泰信天天收益开放式证券投资基金更新招募说明书摘要

2008年第2号

一、重要提示

泰信天天收益开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）2003年12月26日经中国证监会证监基金字[2003]147号文批准公开发行。

本基金为契约型开放式，基金合同于2004年2月10正式生效。基金管理人及注册登记机构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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，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，也不保证最低收益。投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本更新招募说明书。

本更新招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

说明：本摘要摘自《泰信天天收益开放式证券投资基金更新招募说明书(2008年第2号)》。本更新招募说明书所载内容截止日期为2008年8月10日，有关财务数据（未经审计）和净值表现及投资组合数据的截止日为2008年6月30日。原招募说明书及其历次更新与本更新招募说明书不一致的，以本更新招募说明书为准。投资者欲了解更详细的资料，请登录本基金管理人的公司网站（www.ftfund.com）查阅全文。

二、基金管理人

（一）基本情况

基金管理人名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

成立日期：2002年5月8日

法定代表人：朱崇利

总经理：高清海

电话：021-50372168

传真：021-50372197

联系人：王伟毅

发展沿革

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.,Ltd.）是由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日经中国证监会批准筹建，2003年5月8日获准开业，是国内实施“好人举手制”以来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。

（二）注册资本、股权结构

泰信基金管理有限公司注册资本2亿元人民币，股权结构如下：

股东单位名称	现金出资金额	股权比例
山东省国际信托有限公司	9000万元	45%
江苏省投资管理有限责任公司	6000万元	30%
青岛国信实业有限公司	5000万元	25%
合计	2亿元	100%

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

（1）董事会成员

朱崇利先生，董事长，EMBA，高级经济师；曾任山东省计委投资处处长、山东省国际信托投资有限公司党组副书记兼副总经理、山东省鲁信投资控股有限公司党组副书记、山东省国际信托投资有限公司董事长，现任山东省鲁信集团控股有限公司副总经理。

黄东峰先生，副董事长，大学本科，经济师；曾任江苏省计划与经济委员会基建处科长、江苏省投资公司综合计划处主任、江苏省国际信托投资公司综合计划部经理、香港博腾国际投资贸易有限公司总经理，现任江苏省国信资产管理集团有限公司副总经理，江苏省国际信托投资有限责任公司董事长。

李建国先生，董事，硕士；曾任青岛市计委投资处处长，现任青岛国信实业有限公司副总经理。

张效农先生，董事，工学硕士，高级经济师；曾任山东省国际信托投资公司投资部副经理、项目评审部副经理、青岛华和国际租赁公司副总经理、法国巴黎鲁新公司副总经理，现任山东省国际信托投资有限公司投资部高级业务经理。

张中秋先生，独立董事，大学本科；曾任中葡联合联络小组中方驻澳代表、澳门特别行政区筹备委员会经济小组工作成员，现任中国建设银行总行香港华建国际金融投资公司执行董事、副总经理。

刘学涌先生，独立董事，大学本科，高级经济师；曾任中国人民保险公司总公司天津分公司副总经理、中国人民保险公司总公司人身险部总经理、中国人民保险公司总公司第一副总经理、华泰财产保险公司副董事长兼总经理。

刘俊海先生，独立董事，博士；曾任中国社会科学院法学所研究员、研究生院法学系教授、中国法学会商法学研究会副秘书长、中国消费者协会理事，现任中国人民大学法学院教授，博士生导师；中国人民大学商法研究所所长。

（2）监事会成员

牟东明先生，监事长，EMBA，高级经济师；曾任青岛国信实业公司研究发展部经理，现任青岛国信实业公司总经理助理兼青岛国信体育产业有限公司总经理。

戴平先生，监事，大专文化，工程师；曾任江苏省投资公司科长、江苏省计划干部培训中心办公室副主任、中外合资东西方投资咨询公司副总经理、江苏省机电轻纺投资公司投资部经理、江苏省投资管理公司工业部副经理，现任江苏省投资管理有限责任公司综合投资部副经理。

桑维英女士，监事，MBA，15年证券从业经验。2002年10月加入泰信基金管理有限公司。历任监察稽核部经理、综合管理部经理、行政总监，现任泰信基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书。

（3）公司高级管理人员

朱崇利先生，董事长，EMBA，高级经济师；曾任山东省计委投资处处长、山东省国际信托投资有限公司党组副书记兼副总经理、山东省鲁信投资控股有限公司党组副书记、山东省国际信托投资有限公司董事长，现任山东省鲁信集团控股有限公司副总经理。

