

# 易方达裕祥回报债券型证券投资基金

## 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：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 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	20,502,870,160.32 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	20,215,211,051.55 份	287,659,108.77 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 7 月 1 日-2023 年 9 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	162,876,324.38	466,587.55
2.本期利润	135,513,389.94	-422,322.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0070	-0.0029
4.期末基金资产净值	31,503,800,839.95	447,694,041.97
5.期末基金份额净值	1.558	1.556

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	0.52%	0.15%	-0.03%	0.13%	0.55%	0.02%
过去六个月	0.91%	0.17%	0.54%	0.12%	0.37%	0.05%
过去一年	2.10%	0.20%	2.34%	0.14%	-0.24%	0.06%
过去三年	13.06%	0.29%	7.87%	0.17%	5.19%	0.12%
过去五年	56.01%	0.37%	21.68%	0.18%	34.33%	0.19%
自基金合同生效起至今	72.86%	0.34%	31.46%	0.18%	41.40%	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

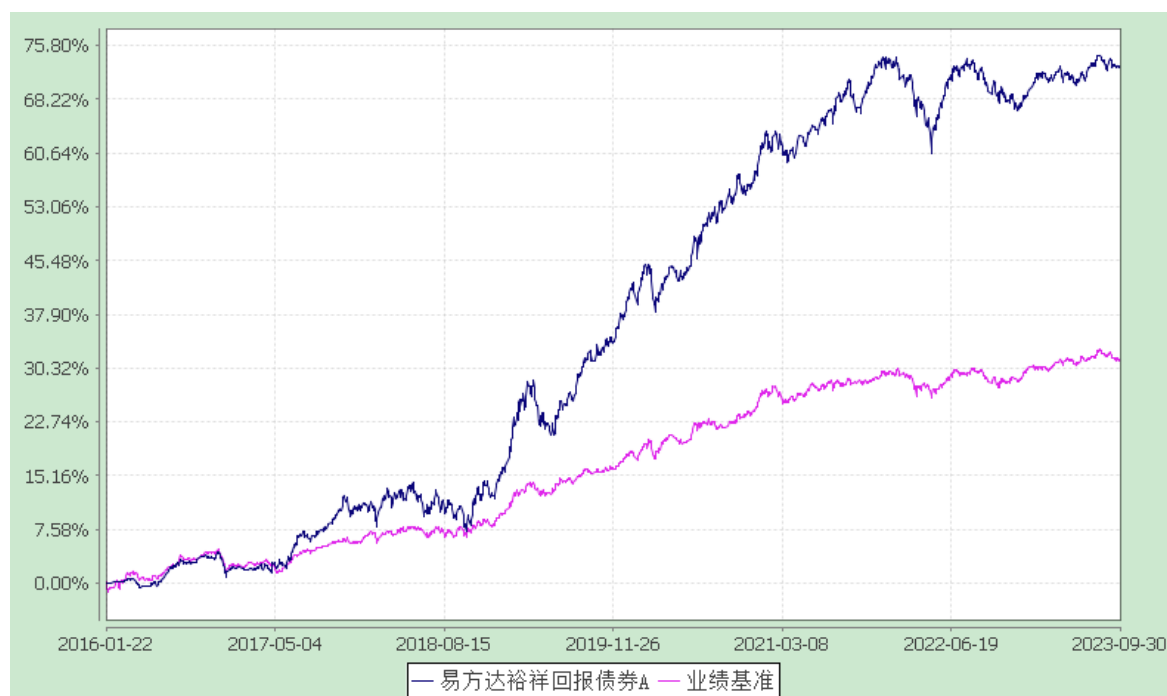
过去三个月	0.39%	0.15%	-0.03%	0.13%	0.42%	0.02%
过去六个月	0.71%	0.17%	0.54%	0.12%	0.17%	0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.71%	0.17%	0.88%	0.12%	-0.17%	0.05%

