

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§ 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达裕惠定开混合发起式
基金主代码	000436
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 18 日
报告期末基金份额总额	2,257,027,707.58 份
投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略。 1、封闭运作期内，本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过久期配置、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；本基金将选择具有较高投资价值

	<p>的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将投资股票期权、股票指数期权、场外衍生工具等金融产品。2、开放运作期内，本基金为方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性投资品种的投资比例，以降低基金净值的波动。</p>	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率（税后）+1.75%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	000436	016344
报告期末下属分级基金的份额总额	2,225,313,907.34 份	31,713,800.24 份

注：自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日。

§ 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 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	易方达裕惠定开混合 发起式 A	易方达裕惠定开混合 发起式 C
1.本期已实现收益	45,842,777.75	115,974.12
2.本期利润	28,684,467.29	-58,487.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0120	-0.0062
4.期末基金资产净值	3,691,595,293.49	52,431,736.38
5.期末基金份额净值	1.659	1.653

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

易方达裕惠定开混合发起式 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	0.73%	0.15%	1.15%	0.01%	-0.42%	0.14%
过去六个月	1.59%	0.15%	2.29%	0.01%	-0.70%	0.14%
过去一年	3.49%	0.18%	4.56%	0.01%	-1.07%	0.17%
过去三年	17.12%	0.17%	13.69%	0.01%	3.43%	0.16%
过去五年	36.81%	0.16%	22.83%	0.01%	13.98%	0.15%

自基金合同生效起至今	129.54%	0.20%	42.80%	0.01%	86.74%	0.19%
------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

易方达裕惠定开混合发起式 C

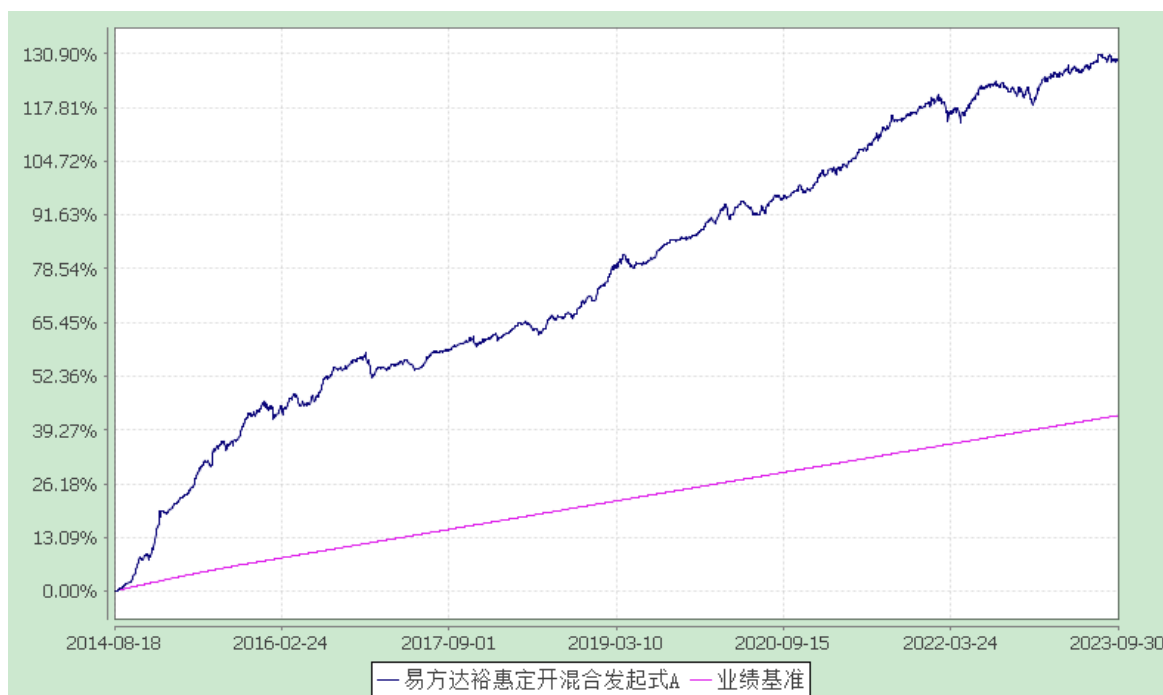
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.61%	0.14%	1.15%	0.01%	-0.54%	0.13%
过去六个月	1.35%	0.15%	2.29%	0.01%	-0.94%	0.14%
过去一年	3.06%	0.18%	4.56%	0.01%	-1.50%	0.17%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.39%	0.17%	5.01%	0.01%	-2.62%	0.16%

