

# 易方达裕祥回报债券型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十八日

## § 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	易方达裕祥回报债券
基金主代码	002351
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 22 日
报告期末基金份额总额	19,698,311,473.56 份
投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，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	1、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。 2、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；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；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。3、本基金将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。4、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	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%	
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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达裕祥回报债券 A	易方达裕祥回报债券 C
下属分级基金的交易代码	002351	017420
报告期末下属分级基金的份额总额	18,579,806,921.94 份	1,118,504,551.62 份

注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
--------	---

	易方达裕祥回报债券 A	易方达裕祥回报债券 C
1.本期已实现收益	-63,058,961.60	-10,214,417.55
2.本期利润	272,740,718.22	-8,567,249.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0157	-0.0104
4.期末基金资产净值	30,011,813,446.92	1,798,968,289.90
5.期末基金份额净值	1.615	1.608

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

##### 易方达裕祥回报债券 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	1.19%	0.21%	1.09%	0.10%	0.10%	0.11%
过去六个月	3.93%	0.23%	3.21%	0.13%	0.72%	0.10%
过去一年	4.19%	0.20%	3.23%	0.13%	0.96%	0.07%
过去三年	8.27%	0.26%	6.14%	0.16%	2.13%	0.10%
过去五年	44.04%	0.30%	18.97%	0.17%	25.07%	0.13%
自基金合同生效起至今	79.19%	0.33%	35.74%	0.17%	43.45%	0.16%

##### 易方达裕祥回报债券 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	1.07%	0.21%	1.09%	0.10%	-0.02%	0.11%
过去六个月	3.68%	0.23%	3.21%	0.13%	0.47%	0.10%
过去一年	3.74%	0.20%	3.23%	0.13%	0.51%	0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.08%	0.19%	4.16%	0.13%	-0.08%	0.06%

### 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

易方达裕祥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

易方达裕祥回报债券 A

(2016 年 1 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)



易方达裕祥回报债券 C

(2023 年 3 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 79.19%，同期业绩比较基准收益率为 35.74%；C 类基金份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准收益率为 4.16%。

## § 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，易方达增强回报债券、易方达投资级信用债债券、易方达双债增强债券、易方达安瑞短债债券（自 2018 年 11 月 14 日至 2024 年 06 月 19 日）、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、	2022-04-30	-	21 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、易方达保

	易方达安泽 180 天持有债券的基金经理，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			证金货币、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达保本一号混合、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、易方达纯债债券、易方达恒益定开债券发起式、易方达新鑫混合、易方达恒安定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债 3-5 年政金债指数的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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，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 21 次，其中 18 次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，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

二季度经济数据较一季度有所走弱。生产端来看，4 月规模以上工业增加值同比增长 6.7%，环比增长 0.97%，5 月同比增长 5.6%，环比增长 0.3%，工业生产继续保持较好增长态势，但环比增速在历史同期中处于偏低水平，或反映企业去库存对生产有所拖累。需求端来看，4、5 月固定资产投资增速较一季度水平有所下行，社会消费品零售总额增速先降后升但高度有限，出口景气维持平稳。价格方面，4、5 月 CPI（消费者物价指数，下同）同比持平于 0.3%，核心 CPI 同比增速稳中略降，服务业 CPI 仍然偏低；PPI（生产者物价指数）同比跌幅收窄，环比由降转涨，主要受部分国际大宗商品价格上行及国内工业品市场供需关系改善等因素影响。综合来看，二季度工业生产保持较快增长，就业物价形势稳定，转型升级持续推进，运行总体平稳。同时外部环境复杂性严峻性有所上升，国内有效需求仍显不足，内生动能仍待增强。

政策方面，4 月底政治局会议“扩内需”部署在“产业发展”之前，要求靠前发力有效落实已经确定的宏观政策，实施好积极的财政政策和稳健的货币政策，强调保持经济稳定，避免政策“前紧后松”，整体政策反应积极，布置具体。央行货币政策委员会第二季度例会指出要加大已出台货币政策实施力度，保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配，推动企业融资和居民信贷成本稳中有降。同时，在经济回升过程中，也要关注长期收益率的变化，保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定，防止形成单边一致性预期并自我强化，坚决防范汇率超调风险。

