

**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年年度报告**

**2020年12月31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

送出日期：二〇二一年三月三十日

## § 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。本年度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2021年3月26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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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12月31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.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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
3.1.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
3.2 广发理财7天债券型证券投资基金.....	11
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2.2 基金净值表现.....	12
3.2.3 过去三年基金的利润分配情况.....	15
<b>§4 管理人报告</b> .....	16
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
<b>§6 审计报告</b> .....	22
6.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金.....	22
6.1.1 审计意见.....	22
6.1.2 形成审计意见的基础.....	23
6.1.3 其他信息.....	23
6.1.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	23
6.1.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
6.2 广发理财7天债券型证券投资基金.....	24
6.2.1 审计意见.....	25
6.2.2 形成审计意见的基础.....	25
6.2.3 其他信息.....	25
6.2.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	25
6.2.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	26

<b>§7 年度财务报表</b> .....	27
7.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金.....	27
7.1.1 资产负债表.....	27
7.1.2 利润表.....	28
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.1.4 报表附注.....	30
7.2 广发理财 7 天债券型证券投资基金.....	51
7.2.1 资产负债表.....	51
7.2.2 利润表.....	52
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	53
7.2.4 报表附注.....	55
<b>§8 投资组合报告</b> .....	79
8.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金.....	79
8.1.1 期末基金资产组合情况.....	79
8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	79
8.1.3 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.....	80
8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
8.1.6 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.....	80
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81
8.1.8 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.....	81
8.1.9 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.....	81
8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
8.1.12 投资组合报告附注.....	81
8.2 广发理财 7 天债券型证券投资基金.....	82
8.2.1 期末基金资产组合情况.....	82
8.2.2 债券回购融资情况.....	82
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明.....	83
8.2.3 基金投资组合平均剩余期限.....	83
8.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	84
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	84
8.2.6 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.....	84
8.2.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	85
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明.....	85
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明.....	85
8.2.8 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.....	85
8.2.9 投资组合报告附注.....	86
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	86
9.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金.....	86
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	86
9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
9.1.3 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情况.....	87
9.2 广发理财 7 天债券型证券投资基金.....	87
9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	87

9.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
9.2.3 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情况 .....	87
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>88</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
11.2 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 .....	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	89
11.4 基金投资策略的改变 .....	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	97
11.9 其他重大事件 .....	97
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>99</b>
12.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金 .....	99
12.1.1 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 .....	99
12.2 广发理财 7 天债券型证券投资基金 .....	99
12.2.1 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 .....	99
12.3 影响投资者决策的其他重要信息 .....	100
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>100</b>
13.1 备查文件目录 .....	100
13.2 存放地点 .....	101
13.3 查阅方式 .....	101

## § 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	103,232,413.99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	
交易代码	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 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
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	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

### 2.5.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
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

### 2.5.2 广发理财7天债券型证券投资基金

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 北京
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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

<b>3.1.1.1 期间数据和指标</b>	<b>报告期(2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日)</b>
本期已实现收益	-11,744,361.96
本期利润	-11,178,491.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0039
本期加权平均净值利润率	-0.39%
本期基金份额净值增长率	1.57%
<b>3.1.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2020年12月31日)</b>
期末可供分配利润	-1,695,919.18
期末可供分配基金份额利润	-0.0164
期末基金资产净值	104,610,249.47
期末基金份额净值	1.0133



<b>3.1.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020年12月31日)</b>
基金份额累计净值增长率	1.57%

注：（1）本基金转型日期为2020年4月22日，至披露时点不满一年。

（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
过去三个月	1.49%	0.06%	1.17%	0.04%	0.32%	0.02%
过去六个月	1.24%	0.10%	0.64%	0.06%	0.60%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.57%	0.11%	-0.46%	0.07%	2.03%	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%”。

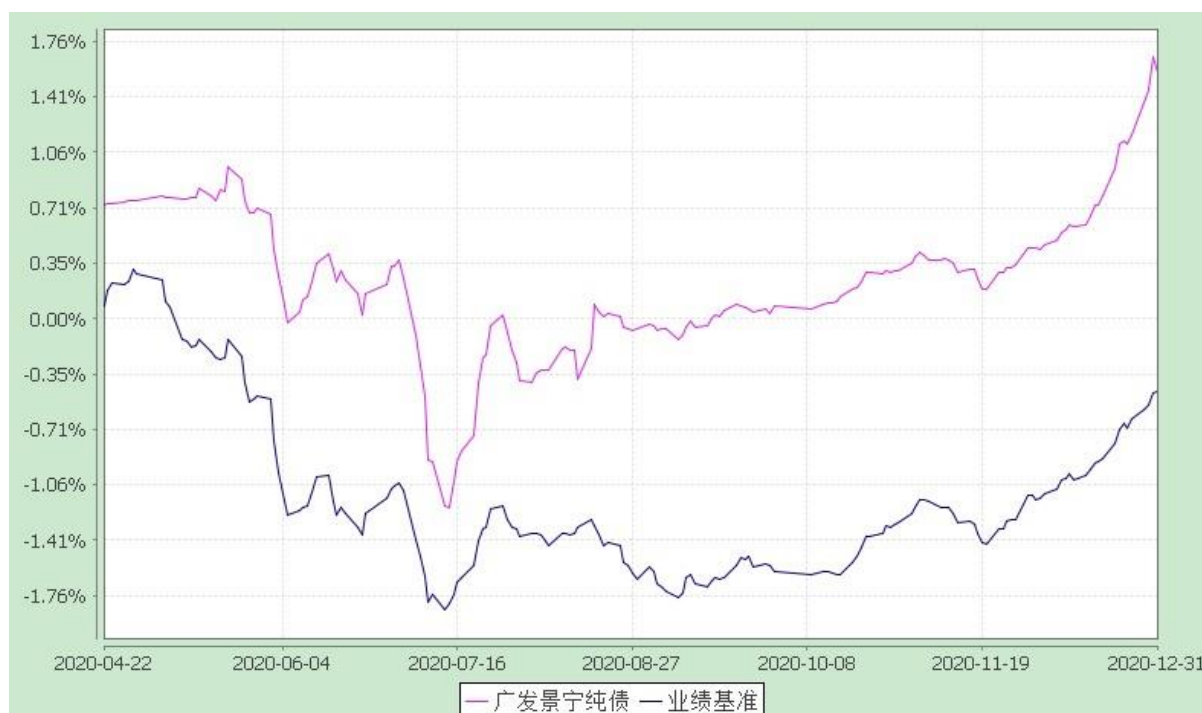
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 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

自基金转型以来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(基金合同生效日)至2020年12月31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。

