泰信天天收益货币市场基金
2022年中期报告

2022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：2022年8月26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。本中期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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15

6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 21

§7 投资组合报告 40

7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 债券回购融资情况 40
7.3 基金投资组合平均剩余期限 41
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 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 42

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 42
7.8 期末按实际利率计算的账面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 42
7.9 投资组合报告附注 43

§8 基金份额持有人信息 43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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情况 44

§9 开放式基金份额变动 45

§10 重大事件揭示 45

10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
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 46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 47
10.9 其他重大事件 47

§11 影响投资者决策的其他重要信息 48

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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48

§12 备查文件目录 49

12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§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	2004 年 2 月 10 日		
基金管理人	泰信基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	29,832,564,865.01 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	88,662,794.08 份	29,743,893,959.07 份	8,111.86 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	罗丽娟	许俊
	联系电话	021-20899098	95566
	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 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		李高峰	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ftfund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)		
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E
本期已实现收益	660,645.79	358,609,513.67	38.06
本期利润	660,645.79	358,609,513.67	38.06
本期净值收益率	1.0577%	1.1778%	1.0604%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	88,662,794.08	29,743,893,959.07	8,111.86
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
累计净值收益率	16.4847%	18.2051%	16.3952%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用（例如基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金收益分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泰信天天收益 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1591%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	0.0466%	0.0002%
过去三个月	0.5132%	0.0006%	0.3412%	0.0000%	0.1720%	0.0006%
过去六个月	1.0577%	0.0006%	0.6787%	0.0000%	0.3790%	0.0006%
过去一年	2.1971%	0.0005%	1.3687%	0.0000%	0.8284%	0.0005%
过去三年	6.2546%	0.0018%	4.1100%	0.0000%	2.1446%	0.0018%
自基金合同生效起至今	16.4847%	0.0031%	8.3850%	0.0000%	8.0997%	0.0031%

泰信天天收益 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1787%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	0.0662%	0.0002%
过去三个月	0.5729%	0.0006%	0.3412%	0.0000%	0.2317%	0.0006%
过去六个月	1.1778%	0.0006%	0.6787%	0.0000%	0.4991%	0.0006%
过去一年	2.4422%	0.0005%	1.3687%	0.0000%	1.0735%	0.0005%

过去三年	7.0213%	0.0018%	4.1100%	0.0000%	2.9113%	0.0018%
自基金合同生效起至今	18.2051%	0.0031%	8.3850%	0.0000%	9.8201%	0.0031%