市场表现方面，债券收益率二季度整体下行。资金方面，二季度 R007（银行间 7 天质押式回购利率）平均水平较一季度有所下行。现券方面，伴随二季度以来债券供需关系有利等原因，债券收益率趋势下行，6 月末 10 年国债收益率收于 2.21%，10

年国开债收益率收于 2.29%，分别较一季度末下行 8.4bp、11.8bp；信用利差中枢持续下行，截止二季度末，3 年 AAA 中短票收益率较一季度末下行 36.7bp，利差压缩 13bp 左右，中低评级信用利差压缩程度稍高，3 年 AA 中短票利差压缩 22bp。

股票方面，二季度股票市场波动较大，沪深 300 指数下跌 2.14%，中证 1000 下跌 10.02%，创业板指数下跌 7.41%。二季度申万行业中，银行、公用事业、电子涨幅靠前，综合、传媒、商贸零售领跌。

转债方面，4 月下旬开始正股表现强劲，带动转债市场情绪回暖，4-5 月中证转债指数上涨 3.49%，同期上证指数涨幅 1.51%；6 月转债跟随权益市场走弱，中下旬受市场定价转债信用风险的影响，短期出现明显下跌，中证转债指数下跌 2.68%。二季度中证转债指数上涨 0.75%，同期上证指数下跌 2.43%，万得全 A 指数下跌 5.32%。

报告期内，组合基于对经济基本面走势的判断，积极应对并调整资产配置。操作方面，二季度组合在债券收益率下行的过程中逐步小幅降低债券仓位和久期，获得了不错的资本利得收益，并根据相对价值变化不断优化券种结构。股票方面，组合维持权益风险敞口，坚持自下而上精选个股，权益资产对组合净值有正向贡献。转债方面，组合自 5 月起逐步降低转债仓位，但二季度整体对组合收益有小幅拖累。本基金将坚持稳健投资的原则，力争以优异的业绩回报基金持有人。

#### 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 1.615 元，本报告期份额净值增长率为 1.19%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%；C 类基金份额净值为 1.608 元，本报告期份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%。

#### 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	5,863,604,384.96	17.73

	其中：股票	5,863,604,384.96	17.73
2	固定收益投资	27,045,154,205.32	81.77
	其中：债券	26,846,363,800.11	81.16
	资产支持证券	198,790,405.21	0.60
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	78,366,454.04	0.24
7	其他资产	89,478,705.56	0.27
8	合计	33,076,603,749.88	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	630,254,235.03	1.98
C	制造业	3,525,866,736.69	11.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	254,086,094.15	0.80
E	建筑业	109,059,061.52	0.34
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	481,594,251.61	1.51
H	住宿和餐饮业	26,261,544.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	248,068,541.53	0.78
J	金融业	342,505,050.67	1.08
K	房地产业	104,587,463.76	0.33
L	租赁和商务服务业	132,650,986.80	0.42
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	8,670,419.20	0.03
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	5,863,604,384.96	18.43

### 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	601088	中国神华	5,286,400	234,557,568.00	0.74
2	600031	三一重工	12,580,591	207,579,751.50	0.65
3	600176	中国巨石	18,378,411	203,081,441.55	0.64
4	600426	华鲁恒升	7,424,032	197,776,212.48	0.62
5	600298	安琪酵母	6,953,644	194,215,276.92	0.61
6	600660	福耀玻璃	4,036,547	193,350,601.30	0.61
7	000338	潍柴动力	11,785,000	191,388,400.00	0.60
8	600938	中国海油	5,486,162	181,043,346.00	0.57
9	600690	海尔智家	5,915,872	167,892,447.36	0.53
10	601985	中国核电	15,305,200	163,153,432.00	0.51

### 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	2,130,823,174.32	6.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,907,813,567.41	43.72
	其中：政策性金融债	4,039,353,314.93	12.70
4	企业债券	2,536,931,665.91	7.98
5	企业短期融资券	658,809,863.40	2.07
6	中期票据	4,607,955,535.29	14.49
7	可转债（可交换债）	3,004,029,993.78	9.44

