

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：二〇二三年四月二十一日

§ 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 2023 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 月 31 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	18,160,625,237.69 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	18,157,346,464.91 份	3,278,772.78 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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 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	154,981,349.29	2,210.15
2.本期利润	666,865,884.29	2,533.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0369	0.0034
4.期末基金资产净值	28,039,015,740.07	5,064,867.71
5.期末基金份额净值	1.544	1.545

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.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。

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	2.46%	0.17%	1.47%	0.13%	0.99%	0.04%
过去六个月	1.19%	0.22%	1.79%	0.16%	-0.60%	0.06%
过去一年	2.52%	0.28%	2.37%	0.17%	0.15%	0.11%
过去三年	22.45%	0.32%	10.28%	0.18%	12.17%	0.14%
过去五年	52.14%	0.39%	22.21%	0.19%	29.93%	0.20%
自基金合同生效起至今	71.31%	0.35%	30.76%	0.18%	40.55%	0.17%

易方达裕祥回报债券 C

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

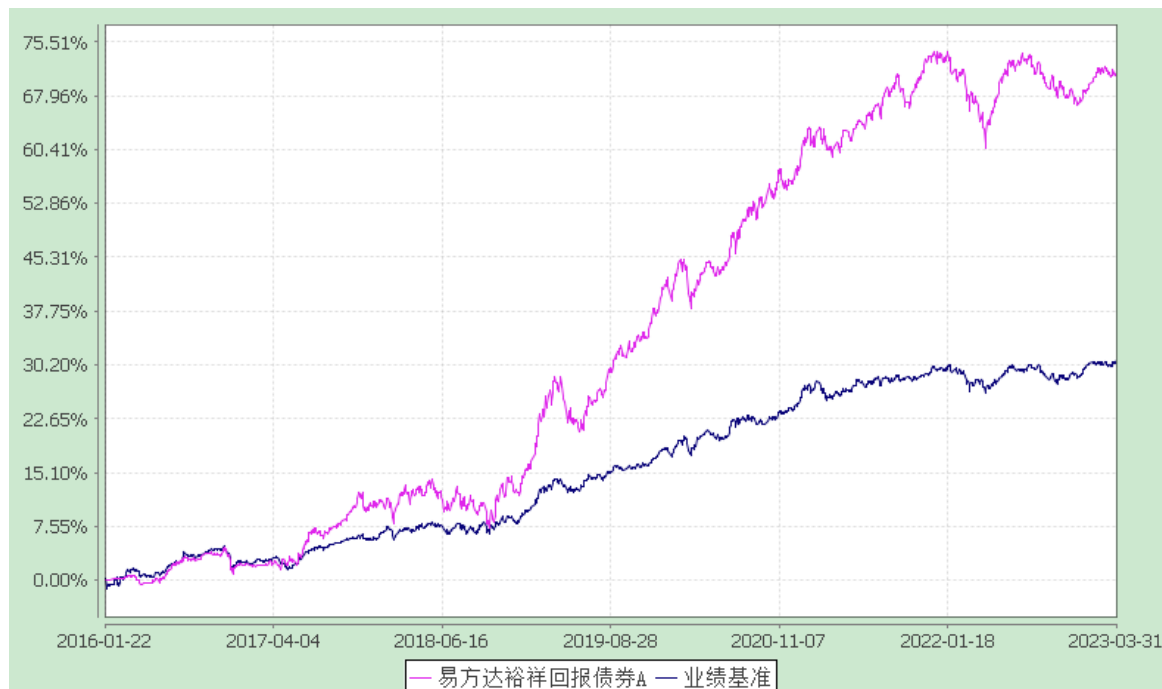
	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合 同生效起 至今	0.00%	0.17%	0.34%	0.10%	-0.34%	0.07%