高清海先生，总经理，经济学博士；曾任新加坡鲁信（亚洲）投资公司董事、济南百灵信息科技有限公司董事、山东省国际信托公司投资银行业务部经理。

吴胜光先生，督察长，硕士，高级经济师；曾任南京大学城市与资源系副主任、江苏省国际信托投资公司投资银行部业务二部经理、信泰证券有限责任公司投资银行部副总经理。

2、基金管理小组成员

何俊春女士，基金经理。大学本科毕业，MBA在读。11年证券从业经历，曾任职于上海鸿安投资咨询有限公司、齐鲁证券有限责任公司。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，泰信天天收益基金基金经理助理，2007年2月起担任本基金基金经理。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
王鹏	2005年5月17日至2008年3月20日
张翎	2004年7月9日至2005年5月17日
徐军	2004年2月10日至2004年7月9日

3、投资决策委员会成员名单

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会包括：

高清海先生，公司总经理，投资决策委员会主任；

崔海鸿先生，公司总经理助理兼泰信优势增长基金基金经理；

王鹏先生，基金投资总监，兼任泰信先行策略、优势增长基金基金经理；

邓良毅，公司研究总监；

梁剑先生，研究部经理兼金融工程部经理，高级金融工程师；

何俊春女士，泰信天天收益基金基金经理。

另外，督察长、监察稽核部经理列席会议。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：宁敏

电话：（010）66594977

传真：（010）66594942

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

法定代表人：朱崇利

总经理：高清海

成立日期：2003年5月8日

电话：021-50372168

传真：021-50372269

联系人：王伟毅

2、代销机构：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

3、代销机构：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路18号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：蒋超良

电话：021-58781234

传真：021-58408836

联系人：王玮

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

4、代销机构：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：(0755)83195834，82090060

传真：(0755)83195049，82090817

客户服务热线：95555

联系人：朱虹、刘薇

网址：www.cmbchina.com

5、代销机构：北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

办公地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

法定代表人：阎冰竹

电话：(010)66223248

联系人：杨永杰

客户服务电话：(010)96169

6、代销机构：中国民生银行

住所：北京市西城复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：（010）58351666

传真：（010）83914283

联系人：李群

客服电话：95568

公司网站：www.cmbc.com.cn

7、代销机构：深圳发展银行

注册地点：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼（Frank N.Newman）

联系人：周勤

电话：0755-82088888

传真：0755-82080714

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

8、代销机构：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市银城中路168号上海银行大厦29层

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：丙敏祺

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

9、代销机构：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

联系电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸

客户服务电话：400-8888-001、021-95533

网址：www.htsec.com

10、代销机构：中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130588

传真：010-65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

11、代销机构：广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555305

联系人：肖中梅

开放式基金咨询电话：020-87555888转各营业网点

网址：www.gf.com.cn

12、代销机构：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务电话：4008888111、95565

13、代销机构：兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：021-68419393-1098

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳

网址：www.syzq.com.cn

14、代销机构：北京证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区车公庄西路乙19号华通大厦B座10-16层

法定代表人：凌新源

电话：010-68431166

客户服务电话：010-68431166-8010

联系人：白源

公司网站：www.bjzq.com.cn

15、代销机构：华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-248

传真：025-84579763

联系人：张小波

客户服务电话：025-95597

网址：www.htsc.com.cn

16、代销机构：汉唐证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦24、25层

法定代表人：吴克龄

电话：0755-26936207

传真：0755-26936223

联系人：姚文强

特别说明：根据中国证监会基金部通知[2006]1号文《关于暂停阜发、汉唐证券公司基金代销业务资格的通知》要求，本基金管理人已于2006年1月27日暂停办理汉唐证券公司提交的申购业务。详情请见2005年1月27日刊登在《中国证券报》上的《泰信基金管理有限公司关于暂停办理汉唐证券公司提交的申购业务的公告》。

17、代销机构：民生证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室

法定代表人：岳献春

电话：010-85252656

传真：010-85252655

联系人：赵明

客户服务电话：400-0619-8888

公司网址：www.mszq.com

18、代销机构：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：肖时庆

电话：010-66568047

传真：010-66568536

联系人：李洋

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-8888-888

19、代销机构：东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22-29层

法定代表人：王益民

客户服务电话：021-95503

电话：021-63325888-3108

传真：021-63326173

联系人：吴宇

公司网站：www.dfzq.com.cn

20、代销机构：财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：周晖

电话：0731-4403319

传真：0731-4403439

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

21、代销机构：华安证券有限责任公司

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号

法定代表人：李工

联系人：唐冰、马文玲

电话：0551-5161671、670

传真：0551-5161672

公司网址：www.hazq.com.cn

22、代销机构：湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地点：上海市浦东银城东路139号华能联合大厦5楼

