

# 易方达增强回报债券型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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：二〇二一年七月二十日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	易方达增强回报债券
基金主代码	110017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 3 月 19 日
报告期末基金份额总额	15,184,054,911.37 份
投资目标	通过主要投资于债券品种，力争为基金持有人创造较高的当期收益和总回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和

	风险；2) 对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3) 基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股申购的收益率以及风险；4) 套利性投资机会的投资期间及预期收益率；5) 股票市场走势的预测；6) 可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断；7) 本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。	
业绩比较基准	中债总指数（全价）	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，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	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B
下属分级基金的交易代码	110017	110018
报告期末下属分级基金的份额总额	11,183,771,083.01 份	4,000,283,828.36 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 (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B

1.本期已实现收益	89,030,062.68	19,030,239.60
2.本期利润	62,091,311.87	2,276,169.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0008
4.期末基金资产净值	15,018,221,189.34	5,335,456,000.78
5.期末基金份额净值	1.343	1.334

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

##### 易方达增强回报债券 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	0.52%	0.17%	0.46%	0.06%	0.06%	0.11%
过去六个月	2.39%	0.27%	0.24%	0.07%	2.15%	0.20%
过去一年	13.20%	0.31%	-0.76%	0.10%	13.96%	0.21%
过去三年	34.84%	0.30%	4.30%	0.11%	30.54%	0.19%
过去五年	41.93%	0.26%	1.43%	0.11%	40.50%	0.15%
自基金合同生效起至今	213.47%	0.29%	12.82%	0.12%	200.65%	0.17%

##### 易方达增强回报债券 B

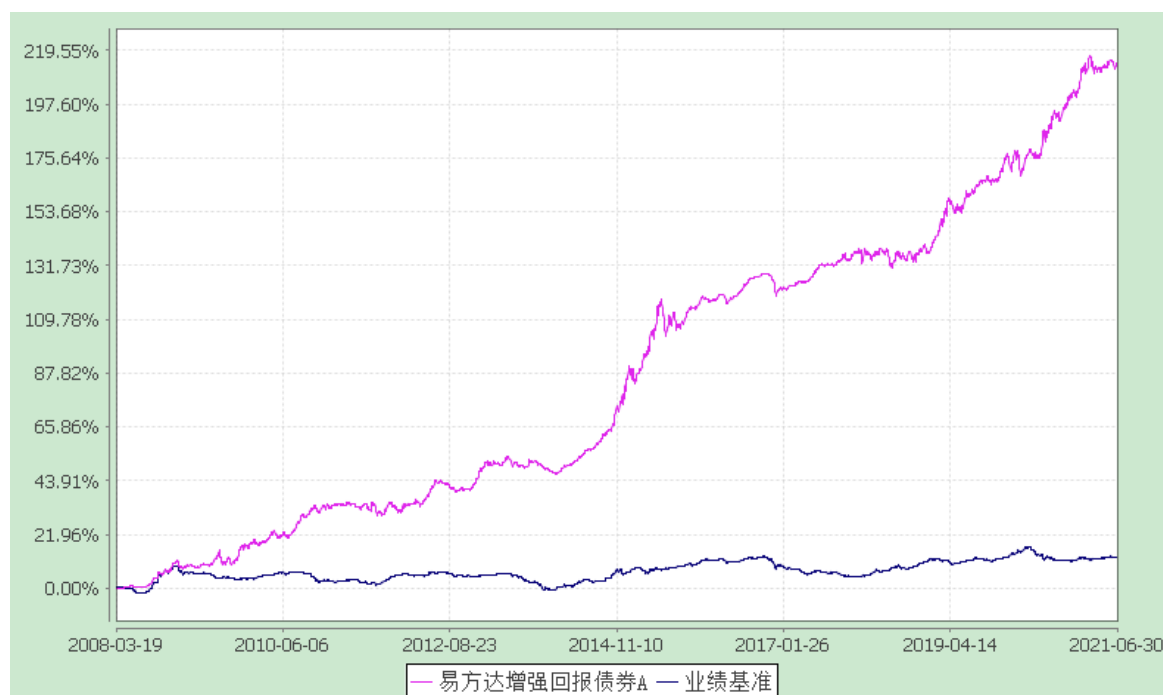
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.37%	0.16%	0.46%	0.06%	-0.09%	0.10%
过去六个	2.17%	0.27%	0.24%	0.07%	1.93%	0.20%