3.2.2 自基金转型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

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金
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

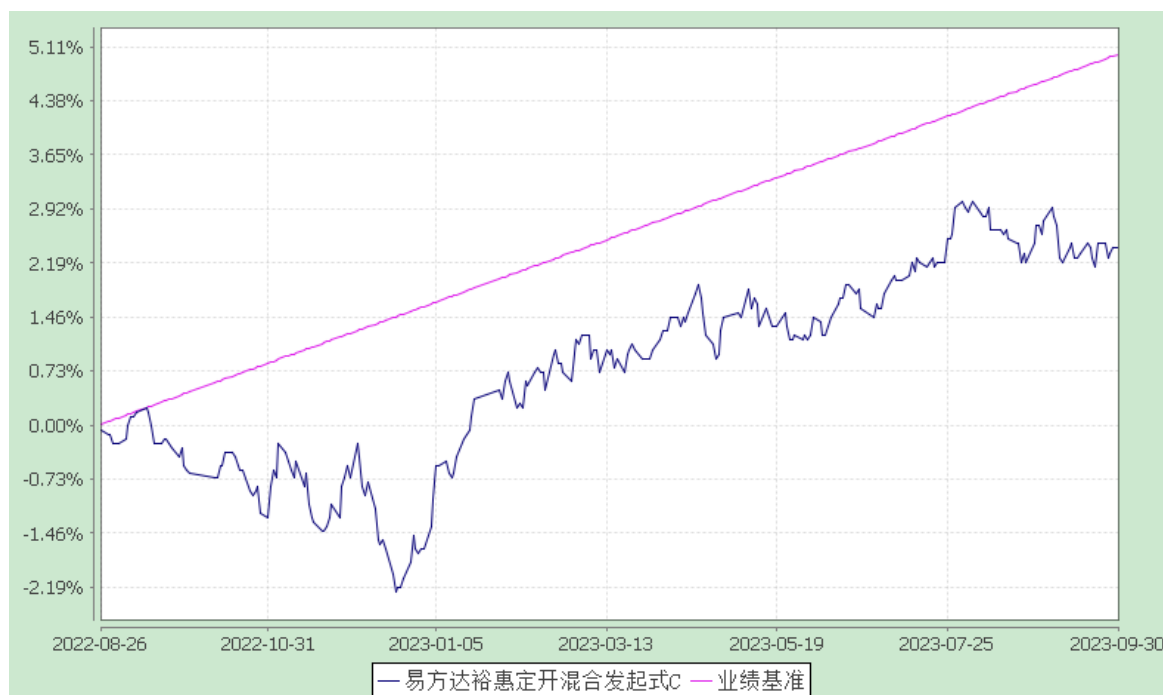
易方达裕惠定开混合发起式 A

(2014 年 8 月 18 日至 2023 年 9 月 30 日)



易方达裕惠定开混合发起式 C

(2022 年 8 月 26 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：1.自 2022 年 8 月 25 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金转型至报告期末, A 类基金份额净值增长率为 129.54%, 同期业绩比较基准收益率为 42.80%; C 类基金份额净值增长率为 2.39%, 同期业绩比较基准收益率

为 5.01%。

§ 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		
胡剑	本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达信用债债券、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员	2014-08-18	-	17 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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。

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行业协会相关规定。

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、决策流程和交易流程，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，其中 9 次为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

基本面在三季度呈现筑底回升的走势。经济数据自 6 月份开始呈现企稳迹象，主要体现为工业增加值、社会消费品零售额、基建投资、制造业投资等指标的环比修复，金融数据也出现改善。这一趋势在 7 月份有所反复，但是在 8 月份得以延续。我们认为经济企稳主要有几方面的原因：一是全球需求恢复带动中国出口，尤其是电子产品出口回升显著；二是随着地方债发行加速，三季度政府支出节奏加快带来基建投资和制造业投资增速的回升；三是新能源退税政策延续及各地加大汽车购置补贴使得汽车生

