

泰信天天收益开放式证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009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:2009年8月25日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
 基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事同意,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2009年8月20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预示其未来表现,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。本报告中财务资料未经审计。
 本报告自2009年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

| | |
|------------|--|
| 基金名称 | 泰信天天收益货币 |
| 交易代码 | 290001 |
| 基金运作方式 | 契约开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年2月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,423,452,594.08 |
| 2.2 投资产品说明 | |
| 投资目标 | 确保本金和资产的充分流动性,追求超越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流动性 |
| 业绩比较基准 | 半年期银行定期存款利率和(1-利息税率)×半年期银行定期存款利率 |
| 风险收益特征 | 属于低风险、预期收益率较低、流动性较强的证券投资基金品种 |

2.3 基金管理人及基金托管人

| 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 |
| 办公地址 | 青岛 | 北京 |
| 信息披露负责人 | 姓名: 吴胜彪 联系电话: 021-50372168 电子信箱: xsp@tfund.com | 姓名: 孙颖 联系电话: 010-66594977 电子信箱: tgsxp@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | 400-888-5988 | 95566 |
| 传真 | 021-50372197 | 010-66594942 |

2.5 信息披露方式

| | |
|-----------------------|------------------------|
| 载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址 | http://www.tfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

| 项目 | 单位:人民币元 |
|---------------|----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 19,185,255.24 |
| 本期利润 | 19,185,255.24 |
| 本期净值收益率 | 0.7672% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) |
| 期末基金资产净值 | 2,423,452,594.08 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计指标指标 | 本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日) |
| 累计净值收益率 | 14.1722% |

注:1、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,由于证券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。
 2、上述基金的业绩指标不包括持有人申购或交易的各项费用,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。
 3、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 | | | | | |
|----------------------------------|----------|------------|------------|---------|----------|
| 阶段 | 份额净值收益率① | 业绩比较基准收益率② | 业绩比较基准收益率③ | ①-③ | ②-④ |
| 过去一个月 | 0.1340% | 0.0075% | 0.1627% | 0.0000% | -0.0287% |
| 过去三个月 | 0.3850% | 0.0065% | 0.4936% | 0.0000% | -0.1086% |
| 过去六个月 | 0.7672% | 0.0052% | 0.9819% | 0.0000% | -0.2147% |
| 过去一年 | 2.6640% | 0.0073% | 2.6253% | 0.0020% | 0.0387% |
| 过去三年 | 8.2122% | 0.0060% | 7.7480% | 0.0021% | 0.4642% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.1722% | 0.0050% | 11.6009% | 0.0021% | 2.5713% |

注:本基金业绩比较基准为:半年期银行定期存款税后利率
 半年期银行定期存款税后利率=0-利息税率)×半年期银行定期存款利率
 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值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、按基金合同约定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同的“七、基金的投资”部分中“四、投资对象与范围”和“五、投资组合”所规定的各项比例。
 2、因业务发展需要,经基金管理人第二届董事会2009年第二次(通讯)会议审议通过,同意何俊春女士不再兼任泰信天天收益基金基金经理,由现任基金经理之一马成先生继续管理该基金。详细情况请见2009年4月18日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的泰信基金管理有限公司关于调整泰信天天收益基金基金经理的公告。
 § 4 管理人报告
 4.1 基金管理人及基金经理情况
 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
 基金管理人:泰信基金管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F
 办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42F
 成立日期:2003年5月23日
 法定代表人:孟凡利
 总经理:高海
 电话:021 50372168
 传真:021 50372197
 联系人:王作敏
 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 更名为山东国际信托有限公司 联合江苏瑞信投资管理有限公司、青岛国际信托投资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正式批准,2003年5月8日获开业,是国内实施“引入外资”以第一家信托投资公司方式发起人而发起设立的基金管理公司。
 公司目前下设市场营销部(华东、华北、华南三个业务部)、营销策划及基金事务团队、基金事务、客户服务、营销策划、新业务团队、份额赎回部、衍生品销售、基金投资部、研究部、金融工程部、清算会计部、信息技术部、监察稽核部、综合管理部(北京分公司、深圳分公司)。截至2009年6月30日,公司共管理泰信天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票等6只开放式基金,基金资产规模141.96亿元。

