泰信天天收益货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018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:2018年8月25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2018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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2018年1月1日起至2018年6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信天天收益货币市场基金		
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	2016年5月17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	419,801,252.04份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
下属分级基金的交易代码:	290001	002234	002235
报告期末下属分级基金的份额总额	110,749,401.90份	309,048,991.07份	2,859.07份

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	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦东南路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

基金级别	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	2,143,642.12	12,363,793.61	69.80
本期利润	2,143,642.12	12,363,793.61	69.80
本期净值收益率	1.8557%	1.9769%	1.8439%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
期末基金资产净值	110,749,401.90	309,048,991.07	2,859.07
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注:1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于2004年2月10日正式生效，于2016年5月17日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加B类、E类份额。

2、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，由于货币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。

3、上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用(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。

4、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

泰信天天收益A

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	0.2936%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.1811%	0.0037%
过去三个月	0.8859%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.5446%	0.0024%
过去六个月	1.8557%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.1769%	0.0023%
过去一年	3.8031%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.4344%	0.0025%
过去三年	9.4477%	0.0047%	4.1842%	0.0003%	5.2635%	0.0044%
自基金合同生效起至今	52.5569%	0.0064%	31.7605%	0.0020%	20.7964%	0.0044%

泰信天天收益B

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	0.3133%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.2008%	0.0037%
过去三个月	0.9461%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.6048%	0.0024%
过去六个月	1.9769%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.2981%	0.0023%
过去一年	4.0517%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.6830%	0.0025%
自基金合同生效起至今	7.6019%	0.0035%	2.9062%	0.0000%	4.6957%	0.0035%

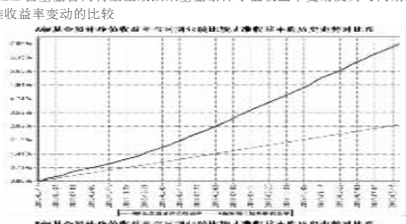
泰信天天收益E

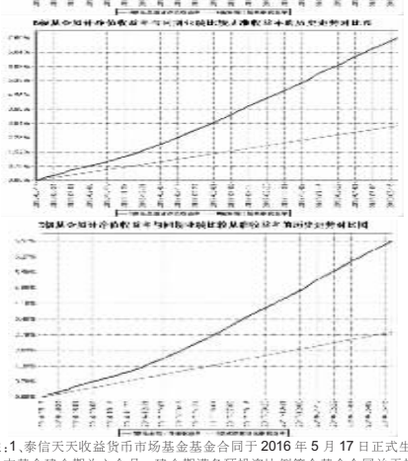
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2918%	0.0037%	0.1125%	0.0000%	0.1793%	0.0037%
过去三个月	0.8798%	0.0024%	0.3413%	0.0000%	0.5385%	0.0024%
过去六个月	1.8439%	0.0023%	0.6788%	0.0000%	1.1651%	0.0023%
过去一年	3.7725%	0.0025%	1.3687%	0.0000%	2.4038%	0.0025%
自基金合同生效起至今	6.9693%	0.0036%	2.9062%	0.0000%	4.0631%	0.0036%

注:1、泰信天天收益开放式证券投资基金合同于2004年2月10日正式生效，于2016年5月17日变更为泰信天天收益货币市场基金，并增加B类、E类份额。

2、本基金建仓期为六个月。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。本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。

3.2.2 自基金合同转型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、泰信天天收益货币市场基金合同于2016年5月17日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。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。本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。

§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)自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦37层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东南路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:万众

总经理:葛航

电话:021-20899188

传真:021-20899008

联系人:桃慧

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、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2018年6月底，公司有正式员工100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2018年6月30日，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、泰信监筹精选混合、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、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合、泰信竞争优选共21只开放式基金及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		
何俊春女士	基金投资部固定收益投资总监、本基金基金经理、泰信双利债券、泰信双息双利债券、泰信增强收益、泰信周期回报、泰信鑫益定期开放债券、泰信利鑫混合基金经理	2016年10月11日	-	22年	工商管理硕士。具有基金从业资格。曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司,齐鲁证券上海斜土路营业部。2002年12月加入泰信基金管理有限公司。先后担任泰信天天收益基金交易员、交易主管。泰信天天收益基金经理。自2008年10月10日起担任泰信双息双利债券基金经理;自2009年7月29日起担任泰信债券增强收益基金经理;自2012年10月25日起担任泰信债券周期回报基金经理;自2013年7月17日起担任泰信鑫益定期开放债券基金经理,自2017年5月25日起任泰信鑫利混合基金经理。现同时担任基金投资部固定收益投资总监。
于瑞女士	本基金经理	2017年12月14日	-	7年	复旦大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利管理服务有限公司,2013年加入泰信基金管理有限公司,历任交易员、交易部总监助理、研究部研究员兼泰信天天收益、周期回报基金经理助理。

