

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 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：二〇二三年七月二十日

§ 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 2023 年 7 月 18 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 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	18,267,648,377.55 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	18,222,228,226.32 份	45,420,151.23 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 4 月 1 日-2023 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	217,510,756.36	344,340.60
2.本期利润	107,902,186.17	-128,857.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060	-0.0036
4.期末基金资产净值	28,249,296,319.60	70,381,407.25
5.期末基金份额净值	1.550	1.550

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	0.39%	0.19%	0.57%	0.12%	-0.18%	0.07%
过去六个月	2.85%	0.18%	2.05%	0.12%	0.80%	0.06%
过去一年	-0.36%	0.21%	1.09%	0.14%	-1.45%	0.07%
过去三年	18.36%	0.31%	9.06%	0.18%	9.30%	0.13%
过去五年	54.79%	0.38%	22.87%	0.19%	31.92%	0.19%
自基金合同生效起至今	71.98%	0.35%	31.50%	0.18%	40.48%	0.17%

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

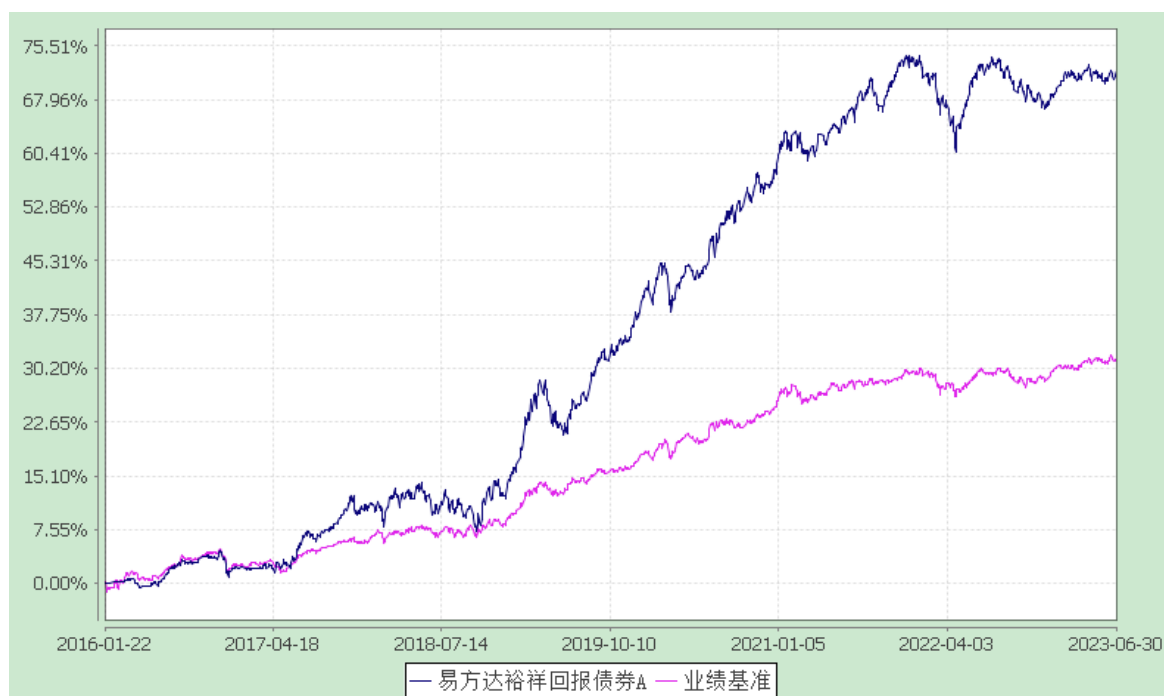
过去三个月	0.32%	0.18%	0.57%	0.12%	-0.25%	0.06%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.32%	0.18%	0.91%	0.12%	-0.59%	0.06%

