

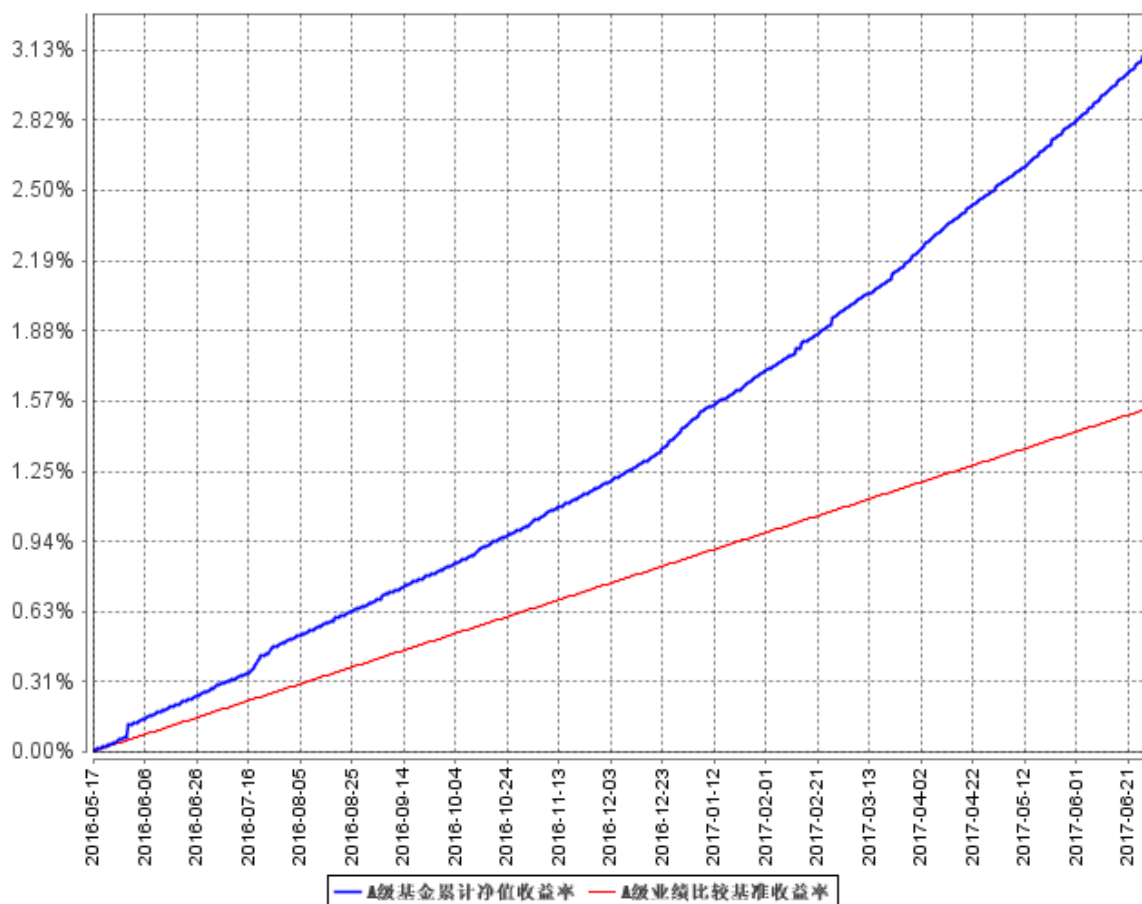
2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。