月						
过去一年	12.78%	0.31%	-0.76%	0.10%	13.54%	0.21%
过去三年	33.18%	0.30%	4.30%	0.11%	28.88%	0.19%
过去五年	39.03%	0.26%	1.43%	0.11%	37.60%	0.15%
自基金合同生效起至今	196.42%	0.30%	12.82%	0.12%	183.60%	0.18%

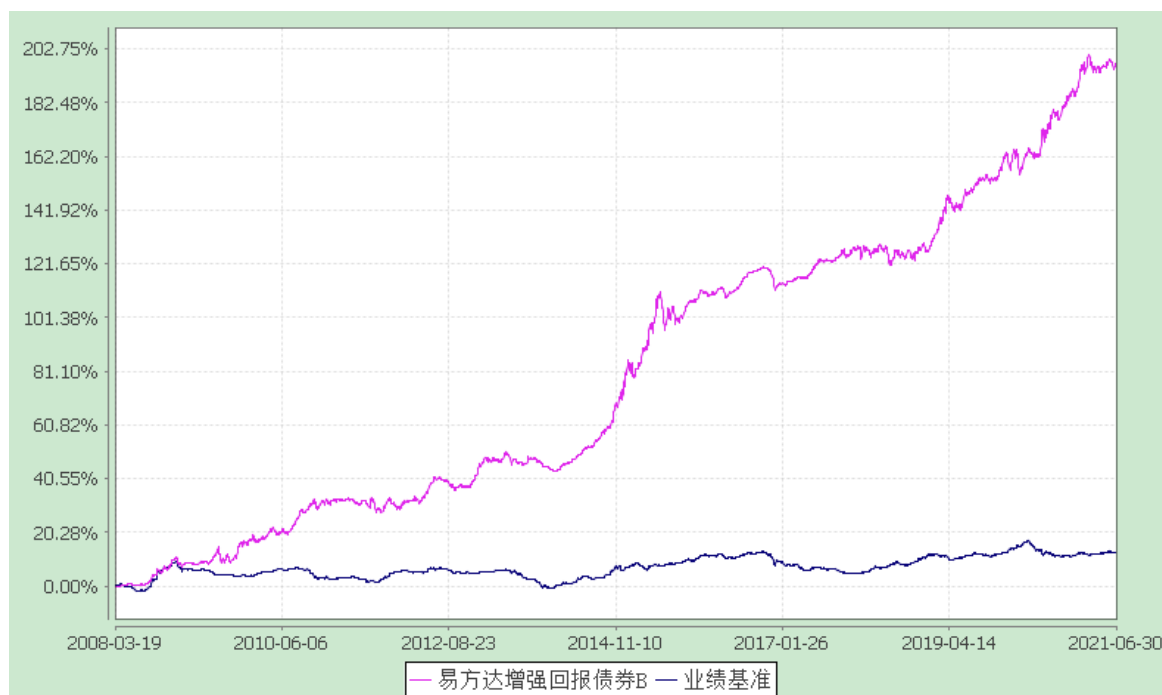
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达增强回报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  
 (2008 年 3 月 19 日至 2021 年 6 月 30 日)

易方达增强回报债券 A



易方达增强回报债券 B



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 213.47%，B 类基金份额净值增长率为 196.42%，同期业绩比较基准收益率为 12.82%。

## § 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		
王晓晨	本基金的基金经理、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、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债	2011-08-15	-	18 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、固定收益基金投资部副总经理、固定收益投资部副总经理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券

	<p>新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益全策略投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、基金经理</p>				<p>投资基金基金经理、易方达纯债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 年期国开债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 1-3 年国开债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国开债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年政策性金融债指数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 12 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