4.1.2 基金业绩 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期限 | 任本基金的基金经理期间 | 说明 |
|-----|--------|-------------|-------------|--|
| 何俊春 | 基金基金经理 | 2007年2月9日 | 2009年4月18日 | 工商管理硕士,曾在齐鲁证券任职,2002年12月加入泰信基金管理有限公司,先后担任交易员、交易主管,2008年10月起兼任泰信双利基金基金经理。 |
| 马成 | 基金基金经理 | 2008年10月10日 | - | 经济学硕士,2003年加入泰信基金管理有限公司,先后担任市场部高级助理、投资管理部助理经理、集中交易室交易主管、泰信双息双利基金基金经理。 |

注: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。
 4.2 管理人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守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金管理暂行办法》等法律法规和《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于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律法规的规定。
 4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
 4.4 公平交易制度的执行情况
 根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和中国证券监督管理委员会公告[2008]9号,公司制定了《公平交易管理制度》,适用于所有投资组合,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、业绩评估等环节,从研究、投资、交易、估值、风险监控、事后监控、发展可操作交易,并由基金工程管理部负责公平交易情况定期和不定期评估。
 4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
 公司旗下管理的其他基金中不存在与本基金风格相似的情形,相互之间的业绩无法具有可比性。
 4.4.3 异常交易行为的专项说明
 本基金在本报告期内不存在异常交易行为。
 4.4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
 4.4.1 基金业绩表现
 截至报告期末,本报告基金净值收益率为0.7672%,同期业绩比较基准收益率为0.9819%。
 4.4.2 行情回顾及运作分析
 一季度,虽然国际经济环境形势不明朗,但是随着国内外一系列振兴经济措施出台以及部分经济复苏的启动,特别是信贷投放预期的增长,下引发了市场对通胀上升的担忧,最明显的就是对短期利率的调大降能。加之A股投资所造成资金分流及股指期货在1月份出现较大幅度的回调,收益率曲线进一步陡峭化,信用债利差显著缩小。随后,债市又开始小幅反弹。
 二季度,国内经济结构形势逐步好转,央行继续维持适度宽松的货币政策,信贷规模超预期增长,上半年新增贷款达到创纪录的7.4万亿。PMI从3月份开始,连续四个位于临界点50%以上,6月当月发电量同比增长3.6%的正增长,是自2008年10月以来首次实现发电量正增长。基准利率和存款准备金率没有调整,但是银行超额准备金一季度有较大幅度的回落,市场流动性依然充裕,交易活跃度明显提高。随着大宗商品价格的上涨,市场对通胀预期的预期加大。5月下旬,IPO的恢复,对债市产生了较大的影响,债市利率收益率显著上行。
 报告期内本基金规模总体保持稳定,继续维持低风险策略,降低利率风险,充分保证了基金

的流动性。
 4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
 对国内而言,经济复苏已经得到确认。虽然当前市场上流动性仍然充裕,但是随着IPO的恢复,以及央行宽松的货币政策进行微调,将对证券市场利率产生较大的影响,中短期利率的波动性必将加大,而且将出现逐步上行的趋势。虽然央行将继续维持适度宽松的货币政策,但是进一步释放流动性并没有太多的空间。央行使用最频繁的手段可能仍然是公开市场业务,而且公开市场操作利率将逐步上行。
 我们认为未来一段时间国债收益率曲线可能会进一步平坦后再继续陡峭。泰信天天收益基金将继续坚持稳健投资策略,采取长久期策略,以保证本基金良好的流动性、灵活性和安全性,积极把握各种交易机会,为持有人继续创造安全稳定的收益。
 4.6 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
 按照相关法律法规,本公司制定了泰信基金管理有限公司证券投资基金估值政策与程序,成立了估值委员会,由主管基金运营的公司总经理助理负责,成员包括清算会计、金融工程、基金投资、监察稽核等业务骨干,所有成员均具有较为丰富的证券投资基金从业经验。估值委员会负责制定、修订估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,负责确定估值模型、估值流程,对特殊投资品种给出估值价格,及对外信息披露等工作。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突,本基金基金经理不参与估值。
 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:
 本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份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。因未结转的余额进行再次分配。
 2、本基金根据每日收益情况,将当日收益全部支付,若当日净收益大于等于0,为投资者记正收益;若当日净收益小于等于0,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、本基金根据每日收益计算并分配时,以人民币元方式记账,每月累计支付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为正时,其累计收益恰好为负值,则将结转投资者基金份额。若投资者全赎回基金份额时,其收益将立即结转,若收益恰好为负值,则将结转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,本基金以累计收益结转份额的形式进行了6次收益支付,金额总计21,713,183.99元。进行的收益支付包括:上年度最后一份的收益结转日之后未结转的收益,不包括当前会计期间最后一个结转日之后实现的收益。
 § 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
 本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对泰信天天收益开放式证券投资基金(以下简称“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有关规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现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内容的真实、准确和完整发表意见
 本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分为本托管人复核范围内。)
 中国银行股份有限公司
 2009年8月20日

