

**广发景宁纯债债券型证券投资基金**  
**(原广发理财 7 天债券型证券投资基金转型)**  
**2020 年中期报告**  
**2020 年 6 月 30 日**

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十七日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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。

广发景宁纯债债券型证券投资基金由广发理财 7 天债券型证券投资基金通过基金合同修订变更而来。广发理财 7 天债券型证券投资基金于 2013 年 6 月 20 日生效。2020 年 3 月 23 日广发理财 7 天债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于广发理财 7 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，同意广发理财 7 天债券型证券投资基金变更为广发景宁纯债债券型证券投资基金及其相关事宜，本基金管理人基于上述变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金名称、运作方式、投资、估值方法、信息披露及其他部分条款进行相应修改。自 2020 年 4 月 22 日起，《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，并取代原《广发理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》，广发理财 7 天债券型证券投资基金正式变更为广发景宁纯债债券型证券投资基金，本基金当事人将按照《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发理财 7 天债券型证券投资基金报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 4 月 21 日止，广发景宁纯债债券型证券投资基金报告期自 2020 年 4 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| <b>2 基金简介</b>                           | 6  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6  |
| 2.2 基金产品说明                              | 6  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 8  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | 8  |
| 3.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金                     | 8  |
| 3.1.1 主要会计数据和财务指标                       | 8  |
| 3.1.2 基金净值表现                            | 9  |
| 3.2 广发理财7天债券型证券投资基金                     | 10 |
| 3.2.1 主要会计数据和财务指标                       | 10 |
| 3.2.2 基金净值表现                            | 10 |
| <b>4 管理人报告</b>                          | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明              | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17 |
| <b>5 托管人报告</b>                          | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17 |
| 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 | 18 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 18 |
| <b>6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>                | 18 |
| 6.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金                     | 18 |
| 6.1.1 资产负债表                             | 18 |
| 6.1.2 利润表                               | 19 |
| 6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表                    | 21 |
| 6.1.4 报表附注                              | 21 |
| 6.2 广发理财7天债券型证券投资基金                     | 42 |
| 6.2.1 资产负债表                             | 42 |
| 6.2.2 利润表                               | 43 |
| 6.2.3 所有者权益(基金净值)变动表                    | 44 |
| 6.2.4 报表附注                              | 46 |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | 65 |
| 7.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金                     | 65 |
| 7.1.1 期末基金资产组合情况                        | 65 |

|           |                                    |           |
|-----------|------------------------------------|-----------|
| 7.1.2     | 报告期末按行业分类的股票投资组合                   | 66        |
| 7.1.3     | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细      | 66        |
| 7.1.4     | 报告期内股票投资组合的重大变动                    | 66        |
| 7.1.5     | 期末按债券品种分类的债券投资组合                   | 66        |
| 7.1.6     | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细     | 67        |
| 7.1.7     | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细  | 67        |
| 7.1.8     | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  | 67        |
| 7.1.9     | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细     | 67        |
| 7.1.10    | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 67        |
| 7.1.11    | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 67        |
| 7.1.12    | 投资组合报告附注                           | 68        |
| 7.2       | 广发理财 7 天债券型证券投资基金                  | 68        |
| 7.2.1     | 期末基金资产组合情况                         | 68        |
| 7.2.2     | 债券回购融资情况                           | 69        |
| 7.2.3     | 基金投资组合平均剩余期限                       | 69        |
| 7.2.4     | 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明        | 70        |
| 7.2.5     | 期末按债券品种分类的债券投资组合                   | 70        |
| 7.2.6     | 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细     | 71        |
| 7.2.7     | “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离         | 71        |
| 7.2.8     | 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 | 71        |
| 7.2.9     | 投资组合报告附注                           | 72        |
| <b>8</b>  | <b>基金份额持有人信息</b>                   | <b>72</b> |
| 8.1       | 广发景宁纯债债券型证券投资基金                    | 72        |
| 8.1.1     | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                  | 72        |
| 8.1.2     | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况               | 73        |
| 8.1.3     | 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的情况      | 73        |
| 8.2       | 广发理财 7 天债券型证券投资基金                  | 73        |
| 8.2.1     | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                  | 73        |
| 8.2.2     | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况               | 73        |
| 8.2.3     | 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的情况      | 74        |
| <b>9</b>  | <b>开放式基金份额变动</b>                   | <b>74</b> |
| 9.1       | 广发景宁纯债债券型证券投资基金                    | 74        |
| 9.2       | 广发理财 7 天债券型证券投资基金                  | 74        |
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示</b>                      | <b>75</b> |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议                        | 75        |
| 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        | 75        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼             | 75        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变                          | 75        |
| 10.5      | 为基金进行审计的会计师事务所情况                   | 75        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况           | 75        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况                  | 75        |
| 10.8      | 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况                  | 84        |
| 10.9      | 其他重大事件                             | 84        |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>              | <b>85</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 11.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金 .....                 | 85        |
| 11.1.1 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 ..... | 85        |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                     | <b>87</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 87        |
| 12.2 存放地点.....                             | 87        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 87        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 广发景宁纯债债券型证券投资基金   |
| 基金简称       | 广发景宁纯债            |
| 基金主代码      | 000037            |
| 交易代码       | 000037            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2020年4月22日        |
| 基金管理人      | 广发基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 6,260,162,956.81份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

#### 2.1.2 广发理财7天债券型证券投资基金

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 广发理财7天债券型证券投资基金    |                    |
| 基金简称            | 广发理财7天债券           |                    |
| 基金主代码           | 000037             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2013年6月20日         |                    |
| 基金管理人           | 广发基金管理有限公司         |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 15,355,555,275.88份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 广发理财7天债券A          | 广发理财7天债券B          |
| 下属分级基金的交易代码     | 000037             | 000038             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 101,313,806.85份    | 15,254,241,469.03份 |

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报，追求基金资产的长期稳健增值。                        |
| 投资策略 | 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。 |

|        |  |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行一年期定期存款利率(税后)×10%        |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 |

### 2.2.2 广发理财7天债券型证券投资基金

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的当期收益。  |
| 投资策略   | 本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税后)  |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。  |

### 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          |      | 广发基金管理有限公司                       | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 程才良                              | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 020-83936666                     | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | ccl@gffunds.com.cn               | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 95105828                         | 95588               |
| 传真          |      | 020-89899158                     | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848(集中办公区) | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址        |      | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼      | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码        |      | 510308                           | 100140              |
| 法定代表人       |      | 孙树明                              | 陈四清                 |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33  |

|  |   |
|--|---|
|  | 楼 |
|--|---|

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                        |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 广发基金管理有限公司 | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

#### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年4月22日(基金合同生效日)至2020年6月30日) |
|-----------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益         | 65,485,372.78                       |
| 本期利润            | 20,899,806.79                       |
| 加权平均基金份额本期利润    | 0.0033                              |
| 本期加权平均净值利润率     | 0.33%                               |
| 本期基金份额净值增长率     | 0.33%                               |
| 3.1.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日)                    |
| 期末可供分配利润        | 5,779,550.17                        |
| 期末可供分配基金份额利润    | 0.0009                              |
| 期末基金资产净值        | 6,265,942,506.98                    |
| 期末基金份额净值        | 1.0009                              |
| 3.1.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年6月30日)                    |
| 基金份额累计净值增长率     | 0.33%                               |

注：（1）本基金转型日期为2020年4月22日，至披露时点不满半年。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。



### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | -0.37%   | 0.11%       | -0.60%     | 0.11%         | 0.23% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.33%    | 0.14%       | -1.09%     | 0.10%         | 1.42% | 0.04% |

注：（1）自2020年4月22日起，本基金的业绩比较基准由“七天通知存款利率(税后)”变更为“中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行一年期定期存款利率（税后）×10%”。

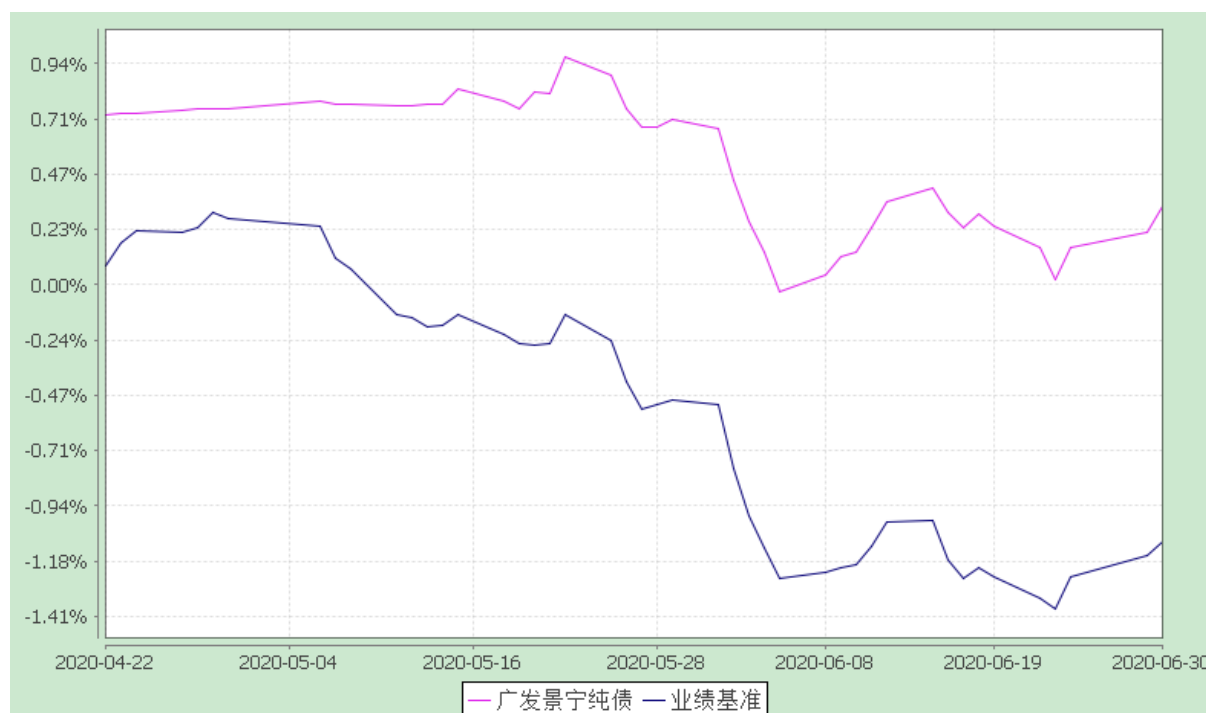
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发景宁纯债债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年4月22日至2020年6月30日)