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

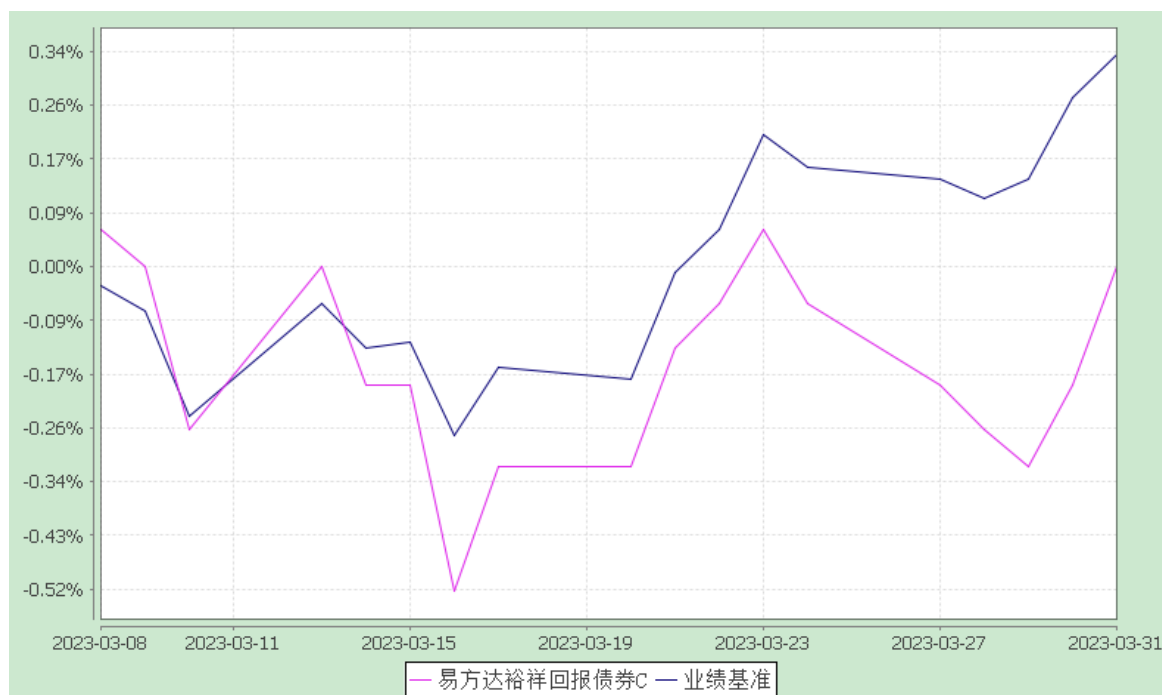
易方达裕祥回报债券 A

(2016 年 1 月 22 日至 2023 年 3 月 31 日)



易方达裕祥回报债券 C

(2023 年 3 月 8 日至 2023 年 3 月 31 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 71.31%，同期业绩比较基准收益率为 30.76%；C 类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

§ 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		
林虎	本基金的基金经理，易方达安心回馈混合（自 2021 年 09 月 08 日至 2023 年 03 月 03 日）、易方达磐泰一年持有混合的基金经理	2021-09-08	2023-03-04	11 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师，易方达基金管理有限公司基金经理助理。
王晓	本基金的基金经理，易方达增强回报债券、易方达	2022-04-30	-	20 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理

晨	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、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式的基金经理，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）				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。
---	---	--	--	--	---

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，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，其中 6 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，2 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

一季度随着疫情防控较快平稳转段，政策稳增长见效，国内经济运行整体呈现企稳回升态势，市场预期加快好转。生产方面，伴随人流物流加快畅通，工业生产全面修复，1-2 月规模以上工业增加值同比增长 2.4%，比 2022 年 12 月加快 1.1 个百分点。需求方面，投资明显回升，1-2 月固定资产投资环比上行；消费改善，社会消费品零售总额环比显著回升。3 月以来，尽管经济高频数据有所分化，但经济回升的方向仍然是确定的。

债券市场方面，一季度无风险利率窄幅震荡，信用利差整体呈波动下行趋势。1 月资金面边际收紧，经济复苏预期升温，债市利率上行。2 月经济基本面待验证复苏高度，资金面波动较大，长端利率维持窄幅震荡，短端利率上行。3 月以来，央行积极通过公开市场操作和降准稳定资金预期，市场对于经济修复斜率产生分歧，债券利率整体下行。全季来看，10 年国开债收益率运行在 2.93-3.09% 之间，一季度末收于 3.02%，较上年四季度末上行 3BP。信用债方面，一季度配置需求恢复，信用利差整体波动下行，3 年 AAA 中短期票据收益率从季内高点下行 20BP 左右。

股票市场方面，一季度市场整体呈现震荡上行走势，从走势节奏上看，1 月市场快速冲高、2-3 月市场震荡整理，两市成交额较上年四季度小幅上升。行业板块方面，计算机、传媒、通信、电子、建筑装饰等板块涨幅靠前，房地产、商贸零售、银行、美容护理、综合等板块跌幅靠前。

转债市场方面，一季度走势整体先回升后震荡调整。1 月转债随正股上涨出现连

续上涨和估值扩张，2 月进入区间震荡，估值整体压缩，偏债型品种估值回落幅度相对较大。3 月权益震荡上涨，转债整体延续低波动态势。

报告期内，随着疫后经济复苏前景向好，稳经济政策的效果持续显现，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，组合维持中性久期和仓位，券种配置方面以中短期限的中高等级信用债为主，结合相对价值变化不断优化券种结构。股票方面，国内经济处于复苏通道，流动性环境维持适度宽松，组合保持了较高的权益风险敞口，并且坚持自下而上精选个股，对组合净值有较大的正贡献。转债方面，组合小幅增加可转债仓位。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 1.544 元，本报告期份额净值增长率为 2.46%，同期业绩比较基准收益率为 1.47%；C 类基金份额净值为 1.545 元，本报告期份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

