

国联日日盈交易型货币市场基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

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。本中期报告已经全体独立董事签字同意。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 债券回购融资情况	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限	46
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	48
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	49
7.9 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 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情况	51
§9 开放式基金份额变动	52

§10 重大事件揭示..... 52

10.1 基金份额持有人大会决议..... 52

10.2 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 52

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 52

10.4 基金投资策略的改变 53

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 53

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 53

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 53

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... 54

10.9 其他重大事件 54

§11 影响投资者决策的其他重要信息..... 55

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... 55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55

§12 备查文件目录..... 55

12.1 备查文件目录 55

12.2 存放地点..... 56

12.3 查阅方式..... 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联日日盈交易型货币市场基金		
基金简称	国联日盈		
场内简称	-		
基金主代码	511930		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2015年11月30日		
基金管理人	国联基金管理有限公司		
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	6,505,552,768.59份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015年12月15日		
下属分级基金的基金简称	国联日盈A	国联日盈B	国联日盈C
下属分级基金场内简称	国联日盈（基金扩位简称：货币ETF国联）	-	-
下属分级基金的交易代码	511930	004869	019040
报告期末下属分级基金的份额总额	20,358,120.21份	1,403,478,534.94份	5,081,716,113.44份

注：本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额面值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据已按1.00元面值折算。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，力

	求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。 1、久期控制策略 2、资产类属配置策略 3、时机选择策略 4、套利策略
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。本基金的预期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		国联基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健	帅芳
	联系电话	010-56517000	021-38677947
	电子邮箱	caojian@glfund.com	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-160-6000；010-56517299	021-38917599-5
传真		010-56517001	021-50872603
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		100011	200041
法定代表人		王瑶	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.glfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、 国联基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街17号、 北京市东城区安定门外大街208 号玖安广场A座11层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊 普通 合伙)	上海市黄浦区延安东路222号30 楼

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)		
	国联日盈 A	国联日盈B	国联日盈C
本期已实现收益	153,486.12	8,278,197.99	30,861,397.69
本期利润	153,486.12	8,278,197.99	30,861,397.69
本期净值收益率	0.5835%	0.7034%	0.6086%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)		
	国联日盈 A	国联日盈B	国联日盈C
期末基金资产净值	20,358,120.21	1,403,478,534.94	5,081,716,113.44
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)		
	国联日盈 A	国联日盈B	国联日盈C
累计净值收益率	25.9945%	22.7931%	4.8322%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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；

2、本基金利润分配是按日结转份额；

3、本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额净值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据已按1.00元面值折算。

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

国联日盈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
过去三个月	0.2851%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	-0.0515%	0.0014%
过去六个月	0.5835%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	-0.0860%	0.0013%
过去一年	1.2154%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	-0.1346%	0.0014%
过去三年	4.8256%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	0.7719%	0.0023%
过去五年	8.3159%	0.0021%	6.7537%	0.0000%	1.5622%	0.0021%
过去七年	13.0480%	0.0028%	9.4574%	0.0000%	3.5906%	0.0028%
过去十年	24.2641%	0.0045%	13.5074%	0.0000%	10.7567%	0.0045%
自基金合同 生效起至今	25.9945%	0.0044%	14.2989%	0.0000%	11.6956%	0.0044%