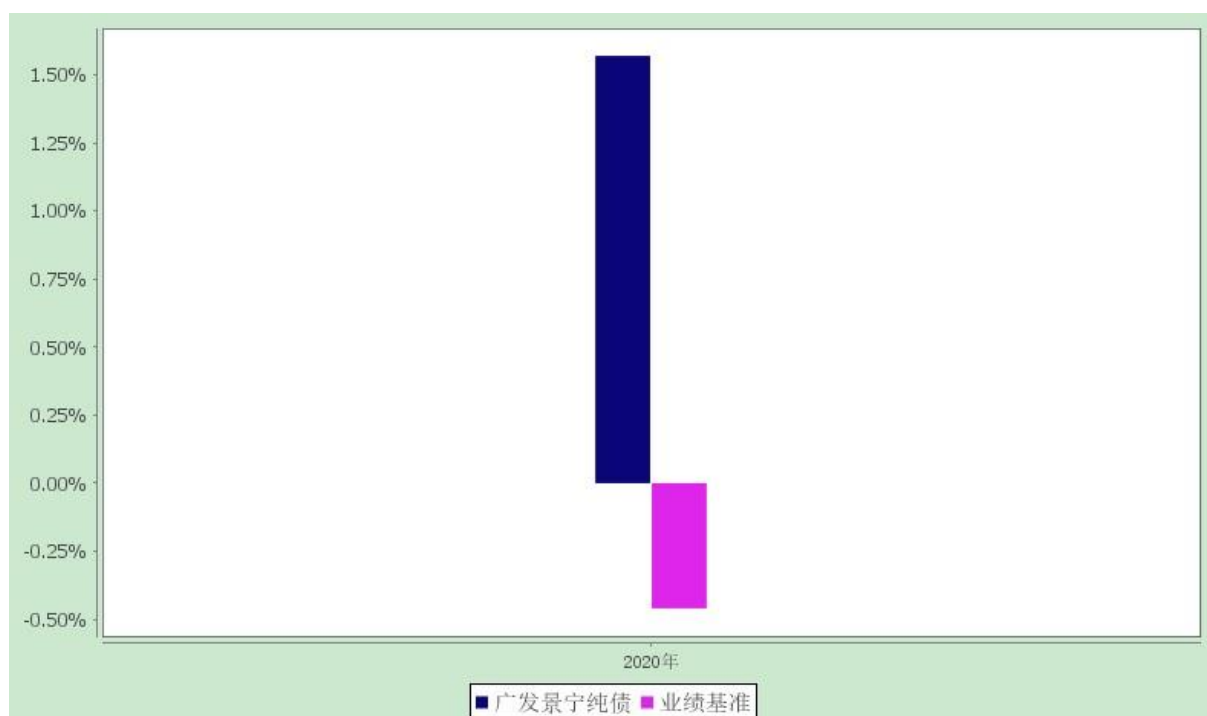
（2）本基金于2020年4月22日正式转型为广发景宁纯债债券型证券投资基金。

（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%”。

### 3.1.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发景宁纯债债券型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金的基金合同于2020年4月22日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.1.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	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	-

### 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)		2019年		2018年	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	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	8,681,864.88	540,909,180.21	18,799,401.61	1,124,498,957.98
本期利润	1,247,469.88	138,013,396.78	8,681,864.88	540,909,180.21	18,799,401.61	1,124,498,957.98
本期净值收益率	0.8208%	0.9108%	2.8502%	3.1496%	4.1108%	4.4129%

3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年4月21日)		2019年末		2018年末	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	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	190,779,671.11	15,152,864.650.20	524,340,286.96	19,993,759.636.52
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年4月21日)		2019年末		2018年末	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	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%	28.6618%	30.3943%	25.0963%	26.4129%

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，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%
过去五年	18.7099%	0.0060%	6.8512%	0.0000%	11.8587%	0.0060%
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%

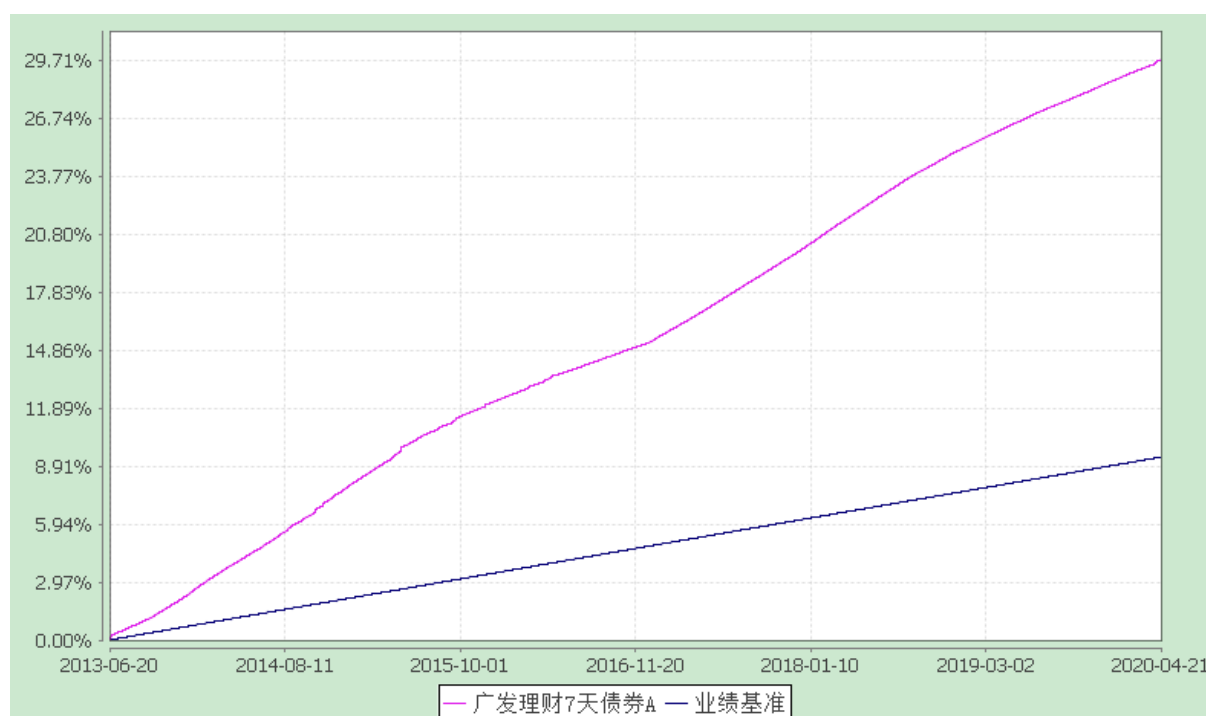
过去三年	12.0972%	0.0029%	4.1100%	0.0000%	7.9872%	0.0029%
过去五年	20.4447%	0.0060%	6.8512%	0.0000%	13.5935%	0.0060%
自基金合同生效起至今	31.5819%	0.0067%	9.3675%	0.0000%	22.2144%	0.0067%

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，过去五年为2015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。