产、零售等数据回暖；四是暑期档出行需求增加带来服务业生产活动强度回升。同时我们也观察到，地产相关政策虽然有所松动，但房地产销售数据改善不显著，地产投资也继续下行。房地产相关产业链条持续对经济造成负面拖累。

政策方面，三季度明显加大了逆周期调节的力度，各方面稳定经济稳定信心的政策陆续出台。央行在降息、降准的同时保持了银行间资金利率水平的稳定，非银资金成本甚至略有上行，债券市场整体杠杆率有所下降。另一方面财政支出发力后，信贷社融数据呈现显著改善。三季度政策积极程度整体强于二季度。后续随着地产政策的进一步放松、地方政府债务化解政策逐步推进，经济有望延续筑底回升的走势。

从债券市场的表现来看，三季度收益率先下后上，呈现平坦化特征。1-3 年国开债收益率上行 8-16BP，4-5 年期国开债收益率上行 3-4BP，而超长端 20 年国开债收益率则下行 8BP。信用债收益率跟随利率债变动，AAA 评级 1-3 年期限信用债收益率上行 8-9BP，5 年期信用债收益率上行 2BP，10 年期信用债收益率反而下行 5BP。城投行业信用利差出现显著压缩，1-5 年期限 AA（2）评级相对于 AAA 信用债的信用利差下行 10-20BP。

三季度权益市场继续震荡下跌。沪深 300 指数下跌 3.98%，创业板指数下跌 9.53%。行业方面，非银金融、煤炭、石油石化行业表现相对较好，上涨 4-5%，而电力设备、传媒、计算机、通信等行业下跌较大，跌幅达到 10% 以上。可转债表现出一定的抗跌属性，中证转债指数下跌 0.52%。

操作上，组合主要配置债券类资产，久期处于中性水平，以获取持有期收益为主要投资策略。权益方面，组合在三季度提升了股票和可转债仓位。本组合净值在三季度整体保持平稳。

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 1.659 元，本报告期份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%；C 类基金份额净值为 1.653 元，本报告期份额净值增长率为 0.61%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	657,281,735.42	12.94
	其中：股票	657,281,735.42	12.94
2	固定收益投资	4,364,614,989.15	85.96
	其中：债券	4,015,773,725.48	79.09
	资产支持证券	348,841,263.67	6.87
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	44,325,002.38	0.87
7	其他资产	11,559,811.34	0.23
8	合计	5,077,781,538.29	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	2,849,328.00	0.08
B	采矿业	25,397,568.00	0.68
C	制造业	376,639,926.87	10.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,430,995.97	0.09
E	建筑业	12,101,841.49	0.32
F	批发和零售业	131,674.95	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	104,556,400.40	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,128,494.85	1.26
J	金融业	37,927,709.92	1.01
K	房地产业	14,459,619.24	0.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	30,704,027.84	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	25,950.09	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,928,197.80	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	657,281,735.42	17.56

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	601298	青岛港	5,714,800	36,346,128.00	0.97
2	600018	上港集团	6,425,400	33,090,810.00	0.88
3	601728	中国电信	4,461,700	25,833,243.00	0.69
4	601088	中国神华	792,300	24,719,760.00	0.66
5	601799	星宇股份	160,018	24,322,736.00	0.65
6	600941	中国移动	216,663	20,977,311.66	0.56
7	600873	梅花生物	2,094,514	20,149,224.68	0.54
8	600685	中船防务	825,607	19,352,228.08	0.52
9	688007	光峰科技	699,450	17,766,030.00	0.47
10	600150	中国船舶	631,200	17,610,480.00	0.47

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	360,845,534.87	9.64
	其中：政策性金融债	60,364,469.94	1.61
4	企业债券	600,406,987.90	16.04
5	企业短期融资券	61,636,344.09	1.65
6	中期票据	2,124,958,572.55	56.76
7	可转债（可交换债）	758,817,973.33	20.27
8	同业存单	109,108,312.74	2.91
9	其他	-	-
10	合计	4,015,773,725.48	107.26