注：（1）本基金转型日期为2020年4月22日，至披露时点未满一年。

（2）本基金于2020年4月22日正式转型为广发景宁纯债债券型证券投资基金。

(3) 自2020年4月22日起,本基金的业绩比较基准由“七天通知存款利率(税后)”变更为“中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行一年期定期存款利率(税后)×10%”。

### 3.2 广发理财7天债券型证券投资基金

#### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.2.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日至2020年4月21日) |                   |
|-----------------|---------------------------|-------------------|
|                 | 广发理财7天债券A                 | 广发理财7天债券B         |
| 本期已实现收益         | 1,247,469.88              | 138,013,396.78    |
| 本期利润            | 1,247,469.88              | 138,013,396.78    |
| 本期净值收益率         | 0.8208%                   | 0.9108%           |
| 3.2.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年4月21日)          |                   |
|                 | 广发理财7天债券A                 | 广发理财7天债券B         |
| 期末基金资产净值        | 101,313,806.85            | 15,254,241,469.03 |
| 期末基金份额净值        | 1                         | 1                 |
| 3.2.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年4月21日)          |                   |
|                 | 广发理财7天债券A                 | 广发理财7天债券B         |
| 累计净值收益率         | 29.7178%                  | 31.5819%          |

注:(1)本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

(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,由于本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)本基金每个运作期期末收益结转。

#### 3.2.2 基金净值表现

##### 3.2.2.1 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

广发理财7天债券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 | 0.2672%  | 0.0119%     | 0.1162%    | 0.0000%       | 0.1510% | 0.0119% |
| 过去三个月 | 0.6687%  | 0.0070%     | 0.3412%    | 0.0000%       | 0.3275% | 0.0070% |

|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去六个月      | 1.3494%  | 0.0050% | 0.6862% | 0.0000% | 0.6632%  | 0.0050% |
| 过去一年       | 2.7334%  | 0.0036% | 1.3725% | 0.0000% | 1.3609%  | 0.0036% |
| 过去三年       | 11.1252% | 0.0029% | 4.1100% | 0.0000% | 7.0152%  | 0.0029% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.7178% | 0.0067% | 9.3675% | 0.0000% | 20.3503% | 0.0067% |

广发理财7天债券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      | 0.2921%  | 0.0119%     | 0.1162%    | 0.0000%       | 0.1759%  | 0.0119% |
| 过去三个月      | 0.7418%  | 0.0070%     | 0.3412%    | 0.0000%       | 0.4006%  | 0.0070% |
| 过去六个月      | 1.4972%  | 0.0050%     | 0.6862%    | 0.0000%       | 0.8110%  | 0.0050% |
| 过去一年       | 3.0332%  | 0.0036%     | 1.3725%    | 0.0000%       | 1.6607%  | 0.0036% |
| 过去三年       | 12.0972% | 0.0029%     | 4.1100%    | 0.0000%       | 7.9872%  | 0.0029% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.5819% | 0.0067%     | 9.3675%    | 0.0000%       | 22.2144% | 0.0067% |

注：过去一个月为2020年3月22日至2020年4月21日，过去三个月为2020年1月22日至2020年4月21日，过去六个月为2019年10月22日至2020年4月21日，过去一年为2019年4月22日至2020年4月21日，过去三年为2017年4月22日至2020年4月21日，自基金合同生效起至今为2013年6月20日至2020年4月21日。

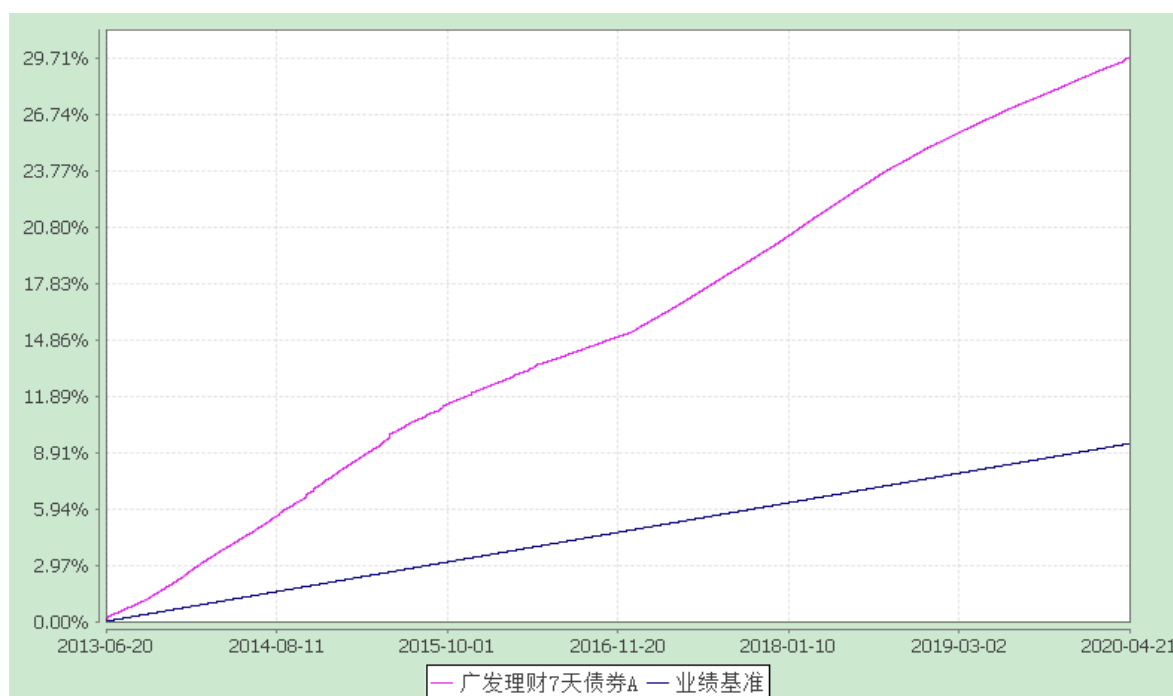
**3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

广发理财7天债券型证券投资基金

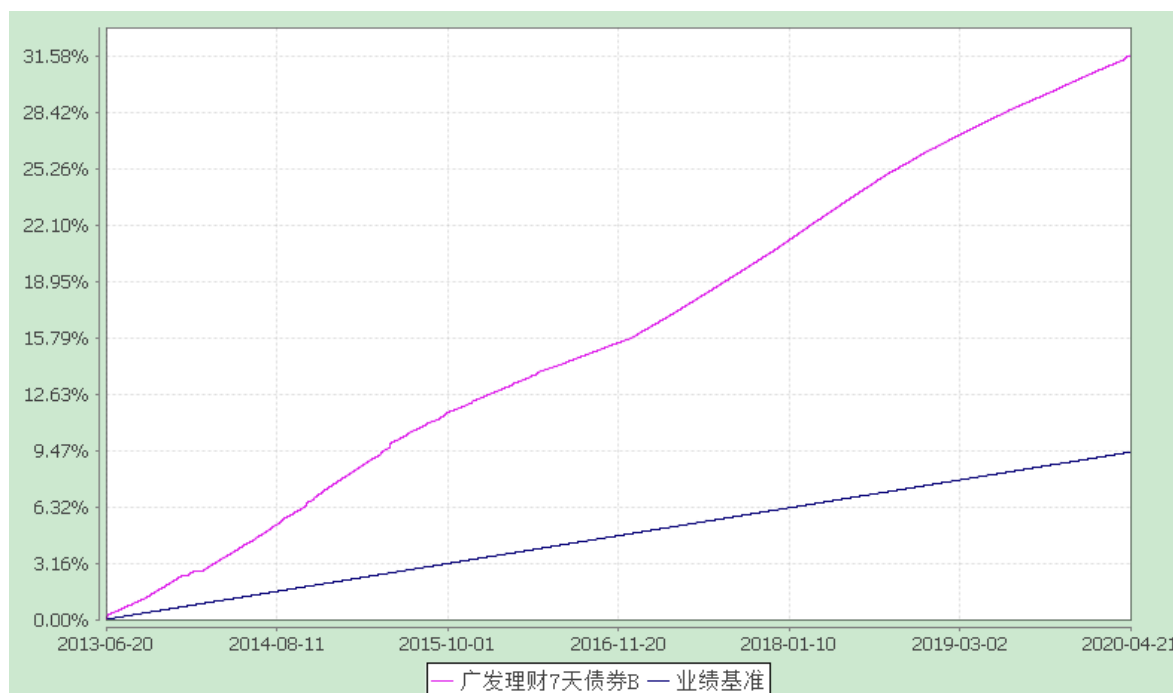
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年6月20日至2020年4月21日)

广发理财7天债券A



#### 广发理财7天债券B



## 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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前

海香江金融控股集团有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和32个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司(香港子公司)，参股了证通股份有限公司。

截至2020年6月30日，公司管理225只开放式基金，管理公募基金规模为6394.81亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