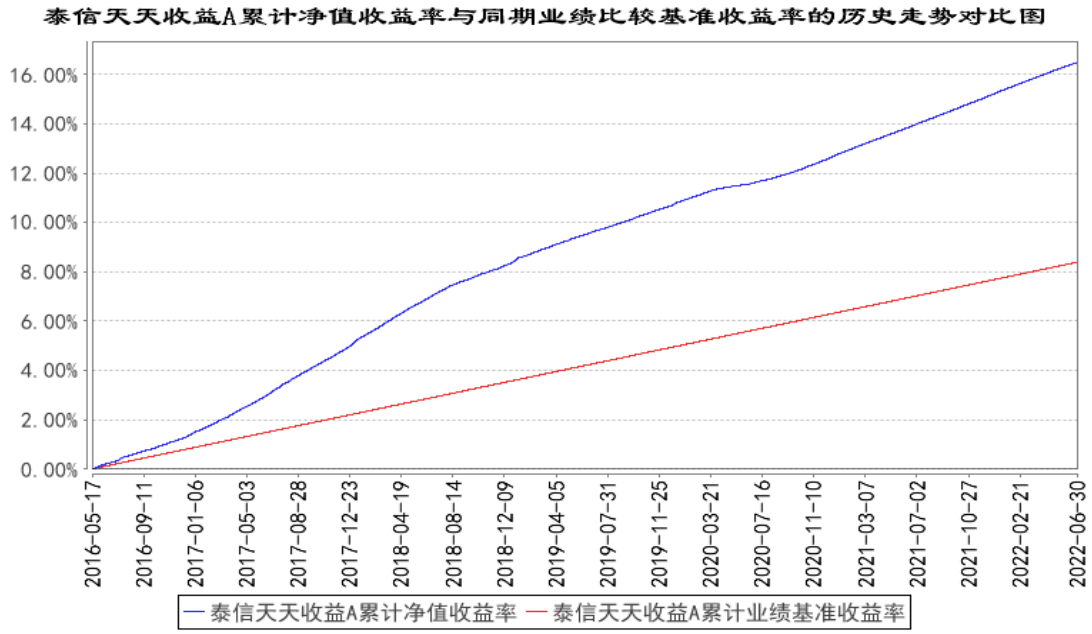
泰信天天收益 E

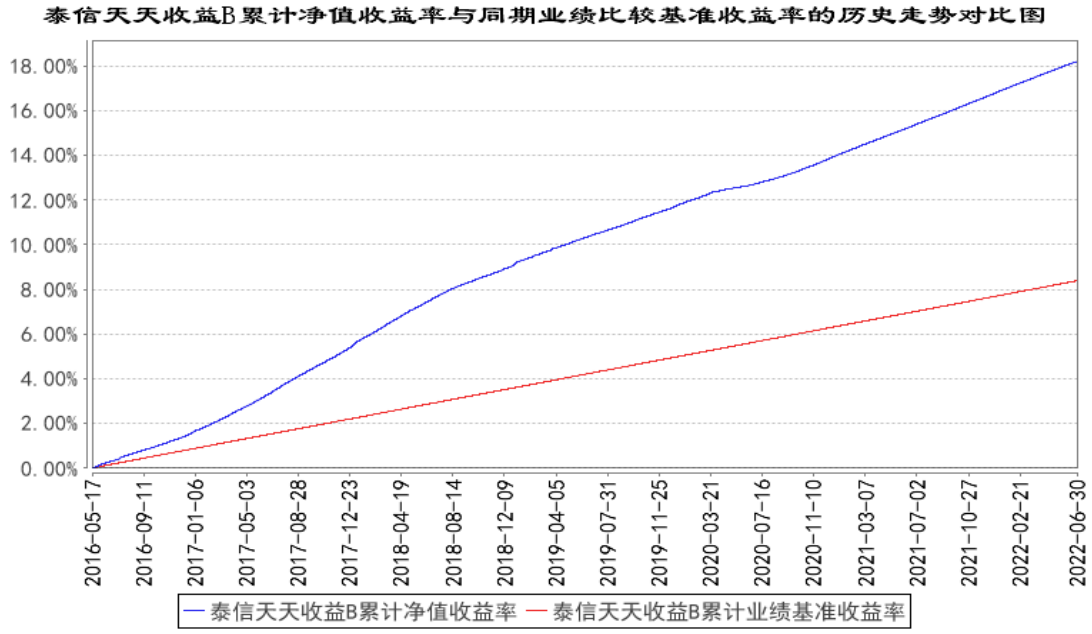
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1583%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	0.0458%	0.0002%
过去三个月	0.5149%	0.0006%	0.3412%	0.0000%	0.1737%	0.0006%
过去六个月	1.0604%	0.0006%	0.6787%	0.0000%	0.3817%	0.0006%
过去一年	2.1975%	0.0005%	1.3687%	0.0000%	0.8288%	0.0005%
过去三年	6.2490%	0.0018%	4.1100%	0.0000%	2.1390%	0.0018%
自基金合同生效起至今	16.3952%	0.0031%	8.3850%	0.0000%	8.0102%	0.0031%