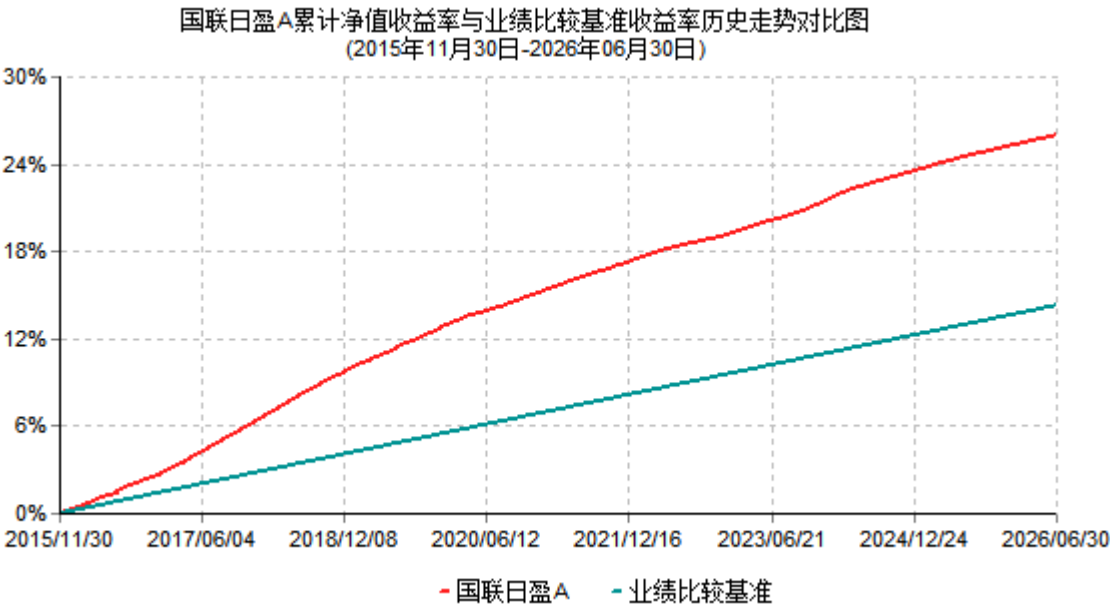
国联日盈B

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
过去三个月	0.3453%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.0087%	0.0014%
过去六个月	0.7034%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	0.0339%	0.0013%
过去一年	1.4587%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	0.1087%	0.0014%
过去三年	5.5820%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	1.5283%	0.0023%
过去五年	9.6230%	0.0021%	6.7537%	0.0000%	2.8693%	0.0021%
过去七年	14.9932%	0.0029%	9.4574%	0.0000%	5.5358%	0.0029%
自基金合同 生效起至今	22.7931%	0.0039%	12.0613%	0.0000%	10.7318%	0.0039%

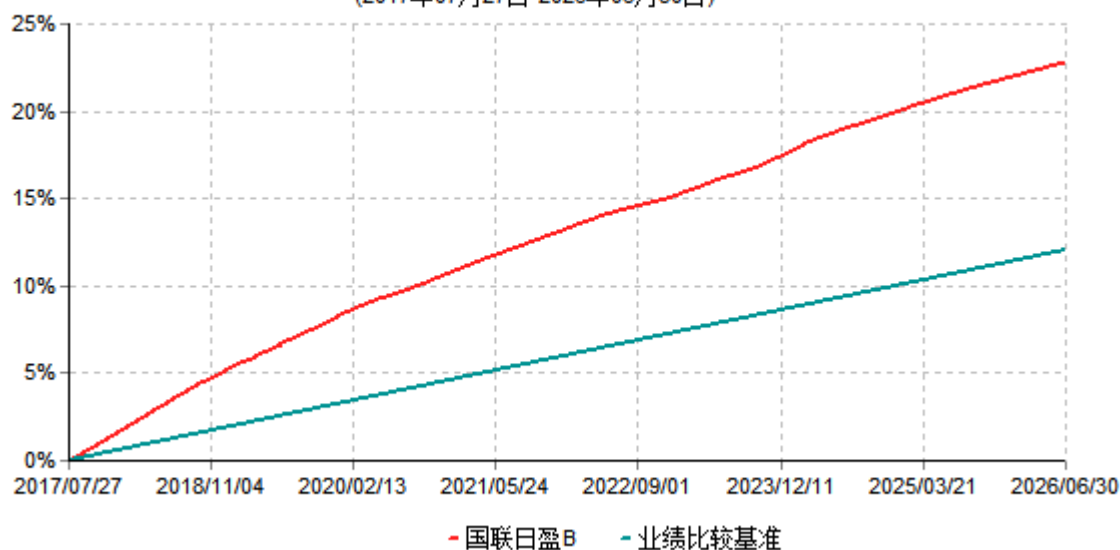
国联日盈C

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	0.2977%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	-0.0389%	0.0014%
过去六个月	0.6086%	0.0013%	0.6695%	0.0000%	-0.0609%	0.0013%
过去一年	1.2662%	0.0014%	1.3500%	0.0000%	-0.0838%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	4.8322%	0.0024%	3.8873%	0.0000%	0.9449%	0.0024%

