# 泰信天天收益开放式证券投资基金

## 2014 年度 报告摘要

2014年12月31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:2015年3月26日**

## §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2015年3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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014年1月1日起至12月31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 | 2,078,354,314.15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 | 胡囡 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-20899098 | 010-66594896 |
| | 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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ftfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2014年 | 2013年 | 2012年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 21,754,017.43 | 16,334,366.33 | 22,474,550.29 |
| 本期利润 | 21,754,017.43 | 16,334,366.33 | 22,474,550.29 |
| 本期净值收益率 | 4.2815% | 3.9132% | 3.9848% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **2014年末** | **2013年末** | **2012年末** |
| 期末可供分配基金份额利润 | - | - | - |
| 期末基金资产净值 | 2,078,354,314.15 | 590,987,205.30 | 532,774,681.83 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

注:1、本基金合同于2004年2月10日正式生效。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末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

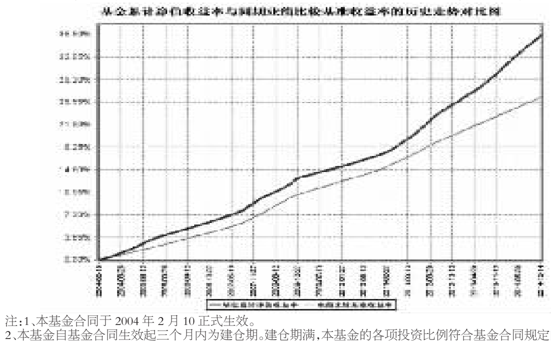
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.0109% | 0.0092% | 0.6878% | 0.0003% | 0.3231% | 0.0089% |
| 过去六个月 | 1.9868% | 0.0072% | 1.4033% | 0.0003% | 0.5835% | 0.0069% |
| 过去一年 | 4.2815% | 0.0073% | 2.8111% | 0.0002% | 1.4704% | 0.0071% |
| 过去三年 | 12.6796% | 0.0082% | 8.7137% | 0.0005% | 3.9659% | 0.0077% |
| 过去五年 | 18.6279% | 0.0074% | 13.8175% | 0.0011% | 4.8104% | 0.0063% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.4663% | 0.0063% | 26.4165% | 0.0019% | 10.0498% | 0.0044% |

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

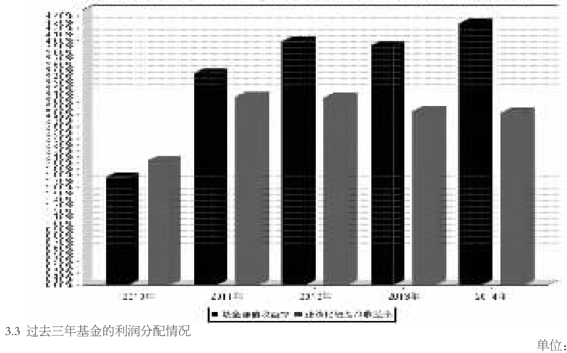
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2004年2月10日正式生效。

2、本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。建仓期满,本基金的各项投资比例符合基金合同规定的比例。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%。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 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 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014 | 18,567,803.69 | 2,245,385.46 | 940,828.28 | 21,754,017.43 | |
| 2013 | 14,727,906.82 | 1,708,103.21 | -101,643.70 | 16,334,366.33 | |
| 2012 | 17,697,950.56 | 4,734,727.75 | 41,871.98 | 22,474,550.29 | |
| 合计 | 50,993,661.07 | 8,688,216.42 | 881,056.56 | 60,562,934.05 | |