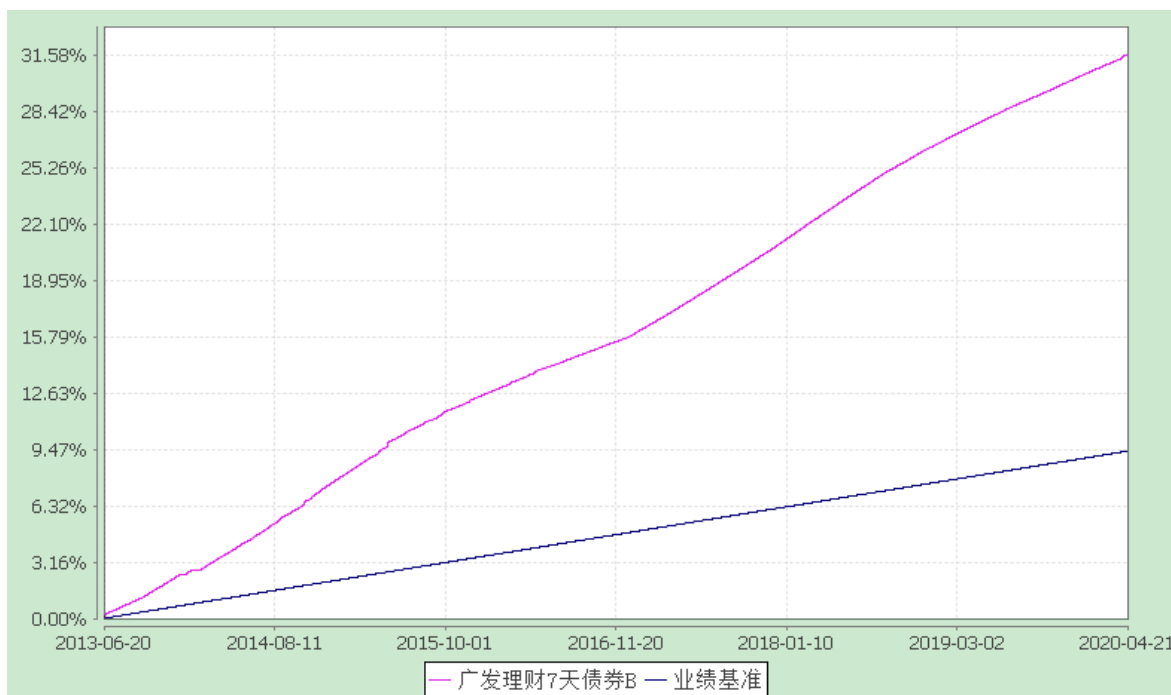
### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

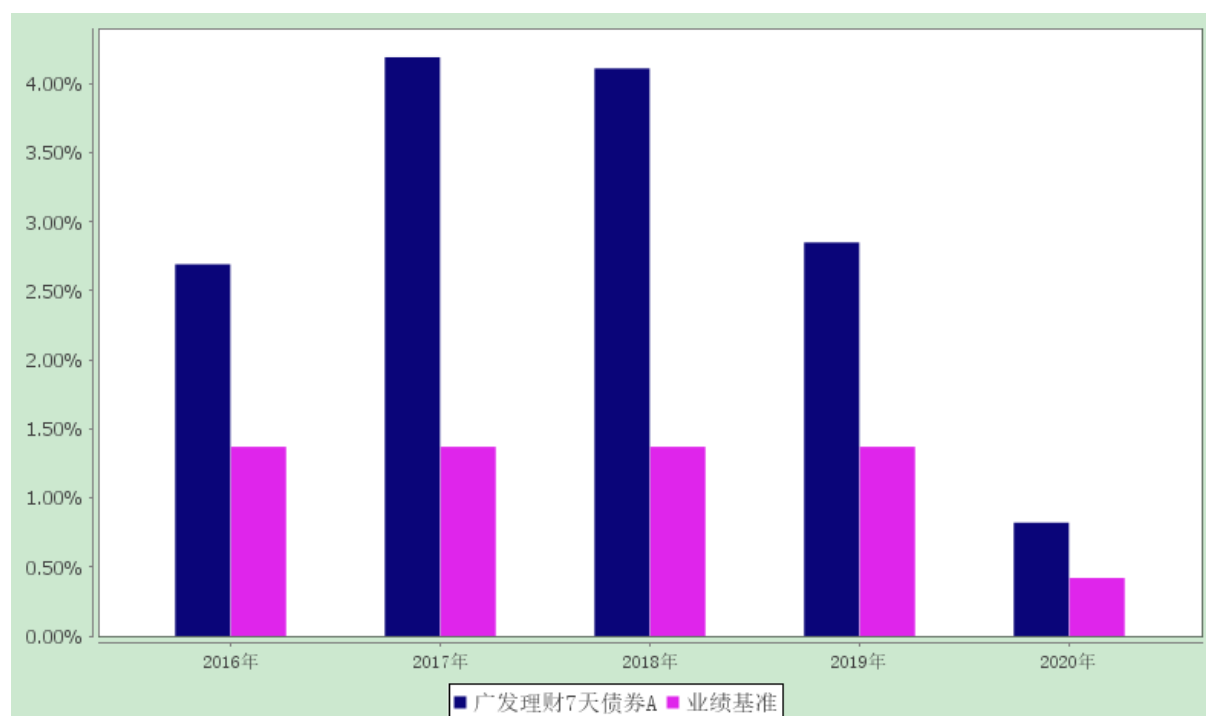


### 3.2.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

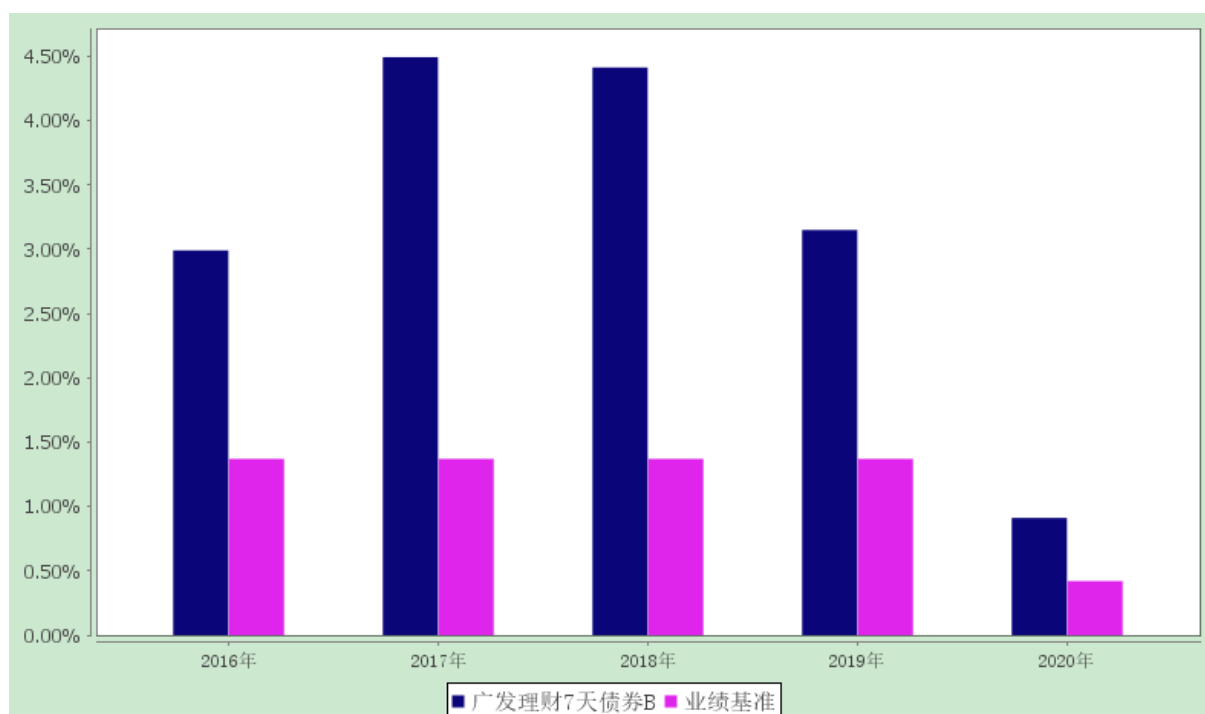
广发理财7天债券型证券投资基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