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

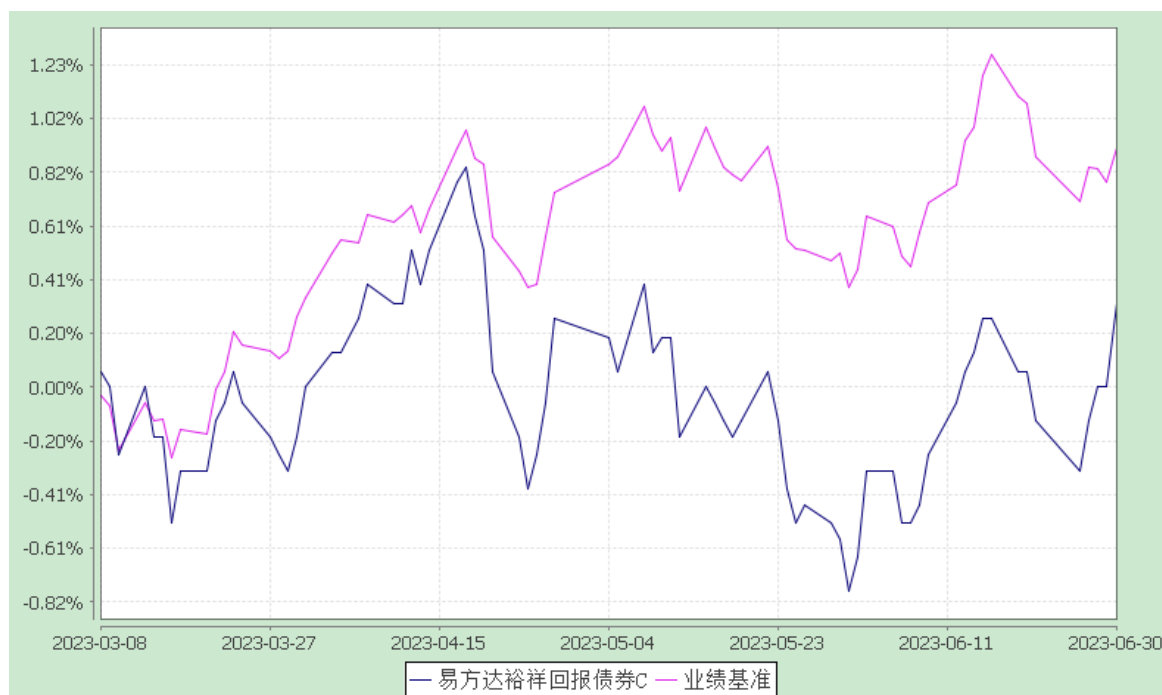
易方达裕祥回报债券 A

(2016 年 1 月 22 日至 2023 年 6 月 30 日)



易方达裕祥回报债券 C

(2023 年 3 月 8 日至 2023 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 71.98%，同期业绩比较基准收益率为 31.50%；C 类基金份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

§ 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、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	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

	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）			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 15 次，其中 14 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，1 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

二季度经济延续恢复态势，但恢复速度有所放缓。生产方面，4 月全国规模以上工业增加值同比增长 5.6%，环比下降 0.47%，环比增速处于历史同期较低水平，5 月低位恢复。需求方面，投资增速放缓，4、5 月全国固定资产投资累计增速连续下行，社会消费品零售增速修复偏慢，出口增速转而回落；6 月制造业 PMI（采购经理指数）小幅回升，制造业景气水平总体有所改善。价格方面，受多重因素影响，1-5 月 CPI（消费者物价指数）同比涨幅总体回落，PPI（生产价格指数）同比增速逐月走低，反映国内市场需求不足，企业经营压力加大。

政策方面，全国两会 2023 年 GDP（国内生产总值）增长目标为 5% 左右，强调实现“质”的有效提升和“量”的合理增长。财政政策适当加力、注重提效，赤字率小幅上调至 3%，地方政府专项债规模扩大至 3.8 万亿元；货币政策强调精准有力，3 月下旬央行宣布全面降准 0.25 个百分点，6 月中旬下调政策利率 10bp，整体平稳宽松。