注:上述各年度的再投资形式转实收基金包括上年度最后一个收益结转日之后未结转的收益,不包括当年度最后一个结转日之后实现的收益。

## §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号华夏银行大厦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:王小林
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,是国内第一家以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、营销部(分华东、华北、华南三大营销中心)、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2014年12月底,公司有正式员工103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2014年12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、泰信鑫益定期开放债券共15只开放式基金及泰信乐利分级1号、泰信乐利3号、泰信乐利分级4号、泰信量化对冲分级1号、泰信财富分级6号、泰信财富分级7号、泰信道简阿尔法、泰信智慧紫藤金1号、泰信至尊阿尔法、泰信至尊阿尔法3号、泰信至尊阿尔法5号、泰信至尊阿尔法6号共12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 | | |
| 邱庆东先生 | 本基金经理 | 2014年9月30日 | - | 7年 | 2007年7月至2012年12月先后任职于国都证券、海通证券、申万菱信基金管理公司担任债券研究员。2012年12月进入泰信基金管理有限公司,在集中交易部担任债券交易员,2013年9月至2014年9月担任研究部高级债券研究员兼泰信天天收益、泰信鑫益定期开放基金经理助理。 |
| 胡哲先生 | 本基金经理 | 2012年9月17日 | 2014年9月30日 | 7年 | 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。已于2014年9月30日离职。 |

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。

3、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定,邱庆东先生担任泰信天天收益开放式证券投资基金经理,胡哲先生不再担任本基金经理,具体详情请见2014年9月30日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益开放式证券投资基金经理变更的公告》。

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守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规、《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、取信于投资者"的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(中国证监会公告[2011]18号),公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易制度》,主要控制方法如下:

1、建立统一的研究平台,所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。

2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。

3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构,主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。

4、投资组合经理同时管理多个投资组合时,必须公平公正的对待管理的所有投资组合,除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外,同一交易日投资同一交易品种时,应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

5、集中交易室负责所有投资指令的执行,必须确保所有同向指令的公平公正,平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令,交易室应立即停止执行指令,并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令,不同投资组合也必须公平对待,主要采取成交结果按比例分配和轮侯方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置,实时监控交易指令,禁止同一投资组合内部的同日反向交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数,强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析,对强制公平委托的执行过程与结果进行检查;对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,并完成定期分析报告。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2014年,市场整体呈现资金宽松,债券收益率下行的走势,但部分时段仍有较为明显的波动。2014年末相比2013年同期,收益率曲线有明显下降,从货币基金主要投资的短期债券来看,1年国开债、AAA短融及AA短融收益率分别为3.95%、4.72%和5.63%,分别比上年同期下降154BP、160BP和143BP。资金中枢也出现明显下移,银行间7天质押式回购利率中枢大约在3.6%附近,明显低于13年的水平。我们认为2014年市场主要受到基本面因素影响:一方面,经济处于调结构阶段,增速稳步回落;另一方面,需求回落及大宗商品价格下跌推动通胀下行,CPI进入1时代。货币政策逐步开始放松,央行通过下调存款准备金率、降息等多种政策工具,向市场注入流动性,降低企业融资成本。另外,新股IPO重启后,对资金面和债券市场也形成一定扰动。

2014年天天收益基金继续保持相对适中的组合期限,持有信用评级较高的短融,并配置一定比例高流动性的利率债,同时较好适应了IPO节奏进行资产配置。

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4.2815%,同期业绩比较基准收益率为2.8111%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,以投资为代表的内需对经济的推动力较弱,而实际汇率上升则导致外需不振,预计2015年经济仍将会继续小幅下滑。通胀方面,货币供应增速稳步下滑,而以原油为代表的大宗商品价格近半年大幅走低,输入性压力不大,预计通胀仍将在低位徘徊。经济及通胀出现下行的背景下,前期政策已转向宽松但力度不大,说明转型仍在管理层政策考虑范围之内,因此今年货币政策将仍会延续去年的节奏,即逐步有节制的进行放松,整体流动性偏宽松,个别时点如IPO及季末等会出现暂时性紧张。债券市场方面,在资金面偏宽松的背景下,短端收益率存在下行的动力,且收益率曲线平坦化,也对短端形成了保护。

2015年投资思路:1)调整组合配置,维持短融等债券品种较高的持仓比例,降低回购等短期资产比例;2)适当拉长组合的久期;3)加强信用甄别,严控信用风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内,本基金管理人内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神,以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体,对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制,较好地保证了基金运作的合规性。