6.1 资产负债表
 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金
 报告截止日:2009年6月30日
 单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 2009年6月30日 | 2008年12月31日 |
|------------|----------|------------------|------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 328,469,937.44 | 732,006,454.75 |
| 结算备付金 | | 4,888,888.89 | 1,500,000.00 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,329,735,503.69 | 3,487,978,977.76 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,329,735,503.69 | 3,487,978,977.76 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 790,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | - | 100,028,000.00 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 13,050,523.12 | 6,091,017.49 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 140,410,439.17 | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,606,555,292.31 | 4,327,604,450.00 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 2009年6月30日 | 2008年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 179,983,900.00 | - |
| 应付赎回款 | | 40,604.08 | 9,920.10 |
| 应付管理人报酬 | | 538,660.69 | 859,381.71 |
| 应付托管费 | | 163,230.50 | 260,418.70 |
| 应付销售服务费 | | 408,076.32 | 651,046.73 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 11,075.60 | 47,938.05 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | 1,659,148.02 | 7,267,513.88 |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 297,913.02 | 294,500.00 |
| 负债合计 | | 183,102,698.23 | 9,390,719.17 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,423,452,594.08 | 4,318,213,730.83 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,423,452,594.08 | 4,318,213,730.83 |
| 所有者权益合计 | | 2,423,452,594.08 | 4,318,213,730.83 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,606,555,292.31 | 4,327,604,450.00 |

6.2 利润表
 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金
 本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日
 单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|-----------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 一、收入 | | 28,309,157.53 | 38,867,720.78 |
| 1.利息收入 | | 22,299,574.24 | 38,648,261.27 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 549,873.77 | 1,316,114.78 |
| 债券利息收入 | | 20,086,288.03 | 23,204,263.19 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,663,412.44 | 14,127,883.30 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 6,009,583.29 | 218,584.51 |
| 其中:股票投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 6,009,583.29 | 218,584.51 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.16 | - | - |
| 4.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | - | 875.00 |
| 二、费用 | | -9,123,902.29 | -8,131,289.19 |
| 1.管理人报酬 | | -4,210,516.92 | -3,754,095.77 |
| 2.托管费 | | -1,275,914.14 | -1,137,604.73 |
| 3.销售服务费 | | -3,189,785.63 | -2,844,012.04 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.18 | -229,256.97 | -280,068.33 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | -229,256.97 | -280,068.33 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.19 | -118,428.61 | -115,508.32 |
| 三、利润总额 | | 19,185,255.24 | 30,736,431.59 |
| 四、净利润 | | 19,185,255.24 | 30,736,431.59 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金
 本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日
 单位:人民币元