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

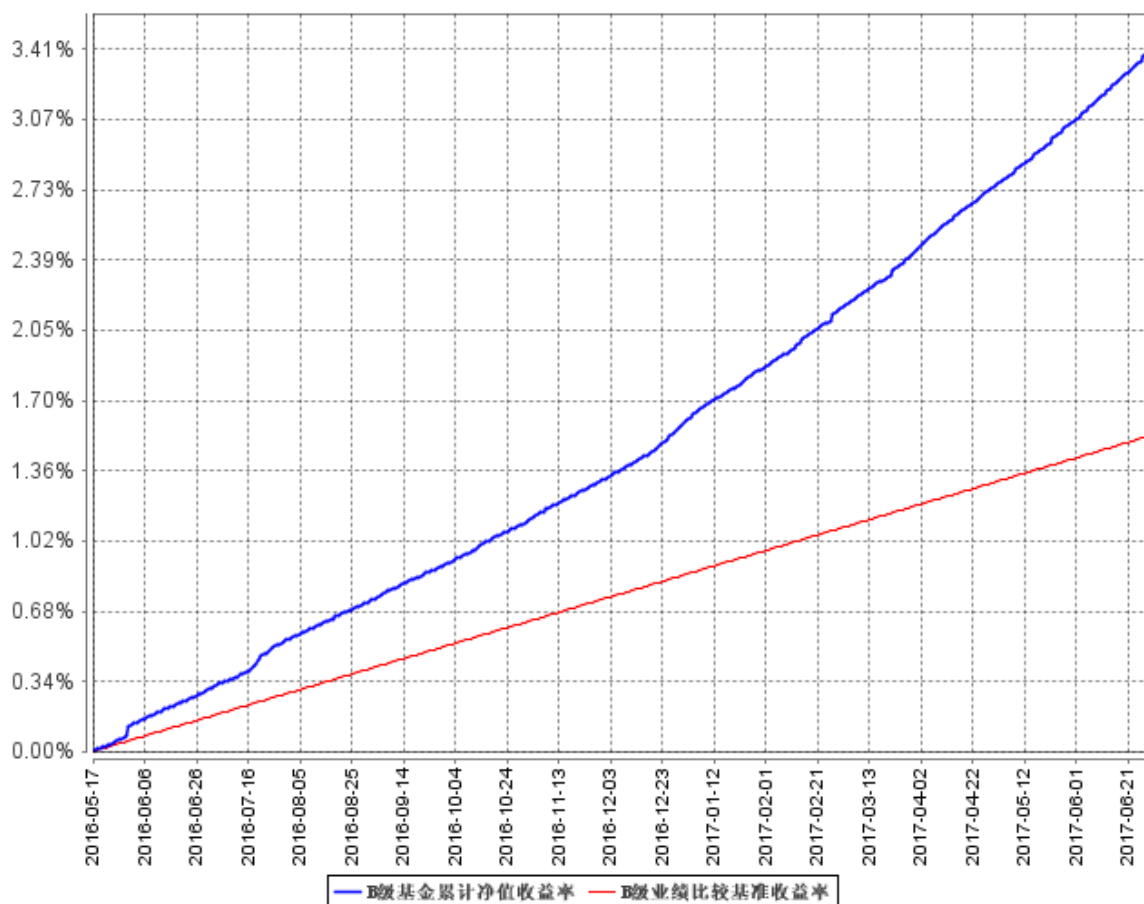
397 天) 的债券、剩余期限在 397 天以内 (含 397 天) 的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内 (含 397 天) 的中期票据, 以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具 (但须符合中国证监会的有关规定)。