#### 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<br>(助理)期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|----|---|---------------------|------|------------|---|
|    |   | 任职日期                | 离任日期 |            |   |
| 任爽 | 本基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；广发天天利货币市场基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的 | 2020-04-22          | -    | 12年        | 任爽女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月16日至2018年3月20日)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年11月9日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月12日至2019年1月8日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年3月21日至2019年3月26日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年3 |

|     |   |            |   |      |  |
|-----|---|------------|---|------|--|
|     | 基金经<br>理；广发<br>聚泰混合<br>型证券投<br>资基金的<br>基金经<br>理；广发<br>鑫惠纯债<br>定期开放<br>债券型发<br>起式证券<br>投资基金<br>的基金经<br>理   |            |   |      | 月 27 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 16 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发理财 7 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 6 月 20 日至 2020 年 4 月 21 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 12 月 9 日至 2020 年 5 月 28 日)。 |
| 温秀娟 | 本基金的<br>基金经<br>理；广发<br>货币市场<br>基金的基<br>金经理；<br>广发理财<br>30 天债券<br>型证券投<br>资基金的<br>基金经<br>理；广发<br>现金宝场<br>内实时申<br>赎货币市<br>场基金的<br>基金经<br>理；广发<br>活期宝货<br>币市场基<br>金的基金<br>经理；广<br>发添利交<br>易型货币<br>市场基金<br>的基金经<br>理；广发<br>天天红发<br>起式货币<br>市场基金 | 2020-04-22 | - | 20 年 | 温秀娟女士，经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、广发理财 7 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 6 月 20 日至 2020 年 4 月 21 日)。   |

|  |                |  |  |  |  |
|--|----------------|--|--|--|--|
|  | 的基金经理；现金投资部总经理 |  |  |  |  |
|--|----------------|--|--|--|--|

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.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。

3.本基金管理人于2020年4月20日发布公告，温秀娟女士于2020年4月20日起休产假，休假期间由本公司基金经理任爽女士代为履行基金经理职责。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 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，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

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，未发生任何不公平的交易事项。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的5%的交易共3次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，疫情冲击是最大的外生变量，与疫情所处阶段、经济数据表现等相一致，货币市场总体表现为1月中性，2月至4月宽松不断加码，5月至6月快速向常态化宽松回摆修正。宏观经济的主线是疫情冲击下的暂停与重启，其中在疫情冲击下1月至2月主要宏观数据大幅下跌，3月起经济开启重启进程，目前来看，工业和建筑业恢复最好，制造业、线下消费的恢复较为疲弱。

债券市场方面，利率先下后上，变盘时点在4月底，具体而言：1月主要受到宽松资金面的支撑，债市忽略了诸多利空缓慢上涨，临近春节随着疫情冲击开始发酵；春节后开盘，疫情对国内冲击的第一阶段，市场的反应相当充分，收益率大幅低开后转入震荡调整。然而2月下旬，疫情对海外冲击的第二阶段超预期爆发，收益率再度下行，并在原油价格战的利多推动下于3月上旬下探至阶段性的低点。随后美元流动性收紧，导致外资被动抛售，利率重新小幅调整，3月下旬利率随着美元流动性冲击减弱而再度下行。4月利率在央行下调超储利率的刺激下下行探底，但5月以后央行表现偏鹰派，市场资金面预期逐步向常态化宽松修正，受此影响各期限利率均出现了明显回调。和去年年底的点位相比，各品种收益率均出现了不同幅度的下行，期限利差整体先上后下，信用利差亦先走阔再压缩。

报告期内本基金实现了产品的转型，目前已经根据合同约定建仓完毕，成为债券型基金。展望未来本基金将会保持以高等级债券为主的配置思路。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由广发理财7天债券型证券投资基金转型为广发景宁纯债债券型证券投资基金，2020年1月1日至2020年4月21日，广发理财7天债券型证券投资基金A类基金份额净值收益率为0.8208%，B类基金份额净值收益率为0.9108%，同期业绩比较基准收益率为0.4200%；2020年4月22日至2020年6月30日，广发景宁纯债债券型证券投资基金的净值增长率为0.33%，同期业绩比较基准收益率为-1.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在“六保六稳”的目标下，央行预计仍会维持稳健的货币政策。从宽信用角度分析，央行预计仍会延续现有的各种措施，尽量增加直达实体经济的资金供给。但从货币市场角度而言，绝对收益的低点或许已经过去。在央行打击结构性存款和票据套利等“浑水摸鱼”的坚定态度下，银行间市场短期资金利率易上难下，预计下半年资金市场仍会面临较大幅度的波动。短期资金利率的新均衡中枢将也会影响整个收益率曲线的重新定价。未来我们将密切关注经济基本面的情况以及回购中枢的变化，继续秉承稳健增值的理念进行资产配置。



#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金由广发理财7天债券型证券投资基金转型为广发景宁纯债债券型证券投资基金。根据广发景宁纯债基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，2020年6月22日广发景宁纯债每10份基金份额分配0.024元。截至2020年6月30日，广发景宁纯债可供分配利润为5,779,550.17元，上述利润分配符合合同规定。根据广发理财7天债券基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，广发理财7天债券基金收益分配方式为红利再投资，每日分配，运作期期末例行收益结转。从2020年1月1日至2020年4月21日，广发理财7天债券基金累计分配收益139,260,866.66元。

### 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，本基金托管人在对广发景宁纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金利润分配、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发景宁纯债债券型证券投资基金2020年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：广发景宁纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号       | 本期末<br>2020年6月30日 |
|------------|-----------|-------------------|
| <b>资产：</b> |           |                   |
| 银行存款       | 6.1.4.7.1 | 600,540,807.78    |
| 结算备付金      |           | 200,329.27        |
| 存出保证金      |           | 15,012.16         |
| 交易性金融资产    | 6.1.4.7.2 | 5,973,221,705.21  |
| 其中：股票投资    |           | -                 |
| 基金投资       |           | -                 |
| 债券投资       |           | 5,796,045,000.00  |
| 资产支持证券投资   |           | 177,176,705.21    |
| 贵金属投资      |           | -                 |
| 衍生金融资产     | 6.1.4.7.3 | -                 |
| 买入返售金融资产   | 6.1.4.7.4 | -                 |
| 应收证券清算款    |           | -                 |

|                   |            |                           |
|-------------------|------------|---------------------------|
| 应收利息              | 6.1.4.7.5  | 125,654,915.94            |
| 应收股利              |            | -                         |
| 应收申购款             |            | -                         |
| 递延所得税资产           |            | -                         |
| 其他资产              | 6.1.4.7.6  | -                         |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>6,699,632,770.36</b>   |
| <b>负债和所有者权益</b>   |            | <b>本期末<br/>2020年6月30日</b> |
| <b>负债:</b>        |            |                           |
| 短期借款              |            | -                         |
| 交易性金融负债           |            | -                         |
| 衍生金融负债            | 6.1.4.7.3  | -                         |
| 卖出回购金融资产款         |            | 429,209,156.18            |
| 应付证券清算款           |            | -                         |
| 应付赎回款             |            | 1,968,079.78              |
| 应付管理人报酬           |            | 1,540,636.02              |
| 应付托管费             |            | 256,772.68                |
| 应付销售服务费           |            | -                         |
| 应付交易费用            | 6.1.4.7.7  | 112,344.82                |
| 应交税费              |            | 250,013.94                |
| 应付利息              |            | 247,786.56                |
| 应付利润              |            | -                         |
| 递延所得税负债           |            | -                         |
| 其他负债              | 6.1.4.7.8  | 105,473.40                |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>433,690,263.38</b>     |
| <b>所有者权益:</b>     |            |                           |
| 实收基金              | 6.1.4.7.9  | 6,260,162,956.81          |
| 未分配利润             | 6.1.4.7.10 | 5,779,550.17              |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>6,265,942,506.98</b>   |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>6,699,632,770.36</b>   |

注:报告截止日2020年6月30日,基金份额净值人民币1.0009元,基金份额总额6,260,162,956.81份。

## 6.1.2 利润表

会计主体:广发景宁纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年4月22日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号          | 本期<br>2020年4月22日(基金合同生效日)<br>至<br>2020年6月30日 |
|-----------------------|--------------|--|
| <b>一、收入</b>           |              | <b>28,465,950.01</b>                         |
| 1.利息收入                |              | 43,007,023.48                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.1.4.7.11   | 6,082,678.07                                 |
| 债券利息收入                |              | 35,843,724.56                                |
| 资产支持证券利息收入            |              | 1,066,607.15                                 |
| 买入返售金融资产收入            |              | 14,013.70                                    |
| 证券出借利息收入              |              | -  |
| 其他利息收入                |              | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |              | 30,044,477.03                                |
| 其中：股票投资收益             | 6.1.4.7.12   | -  |
| 基金投资收益                |              | -  |
| 债券投资收益                | 6.1.4.7.13   | 30,321,352.78                                |
| 资产支持证券投资收益            | 6.1.4.7.13.3 | -276,875.75                                  |
| 贵金属投资收益               |              | -  |
| 衍生工具收益                | 6.1.4.7.14   | -  |
| 股利收益                  | 6.1.4.7.15   | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.1.4.7.16   | -44,585,565.99                               |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |              | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.1.4.7.17   | 15.49  |
| <b>减：二、费用</b>         |              | <b>7,566,143.22</b>                          |
| 1. 管理人报酬              |              | 3,621,432.86                                 |
| 2. 托管费                |              | 614,060.91                                   |
| 3. 销售服务费              |              | 4,998.27                                     |
| 4. 交易费用               | 6.1.4.7.18   | 48,568.36                                    |
| 5. 利息支出               |              | 3,165,547.22                                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |              | 3,165,547.22                                 |
| 6. 税金及附加              |              | 56,851.21                                    |

|                            |            |                      |
|----------------------------|------------|----------------------|
| 7. 其他费用                    | 6.1.4.7.19 | 54,684.39            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>20,899,806.79</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>20,899,806.79</b> |

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发景宁纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年4月22日至2020年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020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）                        | 15,355,555,275.88                    | -              | 15,355,555,275.88  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                    | 20,899,806.79  | 20,899,806.79      |
| 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）      | -9,095,392,319.07                    | -126,306.73    | -9,095,518,625.80  |
| 其中：1.基金申购款                             | 6,203,634,562.68                     | -11,999.74     | 6,203,622,562.94   |
| 2.基金赎回款                                | -15,299,026,881.75                   | -114,306.99    | -15,299,141,188.74 |
| 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） | -                                    | -14,993,949.89 | -14,993,949.89     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 6,260,162,956.81                     | 5,779,550.17   | 6,265,942,506.98   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