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,846,363,800.11	84.39

#### 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	092280108	22 中行二级资本债 02A	11,000,000	1,153,060,393.44	3.62
2	242400009	24 农行永续债 02	6,500,000	656,436,210.96	2.06
3	092280033	22 宁波银行二级资本债 01	6,000,000	636,427,278.69	2.00
4	092280014	22 上海银行二级资本债 01	5,900,000	634,211,827.32	1.99
5	230026	23 附息国债 26	5,500,000	571,386,480.98	1.80

#### 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	112450	22 沪杭优	900,000	86,856,431.31	0.27
2	260258	耘睿 102A	300,000	30,429,833.42	0.10
3	189951	21 十局优	200,000	20,556,547.95	0.06
4	261755	24 海创 9A	200,000	20,257,225.21	0.06
5	180204	22 葛洲优	200,000	20,078,045.90	0.06
6	112813	GC 曹 03A2	200,000	10,384,770.73	0.03
7	183144	21 水八 04	100,000	10,227,550.69	0.03

#### 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，宁波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宁波监管局、国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局宁波市分局的处罚。上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。中国建设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的处罚。中国农业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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国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、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。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	666,920.40
2	应收证券清算款	78,123,613.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,688,171.34
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	89,478,705.56

### 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	118031	天 23 转债	117,565,445.54	0.37
2	113065	齐鲁转债	117,530,402.57	0.37
3	127049	希望转 2	79,810,525.34	0.25
4	127045	牧原转债	77,989,613.00	0.25

5	113641	华友转债	76,512,216.35	0.24
6	110081	闻泰转债	75,523,840.07	0.24
7	127067	恒逸转 2	67,343,158.73	0.21
8	127018	本钢转债	64,262,984.71	0.20
9	113054	绿动转债	57,759,487.30	0.18
10	113059	福莱转债	57,277,964.38	0.18
11	127061	美锦转债	55,697,237.86	0.18
12	127016	鲁泰转债	54,992,382.36	0.17
13	113033	利群转债	48,428,320.95	0.15
14	118000	嘉元转债	48,076,144.11	0.15
15	123149	通裕转债	47,869,093.53	0.15
16	110087	天业转债	45,295,483.63	0.14
17	127030	盛虹转债	43,330,715.77	0.14
18	118022	锂科转债	42,691,280.88	0.13
19	123113	仙乐转债	41,337,670.00	0.13
20	113650	博 22 转债	41,169,826.50	0.13
21	113051	节能转债	41,031,311.98	0.13
22	110089	兴发转债	39,969,853.55	0.13
23	113055	成银转债	39,938,136.59	0.13
24	113045	环旭转债	38,797,697.66	0.12
25	113542	好客转债	38,635,613.57	0.12
26	113048	晶科转债	36,886,023.29	0.12
27	127073	天赐转债	34,373,233.06	0.11
28	127040	国泰转债	32,950,797.44	0.10
29	127083	山路转债	32,326,214.94	0.10
30	113623	凤 21 转债	30,762,148.77	0.10
31	127051	博杰转债	30,454,639.88	0.10
32	123122	富瀚转债	30,194,043.05	0.09
33	128109	楚江转债	29,198,909.24	0.09
34	128125	华阳转债	27,983,607.74	0.09
35	123076	强力转债	27,214,813.15	0.09
36	123104	卫宁转债	26,695,831.80	0.08
37	113584	家悦转债	26,455,061.52	0.08
38	127089	晶澳转债	25,340,599.87	0.08
39	118034	晶能转债	24,793,344.62	0.08
40	113653	永 22 转债	23,071,662.02	0.07
41	113666	爱玛转债	22,465,403.13	0.07
42	113058	友发转债	22,347,110.43	0.07
43	113624	正川转债	22,246,642.54	0.07
44	113609	永安转债	21,799,842.00	0.07
45	118005	天奈转债	21,070,738.81	0.07
46	123215	铭利转债	20,538,426.03	0.06
47	128116	瑞达转债	19,985,629.95	0.06

