

易方达裕富债券型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达裕富债券
基金主代码	008556
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 26 日
报告期末基金份额总额	534,618,534.60 份
投资目标	本基金在控制风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的配置比例。债券投资方面，主要通过久

	期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。股票投资方面，主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+中债新综合指数(财富)收益率×90%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达裕富债券 A	易方达裕富债券 C
下属分级基金的交易代码	008556	008557
报告期末下属分级基金的份额总额	520,049,742.73 份	14,568,791.87 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	易方达裕富债券 A	易方达裕富债券 C

1.本期已实现收益	17,523,725.95	457,794.77
2.本期利润	26,207,460.78	636,553.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0404	0.0367
4.期末基金资产净值	541,878,884.82	15,148,855.40
5.期末基金份额净值	1.0420	1.0398

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

易方达裕富债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.22%	0.36%	0.45%	0.14%	2.77%	0.22%
过去六个月	4.37%	0.27%	1.68%	0.14%	2.69%	0.13%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.20%	0.27%	1.76%	0.14%	2.44%	0.13%

易方达裕富债券 C

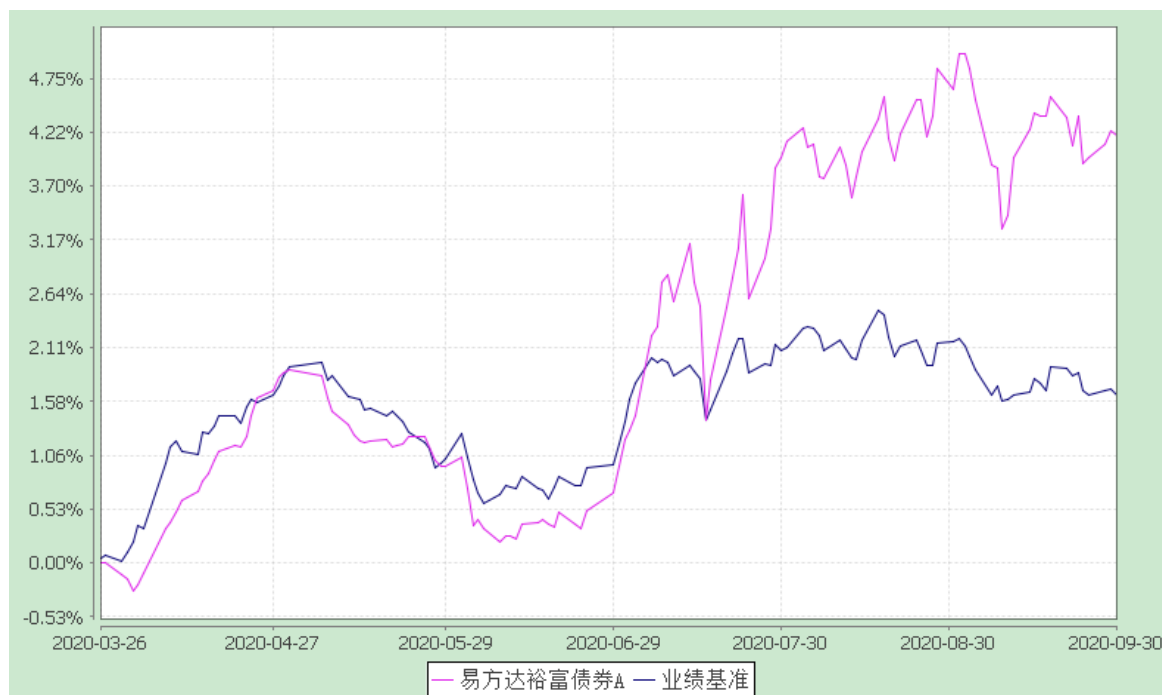
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.11%	0.36%	0.45%	0.14%	2.66%	0.22%
过去六个	4.16%	0.27%	1.68%	0.14%	2.48%	0.13%

月						
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.98%	0.27%	1.76%	0.14%	2.22%	0.13%