1、进一步完善制度建设,构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规,及时补充及完善了内部管理制度,同时对业务流程进一步梳理,严格按照监管要求进行风险控制评估,确保风险控制的有效性,不断提升内部控制水平。

2、进一步规范基金投资管理工作流程,加强基金投资风险控制。

(1)加强基金的日常投资交易进行监控,及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控,并与相关基金经理沟通,提示相关风险。同时根据投委会的投资决议对风险指标设置进行调整,不定期检查风险监控指标设置,并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。另外注意对监管机构处罚信息与市场负面信息搜集,提示投研部门注意潜在风险。

(2)规范投资交易行为,防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易,严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易,新增了基金间同日同向交易。对于日常的投资监控,公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法,在公平交易的各环节建立了责任追究制,实行各部门责任人、分管领导责任人负责制,以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

3、日常监察与专项稽核相结合,深入开展各项监察稽核工作。包括对基金销售、宣传材料、客户服务、反洗钱工作、信息披露、应用系统权限管理、基金投资备选库管理、异常交易监控等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式,保证了内部监察稽核的全面性、实时性,强化了风险控制流程,提高了业务部门及人员的风险意识水平,从而较好地预防风险。

4、做好投研交易等人员的合规培训,提高合规意识。公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训,就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类汇报,并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明,要求投研人员遵守投资纪律,规范决策流程,从源头避免内幕交易事件的发生,加强了投研人员的合规意识。

5、公司采用技术手段对网站、交易、行情等进行屏蔽,对其他非受控方式上网及即时通讯做出进一步规范。加强投研人员的资讯管理,对基金经理集中区域进行录像监控,对于证券公司的网站、网页委托进行了屏蔽,对投研人员的办公电脑安装截屏软件进行留痕处理,并对安装软件的权限进行严格限制。

在本报告期内,本基金的投资运作等各环节基本符合规定的要求,未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续充实内部控制和风险管理工作,保证基金运作的合规性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

蔡海成先生,硕士。2013年加入泰信基金管理有限公司,现任公司清算会计部总监。

朱志权先生,学士。2008年6月加入泰信基金管理有限公司,现任基金投资部总监兼投资总监,泰信优势增长基金基金经理。

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。

4.8 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12次收益支付共18,567,803.69元,包括2014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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2015)第20717号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 | |
|---|---|---|
| 审计报告收件人 | 泰信天天收益开放式证券投资基金全体基金份额持有人 | |
| 引言段 | 我们审计了后附的泰信天天收益开放式证券投资基金(以下简称"泰信天天收益基金")的财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 | |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是泰信天天收益基金的基金管理人泰信基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:<br>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"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财务报表,并使其实现公允反映;<br>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 | |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。<br>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。<br>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 | |
| 审计意见段 | 我们认为,上述泰信天天收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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,公允反映了泰信天天收益基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。 | |
| 注册会计师的姓名 | 单峰 | 周祎 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 | |
| 审计报告日期 | 2015年3月26日 | |

## §7 年度财务报表

7.1 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:2014年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 822,629,121.25 | 151,006,107.64 |
| 结算备付金 | 1,297,500.00 | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 751,486,514.05 | 169,261,838.71 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 751,486,514.05 | 169,261,838.71 |
| 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 | 472,601,894.90 | 229,401,306.10 |
| 应收证券清算款 | 12,069,222.22 | - |
| 应收利息 | 21,704,129.35 | 3,896,263.97 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 14,525.98 | 39,570,460.20 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,081,802,907.75 | 593,135,976.62 |
| **负债和所有者权益** | **本期末<br>2014年12月31日** | **上年度末<br>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 | - | - |
| 应付赎回款 | 46,022.65 | - |
| 应付管理人报酬 | 229,675.92 | 85,382.78 |
| 应付托管费 | 69,598.77 | 25,873.55 |
| 应付销售服务费 | 173,996.93 | 64,683.91 |
| 应付交易费用 | 26,632.98 | 11,374.54 |
| 应交税费 | 628,500.00 | 628,500.00 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | 1,964,784.82 | 1,023,956.54 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 309,381.53 | 309,000.00 |
| 负债合计 | 3,448,593.60 | 2,148,771.32 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 2,078,354,314.15 | 590,987,205.30 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 2,078,354,314.15 | 590,987,205.30 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,081,802,907.75 | 593,135,976.62 |