48	128074	游族转债	19,913,650.21	0.06
49	110086	精工转债	19,032,660.17	0.06
50	127031	洋丰转债	18,603,474.93	0.06
51	127044	蒙娜转债	18,491,715.99	0.06
52	123132	回盛转债	18,371,730.97	0.06
53	127043	川恒转债	18,341,282.71	0.06
54	123180	浙矿转债	18,161,608.41	0.06
55	128117	道恩转债	17,595,895.98	0.06
56	127068	顺博转债	16,982,463.96	0.05
57	123126	瑞丰转债	16,231,892.86	0.05
58	113644	艾迪转债	16,164,963.88	0.05
59	127086	恒邦转债	16,119,676.52	0.05
60	118035	国力转债	16,012,203.36	0.05
61	123216	科顺转债	16,008,317.33	0.05
62	118042	奥维转债	15,602,740.97	0.05
63	123142	申昊转债	15,389,442.35	0.05
64	110095	双良转债	15,082,263.34	0.05
65	127076	中宠转 2	14,949,144.37	0.05
66	113068	金铜转债	14,765,801.13	0.05
67	128134	鸿路转债	14,698,271.71	0.05
68	128105	长集转债	14,689,322.50	0.05
69	113606	荣泰转债	14,246,441.44	0.04
70	123119	康泰转 2	13,643,151.73	0.04
71	113632	鹤 21 转债	13,580,054.81	0.04
72	118013	道通转债	13,249,754.18	0.04
73	113647	禾丰转债	13,141,968.55	0.04
74	113545	金能转债	13,124,452.83	0.04
75	118027	宏图转债	12,585,154.90	0.04
76	127039	北港转债	12,524,123.55	0.04
77	123107	温氏转债	12,176,062.08	0.04
78	123109	昌红转债	11,421,843.08	0.04
79	128097	奥佳转债	11,004,910.57	0.03
80	128142	新乳转债	10,610,861.87	0.03
81	123193	海能转债	10,592,851.89	0.03
82	113061	拓普转债	10,440,729.10	0.03
83	113618	美诺转债	10,406,238.07	0.03
84	110093	神马转债	10,392,883.16	0.03
85	123103	震安转债	10,135,747.04	0.03
86	113643	风语转债	9,819,176.44	0.03
87	123172	漱玉转债	9,736,149.15	0.03
88	118041	星球转债	9,549,091.41	0.03
89	127056	中特转债	9,278,469.18	0.03
90	127091	科数转债	9,203,591.49	0.03

91	128071	合兴转债	9,190,065.81	0.03
92	127042	嘉美转债	9,163,115.80	0.03
93	123151	康医转债	8,552,550.00	0.03
94	123208	孩王转债	8,430,884.82	0.03
95	113569	科达转债	8,304,484.38	0.03
96	123169	正海转债	8,156,902.56	0.03
97	123154	火星转债	7,699,600.70	0.02
98	118030	睿创转债	7,652,313.07	0.02
99	123091	长海转债	7,359,686.83	0.02
100	128138	侨银转债	7,295,778.55	0.02
101	113625	江山转债	7,255,363.27	0.02
102	123190	道氏转 02	7,192,261.50	0.02
103	113675	新 23 转债	7,001,196.35	0.02
104	123165	回天转债	6,983,318.69	0.02
105	127066	科利转债	6,796,124.81	0.02
106	118015	芯海转债	6,780,109.59	0.02
107	113657	再 22 转债	6,179,555.42	0.02
108	128081	海亮转债	6,121,899.25	0.02
109	127070	大中转债	6,031,215.32	0.02
110	127052	西子转债	5,986,364.64	0.02
111	118043	福立转债	5,929,970.32	0.02
112	128108	蓝帆转债	5,715,246.15	0.02
113	127082	亚科转债	5,677,710.48	0.02
114	127055	精装转债	5,399,636.99	0.02
115	127062	垒知转债	5,328,720.02	0.02
116	123056	雪榕转债	5,307,186.85	0.02
117	113633	科沃转债	5,182,559.53	0.02
118	118014	高测转债	4,974,647.51	0.02
119	128132	交建转债	4,938,226.21	0.02
120	128127	文科转债	4,768,280.82	0.01
121	123155	中陆转债	4,606,897.48	0.01
122	118024	冠宇转债	4,541,867.55	0.01
123	111009	盛泰转债	4,494,192.31	0.01
124	123049	维尔转债	4,410,974.24	0.01
125	123162	东杰转债	4,384,611.82	0.01
126	113636	甬金转债	4,201,796.27	0.01
127	123179	立高转债	4,114,640.39	0.01
128	127025	冀东转债	4,013,496.48	0.01
129	123082	北陆转债	3,819,290.65	0.01
130	123145	药石转债	3,711,416.54	0.01
131	113549	白电转债	3,550,909.36	0.01
132	123133	佩蒂转债	3,373,009.11	0.01
133	110085	通 22 转债	3,206,855.86	0.01