### 6.1.4 报表附注

#### 6.1.4.1 基金基本情况

广发景宁纯债债券型证券投资基金（“本基金”）由广发理财7天债券型证券投资基金转型而成。

根据基金管理人于2020年3月24日发布的根据《关于广发理财7天债券型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自2020年4月22日起，基金名称将由“广发理财7天债券型证券投资基金”更名为“广发景宁纯债债券型证券投资基金”，《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《广发理财7天债券型证券投资基金基金合同》同日失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的财务报表于2020年8月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“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。

#### 6.1.4.3 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2020年6月30日的财务状况以及2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日止。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投

资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

## (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易

日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价：

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### **6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.1.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.1.4.4.8 损益平准金**

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### **6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已



确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### **6.1.4.4.12 分部报告**

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.1.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### **6.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### **6.1.4.6 税项**

##### **(1) 印花税**

证券（股票）交易印花税税率为1%，由出让方缴纳。

##### **(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红

利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，减按25%计入应纳税所得额；自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末            |  |
|--------------|----------------|--|
|              | 2020年6月30日     |  |
| 活期存款         | 540,807.78     |  |
| 定期存款         | 600,000,000.00 |  |
| 其中：存款期限1个月以内 | 600,000,000.00 |  |
| 存款期限1-3个月    | -              |  |
| 存款期限3个月以上    | -              |  |
| 其他存款         | -              |  |
| 合计           | 600,540,807.78 |  |

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |                  |                  |                |
|---------------|------------------|------------------|------------------|----------------|
|               | 2020年6月30日       |                  |                  |                |
|               | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动           |                |
| 股票            | -                | -                | -                |                |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -                |                |
| 债券            | 交易所市场            | 179,691,485.63   | 178,253,000.00   | -1,438,485.63  |
|               | 银行间市场            | 5,660,959,532.66 | 5,617,792,000.00 | -43,167,532.66 |
|               | 合计               | 5,840,651,018.29 | 5,796,045,000.00 | -44,606,018.29 |
| 资产支持证券        | 177,156,252.91   | 177,176,705.21   | 20,452.30        |                |
| 基金            | -                | -                | -                |                |
| 其他            | -                | -                | -                |                |
| 合计            | 6,017,807,271.20 | 5,973,221,705.21 | -44,585,565.99   |                |

##### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,729.37          |
| 应收定期存款利息   | 4,331,666.29      |
| 应收其他存款利息   | 6.12              |
| 应收结算备付金利息  | 81.09             |
| 应收债券利息     | 121,172,274.69    |
| 应收资产支持证券利息 | 149,158.38        |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 125,654,915.94    |

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 112,344.82        |
| 合计          | 112,344.82        |

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 2.48              |

|           |            |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 预提费用      | 105,470.92 |
| 合计        | 105,473.40 |

#### 6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |                    |
|----------------|--------------------------------------|--------------------|
|                | 基金份额（份）                              | 账面金额               |
| 基金合同生效日        | 15,355,555,275.88                    | 15,355,555,275.88  |
| -集中申购募集资金本金及利息 | -                                    | -                  |
| -基金拆分和集中申购完成后  | -                                    | -                  |
| 本期申购           | 6,203,634,562.68                     | 6,203,634,562.68   |
| 本期赎回（以“-”号填列）  | -15,299,026,881.75                   | -15,299,026,881.75 |
| 本期末            | 6,260,162,956.81                     | 6,260,162,956.81   |

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期初            | -              | -              | -              |
| 本期利润           | 65,485,372.78  | -44,585,565.99 | 20,899,806.79  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -43,752.53     | -82,554.20     | -126,306.73    |
| 其中：基金申购款       | 104,834.47     | -116,834.21    | -11,999.74     |
| 基金赎回款          | -148,587.00    | 34,280.01      | -114,306.99    |
| 本期已分配利润        | -14,993,949.89 | -              | -14,993,949.89 |
| 本期末            | 50,447,670.36  | -44,668,120.19 | 5,779,550.17   |

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                             |
| 定期存款利息收入  | 5,999,791.94                         |
| 其他存款利息收入  | 40.60                                |
| 结算备付金利息收入 | 78,258.16                            |

|    |              |
|----|--------------|
| 其他 | -            |
| 合计 | 6,082,678.07 |

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

##### 6.1.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                             |
|-------------------------------|--------------------------------|
|                               | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 30,321,352.78                  |
| 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                            | 30,321,352.78                  |

##### 6.1.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                             |
|-------------------------|--------------------------------|
|                         | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,520,221,552.89               |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,389,430,278.67               |
| 减：应收利息总额                | 100,469,921.44                 |
| 买卖债券差价收入                | 30,321,352.78                  |

##### 6.1.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 卖出资产支持证券成交总额   | 142,578,759.18                 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 142,755,875.75                 |
| 减：应收利息总额       | 99,759.18                      |
| 资产支持证券投资收益     | -276,875.75                    |

#### 6.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.1.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                             |
|------------------------|--------------------------------|
|                        | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 1.交易性金融资产              | -44,585,565.99                 |
| ——股票投资                 | -                              |
| ——债券投资                 | -44,606,018.29                 |
| ——资产支持证券投资             | 20,452.30                      |
| ——基金投资                 | -                              |
| ——贵金属投资                | -                              |
| ——其他                   | -                              |
| 2.衍生工具                 | -                              |
| ——权证投资                 | -                              |
| 3.其他                   | -                              |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                              |
| 合计                     | -44,585,565.99                 |

#### 6.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                             |
|---------|--------------------------------|
|         | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 15.17                          |
| 基金转换费收入 | 0.32                           |
| 合计      | 15.49                          |

#### 6.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                             |
|-----------|--------------------------------|
|           | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 268.36                         |
| 银行间市场交易费用 | 48,300.00                      |



|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 48,568.36 |
|----|-----------|

#### 6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 审计费用    | 14,153.30                            |
| 信息披露费   | 22,950.90                            |
| 证券出借违约金 | -                                    |
| 银行汇划费   | 10,657.09                            |
| 账户维护费   | 6,923.10                             |
| 其他      | -                                    |
| 合计      | 54,684.39                            |

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 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未发生变化。

##### 6.1.4.9.2 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                    |
|--------------|----------------------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构                 |
| 广发基金管理有限公司   | 基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构 |
| 广发证券股份有限公司   | 基金管理人控股股东、代销机构             |

#### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |              |
|------------|--------------------------------------|--------------|
|            | 成交金额                                 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 172,098,712.32                       | 100.00%      |

#### 6.1.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |                |
|------------|--------------------------------------|----------------|
|            | 成交金额                                 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 155,000,000.00                       | 100.00%        |

#### 6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 24,419.78                            |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.1.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 614,060.91                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.1.4.10.3 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

| 本期<br>2020年4月22日至2020年6月30日 |        |      |          |          |                  |            |
|-----------------------------|--------|------|----------|----------|------------------|------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称      | 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<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 中国工商银行股份有限公司                | -      | -    | -        | -        | 3,925,925,000.00 | 342,176.33 |

#### 6.1.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.1.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.1.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.1.4.10.5 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.1.4.10.6 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<br>2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |          |
|--------------|--------------------------------------|----------|
|              | 期末余额                                 | 当期利息收入   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 540,807.78                           | 4,587.37 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.1.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日 |            | 每10份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 利润分配合<br>计    | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------------|--------------|-------------------|---------------|----|
|    |            | 场内  | 场外         |                     |              |                   |               |    |
| 1  | 2020-06-22 | -   | 2020-06-22 | 0.024               | 1,457.94     | 14,992,491.95     | 14,993,949.89 | -  |
| 合计 |            |     |            | 0.024               | 1,457.94     | 14,992,491.95     | 14,993,949.89 | -  |

#### 6.1.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 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 429,209,156.18 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<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|--------|----------|------------|------------|--------------|----------------|
| 170209 | 17 国开 09 | 2020-07-01 | 100.46     | 1,518,000.00 | 152,498,280.00 |
| 190215 | 19 国开 15 | 2020-07-01 | 101.38     | 3,000,000.00 | 304,140,000.00 |
| 合计     |          |            |            | 4,518,000.00 | 456,638,280.00 |

#### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.1.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.1.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。

为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

#### 6.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1    | -                 |
| A-1 以下 | -                 |
| 未评级    | 592,080,000.00    |
| 合计     | 592,080,000.00    |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

#### 6.1.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.1.4.13.2.3 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<br>2020年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA    | 1,151,575,000.00  |
| AAA 以下 | 1,524,517,000.00  |
| 未评级    | 2,527,873,000.00  |
| 合计     | 5,203,965,000.00  |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.1.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA    | 177,176,705.21    |
| AAA 以下 | -                 |

|           |                       |
|-----------|-----------------------|
| 未评级       | -                     |
| <b>合计</b> | <b>177,176,705.21</b> |