广发理财7天债券A



广发理财7天债券B



注：2020年（转型前）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

### 3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

广发理财7天债券A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2020年	988,611.38	56,314.43	202,544.07	1,247,469.88	-
2019年	8,670,127.38	195,390.44	-183,652.94	8,681,864.88	-
2018年	18,190,491.39	684,700.18	-75,789.96	18,799,401.61	-
合计	27,849,230.15	936,405.05	-56,898.83	28,728,736.37	-

广发理财7天债券B

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2020年	101,376,818.83	-	36,636,577.95	138,013,396.78	-
2019年	541,166,844.	3,164,604.27	-3,422,268.10	540,909,180.21	-

	04				
2018年	1,124,487,59 1.13	6,647,194.66	-6,635,827.81	1,124,498,957.98	-
合计	1,767,031,25 4.00	9,811,798.93	26,578,482.04	1,803,421,534.97	-

## § 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

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，本基金管理人于2003年8月5日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、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、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、QDII等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
温秀娟	本基金的基金经理；广发货币市场基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；现金投资部总经理	2020-04-22	2020-12-21	21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)、广发理财30天债券型证券投资基金基金经理(自2013年1月14日至2020年9月24



					日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自2020年4月22日至2020年12月21日)。
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基金经理;广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2020-04-22	2020-12-21	13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)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年3月27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)、广发聚泰混合型证券投资

					资基金基金经理(自2015年6月8日至2020年7月1日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自2020年4月22日至2020年12月21日)。
宋倩倩	本基金的基金经理;广发纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发景和中短债债券型证券投资基金的基金经理;广发景明中短债债券型证券投资基金的基金经理;广发景兴中短债债券型证券投资基金的基金经理	2020-12-21	-	10年	宋倩倩女士,工商管理硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广州证券有限责任公司债券交易员,广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员、固定收益部总经理助理、债券投资部投资经理。

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。2020年10月15日起,温秀娟女士恢复履行基金经理职责。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同投资组合之间（完全复制指数组合及量化组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度本组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内本组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 4.3.3 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4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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年，债券市场波动较大，收益率总体呈“V”型走势，年底市场情绪有所好转。本年度大体可以分为三段：1月至4月，疫情的意外冲击使2019年四季度开始的周期复苏迹象中断，全球债券市场转为交易衰退，债券利率大幅下行，期间随着市场对新冠疫情冲击的认识深入，类比对象从2003年的SARS转到2008年的金融危机，市场对于经济和金融的预期异常悲观，对政策维持宽松应对的一致预期较强；5月至11月，国内凭借制度优势率先控制住疫情，预期的出口崩溃并未出现，整体基本面持续改善（尤其是出口项超预期增长），货币政策向常态化宽松回摆修正，驱使收益率从牛陡转向熊平；12月以来，在超预期信用事件的冲击下，货币政策短期维稳，短端资金利率较为宽松、存单利率见顶回落，加上债市对基本面的反应钝化、利率债一级市场供给压力下降等，多因素共振令市场做多的热情再度高涨，收益率出现了5月以来最大幅度的一轮下行。本年度，本组合密切跟

踪市场动向，灵活调整持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。

#### 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12月31日，广发景宁纯债债券型证券投资基金的净值增长率为1.57%，同期业绩比较基准收益率为-0.46%。

#### 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2021年，基本上行走势仍未逆转，但领先的金融数据已经开始走弱，意味着债市利多信号在积累。央行货币政策在稳增长与防风险之间取得微妙平衡，可预测难度加大，但经济复苏的不平衡、外部风险的不确定性，令货币政策难以大幅收紧。综合来看，短期内市场仍然以震荡走势为主，票息价值的确定性更高。未来组合将密切关注基本面走势，社融数据回落显示偏内需的建筑业开始走弱，景气度的核心拉动力是外需，需要密切跟踪出口景气度的变化，一旦基本面因素逆转，长周期品种的久期价值将重新显现。未来本组合将继续跟踪经济基本面、货币政策等方面的变化，增强操作的灵活性，同时注意做好持仓券种梳理，优化持仓结构，抓住市场机会，控制风险，力争为投资人带来理想的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司严格遵循“合规、诚信、专业、稳健”的证券基金行业文化核心理念，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

(1) 推进实施公司企业文化建设，将企业文化建设的基本要求制度化、规范化，加大内部合规培训、品牌宣传及投资者教育的力度。

(2) 持续加强制度建设，积极推进公司内部管理进一步精细化、规范化、科学化。

(3) 逐步提高专兼职合规管理人员工作质量，推动形成合规稽核部门与专兼职合规管理员的信息及资源互动机制，确保合规管理覆盖公司所有重要业务流程和风险点。

(4) 深入完善宣传推介材料管理机制，努力提高材料的制作质量与审核效率，推进宣传材料规范化。

(5) 根据监管精神和要求，逐条逐项研究制定整改办法和整改措施，稳步推进资管新规及销售新规的整改工作。

(6) 针对投研交业务、基金销售业务、中后台运营业务的不同特点，结合监管最新颁布的监管要求、行业及公司发生的热点合规风险事件，开展差异化培训。

(7) 认真做好合规审核及咨询服务, 对公司内部重大决策、新产品和新业务方案、产品运作过程中的重要法律文本等进行审查, 通过及时有效的事前事中审核把关, 监督防范业务中可能存在的风险。

(8) 平稳推进信息披露与监管报送工作, 包括报送历史信息披露文件、完成存量公募基金产品资料概要制作及复核、改造信息披露及销售系统、完成信息披露和监管定期数据常规工作等。

(9) 强化投资组合日常的合规风险监控, 大力推进统一风险监控平台建设, 提升信息化管理水平。

(10) 持续夯实反洗钱工作基础, 不断完善客户身份识别工作, 不断优化公司反洗钱系统, 并积极尝试运用新技术提升反洗钱工作质量。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 积极健全内部管理制度, 不断提高监察稽核工作的科学性和有效性, 努力防范各种风险, 切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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12月31日,广发景宁纯债可供分配利润为-1,695,919.18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遵规守信、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 托管人对本年度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年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

安永华明(2021)审字第60873695\_G02号

广发景宁纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人:

#### 6.1.1 审计意见

我们审计了广发景宁纯债债券型证券投资基金的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年4月22日至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发景宁纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发景宁纯债债券型证券投资基金2020年12月31日的财务状况以及2020年4月22日至2020年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.1.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发景宁纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.1.3 其他信息

广发景宁纯债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.1.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发景宁纯债债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发景宁纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.1.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对广发景宁纯债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发景宁纯债债券型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2021年3月26日

## 6.2 广发理财7天债券型证券投资基金

安永华明（2021）审字第 60873695\_G01 号

广发理财7天债券型证券投资基金全体基金份额持有人：



### 6.2.1 审计意见

我们审计了广发理财7天债券型证券投资基金的财务报表，包括2020年4月21日的资产负债表，2020年1月1日至2020年4月21日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发理财7天债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发理财7天债券型证券投资基金2020年4月21日的财务状况以及2020年1月1日至2020年4月21日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.2.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发理财7天债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.2.3 其他信息

广发理财7天债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.2.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发理财7天债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发理财7天债券型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.2.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对广发理财7天债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发理财7天债券型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