2021 年二季度宏观经济恢复势头减缓，4 月工业增加值同比增长 9.8%，明显低于市场预期，5 月工业增加值同比增长 8.8%，基本符合预期。消费方面，4 月社会消费品零售总额同比增长 17.7%，比 2019 年 4 月份增长 8.8%，两年平均增速为 4.3%；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.4%，比 2019 年 5 月份增长 9.3%，两年平均增速为 4.5%，总体消费恢复程度略低于预期。投资方面，2021 年 1-5 月份全国固定资产投资同比增长 15.4%，比 2019 年 1-5 月份增长 8.5%，两年平均增长 4.2%。结构上，制造业投资总体延续上升的态势，基建投资在 3 月大幅回升后连续两个月有所回落，地产投资 4 月小幅上升后 5 月又小幅回落，总体保持稳定。就业方面，4 月全国城镇调查失业率由 5.3% 降至 5.1%，5 月为 5.0%，持续改善。通胀方面，4 月 CPI 同比上涨 0.9%，5 月同比上涨 1.3%，结构上主要是食品低于预期，非食品高于预期。金融数据方面，4 月和 5 月的新增社会融资数据都低于市场预期，总体维持在偏低增速。从政府债和财政存款来看，收支两方面都表明财政是一个重要拖累因素。

债券市场二季度行情可分为两个阶段，第一阶段从 4 月初到 5 月底，债市延续了从二月下旬开始慢牛行情，第二阶段为 6 月整月，收益率先上后下，呈现倒 V 型震荡调整趋势。二季度中上旬主导债市行情的主要逻辑依然是“钱多”。具体来看，虽然市场普遍担忧二季度地方债供给加速以弥补一季度的空白，以及大宗商品价格涨幅过快带来核心通胀高企的加息问题，而且上述担忧在一定程度上也确实有所实现，但央行的货币政策始终未如大家所预期的那般开始收紧。此外，缓慢的上涨行情中，机构普遍低杠杆运作，叠加国常会提出“应对大宗商品价格过快上涨及其连带影响”稳定了市场情绪，“资产荒”使得机构的配置需求一直较为旺盛。而 6 月初开始，一方面半年末流动性问题即将到来，另一方面经历了五个月的慢牛行情后，利率的进一步下行遇到前低挑战，部分前期做多的资金存在止盈需求，引发了一波调整。但上述调整行情并



未能持续多久，美债走势强势下行提振现券市场情绪，同时央行打破了自 3 月 1 日以来每日 100 亿的公开市场投放惯例，连续两日做了 300 亿元的 7 天逆回购，释放出较为明确的流动性维稳信号，债市收益率再次下行。整个季度来看，10 年期国债和国开债收益率分别下行 12BP 和下行 8BP。信用债走势与无风险利率基本保持一致，收益率同样先下后上再下，信用利差压缩。

股票市场方面，二季度宏观流动性持续宽裕、国内经济稳中趋缓的背景下，市场风格从周期转向成长，但核心资产明显分化，半导体、新能源等板块在供应短缺或强劲需求的驱动下表现亮眼。全季看，上证指数上涨 3.89%，上证 50 指数下跌 2.20%，沪深 300 指数上涨 2.54%，创业板指数上涨 25.47%。

报告期内本基金维持了偏低的杠杆水平，债券仓位方面主要以中短期的中高等级信用债为主，积极根据市场情况进行利率债波段操作；股票仓位方面，保留的股票仓位旨在承受一定波动的前提下获得长期超过债券的回报；可转债仓位方面，主要持有流动性较好的大盘转债。从各类资产的贡献度来看，信用债为组合贡献了较多的正收益。

#### 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 1.343 元，本报告期份额净值增长率为 0.52%，同期业绩比较基准收益率为 0.46%；B 类基金份额净值为 1.334 元，本报告期份额净值增长率为 0.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.46%。

## § 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	2,569,366,078.62	12.46
	其中：股票	2,569,366,078.62	12.46
2	固定收益投资	17,586,681,041.99	85.27
	其中：债券	17,131,502,241.99	83.07
	资产支持证券	455,178,800.00	2.21

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	129,904,634.85	0.63
	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	11,285,269.67	0.05
7	其他资产	326,865,583.39	1.58
8	合计	20,624,102,608.52	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	595,655,521.02	2.93
C	制造业	647,119,197.17	3.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	634,806,543.84	3.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	340,327,944.42	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,921,417.60	0.01
J	金融业	315,979,075.72	1.55
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,556,378.85	0.16
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	2,569,366,078.62	12.62