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为公告日。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》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

2018年一季度是债券供给传统淡季，监管也并无继续加码；中美贸易摩擦升级，市场对经济基本面和出口增速放缓有所担忧，一季度各期限债券收益率下行阻力较小，尤其短端债券收益率下行较快。货币政策真正转为稳健中性，在松紧适度、合理稳定的流动性背景下，债券市场情绪迎来了一波修复。一季度末一年期国开债、AAA短融和AA+短融较2017年年底分别下行67bp、47bp和53bp。二季度六月份的降准，使货币政策边际宽松得到确认，在流动性环境进一步改善的主线下，债券收益率迎来快速下行行情；经济基本面方面中美贸易摩擦有所反复，5月社融、固定资产投资、进出口等经济数据小幅走弱、6月PMI数据也较弱，经济基本面对收益率下行形成一定支撑，各期限债券收益率本季度以下行为主。二季度债市信用风险事件时有发生，导致市场风险偏好走低，利率债、高等级信用债和中低等级信用债走势出现显著分化，信用利差有所走扩。二季度内的两次降准操作后，短端收益率出现较为的明显下行，二季度末较一季度末一年期国开债、AAA短融和AA+短融分别下行33bp、21bp和7bp。

天天收益基金在一季度适当拉长了组合久期、在二季度维持中性策略；组合集中配置了信用评级较高、流动性好的同业存单和高评级短融，在收益率下行的行情中增厚了资本利得收益。另外根据基金规模和市场环境的变化，动态择时调整正逆回购资产配置比例，使得基金在面临市场波动和规模变化时仍具有较好的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期泰信天天收益A的基金份额净值收益率为1.8557%，本报告期泰信天天收益B的基金份额净值收益率为1.9769%，本报告期泰信天天收益E的基金份额净值收益率为1.8439%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，货币政策明确转向宽松，流动性环境继续好转，短端收益率或维持低位震荡。贸易战有所反复，市场对下半年经济的担忧也进一步确认，对债券收益率下行形成支撑。监管方面，去杠杆逐步向稳杠杆过渡，市场风险偏好在缓慢提升，信用利差有修复空间。总体而言，下半年在保证基金流动性的前提下兼顾收益，继续维持中性配置策略，在规避信用风险的前提下选取配置高评级、流动性好的投资标的。

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。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:

张敬燕女士，硕士。2017年加入泰信基金管理有限公司，现任公司风险管理部副总监。

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，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金经理。

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。

4.7 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A类份额收益分配共2,143,642.12元;B类份额收益分配共12,363,793.61元;E类份额收益分配共69.80元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§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")在泰信天天收益货币市场基金(原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:泰信天天收益货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	49,617,347.86	7,648,283.76
结算备付金	522,727.27	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	278,601,807.67	525,790,502.39
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	278,601,807.67	525,790,502.39
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	88,406,558.11	553,691,470.54
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,884,226.90	2,768,803.24
应收股利	-	-
应收申购款	2,751,820.22	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	421,784,488.03	1,089,899,059.93
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	-	-
应付管理人报酬	171,761.28	215,815.16
应付托管费	52,048.91	65,398.55
应付销售服务费	25,563.01	32,813.33
应付交易费用	21,928.63	27,758.76
应交税费	628,500.00	628,500.00
应付利息	-	-
应付利润	910,934.60	2,037,282.83
递延所得税负债	-	-
其他负债	172,499.56	339,000.00
负债合计	1,983,235.99	3,346,568.63
所有者权益:		
实收基金	419,801,252.04	1,086,552,491.30
未分配利润	-	-
所有者权益合计	419,801,252.04	1,086,552,491.30
负债和所有者权益总计	421,784,488.03	1,089,899,059.93