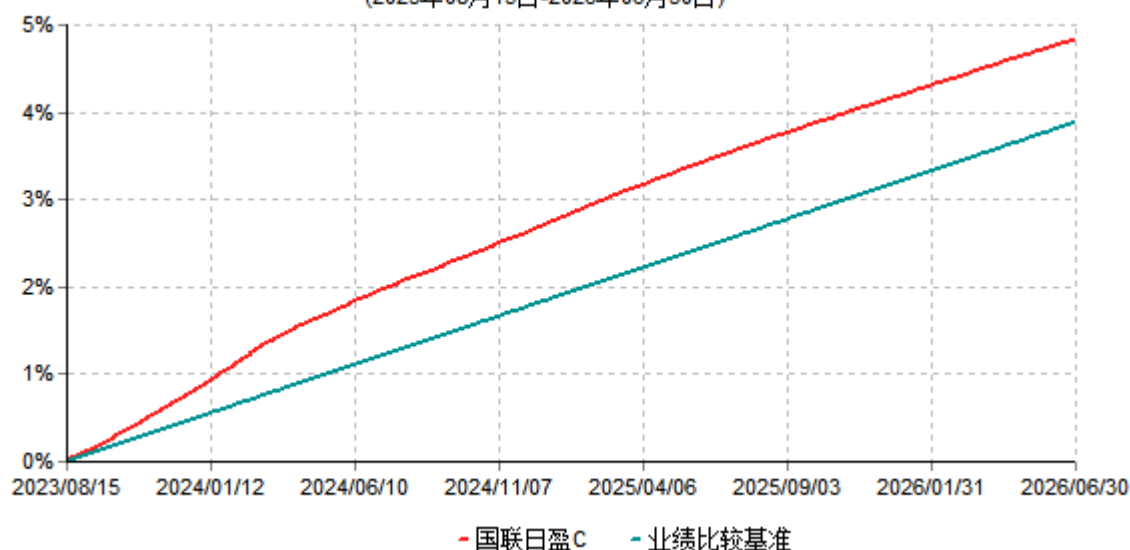
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



国联日日盈B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年07月27日-2026年06月30日)



国联日日盈C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年08月15日-2026年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。自2017年7月26日，本基金增加B类基金份额，自2017年7月27日起B类存在有效基金份额；自2023年8月14日，本基金增加C类基金份额，自2023年8月15日起C类存在有效基金份额。

§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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联民生证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2026年6月30日，国联基金管理有限公司共管理94只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基

金(FOF)、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联稳健增益债券型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联稳健添益债券型证券投资基金、国联中证800指数增强型证券投资基金、国联价值均衡混合型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金、国联多元配置3个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联金如意3个月滚动持有债券型证券投资基金、国联汇富债券型证券投资基金、国联昭元债券型证券投资基金、国联创业板综合指数增强型证券投资基金、国联周期优选混合型发起式证券投资基金、国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

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		
李倩	国联货币市场基金、 国联恒泰纯债债券 型证券投资基金、国 联现金增利货币市 场基金、国联聚商3 个月定期开放债券 型发起式证券投资 基金、国联日日盈交 易型货币市场基金、 国联盈泽中短债债	2025- 11-20	-	19	李倩女士，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限19年。2007年7月至2014年7月曾任银华基金管理有限公司交易管理部交易员，固定收益部基金经理助理。2014年7月加入公司，现任固收投资部下设二级部门“现

	券型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理及固收投资部下设二级部门“现金管理部”总经理。				金管理部”总经理。
韩正宇	国联日日盈交易型货币市场基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联稳健增益债券型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金的基金经理及固收研究部副总经理。	2021-05-18	-	9	韩正宇先生，中国国籍，毕业于美国罗格斯新泽西州立大学金融分析专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2015年7月至2017年5月曾任中国光大银行资产负债管理部流动性管理处流动性管理岗；2017年5月至2020年5月曾任中国人保资产管理有限公司公募基金事业部固定收益交易员、基金经理助理。2020年5月加入公司，现任固收研究部副总经理。
崔帅帅	国联日日盈交易型货币市场基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理。	2026-03-05	-	8	崔帅帅先生，中国国籍，毕业于中央财经大学国际金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限8年。2017年7月加入公司，现任固收投资部下设二级部门“现金管理部”基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业

人员监督管理办法》的相关规定。

(3) 韩正宇于2026年8月12日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

上半年，我国经济运行总体平稳，新旧动能加快转换，呈向新向优发展态势。国内生产总值达69.6万亿，同比增长4.7%，增速处于年初设定合理区间内。物价水平温和上升，CPI同比上涨1.0%，输入型通胀未有效向需求端传导。出口同比增长13.4%，表现亮眼。消费复苏节奏温和，服务消费好于商品消费。房地产等基建投资延续调整态势，但高新技术投资加快转换，保持较强增长韧性。海外方面，地缘政治冲突加剧，美伊战争影响国际能源价格上升，降低全球降息预期。

债市方面，上半年债券市场整体呈现震荡偏强的格局，收益率中枢显著下移，但行情节奏与曲线形态一二季度略有不同。一季度，央行维持适度宽松货币政策，持续投放流动性，资金面整体宽松，短端收益表现较好。2月底美伊战争影响，国际油价上行，