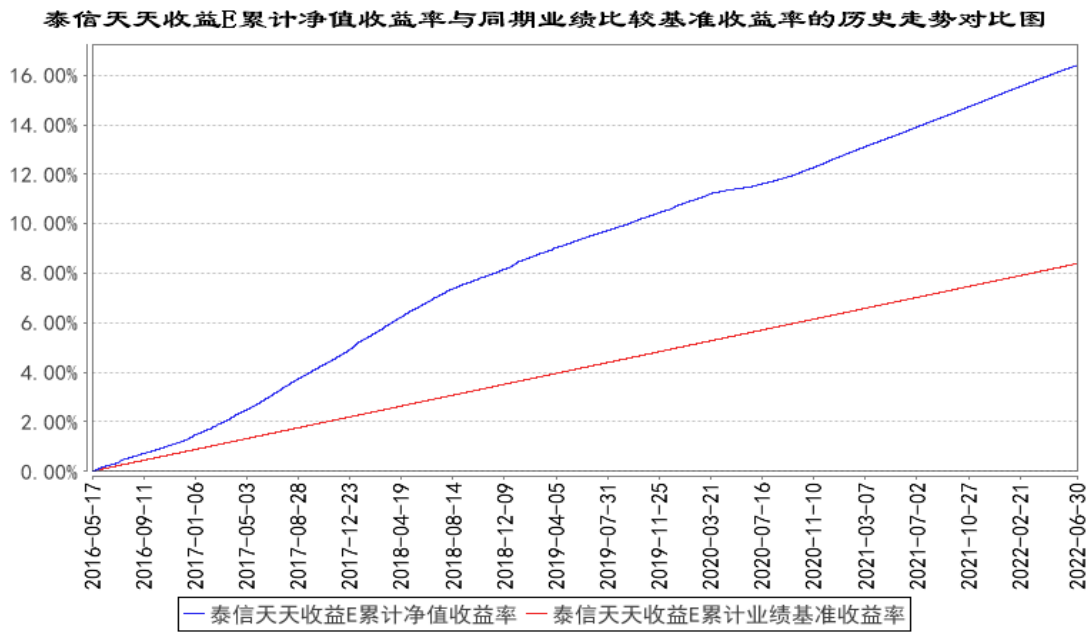
注： 1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于 2004 年 2 月 10 日正式生效，于 2016 年 5 月 17 日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加 B 类、E 类份额。

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份额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







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；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

§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 36-37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：高宇

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 日经中国证券监督委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、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 2022 年 6 月末，公司有正式员工 104 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 2022 年 6 月 30 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信基本面 400、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、泰信竞争优选混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信汇享利率债债券、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式 、泰信汇盈债券共 30 只开放式基金及 39 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		
李俊江	泰信天天收益货币市场基金基金经理、泰信鑫益定期开放债券型证券投资基金基	2020 年 6 月 29 日	-	8 年	李俊江先生，中央财经大学投资学专业硕士，历任中债资信评估有限责任公司研究员，华创证券有限责任公司研究所研究员、资产管理部投资经理、投顾业务管理部（筹）研究员，江海证券有限公司资产管理投资部投资经理。2020 年 5 月加入泰信基金管理有限公司，曾任拟任基金经理，2020 年 6 月至今任泰信天天收益货币市场基金基金经理，2021 年 6 月至今任泰信鑫

	金经理、泰信汇利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理				益定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今任泰信汇利三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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

上半年债市围绕宽货币和宽信用进行多次博弈，其中疫情反复、俄乌冲突、美联储加息等构成一定扰动，整体看长端利率延续震荡走势，信用债结构性资产荒。

具体而言，在降息和经济悲观预期推动下，春节前债券利率快速下行。春节后，债市干扰因素增多，基金和理财产品被赎回产生一定流动性冲击，经济和金融数据走强，各地地产政策不断放松，带动 2-3 月债市调整。一季度末上海等地疫情反复，降准、央行利润上缴、实体融资需求不佳等使得二季度整体资金面超预期宽松。另一方面，疫情防控进展变化、宽信用政策发力、中美利差倒挂等作用下，二季度长端利率处于震荡行情之中，收益率曲线走陡。

天天收益基金在上半年保持中性配置与久期策略，组合主要投资高评级、流动性好的同业存单标的，力图在规避流动性风险和信用风险的前提下为投资者取得合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰信天天收益 A 的基金份额净值收益率为 1.0577%，本报告期泰信天天收益 B 的基金份额净值收益率为 1.1778%，本报告期泰信天天收益 E 的基金份额净值收益率为 1.0604%，同期业绩比较基准收益率为 0.6787%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内疫情缓解，财政发力预期加大，预计经济底部逐步企稳。美联储继续加息，国内通胀中枢有所上行，制约国内降息可能性。整体来看，预计下半年国内资金面将会逐步收敛，但结构性资产荒格局延续，短端品种利率反弹幅度可能相对有限，长债利率底部已经被证实。