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518-8503

传真：021-68865680

联系人：钟康莹

开放式基金客服电话：400-8881-551

网址：www.xcsc.com　　www.eestart.com

23、代销机构：新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区月坛大厦15层

法定代表人：马金声

客服热线：010-68084591

传真：010-68084986

联系人：戴荻

公司网址：www.xsdzq.cn

客户服务电话：400-698-9898

24、代销机构：信泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市长江路88号国信大厦18、19楼

法定代表人：钱凯法

电话：025-84784836

传真：025-84784741

联系人：万明

客户服务电话：400-8000-918

网址：www.thope.com

25、代销机构：渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济术开发区第一大街29号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

客户服务电话：022-28455588

网址：www.bhzq.com.cn

26、代销机构：中信证券股份有限公司

注册地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

27、代销机构：山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686709

联系人：张治国

客户服务电话：400-6661-618

网址：www.i618.com.cn

28、代销机构：中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

网址：www.zxwt.com.cn

29、代销机构：联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马耀明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：400-8888-555

网址：www.lhzq.com

30、代销机构：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：021-68763879

传真：021-68765296

联系人：张勤

网址：www.axzq.com.cn

客户服务电话：020-96210

31、代销机构：万联证券有限责任公司

注册地址：广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人：李舫金

电话：020-37865188

传真：020-37865008

联系人：李俊

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

32、代销机构：中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：唐新宇

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：张静

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com.cn

33、代销机构：平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：陈敬达

电话：0755-82450826

传真：0755-82433794

联系人：袁月

网址：www.PA18.com

34、代销机构：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

电话：021-50818887

传真：021-68815009

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：10108998

35、代销机构：上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：蒋元真

电话：021-51539888

传真：021-33303378

联系人：谢秀峰

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

36、代销机构：国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场45层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：王少华

电话：010-84183389

传真：010-64482090

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：800-810-8809

37、代销机构：江南证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：姚江涛

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

网址：www.scstock.com

38、代销机构：金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

法定代表人：陆涛

电话：400-8888-228

传真：0755-83025625

联系人：金春

网址：www.jyzq.cn

39、代销机构：德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：www.dbtebon.com.cn

本基金管理人可根据有关法律法规规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并予以公告。

（二）基金注册登记机构

注册登记机构名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦42层

法定代表人：朱崇利

总经理：高清海

成立日期：2003年5月8日

电话：021-50372168

传真：021-50372269

联系人：韩波

（三）出具律师意见书的律师事务所

名称：中伦金通律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建外东环南路2号招商局大厦12层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号2801-2810室

负责人：张德荣

联系电话：021-50372668、021-50372212

传真：021-50372678

联系人：廖海

经办律师：廖海

注：联系人及经办律师廖海律师已不在中伦金通律师事务所供职。

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所

住所：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-61238888

传真：021-61238800

联系人：金毅

经办注册会计师：汪棣　金毅

五、基金的名称

基金名称：泰信天天收益开放式证券投资基金

基金简称：泰信天天收益

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资方向

本基金投资于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、债券回购和同业存款等。经中国证监会、中国人民银行等部门批准后本基金可以投资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%。

九、基金的投资策略

本基金运用久期控制、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。

（一）决策依据

1、国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

2、政治形势、政策趋势和宏观经济形势；

3、货币政策、利率趋势；

4、证券市场发展趋势。

（二）决策程序

本基金参与投资决策和操作程序的机构和部门包括：投资决策委员会、投资部、研究部、金融工程部。具体程序如下：

1、金融工程部提出投资基准建议，经投资决策委员会批准后实施；

2、利用短期金融工具的历史数据库，初选出符合投资基准的投资品种；

3、研究部经过深入研究后，精选投资品种，构建证券投资备选库；

4、基金经理构造基金组合计划；

5、金融工程部对投资组合进行风险收益分析，提出修正意见；

6、研究部宏观经济分析师和市场策略分析师通过宏观、中观分析，对投资组合的资产配比提出意见；

7、投资决策委员会最后确定投资组合方案；

8、基金经理实施投资组合方案；

9、金融工程部对投资组合进行跟踪评估，定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会提供基金投资组合风险评估报告并提出风险控制建议；