中国 北京

2021年3月26日

## §7 年度财务报表

### 7.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

#### 7.1.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.1.4.7.1	1,066,639.40
结算备付金		29,100.74
存出保证金		7,944.97
交易性金融资产	7.1.4.7.2	116,529,400.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		116,529,400.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.1.4.7.5	2,504,191.01
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	-
资产总计		120,137,276.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020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	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		15,199,777.20
应付证券清算款		-
应付赎回款		111,089.38

应付管理人报酬		17,492.18
应付托管费		2,915.35
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	3,690.52
应交税费		-
应付利息		3,062.02
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	189,000.00
负债合计		15,527,026.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.1.4.7.9	103,232,413.99
未分配利润	7.1.4.7.10	1,377,835.48
所有者权益合计		104,610,249.47
负债和所有者权益总计		120,137,276.12

注：（1）报告截止日 2020 年 12 月 31 日，广发景宁纯债基金份额净值人民币 1.0133 元，基金份额总额 103,232,413.99 份。

（2）本会计期间为 2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.1.2 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（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>1,608,733.62</b>
1.利息收入		75,470,088.03
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	6,596,271.26
债券利息收入		66,453,101.26
资产支持证券利息收入		2,364,587.14
买入返售金融资产收入		56,128.37
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-74,427,245.37
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	-

基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-72,362,711.58
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.13 .3	-2,064,533.79
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.1.4.7.14	-
股利收益	7.1.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.16	565,870.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.17	20.96
<b>减：二、费用</b>		<b>12,787,225.58</b>
1. 管理人报酬		5,980,565.14
2. 托管费		1,007,249.61
3. 销售服务费		4,998.27
4. 交易费用	7.1.4.7.18	88,349.05
5. 利息支出		5,436,912.47
其中：卖出回购金融资产支出		5,436,912.47
6. 税金及附加		104,402.62
7. 其他费用	7.1.4.7.19	164,748.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-11,178,491.96</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-11,178,491.96</b>

### 7.1.3 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（基金合同生效日）至2020年12月31日

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12月31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）	-	-11,178,491.96	-11,178,491.96
三、本期基金份额交易	-15,252,322,861.89	27,550,277.33	-15,224,772,584.56

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	6,259,490,748.63	352,192.53	6,259,842,941.16
2.基金赎回款	-21,511,813,610.52	27,198,084.80	-21,484,615,525.72
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)	103,232,413.99	1,377,835.48	104,610,249.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4, 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

#### 7.1.4 报表附注

##### 7.1.4.1 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2021年3月26日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

##### 7.1.4.2 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。

##### 7.1.4.3 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12月31日的财务状况以及2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.1.4.4.1 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12月31日止。

##### 7.1.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.1.4.4.3 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。

##### 7.1.4.4.4 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。

#### 7.1.4.4.5 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。

#### 7.1.4.4.6 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。

#### 7.1.4.4.7 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。

#### 7.1.4.4.8 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）。

#### 7.1.4.4.9 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。

#### 7.1.4.4.10 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。

#### 7.1.4.4.11 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。

#### 7.1.4.4.12 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。

#### 7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.5.1 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。

#### 7.1.4.5.2 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。

#### 7.1.4.5.3 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。

#### 7.1.4.6 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。

## 7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	1,066,639.40
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,066,639.40

#### 7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	5,992,800.00	6,600.00
	银行间市场	109,970,730.00	559,270.00
	合计	115,963,530.00	565,870.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	115,963,530.00	116,529,400.00	565,870.00

#### 7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 7.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	237.05

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	3.60
应收结算备付金利息	13.10
应收债券利息	2,503,937.26
应收资产支持证券利息	-
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	2,504,191.01

#### 7.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	3,690.52
合计	3,690.52

#### 7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	189,000.00
合计	189,000.00

#### 7.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31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
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-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	6,259,490,748.63	6,259,490,748.63
本期赎回（以“-”号填列）	-21,511,813,610.52	-21,511,813,610.52
本期末	103,232,413.99	103,232,413.99

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。

#### 7.1.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-11,744,361.96	565,870.00	-11,178,491.96
本期基金份额交易产生的变动数	25,042,392.67	2,507,884.66	27,550,277.33
其中：基金申购款	-913,862.59	1,266,055.12	352,192.53
基金赎回款	25,956,255.26	1,241,829.54	27,198,084.80
本期已分配利润	-14,993,949.89	-	-14,993,949.89
本期末	-1,695,919.18	3,073,754.66	1,377,835.48

#### 7.1.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	
	活期存款利息收入	245,627.03
定期存款利息收入	6,268,125.65	
其他存款利息收入	151.01	
结算备付金利息收入	82,367.57	
其他	-	
合计	6,596,271.26	

**7.1.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内无股票投资收益。

**7.1.4.7.13 债券投资收益****7.1.4.7.13.1 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12月31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	-72,362,711.58
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	-72,362,711.58

**7.1.4.7.13.2 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,495,074,854.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,361,420,487.60
减：应收利息总额	206,017,078.85
买卖债券差价收入	-72,362,711.58

**7.1.4.7.13.3 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12月31日
卖出资产支持证券成交总额	611,534,955.76
减：卖出资产支持证券成本总额	612,306,223.46
减：应收利息总额	1,293,266.09
资产支持证券投资收益	-2,064,533.79

**7.1.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。



#### 7.1.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 7.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	565,870.00
——股票投资	-
——债券投资	565,870.00
——资产支持证券投资	-
——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	565,870.00

#### 7.1.4.7.17 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12月31日
基金赎回费收入	20.14
基金转换费收入	0.82
合计	20.96

#### 7.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,099.05

银行间市场交易费用	86,250.00
合计	88,349.05

#### 7.1.4.7.19 其他费用

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12月31日
审计费用	77,354.72
信息披露费	43,278.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	18,592.04
账户维护费	24,923.10
其他	600.00
合计	164,748.42

#### 7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.1.4.8.1 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。

##### 7.1.4.8.2 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。

#### 7.1.4.9 关联方关系

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
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司）	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人控股子公司（瑞元资本管理有限公司）的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司）	基金管理人全资子公司（GF International Investment Management Limited）的全资子公司

注：根据2020年12月26日发布的《广发基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》，经广发基金管理有限公司股东会决议，并经中国证券监督管理委员会《关于核准广发基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2020]3563号）核准，新增嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）、嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）为广发基金管理有限公司股东，上述事项已完成工商变更登记手续。

#### 7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.1.4.10.1.1 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。

###### 7.1.4.10.1.2 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。

###### 7.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31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	693,059,819.17	100.00%

###### 7.1.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31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	485,000,000.00	100.00%

###### 7.1.4.10.1.5 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，本报告期末无应付关联方佣金余额。

#### 7.1.4.10.2 关联方报酬

##### 7.1.4.10.2.1 基金管理费

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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,980,565.14
其中：支付销售机构的客户维护费	67,928.65

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。

##### 7.1.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,007,249.61

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。

##### 7.1.4.10.3 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
2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日

银行间市场交易的各关联方名称	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	-	-	-	-	6,338,045,000.00	741,408.44

#### 7.1.4.10.4 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

##### 7.1.4.10.4.1 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。

##### 7.1.4.10.4.2 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。

#### 7.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.1.4.10.5.1 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。

##### 7.1.4.10.5.2 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

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。

#### 7.1.4.10.6 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 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,066,639.40	245,627.03

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。

#### 7.1.4.10.7 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。

#### 7.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	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	-

#### 7.1.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.12.1 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12月31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。