总体而言，天天收益下半年继续维持中性配置策略，组合继续选取配置高评级、流动性好的标的，在保证流动性的前提下取得合理收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，保证基金估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本公司建立估值委员会，负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后，将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，由管理人按约定对外公布；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时，应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机

构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

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 660,645.79 元;B 类份额收益分配共 358,609,513.67 元；E 类份额收益分配共 38.06 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§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 托管人对本中期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”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,255,934,590.27	6,033,826,774.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,691,996,296.35	13,736,242,589.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		21,691,996,296.35	13,693,797,446.19
资产支持证券投资		-	42,445,143.14
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,003,241,640.94	2,614,436,350.08
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,548,784.01	549,337,903.56
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	91,287,290.75
资产总计		29,978,721,311.57	23,025,130,908.70
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022年6月30日**	**上年度末 2021年12月31日**
负 债：			
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		100,010,958.90	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,674.87	-
应付管理人报酬		5,976,483.34	4,387,812.26
应付托管费		1,299,235.52	953,872.21
应付销售服务费		276,795.15	203,266.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		930,013.65	796,700.92
应付利润		37,330,386.91	27,538,165.77
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	329,898.22	355,460.00
负债合计		146,156,446.56	34,235,278.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,832,564,865.01	22,990,895,630.60
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		29,832,564,865.01	22,990,895,630.60
负债和净资产总计		29,978,721,311.57	23,025,130,908.70

注： 1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额29,832,564,865.01份，其中泰信天天收益货币A基金份额净值人民币1.0000元，份额总额88,662,794.08份；泰信天天收益货币B基金份额净值人民币1.0000元，份额总额29,743,893,959.07份；泰信天天收益货币E基金份额净值人民币1.0000元，份额总额8,111.86份。

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		407,166,182.38	123,908,026.04
1.利息收入		173,919,884.82	123,480,809.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	109,160,955.25	28,367,333.73
债券利息收入		-	76,588,144.55
资产支持证券利息收入		-	2,607,079.19
买入返售金融资产收入		64,758,929.57	15,918,252.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		233,246,297.56	427,216.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	232,452,269.70	427,216.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	794,027.86	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、营业总支出		47,895,984.86	23,854,211.98
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	35,002,471.61	12,278,854.93
2．托管费	6.4.10.2.2	7,609,233.04	3,493,491.00
3．销售服务费	6.4.10.2.3	1,596,966.54	496,153.44
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		3,347,784.51	7,397,492.90
其中：卖出回购金融资产支出		3,347,784.51	7,397,492.90
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		163,754.76	21,485.44
8．其他费用	6.4.7.18	175,774.40	166,734.27

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		359,270,197.52	100,053,814.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		359,270,197.52	100,053,814.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		359,270,197.52	100,053,814.06

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	22,990,895,630.60	-	-	22,990,895,630.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	22,990,895,630.60	-	-	22,990,895,630.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,841,669,234.41	-	-	6,841,669,234.41
（一）、综合收益总额	-	-	359,270,197.52	359,270,197.52

（二）、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）	6,841,669,234.41	-	-	6,841,669,234.41
其中：1.基金申购款	52,538,277,764.82	-	-	52,538,277,764.82
2.基金赎回款	-45,696,608,530.41	-	-	-45,696,608,530.41
（三）、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）	-	-	-359,270,197.52	-359,270,197.52
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	29,832,564,865.01	-	-	29,832,564,865.01
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,468,482,152.93	-	-	8,468,482,152.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产（基金净值）	8,468,482,152.93	-	-	8,468,482,152.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,003,586,783.46	-	-	7,003,586,783.46
（一）、综合收益总额	-	-	100,053,814.06	100,053,814.06
（二）、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）	7,003,586,783.46	-	-	7,003,586,783.46
其中：1.基金申购款	27,398,830,607.77	-	-	27,398,830,607.77
2.基金赎回款	-20,395,243,824.31	-	-	-20,395,243,824.31
（三）、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）	-	-	-100,053,814.06	-100,053,814.06
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	15,472,068,936.39	-	-	15,472,068,936.39