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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	600900	长江电力	30,756,131	634,806,543.84	3.12
2	601899	紫金矿业	61,471,158	595,655,521.02	2.93
3	002352	顺丰控股	2,873,278	194,520,920.60	0.96
4	600690	海尔智家	7,148,894	185,227,843.54	0.91
5	000001	平安银行	6,797,211	153,752,912.82	0.76
6	000568	泸州老窖	640,075	151,019,295.50	0.74
7	002311	海大集团	1,378,927	112,520,443.20	0.55
8	600031	三一重工	2,745,300	79,805,871.00	0.39
9	601318	中国平安	950,000	61,066,000.00	0.30
10	002142	宁波银行	1,535,570	59,841,162.90	0.29

### 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	1,856,198,852.00	9.12
	其中：政策性金融债	1,052,180,000.00	5.17
4	企业债券	4,124,450,026.92	20.26
5	企业短期融资券	1,953,160,000.00	9.60
6	中期票据	6,578,963,200.00	32.32
7	可转债（可交换债）	2,618,730,163.07	12.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	17,131,502,241.99	84.17
----	----	-------------------	-------

#### 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	210201	21 国开 01	5,500,000	550,330,000.00	2.70
2	190202	19 国开 02	5,000,000	501,850,000.00	2.47
3	132018	G 三峡 EB1	3,197,120	384,038,054.40	1.89
4	113011	光大转债	2,395,960	276,925,056.80	1.36
5	2028029	20 交通银行 01	2,300,000	231,426,000.00	1.14

#### 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	169708	智禾 07A	980,000	98,088,200.00	0.48
2	169664	蚁借 01A	700,000	69,993,000.00	0.34
3	179557	鑫荃 1 优	500,000	50,075,000.00	0.25
4	137683	21 弘基 2A	400,000	40,216,000.00	0.20
5	179659	21 滇中 1A	400,000	40,044,000.00	0.20
6	137667	元熹 8 优 1	300,000	30,171,000.00	0.15
7	137738	辉润 01A	200,000	20,108,000.00	0.10
8	179855	安新 3 优	200,000	20,028,000.00	0.10
9	137881	21 中交 B	160,000	16,057,600.00	0.08
10	169843	益辰 02A1	100,000	10,115,000.00	0.05

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对交通银行股份有限公司太平洋信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计 100 万元”的行政处罚：1.2019 年 6 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2.2019 年 5 月、7 月，该中心对部分信用卡催收外包管理严重不审慎。2020 年 8 月 6 日，上海市黄浦区城市管理行政执法局对交通银行太平洋信用卡中心上海分中心占用城市道路的行为罚款 300 元。

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计 2100 万元”的行政处罚：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为罚款 140 万元人民币：1、违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易。2、违反银行交易记录管理规定。2021 年 4 月 23 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司的如下违法违规行为罚款 760 万元人民币：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务。2021 年 5 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司的如下违法违规行为罚款 40 万元人民币：信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则。

本基金投资光大转债、20 交通银行 01、浦发转债、20 交通银行 02 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除光大转债、20 交通银行 01、浦发转债、20 交通银行 02 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	248,798.46
2	应收证券清算款	24,852,062.26
3	应收股利	-
4	应收利息	222,677,017.03
5	应收申购款	79,087,705.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,865,583.39

### 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	132018	G 三峡 EB1	384,038,054.40	1.89
2	113011	光大转债	276,925,056.80	1.36
3	110059	浦发转债	203,505,875.40	1.00
4	110053	苏银转债	90,282,131.20	0.44
5	128081	海亮转债	69,657,722.61	0.34
6	113037	紫银转债	62,881,083.30	0.31
7	128096	奥瑞转债	53,227,837.00	0.26
8	113013	国君转债	53,082,745.50	0.26
9	128108	蓝帆转债	51,806,105.00	0.25
10	128129	青农转债	46,279,997.40	0.23
11	110052	贵广转债	44,890,683.40	0.22
12	110068	龙净转债	41,254,348.80	0.20
13	132014	18 中化 EB	37,841,124.30	0.19
14	110041	蒙电转债	37,580,858.40	0.18
15	123063	大禹转债	35,642,980.80	0.18