##### 7.1.4.12.2 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12月31日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31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15,199,777.20元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190203	19国开03	2021-01-06	100.69	100,000.00	10,069,000.00
200212	20国开12	2021-01-06	100.57	60,000.00	6,034,200.00
合计				160,000.00	16,103,200.00

###### 7.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31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。

##### 7.1.4.12.4 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12月31日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.1.4.13 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。

#### 7.1.4.13.1 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。

#### 7.1.4.13.2 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。

##### 7.1.4.13.2.1 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 2020年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	5,999,400.00
合计	5,999,400.00

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。

#### 7.1.4.13.2 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 2020年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	110,530,000.00
合计	110,530,000.00

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期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 7.1.4.13.3 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 7.1.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种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。

##### 7.1.4.13.3.1 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。

#### 7.1.4.13.4 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的，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。

#### 7.1.4.13.4.1 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。

##### 7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,066,639.40	-	-	-	1,066,639.40
结算备付金	29,100.74	-	-	-	29,100.74
存出保证金	7,944.97	-	-	-	7,944.97
交易性金融资产	16,041,400.00	60,332,000.00	40,156,000.00	-	116,529,400.00
应收利息	-	-	-	2,504,191.01	2,504,191.01
资产总计	17,145,085.11	60,332,000.00	40,156,000.00	2,504,191.01	120,137,276.12
负债					
卖出回购金融资产款	15,199,777.20	-	-	-	15,199,777.20
应付赎回款	-	-	-	111,089.38	111,089.38
应付管理人报酬	-	-	-	17,492.18	17,492.18
应付托管费	-	-	-	2,915.35	2,915.35
应付交易费用	-	-	-	3,690.52	3,690.52
应付利息	-	-	-	3,062.02	3,062.02
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	15,199,777.20	-	-	327,249.45	15,527,026.65
利率敏感度缺口	1,945,307.91	60,332,000.00	40,156,000.00	2,176,941.56	104,610,249.47

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。

##### 7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

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:人民币元)
		本期末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,741,216.35
	市场利率下降25个基点	1,804,756.74

#### 7.1.4.13.4.2 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。

##### 7.1.4.13.4.2.1 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。

#### 7.1.4.13.4.3 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,以及标准差、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。

##### 7.1.4.13.4.3.1 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。

#### 7.1.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31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次的余额为人民币116,529,400.00元,无属于第一层次和第三层次的金额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次,上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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。

## 7.2 广发理财7天债券型证券投资基金

### 7.2.1 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 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.2.4.7.1	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	7.2.4.7.2	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	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,839,756,038.79	-
应收利息	7.2.4.7.5	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	7.2.4.7.6	-	-
资产总计		15,400,625,057.59	15,581,469,821.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2020年4月21日	2019年12月31日
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.2.4.7.3	-	-
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	7.2.4.7.7	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	7.2.4.7.8	255,443.62	203,000.00
负债合计		45,069,781.71	237,825,499.85
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.2.4.7.9	15,355,555,275.88	15,343,644,321.31
未分配利润	7.2.4.7.10	-	-
所有者权益合计		15,355,555,275.88	15,343,644,321.31
负债和所有者权益总计		15,400,625,057.59	15,581,469,821.16

注：报告截止日2020年4月21日，广发理财7天债券A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。

## 7.2.2 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 2020年1月1日至 2020年4月21日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>156,914,313.53</b>	<b>637,602,226.39</b>
1.利息收入		146,082,355.64	631,526,363.74
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	24,955,523.68	161,143,148.39

债券利息收入		116,878,111.91	449,962,011.47
资产支持证券利息收入		2,570,493.39	18,211,160.04
买入返售金融资产收入		1,678,226.66	2,210,043.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,831,957.89	6,075,862.65
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.2.4.7.12	10,791,937.13	6,195,263.67
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.12 .3	40,020.76	-119,401.02
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.13	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.14	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>17,653,446.87</b>	<b>88,011,181.30</b>
1. 管理人报酬		7,055,721.72	26,426,137.20
2. 托管费		2,351,907.34	8,808,712.45
3. 销售服务费		609,218.14	2,643,673.32
4. 交易费用	7.2.4.7.15	-	-
5. 利息支出		7,423,311.42	49,673,585.41
其中：卖出回购金融资产支出		7,423,311.42	49,673,585.41
6. 税金及附加		98,834.55	152,812.62
7. 其他费用	7.2.4.7.16	114,453.70	306,260.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>139,260,866.66</b>	<b>549,591,045.09</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>549,591,045.09</b>

### 7.2.3 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
----	----

	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
	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年12月31日		
项目	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)	-	549,591,045.09	549,591,045.09
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)	-5,174,455,602.17	-	-5,174,455,602.17
其中：1.基金申购款	555,592,957.75	-	555,592,957.75
2.基金赎回款	-5,730,048,559.92	-	-5,730,048,559.92
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)	-	-549,591,045.09	-549,591,045.09
五、期末所有者权益(基金净值)	15,343,644,321.31	-	15,343,644,321.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 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 2021 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 7.2.4.2 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。

### 7.2.4.3 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。

#### 7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.2.4.4.1 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1月1日至2020年4月21日（基金转型前一日）止。

##### 7.2.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

###### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为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。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.2.4.4.4 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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算



影子价格（附注 7.2.4.4.5），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

#### 7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其接近于公允价值。估值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，每日计提收益或损失。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### （1）银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际利率逐日计提利息；

##### （2）债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### （3）回购协议

A.基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息；

B.基金持有的买断式回购以成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

##### （4）其他

A.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值；

B.为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

C.如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.2.4.4.6 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。

#### 7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。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，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.2.4.4.8 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实际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收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 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；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 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。

#### 7.2.4.4.9 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。

#### 7.2.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 基金收益分配采用红利再投资方式，免收再投资的费用；
- (2) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- (3) 本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，

并在运作期末集中支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位；

(4) 本基金根据每日收益情况，按当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配，累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。若投资者在运作期末累计收益支付时，累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。投资者可通过在基金份额运作期到期日赎回基金份额获得当期运作期的基金未支付收益。对于持有超过一个运作期、在当期运作期到期日提出赎回申请的基金份额而言，除获得当期运作期的基金未支付收益外，投资者还可以获得自申购确认日（认购份额自本基金合同生效日）起至上一运作期末的基金收益；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.2.4.4.11 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。

#### 7.2.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 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。

##### 7.2.4.5.2 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。

##### 7.2.4.5.3 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。

#### 7.2.4.6 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。

## 7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	263,150,098.45	874,486.77
定期存款	1,650,000,000.00	2,950,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	500,000,000.00	600,000,000.00
存款期限1-3个月	1,150,000,000.00	2,350,000,000.00
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,913,150,098.45	2,950,874,486.77

### 7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 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	9,121,845,25 6.92	9,165,034,000. 00	43,188,743.08	0.2813
	合计	9,375,465,83 1.10	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	9,600,275,25 4.55	9,644,400,500. 00	44,125,245.45	0.2874
	项目	上年度末 2019年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
	交易所市场	40,070,241.3 5	40,036,000.00	-34,241.35	-0.0002
	银行间市场	12,190,183,9 06.77	12,198,809,000 .00	8,625,093.23	0.0562
	合计	12,230,254,1 48.12	12,238,845,000 .00	8,590,851.88	0.0560
	资产支持证券	333,134,754. 31	333,309,800.00	175,045.69	0.0011
	合计	12,563,388,9 02.43	12,572,154,800 .00	8,765,897.57	0.0571