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.1.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.1.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及未来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30日 | 1年以内             | 1-5年             | 5年以上             | 不计息            | 合计               |
|-------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| <b>资产：</b>        |                  |                  |                  |                |                  |
| 银行存款              | 600,540,807.78   | -                | -                | -              | 600,540,807.78   |
| 结算备付金             | 200,329.27       | -                | -                | -              | 200,329.27       |
| 存出保证金             | 15,012.16        | -                | -                | -              | 15,012.16        |
| 交易性金融资产           | 1,053,468,705.21 | 2,391,880,000.00 | 2,527,873,000.00 | -              | 5,973,221,705.21 |
| 应收利息              | -                | -                | -                | 125,654,915.94 | 125,654,915.94   |
| 资产总计              | 1,654,224,854.42 | 2,391,880,000.00 | 2,527,873,000.00 | 125,654,915.94 | 6,699,632,770.36 |
| <b>负债：</b>        |                  |                  |                  |                |                  |
| 卖出回购金融资产款         | 429,209,156.18   | -                | -                | -              | 429,209,156.18   |
| 应付赎回款             | -                | -                | -                | 1,968,079.78   | 1,968,079.78     |
| 应付管理人报酬           | -                | -                | -                | 1,540,636.02   | 1,540,636.02     |
| 应付托管费             | -                | -                | -                | 256,772.68     | 256,772.68       |
| 应付交易费用            | -                | -                | -                | 112,344.82     | 112,344.82       |
| 应交税费              | -                | -                | -                | 250,013.94     | 250,013.94       |
| 应付利息              | -                | -                | -                | 247,786.56     | 247,786.56       |
| 其他负债              | -                | -                | -                | 105,473.40     | 105,473.40       |
| 负债总计              | 429,209,156.18   | -                | -                | 4,481,107.20   | 433,690,263.38   |
| 利率敏感度缺口           | 1,225,015,698.24 | 2,391,880,000.00 | 2,527,873,000.00 | 121,173,808.74 | 6,265,942,506.98 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |
|----|-----------|------------------------------|
|    |           | 本期末<br>2020年6月30日            |



|  |               |           |
|--|---------------|-----------|
|  | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 6,167 |
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 6,278 |

#### 6.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 6.1.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

#### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 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。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为人民币 5,973,221,705.21 元，无属于第一层级和第三层级的金额（2019 年 12 月 31 日，属于第二层级的余额为人民币 12,572,154,800.00 元，无属于第一层级和第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.2 广发理财7天债券型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：广发理财7天债券型证券投资基金

报告截止日：2020年4月21日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020年4月21日         | 上年度末<br>2019年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.2.4.7.1  | 1,913,150,098.45          | 2,950,874,486.77            |
| 结算备付金           |            | -                         | -                           |
| 存出保证金           |            | 8,352.86                  | 12,057.30                   |
| 交易性金融资产         | 6.2.4.7.2  | 9,600,275,254.55          | 12,563,388,902.43           |
| 其中：股票投资         |            | -                         | -                           |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 9,375,465,831.10          | 12,230,254,148.12           |
| 资产支持证券投资        |            | 224,809,423.45            | 333,134,754.31              |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.2.4.7.3  | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.2.4.7.4  | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 3,839,756,038.79          | -                           |
| 应收利息            | 6.2.4.7.5  | 47,435,312.94             | 67,194,374.66               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.2.4.7.6  | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>15,400,625,057.59</b>  | <b>15,581,469,821.16</b>    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020年4月21日</b> | <b>上年度末<br/>2019年12月31日</b> |

|                   |            |                          |                          |
|-------------------|------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>负 债:</b>       |            |                          |                          |
| 短期借款              |            | -                        | -                        |
| 交易性金融负债           |            | -                        | -                        |
| 衍生金融负债            | 6.2.4.7.3  | -                        | -                        |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                        | 228,799,536.80           |
| 应付证券清算款           |            | -                        | -                        |
| 应付赎回款             |            | -                        | -                        |
| 应付管理人报酬           |            | 1,322,352.97             | 1,953,192.11             |
| 应付托管费             |            | 440,784.36               | 651,064.05               |
| 应付销售服务费           |            | 106,500.24               | 178,793.94               |
| 应付交易费用            | 6.2.4.7.7  | 99,236.79                | 151,822.48               |
| 应交税费              |            | 280,962.67               | 125,669.27               |
| 应付利息              |            | -                        | 37,042.16                |
| 应付利润              |            | 42,564,501.06            | 5,725,379.04             |
| 递延所得税负债           |            | -                        | -                        |
| 其他负债              | 6.2.4.7.8  | 255,443.62               | 203,000.00               |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>45,069,781.71</b>     | <b>237,825,499.85</b>    |
| <b>所有者权益:</b>     |            |                          |                          |
| 实收基金              | 6.2.4.7.9  | 15,355,555,275.88        | 15,343,644,321.31        |
| 未分配利润             | 6.2.4.7.10 | -                        | -                        |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>15,355,555,275.88</b> | <b>15,343,644,321.31</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>15,400,625,057.59</b> | <b>15,581,469,821.16</b> |

注：报告截止日 2020 年 4 月 21 日，广发景宁纯债基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 101,313,806.85 份；广发理财 7 天债券 B 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 15,254,241,469.03 份；总份额总额 15,355,555,275.88 份。

## 6.2.2 利润表

会计主体：广发理财 7 天债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 4 月 21 日

单位：人民币元

| 项 目         | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 4 月 21 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b> |            | <b>156,914,313.53</b>                    | <b>374,342,525.26</b>                         |
| 1.利息收入      |            | 146,082,355.64                           | 370,658,853.97                                |
| 其中：存款利息收入   | 6.2.4.7.11 | 24,955,523.68                            | 100,710,316.47                                |

|                              |              |                       |                       |
|------------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 债券利息收入                       |              | 116,878,111.91        | 260,097,161.95        |
| 资产支持证券利息收入                   |              | 2,570,493.39          | 8,836,780.44          |
| 买入返售金融资产收入                   |              | 1,678,226.66          | 1,014,595.11          |
| 证券出借利息收入                     |              | -                     | -                     |
| 其他利息收入                       |              | -                     | -                     |
| <b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>      |              | <b>10,831,957.89</b>  | <b>3,683,671.29</b>   |
| 其中：股票投资收益                    |              | -                     | -                     |
| 基金投资收益                       |              | -                     | -                     |
| 债券投资收益                       | 6.2.4.7.12   | 10,791,937.13         | 3,683,671.29          |
| 资产支持证券投资收益                   | 6.2.4.7.12.3 | 40,020.76             | -                     |
| 贵金属投资收益                      |              | -                     | -                     |
| 衍生工具收益                       |              | -                     | -                     |
| 股利收益                         |              | -                     | -                     |
| <b>3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b> |              | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>4.汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>     |              | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>5.其他收入（损失以“-”号填列）</b>     | 6.2.4.7.13   | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>减：二、费用</b>                |              | <b>17,653,446.87</b>  | <b>47,902,218.96</b>  |
| 1. 管理人报酬                     |              | 7,055,721.72          | 14,874,798.18         |
| 2. 托管费                       |              | 2,351,907.34          | 4,958,266.07          |
| 3. 销售服务费                     |              | 609,218.14            | 1,531,740.92          |
| 4. 交易费用                      | 6.2.4.7.14   | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                      |              | 7,423,311.42          | 26,340,275.44         |
| 其中：卖出回购金融资产支出                |              | 7,423,311.42          | 26,340,275.44         |
| 6. 税金及附加                     |              | 98,834.55             | 48,852.30             |
| 7. 其他费用                      | 6.2.4.7.15   | 114,453.70            | 148,286.05            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>   |              | <b>139,260,866.66</b> | <b>326,440,306.30</b> |
| 减：所得税费用                      |              | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>     |              | <b>139,260,866.66</b> | <b>326,440,306.30</b> |

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发理财7天债券型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年4月21日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21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）                        | 15,343,644,321.31               | -               | 15,343,644,321.31 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 139,260,866.66  | 139,260,866.66    |
| 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）      | 11,910,954.57                   | -               | 11,910,954.57     |
| 其中：1.基金申购款                             | 102,365,430.21                  | -               | 102,365,430.21    |
| 2.基金赎回款                                | -90,454,475.64                  | -               | -90,454,475.64    |
| 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） | -                               | -139,260,866.66 | -139,260,866.66   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 15,355,555,275.88               | -               | 15,355,555,275.88 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019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）                        | 20,518,099,923.48               | -               | 20,518,099,923.48 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 326,440,306.30  | 326,440,306.30    |
| 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）      | -5,295,999,964.45               | -               | -5,295,999,964.45 |
| 其中：1.基金申购款                             | 332,596,300.53                  | -               | 332,596,300.53    |
| 2.基金赎回款                                | -5,628,596,264.98               | -               | -5,628,596,264.98 |
| 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） | -                               | -326,440,306.30 | -326,440,306.30   |
| 五、期末所有者权益（基                            | 15,222,099,959.03               | -               | 15,222,099,959.03 |

|      |  |  |  |
|------|--|--|--|
| 金净值) |  |  |  |
|------|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

广发理财 7 天债券型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]63 号文《关于核准广发理财 7 天债券型证券投资基金募集的批复》批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 6 月 20 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为自 2013 年 6 月 13 日至 2013 年 6 月 17 日止，本基金为契约型开放式基金，以定期开放方式运作，存续期限不定，募集资金总额为人民币 942,755,487.21 元，有效认购户数为 2,176 户。其中广发理财 7 天债券 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 410,476,100.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 3,719.51 元；广发理财 7 天债券 B 类基金（“B 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 532,264,000.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 11,667.70 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《关于广发理财 7 天债券型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2020 年 4 月 22 日起，基金名称将由“广发理财 7 天债券型证券投资基金”更名为“广发景宁纯债债券型证券投资基金”，《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《广发理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

本基金的财务报表于 2020 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“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。

#### 6.2.4.3 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2020年4月21日（基金转型前一日）的财务状况以及2020年1月1日至2020年4月21日（基金转型前一日）的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.2.4.4 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相一致。

#### 6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.2.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债

券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所



得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020年4月21日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 263,150,098.45    |
| 定期存款         | 1,650,000,000.00  |
| 其中：存款期限1个月以内 | 500,000,000.00    |
| 存款期限1-3个月    | 1,150,000,000.00  |
| 存款期限3个月以上    | -                 |
| 其他存款         | -                 |
| 合计           | 1,913,150,098.45  |

#### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2020年4月21日 |                  |               |        |
|--------|-------|-------------------|------------------|---------------|--------|
|        |       | 摊余成本              | 影子定价             | 偏离金额          | 偏离度(%) |
| 债券     | 交易所市场 | 253,620,574.18    | 254,198,500.00   | 577,925.82    | 0.0038 |
|        | 银行间市场 | 9,121,845,256.92  | 9,165,034,000.00 | 43,188,743.08 | 0.2813 |
|        | 合计    | 9,375,465,831.10  | 9,419,232,500.00 | 43,766,668.90 | 0.2850 |
| 资产支持证券 |       | 224,809,423.45    | 225,168,000.00   | 358,576.55    | 0.0023 |
| 合计     |       | 9,600,275,254.55  | 9,644,400,500.00 | 44,125,245.45 | 0.2874 |

#### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年4月21日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 128,289.65        |
| 应收定期存款利息   | 7,764,652.13      |
| 应收其他存款利息   | 13.22             |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 39,110,972.20     |
| 应收资产支持证券利息 | 431,385.74        |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 47,435,312.94     |

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年4月21日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 99,236.79         |
| 合计          | 99,236.79         |

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年4月21日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 预提费用        | 255,443.62        |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 255,443.62 |
|----|------------|

#### 6.2.4.7.9 实收基金

广发理财7天债券A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 190,779,671.11             | 190,779,671.11 |
| 本期申购          | 988,611.38                 | 988,611.38     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -90,454,475.64             | -90,454,475.64 |
| 本期末           | 101,313,806.85             | 101,313,806.85 |

广发理财7天债券B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 15,152,864,650.20          | 15,152,864,650.20 |
| 本期申购          | 101,376,818.83             | 101,376,818.83    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -                 |
| 本期末           | 15,254,241,469.03          | 15,254,241,469.03 |

注：申购含转换转入、红利再投资、级别调整入份（金）额，赎回含转换转出、级别调整出份（金）额。

#### 6.2.4.7.10 未分配利润

广发理财7天债券A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 1,247,469.88  | -     | 1,247,469.88  |
| 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        | -1,247,469.88 | -     | -1,247,469.88 |

|     |   |   |   |
|-----|---|---|---|
| 本期末 | - | - | - |
|-----|---|---|---|

广发理财7天债券B

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 138,013,396.78  | -     | 138,013,396.78  |
| 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        | -138,013,396.78 | -     | -138,013,396.78 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 146,382.76                 |
| 定期存款利息收入  | 24,807,708.34              |
| 其他存款利息收入  | 54.90                      |
| 结算备付金利息收入 | 1,377.68                   |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 24,955,523.68              |

6.2.4.7.12 债券投资收益

6.2.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 10,791,937.13              |
| 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                            | 10,791,937.13              |

6.2.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 19,122,654,548.60          |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 19,054,206,749.19          |
| 减：应收利息总额                | 57,655,862.28              |
| 买卖债券差价收入                | 10,791,937.13              |

#### 6.2.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 292,948,685.22             |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 292,608,679.24             |
| 减：应收利息总额       | 299,985.22                 |
| 资产支持证券投资收益     | 40,020.76                  |

#### 6.2.4.7.13 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.2.4.7.14 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.2.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 22,645.28                  |
| 信息披露费   | 36,721.44                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行汇划费   | 23,410.08                  |
| 账户维护费   | 11,076.90                  |
| 其他      | 20,600.00                  |
| 合计      | 114,453.70                 |

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日,本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 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未发生变化。

##### 6.2.4.9.2 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                    |
|--------------|----------------------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构                 |
| 广发基金管理有限公司   | 基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构 |
| 广发证券股份有限公司   | 基金管理人控股股东、代销机构             |

##### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.2.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.2.4.10.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |              | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 254,588,807.37             | 100.00%      | 110,322,490.95                  | 100.00%      |

###### 6.2.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |                | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                |
|------------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 13,918,500,000.00          | 100.00%        | -                               | -              |

#### 6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月<br>21日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,055,721.72                   | 14,874,798.18                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 34,918.45                      | 132,294.51                          |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年4月<br>21日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,351,907.34                   | 4,958,266.07                        |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.2.4.10.2.3 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<br>2020年1月1日至2020年4月21日      |            |              |
|----------------|---------------------------------|------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |              |
|                | 广发理财7天债券A                       | 广发理财7天债券B  | 合计           |
| 广发基金管理有限公司     | 10,154.79                       | 469,762.03 | 479,916.82   |
| 中国工商银行股份有限公司   | 88,151.33                       | -          | 88,151.33    |
| 广发证券股份有限公司     | 626.75                          | -          | 626.75       |
| 合计             | 98,932.87                       | 469,762.03 | 568,694.90   |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |            |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |              |
|                | 广发理财7天债券A                       | 广发理财7天债券B  | 合计           |
| 广发基金管理有限公司     | 54,340.85                       | 972,525.19 | 1,026,866.04 |
| 中国工商银行股份有限公司   | 323,410.82                      | 500.10     | 323,910.92   |
| 广发证券股份有限公司     | 4,694.84                        | -          | 4,694.84     |
| 合计             | 382,446.51                      | 973,025.29 | 1,355,471.80 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。



费率。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.2.4.10.3 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

| 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日      |        |      |       |      |                  |            |
|---------------------------------|--------|------|-------|------|------------------|------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 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       |
| 中国工商银行股份有限公司                    | -      | -    | -     | -    | 2,998,118,000.00 | 308,592.29 |
| 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |        |      |       |      |                  |            |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 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       |
| 中国工商银行股份有限公司                    | -      | -    | -     | -    | 3,485,049,000.00 | 352,962.60 |

#### 6.2.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.2.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.2.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.2.4.10.5.2 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

###### 广发理财7天债券A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

###### 广发理财7天债券B

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.2.4.10.6 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<br>2020年1月1日至2020年4月21日 |            | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |          |
|--------------|----------------------------|------------|---------------------------------|----------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 263,150,098.45             | 146,382.76 | 661,747.58                      | 4,936.15 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.2.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2020年1月1日至2020年4月21日      |         |          |            |            |               |
|---------------------------------|---------|----------|------------|------------|---------------|
| 关联方名称                           | 证券代码    | 证券名称     | 发行方式       | 基金在承销期内买入  |               |
|                                 |         |          |            | 数量（单位：股/张） | 总金额           |
| 广发证券股份有限公司                      | 2089052 | 20 兴银 2A | 一级市场<br>分销 | 850,000.00 | 85,000,000.00 |
| 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |         |          |            |            |               |
| 关联方名称                           | 证券代码    | 证券名称     | 发行方式       | 基金在承销期内买入  |               |
|                                 |         |          |            | 数量（单位：股/张） | 总金额           |
| 广发证券股份有限公司                      | -       | -        | -          | -          | -             |

### 6.2.4.11 利润分配情况

广发理财7天债券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 |
|--------------|---------------|------------|--------------|----|
| 988,611.38   | 56,314.43     | 202,544.07 | 1,247,469.88 | -  |

广发理财7天债券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 |
|----------------|---------------|---------------|----------------|----|
| 101,376,818.83 | -             | 36,636,577.95 | 138,013,396.78 | -  |

### 6.2.4.12 期末（2020年4月21日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2020年4月21日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2020年4月21日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年4月21日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年4月21日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.2.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2020年4月21日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

#### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.2.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

##### 6.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年4月21日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 269,776,700.58    | 120,031,366.45      |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 2,252,308,031.69  | 2,123,132,629.43    |
| 合计     | 2,522,084,732.27  | 2,243,163,995.88    |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

##### 6.2.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年4月21日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |

|        |   |                |
|--------|---|----------------|
| A-1 以下 | - | -              |
| AAA    | - | 333,134,754.31 |
| 未评级    | - | -              |
| 合计     | - | 333,134,754.31 |

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

#### 6.2.4.13.2.3 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<br>2020年4月21日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| AAA    | 3,812,849,887.31  | 6,234,433,679.62    |
| AAA 以下 | 2,319,917,730.65  | 3,379,436,322.56    |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 6,132,767,617.96  | 9,613,870,002.18    |

注：短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

#### 6.2.4.13.2.4 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<br>2020年4月21日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 619,328,673.08    | 373,220,150.06      |
| AAA 以下 | 101,284,807.79    | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 720,613,480.87    | 373,220,150.06      |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.2.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年4月21日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 224,809,423.45    | -                   |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 224,809,423.45    | -                   |

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

#### 6.2.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.2.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.2.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年4月21日           | 1年以内              | 1-5年        | 5年以上        | 不计息              | 合计                |
|-----------------------------|-------------------|-------------|-------------|------------------|-------------------|
| <b>资产:</b>                  |                   |             |             |                  |                   |
| 银行存款                        | 1,913,150,098.45  | -           | -           | -                | 1,913,150,098.45  |
| 结算备付金                       | -                 | -           | -           | -                | -                 |
| 存出保证金                       | 8,352.86          | -           | -           | -                | 8,352.86          |
| 交易性金融资产                     | 9,600,275,254.55  | -           | -           | -                | 9,600,275,254.55  |
| 应收证券清算款                     | -                 | -           | -           | 3,839,756,038.79 | 3,839,756,038.79  |
| 应收利息                        | -                 | -           | -           | 47,435,312.94    | 47,435,312.94     |
| 资产总计                        | 11,513,433,705.86 | -           | -           | 3,887,191,351.73 | 15,400,625,057.59 |
| <b>负债:</b>                  |                   |             |             |                  |                   |
| 应付管理人报酬                     | -                 | -           | -           | 1,322,352.97     | 1,322,352.97      |
| 应付托管费                       | -                 | -           | -           | 440,784.36       | 440,784.36        |
| 应付销售服务费                     | -                 | -           | -           | 106,500.24       | 106,500.24        |
| 应付交易费用                      | -                 | -           | -           | 99,236.79        | 99,236.79         |
| 应交税费                        | -                 | -           | -           | 280,962.67       | 280,962.67        |
| 应付利润                        | -                 | -           | -           | 42,564,501.06    | 42,564,501.06     |
| 其他负债                        | -                 | -           | -           | 255,443.62       | 255,443.62        |
| 负债总计                        | -                 | -           | -           | 45,069,781.71    | 45,069,781.71     |
| 利率敏感度缺口                     | 11,513,433,705.86 | -           | -           | 3,842,121,570.02 | 15,355,555,275.88 |
| <b>上年度末<br/>2019年12月31日</b> | <b>1年以内</b>       | <b>1-5年</b> | <b>5年以上</b> | <b>不计息</b>       | <b>合计</b>         |
| <b>资产:</b>                  |                   |             |             |                  |                   |
| 银行存款                        | 2,950,874,486.77  | -           | -           | -                | 2,950,874,486.77  |
| 存出保证金                       | 12,057.30         | -           | -           | -                | 12,057.30         |
| 交易性金融资产                     | 12,563,388,902.43 | -           | -           | -                | 12,563,388,902.43 |
| 应收利息                        | -                 | -           | -           | 67,194,374.66    | 67,194,374.66     |
| 资产总计                        | 15,514,275,446.50 | -           | -           | 67,194,374.66    | 15,581,469,821.16 |
| <b>负债:</b>                  |                   |             |             |                  |                   |
| 卖出回购金融资产款                   | 228,799,536.80    | -           | -           | -                | 228,799,536.80    |
| 应付管理人报酬                     | -                 | -           | -           | 1,953,192.11     | 1,953,192.11      |