推升全球通胀预期，长债收益率表现承压，债券收益率呈陡峭化下行。二季度，经济修复斜率放缓叠加输入型通胀向需求端传导受阻，资金面维持低位，长端利率下行表现较好，收益率曲线趋于平坦化。

具体来看，1年期国开债收益率下行20bp，3年期国开债收益率下行24bp，5年期国开债收益率下行27bp，10年期国开债收益率下行22bp。

本基金坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，依据资金面季节性波动规律，将现金流主要分布在季末等关键时点，利用短端资产在资金收敛时点收益率冲高的特点，努力提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联日盈A基金份额净值为100.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5835%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末国联日盈B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.7034%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末国联日盈C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6086%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我国经济有望平稳运行，展现韧性，新旧动能转换延续，总体维持向新向好发展态势。货币政策预估维持适度宽松，多种货币政策工具箱有望综合运用并适时灵活调整。财政方面预计保持积极的财政政策，加快财政支出与债券资金使用，发挥财政政策的积极作用。债券市场，预估资金面保持宽松，短端收益率维持低位震荡，长端收益率有望提供波段操作机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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

本基金的利润分配方式为按日结转份额。本基金A类份额采用人民币100.00元，B类、C类份额采用人民币1.00元的固定份额净值交易方式，每日将各级基金份额实现的基金净收益分配给该级基金份额持有人。

本基金本报告期内向A类份额持有人分配利润：153,486.12元，向B类份额持有人分配利润：8,278,197.99元，向C类份额持有人分配利润：30,861,397.69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

无。

§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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在国联日日盈交易型货币市场基金（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，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、利润分配等情况进行了复核，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为其真实、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：国联日日盈交易型货币市场基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	1,151,100,290.75	407,337,694.24
结算备付金		-	1,200,072.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,917,097,222.72	6,128,511,402.71
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,917,097,222.72	6,128,511,402.71
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,180,294,404.13	1,000,232,475.07
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,303.78	12,073,109.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		7,248,500,221.38	7,549,354,753.93
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		740,532,163.84	343,019,031.03
应付清算款		-	-
应付赎回款		282,427.23	38,550.09

应付管理人报酬		813,637.18	821,816.01
应付托管费		271,212.40	273,938.67
应付销售服务费		864,704.48	940,849.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,300.49	4,019.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	170,007.17	271,569.07
负债合计		742,947,452.79	345,369,773.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,505,552,768.59	7,203,984,980.44
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		6,505,552,768.59	7,203,984,980.44
负债和净资产总计		7,248,500,221.38	7,549,354,753.93

注：报告截止日2026年06月30日，A类基金份额净值100.00元，B类、C类基金份额净值1.0000元，此处所列A类份额数据按1.00元面值折算列式。基金份额总额6,505,552,768.59份，其中A类基金的份额总额为20,358,120.21份；B类基金的份额总额为1,403,478,534.94份；C类基金的份额总额为5,081,716,113.44份。

6.2 利润表

会计主体：国联日日盈交易型货币市场基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		53,612,723.73	39,719,223.68
1.利息收入		12,875,155.40	11,837,531.54
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,635,003.71	4,186,059.08
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		5,240,151.69	7,651,472.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,737,568.33	27,881,692.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	40,737,568.33	27,881,692.14
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		14,319,641.93	8,093,781.09
1.管理人报酬		4,701,464.59	3,130,734.93
2.托管费		1,567,154.88	1,043,578.32
3.销售服务费		5,151,525.81	3,691,119.31
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,782,633.42	114,027.82
其中：卖出回购金融资产支出		2,782,633.42	114,027.82
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		6,134.88	11,418.15
8.其他费用	6.4.7.20	110,728.35	102,902.56

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,293,081.80	31,625,442.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,293,081.80	31,625,442.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		39,293,081.80	31,625,442.59

6.3 净资产变动表

会计主体：国联日日盈交易型货币市场基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,203,984,980.44	-	7,203,984,980.44
二、本期期初净资产	7,203,984,980.44	-	7,203,984,980.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-698,432,211.85	-	-698,432,211.85
（一）、综合收益总额	-	39,293,081.80	39,293,081.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-698,432,211.85	-	-698,432,211.85
其中：1.基金申购款	14,781,461,474.24	-	14,781,461,474.24
2.基金赎回款	-15,479,893,686.09	-	-15,479,893,686.09

