

泰信天天收益开放式证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014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:2014年8月26日		51 重要提示 1.1 重要提示 基金管理人董事会、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2014年6月22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,投资者应自担投资风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。 本报告中文财务数据未经审计。 本报告自2014年1月1日起至6月30日止。
52 基金简介 2.1 基金基本情况		51 重要提示 1.1 重要提示 基金管理人董事会、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2014年6月22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,投资者应自担投资风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。 本报告中文财务数据未经审计。 本报告自2014年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况 基金名称:泰信天天收益货币 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:615,432,316.15份 基金存续期限:不定期		52 基金简介 2.1 基金基本情况
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,追求超越业绩比较基准的现金收益。 投资策略:灵活运用利率、类别配置和无风险套券等投资策略,追求长期稳健增值并保障基金资产的流动性。 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税后利率。 风险收益特征:属于低风险、预期收益较低、流动性较强的证券投资基金品种。		52 基金简介 2.2 基金产品说明

2.3 基金管理人及基金托管人 <table border="1"> <tr> <th>项目</th> <th>基金管理人</th> <th>基金托管人</th> </tr> <tr> <td>名称</td> <td>泰信基金管理有限公司</td> <td>中国银行股份有限公司</td> </tr> <tr> <td>信息披露负责人</td> <td>姓名:王其兵 联系电话:021-28999088 电子邮箱:wangqibing@taixin.com</td> <td>姓名:王其兵 联系电话:010-65948986 电子邮箱:king@bankofchina.com</td> </tr> <tr> <td>客户服务电话</td> <td>400-888-5988</td> <td>95566</td> </tr> <tr> <td>传真</td> <td>021-28999088</td> <td>010-65949242</td> </tr> </table>		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:王其兵 联系电话:021-28999088 电子邮箱:wangqibing@taixin.com	姓名:王其兵 联系电话:010-65948986 电子邮箱:king@bankofchina.com	客户服务电话	400-888-5988	95566	传真	021-28999088	010-65949242	52 基金简介 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															
信息披露负责人	姓名:王其兵 联系电话:021-28999088 电子邮箱:wangqibing@taixin.com	姓名:王其兵 联系电话:010-65948986 电子邮箱:king@bankofchina.com															
客户服务电话	400-888-5988	95566															
传真	021-28999088	010-65949242															
2.4 信息披露方式 登载基金半年度报告正文的互联网网址: http://www.ftfund.com 基金半年度报告备置地点:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦36-37层		52 基金简介 2.4 信息披露方式															

53 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		53 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
3.1.1 期间报告指标 本期已实现收益: 10,845,640.89 本期净利润: 10,845,640.89 本期净收益: 2,250.26 3.1.2 期末报告指标 期末可供分配基金份额利润: -- 期末基金资产净值: 615,432,316.15 期末基金份额净值: 1.0000	3.1.1 期间报告指标 本报告期(2014年1月1日至2014年6月30日) 本期已实现收益: 10,845,640.89 本期净利润: 10,845,640.89 本期净收益: 2,250.26 3.1.2 期末报告指标 本报告期末(2014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: 615,432,316.15 期末基金份额净值: 1.0000	53 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

