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:2013年8月27日

泰信天天收益开放式证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30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2013年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	415,571,335.81份
基金合同存续期	不定期

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	半年期银行定期存款税后利率;(1-利息税率)*半年期银行定期存款利率
风险收益特征	属于风险较低、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	唐国培	唐州徽
	联系电话	021-20899032	95566
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.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
基金半年度报告报告备置地点	上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦36-37层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	8,483,132.32
本期利润	8,483,132.32
本期净值收益率	1.6920%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	415,571,335.81
期末基金份额净值	1.0000

注:1、本基金收益分配按月结转份额。

2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、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。

4、期末可供分配利润是指未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

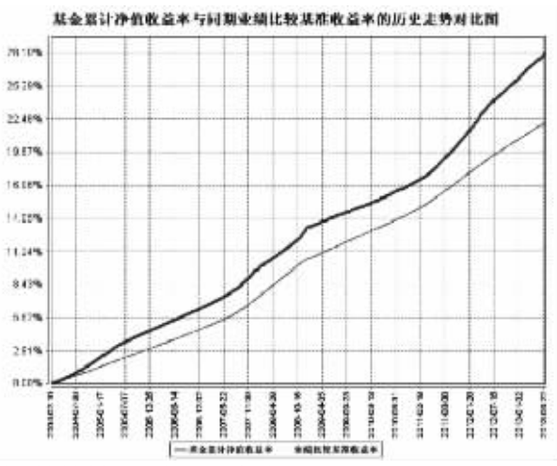
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	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	0.3208%	0.0035%	0.2333%	0.0000%	0.0875%	0.0035%
过去三个月	0.8204%	0.0037%	0.7078%	0.0000%	0.1126%	0.0037%
过去六个月	1.6920%	0.0070%	1.4078%	0.0000%	0.2842%	0.0070%
过去一年	3.3424%	0.0061%	2.8418%	0.0001%	0.5006%	0.0060%
过去三年	10.4408%	0.0070%	8.5934%	0.0011%	1.8474%	0.0059%
自基金合同生效日起至今	28.0666%	0.0057%	22.1743%	0.0019%	5.8923%	0.0038%

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=(1-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、本基金基金合同于2004年2月10日正式生效。

2、本基金建仓期为三个月。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。各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为：短期债券20%-60%，债券回购0%-80%，央行票据0%-70%,现金5%-80%。

§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:上海市浦东新区浦东南路256号37层

办公地址:上海市浦东新区浦东南路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(代任)

总经理:葛航

电话:021-20899188

传真:021-20899008

联系人:庄严

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(现更名为山东省国际信托有限公司)联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于2002 年9 月24 日经中国证券监督委员会批准正式筹建,2003 年5 月8 日获准开业,是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心和电子商务部)、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、理财顾问部、清算会计部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、计划财务部、综合管理部、北京分公司、深圳分公司。截至2013年6月,公司有正式员工111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2013年6月,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、泰信优质生活股票、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信发展主题股票、泰信债券周期回报、泰信中证200指数、泰信中小盘精选股票、泰信保本混合、泰信中证基本面400指数分级、泰信现代服务业股票共14只开放式基金及泰信财富分级5号、泰信恒益高息债分级共2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		
胡哲 先生	本基金经理	2012年9月17日	-	6	经济学硕士,具有基金从业资格,2007年5月加入泰信基金管理有限公司,担任交易室交易员。自2010年12月28日至2012年9月16日担任泰信天天收益货币基金、泰信双息双利债券基金经理助理。

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和离职日期以公司公告为准。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》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

今年上半年的货币市场出现过极为宽松和极为紧张的局面。前5个月巨量外汇占款向货币市场注入了充足的流动性,回购利率长期徘徊在低位,仅在春节和月末时点出现过小幅波动。前5个月的隔夜回购和7天回购利率的平均值是2.51%和3.3%,相比2012年的平均值减少了33和22个bp。短期债券的收益率也持续保持在低位,1年期政策金融债持续保持在3.25%附近，短期融资券的收益率在1月份有较大的下滑,2月至5月份则在低位震荡(期间只有4月份因为监管而短暂上行)。