在前述经济和政策组合下，债券市场二季度收益率整体下行。资金方面，R007（银行间市场 7 天回购利率）月度中枢二季度转而下行，银行间流动性较为充裕。现券方面，3 月以来，随着经济恢复速度边际放缓，债券收益率整体呈下行走势。6 月末 10 年国开收益率收于 2.77%，较一季度末下行 25bp，10 年国债收益率收于 2.64%，较一季度末下行 22bp；二季度配置需求持续，信用利差整体波动下行，3 年 AAA 中短票收益率较一季度末下行 29BP 左右。

股票方面，二季度股票市场振荡下跌，沪深 300 指数下跌 5.15%，创业板指数下跌 7.69%。行业表现明显分化，TMT（数字新媒体）、家电等行业涨幅靠前，商贸零售、食品饮料、建筑材料等行业领跌。

转债方面，4 月中旬以来，转债估值经历了压缩、修复和震荡三个阶段，二季度

整体延续估值高位震荡的特征，中证转债指数表现相对权益指数较好，小幅下跌 0.15%。

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，二季度组合提升有效久期至中性偏高水平，券种配置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，组合小幅降低了权益风险敞口，行业均衡配置，并且坚持自下而上精选个股，权益市场波动对组合净值拖累有限。转债方面，组合维持可转债仓位。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 1.550 元，本报告期份额净值增长率为 0.39%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%；C 类基金份额净值为 1.550 元，本报告期份额净值增长率为 0.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

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	5,482,866,246.38	17.44
	其中：股票	5,482,866,246.38	17.44
2	固定收益投资	25,744,842,826.00	81.91
	其中：债券	25,500,714,570.17	81.13
	资产支持证券	244,128,255.83	0.78
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	195,327,204.13	0.62
7	其他资产	7,829,096.06	0.02
8	合计	31,430,865,372.57	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	391,018,730.08	1.38
C	制造业	3,508,639,750.05	12.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	142,487,805.00	0.50
E	建筑业	109,588,474.44	0.39
F	批发和零售业	62,931,771.06	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	345,471,506.37	1.22
H	住宿和餐饮业	1,812,152.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,338,624.26	0.68
J	金融业	398,643,250.00	1.41
K	房地产业	180,124,333.60	0.64
L	租赁和商务服务业	128,203,691.70	0.45
M	科学研究和技术服务业	17,498,018.82	0.06
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	4,550,211.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	557,928.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,482,866,246.38	19.36

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	601799	星宇股份	2,636,598	325,883,512.80	1.15
2	600219	南山铝业	106,332,064	321,122,833.28	1.13
3	601088	中国神华	7,500,000	230,625,000.00	0.81
4	600660	福耀玻璃	5,822,147	208,723,969.95	0.74
5	600690	海尔智家	7,441,372	174,723,414.56	0.62
6	300124	汇川技术	2,403,074	154,301,381.54	0.54
7	601111	中国国航	17,289,034	140,791,249.23	0.50
8	600760	中航沈飞	2,879,729	129,587,805.00	0.46
9	000069	华侨城 A	29,091,894	128,004,333.60	0.45
10	600057	厦门象屿	14,434,851	125,583,203.70	0.44

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	16,039,817,177.77	56.64
	其中：政策性金融债	2,140,547,870.23	7.56
4	企业债券	2,452,302,740.20	8.66
5	企业短期融资券	160,135,805.93	0.57
6	中期票据	3,803,354,998.38	13.43
7	可转债（可交换债）	3,045,103,847.89	10.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,500,714,570.17	90.05

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	190203	19 国开 03	12,700,000	1,296,113,287.67	4.58
2	2128039	21 中国银行二级 03	9,500,000	988,295,671.23	3.49
3	2228004	22 工商银行二级 01	9,200,000	940,098,546.85	3.32
4	2128042	21 兴业银行二级 02	7,600,000	788,041,459.73	2.78
5	2228003	22 兴业银行二级 01	7,400,000	758,576,635.62	2.68