16	123069	金诺转债	35,520,424.20	0.17
17	123075	贝斯转债	35,041,293.59	0.17
18	127025	冀东转债	32,725,759.98	0.16
19	110057	现代转债	32,135,312.10	0.16
20	110064	建工转债	31,333,728.00	0.15
21	127012	招路转债	30,498,412.56	0.15
22	128035	大族转债	26,512,700.20	0.13
23	127013	创维转债	26,160,834.75	0.13
24	123076	强力转债	25,923,993.48	0.13
25	127018	本钢转债	25,681,128.48	0.13
26	113036	宁建转债	23,356,384.80	0.11
27	113508	新风转债	21,571,825.80	0.11
28	128119	龙大转债	18,574,545.90	0.09
29	127022	恒逸转债	18,420,000.00	0.09
30	128141	旺能转债	17,657,348.52	0.09
31	113584	家悦转债	17,452,031.60	0.09
32	128121	宏川转债	17,404,569.42	0.09
33	128109	楚江转债	17,072,300.00	0.08
34	110062	烽火转债	16,707,940.00	0.08
35	123086	海兰转债	16,619,335.20	0.08
36	127016	鲁泰转债	15,419,100.00	0.08
37	128114	正邦转债	14,641,858.32	0.07
38	123056	雪榕转债	14,220,931.20	0.07
39	128127	文科转债	12,985,197.82	0.06
40	110048	福能转债	12,795,628.20	0.06
41	123081	精研转债	12,557,513.20	0.06
42	128044	岭南转债	11,921,812.92	0.06
43	128023	亚太转债	11,649,252.72	0.06
44	113598	法兰转债	11,193,587.50	0.05
45	113603	东缆转债	10,629,668.40	0.05
46	128083	新北转债	10,195,391.29	0.05
47	113535	大业转债	10,100,000.00	0.05
48	127019	国城转债	9,947,479.28	0.05
49	110045	海澜转债	9,059,890.80	0.04
50	123049	维尔转债	8,756,398.38	0.04
51	110047	山鹰转债	8,750,250.00	0.04
52	110051	中天转债	8,735,118.10	0.04
53	123082	北陆转债	8,679,238.86	0.04
54	113040	星宇转债	8,028,438.90	0.04
55	110076	华海转债	7,935,209.10	0.04
56	128132	交建转债	7,687,105.47	0.04
57	128063	未来转债	7,399,171.45	0.04
58	128107	交科转债	7,056,400.00	0.03

59	128128	齐翔转 2	7,030,610.50	0.03
60	113601	塞力转债	6,817,769.30	0.03
61	132017	19 新钢 EB	5,602,668.00	0.03
62	128106	华统转债	5,573,500.00	0.03
63	110073	国投转债	5,385,500.00	0.03
64	128113	比音转债	4,943,559.60	0.02
65	113600	新星转债	4,935,599.90	0.02
66	123091	长海转债	4,099,302.48	0.02
67	123070	鹏辉转债	3,788,700.00	0.02
68	128037	岩土转债	3,409,720.77	0.02
69	113528	长城转债	3,112,410.60	0.02
70	128139	祥鑫转债	3,002,699.34	0.01
71	123053	宝通转债	2,790,325.50	0.01
72	123048	应急转债	2,761,287.30	0.01
73	128071	合兴转债	2,654,014.00	0.01
74	110061	川投转债	2,528,107.00	0.01
75	128130	景兴转债	2,261,800.00	0.01
76	113596	城地转债	1,993,157.00	0.01
77	113024	核建转债	1,448,925.80	0.01
78	128140	润建转债	1,274,437.28	0.01
79	127011	中鼎转 2	1,212,500.00	0.01
80	113579	健友转债	1,201,200.00	0.01
81	128125	华阳转债	1,175,790.00	0.01
82	127014	北方转债	623,060.20	0.00
83	113604	多伦转债	526,250.00	0.00
84	123059	银信转债	526,150.00	0.00
85	123088	威唐转债	516,950.00	0.00
86	113033	利群转债	501,000.00	0.00
87	113608	威派转债	443,626.30	0.00

## 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	易方达增强回报债券A	易方达增强回报债券B
报告期期初基金份额总额	9,838,344,904.23	1,765,967,145.10
报告期期间基金总申购份额	2,778,334,608.94	2,937,773,758.27



减：报告期期间基金总赎回份额	1,432,908,430.16	703,457,075.01
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	11,183,771,083.01	4,000,283,828.36

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达增强回报债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达增强回报债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达增强回报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和营业执照。

### 8.2 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。

### 8.3 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

二〇二一年七月二十日