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-39,293,081.80	-39,293,081.80
四、本期期末净资产	6,505,552,768.59	-	6,505,552,768.59
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,688,588,568.06	-	2,688,588,568.06
二、本期期初净资产	2,688,588,568.06	-	2,688,588,568.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,448,318,510.98	-	2,448,318,510.98
（一）、综合收益总额	-	31,625,442.59	31,625,442.59
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,448,318,510.98	-	2,448,318,510.98
其中：1.基金申购款	8,074,368,714.46	-	8,074,368,714.46
2.基金赎回款	-5,626,050,203.48	-	-5,626,050,203.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-31,625,442.59	-31,625,442.59
四、本期期末净资产	5,136,907,079.04	-	5,136,907,079.04

产			
---	--	--	--

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:

王瑶	周妹云	李克
-----	-----	-----
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

国联日日盈交易型货币市场基金(原名中融日日盈交易型货币市场基金)(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”)证监许可[2015]2565号文的核准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《中融日日盈交易型货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)向社会公开募集,基金合同于2015年11月30日正式生效,首次设立募集规模为974,878,000.00份基金份额,经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验证。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

根据基金管理人于2017年7月26日发布的《关于中融日日盈交易型货币市场基金增设场外份额并修改基金合同及托管协议的公告》,自2017年7月26日起,本基金增设场外份额(B类基金份额,代码:004869),B类基金份额仅在场外进行申购和赎回。本基金的原有基金份额均为场内份额(A类基金份额,代码:511930),A类基金份额仅在上海证券交易所申购、赎回和上市交易。根据基金管理人于2023年8月8日发布的《国联基金管理有限公司关于中融日日盈交易型货币市场基金降低管理费、托管费和增加C类基金份额并修改相关法律文件的公告》,从2023年8月14日起,本基金增设C类基金份额,C类基金份额的年销售服务费率为0.20%。本基金进行份额新增后,原有A类、B类基金份额将自动保留,对原基金份额持有人的继续持有、赎回或转换无任何改变,原有基金份额持有人利益不受任何影响。

根据基金管理人于2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,自2023年9月8日起,本基金更名为国联日日盈交易型货币市场基金(基金的基金代码保持不变)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《国联日日盈交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定,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、中央银行票据和同业存单,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，以及中国证监会、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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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相一致的说明

本基金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。

6.4.4.1 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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[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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1)2027年12月31日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。
- (2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。
- (3)对证券投资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。
- (4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	148,421,579.67
等于：本金	148,357,678.10
加：应计利息	63,901.57
减：坏账准备	-
定期存款	1,002,678,711.08
等于：本金	1,000,000,000.00
加：应计利息	2,678,711.08
减：坏账准备	-

其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	100,028,388.92
存款期限3个月以上	902,650,322.16
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,151,100,290.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		按实际利率计 算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,917,097,222.7 2	4,918,189,522.7 2	1,092,300.00	0.0168
	合计	4,917,097,222.7 2	4,918,189,522.7 2	1,092,300.00	0.0168
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,917,097,222.7 2	4,918,189,522.7 2	1,092,300.00	0.0168

注：偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,180,294,404.13	-
合计	1,180,294,404.13	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	133.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	68,833.35
其中：交易所市场	-
银行间市场	68,833.35
应付利息	-
预提费用	101,039.85
合计	170,007.17

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 国联日日盈A

金额单位：人民币元

项目 (国联日日盈A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	22,985,612.46	22,985,612.46
本期申购	40,670,086.12	40,670,086.12
本期赎回（以“-”号填列）	-43,297,578.37	-43,297,578.37
本期末	20,358,120.21	20,358,120.21

6.4.7.7.2 国联日盈B

金额单位：人民币元

项目 (国联日盈B)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,945,703,188.71	1,945,703,188.71
本期申购	10,341,413,491.15	10,341,413,491.15
本期赎回（以“-”号填列）	-10,883,638,144.92	-10,883,638,144.92
本期末	1,403,478,534.94	1,403,478,534.94

6.4.7.7.3 国联日盈C

金额单位：人民币元

项目 (国联日盈C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,235,296,179.27	5,235,296,179.27
本期申购	4,399,377,896.97	4,399,377,896.97
本期赎回（以“-”号填列）	-4,552,957,962.80	-4,552,957,962.80
本期末	5,081,716,113.44	5,081,716,113.44

注：（1）、本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额面值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据按1.00元面值折算列示。（2）、申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 国联日盈A

单位：人民币元

项目 (国联日盈A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	153,486.12	-	153,486.12
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-153,486.12	-	-153,486.12
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 国联日盈B

单位：人民币元

项目 (国联日盈B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	8,278,197.99	-	8,278,197.99
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-8,278,197.99	-	-8,278,197.99
本期末	-	-	-