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额2,078,354,314.15份。

7.2 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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 25,989,652.72 | 19,775,514.97 |
| 1.利息收入 | 23,231,459.85 | 17,873,927.25 |
| 其中:存款利息收入 | 7,993,093.95 | 3,362,702.17 |
| 债券利息收入 | 11,495,662.83 | 9,222,898.53 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 3,742,703.07 | 5,288,326.55 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 2,758,192.87 | 1,901,587.66 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,758,192.87 | 1,901,587.66 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | - | 0.06 |
| 减:二、费用 | 4,235,635.29 | 3,441,148.64 |
| 1.管理人报酬 | 1,765,504.79 | 1,456,764.36 |
| 2.托管费 | 535,001.55 | 441,443.75 |
| 3.销售服务费 | 1,337,503.78 | 1,103,609.29 |
| 4.交易费用 | 1,000.00 | 125.00 |
| 5.利息支出 | 222,102.83 | 73,090.81 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 222,102.83 | 73,090.81 |
| 6.其他费用 | 374,522.34 | 366,115.43 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 21,754,017.43 | 16,334,366.33 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 21,754,017.43 | 16,334,366.33 |

7.3 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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31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) | 590,987,205.30 | - | 590,987,205.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 21,754,017.43 | 21,754,017.43 |
| 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) | 1,487,367,108.85 | - | 1,487,367,108.85 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,059,954,152.91 | - | 4,059,954,152.91 |
| 2.基金赎回款 | -2,572,587,044.06 | - | -2,572,587,044.06 |
| 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) | - | -21,754,017.43 | -21,754,017.43 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,078,354,314.15 | - | 2,078,354,314.15 |
| **项目** | **上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31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) | - | 16,334,366.33 | 16,334,366.33 |
| 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) | 58,212,523.47 | - | 58,212,523.47 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,056,583,409.24 | - | 2,056,583,409.24 |
| 2.基金赎回款 | -1,998,370,885.77 | - | -1,998,370,885.77 |
| 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) | - | -16,334,366.33 | -16,334,366.33 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 590,987,205.30 | - | 590,987,205.30 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|---|---|---|
| 葛航 | 韩波 | 蔡海成 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 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。

本财务报表由本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司于2015年3月26日批准报出。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 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("山东信托") | 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 |
| 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本期末及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 中国银行 | 20,063,020.00 | 0.75% | 20,097,698.63 | 2.90% |

债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方佣金余额。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,765,504.79 | 1,456,764.36 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 223,370.70 | 304,522.68 |

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 535,001.55 | 441,443.75 |

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。

7.4.8.2.3 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<br>2014年1月1日至2014年12月31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 | 911,035.50 |
| 中国银行 | 169,554.94 |
| 合计 | 1,080,590.44 |
| **获得销售服务费各关联方名称** | **上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31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 | 519,633.62 |
| 中国银行 | 161,931.00 |
| 合计 | 681,564.62 |

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。

7.4.8.3 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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 20,337,540.55 | - | - | - | - | - |
| **银行间市场交易的各关联方名称** | **上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日** | | | | | |
| | 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 | - | 20,804,692.60 | - | - | - | - |

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | 60,686,466.38 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 45,148,567.52 | - |
| 期末持有的基金份额 | 15,537,898.86 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.7500% | - |

注:基金管理人泰信基金管理有限公司在本年度申购和赎回本基金的交易委托中国银行和光大银行办理,无赎回费。

7.4.8.4.2 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<br>2014年12月31日 | | 上年度末<br>2013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 |
| 山东国托 | 100,076,646.58 | 4.8200% | 87,099,822.11 | 14.7400% |