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	1928020	19 交通银行二级 02	1,000,000	106,581,453.55	2.85
2	092280105	22 南京银行永续 债 01	800,000	81,686,908.49	2.18
3	102282540	22 大唐集 MTN010	600,000	62,436,598.36	1.67
4	132280020	22 湖南钢铁 GN001	600,000	61,014,570.49	1.63
5	112387025	23 吉林银行 CD135	600,000	59,684,845.71	1.59

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	180335	工鑫 12A	400,000	40,174,051.51	1.07
2	112060	二发 A	400,000	38,282,028.27	1.02
3	199694	G23XH 优	300,000	30,342,427.40	0.81
4	193933	和皖 A	200,000	20,618,969.64	0.55
5	135572	荟臻 021A	200,000	20,053,332.60	0.54
6	180588	大板 A	200,000	20,031,010.16	0.54
7	180991	工鑫 15A	200,000	19,972,339.73	0.53

8	183916	22 保置优	200,000	19,751,192.94	0.53
9	112450	22 沪杭优	100,000	10,293,243.84	0.27
10	112424	星惠 5A	100,000	10,213,745.21	0.27

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，湖北银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局湖北监管局的处罚。吉林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吉林监管局、中国人民银行长春中心支行的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚。申万宏源证券有限公司在报告编制日前一年内曾受到濂溪区城管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	132,280.78
2	应收证券清算款	11,427,530.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	11,559,811.34

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	113050	南银转债	27,181,463.44	0.73
2	127045	牧原转债	18,340,391.33	0.49
3	113056	重银转债	13,354,941.50	0.36
4	113641	华友转债	12,660,339.76	0.34
5	128037	岩土转债	12,052,691.19	0.32
6	123149	通裕转债	11,777,701.88	0.31
7	113059	福莱转债	11,263,504.37	0.30
8	127018	本钢转债	11,113,486.13	0.30
9	110085	通 22 转债	10,994,615.56	0.29
10	123151	康医转债	10,793,611.96	0.29
11	127061	美锦转债	10,614,636.35	0.28
12	110089	兴发转债	10,399,623.26	0.28
13	113065	齐鲁转债	10,290,556.41	0.27
14	128066	亚泰转债	10,081,659.34	0.27
15	110093	神马转债	9,640,868.67	0.26
16	127047	帝欧转债	9,402,653.53	0.25
17	127007	湖广转债	8,942,052.40	0.24
18	132020	19 蓝星 EB	8,701,238.65	0.23
19	118031	天 23 转债	8,681,629.23	0.23
20	111009	盛泰转债	8,675,073.07	0.23
21	113644	艾迪转债	8,611,183.52	0.23
22	118022	锂科转债	8,270,761.11	0.22
23	113062	常银转债	7,982,687.14	0.21
24	118025	奕瑞转债	7,910,605.38	0.21
25	127066	科利转债	7,898,092.87	0.21
26	113051	节能转债	7,139,583.09	0.19
27	127053	豪美转债	6,958,600.02	0.19
28	128109	楚江转债	6,937,902.99	0.19
29	113053	隆 22 转债	6,848,025.31	0.18
30	113623	凤 21 转债	6,837,462.99	0.18
31	113647	禾丰转债	6,776,447.09	0.18
32	113048	晶科转债	6,766,000.58	0.18
33	113058	友发转债	6,743,358.31	0.18
34	127027	能化转债	6,689,478.49	0.18
35	127073	天赐转债	6,664,442.42	0.18