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		53 主要财务指标和基金净值表现 3.2 基金净值表现																																																																																																		
<table border="1"> <tr> <th>阶段</th> <th>份额净值收益率①</th> <th>份额净值收益率标准差②</th> <th>业绩比较基准收益率③</th> <th>业绩比较基准收益率标准差④</th> <th>①-③</th> <th>②-④</th> </tr> <tr> <td>过去一个月</td> <td>0.3532%</td> <td>0.0057%</td> <td>0.2333%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.1219%</td> <td>0.0057%</td> </tr> <tr> <td>过去三个月</td> <td>1.0750%</td> <td>0.0053%</td> <td>0.7078%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.3672%</td> <td>0.0053%</td> </tr> <tr> <td>过去六个月</td> <td>2.2502%</td> <td>0.0075%</td> <td>1.4078%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.8424%</td> <td>0.0075%</td> </tr> <tr> <td>过去一年</td> <td>4.4836%</td> <td>0.0083%</td> <td>2.8389%</td> <td>0.0000%</td> <td>1.6447%</td> <td>0.0083%</td> </tr> <tr> <td>过去三年</td> <td>12.7340%</td> <td>0.0078%</td> <td>8.9698%</td> <td>0.0000%</td> <td>3.7642%</td> <td>0.0072%</td> </tr> <tr> <td>自基金合同生效日起至今</td> <td>33.8081%</td> <td>0.0062%</td> <td>25.0132%</td> <td>0.0019%</td> <td>8.7949%</td> <td>0.0043%</td> </tr> </table>	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	0.3532%	0.0057%	0.2333%	0.0000%	0.1219%	0.0057%	过去三个月	1.0750%	0.0053%	0.7078%	0.0000%	0.3672%	0.0053%	过去六个月	2.2502%	0.0075%	1.4078%	0.0000%	0.8424%	0.0075%	过去一年	4.4836%	0.0083%	2.8389%	0.0000%	1.6447%	0.0083%	过去三年	12.7340%	0.0078%	8.9698%	0.0000%	3.7642%	0.0072%	自基金合同生效日起至今	33.8081%	0.0062%	25.0132%	0.0019%	8.7949%	0.0043%	<table border="1"> <tr> <th>阶段</th> <th>份额净值收益率①</th> <th>份额净值收益率标准差②</th> <th>业绩比较基准收益率③</th> <th>业绩比较基准收益率标准差④</th> <th>①-③</th> <th>②-④</th> </tr> <tr> <td>过去一个月</td> <td>0.3532%</td> <td>0.0057%</td> <td>0.2333%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.1219%</td> <td>0.0057%</td> </tr> <tr> <td>过去三个月</td> <td>1.0750%</td> <td>0.0053%</td> <td>0.7078%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.3672%</td> <td>0.0053%</td> </tr> <tr> <td>过去六个月</td> <td>2.2502%</td> <td>0.0075%</td> <td>1.4078%</td> <td>0.0000%</td> <td>0.8424%</td> <td>0.0075%</td> </tr> <tr> <td>过去一年</td> <td>4.4836%</td> <td>0.0083%</td> <td>2.8389%</td> <td>0.0000%</td> <td>1.6447%</td> <td>0.0083%</td> </tr> <tr> <td>过去三年</td> <td>12.7340%</td> <td>0.0078%</td> <td>8.9698%</td> <td>0.0000%</td> <td>3.7642%</td> <td>0.0072%</td> </tr> <tr> <td>自基金合同生效日起至今</td> <td>33.8081%</td> <td>0.0062%</td> <td>25.0132%</td> <td>0.0019%</td> <td>8.7949%</td> <td>0.0043%</td> </tr> </table>	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	0.3532%	0.0057%	0.2333%	0.0000%	0.1219%	0.0057%	过去三个月	1.0750%	0.0053%	0.7078%	0.0000%	0.3672%	0.0053%	过去六个月	2.2502%	0.0075%	1.4078%	0.0000%	0.8424%	0.0075%	过去一年	4.4836%	0.0083%	2.8389%	0.0000%	1.6447%	0.0083%	过去三年	12.7340%	0.0078%	8.9698%	0.0000%	3.7642%	0.0072%	自基金合同生效日起至今	33.8081%	0.0062%	25.0132%	0.0019%	8.7949%	0.0043%	53 主要财务指标和基金净值表现 3.2 基金净值表现
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	0.3532%	0.0057%	0.2333%	0.0000%	0.1219%	0.0057%																																																																																														
过去三个月	1.0750%	0.0053%	0.7078%	0.0000%	0.3672%	0.0053%																																																																																														
过去六个月	2.2502%	0.0075%	1.4078%	0.0000%	0.8424%	0.0075%																																																																																														
过去一年	4.4836%	0.0083%	2.8389%	0.0000%	1.6447%	0.0083%																																																																																														
过去三年	12.7340%	0.0078%	8.9698%	0.0000%	3.7642%	0.0072%																																																																																														
自基金合同生效日起至今	33.8081%	0.0062%	25.0132%	0.0019%	8.7949%	0.0043%																																																																																														
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	0.3532%	0.0057%	0.2333%	0.0000%	0.1219%	0.0057%																																																																																														
过去三个月	1.0750%	0.0053%	0.7078%	0.0000%	0.3672%	0.0053%																																																																																														
过去六个月	2.2502%	0.0075%	1.4078%	0.0000%	0.8424%	0.0075%																																																																																														
过去一年	4.4836%	0.0083%	2.8389%	0.0000%	1.6447%	0.0083%																																																																																														
过去三年	12.7340%	0.0078%	8.9698%	0.0000%	3.7642%	0.0072%																																																																																														
自基金合同生效日起至今	33.8081%	0.0062%	25.0132%	0.0019%	8.7949%	0.0043%																																																																																														