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	5,485,316,029.30	15.85
	其中：股票	5,485,316,029.30	15.85
2	固定收益投资	28,867,359,889.46	83.39
	其中：债券	28,613,526,398.90	82.66
	资产支持证券	253,833,490.56	0.73
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	249,770,522.52	0.72
7	其他资产	14,123,412.97	0.04
8	合计	34,616,569,854.25	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	314,061,348.32	1.12
C	制造业	3,612,202,438.61	12.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	122,823,797.44	0.44
F	批发和零售业	7,135,611.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	368,454,616.08	1.31
H	住宿和餐饮业	2,692,548.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	298,087,880.14	1.06
J	金融业	421,983,607.44	1.50
K	房地产业	140,513,848.02	0.50
L	租赁和商务服务业	157,818,224.25	0.56
M	科学研究和技术服务业	14,375,349.00	0.05
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	6,546,761.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,620,000.00	0.07
S	综合	-	-

合计	5,485,316,029.30	19.56
----	------------------	-------

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	600219	南山铝业	106,332,064	360,465,696.96	1.29
2	601799	星宇股份	2,636,598	316,128,100.20	1.13
3	601088	中国神华	7,500,000	211,275,000.00	0.75
4	600660	福耀玻璃	5,822,147	202,377,829.72	0.72
5	601111	中国国航	17,289,034	180,109,982.62	0.64
6	300124	汇川技术	2,403,074	168,936,102.20	0.60
7	600690	海尔智家	7,441,372	168,770,316.96	0.60
8	600057	厦门象屿	14,434,851	155,174,648.25	0.55
9	000069	华侨城 A	29,091,894	140,513,848.02	0.50
10	601166	兴业银行	7,859,682	132,750,028.98	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	17,165,412,622.40	61.21
	其中：政策性金融债	1,774,264,230.14	6.33
4	企业债券	3,339,188,489.14	11.91
5	企业短期融资券	150,852,459.28	0.54
6	中期票据	5,104,486,971.77	18.20
7	可转债（可交换债）	2,853,585,856.31	10.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,613,526,398.90	102.03

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	2228004	22 工商银行二级 01	10,200,000	1,021,126,303.56	3.64
2	2128039	21 中国银行二级 03	9,400,000	958,923,101.37	3.42
3	220211	22 国开 11	8,200,000	828,425,331.51	2.95
4	220206	22 国开 06	8,000,000	812,234,301.37	2.90
5	2128042	21 兴业银行二级 02	7,600,000	772,066,134.79	2.75

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	91,022,863.56	0.32
2	135519	荟臻 022A	500,000	49,794,183.56	0.18
3	112561	22 和闽优	200,000	21,012,306.85	0.07
4	189329	21 工鑫 5A	200,000	20,592,400.00	0.07
5	189951	21 十局优	200,000	20,470,942.47	0.07
6	180204	22 葛洲优	200,000	20,261,623.01	0.07
7	193732	至通 02A2	180,000	18,277,123.07	0.07
8	156659	PR 产 1A	100,000	10,022,998.14	0.04
9	169304	20 曹操 A3	100,000	2,379,049.90	0.01

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，兴业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中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	1,348,756.63
2	应收证券清算款	10,731,808.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,042,847.93
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,123,412.97

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	217,957,665.21	0.78
2	110072	广汇转债	177,037,924.91	0.63
3	110079	杭银转债	117,937,996.62	0.42
4	127018	本钢转债	91,860,620.46	0.33
5	113044	大秦转债	81,402,787.09	0.29
6	127049	希望转 2	76,850,339.71	0.27
7	113641	华友转债	75,047,124.56	0.27
8	110081	闻泰转债	65,985,957.69	0.24
9	110047	山鹰转债	64,418,015.32	0.23
10	123149	通裕转债	60,238,309.43	0.21
11	127067	恒逸转 2	57,607,699.76	0.21
12	127016	鲁泰转债	57,102,112.45	0.20
13	128023	亚太转债	55,748,477.60	0.20
14	113033	利群转债	55,168,581.60	0.20

