泰信天天收益开放式证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:2016年3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2016年3月28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2015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	5,209,544,242.80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	胡图	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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	62,741,279.10	21,754,017.43	16,334,366.33
本期利润	62,741,279.10	21,754,017.43	16,334,366.33
本期净值收益率	3.6571%	4.2815%	3.9132%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-	-	-
期末基金资产净值	5,209,544,242.80	2,078,354,314.15	590,987,205.30
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。

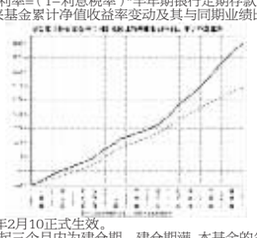
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.7477%	0.0063%	0.3482%	0.0003%	0.3995%	0.0060%
过去六个月	1.4842%	0.0083%	0.7832%	0.0006%	0.7010%	0.0077%
过去一年	3.6571%	0.0112%	1.9431%	0.0012%	1.7140%	0.0100%
过去三年	12.3246%	0.0091%	7.5931%	0.0013%	4.7315%	0.0078%
过去五年	20.8396%	0.0084%	13.7316%	0.0013%	7.1080%	0.0071%
自基金合同生效起至今	41.4567%	0.0068%	28.3596%	0.0018%	13.0971%	0.0050%

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

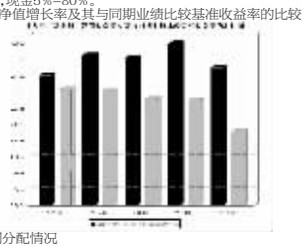
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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增长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
2015	52,136,688.85	6,283,123.79	4,321,466.46	62,741,279.10	
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	
合计	85,432,399.36	10,236,612.46	5,160,651.04	100,829,662.86	

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:中国(上海)自由贸易实验区浦东南路256号37层

办公地址:中国(上海)自由贸易实验区浦东南路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:王斌

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。

公司目前下设上海悦懿资产管理有限公司、市场部、产品部、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2015年12月底,公司有正式员工108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2015年12月底,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、泰信中证基本面400指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合共16只开放式基金及泰信乐利5号、泰信至尊阿尔法6号、泰信吉渊分级1号、泰信鲁信1号、泰信磐晟稳健1号、泰信磐晟定增1号、泰信价值1号、泰信添盈债券分级1号、泰信中行新时代6号共9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	-	8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月担任研究部固定收益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。

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。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

2015年一季度,央行进行了降息降准操作。在此背景下,市场资金面中性偏宽松,但外汇占款低迷、IPO冲击和节假日效应也对资金面产生一定影响,部分时点资金面略显紧张。债券市场方面,收益率先降后升,前期下降有一定的季节性特点,主要是资金面从年末的紧张状态逐步回归正常化所致;而后期收益率上升,则是由于市场对未来经济和通胀逐步稳定产生预期,同时对债券供给存在一定担忧所致,曲线呈现出陡峭化走势,长端带动短端上行。二季度,央行继续维持宽松的货币政策,其中4月份存款准备金率直接大幅下降1个百分点,市场流动性极其充裕。至6月中下旬,大型IPO和半年末效应使得短期资金略显紧张。债券市场方面,二季度短债收益率出现明显下降,而长端利率债收益率出现短期下降后,受到经济稳定预期及地方政府债供给增加影响出现回升,短降长升导致收益率曲线出现陡峭化。三季度,人民币贬值一度引发关注,资金流出成市场隐忧,资金面部分时点呈略紧状态,但至9月份人民币持续大幅贬值预期被打破,市场资金面转回至稳定。债券市场方面,在数次宽松之后,经济仍未见明显回暖,市场对未来经济增长预期略显悲观,推动长债收益率大幅下行。而回购利率稳步回升,使得短债收益率下行动力有限,短端基本保持平稳,收益率曲线出现明显平坦化。信用债也成为市场关注点之一,短期信用债的信用利差大幅缩窄。四季度,央行延续降息降准的宽松货币政策,银行间7天回购利率基本保持在2.5%以下,资金面保持宽裕。债券市场方面,虽然IPO重启一定程度上对收益率形成扰动,但未改变债券市场整体上涨走势。由于市场对经济走势较为悲观,在宽松资金面的推动下,长短端收益率整体下行,长端收益率下行幅度高于短端,曲线平坦化明显。信用风险也是四季度市场的重要关注点,信用利差方面,AA+以上短融信用利差仍保持低位,但AA以下短融信用利差有所回升,显示市场风险偏好急剧降低。