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比较 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税后利率。 注:本基金建仓期为三个月,建仓期间各项投资组合符合基金合同关于投资组合的相关规定,各种风险金融工具占基金资产总额的比例符合基金合同关于投资组合比例、持仓比例、行业集中度等限制。		53 主要财务指标和基金净值表现 3.2 基金净值表现
		53 主要财务指标和基金净值表现 3.2 基金净值表现

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:孟凡利 总经理:戴斌 电话:021-20899188 传真:021-20899088 联系人:庄平 发展沿革: 泰信基金管理有限公司(Fine-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日经中国证监会核准正式筹建,2003年5月8日获准开业,是信托行业首家以发起方式发起设立并成功设立的基金管理公司。 公司前下设投融资资产管理部、市场部、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、后台管理部。截至2014年6月,公司有正式员工103人,多数具有本科以上学历,所有人员在最近三年内均无受到所在单位有关管理部门处罚。 截至2014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、泰信双利债券、泰信佳选灵活配置、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信货币增强收益、泰信货币定期回报、泰信中证200指数、泰信中心超额投资、泰信保本混合、泰信中证基本面400增强收益、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券153只,开放式基金及货币理财产品:泰信乐利分级、泰信乐和分级、泰信乐和2号、泰信乐和3号、泰信量化对冲分级1号、泰信财富分级1号、泰信财富分级2号共7个资产管理计划。 4.1.2 基金基金经理(或基金经理助理)简介		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:孟凡利 总经理:戴斌 电话:021-20899188 传真:021-20899088 联系人:庄平 发展沿革: 泰信基金管理有限公司(Fine-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日经中国证监会核准正式筹建,2003年5月8日获准开业,是信托行业首家以发起方式发起设立并成功设立的基金管理公司。 公司前下设投融资资产管理部、市场部、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、后台管理部。截至2014年6月,公司有正式员工103人,多数具有本科以上学历,所有人员在最近三年内均无受到所在单位有关管理部门处罚。 截至2014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、泰信双利债券、泰信佳选灵活配置、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、泰信货币增强收益、泰信货币定期回报、泰信中证200指数、泰信中心超额投资、泰信保本混合、泰信中证基本面400增强收益、泰信现代服务业股票基金、泰信鑫益定期开放债券153只,开放式基金及货币理财产品:泰信乐利分级、泰信乐和分级、泰信乐和2号、泰信乐和3号、泰信量化对冲分级1号、泰信财富分级1号、泰信财富分级2号共7个资产管理计划。 4.1.2 基金基金经理(或基金经理助理)简介
--	--	--

4.2 基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征 4.2.1 基金的投资目标 4.2.2 基金的投资范围 4.2.3 基金的投资策略 4.2.4 基金业绩比较基准 4.2.5 基金的风险收益特征		4.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.2 基金基金经理(或基金经理助理)简介
4.3 基金的投资组合报告 4.3.1 基金投资组合报告 4.3.2 基金投资组合报告附注 4.3.3 基金投资组合报告附注		4.2 基金的投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征 4.2.1 基金的投资目标 4.2.2 基金的投资范围 4.2.3 基金的投资策略 4.2.4 基金业绩比较基准 4.2.5 基金的风险收益特征