7.4.8.5 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<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31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 | 12,629,121.25 | 43,689.18 | 1,006,107.64 | 73,697.25 |

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(ii)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为751,486,514.05元,无属于第一或第三层次的余额(2013年12月31日:第二层次169,261,838.71元,无属于第一或第三层次的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

8.1 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 | 751,486,514.05 | 36.10 |
| | 其中:债券 | 751,486,514.05 | 36.10 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 472,601,894.90 | 22.70 |
| | 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 | 823,926,621.25 | 39.58 |
| 4 | 其他各项资产 | 33,787,877.55 | 1.62 |
| 5 | 合计 | 2,081,802,907.75 | 100.00 |

8.2 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 | 1.28 | |
| | 其中:买断式回购融资 | - | |
| **序号** | **项目** | **金额** | **占基金资产净值的比例(%)** |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每个交易日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

2、本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 46 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 164 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 45 |

注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

8.3.2 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 | 70.68 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 3.38 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 2.90 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 15.41 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 6.74 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.11 | - |

8.4 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 | 350,239,872.18 | 16.85 |
| | 其中:政策性金融债 | 350,239,872.18 | 16.85 |
| 4 | 企业债券 | 9,841,601.97 | 0.47 |
| 5 | 企业短期融资券 | 391,405,039.90 | 18.83 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 751,486,514.05 | 36.16 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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 | 140207 | 14国开07 | 1,000,000 | 100,096,833.86 | 4.82 |
| 2 | 140223 | 14国开23 | 700,000 | 70,053,029.47 | 3.37 |
| 3 | 140212 | 14国开12 | 600,000 | 60,045,688.42 | 2.89 |
| 4 | 071404013 | 14广发CP013 | 500,000 | 50,002,623.75 | 2.41 |
| 5 | 140213 | 14国开13 | 500,000 | 49,999,015.55 | 2.41 |
| 6 | 041454010 | 14洋河CP001 | 300,000 | 30,212,885.11 | 1.45 |
| 7 | 041453003 | 14宁城建CP001 | 300,000 | 30,156,274.76 | 1.45 |
| 8 | 041462005 | 14天药集CP001 | 300,000 | 30,036,697.98 | 1.45 |
| 9 | 140429 | 14农发29 | 300,000 | 30,035,244.12 | 1.45 |
| 10 | 140218 | 14国开18 | 300,000 | 30,008,003.44 | 1.44 |

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 24 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.3843% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0224% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1427% |

注:偏离度情况统计只包含交易日,交易所休市银行间有交易也统计在内。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

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

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

(3)本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。

8.8.2

本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动债的摊余成本超过日基金资产净值20%的情况。

8.8.3 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内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,069,222.22 |
| 3 | 应收利息 | 21,704,129.35 |
| 4 | 应收申购款 | 14,525.98 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 33,787,877.55 |

8.8.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 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 |
| 5,992 | 346,854.86 | 1,902,598,070.64 | 91.54% | 175,756,243.51 | 8.46% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 431,709.15 | 0.0208% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 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 | 590,987,205.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,059,954,152.91 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,572,587,044.06 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,078,354,314.15 |

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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、2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过,自2014年4月2日起,王小林先生担任公司董事长职务,公司总经理葛航先生不再代理董事长职务。具体详情请见2014年4月9日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《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》。

3、经工商行政管理部门核准,泰信基金管理有限公司法定代表人变更为王小林先生。具体详情请见2014年9月13日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告》。

4、经泰信基金管理有限公司总办会审议决定,邱庆东先生担任泰信天天收益开放式证券投资基金经理,胡哲先生不再担任本基金经理,具体详情请见2014年9月30日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站上的《泰信基金管理有限公司关于泰信天天收益开放式证券投资基金经理变更的公告》。本公司上述人事变动已按相关规定向监管机构进行备案。

除此以外无其他重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费为人民币6万元。该审计机构从基金合同生效日(2004年2月10日)开始为本基金提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |

11.7.2 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 |
| 海通证券 | - | - | 1,795,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 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。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

泰信基金管理有限公司
2015年3月26日