

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年第2季度报告

2020年6月30日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月二十日

§ 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7月16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。

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

本报告中财务资料未经审计。

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

§ 2 基金产品概况

2.1 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
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
报告期末基金份额总额	6,260,162,956.81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

2.2 广发理财7天债券型证券投资基金

基金简称	广发理财7天债券
基金主代码	000037
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月20日
报告期末基金份额总额	15,355,555,275.88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

§ 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 广发景宁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4月22日-2020年6月30日)
1. 本期已实现收益	65,485,372.78
2. 本期利润	20,899,806.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033

4. 期末基金资产净值	6,265,942,506.98
5. 期末基金份额净值	1.0009

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7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4月1日-2020年4月21日)	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
	1. 本期已实现收益	225,968.94
2. 本期利润	225,968.94	34,122,694.77
3. 期末基金资产净值	101,313,806.85	15,254,241,469.03

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 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020年4月22日-2020年6月30日)

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

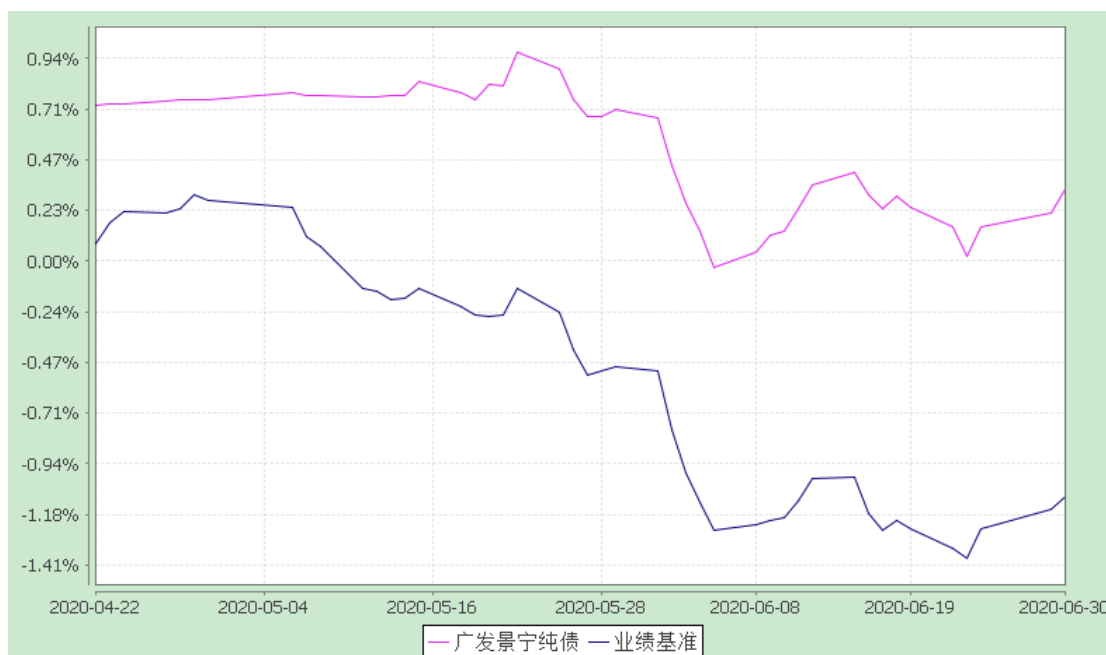
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④

			③	标准差 ④		
自基金合同生效起至今	0.33%	0.14%	-1.09%	0.10%	1.42%	0.04%

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

3.2.1.2 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

广发景宁纯债债券型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020年4月22日-2020年6月30日)



注：(1) 本基金转型日期为2020年4月22日，至披露时点本基金成立未满一年。

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

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

3.2.2 广发理财7天债券型证券投资基金

(报告期: 2020年4月1日-2020年4月21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7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	0.6687%	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	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	0.7418%	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: (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。