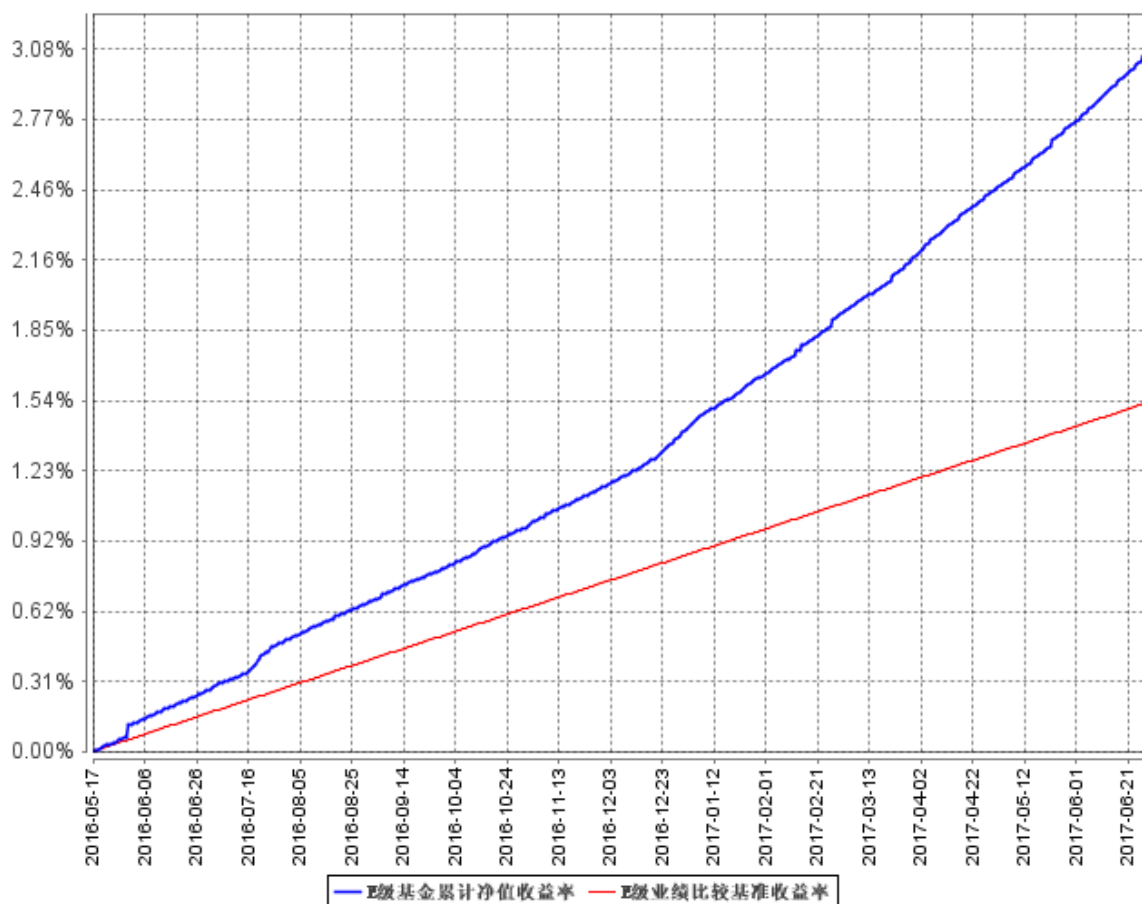
### 3.2.2 自基金合同转型生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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 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：葛航

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.）是山东省国际信托投资有限公司（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 2017 年 6 月底，公司有正式员工 105 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 2017 年 6 月底，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、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合共 20 只开放式基金及 26 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 | 2016 年 10 月 11 日 | -    | 21 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 |

|      |  |           |   |    |   |
|------|--|-----------|---|----|---|
|      | 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 |           |   |    | 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 | 基金经理助理   | 2016年9月6日 | - | 6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。  |

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

2017 年一季度，美联储加息正式落地，国内货币政策也正式步入加息周期，银行 MPA 考核及金融去杠杆监管政策延续去年态势持续收紧，资金利率中枢不断抬升，经济基本面有所企稳。受此影响，一季度债券市场持续调整，收益率曲线平坦化上行。一季度债券市场走势主要分为两阶段，一月份受货币政策转向、公开市场操作利率上调的超预期冲击，10 年期国开债一路上行，短端债券收益率先下后上，波动较为明显。2-3 月债券收益率整体呈现震荡上行趋势，受 CPI 持续低位运行、房地产调控进一步升级的刺激，3 月中旬长端债券收益率出现小幅回落；但受到季末银行 MPA 考核、大行资金融出意愿下降、资金面趋紧影响，短端收益率小幅上行。一季度一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融分别上行 37bp、38bp 和 40bp。2017 年第二季度，金融去杠杆的重心进一步落实到各项监管政策上。二季度债券市场走势分为两个阶段，四月份银监会陆续出台整治“三违反”、“三套利”、“四不当”等监管文件，敦促各银行进行自查，在金融监管趋严背景下，叠加资金面持续紧张，四月下旬市场对大行赎回委外理财的消息反应剧烈，债券收益小幅震荡上行。五月份债市延续调整，收益率较四月末有所上升，受资管整顿资金池产品的影响，债市情绪谨慎，利率曲线走势呈 M 型，债券收益率上行突破前期高点。进入六月份央行通过公开市场操作维持资金面稳定，监管也相对平静，央行未跟随美联储加息的脚步上调国内货币政策工具利率，市场情绪有所缓解，短端高评级债券收益率出现缓慢下行。二季度一年期国开债、AAA 短融和 AA+短融分别上行 31bp、16bp 和 9bp。