15	127061	美锦转债	52,937,454.31	0.19
16	110087	天业转债	44,815,527.77	0.16
17	128129	青农转债	44,690,209.61	0.16
18	127045	牧原转债	42,527,151.83	0.15
19	113059	福莱转债	41,290,708.84	0.15
20	113013	国君转债	40,522,938.44	0.14
21	110045	海澜转债	40,155,635.64	0.14
22	128142	新乳转债	36,948,709.21	0.13
23	110089	兴发转债	36,516,595.87	0.13
24	128109	楚江转债	34,184,638.96	0.12
25	123113	仙乐转债	33,414,065.84	0.12
26	123099	普利转债	30,931,616.13	0.11
27	127040	国泰转债	28,659,166.80	0.10
28	113623	凤 21 转债	27,789,314.47	0.10
29	113651	松霖转债	27,336,592.04	0.10
30	113653	永 22 转债	25,706,588.74	0.09
31	113052	兴业转债	25,338,321.92	0.09
32	110086	精工转债	24,619,195.83	0.09
33	113542	好客转债	22,639,125.60	0.08
34	113609	永安转债	22,623,344.46	0.08
35	113060	浙 22 转债	22,308,400.98	0.08
36	113048	晶科转债	22,301,755.19	0.08
37	110080	东湖转债	21,842,373.07	0.08
38	127073	天赐转债	20,931,940.30	0.07
39	113631	皖天转债	20,792,692.65	0.07
40	127068	顺博转债	19,804,311.60	0.07
41	123132	回盛转债	19,422,116.69	0.07
42	127044	蒙娜转债	19,117,692.23	0.07
43	127031	洋丰转债	17,497,444.09	0.06
44	110053	苏银转债	17,152,334.08	0.06
45	127025	冀东转债	16,834,379.80	0.06
46	113649	丰山转债	15,205,754.15	0.05
47	113545	金能转债	15,068,020.68	0.05
48	113644	艾迪转债	14,850,334.43	0.05
49	113058	友发转债	14,676,722.67	0.05
50	127019	国城转债	14,662,094.91	0.05
51	123119	康泰转 2	14,587,537.98	0.05
52	128083	新北转债	13,834,877.30	0.05
53	128138	侨银转债	13,436,126.95	0.05
54	128105	长集转债	12,817,972.12	0.05
55	128108	蓝帆转债	12,748,626.49	0.05
56	113606	荣泰转债	12,533,987.67	0.04
57	128134	鸿路转债	11,174,599.93	0.04

58	113519	长久转债	10,944,077.94	0.04
59	123044	红相转债	10,342,961.08	0.04
60	123150	九强转债	9,889,081.90	0.04
61	127039	北港转债	9,852,341.38	0.04
62	123151	康医转债	9,812,209.25	0.03
63	113056	重银转债	9,732,789.04	0.03
64	113596	城地转债	9,596,014.17	0.03
65	127056	中特转债	9,529,836.12	0.03
66	113037	紫银转债	9,459,977.65	0.03
67	123049	维尔转债	9,347,447.39	0.03
68	123004	铁汉转债	8,532,265.49	0.03
69	132018	G 三峡 EB1	8,078,188.42	0.03
70	113045	环旭转债	8,010,638.15	0.03
71	127054	双箭转债	7,412,319.86	0.03
72	113584	家悦转债	7,059,787.19	0.03
73	113656	嘉诚转债	6,980,957.94	0.02
74	128125	华阳转债	6,809,145.89	0.02
75	110088	淮 22 转债	6,724,140.99	0.02
76	110077	洪城转债	6,323,179.45	0.02
77	118005	天奈转债	6,260,113.16	0.02
78	118011	银微转债	6,126,879.45	0.02
79	123142	申昊转债	6,048,541.21	0.02
80	127052	西子转债	5,915,869.86	0.02
81	127055	精装转债	5,892,582.19	0.02
82	128097	奥佳转债	5,853,706.44	0.02
83	123155	中陆转债	5,723,169.86	0.02
84	128127	文科转债	5,516,047.95	0.02
85	110084	贵燃转债	5,165,913.93	0.02
86	128063	未来转债	5,128,173.83	0.02
87	123152	润禾转债	5,101,854.98	0.02
88	113054	绿动转债	5,070,473.82	0.02
89	127047	帝欧转债	4,940,157.53	0.02
90	123071	天能转债	4,619,136.51	0.02
91	118013	道通转债	4,523,074.17	0.02
92	123154	火星转债	4,376,984.52	0.02
93	113636	甬金转债	2,399,389.04	0.01
94	127042	嘉美转债	2,334,853.67	0.01
95	123056	雪榕转债	2,199,917.81	0.01
96	128119	龙大转债	1,842,576.22	0.01
97	113505	杭电转债	1,737,335.18	0.01
98	123109	昌红转债	1,089,960.00	0.00
99	127032	苏行转债	16,398.25	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	601111	中国国航	132,603,341.52	0.47	非公开发行流通受限

§ 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	18,544,662,162.99	-
报告期期间基金总申购份额	1,407,226,298.75	3,278,774.08
减：报告期期间基金总赎回份额	1,794,541,996.83	1.30
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	18,157,346,464.91	3,278,772.78

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2023 年 3 月 7 日起增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 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

二〇二三年四月二十一日