4.4 基金管理人及基金托管人 4.4.1 基金管理人 4.4.2 基金托管人		4.3 基金的投资组合报告 4.3.1 基金投资组合报告
--	--	--

54 报告期内基金投资策略和运作分析 报告期内,本基金管理人严格遵守法律法规、基金合同和信托协议的有关规定,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。 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. 基金管理人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,以每万份基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每日基金净收益,投资者可在当日收益精度为0.01元,第三位采用去尾的方式,因去尾形成的余额留存再行分配。 (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,以人民币元为记账单位,每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红转基金份额)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,则将相应投资者基金份额,若投资者全额赎回基金份额时,其收益将立即扣除,若收益恰好为负值,则将相应投资者基金份额中扣除。 (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次收益支付共9,268,876.71元,包括2013年末最后一次收益结转份额之后未结转的收益。		54 报告期内基金投资策略和运作分析 报告期内,本基金管理人严格遵守法律法规、基金合同和信托协议的有关规定,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。 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. 基金管理人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,以每万份基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每日基金净收益,投资者可在当日收益精度为0.01元,第三位采用去尾的方式,因去尾形成的余额留存再行分配。 (2) 本基金根据每日收益情况,将当日净收益全部分配,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,以人民币元为记账单位,每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红转基金份额)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,则将相应投资者基金份额,若投资者全额赎回基金份额时,其收益将立即扣除,若收益恰好为负值,则将相应投资者基金份额中扣除。 (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次收益支付共9,268,876.71元,包括2013年末最后一次收益结转份额之后未结转的收益。
--	--	---

55 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况 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、基金合同和信托协议的有关规定,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、基金合同和信托协议的规定,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内容的真实性、准确性和完整性的意见 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“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。		55 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况 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、基金合同和信托协议的有关规定,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、基金合同和信托协议的规定,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内容的真实性、准确性和完整性的意见 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“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。
---	--	---

56 年度财务报告(未经审计) 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 报告截止日:2014年6月30日 单位:人民币元		56 年度财务报告(未经审计) 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 报告截止日:2014年6月30日 单位:人民币元																																																						
<table border="1"> <tr> <th>资产</th> <th>本期末 2014年6月30日</th> <th>上年度末 2013年12月31日</th> </tr> <tr> <td>货币资金</td> <td>191,062,852.39</td> <td>151,006,107.64</td> </tr> <tr> <td>结算备付金</td> <td>1,710,000.00</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>存出保证金</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>交易性金融资产</td> <td>320,174,949.98</td> <td>169,264,838.71</td> </tr> <tr> <td>其中:股票投资</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>基金投资</td> <td>320,174,949.98</td> <td>169,264,838.71</td> </tr> <tr> <td>资产支持证券投资</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>贵金属投资</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>衍生金融资产</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>买入返售金融资产</td> <td>59,800,229.70</td> <td>229,491,306.01</td> </tr> <tr> <td>应收证券清算款</td> <td>40,295,734.25</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>应收利息</td> <td>4,847,403.81</td> <td>3,896,263.97</td> </tr> <tr> <td>应收股利</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>应收申购款</td> <td>90,766.38</td> <td>39,576,460.20</td> </tr> <tr> <td>递延所得税资产</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>其他资产</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>资产总计</td> <td>617,981,936.51</td> <td>593,138,976.62</td> </tr> </table>		资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日	货币资金	191,062,852.39	151,006,107.64	结算备付金	1,710,000.00	--	存出保证金	--	--	交易性金融资产	320,174,949.98	169,264,838.71	其中:股票投资	--	--	基金投资	320,174,949.98	169,264,838.71	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	59,800,229.70	229,491,306.01	应收证券清算款	40,295,734.25	--	应收利息	4,847,403.81	3,896,263.97	应收股利	--	--	应收申购款	90,766.38	39,576,460.20	递延所得税资产	--	--	其他资产	--	--	资产总计	617,981,936.51	593,138,976.62	56 年度财务报告(未经审计) 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 报告截止日:2014年6月30日 单位:人民币元
资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日																																																						
货币资金	191,062,852.39	151,006,107.64																																																						
结算备付金	1,710,000.00	--																																																						
存出保证金	--	--																																																						
交易性金融资产	320,174,949.98	169,264,838.71																																																						
其中:股票投资	--	--																																																						
基金投资	320,174,949.98	169,264,838.71																																																						
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	59,800,229.70	229,491,306.01																																																						
应收证券清算款	40,295,734.25	--																																																						
应收利息	4,847,403.81	3,896,263.97																																																						
应收股利	--	--																																																						
应收申购款	90,766.38	39,576,460.20																																																						
递延所得税资产	--	--																																																						
其他资产	--	--																																																						
资产总计	617,981,936.51	593,138,976.62																																																						