#### 7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	128,289.65	167.04
应收定期存款利息	7,764,652.13	33,001,652.12
应收其他存款利息	13.22	5.40
应收结算备付金利息	-	-

应收债券利息	39,110,972.20	33,876,640.09
应收资产支持证券利息	431,385.74	315,910.01
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	67,194,374.66

#### 7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31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	151,822.48
合计	99,236.79	151,822.48

#### 7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31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	203,000.00
合计	255,443.62	203,000.00

#### 7.2.4.7.9 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 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 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。

#### 7.2.4.7.10 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	-	-	-

#### 7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4月 21日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
活期存款利息收入	146,382.76	17,310.57
定期存款利息收入	24,807,708.34	161,123,623.44
其他存款利息收入	54.90	139.79
结算备付金利息收入	1,377.68	2,074.59
其他	-	-
合计	24,955,523.68	161,143,148.39

#### 7.2.4.7.12 债券投资收益

##### 7.2.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4 月21日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31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	6,195,263.67
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	6,195,263.67

##### 7.2.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4月 21日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	19,122,654,548.60	39,161,118,131.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,054,206,749.19	39,066,270,599.51
减：应收利息总额	57,655,862.28	88,652,268.16
买卖债券差价收入	10,791,937.13	6,195,263.67

#### 7.2.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4月21日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	292,948,685.22	1,609,284,865.46
减：卖出资产支持证券成本总额	292,608,679.24	1,608,463,901.02
减：应收利息总额	299,985.22	940,365.46
资产支持证券投资收益	40,020.76	-119,401.02

#### 7.2.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无公允价值变动损益。

#### 7.2.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他收入。

#### 7.2.4.7.16 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间内无交易费用。

#### 7.2.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4月21 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	22,645.28	74,000.00
信息披露费	36,721.44	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行汇划费	23,410.08	75,060.30
账户维护费	11,076.90	36,000.00
其他	20,600.00	1,200.00
合计	114,453.70	306,260.30

#### 7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.2.4.8.1 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。

##### 7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人已发布本基金分红公告，向截至2020年6月22日止在本基金注册登记机构广发基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利人民币0.024元。实际分配金额为人民币14,993,949.89元。

除上述情况外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.2.4.9 关联方关系

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
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业(有限合伙)	基金管理人控股子公司(瑞元资本管理有限公司)的控股子公司
GF International Asset Management (UK) Company Limited (广发国际资产管理(英国)有限公司)	基金管理人全资子公司(GF International Investment Management Limited)的全资子公司

注：本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

#### 7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.2.4.10.1.1 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。

#### 7.2.4.10.1.2 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。

#### 7.2.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年4月21日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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%	471,416,831.78	100.00%

#### 7.2.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年4月21日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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%	-	-

#### 7.2.4.10.1.5 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。

#### 7.2.4.10.2 关联方报酬

##### 7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年4月21日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,055,721.72	26,426,137.20
其中：支付销售机构的客户维护费	34,918.45	215,953.28

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。

#### 7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年4月21日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,351,907.34	8,808,712.45

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。

#### 7.2.4.10.2.3 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		
	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	上年度可比期间		

关联方名称	2019年1月1日至2019年12月31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	85,206.29	1,730,826.84	1,816,033.13
中国工商银行股份有限公司	538,470.67	500.10	538,970.77
广发证券股份有限公司	7,187.88	-	7,187.88
合计	630,864.84	1,731,326.94	2,362,191.78

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。

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。

### 7.2.4.10.3 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 2020年1月1日至2020年4月21日						
银行间市场 交易的各关 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 2019年1月1日至2019年12月31日						

银行间市场交易的各关联方名称	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	-	-	-	-	11,811,631,000.00	2,051,361.50

#### 7.2.4.10.4 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

##### 7.2.4.10.4.1 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。

##### 7.2.4.10.4.2 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。

#### 7.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

##### 7.2.4.10.5.2 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。

#### 7.2.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年4月21日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	874,486.77	17,310.57

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。

#### 7.2.4.10.7 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 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 分销	850,000.00	85,000,000.00
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	-	-	-	-	-

#### 7.2.4.11 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	-

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

##### 7.2.4.12.1 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。

##### 7.2.4.12.2 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,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.2.4.12.3.1 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。

#### 7.2.4.12.3.2 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。

#### 7.2.4.12.4 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。

### 7.2.4.13 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。

#### 7.2.4.13.1 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。

#### 7.2.4.13.2 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。

### 7.2.4.13.2.1 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 2020年4月21日	上年度末 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。

### 7.2.4.13.2.2 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 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	333,134,754.31
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	333,134,754.31

注：1、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。

2、短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 的短期资产支持证券，短期信用评级 A-1 以下所填列的资产支持证券均为 AAA 以下的短期资产支持证券。

### 7.2.4.13.2.3 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 2020年4月21日	上年度末 2019年12月31日
A-1	3,812,849,887.31	6,234,433,679.62
A-1 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：1、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。

2、短期同业存单 A-1 所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 的短期同业存单，短期同业存单 A-1 以下所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 以下的短期同业存单。

#### 7.2.4.13.2.4 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 2020年4月21日	上年度末 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期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 7.2.4.13.2.5 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 2020年4月21日	上年度末 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。

#### 7.2.4.13.2.6 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。

#### 7.2.4.13.3 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 7.2.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种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。

#### 7.2.4.13.3.1 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。

#### 7.2.4.13.4 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的，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。

##### 7.2.4.13.4.1 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。

##### 7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年4月21日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,913,150,098.45	-	-	-	1,913,150,098.45
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
负债					
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	15,355,555.27 5.88
<b>上年度末 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>
资产					
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
负债					
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	15,343,644.32 1.31

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。

#### 7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变			
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：人民币元）		
		<table border="1"> <thead> <tr> <th>本期末</th> <th>上年度末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	本期末	上年度末
本期末	上年度末			

	2020年4月21日	2019年12月31日
市场利率上升25个基点	-8,572,930.43	-7,769,489.76
市场利率下降25个基点	8,595,880.53	7,787,320.86

#### 7.2.4.13.4.2 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。

##### 7.2.4.13.4.2.1 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。

#### 7.2.4.13.4.3 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，以及标准差、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。

##### 7.2.4.13.4.3.1 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。

#### 7.2.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

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次的余额为人民币9,600,275,254.55元，无属于第一层次和第三层次的金额（2019年12月31日，属于第二层次的余额为人民币12,563,388,902.43元，无属于第一层次和第三层次的金额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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。

## § 8 投资组合报告

### 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(基金合同生效日)-2020年12月31日)

#### 8.1.1 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	116,529,400.00	97.00
	其中：债券	116,529,400.00	97.00
	资产支持证券	-	-
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	1,095,740.14	0.91
8	其他各项资产	2,512,135.98	2.09
9	合计	120,137,276.12	100.00

#### 8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.1.2.1 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。

##### 8.1.2.2 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。

### 8.1.3 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。

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.4.1 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。

#### 8.1.4.2 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。

#### 8.1.4.3 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。

### 8.1.5 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	5,999,400.00	5.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,530,000.00	105.66
	其中：政策性金融债	110,530,000.00	105.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,529,400.00	111.39