6.4.7.8.3 国联日盈C

单位：人民币元

项目 (国联日盈C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	30,861,397.69	-	30,861,397.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-30,861,397.69	-	-30,861,397.69
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,645,284.60
定期存款利息收入	4,938,251.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	455.34
其他	51,012.22
合计	7,635,003.71

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	38,794,650.56
债券投资收益——买卖债券（债转股	1,942,917.77

及债券到期兑付）差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	40,737,568.33

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,801,359,496.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,778,582,354.81
减：应计利息总额	20,834,224.10
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,942,917.77

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.18 其他收入

注：无。

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	988.50
合计	110,728.35

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联民生证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
民生证券股份有限公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 基金交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,701,464.59	3,130,734.93

其中：应支付销售机构的客户维护费	2,251,673.01	1,505,434.50
应支付基金管理人的净管理费	2,449,791.58	1,625,300.43

注：① 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，每日计提，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×0.15%/当年天数；

② 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,567,154.88	1,043,578.32

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，每日计提，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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国联日盈A	国联日盈B	国联日盈C	合计
国联基金 管理有限 公司	0.00	2,588.60	5.88	2,594.48
国泰海通 证券股份 有限公司	1,785.87	779.75	166.35	2,731.97
国联民生 证券股份	0.00	30.68	218.54	249.22

有限公司				
民生证券股份有限公司	0.00	0.45	19.41	19.86
合计	1,785.87	3,399.48	410.18	5,595.53
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国联日盈A	国联日盈B	国联日盈C	合计
国联基金 管理有限 公司	0.00	960.71	240.80	1,201.51
国泰海通 证券股份 有限公司	1,171.03	24.98	0.00	1,196.01
国联民生 证券股份 有限公司	0.00	14.18	197.64	211.82
合计	1,171.03	999.87	438.44	2,609.34

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，C类基金份额的年销售服务费率为0.20%。

基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{该类份额的年销售服务费率} / \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 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

上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日						
银行 间市	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

场交易的各关联方名称						
国泰海通证券股份有限公司	-	-	118,000,000.00	9,698.63	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国联日盈A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
基金合同生效日（2015年11月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	10,035,556.31	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,035,556.31	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	49.30%	-

国联日盈B

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
----	-----------------------------------	--

基金合同生效日（2015年11月30日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	17,170,475.60	16,899,271.33
报告期间申购/买入总份额	120,781.39	143,384.29
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,291,256.99	17,042,655.62
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.23%	2.92%

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额；
3、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.4.2 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

国联日盈A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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
国联（北京）资产管理有限公司	-	-	11,128,926.18	48.42%

国联日盈B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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

国泰海通 证券股份 有限公司	-	-	200,015,436.90	10.28%
----------------------	---	---	----------------	--------

注：（1）除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

（2）对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

（3）本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额面值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据按1.00元面值折算列示。

6.4.10.5 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通 证券股份 有限公司	148,421,579.67	2,645,284.60	660,606.21	8,033.30

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

国联日日盈A

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
153,486.12	-	-	153,486.12	-

国联日盈B

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
8,278,197.99	-	-	8,278,197.99	-

国联日盈C

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
30,861,397.69	-	-	30,861,397.69	-

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额是740,532,163.84元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估 值单价	数量（张）	期末估值总额
112603134	26农业银行CD 134	2026-07-01	99.39	2,203,000	218,956,170.00
112693112	26天津银行CD 041	2026-07-01	99.67	447,000	44,552,490.00
112693736	26天津银行CD 052	2026-07-01	99.62	500,000	49,810,000.00
112695445	26齐鲁银行CD 042	2026-07-01	98.75	300,000	29,625,000.00

112696663	26江西银行CD 037	2026-07-01	99.02	600,000	59,412,000.00
112697040	26江西银行CD 042	2026-07-01	99.33	319,000	31,686,270.00
112697065	26天津银行CD 107	2026-07-01	99.69	600,000	59,814,000.00
112697194	26江西银行CD 044	2026-07-01	99.31	500,000	49,655,000.00
112697349	26天津银行CD 115	2026-07-01	99.30	600,000	59,580,000.00
240214	24国开14	2026-07-01	100.66	40,000	4,026,400.00
250211	25国开11	2026-07-01	101.24	300,000	30,372,000.00
250361	25进出61	2026-07-01	100.13	800,000	80,104,000.00
250431	25农发31	2026-07-01	101.22	200,000	20,244,000.00
267702	26贴现国开02	2026-07-01	99.95	500,000	49,975,000.00
合计				7,909,000	787,812,330.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部