<table border="1"> <tr> <th>负债和所有者权益</th> <th>本期末 2014年6月30日</th> <th>上年度末 2013年12月31日</th> </tr> <tr> <td>负债:</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>短期借款</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>交易性金融负债</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>衍生金融负债</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>卖出回购金融资产款</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>应付证券清算款</td> <td>1,758.29</td> <td>85,382.78</td> </tr> <tr> <td>应付赎回款</td> <td>151,268.63</td> <td>45,839.98</td> </tr> <tr> <td>应付托管费</td> <td>45,839.98</td> <td>25,873.55</td> </tr> <tr> <td>应付销售服务费</td> <td>114,997.49</td> <td>64,683.91</td> </tr> <tr> <td>应付交易费用</td> <td>13,296.26</td> <td>11,374.54</td> </tr> <tr> <td>应交税费</td> <td>628,500.00</td> <td>628,500.00</td> </tr> <tr> <td>应付利息</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>应付股利</td> <td>1,436,713.00</td> <td>1,023,956.54</td> </tr> <tr> <td>递延所得税负债</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>其他负债</td> <td>157,647.71</td> <td>309,000.00</td> </tr> <tr> <td>负债合计</td> <td>2,549,620.36</td> <td>2,148,771.32</td> </tr> <tr> <td>所有者权益:</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>实收基金</td> <td>615,432,316.15</td> <td>590,987,205.30</td> </tr> <tr> <td>未分配利润</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>所有者权益合计</td> <td>615,432,316.15</td> <td>590,987,205.30</td> </tr> <tr> <td>负债和所有者权益总计</td> <td>617,981,936.51</td> <td>593,138,976.62</td> </tr> </table>		负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	1,758.29	85,382.78	应付赎回款	151,268.63	45,839.98	应付托管费	45,839.98	25,873.55	应付销售服务费	114,997.49	64,683.91	应付交易费用	13,296.26	11,374.54	应交税费	628,500.00	628,500.00	应付利息	--	--	应付股利	1,436,713.00	1,023,956.54	递延所得税负债	--	--	其他负债	157,647.71	309,000.00	负债合计	2,549,620.36	2,148,771.32	所有者权益:			实收基金	615,432,316.15	590,987,205.30	未分配利润	--	--	所有者权益合计	615,432,316.15	590,987,205.30	负债和所有者权益总计	617,981,936.51	593,138,976.62	56 年度财务报告(未经审计) 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 报告截止日:2014年6月30日 单位:人民币元
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	1,758.29	85,382.78																																																																		
应付赎回款	151,268.63	45,839.98																																																																		
应付托管费	45,839.98	25,873.55																																																																		
应付销售服务费	114,997.49	64,683.91																																																																		
应付交易费用	13,296.26	11,374.54																																																																		
应交税费	628,500.00	628,500.00																																																																		
应付利息	--	--																																																																		
应付股利	1,436,713.00	1,023,956.54																																																																		
递延所得税负债	--	--																																																																		
其他负债	157,647.71	309,000.00																																																																		
负债合计	2,549,620.36	2,148,771.32																																																																		
所有者权益:																																																																				
实收基金	615,432,316.15	590,987,205.30																																																																		
未分配利润	--	--																																																																		
所有者权益合计	615,432,316.15	590,987,205.30																																																																		
负债和所有者权益总计	617,981,936.51	593,138,976.62																																																																		