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：

高宇	叶振宇	叶振宇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信天天收益货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]147 号《关于同意泰信天天收益开放式证券投资基金设立的批复》核准，由泰信基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《泰信天天收益开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于 2004 年 2 月 10 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,020,966,560.32 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第 004 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2016 年 5 月 11 日《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，依据基金份额持有人大会决议，自 2016 年 5 月 17 日起，本基金更名为泰信天天收益货币市场基金，并将基金份额分为 A 类、B 类和 E 类。三类基金份额根据基金份额费率结构、申购赎回各类基金份额的最低金额限制及在销售机构保留的各类基金份额的最低份额限制不同而区分，各份额类别基金资产合并运作，单独计算并公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。本基金 E 类基金份额目前仅限通过直销渠道及公司指定的电子交易平台进行申购、赎回和转换等业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内含 397 天的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。根据基金管理人 2017 年 9 月 4 日发布的《关于泰信天天收益货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告》及修改后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围修改为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在 1

年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的原业绩比较基准为半年期银行定期存款税后利率；自 2016 年 5 月 17 日起，本基金业绩比较基准变更为七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，金额分别为人民币 6,033,826,774.98 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 2,614,436,350.08 元、人民币 48,481,432.80 元。新金融工具准则下以摊余成

本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息的金额分别为人民币 6,081,856,560.80 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 2,614,887,997.06 元、人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 13,736,242,589.33 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 42,805,857.95 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 13,779,048,447.28 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(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，暂不计缴企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	16,878,720.37
等于：本金	16,877,856.08
加：应计利息	864.29
减：坏账准备	-
定期存款	6,239,055,869.90
等于：本金	6,167,000,000.00
加：应计利息	72,055,869.90
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	511,007,999.95
存款期限 3 个月以上	5,728,047,869.95
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,255,934,590.27

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	20,284,962.19	20,336,962.19	52,000.00	0.0002
	银行间市场	21,671,711,334.16	21,694,466,535.57	22,755,201.41	0.0763
	合计	21,691,996,296.35	21,714,803,497.76	22,807,201.41	0.0765
资产支持证券		-	-	-	-
合计		21,691,996,296.35	21,714,803,497.76	22,807,201.41	0.0765

注：1、偏离金额＝影子定价－摊余成本；

2、偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,003,241,640.94	-
合计	2,003,241,640.94	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	217,029.21
其中：交易所市场	-
银行间市场	217,029.21
应付利息	-
预提费用	112,828.88
合计	329,898.22

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信天天收益 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,766,552.28	86,766,552.28
本期申购	158,042,244.31	158,042,244.31
本期赎回（以“-”号填列）	-156,146,002.51	-156,146,002.51
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	88,662,794.08	88,662,794.08

泰信天天收益 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,904,126,108.70	22,904,126,108.70
本期申购	52,380,230,378.27	52,380,230,378.27
本期赎回（以“-”号填列）	-45,540,462,527.90	-45,540,462,527.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,743,893,959.07	29,743,893,959.07

泰信天天收益 E

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,969.62	2,969.62
本期申购	5,142.24	5,142.24
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,111.86	8,111.86

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

6.4.7.8 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
本期期初	-	-	-
本期利润	660,645.79	-	660,645.79
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	-660,645.79	-	-660,645.79
本期末	-	-	-

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
本期期初	-	-	-
本期利润	358,609,513.67	-	358,609,513.67
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	-358,609,513.67	-	-358,609,513.67
本期末	-	-	-

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
本期期初	-	-	-
本期利润	38.06	-	38.06
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	-38.06	-	-38.06
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,914.47
定期存款利息收入	109,132,040.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	109,160,955.25

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	229,880,882.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,571,386.83
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	232,452,269.70

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,117,017,826.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,046,923,678.62
减：应计利息总额	67,522,761.10
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,571,386.83

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	794,027.86
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	794,027.86

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	44,605,780.69
减：卖出资产支持证券成本总额	42,392,000.00
减：应计利息总额	2,213,780.69
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	42,547.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	54,560.01
账户维护费	17,853.84
其他	1,305.51
合计	175,774.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期本基金控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰信基金管理有限公司(“泰信基金管理有限公司”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
山东省鲁信投资控股集团有限公司	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	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,002,471.61	12,278,854.93
其中：支付销售机构的客户维护费	2,905,075.21	574,337.58

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 0.23%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×0.23%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,609,233.04	3,493,491.00