天天收益基金在一季度继续维持短久期策略，同业存单配置比例在 30%左右、短融配置比例在 15%左右，且所持存单和短融信用评级较高、流动性好。另外动态择时调整逆回购资产配置比例，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。天天收益基金在二季度继续维持短久期策略，在六月份收益率下行过程中小幅提高久期。所持存单和短融信用评级较高、流动性好。另外动态择时调整逆回购资产配置比例，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 1.6720%, 业绩比较基准收益率为 0.6788%; B 份额净值收益率为 1.7929%, 业绩比较基准收益率为 0.6788%; E 份额净值收益率为 1.6574%, 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, 海外债市可能呈现收益率结构性分化, 对国内债市影响总体偏中性; 需继续关注欧央行态度和美联储缩表及加息的进程、以及上述因素对人民币汇率的压力。同时央行自 5 月以来持续呵护资金面基本稳定的政策意图较为明显, 预计下半年资金面较上半年有所改善, 为短端下行带来空间, 曲线或进一步陡峭化。预计 7 月的经济数据仍继续企稳, 或令市场情绪继续维持谨慎, 长债利率继续小幅震荡; 但在当前监管逐步明朗、海外因素利好人民币汇率的背景下, 债券收益率上行有顶。房地产高频数据仍需继续关注销售和 investment 数据, 二、三季度高频经济数据也显示经济基本面并未如预期般糟糕。下半年通胀风险较小, 未能对货币政策形成掣肘, 货币政策则继续贯彻稳健中性原则不变。监管政策方面, 需警惕四季度或出台相关监管文件细则和由此产生的冲击。总体而言, 本基金下半年在兼顾流动性风险和信用风险的前提下, 继续选取短久期且具有相对投资价值的投资标的。

#### 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:

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、泰信智选成长基金经理。

梁剑先生, 硕士。2004 年 7 月加入泰信基金管理有限公司, 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 1,850,431.75 元；B 类份额收益分配共 22,406,001.62 元；E 类份额收益分配共 58.94 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（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：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|-------------------|---------------------|
| <b>资 产：</b> |                   |                     |
| 银行存款        | 46,545,379.33     | 87,220,186.75       |
| 结算备付金       | -                 | -                   |
| 存出保证金       | -                 | -                   |
| 交易性金融资产     | 664,547,532.11    | 737,926,380.07      |
| 其中：股票投资     | -                 | -                   |
| 基金投资        | -                 | -                   |
| 债券投资        | 664,547,532.11    | 737,926,380.07      |
| 资产支持证券投资    | -                 | -                   |
| 贵金属投资       | -                 | -                   |
| 衍生金融资产      | -                 | -                   |
| 买入返售金融资产    | 486,931,370.40    | 1,229,266,283.91    |