6月份的货币市场的紧张出人意料,隔夜和七天回购利率都达到过近十年来的最高值;从5月底到6月下旬的20个交易日,一年期政策金融债、aaa短融和aa-短融的到期收益率分别上行了85bp、150bp和150bp。使得货币基金受到了近几年来最大的一次冲击。6月初,天天收益保持较好的流动性和较高的偏离度,使得基金能够较好的应对冲击。同时我们在6月底和7月初配置了收益较高的资产,并为下一步的投资操作带来便利。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金净值收益率为1.6920%,同期业绩比较基准收益率为1.4078%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

这次资金紧张的几个原因:(1)是前期资金面的持续宽松,加强了市场参与者对未来资金面的宽松预期;(2)2012年以及2013年前5个月的较高的投资收益,减少了参与者的风险意识;(3)前面两种状态下,市场参与者较多的通过期限错配来提高收益,同时由于前期整体较低的资产利率,金融机构的创新业务往往通过增大资产的规模来维持资产收益的规模。虽然金融市场上资金泛滥,但是实体经济的资金并不充足。目前监管部门的态度是对上述因素加以矫正，因为近年来兴起的非标资产的期限至少是3到6个月或者更长,所以这个矫正过程也会是个缓慢的过程。过去几年三季度的资金面都不是宽松的,今年可能也是这个状态。

下一阶段的主要操作思路是,(1)卖出短期债券,兑现一部分浮盈;(2)适当增加配置较长期限的金融债券或者收益具备吸引力的企业债券;(3)做好三季度货币市场持续紧张的准备,保持基金较好的流动性和安全性。

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。曾任职于山东省国际信托投资公司计财部、山东省国际信托投资公司上海证券部、鲁信香港投资有限公司。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。

庞少华先生,硕士,会计师。2005年1月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,经济学学士。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,现任投资部总监兼投资总监,泰信先行策略、泰信优势增长基金基金经理。

梁剑先生,硕士。2004年7月加入泰信基金管理有限公司,曾任泰信先行策略混合基金经理。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,本基金以累计收益转份额的形式进行了6次收益支付共7,820,658.42元,包括2012年最后一次收益结转份额之后未结转的收益。

§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、净值收益表现、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:泰信天天收益开放式证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	2,045,902.02	180,291,045.65
结算备付金	2,068,181.82	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	259,784,666.50	319,590,637.25
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	259,784,666.50	319,590,637.25
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	146,500,551.25	30,000,165.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,689,475.90	5,338,844.96
应收股利	-	-
应收申购款	617,796.88	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	417,706,574.37	535,220,692.86
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	5,163.03	-
应付管理人报酬	121,051.99	147,131.44
应付托管费	36,682.42	44,585.32
应付销售服务费	91,706.07	111,463.20
应付交易费用	19,152.91	20,830.83
应交税费	628,500.00	582,900.00
应付利息	-	-
应付利润	865,283.48	1,125,600.24
递延所得税负债	-	-
其他负债	367,698.66	413,500.00
负债合计	2,135,238.56	2,446,011.03
所有者权益:		
实收基金	415,571,335.81	532,774,681.83
未分配利润	-	-
所有者权益合计	415,571,335.81	532,774,681.83
负债和所有者权益总计	417,706,574.37	535,220,692.86

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额415,571,335.81份。

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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日
一、收入	10,448,065.35	16,942,889.22
1.利息收入	9,456,911.68	14,689,241.72
其中:存款利息收入	1,363,276.46	7,905,501.65
债券利息收入	5,265,671.69	5,791,071.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,827,963.53	992,668.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	991,153.61	2,253,647.50
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	991,153.61	2,253,647.50
资产支持证券投资收益	-	-
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)	0.06	-
减:二、费用	1,964,933.03	2,825,641.02
1.管理人报酬	852,050.84	1,092,742.47
2.托管费	258,197.24	331,134.11
3.销售服务费	645,493.04	827,835.28
4.交易费用	-	55.00
5.利息支出	28,194.67	390,935.44
其中:卖出回购金融资产支出	28,194.67	390,935.44
6.其他费用	180,997.24	182,938.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	8,483,132.32	14,117,248.20
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	8,483,132.32	14,117,248.20