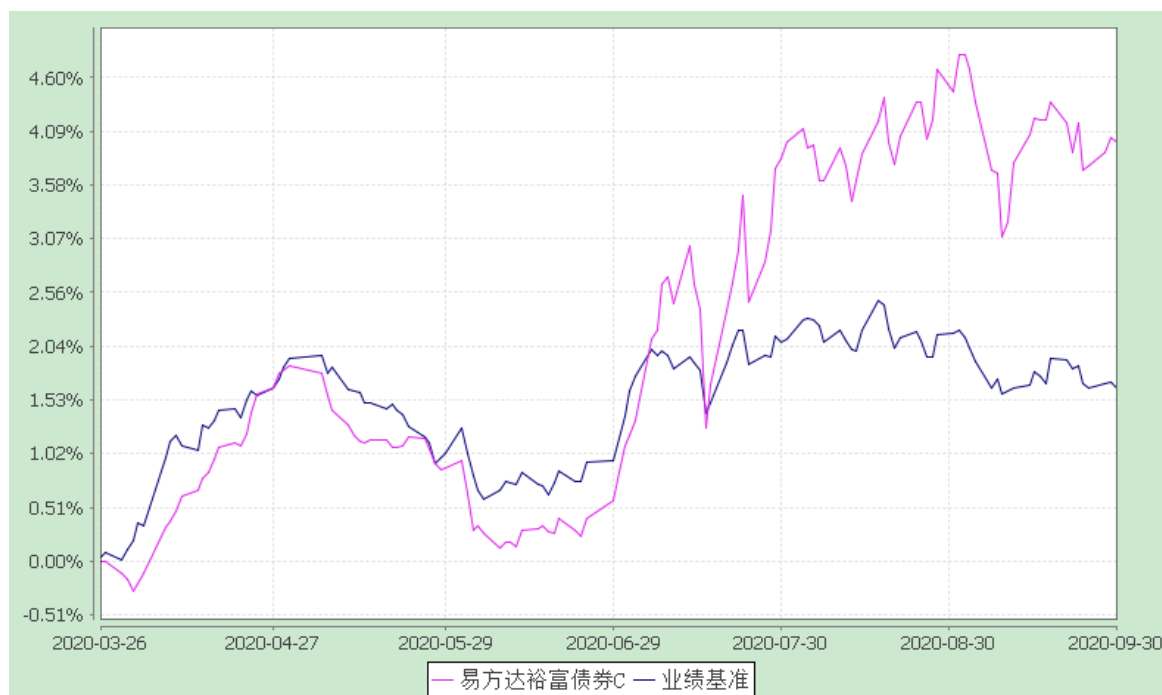
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达裕富债券型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2020 年 3 月 26 日至 2020 年 9 月 30 日)

易方达裕富债券 A



易方达裕富债券 C



注：1.本基金合同于 2020 年 3 月 26 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 4.20%，C 类基金份额净值增长率为 3.98%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

§ 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		
张雅君	本基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方	2020-03-26	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限

<p>达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、混合资产投资部总经理助理</p>				<p>公司债券交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理。</p>
---	--	--	--	---

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前

提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

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 8 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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场方面，三季度在经济持续修复、央行货币政策向常态化回归、市场风险偏好逐渐抬升的背景下，债券收益率呈现震荡上行的态势。7 月市场主要受风险偏好变化的影响，表现出明显的“股债跷跷板”效应，月初股市大涨，债券情绪较弱，长端利率快速上行，下半月随着风险偏好的回落和部分配置力量出现，债市有所回暖，长端利率向下修复。8 月后，经济中观指标短期呈现出较好的改善，同时银行超储率处于偏低水平、同业存单发行利率快速上行，引发市场对流动性的担忧，中短端利率上行幅度大于长端，债券收益率曲线演绎熊平行行情。直到月末附近，资金面紧张态势才有所好转，短端利率上行斜率才略有趋缓。进入 9 月后，经济基本面仍在改善、信用扩张继续，同业存单利率持续上行，同时债市供给增加、季末资金面趋紧，债市继续弱势运行。整个季度来看，10 年期国债和国开债收益率分别大幅上行 30BP 和 60BP，信用债亦跟随无风险利率整体震荡上行，且上行幅度更大，信用利差整体走阔。

权益市场方面，三季度前两月市场整体收涨，各类风格及指数品种均有较好表现，但 9 月以来市场情绪转为谨慎，更多表现为结构性行情的演绎。从二季度末开始，在

国内外经济修复和流动性宽松的环境下，金融股快速拉涨带动 A 股走出一波短暂的“全面牛市”行情，风险偏好持续提升，增量资金快速进场，各板块均有较好表现。但市场的短期过热引发监管对部分杠杆行为的警惕，这对市场风险偏好形成压制，7 月中下旬两市交易量见顶。进入 8 月，主板和创业板整体均处于震荡上行状态，市场由流动性驱动逐步过渡为盈利驱动，风格上也表现出成长价值平衡以及大盘股和中小盘股的平衡，部分低估值金融、周期类品种估值有所修复。9 月份之后，美股波动、海外疫情二次爆发以及 A 股整体偏高的估值导致市场情绪持续谨慎，股市呈现下跌趋势，并出现一定程度的风格切换：年初以来持续强势的大消费板块出现明显回调，低估值、顺周期板块则维持震荡，直到 9 月底大消费短期调整结束，风格才较前期略有反转，市场重新回到平衡状态。