|         |                   |   |   |               |                   |
|---------|-------------------|---|---|---------------|-------------------|
| 应付托管费   | -                 | - | - | 651,064.05    | 651,064.05        |
| 应付销售服务费 | -                 | - | - | 178,793.94    | 178,793.94        |
| 应付交易费用  | -                 | - | - | 151,822.48    | 151,822.48        |
| 应交税费    | -                 | - | - | 125,669.27    | 125,669.27        |
| 应付利息    | -                 | - | - | 37,042.16     | 37,042.16         |
| 应付利润    | -                 | - | - | 5,725,379.04  | 5,725,379.04      |
| 其他负债    | -                 | - | - | 203,000.00    | 203,000.00        |
| 负债总计    | 228,799,536.80    | - | - | 9,025,963.05  | 237,825,499.85    |
| 利率敏感度缺口 | 15,285,475,909.70 | - | - | 58,168,411.61 | 15,343,644.321.31 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析          | 相关风险变量的变动    | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|-------------|--------------|---------------------------------|---------------------|
|             |              | 本期末<br>2020年4月21日               | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|             |              | 市场利率上升25个基点                     | -8,572,930.43       |
| 市场利率下降25个基点 | 8,595,880.54 | 7,787,320.86                    |                     |

#### 6.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金转型前及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，且以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

#### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公



允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 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。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2020年4月21日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为人民币9,600,275,254.55元，无属于第一层级和第三层级的金额（2019年12月31日，属于第二层级的余额为人民币12,563,388,902.43元，无属于第一层级和第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020年4月22日-2020年6月30日)

#### 7.1.1 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  | 权益投资   | -                | -            |
|    | 其中：股票  | -                | -            |
| 2  | 基金投资   | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 5,973,221,705.21 | 89.16        |
|    | 其中：债券  | 5,796,045,000.00 | 86.51        |
|    | 资产支持证券 | 177,176,705.21   | 2.64         |
| 4  | 贵金属投资  | -                | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 600,741,137.05   | 8.97   |
| 7 | 其他各项资产            | 125,669,928.10   | 1.88   |
| 8 | 合计                | 6,699,632,770.36 | 100.00 |

### 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 7.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.1.5 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      | 3,336,494,000.00 | 53.25        |
|    | 其中:政策性金融债 | 2,849,094,000.00 | 45.47        |
| 4  | 企业债券      | 271,780,000.00   | 4.34         |
| 5  | 企业短期融资券   | 270,859,000.00   | 4.32         |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 1,916,912,000.00 | 30.59 |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -     |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 5,796,045,000.00 | 92.50 |

#### 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称      | 数量(张)      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 180210  | 18 国开 10  | 14,500,000 | 1,518,295,000.00 | 24.23        |
| 2  | 2028018 | 20 交通银行二级 | 5,000,000  | 487,400,000.00   | 7.78         |
| 3  | 180205  | 18 国开 05  | 4,300,000  | 473,473,000.00   | 7.56         |
| 4  | 190215  | 19 国开 15  | 4,000,000  | 405,520,000.00   | 6.47         |
| 5  | 170209  | 17 国开 09  | 2,100,000  | 210,966,000.00   | 3.37         |

#### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码    | 证券名称      | 数量(份)     | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 138835  | 兴恒 3A     | 890,000   | 89,000,000.00 | 1.42         |
| 2  | 1989263 | 19 福元 1A2 | 1,500,000 | 64,410,000.00 | 1.03         |
| 3  | 2089052 | 20 兴银 2A  | 850,000   | 12,274,000.00 | 0.20         |
| 4  | 139631  | 京东 24B    | 60,000    | 6,102,705.21  | 0.10         |
| 5  | 1789345 | 17 建元 9A1 | 500,000   | 5,390,000.00  | 0.09         |

#### 7.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 7.1.12 投资组合报告附注

**7.1.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到北京市西城区卫生健康委员会的处罚。

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。

**7.1.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 7.1.12.3 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   | 15,012.16      |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 125,654,915.94 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 125,669,928.10 |

### 7.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2 广发理财7天债券型证券投资基金

(报告期：2020年1月1日-2020年4月21日)

### 7.2.1 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            | 9,600,275,254.55  | 62.34        |
|    | 其中：债券             | 9,375,465,831.10  | 60.88        |
|    | 资产支持证券            | 224,809,423.45    | 1.46         |
| 2  | 买入返售金融资产          | -                 | -            |
|    | 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      | 1,913,150,098.45  | 12.42        |
| 4  | 其他各项资产            | 3,887,199,704.59  | 25.24        |
| 5  | 合计                | 15,400,625,057.59 | 100.00       |

### 7.2.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例(%) |               |
|----|--------------|---------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 9.79          |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             |               |
| 序号 | 项目           | 金额            | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -             | -             |
|    | 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

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 7.2.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.2.3.1 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    | 91  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 124 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 80  |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过127天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.2.3.2 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                | 12.07              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 12.31              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60天(含)—90天           | 10.48              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)—120天          | 6.30               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 33.82              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
|    | 合计                   | 74.98              | -                  |

7.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

7.2.5 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      | 摊余成本             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 854,400,675.95   | 5.56         |
|    | 其中：政策性金融债 | 603,556,415.95   | 3.93         |
| 4  | 企业债券      | 253,620,574.18   | 1.65         |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,818,726,110.88 | 11.84        |
| 6  | 中期票据      | 315,950,852.13   | 2.06         |
| 7  | 同业存单      | 6,132,767,617.96 | 39.94        |
| 8  | 其他        | -                | -            |

|    |                    |                  |       |
|----|--------------------|------------------|-------|
| 9  | 合计                 | 9,375,465,831.10 | 61.06 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                | -     |

### 7.2.6 期末按摊余成本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)      | 摊余成本           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------------|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 111970659 | 19 东莞农村商业银行 CD077  | 5,000,000.00 | 492,277,717.62 | 3.21         |
| 2  | 112014007 | 20 江苏银行 CD007      | 5,000,000.00 | 488,652,253.85 | 3.18         |
| 3  | 112093379 | 20 广东南海农商行 CD002   | 4,200,000.00 | 413,836,411.96 | 2.70         |
| 4  | 111975341 | 19 昆山农村商行 CD035    | 4,000,000.00 | 398,841,688.25 | 2.60         |
| 5  | 112092071 | 20 无锡农村商业银行 CD002  | 4,000,000.00 | 396,455,360.26 | 2.58         |
| 6  | 111985297 | 19 青岛农商行 CD095     | 3,500,000.00 | 346,379,257.35 | 2.26         |
| 7  | 112092606 | 20 无锡农村商业银行 CD004  | 3,000,000.00 | 299,308,208.52 | 1.95         |
| 8  | 111998682 | 19 南京银行 CD043      | 3,000,000.00 | 299,134,756.17 | 1.95         |
| 9  | 111975291 | 19 张家港农村商业银行 CD053 | 3,000,000.00 | 298,839,184.37 | 1.95         |
| 10 | 112092593 | 20 长城华西银行 CD001    | 3,000,000.00 | 296,592,649.49 | 1.93         |

### 7.2.7 “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                   | 0.4025% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0420% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1686% |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.2.8 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值 | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|------|--------|
|----|------|------|-------|------|--------|

|   |         |                 |           |               | 值比例(%) |
|---|---------|-----------------|-----------|---------------|--------|
| 1 | 1989263 | 19 福元 1A2       | 1,500,000 | 86,488,590.89 | 0.56   |
| 2 | 2089052 | 20 兴银 2A        | 850,000   | 46,427,000.00 | 0.30   |
| 3 | 1889100 | 18 融腾<br>2B_bc  | 700,000   | 33,689,116.84 | 0.22   |
| 4 | 1889231 | 18 德宝天<br>元 1A  | 3,300,000 | 25,161,717.00 | 0.16   |
| 5 | 1889021 | 18 建元<br>2A1_bc | 2,600,000 | 23,296,000.00 | 0.15   |
| 6 | 1789345 | 17 建元 9A1       | 500,000   | 9,746,998.72  | 0.06   |

## 7.2.9 投资组合报告附注

### 7.2.9.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

7.2.9.2 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 7.2.9.3 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   | 8,352.86         |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,839,756,038.79 |
| 3  | 应收利息    | 47,435,312.94    |
| 4  | 应收申购款   | -                |
| 5  | 其他应收款   | -                |
| 6  | 待摊费用    | -                |
| 7  | 其他      | -                |
| 8  | 合计      | 3,887,199,704.59 |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020年4月22日-2020年6月30日)

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份



| 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 |
| 6,435    | 972,830.30 | 6,186,190,935.81 | 98.82% | 73,972,021.00 | 1.18%  |