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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	532,774,681.83	-	532,774,681.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,483,132.32	8,483,132.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-117,203,346.02	-	-117,203,346.02
其中:1.基金申购款	923,309,511.34	-	923,309,511.34
2.基金赎回款	-1,040,512,857.36	-	-1,040,512,857.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-8,483,132.32	-8,483,132.32
五、期末所有者权益(基金净值)	415,571,335.81	-	415,571,335.81
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	577,261,979.90	-	577,261,979.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	14,117,248.20	14,117,248.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-131,612,132.74	-	-131,612,132.74
其中:1.基金申购款	2,873,306,697.26	-	2,873,306,697.26
2.基金赎回款	-3,004,918,830.00	-	-3,004,918,830.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-14,117,248.20	-14,117,248.20
五、期末所有者权益(基金净值)	445,649,847.16	-	445,649,847.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

葛航 韩波 庞少华

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《货币市场基金管理暂行规定》和《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为流动性良好的短期金融工具,包括到期期限在一年以内的国债、金融债、央行票据、AAA级企业债、债券回购、同业存款以及中国证监会、中国人民银行等部门批准基金投资的商业票据及其他流动性良好的短期金融工具。本基金投资组合的平均剩余期限不超过180天。各种短期金融工具占基金财产总值的比重浮动范围分别为:短期债券20-60%,债券回购0-80%,央行票据0-70%,现金5-80%。本基金的业绩比较基准为半年期银行定期存款税后利率。

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》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》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2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财政部、国家税务总局、中国证监会联合发布财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

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。

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。

6.4.8.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	852,050.84	1,092,742.47
其中,支付销售机构的客户维护费	172,324.81	317,532.45

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	258,197.24	331,134.11

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

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰信基金管理有限公司	346,525.47
中国银行	91,229.67
合计	437,755.14
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
泰信基金管理有限公司	262,197.29
中国银行	220,288.94
合计	482,486.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底,按月支付给泰信基金管理有限公司,再由泰信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 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 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	10,549,723.15	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	19,570,495.85	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
山东省国际信托有限公司	204,914,033.58	49.31%	201,517,340.45	37.82%

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	2,045,902.02	57,953.62	37,170,792.19	55,890.32

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无其他需要说明有助于理解和分析会计报表事项。

§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	259,784,666.50	62.19
	其中:债券	259,784,666.50	62.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	146,500,551.25	35.07
	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	4,114,083.84	0.98
4	其他各项资产	7,307,272.78	1.75
5	合计	417,706,574.37	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.66	
	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、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	141
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

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	45.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	19.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	14.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.31	-
5	180天(含)—397天(含)	14.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.76	-

7.4 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	100,023,950.76	24.07
	其中:政策性金融债	100,023,950.76	24.07
4	企业债券	9,605,955.46	2.31
5	企业短期融资券	150,154,760.28	36.13
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	259,784,666.50	62.51
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,605,955.46	2.31

7.5 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	080308	08进出08	300,000	30,041,192.32	7.23
2	041359020	13川铁投CP001	300,000	30,039,017.77	7.23
3	130201	13国开01	300,000	29,995,873.68	7.22
4	041264025	12新港CP001	200,000	20,075,817.33	4.83
5	041266005	12京昊华CP001	200,000	20,036,177.71	4.82
6	041259040	12好当家CP001	200,000	20,001,813.82	4.81
7	041252029	12华泰CP002	200,000	20,000,042.30	4.81
8	120318	12进出18	200,000	19,993,864.89	4.81
9	120238