易方达裕祥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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	易方达裕祥回报债券
基金主代码	002351
交易代码	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	23,709,052,820.40 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

§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)
1.本期已实现收益	942,736,903.76
2.本期利润	1,065,783,551.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0477
4.期末基金资产净值	39,228,253,703.50
5.期末基金份额净值	1.655

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

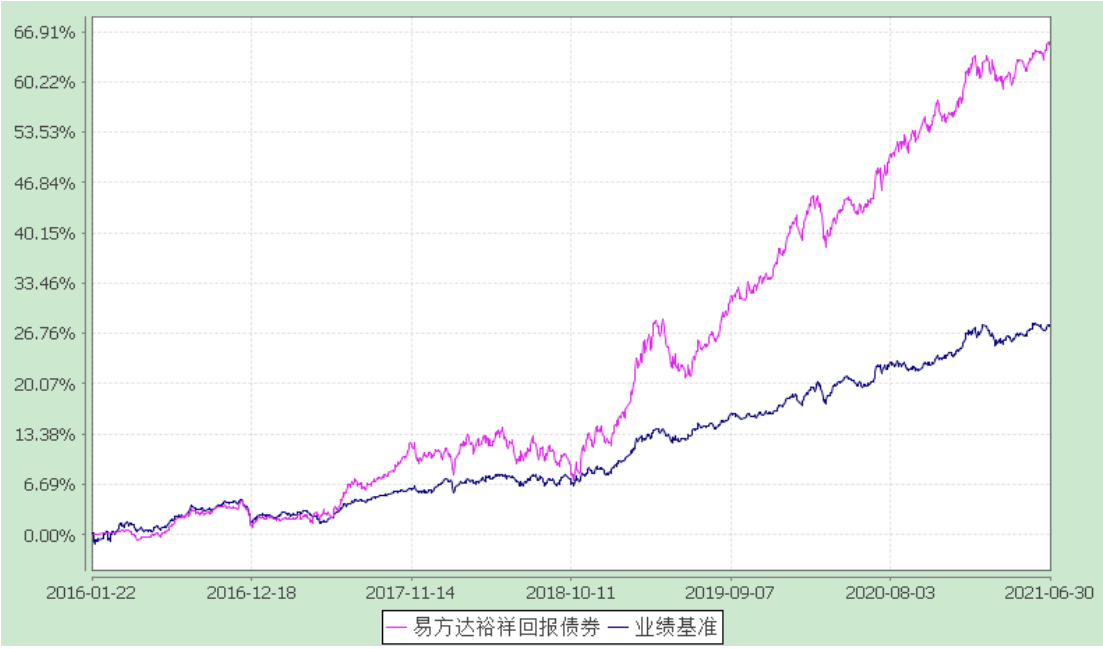
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.99%	0.23%	1.54%	0.15%	1.45%	0.08%
过去六个月	4.15%	0.31%	1.88%	0.20%	2.27%	0.11%
过去一年	13.90%	0.36%	6.06%	0.20%	7.84%	0.16%
过去三年	48.96%	0.43%	19.49%	0.20%	29.47%	0.23%
过去五年	64.19%	0.38%	25.99%	0.18%	38.20%	0.20%
自基金合同生效起至今	65.50%	0.37%	27.89%	0.18%	37.61%	0.19%

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

（2016 年 1 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 65.50%，同期业绩比较基准收益率为 27.89%。

§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		
张清华	本基金的基金经理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、	2016-01-22	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵

	易方达安心回馈混合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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、多资产投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员				活配置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投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理。
林森	本基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、固定收益全策略投资部联席总经理、投资经理	2017-07-28	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司（PIMCO）基金管理部基金经理，易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、基金经理助理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
林森	公募基金	7	64,222,221,326.79	2015-11-28
	私募资产管理计划	2	1,419,036,045.90	2018-12-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	9	65,641,257,372.69	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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