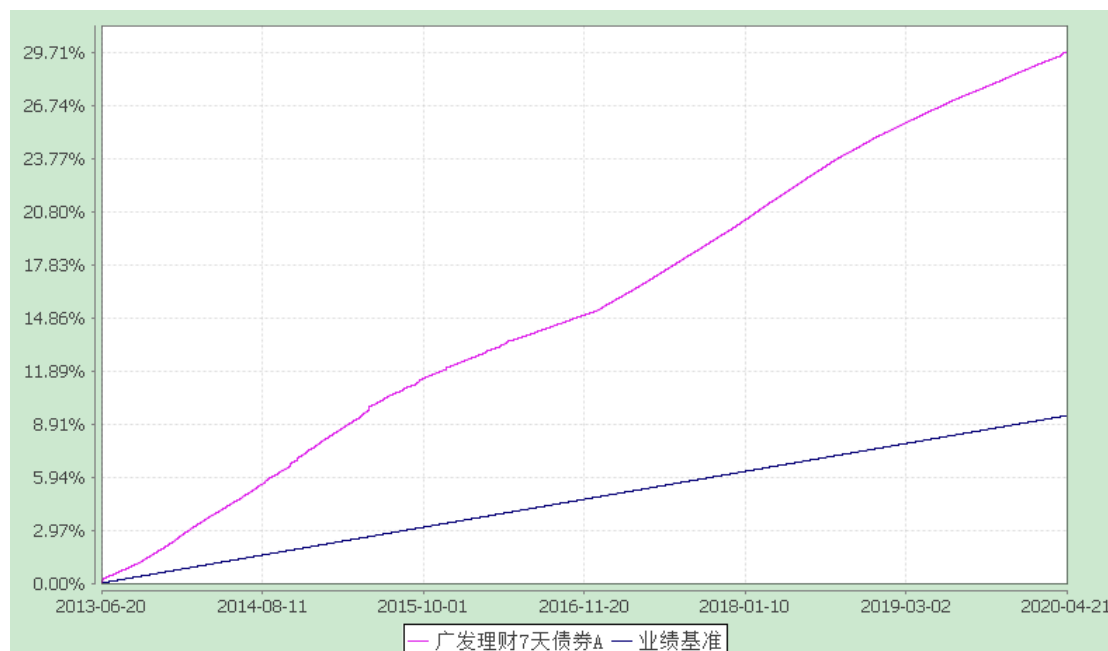
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财7天债券型证券投资基金

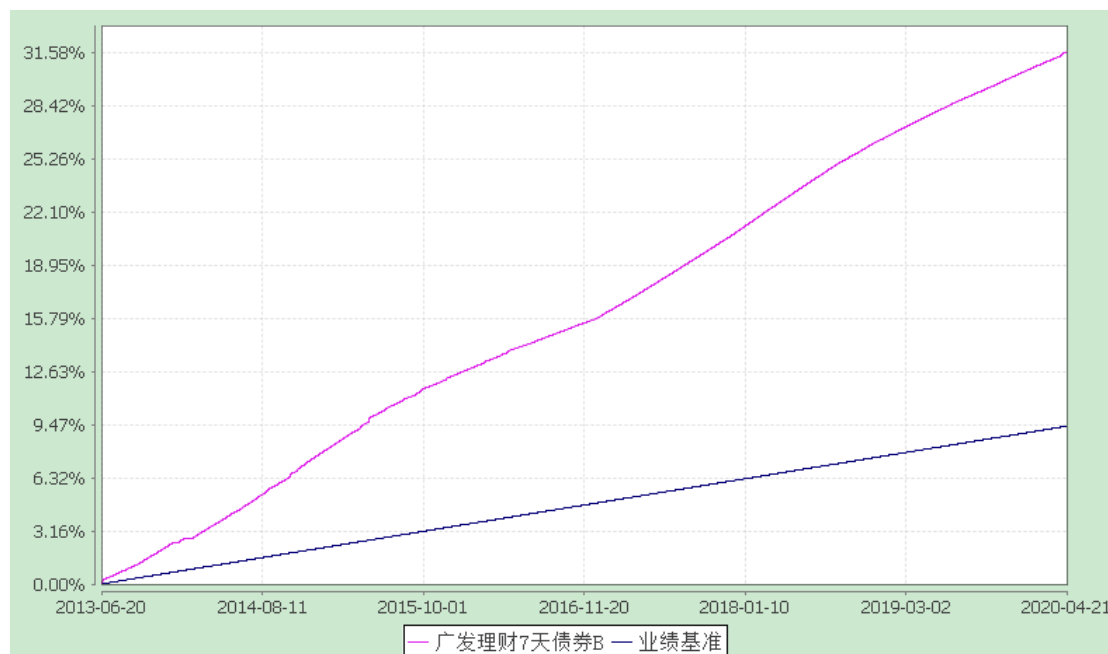
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年6月20日至2020年4月21日)

