

广发景荣纯债债券型证券投资基金
(原广发理财 30 天债券型证券投资基金转型)
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

广发景荣纯债债券型证券投资基金由广发理财 30 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 30 天债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 1 月 14 日生效。2020 年 8 月 27 日广发理财 30 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 30 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金管理人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 9 月 25 日起，《广发景荣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 30 天债券型证券投资基金基金合同》，广发理财 30 天债券型证券投资基金正式变更为广发景荣纯债债券型证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发理财 30 天债券型证券投资基金报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 24 日止，广发景荣纯债债券型证券投资基金报告期自 2020 年 9 月 25 日至 2020 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

基金简称	广发景荣纯债
基金主代码	270046

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年9月25日
报告期末基金份额总额	6,327,968,656.35份
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	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
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

2.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

基金简称	广发理财30天债券
基金主代码	270046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月14日
报告期末基金份额总额	6,319,143,112.09份
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发理财30天债券A	广发理财30天债券B
下属分级基金的交易代码	270046	270047
报告期末下属分级基金的份额总额	212, 570, 829. 85份	6, 106, 572, 282. 24份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2020年9月25日-2020年9月30日)
1. 本期已实现收益	2, 422, 584. 06
2. 本期利润	2, 092, 609. 49
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0003
4. 期末基金资产净值	6, 330, 061, 265. 84
5. 期末基金份额净值	1. 0003

注：（1）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。

（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。

3.1.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 24 日)	
	广发理财 30 天债券 A	广发理财 30 天债券 B
1. 本期已实现收益	1,191,881.98	79,677,633.49
2. 本期利润	1,191,881.98	79,677,633.49
3. 期末基金资产净值	212,570,829.85	6,106,572,282.24

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

（报告期：2020年9月25日-2020年9月30日）

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合	0.03%	0.04%	-0.09%	0.03%	0.12%	0.01%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

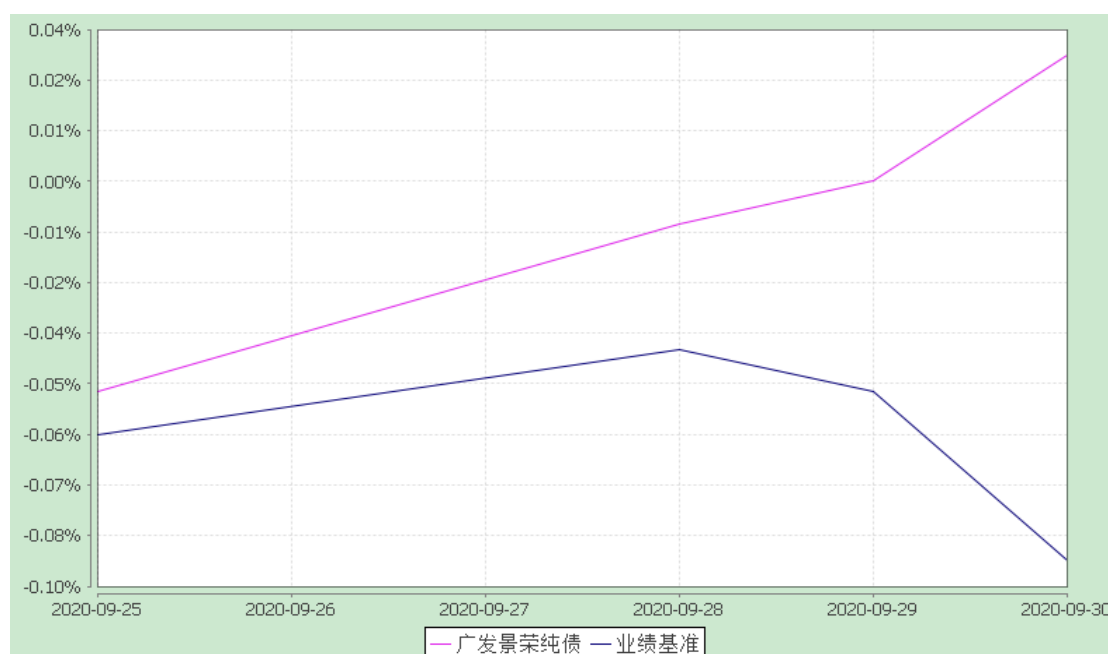
注：自2020年9月25日起，本基金的业绩比较基准由“七天通知存款利率(税后)”变更为“中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行一年期定期存款利率(税后)×10%”。

3.2.1.2 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

广发景荣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9月25日-2020年9月30日)