10、基金经理根据市场环境的变化和实际需要调整投资组合，但调整投资组合应按授权权限和批准程序进行。

（三）投资组合管理的方法和标准

1、投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

2、存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；

3、本基金投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%；

4、在全国银行间市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%；

5、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；

6、本基金在成立后三个月内达到上述规定的投资比例；

7、因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。

十、基金的业绩比较标准

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。

本基金为类储蓄品种，流动性、安全性都较股票型基金和债券型基金高，故采用半年期银行定期存款税后利率作为业绩比较基准。

十一、基金的风险收益特征

本基金属于风险较低、预期收益率较低、流动性较强的证券投资基金品种。

十二、基金的投资组合报告(未经审计)

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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同已于2008年8月22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。

（一）截至2008年6月30日基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	958,385,750.24	40.78
买入返售证券	1,241,803,302.70	52.85
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	139,979,944.37	5.96
其他资产	9,713,804.49	0.41
合计	2,349,882,801.80	100.00

（二）截至2008年6月30日债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资情况	999,996,936.00	0.52
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00
2	报告期末债券回购融资情况	0.00	0.00
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

注：

上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

（三）截至2008年6月30日基金投资组合平均剩余期限

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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

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天内	56.36%	0.00%
2	30天(含)－60天	5.51%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.82%	0.00%
3	60天(含)－90天	0.00%	0.00%
4	90天(含)－180天	29.35%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.54%	0.00%
5	180天(含)－397天(含)	8.56%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.43%	0.00%
	合计	99.78%	0.00%

（四）截至2008年6月30日债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	金融债券	430,888,443.29	18.37
	其中：政策性金融债	280,100,094.20	11.94
3	央行票据	373,669,936.14	15.93
4	企业债券	153,827,370.81	6.56
5	其他	0.00	0.00
	合计	958,385,750.24	40.87
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	229,629,875.13	9.79

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	07进出14	2,300,000		230,101,307.19	9.81
2	07央票130	2,000,000		196,845,861.31	8.39
3	07央票136	1,800,000		176,824,074.83	7.54
4	04建行03浮	1,514,000		150,788,349.09	6.43
5	05中信债1	600,000		59,619,414.56	2.54
6	08华电CP02	500,000		50,001,189.93	2.13
7	03进出01	500,000		49,998,787.01	2.13
8	07上药CP02	250,000		24,984,654.84	1.07
9	06首都机场债	200,000		19,222,111.48	0.82

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

（五）“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	20
报告期内偏离度的最高值	-0.0141%
报告期内偏离度的最低值	-0.3323%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2035%

（六）报告期末资产支持证券用在基金净值计算中的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细。

报告期末本基金未持有资产支持证券。

（七）投资组合报告附注

1、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。

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序：无。

3、其他资产的构成：

序号	其他资产	金额（元）
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	9,147,072.05
4	应收申购款	566,732.44
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
	合　计	9,713,804.49

八、开放式基金份额变动

2008年4月1日——2008年6月30日　　单位：份

本报告期初基金份额总额	5,126,606,773.14
本报告期间基金总申购份额	2,504,221,818.52
本报告期间基金总赎回份额	5,285,615,057.38
本报告期末基金份额总额	2,345,213,534.28

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金合同生效日为2004年2月10日。基金合同生效以来（截至2008年6月30日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

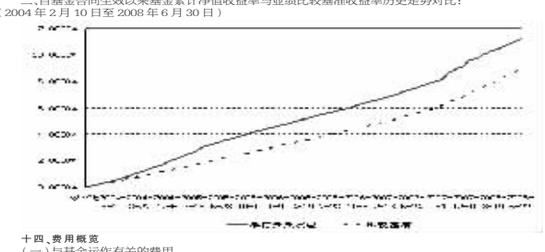
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
20080601-20080630	0.2315%	0.0004%	0.2952%	0.0000%	-0.0637%	0.0004%
20080401-20080630	0.7003%	0.0008%	0.8953%	0.0000%	-0.1950%	0.0008%
20080101-20080630	1.4496%	0.0040%	1.7906%	0.0000%	-0.3410%	0.0040%
20070101-20071231	2.9256%	0.0057%	2.4441%	0.0016%	0.4815%	0.0041%
20060101-20061231	1.8763%	0.0026%	1.7093%	0.0002%	0.1670%	0.0024%
20050101-20051231	2.4032%	0.0021%	1.6687%	0.0000%	0.7345%	0.0021%
20040210-20041231	2.0901%	0.0012%	1.3757%	0.0002%	0.7144%	0.0010%
20040210-20080630	11.2097%	0.0036%	8.9756%	0.0017%	2.2341%	0.0019%

重要说明：

本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配。每月10日（遇假日顺延）将投资人账户累计的收益结转为其基金份额，计入该投资人账户的本基金份额中。