债券市场方面，二季度收益率呈现震荡下行的走势。4-5 月流动性环境相对宽松，市场担忧的地方债供给加速迟迟没有出现，同时信用市场的一级供给也弱于往年同期水平。在机构杠杆与久期水平普遍偏低的情况下，“资产荒”使得机构的配置需求较为旺盛。6 月初开始，地方债供给开始增多，资金价格上行，引发市场对流动性的担忧，同时债券在经历前期上涨后赔率有所下降，收益率小幅回调。但在央行持续表态维持流动性稳定的背景下，叠加 5 月经济数据表现偏弱，债券收益率再次下行，并持续到季末。整个季度来看，经济修复进程中内外需分化明显，内需修复高度不及预期，市场对后续基本面走势出现较大分歧，流动性成为短期债券市场的重要主导因素。流动性持续宽松推动收益率曲线陡峭化下行，1Y 和 10Y 国开债分别较一季度末下行 25bp 和 8bp，高等级信用债走势基本跟随无风险利率，而机构的配置需求推动流动性溢价品种利差持续压缩。

权益市场方面，二季度指数震荡上行，但结构分化明显。4 月流动性超预期宽松推动前期调整幅度较大的机构重仓股走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利，基本面高增长板块取得了显著的超额收益，另一方面受到需求动能放缓影响的部分行业则持续回调，市场的结构分化进一步加剧。整体上来看，市场风格从周期向成长切换，并持续至半年末，赚钱效应只在个别行业存在，其他大部分行业表现平平。

报告期内，组合权益仓位维持稳定，坚持自下而上寻找估值合理的成长股；债券保持中性久期，以性价比较高的信用债为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.655 元，本报告期份额净值增长率为 2.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

§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	7,618,493,842.16	17.59
	其中：股票	7,618,493,842.16	17.59

2	固定收益投资	34,665,569,658.06	80.03
	其中：债券	34,173,073,158.06	78.89
	资产支持证券	492,496,500.00	1.14
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	312,944,538.69	0.72
7	其他资产	718,530,732.61	1.66
8	合计	43,315,538,771.52	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	77,946,994.56	0.20
B	采矿业	94,053,349.32	0.24
C	制造业	5,738,288,807.42	14.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	170,594,938.20	0.43
F	批发和零售业	73,392.96	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	27,262,790.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	505,287,053.00	1.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	655,239,686.70	1.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	258,223,761.40	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	91,523,068.60	0.23

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	7,618,493,842.16	19.42

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	002241	歌尔股份	20,766,678	887,567,817.72	2.26
2	603444	吉比特	886,714	469,958,420.00	1.20
3	002080	中材科技	16,670,351	436,263,085.67	1.11
4	300433	蓝思科技	11,959,134	344,406,808.84	0.88
5	603416	信捷电气	4,859,254	308,416,851.38	0.79
6	000656	金科股份	48,225,688	279,226,733.52	0.71
7	601799	星宇股份	1,204,050	271,778,166.00	0.69
8	603018	华设集团	31,509,492	250,500,461.40	0.64
9	000961	中南建设	37,053,533	219,356,915.36	0.56
10	603236	移远通信	1,226,918	209,324,479.98	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	6,012,320,500.00	15.33
	其中：政策性金融债	2,005,381,500.00	5.11
4	企业债券	9,139,218,730.10	23.30
5	企业短期融资券	280,901,000.00	0.72
6	中期票据	16,324,293,500.00	41.61
7	可转债（可交换债）	2,416,339,427.96	6.16

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,173,073,158.06	87.11

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	11,800,000	1,180,708,000.00	3.01
2	1828013	18 建设银行二级 02	4,200,000	434,532,000.00	1.11
3	200302	20 进出 02	4,000,000	398,680,000.00	1.02
4	1928006	19 工商银行二级 01	3,800,000	388,208,000.00	0.99
5	1920046	19 宁波银行二级	3,200,000	329,376,000.00	0.84