注：(1) 本基金转型日期为2020年9月25日，至披露时点未满一年。

(2) 本基金于2020年9月25日正式转型为广发景荣纯债债券型证券投资基金。

(3) 自2020年9月25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%”。

3.2.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

(报告期：2020年7月1日-2020年9月24日)

3.2.2.1 本报告期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 30 天债券 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4828%	0.0018%	0.3450%	0.0000%	0.1378%	0.0018%
过去六个月	0.9232%	0.0013%	0.6900%	0.0000%	0.2332%	0.0013%
过去一年	2.1587%	0.0013%	1.3725%	0.0000%	0.7862%	0.0013%
过去三年	9.5815%	0.0027%	4.1100%	0.0000%	5.4715%	0.0027%
过去五年	17.3315%	0.0041%	6.8513%	0.0000%	10.4802%	0.0041%
自基金合同生效起至今	32.8363%	0.0063%	10.5413%	0.0000%	22.2950%	0.0063%

广发理财 30 天债券 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5562%	0.0018%	0.3450%	0.0000%	0.2112%	0.0018%
过去六个月	1.0706%	0.0013%	0.6900%	0.0000%	0.3806%	0.0013%
过去一年	2.4557%	0.0013%	1.3725%	0.0000%	1.0832%	0.0013%
过去三年	10.5386%	0.0027%	4.1100%	0.0000%	6.4286%	0.0027%
过去五年	19.0408%	0.0041%	6.8513%	0.0000%	12.1895%	0.0041%
自基金合同生效起至今	35.8276%	0.0063%	10.5413%	0.0000%	25.2863%	0.0063%

注：（1）本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期末集中支付；

（2）过去三个月为2020年6月25日至2020年9月24日，过去六个月为2020年3月25日至2020年9月24日，过去一年为2019年9月25日至2020年9月24日，过去三年为2017年9月25日至2020年9月24日，过去五年为2015年9月25日至2020年9月24日，自基金合同生效起至今为2013年1月14日至2020年9月24日。

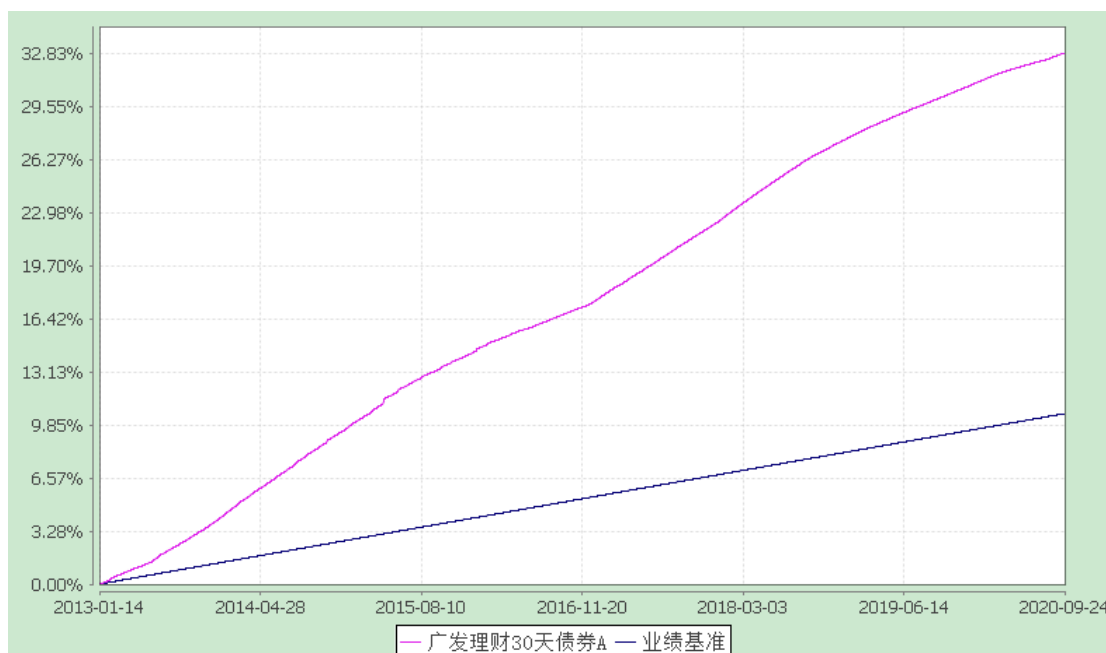
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财 30 天债券型证券投资基金