36	110063	鹰 19 转债	6,609,748.00	0.18
37	127005	长证转债	6,543,591.78	0.17
38	113625	江山转债	6,461,530.30	0.17
39	123091	长海转债	6,321,672.72	0.17
40	110086	精工转债	5,817,161.19	0.16
41	113639	华正转债	5,731,910.27	0.15
42	123150	九强转债	5,725,431.33	0.15
43	123119	康泰转 2	5,678,791.21	0.15
44	110088	淮 22 转债	5,672,221.36	0.15
45	123002	国祯转债	5,656,456.14	0.15
46	118023	广大转债	5,643,424.65	0.15
47	118009	华锐转债	5,608,025.88	0.15
48	127070	大中转债	5,593,665.07	0.15
49	113066	平煤转债	5,590,704.11	0.15
50	113604	多伦转债	5,568,764.27	0.15
51	118027	宏图转债	5,559,614.10	0.15
52	110073	国投转债	5,542,041.78	0.15
53	123171	共同转债	5,534,832.16	0.15
54	127067	恒逸转 2	5,534,610.35	0.15
55	123138	丝路转债	5,518,785.98	0.15
56	110047	山鹰转债	5,515,713.37	0.15
57	128141	旺能转债	5,503,007.86	0.15
58	123175	百畅转债	5,494,078.33	0.15
59	123072	乐歌转债	5,471,442.13	0.15
60	128034	江银转债	5,470,332.76	0.15
61	123135	泰林转债	5,468,832.27	0.15
62	123170	南电转债	5,453,402.16	0.15
63	128116	瑞达转债	5,383,244.74	0.14
64	128044	岭南转债	5,373,404.87	0.14
65	123169	正海转债	5,361,923.59	0.14
66	113627	太平转债	5,354,201.64	0.14
67	113655	欧 22 转债	5,325,664.10	0.14
68	127081	中旗转债	5,299,450.32	0.14
69	113505	杭电转债	5,268,377.90	0.14
70	127044	蒙娜转债	5,195,338.82	0.14
71	118013	道通转债	5,193,200.14	0.14
72	110043	无锡转债	5,085,812.73	0.14
73	128017	金禾转债	5,004,730.25	0.13
74	127075	百川转 2	4,871,566.35	0.13
75	123162	东杰转债	4,601,264.51	0.12
76	113049	长汽转债	4,521,544.11	0.12
77	118018	瑞科转债	4,173,188.45	0.11
78	118032	建龙转债	4,065,624.61	0.11

79	123154	火星转债	4,016,553.80	0.11
80	118024	冠宇转债	3,942,449.39	0.11
81	123153	英力转债	3,860,550.71	0.10
82	123049	维尔转债	3,617,625.28	0.10
83	118006	阿拉转债	3,555,089.56	0.09
84	118015	芯海转债	3,396,767.14	0.09
85	118033	华特转债	3,386,423.67	0.09
86	127043	川恒转债	3,383,167.35	0.09
87	113574	华体转债	3,328,803.36	0.09
88	128081	海亮转债	3,080,630.68	0.08
89	118029	富淼转债	3,066,238.77	0.08
90	123158	宙邦转债	2,550,881.78	0.07
91	123085	万顺转 2	2,509,668.10	0.07
92	118012	微芯转债	2,361,076.76	0.06
93	128021	兄弟转债	2,139,515.44	0.06
94	118020	芳源转债	2,104,436.22	0.06
95	123161	强联转债	1,984,819.54	0.05
96	113629	泉峰转债	1,980,252.05	0.05
97	113638	台 21 转债	1,972,765.66	0.05
98	123166	蒙泰转债	1,958,395.92	0.05
99	113643	风语转债	1,818,079.84	0.05
100	127071	天箭转债	1,766,270.37	0.05
101	123182	广联转债	1,739,541.67	0.05
102	113061	拓普转债	1,697,656.11	0.05
103	113636	甬金转债	1,257,391.10	0.03
104	111008	沿浦转债	1,124,170.83	0.03
105	123178	花园转债	1,088,756.01	0.03
106	118004	博瑞转债	986,272.77	0.03
107	127052	西子转债	923,556.53	0.02
108	113619	世运转债	898,824.33	0.02
109	113042	上银转债	332,659.32	0.01
110	123035	利德转债	102,907.45	0.00
111	127022	恒逸转债	73,808.94	0.00
112	127058	科伦转债	920.51	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	易方达裕惠定开混	易方达裕惠定开混
----	----------	----------

	合发起式A	合发起式C
报告期期初基金份额总额	2,472,122,889.20	1,784,268.98
报告期期间基金总申购份额	442,667,943.27	30,797,532.41
减：报告期期间基金总赎回份额	689,476,925.13	868,001.15
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	2,225,313,907.34	31,713,800.24

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	9,149,130.83	0.4054%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	9,149,130.83	0.4054%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额已全部赎回。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达裕惠回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2.易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告；
- 3.《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.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

二〇二三年十月二十五日