风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
--------	--------------------	---------------------

A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	4,485,277,270.73	5,421,018,486.85
合计	4,485,277,270.73	5,421,018,486.85

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	82,419,894.67	61,833,269.55
AAA以下	-	-
未评级	164,674,871.73	266,718,053.47
合计	247,094,766.40	328,551,323.02

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购

赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本计量的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	148,421,579.67	542,250,236.41	460,428,474.67	-	-	-	1,151,100,290.75
交易性金融资产	184,640,842.44	1,531,624,272.62	3,200,832,107.66	-	-	-	4,917,097,222.72
买入返售金融资产	1,180,294,404.13	-	-	-	-	-	1,180,294,404.13
应收申购	-	-	-	-	-	8,303.78	8,303.78

款							
资产总计	1,513,356,826.24	2,073,874,509.03	3,661,260,582.33	-	-	8,303.78	7,248,500,221.38
负债							
卖出回购金融资产款	740,532,163.84	-	-	-	-	-	740,532,163.84
应付赎回款	-	-	-	-	-	282,427.23	282,427.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	813,637.18	813,637.18
应付托管费	-	-	-	-	-	271,212.40	271,212.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	864,704.48	864,704.48
应交税费	-	-	-	-	-	13,300.49	13,300.49
其他负债	-	-	-	-	-	170,007.17	170,007.17
负债总计	740,532,163.84	-	-	-	-	2,415,288.95	742,947,452.79
利率敏感度缺口	772,824,662.40	2,073,874,509.03	3,661,260,582.33	-	-	-2,406,985.17	6,505,552,768.59
上年度末2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	6,279,831.91	200,782,945.33	200,274,917.00	-	-	-	407,337,694.24
结算备付金	1,200,072.09	-	-	-	-	-	1,200,072.09
交易性金融资产	267,718,341.02	2,480,236,813.67	3,380,556,248.02	-	-	-	6,128,511,402.71
买入返售金融资产	1,000,232,475.07	-	-	-	-	-	1,000,232,475.07
应收申购款	-	-	-	-	-	12,073,109.82	12,073,109.82
资产总计	1,275,430,720.09	2,681,019,759.00	3,580,831,165.02	-	-	12,073,109.82	7,549,354,753.93
负债							
卖出回购金融资产款	343,019,031.03	-	-	-	-	-	343,019,031.03
应付赎回款	-	-	-	-	-	38,550.09	38,550.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	821,816.01	821,816.01
应付托管费	-	-	-	-	-	273,938.67	273,938.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	940,849.09	940,849.09
应交税费	-	-	-	-	-	4,019.53	4,019.53
其他负债	-	-	-	-	-	271,569.07	271,569.07
负债总计	343,019,031.03	-	-	-	-	2,350,742.46	345,369,773.49

利率敏感度缺口	932,411,689.06	2,681,019,759.00	3,580,831,165.02	-	-	9,722,367.36	7,203,984,980.44
---------	----------------	------------------	------------------	---	---	--------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值不会发生重大变动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	-	-
第二层次	4,917,097,222.72	6,128,511,402.71
第三层次	-	-
合计	4,917,097,222.72	6,128,511,402.71

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 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	4,917,097,222.72	67.84
	其中：债券	4,917,097,222.72	67.84
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,180,294,404.13	16.28
	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	1,151,100,290.75	15.88

4	其他各项资产	8,303.78	0.00
5	合计	7,248,500,221.38	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.47	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	740,532,163.84	11.38
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

7.3.2 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	22.79	11.38
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	11.43	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	16.48	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	49.38	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		111.42	11.38

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天的情况。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,725,185.59	2.84
	其中：政策性金融债	184,725,185.59	2.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	247,094,766.40	3.80
7	同业存单	4,485,277,270.73	68.95
8	其他	-	-
9	合计	4,917,097,222.72	75.58

10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
----	--------------------	---	---

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112603134	26农业银行CD134	2,500,000	248,462,832.17	3.82
2	112503406	25农业银行CD406	1,000,000	99,778,430.83	1.53
3	112693726	26广州银行CD039	1,000,000	99,642,678.94	1.53
4	112603128	26农业银行CD128	1,000,000	99,424,253.50	1.53
5	112621224	26渤海银行CD224	1,000,000	99,319,559.73	1.53
6	112604011	26中国银行CD011	1,000,000	98,722,573.49	1.52
7	250361	25进出61	800,000	80,105,880.66	1.23
8	112697065	26天津银行CD107	600,000	59,815,797.70	0.92
9	112603146	26农业银行CD146	600,000	59,589,328.36	0.92
10	112621228	26渤海银行CD228	600,000	59,587,989.95	0.92