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	137269	20 中交 A	750,000	75,457,500.00	0.19
2	137094	厚德 05A	400,000	40,360,000.00	0.10
3	169118	长治 01A	400,000	39,932,000.00	0.10
4	169889	蚁借 03A	300,000	30,318,000.00	0.08
5	137104	中借 04A	300,000	30,276,000.00	0.08
6	169843	益辰 02A1	200,000	20,230,000.00	0.05
7	169296	智禾 05A	200,000	20,196,000.00	0.05
8	169306	兴辰 01A	200,000	20,094,000.00	0.05
9	168022	兆玺 01 优	200,000	19,924,000.00	0.05
10	168483	健弘 02A	200,000	19,816,000.00	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 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款合计 3920 万元”的行政处罚决定：（一)内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保。

2020 年 11 月 6 日，中国人民银行衡水市中心支行对中国工商银行股份有限公司违反反洗钱法的行为，处以 21 万元罚款，对高管及直接责任人各处 1 万元罚款，共计 23 万元。2020 年 11 月 10 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对工商银行“违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务”的行为处 100 万元人民币罚款,并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 12 月 25 日,中国银保监会对工商银行的如下违法违规行为罚款 5470 万：一、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；二、关键岗位未进行实质性轮岗；三、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；四、为同业投资业务提供隐性担保；五、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；六、非标准化债权资产限额测算不准确；七、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；八、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；九、为违规的政府购买服务项目提供融资；十、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；十一、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；十二、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；十三、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；十四、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；十五、全权委托业务不规范；十六、用其他资金支付结构性存款收益；十七、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；十八、

理财资金承接本行自营贷款；十九、封闭式理财产品相互交易调节收益；二十、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；二十一、高净值客户认定不审慎；二十二、理财产品信息披露不到位；二十三、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记。

2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。2021 年 6 月 10 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚：代理销售保险不规范。

本基金投资 18 建设银行二级 02、19 工商银行二级 01、19 宁波银行二级的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 建设银行二级 02、19 工商银行二级 01、19 宁波银行二级外，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	2,667,814.65
2	应收证券清算款	62,960,324.04
3	应收股利	-
4	应收利息	551,258,935.30
5	应收申购款	101,643,658.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	718,530,732.61

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	127018	本钢转债	264,889,842.48	0.68
2	110072	广汇转债	191,761,565.00	0.49
3	113044	大秦转债	144,013,283.10	0.37
4	113011	光大转债	112,813,014.80	0.29
5	110047	山鹰转债	61,777,931.70	0.16
6	113033	利群转债	60,785,328.00	0.15
7	123079	运达转债	58,434,922.24	0.15
8	127016	鲁泰转债	54,242,700.00	0.14
9	128141	旺能转债	51,484,414.80	0.13
10	127012	招路转债	46,650,630.95	0.12
11	110045	海澜转债	41,180,307.00	0.10
12	113591	胜达转债	40,515,761.00	0.10
13	128107	交科转债	37,275,161.60	0.10
14	110052	贵广转债	36,349,571.50	0.09
15	128129	青农转债	36,315,302.40	0.09
16	113014	林洋转债	36,217,524.00	0.09
17	128081	海亮转债	35,159,132.00	0.09
18	128121	宏川转债	31,047,537.78	0.08
19	110053	苏银转债	30,477,136.80	0.08
20	110068	龙净转债	30,145,705.60	0.08
21	113037	紫银转债	29,792,400.90	0.08
22	123081	精研转债	29,611,412.44	0.08
23	132015	18 中油 EB	27,800,752.50	0.07
24	113009	广汽转债	24,971,577.30	0.06
25	132017	19 新钢 EB	24,403,545.00	0.06
26	113519	长久转债	23,774,818.40	0.06
27	113040	星宇转债	22,568,031.00	0.06
28	128125	华阳转债	20,934,762.80	0.05
29	123071	天能转债	20,306,562.90	0.05
30	123004	铁汉转债	17,715,624.66	0.05
31	113024	核建转债	17,177,046.10	0.04
32	128132	交建转债	16,835,979.60	0.04
33	123028	清水转债	15,912,827.04	0.04
34	113021	中信转债	15,789,049.20	0.04