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 0.05%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×0.05%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E	合计

泰信金管理有限公司	1,895.80	1,076,995.79	3.85	1,078,895.44
中国银行	21,783.78	20.18	-	21,803.96
合计	23,679.58	1,077,015.97	3.85	1,100,699.40

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益 A	泰信天天收益 B	泰信天天收益 E	合计
泰信基金管理有限公司	13,538.33	336,635.33	3.62	350,177.28
中国银行	23,197.09	170.99	-	23,368.08
合计	36,735.42	336,806.32	3.62	373,545.36

注：根据《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，自 2016 年 5 月 17 日起，泰信天天收益开放式证券投资基金更名为泰信天天收益货币市场基金，且分为 A 类、B 类和 E 类，其中 A 类和 E 类销售服务费率为 0.25%，B 类销售服务费费率为 0.01%，调整后，各类别的销售服务费按前一日基金资产净值的适用年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：A 类和 E 类日基金销售服务费＝前一日各类别基金资产净值 X 0.25%÷当年天数；B 类日基金销售服务费＝前一日 B 类基金资产净值 X 0.01%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
报告期初持有的基金份额	71,452.70	-	-
报告期间申购/买入总份额	777.78	13,028,603.08	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	72,230.48	-	-

报告期末持有的基金份额	0.00	13,028,603.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.04%	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

泰信天天收益 B

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021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（%）
上海锐懿资产管理有限公司	29,572,355.85	0.10	38,947,079.03	0.17

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	16,878,720.37	28,914.47	7,629,268.18	22,901.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

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
1,074,582.53	211,311.31	-625,248.05	660,645.79	-
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
317,421,551.81	30,770,497.49	10,417,464.37	358,609,513.67	-
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
33.24	-	4.82	38.06	-

注：1.本基金在本年度累计分配收益 359,270,197.52 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 318,496,167.58 元，计入应付收益 9,792,221.14 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 6.4.8.2。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额

2203674	22 进出 674	2022 年 7 月 1 日	99.82	1,200,000	119,786,348.42
合计				1,200,000	119,786,348.42

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要为债券投资、银行存款与买入返售金融资产。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、债券投资及其他金融资产。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中国银行，定期存款分别存放于信用良好的股份制商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并由交易对手向中央国债登记结算公司提交充足的债券进行质押，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级情况参见附注 6.4.13.2.1 至附注 6.4.13.2.6，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,463,905,535.49	2,270,009,896.80
合计	4,463,905,535.49	2,270,009,896.80

注：此处信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	2,392,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	2,392,000.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,345,483,638.44	10,163,097,812.94
合计	15,345,483,638.44	10,163,097,812.94

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	20,000,000.00	20,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	20,000,000.00	20,000,000.00

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	40,053,143.14
AAA 以下	-	-
未评级	-	-

合计	-	40,053,143.14

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的其他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。

日常流动性风险管理中，本基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行 票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 44.18%，本基金投资组合的平均剩余期限为 83 天，平均剩余存续期为 83 天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为 10.84%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

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

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

6.4.13.4 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，包括利率风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资和买入返售金融资产；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。基于本基金产品性质，生息资产占基金资产的比重较大，但资产期限配置比较短，因此本基金利率风险适中。本基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线、久期管理及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	5,323,115,420.24	932,819,170.03	-	-	6,255,934,590.27
交易性金融资产	20,734,867,552.58	957,128,743.77	-	-	21,691,996,296.35
买入返售金融资产	2,003,241,640.94	-	-	-	2,003,241,640.94
应收申购款	-	-	-	27,548,784.01	27,548,784.01
资产总计	28,061,224,613.76	1,889,947,913.80	-	27,548,784.01	29,978,721,311.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,674.87	2,674.87
应付管理人报酬	-	-	-	5,976,483.34	5,976,483.34
应付托管费	-	-	-	1,299,235.52	1,299,235.52
卖出回购金融资产款	100,010,958.90	-	-	-	100,010,958.90
应付销售服务费	-	-	-	276,795.15	276,795.15
应付利润	-	-	-	37,330,386.91	37,330,386.91
应交税费	-	-	-	930,013.65	930,013.65
其他负债	-	-	-	329,898.22	329,898.22