134	127035	濮耐转债	3,206,218.68	0.01
135	128137	洁美转债	2,967,236.92	0.01
136	113659	莱克转债	2,944,329.45	0.01
137	113670	金 23 转债	2,923,384.59	0.01
138	118032	建龙转债	2,807,359.37	0.01
139	123163	金沃转债	2,678,842.25	0.01
140	128130	景兴转债	2,647,458.55	0.01
141	123130	设研转债	2,597,767.88	0.01
142	127088	赫达转债	2,530,690.05	0.01
143	123171	共同转债	2,437,907.95	0.01
144	128144	利民转债	2,301,563.10	0.01
145	123039	开润转债	2,272,915.67	0.01
146	113649	丰山转债	2,245,872.59	0.01
147	123064	万孚转债	2,217,009.04	0.01
148	127087	星帅转 2	2,212,075.08	0.01
149	127077	华宏转债	2,122,629.23	0.01
150	113628	晨丰转债	2,102,006.68	0.01
151	123183	海顺转债	1,876,884.71	0.01
152	123220	易瑞转债	1,871,154.69	0.01
153	123161	强联转债	1,849,930.00	0.01
154	118018	瑞科转债	1,826,032.07	0.01
155	127060	湘佳转债	1,728,923.76	0.01
156	118006	阿拉转债	1,691,422.85	0.01
157	123186	志特转债	1,676,616.44	0.01
158	123189	晓鸣转债	1,668,412.75	0.01
159	118010	洁特转债	1,612,164.93	0.01
160	113627	太平转债	1,546,693.39	0.00
161	127046	百润转债	1,535,396.88	0.00
162	113656	嘉诚转债	1,526,628.41	0.00
163	128119	龙大转债	1,452,119.01	0.00
164	118029	富淼转债	1,315,753.39	0.00
165	123233	凯盛转债	1,184,744.32	0.00
166	113652	伟 22 转债	1,165,049.37	0.00
167	127099	盛航转债	1,125,240.30	0.00
168	113668	鹿山转债	1,025,145.34	0.00
169	123185	能辉转债	1,019,782.52	0.00
170	123166	蒙泰转债	993,570.56	0.00
171	110076	华海转债	983,937.10	0.00
172	111004	明新转债	970,188.82	0.00
173	123146	中环转 2	934,427.40	0.00
174	123144	裕兴转债	924,075.34	0.00
175	118038	金宏转债	891,120.54	0.00
176	113640	苏利转债	799,137.95	0.00

177	123178	花园转债	747,741.24	0.00
178	113665	汇通转债	700,992.99	0.00
179	123219	宇瞳转债	648,786.43	0.00
180	113663	新化转债	592,101.21	0.00
181	123184	天阳转债	573,149.29	0.00
182	113579	健友转债	542,924.14	0.00
183	118020	芳源转债	533,402.21	0.00
184	123065	宝莱转债	495,697.41	0.00
185	111001	山玻转债	416,628.01	0.00
186	123124	晶瑞转 2	405,304.70	0.00
187	123200	海泰转债	377,749.43	0.00
188	123175	百畅转债	374,471.23	0.00
189	123115	捷捷转债	354,353.97	0.00
190	118011	银微转债	345,815.31	0.00
191	128066	亚泰转债	293,227.24	0.00
192	127081	中旗转债	289,378.77	0.00
193	118009	华锐转债	287,733.46	0.00
194	127074	麦米转 2	166,669.38	0.00
195	118033	华特转债	44,708.71	0.00
196	132026	G 三峡 EB2	14,240.22	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	易方达裕祥回报债券A	易方达裕祥回报债券C
报告期期初基金份额总额	15,882,266,343.66	208,534,574.93
报告期期间基金总申购份额	3,577,360,194.36	1,082,301,911.55
减：报告期期间基金总赎回份额	879,819,616.08	172,331,934.86
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	18,579,806,921.94	1,118,504,551.62

## § 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. 中国证监会准予易方达裕祥回报债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达裕祥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、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

二〇二四年七月十八日