报告期内，组合规模变化较大，7 月逐步加仓权益资产至偏高水平，自 9 月逢高止盈，仓位降至中性。股票方面，增持化工，减持医药、电子等行业。转债方面，减持进入赎回期的转债，并增持部分弹性品种。债券方面，组合进一步降低了久期水平，信用债仓位有小幅提升，以获取票息收益为主

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0420 元，本报告期份额净值增长率为 3.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%；C 类基金份额净值为 1.0398 元，本报告期份额净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	77,628,222.88	11.48
	其中：股票	77,628,222.88	11.48
2	固定收益投资	560,144,066.62	82.83
	其中：债券	540,302,066.62	79.90
	资产支持证券	19,842,000.00	2.93

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	27,913,498.35	4.13
7	其他资产	10,536,824.88	1.56
8	合计	676,222,612.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	74,694,162.38	13.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,934,060.50	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	77,628,222.88	13.94

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	109,158	8,187,941.58	1.47
2	603806	福斯特	108,470	7,928,072.30	1.42
3	600519	贵州茅台	4,200	7,007,700.00	1.26
4	000858	五粮液	29,800	6,585,800.00	1.18
5	000333	美的集团	80,550	5,847,930.00	1.05
6	002078	太阳纸业	409,400	5,772,540.00	1.04
7	002597	金禾实业	174,000	5,515,800.00	0.99
8	002241	歌尔股份	80,300	3,246,529.00	0.58
9	600486	扬农化工	34,700	3,043,190.00	0.55
10	603259	药明康德	28,907	2,934,060.50	0.53

5.4 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	30,201,000.00	5.42
	其中：政策性金融债	30,201,000.00	5.42
4	企业债券	208,941,000.00	37.51
5	企业短期融资券	9,997,000.00	1.79
6	中期票据	261,288,000.00	46.91
7	可转债（可交换债）	29,875,066.62	5.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	540,302,066.62	97.00

5.5 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	101800656	18 中建五局 MTN001	500,000	51,080,000.00	9.17
2	112979	19 海集 01	400,000	39,940,000.00	7.17
3	101900454	19 首旅 MTN001	300,000	30,519,000.00	5.48
4	180208	18 国开 08	300,000	30,201,000.00	5.42
5	163366	20 津投 07	300,000	29,505,000.00	5.30

5.6 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	168880	益行 04A1	100,000	9,921,000.00	1.78
1	168907	健弘 05A	100,000	9,921,000.00	1.78

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的利率风险、有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					1,396,213.59
国债期货投资本期公允价值变动（元）					199,500.00

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约。本基金力争利用国债期货的杠杆作用，降低债券持仓调整的交易成本，以达到有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本的目的。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2019 年 10 月 8 日，深圳市生态环境局对中国建筑第五工程局有限公司“夜间在城市建成区内进行产生环境噪声的建筑施工作业”的行为罚款五万元。2019 年 10 月 9 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境主管部门出具的夜间作业证明，擅自在夜间进行混凝土浇筑施工作业”的行为罚款五万元。2019 年 10 月 9 日，青岛市住房和城乡建设局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《青岛市安全生产条例》第四十二条”的行为罚款一万元。2019 年 10 月 11 日，邯郸市建设局对中国建筑第五工程局有限公司“保利堂悦住宅小区项目施工现场存在 1#楼西侧土方回填作业裸土未做到严密覆盖”的行为罚款一万元。2019 年 10 月 22 日，济南市历城区综合行政执法局对中国建筑第五工程局有限公司“施工工地未采取防尘抑尘措施”的行为罚款四万元。2019 年 11 月 5 日，无锡市住房和城乡建设局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《江苏省大气污染防治条例》第九十四条第（二）项”的行为罚款五万元。2019 年 11 月 7 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“夜间在城市建成区内进行产生环境噪声的建筑施工作业”的行为罚款五万元。2019 年 11 月 26 日，深圳市市场监督管理局坪山局对中国建筑第五工程局有限公司的食品违法行为罚款五万五千元。2019 年 11 月 29 日，邯郸市建设局对中国建筑第五工程局有限公司“施工现场存在硬化地面未及时清扫、冲洗，场地内建筑垃圾未及时清运、苫盖”的行为罚款三万元。2019 年 12 月 2 日，济南市历城区综合行政执法局对中国建筑第五工程局有限公司“未经水行政主管部门批准，擅自取用地下水”的行为罚款二万元。2019 年 12 月 3 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“夜间在城市建成区内进行产生环境噪声的建筑施工作业”的行为罚款五万元。2019 年 12 月 16 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“夜间在城市建成区内进行产生环境噪声的建筑施工作业”的行为罚款三