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0527%
报告期内偏离度的最低值	0.0033%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0309%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，A类基金份额账面净值始终保持为100.00人民币元，B类、C类基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金所持有的债券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或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 报告期内基金投资的前十名证券除中国农业银行股份有限公司,广州银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国进出口银行,天津银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未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。

国家金融监督管理总局2025年10月31日对中国农业银行股份有限公司进行处罚。国家金融监督管理总局广东监管局2026年04月30日对广州银行股份有限公司进行处罚。国家金融监督管理总局广东监管局2026年01月14日对广州银行股份有限公司进行处罚。国家金融监督管理总局2025年10月31日对中国银行股份有限公司进行处罚。国家外汇管理局北京市分局2026年03月05日对中国进出口银行进行处罚(京汇罚[2026]14号)。国家金融监督管理总局2025年09月12日对中国进出口银行进行处罚。国家金融监督管理总局天津监管局2026年06月04日对天津银行股份有限公司进行处罚。国家金融监督管理总局天津监管局2026年05月29日对天津银行股份有限公司进行处罚。央行天津市分行2025年12月26日对天津银行股份有限公司进行处罚(津银罚决字[2025]9号)。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

7.9.3 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	8,303.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,303.78

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
国联 日盈A	183	111,246.56	10,037,158.60	49.30%	10,320,961.61	50.70%
国联 日盈B	18,775	74,752.52	603,528,647.48	43.00%	799,949,887.46	57.00%
国联 日盈C	274,952	18,482.19	7,553,207.37	0.15%	5,074,162,906.07	99.85%
合计	293,910	22,134.51	621,119,013.45	9.55%	5,884,433,755.14	90.45%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额面值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据按1.00元面值折算列示。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	100,440,295.31	1.54%
2	券商类机构	100,161,070.34	1.54%
3	其他机构	50,127,691.43	0.77%
4	银行类机构	50,125,869.37	0.77%
5	券商类机构	50,072,053.95	0.77%
6	信托类机构	40,001,312.82	0.61%
7	其他机构	30,000,984.61	0.46%
8	信托类机构	30,000,984.61	0.46%
9	基金类机构	27,326,813.30	0.42%
10	券商类机构	25,004,162.61	0.38%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国联日盈A	-	-
	国联日盈B	270,862.50	0.02%
	国联日盈C	754,041.07	0.01%
	合计	1,024,903.57	0.02%

8.4 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情况

项目	份额级别	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	国联日盈A	-
	国联日盈B	-
	国联日盈C	0~10
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	国联日盈A	-
	国联日盈B	-
	国联日盈C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	国联日盈A	国联日盈B	国联日盈C
基金合同生效日(2015年11月30日)基金份额总额	974,878,000.00	-	-
本报告期期初基金份额总额	22,985,612.46	1,945,703,188.71	5,235,296,179.27
本报告期基金总申购份额	40,670,086.12	10,341,413,491.15	4,399,377,896.97
减：本报告期基金总赎回份额	43,297,578.37	10,883,638,144.92	4,552,957,962.80
本报告期期末基金份额总额	20,358,120.21	1,403,478,534.94	5,081,716,113.44

注：1、申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。
2、本基金场内基金份额（A类基金份额），基金份额净值为100.00元，场外基金份额（B类、C类基金份额），基金份额净值1.00元，本表所列A类份额数据已按1.00元面值折算。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期本基金管理人无重大人事变动。
本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营以及涉及基金财产的诉讼。
本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
万联证券	1	-	-	-	-	退租1个

						交易 单 元。
国泰 海通 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

- 1、财务状况良好；
- 2、经营行为规范；
- 3、合规风控能力和交易能力较强；
- 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
 - （1）有较强的宏观及行业研究能力。能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并进行路演、培训等。
 - （2）有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
 - （3）有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。

②券商专用交易单元选择程序：

- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；
- 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	国联基金管理有限公司关于旗下部分上交所ETF变更扩位证券简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-30
2	国联基金管理有限公司基金经理变更公告（国联日盈）	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-06
3	国联基金管理有限公司关于为终止合作销售机构的客户办理转托管业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-07
4	国联基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下货币市场基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-05-26
5	国联基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予中融日日盈交易型货币市场基金募集注册的文件
- （2）《国联日日盈交易型货币市场基金基金合同》
- （3）《国联日日盈交易型货币市场基金托管协议》
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （6）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （7）注册登记协议
- （8）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日