2015年一季度天天收益基金适当拉长了组合久期,同时增持收益率较高的短融,降低短期回购的投资比例。在二季度初继续拉长组合久期,并融资加杠杆,取得较好的组合收益。至季末,考虑到流动性的影响,适当缩短久期并降低杠杆,较好回避短债的调整。三季度,基金果断增持信用债,至季末考虑到流动性的因素逐步降低其投资比例。同时适度通过杠杆增加组合收益,并有效拉长组合久期。四季度,基金整体维持了较高的债券投资比例,在债券收益率下行期间获得较好的投资收益。年底前,随着债券收益率大幅下行,本基金逐步降低债券投资比例,以收益率较高的跨年回购进行替代,并降低组合久期。

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3.6571%,同期业绩比较基准收益率为1.9431%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,我们认为虽然当前债券收益率较低,但一季度经济和通胀等基本面因素变化不大,债券市场仍面临有利的市场环境,因此债券市场不会出现明显的大幅下跌走势。同时由于收益率曲线平坦化明显,因此长端的后续走势将受到短端的影响。而短期债券,则会受到资金利率的影响,未来需要重点关注的是回购利率走势。展望全年,需要重点关注的是宏观因素可能出现的潜在变化,主要关注点为信贷的持续投放力度以及美国经济环境及货币政策变化导致对国内货币政策的影响。

本基金投资展望:整体而言,当前债券市场虽面临较好的环境,但整体债券收益率偏低,资产组合以中性配置为主,信用风险控制仍将加强,提升组合的信用评级。同时可以肯定的是:今年债券市场将不会是单边上涨市场,关注重点影响因素的变化,投资需要跟紧市场环境及预期变化。

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。今后公司将继续夯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。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,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62,741,279.10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(2016)第20838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2015年12月31日的资产负债表、2015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: (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; (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。 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。 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、中国基金业协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2015年12月31日的财务状况以及2015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	2016年3月25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:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	1,530,793,676.12	822,629,121.25
结算备付金	-	1,297,500.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,446,854,506.81	751,486,514.05
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,446,854,506.81	751,486,514.05
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	2,030,507,925.75	472,601,894.90
应收证券清算款	-	12,069,222.22
应收利息	9,090,672.09	21,704,129.35
应收股利	-	-
应收申购款	201,000,006.97	14,525.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,218,246,787.74	2,081,802,907.75
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	3,114.08	46,022.65
应付管理人报酬	674,261.02	229,675.92
应付托管费	204,321.51	69,598.77
应付销售服务费	510,803.80	173,996.93
应付交易费用	46,246.64	26,632.98
应交税费	628,500.00	628,500.00
应付利息	-	-
应付利润	6,286,251.28	1,964,784.82
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,046.61	309,381.53
负债合计	8,702,544.94	3,448,593.60
所有者权益:		
实收基金	5,209,544,242.80	2,078,354,314.15
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,209,544,242.80	2,078,354,314.15
负债和所有者权益总计	5,218,246,787.74	2,081,802,907.75

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额5,209,544,242.80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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	77,184,204.23	25,989,652.72
1.利息收入	60,551,303.56	23,231,459.95
其中:存款利息收入	23,033,274.40	7,993,093.95
债券利息收入	29,736,252.88	11,495,662.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,781,776.28	3,742,703.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	16,632,900.67	2,758,192.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	16,632,900.67	2,758,192.87
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)	-	-
减:二、费用	14,442,925.13	4,235,635.29
1. 管理人报酬	6,237,301.25	1,765,504.79
2. 托管费	1,890,091.23	535,001.55
3. 销售服务费	4,725,228.19	1,337,503.78
4. 交易费用	75.00	1,000.00
5. 利息支出	1,155,696.81	222,102.83
其中:卖出回购金融资产支出	1,155,696.81	222,102.83
6. 其他费用	434,532.65	374,522.34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	62,741,279.10	21,754,017.43
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	62,741,279.10	21,754,017.43

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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	2,078,354,314.15	-	2,078,354,314.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	62,741,279.10	62,741,279.10
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)	3,131,189,928.65	-	3,131,189,928.65
其中:1.基金申购款	11,481,584,714.56	-	11,481,584,714.56
2.基金赎回款	-8,350,394,785.91	-	-8,350,394,785.91
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)	-	-62,741,279.10	-62,741,279.10
五、期末所有者权益(基金净值)	5,209,544,242.80	-	5,209,544,242.80
项目	上年度可比期间 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

注: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2016年3月25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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协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2015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2015年12月31日的财务状况以及2015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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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
上海悦懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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
山东省国际信托股份有限公司("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:1. 本基金的基金管理人泰信基金管理有限公司的股东山东省国际信托有限公司于2015年7月30日变更注册为山东省国际信托股份有限公司。

2.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

本基金本期未及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

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交易。

7.4.8.1.3 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。