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	92,016,498.08	0.32
2	135519	荟臻 022A	500,000	49,951,290.41	0.18
3	112561	22 和闽优	200,000	20,959,824.66	0.07
4	189951	21 十局优	200,000	20,676,547.95	0.07
5	189329	21 工鑫 5A	200,000	20,209,200.00	0.07
6	180204	22 葛洲优	200,000	20,012,071.23	0.07
7	183144	21 水八 04	100,000	10,241,550.69	0.04
8	156659	PR 产 1A	100,000	10,061,272.81	0.04

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，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外汇管理局上海市分局的处罚。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、中国银行保险监督管理委员会

海监管局的处罚。中国工商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上海监管局的处罚。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、中国银行保险监督管理委员会重庆监管局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

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	1,372,836.27
2	应收证券清算款	5,699,475.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	756,784.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,829,096.06

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	215,149,071.13	0.76
2	110072	广汇转债	169,765,636.63	0.60
3	110079	杭银转债	119,034,589.95	0.42
4	127018	本钢转债	92,315,588.81	0.33
5	113065	齐鲁转债	85,071,468.09	0.30
6	127049	希望转 2	84,222,453.58	0.30
7	113044	大秦转债	83,276,758.06	0.29
8	113641	华友转债	71,475,541.43	0.25
9	110081	闻泰转债	64,893,952.44	0.23
10	113059	福莱转债	63,274,891.02	0.22

11	123149	通裕转债	61,355,798.87	0.22
12	110047	山鹰转债	60,981,127.63	0.22
13	127067	恒逸转 2	60,447,845.63	0.21
14	113054	绿动转债	59,632,081.46	0.21
15	127045	牧原转债	56,091,438.85	0.20
16	128023	亚太转债	55,523,957.25	0.20
17	127016	鲁泰转债	55,388,313.43	0.20
18	113033	利群转债	53,945,284.91	0.19
19	118024	冠宇转债	51,856,697.08	0.18
20	110087	天业转债	48,642,485.32	0.17
21	127061	美锦转债	45,986,136.75	0.16
22	128129	青农转债	45,302,735.09	0.16
23	110045	海澜转债	42,096,309.26	0.15
24	113013	国君转债	40,681,556.44	0.14
25	110089	兴发转债	34,069,683.58	0.12
26	128109	楚江转债	33,471,237.87	0.12
27	113060	浙 22 转债	32,835,627.82	0.12
28	123113	仙乐转债	32,544,885.00	0.11
29	123099	普利转债	30,057,377.88	0.11
30	127040	国泰转债	28,619,788.13	0.10
31	113623	凤 21 转债	27,563,209.56	0.10
32	113056	重银转债	26,665,375.25	0.09
33	113651	松霖转债	26,386,847.11	0.09
34	113052	兴业转债	25,428,267.12	0.09
35	110086	精工转债	24,331,041.48	0.09
36	110080	东湖转债	23,576,210.42	0.08
37	113542	好客转债	22,678,819.80	0.08
38	113653	永 22 转债	22,548,815.32	0.08
39	113048	晶科转债	22,102,297.64	0.08
40	113609	永安转债	21,398,875.40	0.08
41	127073	天赐转债	21,271,232.67	0.08
42	113631	皖天转债	21,082,240.06	0.07
43	127068	顺博转债	20,525,721.20	0.07
44	123049	维尔转债	19,621,532.73	0.07
45	123132	回盛转债	18,823,872.02	0.07
46	127044	蒙娜转债	17,957,284.50	0.06
47	113062	常银转债	17,736,329.67	0.06
48	127031	洋丰转债	17,283,197.25	0.06
49	127076	中宠转 2	17,198,659.52	0.06
50	127025	冀东转债	16,582,486.30	0.06
51	110088	淮 22 转债	16,580,628.80	0.06
52	127043	川恒转债	15,602,024.13	0.06
53	118022	锂科转债	15,585,749.50	0.06

