

泰信天天收益开放式证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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
报告送出日期:2015年10月24日§1 重要提示
本基金管理人的董事会及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责任。
本基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期财务报表未经审计。

本报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	泰信天天收益货币
交易代码	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
报告期末基金份额总额	2,824,370,966.41份

注:1.表中报告期内购回或赎回金额为报告期内每个交易日的基金余额占基金资产净值比例的合计数，报告期内购回或赎回金额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日基金余额占基金资产净值比例的简单平均值。
2.本报告期内本产品持有的国债面值比例为0%，没有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务报表未经审计。

本报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

§3 基金主要财务指标和基金净值表现						
3.1 主要财务指标						
单位:人民币元						
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)					
1. 本期已实现收益	14,918,601.24					
2. 本期利润	14,918,601.24					
3. 期末基金资产净值	2,824,370,966.41					
注:1.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，公允价值变动收益为0%，本期已实现收益和本期利润的金额相等。 2.上述基金财务指标不包括持有人申购或赎回本基金的各项费用(例如基金转换费等)，计入费用后实际收益水平将低于所列数据。						
3.2 基金主要财务指标按月度折算百分比及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值增长率为0%的折算率(%)	净值增长率为2%的折算率(%)	净值增长率为3%的折算率(%)	①-③	②-④	
过去三个月	0.731%	0.699%	0.436%	0.0003%	0.261%	0.0006%
注:本基金业绩比较基准为:半年期银行定期存款税后利率+0.2%。定期存款利率变动时，业绩比较基准将随之调整。						
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.本基金合同基金合同期内三个会计月内为建仓期。建仓期间，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资产总值的比重波动范围分别为：短期债券20%-60%，债券回购0%-80%，银行存款0%-70%，现金0%-60%。						
§4 管理人报告						
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介						
姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明	说明			
胡庆东先生	本基金经理	2014年9月30日	- 8年 注:1.以上日期为公司公告的日期。 2.证券从业从基金管理公司证券从业人员资格管理办法》的相关规定。 3.对本基金的管理人和基金托管人履行的监督情况。 在本报期内,本公司基金经理严遵遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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,本基金管理人勤勉尽责、取信于市场,诚信于社会的原 则和运用基金资产。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取最大利益,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 公平交易制度的执行情况 4.3.1 平等交易制度的执行情况 本基金严格按照《公开募集证券投资基金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《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相关的各个环节,从研究、投资、交易、合规性监控,以及交易记录报告、风险控制和风险管理等方面,确保基金在公平交易制度下运行。 本公司所进行的研究对公司的所有产品公开开放,基金管理人严格遵守公平、公正的原则下达成投资指令,所有投资指令在集中交易室下达,执行投资交易公平公开,投资交易监控贯穿于整个投资过程。 本报告期内,投资交易监控与公平交易分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体运行良好。 4.3.2 异常交易行为的专项说明 4.4 报告期内本基金的公平交易说明 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析 4.4.2 报告期内本基金投资组合运作情况 4.5 其他资产构成	2007年7月至2012年12月先后任职于国泰证券、海通证券,申银万国基金管理有限公司,任研究员、基金经理、基金经理助理、基金经理,2013年1月加入泰信基金管理有限公司,任中台交易部任高级交易员,2014年9月30日任基金经理。 注:本基金持有的银行存款和结算备付金以活期存款为主,定期存款为辅,并根据基金合同的约定定期开放基金定期报告。		
注:1.以上日期为公司公告的日期。 2.证券从业从基金管理公司证券从业人员资格管理办法》的相关规定。 3.对本基金的管理人和基金托管人履行的监督情况。 在本报期内,本公司基金经理严遵遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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,本基金管理人勤勉尽责、取信于市场,诚信于社会的原 则和运用基金资产。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取最大利益,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 公平交易制度的执行情况 4.3.1 平等交易制度的执行情况 本基金严格按照《公开募集证券投资基金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《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相关的各个环节,从研究、投资、交易、合规性监控,以及交易记录报告、风险控制和风险管理等方面,确保基金在公平交易制度下运行。 本公司所进行的研究对公司的所有产品公开开放,基金管理人严格遵守公平、公正的原则下达成投资指令,所有投资指令在集中交易室下达,执行投资交易公平公开,投资交易监控贯穿于整个投资过程。 本报告期内,投资交易监控与公平交易分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体运行良好。 4.3.2 异常交易行为的专项说明 4.4 报告期内本基金的公平交易说明 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析 4.4.2 报告期内本基金投资组合运作情况 4.5 其他资产构成	注:本基金持有的银行存款和结算备付金以活期存款为主,定期存款为辅,并根据基金合同的约定定期开放基金定期报告。					
5.1 报告期末基金资产组合情况						
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)			
1 固定收益投资		1,473,909,320,000	51.63			
其中:债券		1,473,909,320,000	51.63			
资产支持证券		-	-			
2 其他资产		428,001,262,60	15.05			
其中:应收利息		-	-			
3 衍生工具		919,881,601,32	32.35			
4 其他资产		21,745,502,00	0.76			
5.2 报告期债券回购融资情况		2,843,943,737,36	100.00			
注:1.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。 2.所述基金业绩指标不包括持有人申购或赎回本基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数据。						
3.2 基金主要财务指标						
阶段	净值增长率为0%的折算率(%)	净值增长率为2%的折算率(%)	净值增长率为3%的折算率(%)	①-③	②-④	
过去三个月	-33.48%	4.07%	-21.11%	2.51%	-12.27%	1.56%
注:本基金业绩比较基准为:7%×沪深300指数+25%×中证全债指数						
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
注:1.泰信天天收益开放式证券投资基金合同于2013年2月7日正式生效。本基金自2015年8月7日起变更为货币基金。 2.本基金的建仓期为六个月。建仓期间,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金将基金						