|                 |                   |                    |
|-----------------|-------------------|--------------------|
| 应收证券清算款         | -                 | -                  |
| 应收利息            | 3,602,618.31      | 8,968,626.24       |
| 应收股利            | -                 | -                  |
| 应收申购款           | 20,590,700.00     | -                  |
| 递延所得税资产         | -                 | -                  |
| 其他资产            | -                 | -                  |
| 资产总计            | 1,222,217,600.15  | 2,063,381,476.97   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2017年6月30日</b> | <b>2016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          | -                 | -                  |
| 卖出回购金融资产款       | -                 | -                  |
| 应付证券清算款         | -                 | -                  |
| 应付赎回款           | -                 | 9,852.22           |
| 应付管理人报酬         | 313,287.68        | 404,849.23         |
| 应付托管费           | 94,935.64         | 122,681.59         |
| 应付销售服务费         | 29,391.15         | 32,683.52          |
| 应付交易费用          | 46,478.16         | 31,229.91          |
| 应交税费            | 628,500.00        | 628,500.00         |
| 应付利息            | -                 | -                  |
| 应付利润            | 2,284,797.85      | 2,967,524.32       |
| 递延所得税负债         | -                 | -                  |
| 其他负债            | 177,457.15        | 349,147.78         |
| 负债合计            | 3,574,847.63      | 4,546,468.57       |
| <b>所有者权益:</b>   |                   |                    |
| 实收基金            | 1,218,642,752.52  | 2,058,835,008.40   |
| 未分配利润           | -                 | -                  |
| 所有者权益合计         | 1,218,642,752.52  | 2,058,835,008.40   |
| 负债和所有者权益总计      | 1,222,217,600.15  | 2,063,381,476.97   |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,218,642,752.52 份，其中 A 类基金份额 94,633,605.75 份，B 类基金份额 1,124,005,310.08 份。E 类基金份额 3,836.69 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
|     |                                |                                     |

|                            |               |               |
|----------------------------|---------------|---------------|
| <b>一、收入</b>                | 27,759,975.63 | 27,668,264.26 |
| 1.利息收入                     | 27,077,655.84 | 26,480,651.65 |
| 其中：存款利息收入                  | 2,049,254.21  | 6,917,689.16  |
| 债券利息收入                     | 15,308,039.97 | 13,271,264.34 |
| 资产支持证券利息收入                 | -             | -             |
| 买入返售金融资产收入                 | 9,720,361.66  | 6,291,698.15  |
| 其他利息收入                     | -             | -             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 682,319.79    | 1,187,612.61  |
| 其中：股票投资收益                  | -             | -             |
| 基金投资收益                     | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 682,319.79    | 1,187,612.61  |
| 资产支持证券投资收益                 | -             | -             |
| 贵金属投资收益                    | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | -             | -             |
| 股利收益                       | -             | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”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）          | -             | -             |
| <b>减：二、费用</b>              | 3,581,306.93  | 6,830,307.95  |
| 1. 管理人报酬                   | 2,245,650.74  | 3,379,811.29  |
| 2. 托管费                     | 680,500.16    | 1,024,185.19  |
| 3. 销售服务费                   | 195,328.25    | 2,132,045.17  |
| 4. 交易费用                    | -             | 125.00        |
| 5. 利息支出                    | 255,458.63    | 73,701.01     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 255,458.63    | 73,701.01     |
| 6. 其他费用                    | 204,369.15    | 220,440.29    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 24,178,668.70 | 20,837,956.31 |
| 减：所得税费用                    | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | 24,178,668.70 | 20,837,956.31 |

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                   |
|----|----------------------|
|    | 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<br>(基金净值)                                | 2,058,835,008.40                | -              | 2,058,835,008.40  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期净利润)                  | -                               | 24,178,668.70  | 24,178,668.70     |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号<br>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<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动(净值减少<br>以“-”号填列) | -                               | -24,178,668.70 | -24,178,668.70    |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 1,218,642,752.52                | -              | 1,218,642,752.52  |
|  | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                |                   |
| 项目   | 实收基金                            | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                | 5,209,544,242.80                | -              | 5,209,544,242.80  |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动数(本<br>期净利润)                  | -                               | 20,837,956.31  | 20,837,956.31     |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号<br>填列)      | -2,040,823,161.15               | -              | -2,040,823,161.15 |
| 其中:1.基金申购款   | 4,449,663,718.22                | -              | 4,449,663,718.22  |
| 2.基金赎回款  | -6,490,486,879.37               | -              | -6,490,486,879.37 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的基<br>金净值变动(净值减少<br>以“-”号填列) | -                               | -20,837,956.31 | -20,837,956.31    |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 3,168,721,081.65                | -              | 3,168,721,081.65  |