### 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 31,354.24 | 0.0005%  |

### 8.1.3 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的情况

| 项目                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 8.2 广发理财7天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年4月21日)

### 8.2.1 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 |
| 广发理财7天债券A | 7,131    | 14,207.52         | 57,645.47         | 0.06%   | 101,256,161.38 | 99.94% |
| 广发理财7天债券B | 1        | 15,254,241,469.03 | 15,254,241,469.03 | 100.00% | 0.00           | 0.00%  |
| 合计        | 7,132    | 2,153,050.38      | 15,254,299,114.50 | 99.34%  | 101,256,161.38 | 0.66%  |

### 8.2.2 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 | 广发理财7天债券A | 35,183.49 | 0.0347%  |

|        |           |           |         |
|--------|-----------|-----------|---------|
| 员持有本基金 | 广发理财7天债券B | 0.00      | 0.0000% |
|        | 合计        | 35,183.49 | 0.0002% |

### 8.2.3 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的情况

| 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 | 广发理财7天债券A | 0                 |
|                                | 广发理财7天债券B | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 广发理财7天债券A | 0                 |
|                                | 广发理财7天债券B | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

### 9.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2020年4月22日-2020年6月30日)

单位: 份

|                           |                   |
|---------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2020年4月22日)基金份额总额 | 15,355,555,275.88 |
| 本报告期基金总申购份额               | 6,203,634,562.68  |
| 减: 本报告期基金总赎回份额            | 15,299,026,881.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额              | 6,260,162,956.81  |

### 9.2 广发理财7天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年4月21日)

单位: 份

| 项目                        | 广发理财7天债券A      | 广发理财7天债券B         |
|---------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2013年6月20日)基金份额总额 | 410,479,819.51 | 532,275,667.70    |
| 本报告期期初基金份额总额              | 190,779,671.11 | 15,152,864,650.20 |
| 本报告期基金总申购份额               | 988,611.38     | 101,376,818.83    |
| 减: 本报告期基金总赎回份额            | 90,454,475.64  | -                 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              | -                 |

|             |                |                   |
|-------------|----------------|-------------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 101,313,806.85 | 15,254,241,469.03 |
|-------------|----------------|-------------------|

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金自2020年2月21日起至2020年3月22日15:00止，以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于广发理财7天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。

### 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

本基金管理人于2020年7月11日发布公告，自2020年7月11日起，邱春杨先生不再担任公司督察长，程才良先生新任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金是由广发理财7天债券型证券投资基金变更而来，投资策略发生改变。详情请查阅本基金基金合同或招募说明书。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2020年4月22日(基金合同生效日)-2020年6月30日)

##### 10.7.1.1 基金租用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 |    |
|      |        |      |              |           |            |    |

|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 东莞证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中天证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 国元证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 万和证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 东海证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券     | 4 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 英大证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券     | 4 | - | - | - | - | - |
| 华创证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 华林证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券     | 3 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源     | 6 | - | - | - | - | - |
| 民生证券     | 3 | - | - | - | - | - |
| 招商证券     | 4 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券     | 3 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券     | 2 | - | - | - | - | - |
| 国都证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安     | 3 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券     | 1 | - | - | - | - | - |
| 北京高华     | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券     | 3 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证    | 1 | - | - | - | - | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 券          |   |   |   |   |   |   |
| 西部证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 安信证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证<br>券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | 5 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券      | 3 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华菁证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中原证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券       | 7 | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 国金证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 东北证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中银国际       | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 财富证券       | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

**10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|----------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|          | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东莞证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华融证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西藏东方财富证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中天证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 湘财证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 联讯证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国元证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广州证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 德邦证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 万和证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东吴证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东海证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华宝证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 英大证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 万联证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长城证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 瑞银证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 川财证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华福证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华林证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|            |                |             |                |         |   |   |
|------------|----------------|-------------|----------------|---------|---|---|
| 招商证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 渤海证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 南京证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 西南证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国联证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 天风证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 华鑫证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国都证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国泰君安       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 浙商证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 上海证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 华安证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 北京高华       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 信达证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 第一创业<br>证券 | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 西部证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 长江证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 安信证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 平安证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国海证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中山证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中金公司       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中金财富<br>证券 | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中信证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中信建投       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 新时代证<br>券  | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 世纪证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 华菁证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中泰证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 中原证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 银河证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国盛证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 广发证券       | 172,098,712.32 | 100.00<br>% | 155,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 海通证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 太平洋证<br>券  | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 首创证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 华泰证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |
| 国金证券       | -              | -           | -              | -       | - | - |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | - | - | - | - | - | - |

**10.7.2 广发理财7天债券型证券投资基金**

(报告期: 2020年1月1日-2020年4月21日)

**10.7.2.1 基金租用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 |    |
| 东莞证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华融证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西藏东方财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中天证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 湘财证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 联讯证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国元证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广州证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 德邦证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 万和证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东海证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券     | 4      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华宝证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 英大证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 万联证券     | 4      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 瑞银证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华福证券     | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华林证券     | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券     | 3      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源     | 6      | -    | -            | -         | -          | -  |



|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 民生证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 国都证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安       | 3 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 北京高华       | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证<br>券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 安信证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证<br>券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 中信建投       | 5 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券      | 3 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华菁证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 中原证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | 4 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券       | 7 | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | 5 | - | - | - | - | - |
| 国金证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券       | 3 | - | - | - | - | - |
| 东北证券       | 4 | - | - | - | - | - |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

#### 10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|----------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|          | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东莞证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华融证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西藏东方财富证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中天证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 湘财证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 联讯证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国元证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广州证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 德邦证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 万和证券     | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券       | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券       | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券       | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券       | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券       | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券       | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华林证券       | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券       | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券       | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安       | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华       | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券       | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券       | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | - | - | - | - | - | - |

|       |                |             |                   |         |   |   |
|-------|----------------|-------------|-------------------|---------|---|---|
| 中信建投  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 新时代证券 | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 世纪证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 华菁证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 中泰证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 中原证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 银河证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 国盛证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 广发证券  | 254,588,807.37 | 100.00<br>% | 13,918,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 海通证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 太平洋证券 | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 首创证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 华泰证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 国金证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 光大证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 东北证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 中银国际  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 方正证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |
| 财富证券  | -              | -           | -                 | -       | - | - |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

广发理财7天债券型证券投资基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 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  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金恢复机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-06-30 |
| 2  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金分红公告                    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-06-19 |
| 3  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金暂停机构投资者大额申购（含转换转入）业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-06-17 |
| 4  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金暂停个人投资者申购、转换转入业务的公告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-04-22 |
| 5  | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-04-21 |
| 6  | 关于代为履行基金经理职责的公告                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-04-20 |
| 7  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金开                       | 中国证监会指定报刊    | 2020-04-20 |

|    |  |              |            |
|----|--|--------------|------------|
|    | 放日常申购、赎回和转换业务的公告                         | 及网站          |            |
| 8  | 关于广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-04-20 |
| 9  | 关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-04-13 |
| 10 | 关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-03-30 |
| 11 | 广发基金管理有限公司旗下基金2019年年度报告提示性公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-03-27 |
| 12 | 关于广发理财7天债券型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-03-24 |
| 13 | 关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-03-16 |
| 14 | 关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-03-02 |
| 15 | 关于旗下基金调整申购(含定期定额投资)及转换转入确认业务规则的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-02-28 |
| 16 | 关于召开广发理财7天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的第二次提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-02-21 |
| 17 | 关于召开广发理财7天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告的第一次提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-02-20 |
| 18 | 关于召开广发理财7天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-02-19 |
| 19 | 关于广发理财7天债券型证券投资基金继续暂停申购业务的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-02-15 |
| 20 | 关于广发理财7天债券型证券投资基金继续暂停申购业务的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-01-23 |
| 21 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金2019年第4季度报告提示性公告         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-01-17 |
| 22 | 关于广发理财7天债券型证券投资基金继续暂停申购业务的公告             | 中国证监会指定报刊及网站 | 2020-01-11 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

#### 11.1.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|-------|----------------|------------------------|------|------|------|------------|------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |
|       |                |                        |      |      |      |            |      |

|   |   |                   |                       |                  |                   |                  |        |
|---|---|-------------------|-----------------------|------------------|-------------------|------------------|--------|
| 机构  | 1 | 20200422-20200630 | 15,254,241.46<br>9.03 | 6,203,201,538.62 | 15,271,310,002.62 | 6,186,133,005.03 | 98.82% |
| 产品特有风险  |   |                   |                       |                  |                   |                  |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> |   |                   |                       |                  |                   |                  |        |

## 11.2 广发理财7天债券型证券投资基金

### 11.2.1 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                       |                |      | 报告期末持有基金情况        |        |
|---|----------------|------------------------|-----------------------|----------------|------|-------------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额                  | 申购份额           | 赎回份额 | 持有份额              | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20200101-20200421      | 15,152,864.65<br>0.20 | 101,376,818.83 | -    | 15,254,241.469.03 | 99.34% |
| 产品特有风险  |                |                        |                       |                |      |                   |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> |                |                        |                       |                |      |                   |        |

### 11.3 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和本基金基金合同的有关约定，本基金自 2020 年 2 月 21 日起至 2020 年 3 月 22 日 15:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2020 年 3 月 23 日审议通过了《关于广发理财 7 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发理财 7 天债券型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

2、根据《关于广发理财 7 天债券型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2020 年 4 月 22 日起，基金名称由“广发理财 7 天债券型证券投资基金”更名为“广发景宁纯债债券型证券投资基金”，《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《广发理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》同日失效。广发理财 7 天债券型证券投资基金正式变更为广发景宁纯债债券型

证券投资基金，本基金基金合同当事人将按照《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发理财 7 天债券型证券投资基金变更注册为广发景宁纯债债券型证券投资基金的文件

（二）《广发景宁纯债债券型证券投资基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

（四）《广发景宁纯债债券型证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十七日