6.2 关联交易 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元		6.2 关联交易 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元																																																																																													
<table border="1"> <tr> <th>项目</th> <th>本期 2014年1月1日至2014年6月30日</th> <th>上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日</th> </tr> <tr> <td>一收入</td> <td>12,800,374.67</td> <td>10,448,006.35</td> </tr> <tr> <td>1.利息收入</td> <td>11,417,321.69</td> <td>9,458,911.68</td> </tr> <tr> <td>其中:存款利息收入</td> <td>3,465,104.28</td> <td>1,363,276.46</td> </tr> <tr> <td>债券利息收入</td> <td>5,651,473.36</td> <td>5,265,671.69</td> </tr> <tr> <td>资产支持证券利息收入</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>买入返售金融资产收入</td> <td>2,100,743.45</td> <td>2,827,963.53</td> </tr> <tr> <td>其他利息收入</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>2.投资收益</td> <td>1,393,053.58</td> <td>991,153.61</td> </tr> <tr> <td>其中:股票投资收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>基金投资收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>债券投资收益</td> <td>1,393,053.58</td> <td>991,153.61</td> </tr> <tr> <td>资产支持证券投资收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>贵金属投资收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>衍生工具收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>股利收益</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>4.其他收入(损失以“-”号填列)</td> <td>--</td> <td>0.06</td> </tr> <tr> <td>5.其他收入(损失以“-”号填列)</td> <td>1,964,733.78</td> <td>1,964,933.03</td> </tr> <tr> <td>二费用</td> <td>824,357.40</td> <td>852,050.84</td> </tr> <tr> <td>1.管理费</td> <td>249,805.35</td> <td>258,197.24</td> </tr> <tr> <td>2.托管费</td> <td>624,513.30</td> <td>645,493.04</td> </tr> <tr> <td>3.销售服务费</td> <td>1,000.00</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>4.交易费用</td> <td>81,354.83</td> <td>28,194.67</td> </tr> <tr> <td>5.利息支出</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>6.其他</td> <td>183,702.90</td> <td>189,997.24</td> </tr> <tr> <td>其中:卖出回购金融资产支出</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>7.其他支出</td> <td>183,702.90</td> <td>189,997.24</td> </tr> <tr> <td>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</td> <td>10,845,640.89</td> <td>8,483,132.32</td> </tr> <tr> <td>减:所得税费用</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</td> <td>10,845,640.89</td> <td>8,483,132.32</td> </tr> </table>		项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	一收入	12,800,374.67	10,448,006.35	1.利息收入	11,417,321.69	9,458,911.68	其中:存款利息收入	3,465,104.28	1,363,276.46	债券利息收入	5,651,473.36	5,265,671.69	资产支持证券利息收入	--	--	买入返售金融资产收入	2,100,743.45	2,827,963.53	其他利息收入	--	--	2.投资收益	1,393,053.58	991,153.61	其中:股票投资收益	--	--	基金投资收益	--	--	债券投资收益	1,393,053.58	991,153.61	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.其他收入(损失以“-”号填列)	--	0.06	5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,964,733.78	1,964,933.03	二费用	824,357.40	852,050.84	1.管理费	249,805.35	258,197.24	2.托管费	624,513.30	645,493.04	3.销售服务费	1,000.00	--	4.交易费用	81,354.83	28,194.67	5.利息支出	--	--	6.其他	183,702.90	189,997.24	其中:卖出回购金融资产支出	--	--	7.其他支出	183,702.90	189,997.24	三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	10,845,640.89	8,483,132.32	减:所得税费用	--	--	四、净利润(净亏损以“-”号填列)	10,845,640.89	8,483,132.32	6.2 关联交易 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日																																																																																													
一收入	12,800,374.67	10,448,006.35																																																																																													
1.利息收入	11,417,321.69	9,458,911.68																																																																																													
其中:存款利息收入	3,465,104.28	1,363,276.46																																																																																													
债券利息收入	5,651,473.36	5,265,671.69																																																																																													
资产支持证券利息收入	--	--																																																																																													
买入返售金融资产收入	2,100,743.45	2,827,963.53																																																																																													
其他利息收入	--	--																																																																																													
2.投资收益	1,393,053.58	991,153.61																																																																																													
其中:股票投资收益	--	--																																																																																													
基金投资收益	--	--																																																																																													
债券投资收益	1,393,053.58	991,153.61																																																																																													
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.其他收入(损失以“-”号填列)	--	0.06																																																																																													
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,964,733.78	1,964,933.03																																																																																													
二费用	824,357.40	852,050.84																																																																																													
1.管理费	249,805.35	258,197.24																																																																																													
2.托管费	624,513.30	645,493.04																																																																																													
3.销售服务费	1,000.00	--																																																																																													
4.交易费用	81,354.83	28,194.67																																																																																													
5.利息支出	--	--																																																																																													
6.其他	183,702.90	189,997.24																																																																																													
其中:卖出回购金融资产支出	--	--																																																																																													
7.其他支出	183,702.90	189,997.24																																																																																													
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	10,845,640.89	8,483,132.32																																																																																													
减:所得税费用	--	--																																																																																													
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	10,845,640.89	8,483,132.32																																																																																													