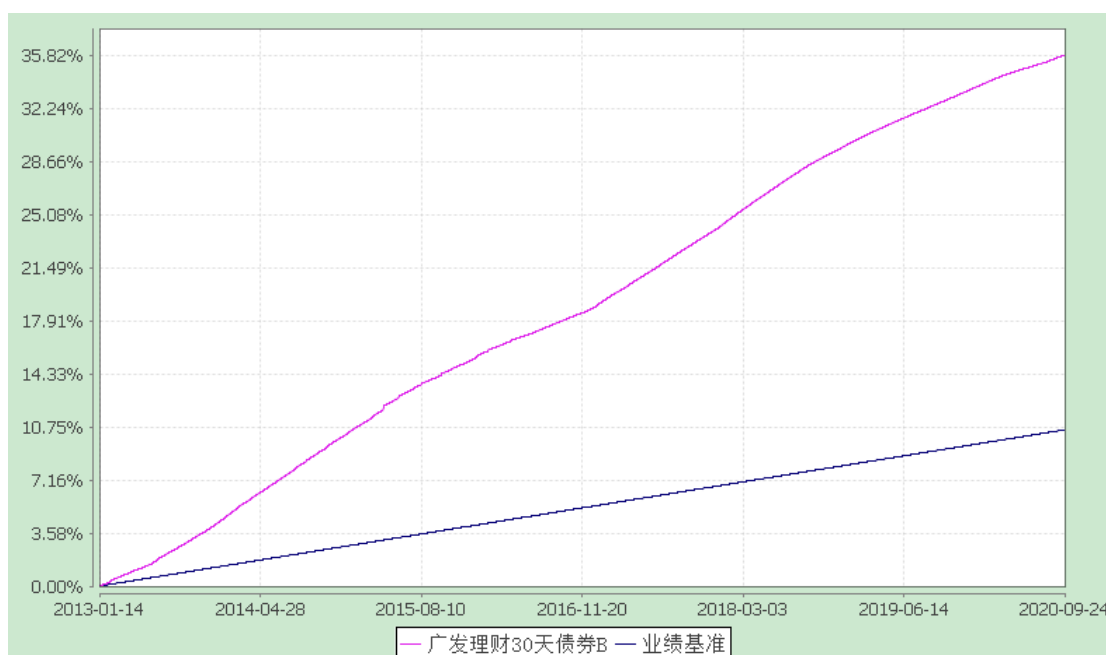
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 1 月 14 日至 2020 年 9 月 24 日)

广发理财 30 天债券 A



广发理财 30 天债券 B



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾雪	本基金的基金经理; 广发	2020-	-	10年	曾雪兰女士, 经济学硕士,

兰	现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理	09-25			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债券交易员、债券研究员、基金经理助理、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 2 月 6 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 7 月 22 日至 2020 年 9 月 24 日)。
---	----------------------	-------	--	--	--

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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，未发生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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度，债市收益率震荡上行，除了7月上旬股市明显上涨带来的负面冲击外，资金利率预期的变化仍然是驱动市场波动的主线。虽然DR007实现了货币政策执行报告中表述的“围绕OMO利率中枢波动”，但以超储率衡量的流动性总量水平偏低，且银行体系的中长期负债困境待解，并不利于资金利率预期的稳定，市场情绪也容易受到包括一级发行缴款、缴税激增等因素的负面冲击。纵观全季，在资金利率预期主导下，现券收益率曲线平坦化上移，信用债总体表现仍好于利率债，信用利差压缩至较低的历史分位水平。

组合在本季度密切跟踪市场动向，灵活调整了持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。

展望下季度，当前市场利率已经充分反映了对“基本面向潜在增速回归”、“货币政策回归中性”等趋势的预期；不过，基本面仍然在回升过程中、货币政策短期难以大幅宽松以及银行体系的中长期负债压力仍待解决等因素，都将对债市表现形成压制，仍需静待利多信号逐渐积累，在此之前预计债券收益率将以震荡为主。

报告期内，本基金从理财型债基转为纯债基金。未来组合将保持以高等级债券为主的配置思路。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由广发理财30天债券型证券投资基金转型为广发景荣纯债债券型证券投资基金，2020年7月1日至2020年9月24日，广发理财30天债券型证券投资基金A类基金份额净值收益率为0.4544%，B类基金份额净值收益率为0.5230%，同期业绩比较基准收益率为0.3225%；2020年9月25日至2020年9月30日，广发景荣纯债债券型证券投资基金的净值增长率为0.03%，同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

§ 5 投资组合报告

5.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020年9月25日-2020年9月30日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	7,844,787,000.00	98.59
	其中：债券	7,844,787,000.00	98.59
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	649,962.75	0.01
7	其他资产	111,356,850.68	1.40
8	合计	7,956,793,813.43	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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。