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：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>葛航</u> | <u>韩波</u> | <u>蔡海成</u> |
| 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(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)。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 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。

## 6.4.5 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。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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

本报告期本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.6.2 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。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

本期末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。

#### 6.4.7.1.2 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。

#### 6.4.7.1.3 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。

#### 6.4.7.1.4 权证交易

本报告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。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金无应支付关联方佣金。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,245,650.74                   | 3,379,811.29                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 261,383.74                     | 239,150.21                          |

注：支付基金管理人泰信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}$ 。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 680,500.16                     | 1,024,185.19                        |

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

### 6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>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<br>A                     | 泰信天天收<br>益 B | 泰信天天<br>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 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016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<br>A                     | 泰信天天收<br>益 B | 泰信天天收<br>益 E | 合计        |

|            |              |           |       |              |
|------------|--------------|-----------|-------|--------------|
| 泰信基金管理有限公司 | 1,643,204.78 | 16,372.94 | 14.29 | 1,659,592.01 |
| 中国银行       | 85,378.72    | 82.72     | -     | 85,461.44    |
| 合计         | 1,728,583.50 | 16,455.66 | 14.29 | 1,745,053.45 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式具体如下：

每日该类基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 年销售服务费年费率 / 当年天数

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日      |        |               |       |      |       |      |
|--|--------|---------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>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 |
| 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |        |               |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>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                                       | -      | 10,185,876.23 | -     | -    | -     | -    |

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                                      | 本期<br>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 |
| 基金合同生效日（<br>2016 年 5 月 17 日）持有的<br>基金份额 | -                                     | -             | -        |
| 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                               | -                                     | -             | -        |
| 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<br>占基金总份额比例                   | -                                     | 3.5700%       | -        |

| 项目                                      | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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 |
| 基金合同生效日（<br>2016 年 5 月 17 日）持有的<br>基金份额 | -  | 6,877,270.21 | -        |
| 期初持有的基金份额                               | -  | 6,877,270.21 | -        |
| 期间申购/买入总份额                              | -  | 16,102.17    | -        |
| 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                               | -  | 6,893,372.38 | -        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例                   | -  | 0.2300%      | -        |

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。

3、基金管理人泰信基金管理有限公司在本期赎回本基金的交易委托光大银行和中国银行办理。

#### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

泰信天天收益 B  
份额单位：份

| 关联方名称                 | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          |
|-----------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 山东省国际信<br>托股份有限公<br>司 | 30,000,000.00          | 2.4600%                  | -                        | -                        |

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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      | 6,545,379.33                          | 20,576.64 | 22,817,872.16                              | 52,330.26 |

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。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期末及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

##### 6.4.8.2 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。

##### 6.4.8.3.1 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。

##### 6.4.8.3.2 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。

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。



## § 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             | 664,547,532.11   | 54.37         |
|    | 其中: 债券             | 664,547,532.11   | 54.37         |
|    | 资产支持证券             | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产           | 486,931,370.40   | 39.84         |
|    | 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       | 46,545,379.33    | 3.81          |
| 4  | 其他各项资产             | 24,193,318.31    | 1.98          |
| 5  | 合计                 | 1,222,217,600.15 | 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 | 1.36           |                |
|    | 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    | 51 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 81 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 34 |

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                 | 42.95               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 25.37               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 12.19               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 6.49                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 11.30               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 98.31               | -                   |