54	113644	艾迪转债	15,358,357.48	0.05
55	113058	友发转债	14,583,263.27	0.05
56	113649	丰山转债	14,410,606.40	0.05
57	113545	金能转债	13,977,617.27	0.05
58	123119	康泰转 2	13,660,318.56	0.05
59	123172	漱玉转债	13,339,701.66	0.05
60	128108	蓝帆转债	12,577,588.42	0.04
61	128105	长集转债	12,472,764.10	0.04
62	113606	荣泰转债	12,276,527.40	0.04
63	118023	广大转债	11,948,315.88	0.04
64	113061	拓普转债	11,875,387.31	0.04
65	118026	利元转债	11,690,767.47	0.04
66	127019	国城转债	11,642,973.51	0.04
67	113519	长久转债	11,451,551.25	0.04
68	127074	麦米转 2	11,019,399.49	0.04
69	128134	鸿路转债	10,708,805.86	0.04
70	128026	众兴转债	10,701,594.05	0.04
71	127039	北港转债	10,250,722.65	0.04
72	118025	奕瑞转债	9,672,586.29	0.03
73	113037	紫银转债	9,641,551.03	0.03
74	123151	康医转债	9,614,864.80	0.03
75	127056	中特转债	9,351,611.52	0.03
76	128138	侨银转债	9,167,301.62	0.03
77	132018	G 三峡 EB1	8,391,075.72	0.03
78	113596	城地转债	8,162,949.89	0.03
79	113045	环旭转债	7,651,570.65	0.03
80	128125	华阳转债	6,890,411.79	0.02
81	127053	豪美转债	6,832,793.57	0.02
82	113656	嘉诚转债	6,757,221.31	0.02
83	123091	长海转债	6,744,154.59	0.02
84	118004	博瑞转债	6,253,175.79	0.02
85	127052	西子转债	6,135,356.16	0.02
86	118005	天奈转债	6,042,728.44	0.02
87	123004	铁汉转债	6,028,475.13	0.02
88	118011	银微转债	5,914,368.49	0.02
89	127055	精装转债	5,812,568.49	0.02
90	128097	奥佳转债	5,745,690.33	0.02
91	128044	岭南转债	5,684,174.13	0.02
92	123165	回天转债	5,682,324.91	0.02
93	123155	中陆转债	5,507,158.90	0.02
94	113657	再 22 转债	5,301,096.01	0.02
95	128127	文科转债	5,218,020.55	0.02
96	113662	豪能转债	4,911,304.52	0.02

97	127066	科利转债	4,649,564.80	0.02
98	118013	道通转债	4,459,771.53	0.02
99	127047	帝欧转债	4,262,643.84	0.02
100	123154	火星转债	4,070,882.21	0.01
101	127062	垒知转债	3,613,183.58	0.01
102	110084	贵燃转债	3,413,082.79	0.01
103	113659	莱克转债	3,166,282.56	0.01
104	128142	新乳转债	2,464,232.46	0.01
105	127042	嘉美转债	2,292,395.28	0.01
106	113636	甬金转债	2,287,383.56	0.01
107	123064	万孚转债	2,249,037.89	0.01
108	123056	雪榕转债	2,231,060.27	0.01
109	113505	杭电转债	1,883,926.30	0.01
110	128119	龙大转债	1,783,131.85	0.01
111	113584	家悦转债	1,752,647.56	0.01
112	113647	禾丰转债	928,232.56	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	104,206,695.71	0.37	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	18,157,346,464.91	3,278,772.78
报告期期间基金总申购份额	1,271,321,511.97	42,194,355.04
减：报告期期间基金总赎回份额	1,206,439,750.56	52,976.59
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	18,222,228,226.32	45,420,151.23

§ 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

二〇二三年七月二十日