广发理财7天债券A



广发理财7天债券B



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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		
温秀娟	本基金的基金经理；广发货币市场基金的基金经理；广发理财30天债券型证券投资基金的基金经理；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	-	20年	温秀娟女士，经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日至2020年4月21日)。
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；广发聚泰混合型证券投资基金的基金经理；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	-	12年	任爽女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月16日至2018年3月20日)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年11月9日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月12日至2019年1月8日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年3月21日至2019年3月26日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年3月27日至2019年10月29日)、广发鑫益灵活配置混

					合型证券投资基金基金经理(自2016年11月16日至2019年10月29日)、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日至2020年4月21日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月9日至2020年5月28日)。
--	--	--	--	--	---

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共3次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，货币市场宽松预期在4月极度乐观后，5至6月快速向常态化宽松回摆修正，进而驱动收益率曲线先经历牛陡，后迅速转向熊平。具体而言：4月，央行超预期下调超储利率，打开了利率走廊下限，释放出了较强的宽松信号，全月资金利率中枢下移且在低水平上保持了较高的稳定性。但市场预期的超低资金利率并未保持太长时间，5月央行操作非常克制，公开市场进入了长时间的静默期；同时，随着地方政府债的巨量发行，资金利率在5月下旬超预期向上收敛至OMO利率附近，市场开始重估货币政策的宽松程度，收益率曲线迅速转入熊平。进入6月以后，央行操作继续维持偏鹰派表现，主要通过逆回购进行短期流动性管理，市场此前预期的降准并未实现，以利率互换为代表的资金利率预期依旧在向上寻找央行的合意位置。目前，资金利率预期已经上修至OMO利率附近，中短债的期限利差也回归至历史中枢位置附近。

宏观数据方面，二季度的关键词是疫情后经济重启，整体而言工业和建筑业的恢复最好，制造业、线下消费的恢复较为疲弱，而出口在防疫物资支撑、前期积压订单的支撑下连续超预期增长。4月债市收益率在央行下调超储利率的刺激下下行探底，但5月以后央行表现偏鹰派，市场资金面预期逐步向常态化宽松修正，受此影响各期限利率均出现了明显回调。

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

4.5 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4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0.2070%，B类基金份额净值收益率为

0.2239%，同期业绩比较基准收益率为0.0787%；2020年4月22日至2020年6月30日，广发景宁纯债债券型证券投资基金的净值增长率为0.33%，同期业绩比较基准收益率为-1.09%。

§ 5 投资组合报告

5.1 广发景宁纯债债券型证券投资基金

(报告期：2020年4月22日-2020年6月30日)

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	5,973,221,705.21	89.16
	其中：债券	5,796,045,000.00	86.51
	资产支持证券	177,176,705.21	2.64
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	600,741,137.05	8.97
7	其他资产	125,669,928.10	1.88
8	合计	6,699,632,770.36	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	3,336,494,000.00	53.25
	其中：政策性金融债	2,849,094,000.00	45.47
4	企业债券	271,780,000.00	4.34
5	企业短期融资券	270,859,000.00	4.32
6	中期票据	1,916,912,000.00	30.59
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,796,045,000.00	92.50

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	180210	18 国开 10	14,500,000	1,518,295,000.00	24.23
2	2028018	20 交通银行二级	5,000,000	487,400,000.00	7.78
3	180205	18 国开 05	4,300,000	473,473,000.00	7.56
4	190215	19 国开 15	4,000,000	405,520,000.00	6.47
5	170209	17 国开 09	2,100,000	210,966,000.00	3.37

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

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

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，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到北京市西城区卫生健康委员会的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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7天债券型证券投资基金

(报告期:2020年4月1日-2020年4月21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	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	其他资产	3,887,199,704.59	25.24
5	合计	15,400,625,057.59	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	7.43	
	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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
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。

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	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

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	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	-	-

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	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

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	14次
报告期内偏离度的最高值	0.40%
报告期内偏离度的最低值	0.28%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.32%

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

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

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。

5.2.9.2 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。

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	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

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 广发景宁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	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	6,203,634,562.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,299,026,881.75
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	6,260,162,956.81

6.2 广发理财7天债券型证券投资基金

单位：份

项目	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
本报告期期初基金份额总额	119,739,093.32	15,254,241,469.03
报告期基金总申购份额	-	-
减：报告期基金总赎回份额	18,425,286.47	-

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

§ 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 广发景宁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超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200422-20200630	15,254,241,469.03	6,203,201,538.62	15,271,310,002.62	6,186,133,005.03	98.82%

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。

8.2 广发理财7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	20200401-20200421	15,254,241,469.03	-	-	15,254,241,469.03	99.34%

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》。

§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

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

二〇二〇年七月二十日