注:报告截止日2018年6月30日，泰信天天收益A基金份额净值1.0000元，基金份额总额110,749,401.90份;泰信天天收益B基金份额净值1.0000元，基金份额总额309,048,991.07份;泰信天天收益E基金份额净值1.0000元，基金份额总额2,859.07份。泰信天天收益货币份额总额合计为419,801,252.04份。

6.2 利润表

会计主体:泰信天天收益货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	16,562,091.11	27,759,975.63
1.利息收入	16,388,347.47	27,077,655.84
其中:存款利息收入	878,868.02	2,049,254.21
债券利息收入	11,106,288.36	15,308,039.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,403,191.09	9,720,361.66
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	173,743.64	682,319.79
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	173,743.64	682,319.79
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	2,054,585.58	3,581,306.93
1、管理人报酬	1,224,133.11	2,245,650.74
2、托管费	370,949.54	680,500.16
3、销售服务费	175,144.90	195,328.25
4、交易费用	134.99	-
5、利息支出	84,318.26	255,458.63
其中:卖出回购金融资产支出	84,318.26	255,458.63
6、其他费用	199,904.78	204,369.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	14,507,505.53	24,178,668.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	14,507,505.53	24,178,668.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:泰信天天收益货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	1,086,552,491.30	-	1,086,552,491.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	14,507,505.53	14,507,505.53
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)	-666,751,239.26	-	-666,751,239.26
其中:1.基金申购款	943,608,209.50	-	943,608,209.50
2.基金赎回款	-1,610,359,448.76	-	-1,610,359,448.76
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)	-	-14,507,505.53	-14,507,505.53
五、期末所有者权益(基金净值)	419,801,252.04	-	419,801,252.04
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	2,058,835,008.40	-	2,058,835,008.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	24,178,668.70	24,178,668.70
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)	-840,192,255.88	-	-840,192,255.88
其中:1.基金申购款	2,350,065,181.85	-	2,350,065,181.85
2.基金赎回款	-3,190,257,437.73	-	-3,190,257,437.73
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)	-	-24,178,668.70	-24,178,668.70
五、期末所有者权益(基金净值)	1,218,642,752.52	-	1,218,642,752.52

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_____ _____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泰信天天收益货币市场基金(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2016年5月11日《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，依据基金份额持有人大会决议，自2016年5月17日起，本基金更名为泰信天天收益货币市场基金，并将基金份额分为A类、B类和E类。三类基金份额根据基金份额费率结构、申购(赎回)各类基金份额的最低金额限制及在销售机构保留的各类基金份额的最低份额限制不同而区分，各份额类别基金资产合并运作，单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。本基金E类基金份额目前仅限通过直销渠道及公司指定的电子交易平台进行申购、赎回和转换等业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包含超级短期融资券)、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具(但须符合中国证监会的有关规定)。根据基金管理人2017年9月4日发布的《关于泰信天天收益货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告》及修改后的《泰信天天收益货币市场基金基金合同》，本基金的投资范围修改为:本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的原业绩比较基准为半年期银行定期存款税后利率;自2016年5月17日起，本基金业绩比较基准变更为七天通知存款利率(税后)。

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日及以后期间颁布的《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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰信天天收益货币市场基金基金合同》和中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年6月30日的财务状况以及2018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须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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳;已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，应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。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
上海锐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: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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,224,133.11	2,245,650.74
其中:支付销售机构的客户维护费	203,782.72	261,383.74

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X0.33%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	370,949.54	680,500.16

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X0.1%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E	合计
泰信基金管理有限公司	5,030.82	23,163.34	5.25	28,199.41
中国银行	34,645.98	593.34	-	35,239.32
合计	39,676.80	23,756.68	5.25	63,438.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	泰信天天收益A	泰信天天收益B	泰信天天收益E	合计
泰信基金管理有限公司	6,349.28	-	-	6,349.28
中国银行	37,416.68	2,685.36	-	40,102.04
合计	43,765.96	2,685.36	-	46,451.32

注:根据《泰信天天收益开放式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，自2016年5月17日起，泰信天天收益开放式证券投资基金更名为泰信天天收益货币市场基金，且分为A类、B类和E类，其中A类和E类销售服务费率为0.25%，B类销售服务费费率为0.01%，调整后，各类别的销售服务费按前一日基金资产净值的适用年费率计提，