负债总计	100,010,958.90	-	-	46,145,487.66	146,156,446.56
利率敏感度缺口	27,961,213,654.86	1,889,947,913.80	-	-18,596,703.65	29,832,564,865.01
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	6,033,826,774.98	-	-	-	6,033,826,774.98
交易性金融资产	13,056,280,346.22	679,962,243.11	-	-	13,736,242,589.33
买入返售金融资产	2,614,436,350.08	-	-	-	2,614,436,350.08
应收利息	-	-	-	91,287,290.75	91,287,290.75
应收申购款	-	-	-	549,337,903.56	549,337,903.56
资产总计	21,704,543,471.28	679,962,243.11	-	640,625,194.31	23,025,130,908.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,387,812.26	4,387,812.26
应付托管费	-	-	-	953,872.21	953,872.21
应付销售服务费	-	-	-	203,266.94	203,266.94
应付交易费用	-	-	-	140,660.00	140,660.00
应交税费	-	-	-	796,700.92	796,700.92
应付利润	-	-	-	27,538,165.77	27,538,165.77
其他负债	-	-	-	214,800.00	214,800.00
负债总计	-	-	-	34,235,278.10	34,235,278.10
利率敏感度缺口	21,704,543,471.28	679,962,243.11	-	606,389,916.21	22,990,895,630.60

注：上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按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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 （2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率上升 25 个基点	-12,434,774.19	-7,884,377.75
	2.市场利率下降 25 个基点	12,456,791.56	7,897,907.88

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资组合相关。对本基金而言，其他价格风险表现在当投资组合的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动导致与其摊余成本发生重大差异时对损益的影响。本基金管理人通过对加强投资组合管理、优化品

种配置、每日跟踪偏离程度等方法对其他价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无股票投资、权证投资等权益性投资。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

截至本报告期末，本基金未持有股票投资、权证投资等权益性投资，若除市场利率和外汇汇率外的其他市场因素变化导致本基金所持有的权益性投资的市场价格上升或下降 5%且其他市场变量保持不变，对于本基金的基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	21,691,996,296.35	13,736,242,589.33
第三层次	-	-
合计	21,691,996,296.35	13,736,242,589.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	21,691,996,296.35	72.36
	其中：债券	21,691,996,296.35	72.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,003,241,640.94	6.68
	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	6,255,934,590.27	20.87
4	其他各项资产	27,548,784.01	0.09
5	合计	29,978,721,311.57	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	1.45	
	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	100,010,958.90	0.34
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

注：本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	23.11	0.34
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	26.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.00	0.34

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	803,727,276.81	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,058,594,883.42	3.55
	其中：政策性金融债	1,058,594,883.42	3.55
4	企业债券	20,284,962.19	0.07
5	企业短期融资券	4,463,905,535.49	14.96
6	中期票据	-	-

7	同业存单	15,345,483,638.44	51.44
8	其他	-	-
9	合计	21,691,996,296.35	72.71
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值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）	按实际利率计算的账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112219075	22 恒丰银行 CD075	5,000,000	497,610,745.87	1.67
2	112217065	22 光大银行 CD065	4,000,000	399,673,549.58	1.34
3	2203674	22 进出 674	4,000,000	399,287,828.06	1.34
4	112121496	21 渤海银行 CD496	3,000,000	299,937,275.56	1.01
5	229914	22 贴现国债 14	3,000,000	299,842,706.75	1.01
6	229918	22 贴现国债 18	3,000,000	299,455,331.75	1.00
7	112281100	22 台州银行 CD015	3,000,000	298,772,691.23	1.00
8	112291071	22 浙江泰隆商行 CD011	3,000,000	298,106,975.04	1.00
9	112115338	21 民生银行 CD338	3,000,000	297,663,931.62	1.00
10	112209118	22 浦发银行 CD118	3,000,000	293,323,151.66	0.98

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1081%
报告期内偏离度的最低值	0.0315%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0635%

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 期末按实际利率计算的账面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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

（1）本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

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

（3）本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	27,548,784.01
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	27,548,784.01

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	4,200	21,110.19	21,919,851.98	24.72	66,742,942.10	75.28