信息披露 Disclosure

泰信先行策略开放式证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:泰信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24日§1 重要提示
本基金管理人的董事会及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责任。
本基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同于2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期财务报表未经审计。

本报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	泰信先行策略
交易代码	290002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月21日
报告期末基金份额总额	71,249,143,297.05份

注:1.表中报告期内购回或赎回金额为报告期内每个交易日的基金余额占基金资产净值比例的合计数,报告期内购回或赎回金额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日基金余额占基金资产净值比例的简单平均值。
2.本报告期内本产品持有的国债面值比例为0%,没有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务报表未经审计。

本报告期为2015年7月1日起至9月30日止。

§3 基金主要财务指标和基金净值表现						
3.1 主要财务指标						
单位:人民币元						
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)					
1. 本期已实现收益	-10,425,223,070					
2. 本期利润	-23,229,011,45					
3. 期末基金资产净值	69,006,730,705					
4. 期末基金份额净值	-0.167					
5. 期末基金资产净值	1,396					
注:1.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,公允价值变动收益为0%,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 2.上述基金财务指标不包括持有人申购或赎回本基金的各项费用(例如基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数据。						
3.2 报告期主要财务指标按月度折算百分比及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值增长率为0%的折算率(%)	净值增长率为2%的折算率(%)	净值增长率为3%的折算率(%)	①-③	②-④	
过去三个月	-33.48%	4.07%	-21.11%	2.51%	-12.27%	1.56%
注:本基金业绩比较基准为:7%×沪深300指数+25%×中证全债指数						
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
注:1.泰信先行策略开放式证券投资基金合同于2013年2月7日正式生效。本基金自2015年8月7日起变更为货币基金。 2.本基金的建仓期为六个月。建仓期间,基金投资组合各项比例符合基金合同的约定。本基金将基金						

§4 管理人报告				
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明	说明	
胡庆东先生	本基金经理	2014年9月30日	- 8年 注:1.以上日期为公司公告的日期。 2.证券从业从基金管理公司证券从业人员资格管理办法》的相关规定。 3.对本基金的管理人和基金托管人履行的监督情况。 在本报期内,本公司基金经理严遵遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,本基金管理人勤勉尽责、取信于市场,诚信于社会的原 则和运用基金资产。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取最大利益,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 公平交易制度的执行情况 4.3.1 平等交易制度的执行情况 本基金严格按照《公开募集证券投资基金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《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相关的各个环节,从研究、投资、交易、合规性监控,以及交易记录报告、风险控制和风险管理等方面,确保基金在公平交易制度下运行。 本公司所进行的研究对公司的所有产品公开开放,基金管理人严格遵守公平、公正的原则下达成投资指令,所有投资指令在集中交易室下达,执行投资交易公平公开,投资交易监控贯穿于整个投资过程。 本报告期内,投资交易监控与公平交易分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为,公平交易制度整体运行良好。 4.3.2 异常交易行为的专项说明 4.4 报告期内本基金的公平交易说明 4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析 4.4.2 报告期内本基金投资组合运作情况 4.5 其他资产构成	2007年7月至2012年12月先后任职于国泰证券、海通证券,申银万国基金管理有限公司,任研究员、基金经理、基金经理助理、基金经理,2013年1月加入泰信基金管理有限公司,任中台交易部任高级交易员,2014年9月30日任基金经理。 注:本基金持有的银行存款和结算备付金以活期存款为主,定期存款为辅,并根据基金合同的约定定期开放基金定期报告。
注:1.以上日期为公司公告的日期。 2.证券从业从基金管理公司证券从业人员资格管理办法》的相关规定。 3.对本基金的管理人和基金托管人履行的监督情况。 在本报期内,本公司基金经理严遵遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,本基金管理人勤勉尽责、取信于市场,诚信于社会的原 则和运用基金资产。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取最大利益,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				