二、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比：

（2004年2月10日至2008年6月30日）



十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

3、其它与基金运作有关的费用

（1）投资交易费用；

（2）基金信息披露费用；

（3）基金份额持有人大会费用；

（4）与基金相关的会计师费和律师费；

（5）其他按照国家有关规定可以列入的费用。

本款上述各项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金申购费的费率为零。

2、赎回费

本基金赎回费的费率为零。

3、基金销售服务费

在通常情况下，基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《基金法》、《基金运作办法》、《基金销售办法》、《信息披露办法》、《内容与格式准则第5号－基金招募说明书的内容与格式－》、《泰信天天收益开放式证券投资基金基金合同》其它有关法律法规的要求，结合本基金最近半年的投资运作情况，对2008年3月26日更新、公告的《泰信天天收益开放式证券投资基金更新招募说明书（2008年第1号）》的内容进行了必要的补充和更新。

具体情况说明如下：

1、在“重要提示”中明确了本次更新招募说明书更新内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、第三节“基金管理人”部分：

（1）在“二、注册资本、股权结构”部分，更新了公司注册资本变更情况。

（2）在“三、主要人员情况”中，对监事会部分成员的简历进行了补充、更新；基金管理小组成员中删除了王鹏，并对“本基金历任基金经理情况”进行了相应的补充；投资决策委员会成员中增加“邓良毅先生”，并对相关人员职务信息进行了更新。

3、第四节“基金托管人”部分，对基金托管人的主要业务经营情况进行了更新。

4、第五节“相关服务机构”部分，新增招商银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、中国民生银行、深圳发展银行、江南证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司为代销机构。另外，部分销售机构的联系电话或联系人略有变动，请仔细阅读相关章节。

5、第六节“基金份额的申购与赎回”部分，在“一、申购与赎回的场所”增加了招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、中国民生银行、深圳发展银行、江南证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司。

6、第九节“基金的投资”部分，根据本基金2008年第二季度报告的相关内容，更新了“七、基金投资组合报告”中的内容。

7、第十节“基金的业绩”部分，修订了本基金自合同生效以来的投资业绩，该部分内容均按规定格式要求编制，并经基金托管人复核。

8、第十七节“风险揭示”的“声明”部分，增加了“招商银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、中国民生银行、深圳发展银行、江南证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司”。

9、第二十节“基金托管协议的内容摘要”中，对基金管理人的注册资本进行了更新。

10、第二十二节“其他应披露事项”中，汇总了本报告期内的重要公告事项。

泰信基金管理有限公司

2008年9月24日

东吴基金管理有限公司关于新增宁波银行为代销机构的公告

根据东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）签署的基金销售代理协议，自2008年9月26日起，宁波银行在所有营业网点对投资者开始代理销售本公司旗下管理的所有证券投资基金。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1、东吴基金管理有限公司

东吴基金客户服务热线：021-50509666

东吴基金网址：www.scfund.com.cn

2、宁波银行股份有限公司

宁波银行客户服务统一咨询电话：96528；上海地区：962528

宁波银行网站：www.nbcb.com.cn

欢迎广大投资者垂询、惠顾办理东吴基金管理有限公司旗下的开放式基金的开户、申购等相关业务。

特此公告。

东吴基金管理有限公司

2008年9月24日

证券简称：宏达股份　　证券代码：600331　　公告编号：临2008—057

四川宏达股份有限公司关于灾后恢复生产的后续公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

四川宏达股份有限公司（简称宏达股份）本部有色金属生产基地和磷化工生产基地在2008年5月12日四川汶川发生的里氏8.0级强烈地震中，部分生产设备和厂房受损，并于2008年5月12日下午全面停产。（详见2008年5月16日临2008—034号公告）

地震发生后，宏达股份在地方党委、政府和有关设计单位、设备制造单位和同行业友好单位的大力支持下，本着对股东高度负责的精神，按照“尽量减少损失，尽快恢复生产”的原则，采取有效措施，积极恢复生产。经过宏达股份全体员工的共同努力，截至日前，公司本部磷化工生产基地的年产15万吨粉状磷铵、年产10万吨粒状磷铵生产装置和年产18万吨硫酸生产装置已正式恢复生产。公司本部有色生产基地的电解锌生产装置恢复至震前70%的生产能力。宏达股份控股子公司四川安县宏达化工有限公司（控股比例97.98%）已顺利完成厂房维护和设备检修，正式恢复生产。

至此，宏达股份本部有色生产基地和磷化工生产基地及德阳市境内控股子公司的主要生产装置已基本恢复生产。本次地震，造成