6.3 有关关联方 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元		6.3 有关关联方 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元																																	
<table border="1"> <tr> <th>项目</th> <th>本期 2014年1月1日至2014年6月30日</th> <th>上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日</th> </tr> <tr> <td>一、期间所有者权益(基金净值)</td> <td>590,987,205.30</td> <td>590,987,205.30</td> </tr> <tr> <td>二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)</td> <td>--</td> <td>10,845,640.89</td> </tr> <tr> <td>三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)</td> <td>24,445,110.85</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>其中:1.基金申购款</td> <td>1,488,473,172.86</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>2.基金赎回款</td> <td>-1,464,028,062.01</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>三、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)</td> <td>-117,203,346.02</td> <td>-117,203,346.02</td> </tr> <tr> <td>其中:1.基金申购款</td> <td>923,309,511.34</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>2.基金赎回款</td> <td>-1,040,512,857.36</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>四、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)</td> <td>--</td> <td>-8,483,132.32</td> </tr> <tr> <td>五、期末所有者权益(基金净值)</td> <td>615,432,316.15</td> <td>615,432,316.15</td> </tr> </table>		项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	一、期间所有者权益(基金净值)	590,987,205.30	590,987,205.30	二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)	--	10,845,640.89	三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)	24,445,110.85	--	其中:1.基金申购款	1,488,473,172.86	--	2.基金赎回款	-1,464,028,062.01	--	三、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(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	--	2.基金赎回款	-1,040,512,857.36	--	四、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	--	-8,483,132.32	五、期末所有者权益(基金净值)	615,432,316.15	615,432,316.15	6.3 有关关联方 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日																																	
一、期间所有者权益(基金净值)	590,987,205.30	590,987,205.30																																	
二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)	--	10,845,640.89																																	
三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)	24,445,110.85	--																																	
其中:1.基金申购款	1,488,473,172.86	--																																	
2.基金赎回款	-1,464,028,062.01	--																																	
三、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(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	--																																	
2.基金赎回款	-1,040,512,857.36	--																																	
四、本期基金份额持有人持有的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	--	-8,483,132.32																																	
五、期末所有者权益(基金净值)	615,432,316.15	615,432,316.15																																	

6.4 关联方 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元		6.4 关联方 会计主体:泰信天天收益开放式证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日 单位:人民币元													
<table border="1"> <tr> <th>项目</th> <th>本期 2014年1月1日至2014年6月30日</th> <th>上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日</th> </tr> <tr> <td>一、期间所有者权益(基金净值)</td> <td>590,987,205.30</td> <td>590,987,205.30</td> </tr> <tr> <td>二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)</td> <td>--</td> <td>10,845,640.89</td> </tr> <tr> <td>三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)</td> <td>24,445,110.85</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>其中:1.基金申购款</td> <td>1,488,473,172.86</td></tr></table>		项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	一、期间所有者权益(基金净值)	590,987,205.30	590,987,205.30	二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)	--	10,845,640.89	三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)	24,445,110.85	--	其中:1.基金申购款	1,488,473,172.86
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日													
一、期间所有者权益(基金净值)	590,987,205.30	590,987,205.30													
二、本期新增权益产生的基金净值变动数(本期净申购)	--	10,845,640.89													
三、本期基金份额减少产生的基金净值变动数(本期净赎回)(净值减少以“-”号填列)	24,445,110.85	--													
其中:1.基金申购款	1,488,473,172.86														