### 8.1.6 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

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	200220	20国开20	400,000	40,156,000.00	38.39
2	200212	20国开12	300,000	30,171,000.00	28.84
3	190202	19国开02	200,000	20,092,000.00	19.21
4	190203	19国开03	100,000	10,069,000.00	9.63
5	180203	18国开03	100,000	10,042,000.00	9.60



### 8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.1.8 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。

### 8.1.9 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。

### 8.1.10 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。

### 8.1.11 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。

### 8.1.12 投资组合报告附注

**8.1.12.1** 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。

**8.1.12.2** 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。

### 8.1.12.3 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	7,944.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,504,191.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,512,135.98

### 8.1.12.4 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。

### 8.1.12.5 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。

## 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

### 8.2.2 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。

### 8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.2.3.1 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。

#### 8.2.3.2 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	0.00
	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	0.00

#### 8.2.4 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。

#### 8.2.5 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	-	-

#### 8.2.6 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

### 8.2.7 “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。

### 8.2.8 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）	摊余成本（元）	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 2B_bc	700,000	33,689,116.84	0.22
4	1889231	18 德宝天元 1A	3,300,000	25,161,717.00	0.16
5	1889021	18 建元 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

## 8.2.9 投资组合报告附注

### 8.2.9.1 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。

8.2.9.2 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。

### 8.2.9.3 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

## § 9 基金份额持有人信息

### 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（基金合同生效日）-2020年12月31日)

#### 9.1.1 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
5,369	19,227.49	55,810,969.12	54.06%	47,421,444.87	45.94%

### 9.1.2 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	0.00	0.0000%

### 9.1.3 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 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

## 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)

### 9.2.1 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%

### 9.2.2 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员持有本基金	广发理财7天债券A	35,183.49	0.0347%
	广发理财7天债券B	0.00	0.0000%
	合计	35,183.49	0.0002%

### 9.2.3 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	广发理财7天债券A	0
	广发理财7天债券B	0

持有本开放式基金	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

## § 10 开放式基金份额变动

### 10.1 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12月31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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,259,490,748.63
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	21,511,813,610.52
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	103,232,413.99

### 10.2 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	-	-
本报告期期末基金份额总额	101,313,806.85	15,254,241,469.03

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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》。



## 11.2 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；于2020年12月11日发布公告，自2020年12月11日起，林传辉先生不再担任公司总经理，王凡先生由公司副总经理转任公司总经理。

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。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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12月31日）

#### 11.7.1.1 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	-	-	-	-	新增1个
华融证券	1	-	-	-	-	新增1个
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	新增2个
中天证券	1	-	-	-	-	新增1个
湘财证券	1	-	-	-	-	新增1个
国元证券	2	-	-	-	-	新增2个
德邦证券	1	-	-	-	-	新增1个
国信证券	2	-	-	-	-	新增2个
东吴证券	1	-	-	-	-	新增1个

东方证券	2	-	-	-	-	新增2个
东海证券	1	-	-	-	-	新增1个
兴业证券	4	-	-	-	-	新增4个
华宝证券	1	-	-	-	-	新增1个
英大证券	2	-	-	-	-	新增2个
万联证券	4	-	-	-	-	新增4个
华创证券	2	-	-	-	-	新增2个
长城证券	2	-	-	-	-	新增2个
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增1个
川财证券	2	-	-	-	-	新增2个
华福证券	2	-	-	-	-	新增2个
华林证券	1	-	-	-	-	新增1个
东兴证券	3	-	-	-	-	新增3个
申万宏源	6	-	-	-	-	新增6个
民生证券	3	-	-	-	-	新增3个
招商证券	4	-	-	-	-	新增4个
国泰君安	2	-	-	-	-	新增2个
渤海证券	1	-	-	-	-	新增1个
南京证券	1	-	-	-	-	新增1个
中泰证券	5	-	-	-	-	新增5个
西南证券	2	-	-	-	-	新增2个
国联证券	1	-	-	-	-	新增1个
天风证券	3	-	-	-	-	新增3个
华鑫证券	2	-	-	-	-	新增2个
国都证券	1	-	-	-	-	新增1个
中信华南	1	-	-	-	-	新增1个
浙商证券	1	-	-	-	-	新增1个
上海证券	1	-	-	-	-	新增1个
华安证券	1	-	-	-	-	新增1个
北京高华	1	-	-	-	-	新增1个
信达证券	3	-	-	-	-	新增3个
第一创业证券	1	-	-	-	-	新增1个
西部证券	2	-	-	-	-	新增2个
长江证券	3	-	-	-	-	新增3个
安信证券	5	-	-	-	-	新增5个
平安证券	4	-	-	-	-	新增4个
国海证券	1	-	-	-	-	新增1个
中山证券	1	-	-	-	-	新增1个
中金公司	4	-	-	-	-	新增4个
中金财富证券	3	-	-	-	-	新增3个
中信证券	5	-	-	-	-	新增5个
粤开证券	2	-	-	-	-	新增2个
新时代证券	3	-	-	-	-	新增3个
世纪证券	1	-	-	-	-	新增1个

华菁证券	2	-	-	-	-	新增2个
中原证券	2	-	-	-	-	新增2个
银河证券	4	-	-	-	-	新增4个
国盛证券	2	-	-	-	-	新增2个
广发证券	7	-	-	-	-	新增7个
海通证券	2	-	-	-	-	新增2个
中信建投	4	-	-	-	-	新增4个
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增2个
首创证券	1	-	-	-	-	新增1个
华泰证券	5	-	-	-	-	新增5个
国金证券	1	-	-	-	-	新增1个
光大证券	3	-	-	-	-	新增3个
东北证券	4	-	-	-	-	新增4个
中银国际	2	-	-	-	-	新增2个
方正证券	5	-	-	-	-	新增5个
财富证券	2	-	-	-	-	新增2个

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。

#### 11.7.1.2 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	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	693,059,819.17	100.00%	485,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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)

#### 11.7.2.1 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。

#### 11.7.2.2 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%	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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 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	中国证监会规定报刊及网站	2020-01-11
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金2019年	中国证监会规定报刊及	2020-01-17

	第4季度报告提示性公告	网站	
3	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-01-23
4	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-15
5	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-19
6	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-20
7	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-21
8	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-02-28
9	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-02
10	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-16
11	关于广发理财7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	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-24
12	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-27
13	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-03-30
14	关于旗下部分基金继续暂停申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-13
15	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-20
16	关于广发景宁纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-20
17	关于代为履行基金经理职责的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-20
18	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-21
19	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-04-22
20	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-06-17
21	关于广发景宁纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-06-19
22	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	中国证监会规定报刊及网站	2020-06-30

	告		
23	广发基金管理有限公司关于旗下基金2020年第2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-07-20
24	广发基金管理有限公司关于旗下基金2020年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-27
25	广发基金管理有限公司关于旗下基金基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-08-28
26	广发基金管理有限公司关于旗下基金2020年第3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-10-28
27	关于广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2020-12-21

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

#### 12.1.1 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	20201216-20201216	-	13,941,838.46	-	13,941,838.46	13.51%
	2	20200422-20200813	15,254,241.469.03	6,203,201,538.62	21,457,443,007.65	-	-
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>							

### 12.2 广发理财7天债券型证券投资基金

#### 12.2.1 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	15,152,864.650.20	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>
---

### 12.3 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，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》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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

二〇二一年三月三十日