35	113600	新星转债	14,833,500.00	0.04
36	113530	大丰转债	14,641,317.60	0.04
37	110048	福能转债	13,805,493.00	0.04
38	113606	荣泰转债	13,772,000.00	0.04
39	128120	联诚转债	13,447,713.60	0.03
40	128083	新北转债	13,317,872.68	0.03
41	127019	国城转债	13,227,161.44	0.03
42	113584	家悦转债	12,941,258.70	0.03
43	113017	吉视转债	12,676,933.20	0.03
44	113508	新凤转债	12,431,903.70	0.03
45	113601	塞力转债	12,176,400.00	0.03
46	128138	侨银转债	11,787,090.00	0.03
47	132014	18 中化 EB	11,578,062.30	0.03
48	123044	红相转债	11,513,700.00	0.03
49	113570	百达转债	11,433,792.00	0.03
50	113604	多伦转债	10,783,915.00	0.03
51	128013	洪涛转债	10,745,876.40	0.03
52	123049	维尔转债	10,708,987.96	0.03
53	123075	贝斯转债	10,435,870.08	0.03
54	123053	宝通转债	10,410,513.00	0.03
55	113525	台华转债	9,925,200.00	0.03
56	123083	朗新转债	9,815,224.21	0.03
57	128127	文科转债	9,811,939.06	0.03
58	113599	嘉友转债	9,572,035.50	0.02
59	123063	大禹转债	8,349,642.00	0.02
60	128023	亚太转债	7,900,674.18	0.02
61	113577	春秋转债	7,891,940.10	0.02
62	113603	东缆转债	7,795,774.40	0.02
63	132018	G 三峡 EB1	7,105,098.00	0.02
64	123059	银信转债	7,052,935.52	0.02
65	128063	未来转债	6,330,126.22	0.02
66	113528	长城转债	5,919,478.80	0.02
67	127011	中鼎转 2	5,741,672.50	0.01
68	128072	翔鹭转债	5,600,136.60	0.01
69	113612	永冠转债	5,574,569.60	0.01
70	113569	科达转债	4,956,700.00	0.01
71	113596	城地转债	4,750,737.60	0.01
72	128130	景兴转债	4,580,145.00	0.01
73	128140	润建转债	4,413,958.56	0.01
74	113549	白电转债	4,213,600.00	0.01
75	127014	北方转债	4,195,868.60	0.01
76	128044	岭南转债	3,858,500.16	0.01
77	123091	长海转债	3,755,416.96	0.01

78	113602	景 20 转债	3,164,032.80	0.01
79	127013	创维转债	3,157,500.00	0.01
80	113567	君禾转债	3,102,556.80	0.01
81	128117	道恩转债	3,040,800.00	0.01
82	113535	大业转债	2,993,640.00	0.01
83	128015	久其转债	2,839,585.50	0.01
84	123052	飞鹿转债	2,691,360.00	0.01
85	110062	烽火转债	2,595,583.80	0.01
86	110051	中天转债	2,296,600.00	0.01
87	123039	开润转债	2,211,536.94	0.01
88	123056	雪榕转债	2,068,800.00	0.01
89	128037	岩土转债	1,533,240.96	0.00
90	113568	新春转债	1,491,828.00	0.00
91	132011	17 浙报 EB	1,439,160.00	0.00
92	128105	长集转债	1,293,687.94	0.00
93	113614	健 20 转债	977,492.10	0.00
94	123023	迪森转债	824,352.45	0.00
95	128136	立讯转债	78,005.65	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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300433	蓝思科技	339,504,779.45	0.87	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	21,242,150,122.77
报告期期间基金总申购份额	5,564,665,808.27
减：报告期期间基金总赎回份额	3,097,763,110.64
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	23,709,052,820.40

§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

二〇二一年七月二十日