5.1.2.2 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。

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	322,062,000.00	5.09
	其中：政策性金融债	322,062,000.00	5.09
4	企业债券	498,255,000.00	7.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,741,236,000.00	43.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	4,283,234,000.00	67.66
9	其他	-	-
10	合计	7,844,787,000.00	123.93

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112003008	20 农业银行 CD008	10,000,000	974,100,000.00	15.39
2	112010074	20 兴业银行 CD074	8,000,000	778,560,000.00	12.30
3	101901385	19 中石油 MTN006	5,000,000	502,600,000.00	7.94
4	112012019	20 北京银行 CD019	4,000,000	388,920,000.00	6.14
5	112015108	20 民生银行 CD108	3,500,000	341,040,000.00	5.39

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、兴业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。北京银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行等监管机构的处罚。

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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	111,356,351.08
5	应收申购款	499.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,356,850.68

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告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。

5.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

(报告期：2020年7月1日-2020年9月24日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,762,971,657.39	75.21
	其中：债券	4,762,971,657.39	75.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,560,137,500.12	24.64
	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	4,225,823.00	0.07
4	其他资产	5,500,717.25	0.09
5	合计	6,332,835,697.76	100.00

5.2.2 报告期债券回购融资情况

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	4.32

	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。

5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

5.2.3.1 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	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	142
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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 150 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.2.3.2 报告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	29.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	62.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.13	-

5.2.4 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。

5.2.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	322,149,705.43	5.10
	其中：政策性金融债	322,149,705.43	5.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,440,821,951.96	70.28
8	其他	-	-
9	合计	4,762,971,657.39	75.37
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.2.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112003008	20 农业银行 CD008	10,000,000.00	987,490,703.40	15.63

2	112010074	20 兴业银行 CD074	8,000,000.00	790,025,339.08	12.50
3	112012019	20 北京银行 CD019	4,000,000.00	395,208,307.46	6.25
4	112015108	20 民生银行 CD108	3,500,000.00	345,487,957.69	5.47
5	180208	18 国开 08	3,000,000.00	302,104,089.36	4.78
6	112097172	20 萧山农商银行 CD028	3,000,000.00	299,504,601.99	4.74
7	112015093	20 民生银行 CD093	3,000,000.00	296,282,639.43	4.69
8	112093847	20 成都银行 CD035	3,000,000.00	296,218,173.40	4.69
9	112093379	20 广东南海农商行 CD002	2,200,000.00	218,896,726.09	3.46
10	112094581	20 齐鲁银行 CD006	2,000,000.00	198,841,960.45	3.15

5.2.7 “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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0718%
报告期内偏离度的最低值	-0.0594%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0287%

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。

5.2.8 报告期末按摊余成本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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.9 投资组合报告附注

5.2.9.1 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、兴业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。北京银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行等监管机构的处罚。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,500,717.25
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,500,717.25

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	6,319,143,112.09
----------------	------------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,129,411,908.03
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,120,586,363.77
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,327,968,656.35

6.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

单位：份

项目	广发理财30天债券A	广发理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	299,473,511.62	27,246,566,085.83
报告期基金总申购份额	3,031,139.42	6,153,642,731.43
减：报告期基金总赎回份额	89,933,821.19	27,293,636,535.02
本报告期期末基金份额总额	212,570,829.85	6,106,572,282.24

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 广发景荣纯债债券型证券投资基金

8.1.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间 区间					
机构	1	20200925-2020 0930	6,106 ,572, 282.2 4	6,129 ,070, 425.9 6	6,117,8 21,354. 10	6,117,821, 354.10	96.68%
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>							

8.2 广发理财 30 天债券型证券投资基金

8.2.1 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	20200701-2020 0817	13,38 8,702 ,029. 88	14,87 5,886 .55	13,403, 577,916 .43	-	-
	2	20200811-2020 0924	-	6,106 ,572, 282.2 4	-	6,106,572, 282.24	96.64%
	3	20200831-2020 0901	2,455 ,202, 877.2 5	10,93 6,700 .46	2,466,1 39,577. 71	-	-

产品特有风险

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。

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于广发理财 30 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2020 年 9 月 25 日起，本基金名称由“广发理财 30 天债券型证券投资基金”更名为“广发景荣纯债债券型证券投资基金”，《广发景荣纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《广发理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》同日失效。广发理财 30 天债券型证券投资基金正式变更为广发景荣纯债债券型证券投资基金，本基金基金合同当事人将按照《广发景荣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《关于广发理财 30 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、《关于广发景荣纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准广发理财 30 天债券型证券投资基金变更注册为广发景荣纯债债券型证券投资基金的文件
- （二）《广发景荣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）《广发景荣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

9.2 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

9.3 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
二〇二〇年十月二十八日