### 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      | 69,903,745.70 | 5.74          |
|    | 其中：政策性金融债 | 69,903,745.70 | 5.74          |
| 4  | 企业债券      | -             | -             |

|    |                      |                |       |
|----|----------------------|----------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券              | 89,991,511.94  | 7.38  |
| 6  | 中期票据                 | -              | -     |
| 7  | 同业存单                 | 504,652,274.47 | 41.41 |
| 8  | 其他                   | -              | -     |
| 9  | 合计                   | 664,547,532.11 | 54.53 |
| 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名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张) | 摊余成本          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 111710239 | 17 兴业银行 CD239 | 500,000 | 49,752,864.28 | 4.08         |
| 2  | 111791884 | 17 杭州银行 CD047 | 500,000 | 49,730,813.78 | 4.08         |
| 3  | 111709217 | 17 浦发银行 CD217 | 500,000 | 49,557,043.39 | 4.07         |
| 4  | 111799292 | 17 宁波银行 CD101 | 500,000 | 49,532,786.03 | 4.06         |
| 5  | 111711245 | 17 平安银行 CD245 | 500,000 | 49,490,722.89 | 4.06         |
| 6  | 111710185 | 17 兴业银行 CD185 | 500,000 | 49,402,519.08 | 4.05         |
| 7  | 111709259 | 17 浦发银行 CD259 | 500,000 | 48,915,985.18 | 4.01         |
| 8  | 111711255 | 17 平安银行 CD255 | 500,000 | 48,912,708.26 | 4.01         |
| 9  | 041772002 | 17 常城建 CP001  | 400,000 | 39,996,409.34 | 3.28         |
| 10 | 170203    | 17 国开 03      | 400,000 | 39,921,513.47 | 3.28         |

## 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                   | 0.0411%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0732% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0199%  |

### 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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 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    | 3,602,618.31  |
| 4  | 应收申购款   | 20,590,700.00 |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 24,193,318.31 |

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 | 5,007    | 18,900.26     | 9,881,024.95     | 10.44% | 84,752,580.80  | 89.56%  |
| 泰信天天收益 B | 32       | 35,125,165.94 | 1,081,532,155.84 | 96.22% | 42,473,154.24  | 3.78%   |
| 泰信天天收益 E | 29       | 132.30        | -                | -      | 3,836.69       | 100.00% |
| 合计       | 5,068    | 240,458.32    | 1,091,413,180.79 | 89.56% | 127,229,571.73 | 10.44%  |

### 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 | 41,173.90 | 0.0435%  |
|                  | 泰信天天收益 B | -         | -        |
|                  | 泰信天天收益 E | 3,581.17  | 93.3401% |
|                  | 合计       | 44,755.07 | 0.0037%  |

### 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                   | 125,746,750.82 | 1,933,085,386.07 | 2,871.51 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 161,713,223.76 | 2,188,349,888.64 | 2,069.45 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 192,826,368.83 | 2,997,429,964.63 | 1,104.27 |
| 本报告期基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列）   | -              | -                | -        |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 94,633,605.75  | 1,124,005,310.08 | 3,836.69 |

## § 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

2017 年 1 月 23 日起，公司董事总经理葛航先生代理公司董事长职务，王小林先生不再担任公司董事长职务，上述高管变动按照相关规定报监管机构备案并公告。

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

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，截至报告期末诉讼处于审理阶段，法院未作出判决。

本报告期无涉及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 |    |
| 华安证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华金证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券 | 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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

|      |   |   |   | 的比例 |   |   |
|------|---|---|---|-----|---|---|
| 华安证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | -   | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | -   | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | -   | - | - |

## 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。

## § 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              | 20170101-20170630      | 432,327,702.38 | 7,623,357.68 | 0.00 | 439,951,060.06 | 36.10% |
| 个人   | -              | -                      | -              | -            | -    | -              | -      |
| -  | -              | -                      | -              | -            | -    | -              | -      |
| 产品特有风险   |                |                        |                |              |      |                |        |
| <p>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</p> |                |                        |                |              |      |                |        |



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 2017 年 4 月 5 日申请赎回泰信天天收益货币 11,589,195.47 份。

本基金基金管理人于 2017 年 6 月 14 日申请赎回泰信天天收益货币 14,508,885.50 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 2017 年 6 月 29 日申请申购泰信天天收益货币 30,000,000.00 份。

泰信基金管理有限公司  
2017 年 8 月 26 日