| 项目 | 2009年1月1日 | 2009年6月30日 | 2008年1月1日 | 2008年6月30日 |
|---|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 4,318,213,730.83 | - | 4,318,213,730.83 | - |
| 二、本期新增基金份额产生的基金净值变动数(本期申购) | - | 19,185,255.24 | - | 19,185,255.24 |
| 三、本期基金份额赎回产生的基金净值变动数(本期赎回)(净值减少以“-”号填列) | -1,894,761,136.75 | - | -1,894,761,136.75 | - |
| 四、本期基金份额申购/赎回产生的基金净值变动数(净值增加以“-”号填列) | 4,416,085,214.77 | - | 4,416,085,214.77 | - |
| 五、本期赎回款(以“-”号填列) | -6,310,846,351.52 | - | -6,310,846,351.52 | - |
| 六、本期申购款/赎回款产生的基金净值变动数(净值增加以“-”号填列) | - | -19,185,255.24 | - | -19,185,255.24 |
| 七、本期基金份额持有者申购/赎回产生的基金净值变动数(净值增加以“-”号填列) | 2,423,452,594.08 | - | 2,423,452,594.08 | - |
| 八、本期基金份额持有者申购/赎回产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | - | -30,736,431.59 | - | -30,736,431.59 |
| 九、期末所有者权益(基金净值) | 2,345,213,534.28 | - | 2,345,213,534.28 | - |

6.4 费用表
 6.4.1 基金费用表

| 项目 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|---|----------------------|----------------------|
| 一、期间费用 | 3,669,627,758.73 | 3,669,627,758.73 |
| 二、本期应计提的基金净值变动数(本期费用) | - | - |
| 三、本期基金份额持有者申购/赎回产生的基金净值变动数(净值增加以“-”号填列) | -1,324,414,224.45 | -1,324,414,224.45 |
| 四、本期基金份额持有者申购/赎回产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 8,314,063,473.68 | 8,314,063,473.68 |
| 五、本期赎回款(以“-”号填列) | -9,638,477,698.13 | -9,638,477,698.13 |
| 六、本期申购款/赎回款产生的基金净值变动数(净值增加以“-”号填列) | - | -30,736,431.59 |
| 七、本期基金份额持有者申购/赎回产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 2,345,213,534.28 | 2,345,213,534.28 |

6.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
 6.4.3 关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
 6.4.4 报告期末本基金投资的公允价值计量属性情况

| 关联方名称 | 2009年6月30日 | 2008年12月31日 |
|--------------------|----------------|----------------|
| 持有的基金份额 | 328,469,937.44 | 732,006,454.75 |
| 持有的基金份额占基金总资产的比例 | 12.60% | 16.89% |
| 持有的债券基金份额 | - | - |
| 持有的债券基金份额占基金总资产的比例 | - | - |

6.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|--------|----------------------|----------------------|
| 期末余额 | 328,469,937.44 | 732,006,454.75 |
| 当期利息收入 | 505,576.88 | 1,354,931.05 |

6.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
 6.4.7 报告期末本基金投资的公允价值计量属性情况

| 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 |
|-------------------|------------------|-----------|
| 1 固定收益投资 | 1,329,735,503.69 | 51.02% |
| 其中:债券 | 1,329,735,503.69 | 51.02% |
| 2 资产支持投资 | - | - |
| 3 买入返售金融资产 | 790,000,000.00 | 30.31% |
| 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 4 其他资产 | 153,460,962.29 | 5.88% |
| 合计 | 2,606,555,292.31 | 100.00% |

6.4.8 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
 6.4.9 关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
 6.4.10 报告期末本基金投资的公允价值计量属性情况

| 关联方名称 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|--------------------|----------------------|----------------------|
| 持有的基金份额 | 328,469,937.44 | 732,006,454.75 |
| 持有的基金份额占基金总资产的比例 | 12.60% | 16.89% |
| 持有的债券基金份额 | - | - |
| 持有的债券基金份额占基金总资产的比例 | - | - |

6.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 2009年1月1日至2009年6月30日 | 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|--------|----------------------|----------------------|
| 期末余额 | 328,469,937.44 | 732,006,454.75 |
| 当期利息收入 | 505,576.88 | 1,354,931.05 |

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》批准,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6,020,966,500.32元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2004]第004号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。
 根据《货币市场基金管理暂行规定》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的基金投资范围为流动性良好的短期金融工具,包括到期期限在