十万元。2019 年 12 月 30 日，北京市大兴区环境保护局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《中华人民共和国大气污染防治法》第一百零八条第一款第(一)项、《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第七十五条第一款第(一)项和第二款”的行为罚款四万元。2020 年 2 月 10 日，青岛市城市管理局对中国建筑第五工程局有限公司“不按照污水排入排水管网许可证的要求，将工地基坑污水排放到李沧区安顺路城市排水设施中”的行为罚款五千元。2020 年 2 月 13 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“夜间在城市建成区内进行产生环境噪声的建筑施工作业”的行为罚款五万元。2020 年 3 月 2 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境部门出具的夜间施工作业证明，擅自施工”的行为罚款五万元。2020 年 3 月 8 日，北京市住房和城乡建设委员会对中国建筑第五工程局有限公司“存在未严格按照建筑业安全作业标准进行施工，造成事故隐患”的行为罚款一千元。2020 年 3 月 13 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境部门的作业证明，在夜间违法超时施工”的行为罚款五万元。2020 年 3 月 30 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境部门的作业证明，在夜间违法超时施工”的行为罚款五万元。2020 年 4 月 3 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境部门的作业证明，在夜间违法超时施工”的行为罚款五万元。2020 年 4 月 9 日，北京市住房和城乡建设委员会对中国建筑第五工程局有限公司“将工程违法分包”的行为罚款 1609.38 元。2020 年 4 月 14 日，深圳市住房和建设局对中国建筑第五工程局有限公司“未将事故隐患排查治理情况如实记录”的行为罚款五万元。2020 年 4 月 26 日，深圳市住房和建设局对中国建筑第五工程局有限公司“擅自在建筑起重机械上安装非原制造厂制造的标准节”的行为罚款一万元。2020 年 5 月 13 日，北京市大兴区城市管理综合行政执法局对中国建筑第五工程局有限公司“暂不施工的空地地表存在裸露现象”的行为罚款一万元。2020 年 5 月 21 日，深圳市生态环境局南山管理局对中国建筑第五工程局有限公司“未取得生态环境主管部门出具的夜间作业证明，擅自在夜间进行混凝土浇筑施工作业”的行为罚款五万元。2020 年 7 月 2 日，福州市仓山区城市综合执法局对中国建筑第五工程局有限公司“在南二环路盖山铂悦华郡（一期）工地车辆未冲洗上路造成路面污染”的行为罚款两千元。2020 年 7 月 13 日，佛山市禅城区城市管理和综合执法局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《广东省实施〈中华人民

共和国环境噪声污染防治法》办法》第十九条第一款”的行为罚款 10500 元。2020 年 7 月 28 日,佛山市禅城区城市管理和综合执法局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《城市建筑垃圾管理规定》第二十二条第二款”的行为罚款 50000 元。2020 年 9 月 15 日,深圳市南山区水务局对中国建筑第五工程局有限公司违反“《深圳市排水条例》第二十九条第二款”的行为罚款 75000 元。

本基金投资 18 中建五局 MTN001 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 中建五局 MTN001 外,本基金投资的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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	181,224.47
2	应收证券清算款	2,950,823.10
3	应收股利	-
4	应收利息	7,374,163.62
5	应收申购款	30,613.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,536,824.88

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	5,301,223.20	0.95
2	110059	浦发转债	3,796,724.10	0.68
3	132018	G 三峡 EB1	1,923,110.00	0.35
4	113011	光大转债	1,775,547.40	0.32
5	113032	桐 20 转债	1,768,925.70	0.32
6	113541	荣晟转债	1,238,425.60	0.22
7	110068	龙净转债	954,740.40	0.17

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达裕富债券A	易方达裕富债券C
报告期期初基金份额总额	961,390,129.10	22,221,743.43
报告期基金总申购份额	43,431,516.13	6,562,941.44
减：报告期基金总赎回份额	484,771,902.50	14,215,893.00
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	520,049,742.73	14,568,791.87

§ 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未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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
个人	1	2020年08月28日~2020年09月30日	118,054,890.19	-	-	118,054,890.19	22.08%

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以合理价格及时

变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达裕富债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达裕富债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达裕富债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年十月二十八日