收益 A						
泰信天天收益 B	178	167,100,527.86	29,674,552,198.03	99.77	69,341,761.04	0.23
泰信天天收益 E	30	270.40	10.00	0.12	8,101.86	99.88
合计	4,408	6,767,823.25	29,696,472,060.01	99.54	136,092,805.00	0.46

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	保险类机构	2,036,069,059.36	6.82
2	银行类机构	2,022,422,660.99	6.78
3	银行类机构	2,003,744,644.76	6.72
4	银行类机构	1,304,900,408.46	4.37
5	银行类机构	1,010,590,424.43	3.39
6	银行类机构	1,010,493,485.99	3.39
7	保险类机构	1,000,000,000.00	3.35
8	银行类机构	978,932,270.64	3.28
9	券商类机构	906,983,501.67	3.04
10	银行类机构	906,623,700.80	3.04

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	6,699.91	0.0076
	泰信天天收益 B	0.00	0.0000
	泰信天天收益 E	484.15	5.9684
	合计	7,184.06	0.0000

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

项目	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（2004 年 2 月 10 日）基金份额总额	6,023,310,189.68	-	-
本报告期期初基金份额总额	86,766,552.28	22,904,126,108.70	2,969.62
本报告期基金总申购份额	158,042,244.31	52,380,230,378.27	5,142.24
减：本报告期基金总赎回份额	156,146,002.51	45,540,462,527.90	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	88,662,794.08	29,743,893,959.07	8,111.86

§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

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,自 2022 年 4 月 26 日起，总经理高宇先生代任公司董事长职务，万众先生不再任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 4 月 28 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2022 年 6 月 30 日起，李高峰先生担任公司董事长职务，总经理高宇先生不再代任公司董事长职务。具体详情参见 2022 年 7 月 1 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所，仍为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

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(%)	
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 7 日
2	关于旗下部分基金新增奕丰基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 11 日
3	关于旗下部分基金在上海华夏财富投资管理有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 17 日
4	泰信天天收益货币市场基金 2022 年“春节”前暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 24 日
5	2021 年第 4 季度报告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 24 日
6	关于旗下部分基金新增海银基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 1 月 26 日
7	关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 2 月 10 日
8	泰信天天收益货币市场基金基金暂停大额申购、转换转入业务公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 2 月 16 日
9	泰信天天收益货币市场基金调整限制大额申购、转换转入业务公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 2 日
10	泰信天天收益货币市场基金更新招募说明书（2022 年 1 号）、产品资料概要更新	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 11 日
11	关于泰信天天收益货币市场基金在非直销销售机构调整大额申购、转换转入业务金额限制的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 14 日

12	关于旗下部分开放式基金新增青岛意才基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 25 日
13	关于泰信天天收益货币市场基金恢复非直销销售机构大额申购、转换转入业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 28 日
14	2021 年年度报告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 29 日
15	泰信天天收益货币市场基金 2022 年“清明节”前暂停申购、定期定额投资及转换转入业务公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 3 月 30 日
16	关于泰信天天收益货币市场基金限制非直销销售机构大额申购、转换转入业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 4 月 8 日
17	2022 年第 1 季度报告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 4 月 21 日
18	关于基金行业高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 4 月 28 日
19	关于旗下部分开放式基金新增销售机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 5 月 16 日
20	关于旗下部分基金在南京银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 5 月 26 日
21	关于调整旗下部分基金在申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司申购、定期定额投资、赎回、转换业务起点金额（份额）并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 6 月 10 日
22	关于旗下部分开放式基金参加和讯科技费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 6 月 21 日
23	关于调整旗下部分基金在华宝证券股份有限公司申购起点的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 6 月 21 日
24	关于旗下部分开放式基金新增诺亚正行为销售机构并开通转换及定期定额投资业务、调整申购赎回业务起点金额（份额）并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、规定网站	2022 年 6 月 22 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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 2022 年 6 月 27 日申请基金转换入泰信天天收益货币 12,956,372.60 份。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准原泰信天天收益开放式证券投资基金设立的文件

2、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》

3、《泰信天天收益货币市场基金招募说明书》

4、《泰信天天收益货币市场托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、报告期内本基金在规定媒介对外披露的各项公告

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件或复印件。

12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2022 年 8 月 26 日