### 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

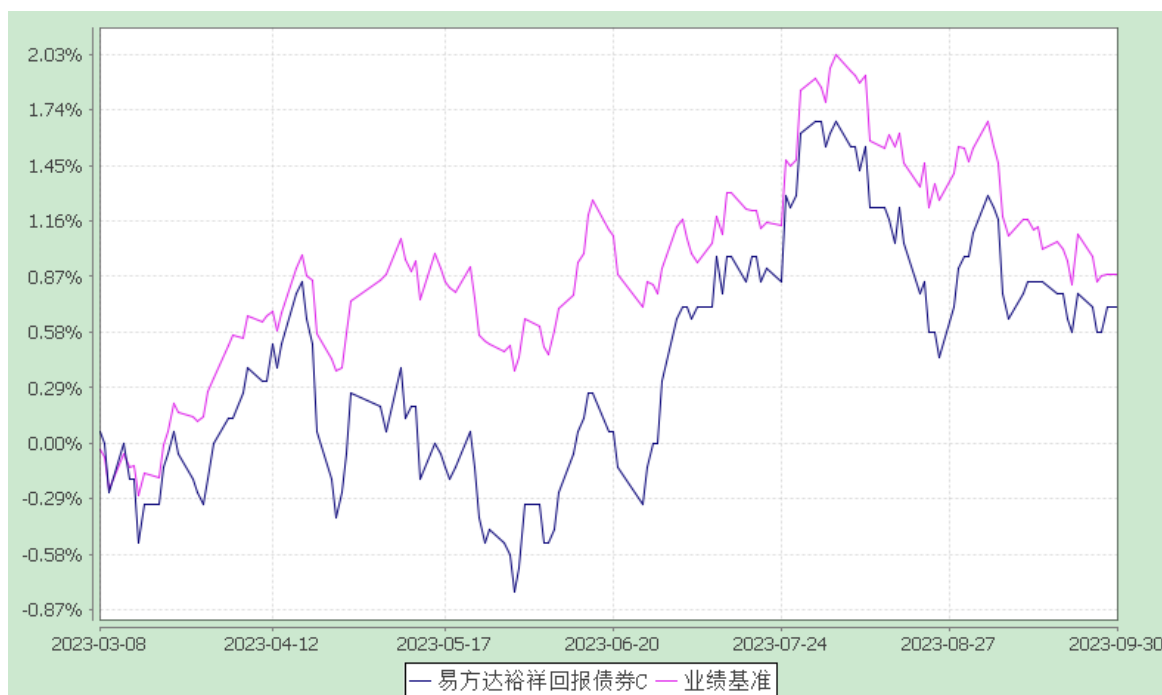
易方达裕祥回报债券 A

(2016 年 1 月 22 日至 2023 年 9 月 30 日)



易方达裕祥回报债券 C

(2023 年 3 月 8 日至 2023 年 9 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 72.86%，同期业绩比较基准收益率为 31.46%；C 类基金份额净值增长率为 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

## § 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			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，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

三季度，经济在季初下行后呈现企稳态势。节奏上看，7 月经济显著走弱，供需两端均大幅下滑，8、9 月有所企稳。生产方面，7 月工业增加值同比增长 3.7%，较去年同期更弱，8 月回升至 4.5%，环比增速也较 7 月加快，9 月是传统生产旺季，PMI（采购经理指数，下同）生产分项显著回升。需求方面，7 月投资消费显著走弱，而 8 月投资消费的环比增速较前月明显改善，9 月 PMI 继续回升至 50% 以上，经济景气水平有所回升。价格方面，7 月 CPI（消费者物价指数，下同）同比由上月持平转为下降 0.3%，PPI（生产者物价指数，下同）同比下降 4.4%，降幅比上月收窄 1 个百分点，8 月 CPI 同比由降转涨，PPI 同比降幅收窄，但整体上核心通胀回升斜率和高度较为受限。经济供给修复快于需求的特征仍在，经济结构性矛盾和周期性因素叠加，持续恢复基础仍然需要巩固。

政策方面，7 月 24 日中共中央政治局会议部署“加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险”，要求“精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备”。央行三季度下调了政策利率和存款准备金率，存量房贷利率调降落地，此外央行表态持续加大对“平急两用”公共基础设施建设、城中村改造、保障性住房建设等金融支持力度；财政政策方面，财政部 8 月底表示下一步将重点加力提效实施好积极的财政政策、支持做强做优实体经济、切实保障和改善民生、防范化解地方政府债务风险，此外还将延续实施多项税收优惠政策。

在前述经济和政策组合下，债券市场三季度收益率先下后上，整体震荡。资金方面，三季度 R007（银行间市场 7 天回购利率）月度中枢前低后高，银行间流动性较为充裕。现券方面，债券收益率也呈现前低后高的形态，8 月中下旬见到季度内低点。



9 月末 10 年国开收益率收于 2.74%，较二季度末下行 3bp，10 年国债收益率收于 2.68%，较二季度末上行 4bp；三季度高评级信用利差先压缩后扩大，3 年 AAA 中短票收益率较二季度末上行 9bp 左右，利差压缩 5bp 左右；中低评级信用利差持续压缩，1 年 AA 中短票利差压缩 12bp 左右。

股票方面，三季度股票市场震荡下跌，沪深 300 指数下跌 3.98%，中证 1000 指数下跌 7.92%，创业板指数下跌 9.53%。三季度行业表现分化，非银、煤炭石油石化行业领涨，电力设备、传媒、计算机行业领跌，与二季度相比，通信传媒行业反转下跌且跌幅最大，商贸零售、食品饮料和煤炭行业转而上涨且涨幅靠前。

转债方面，三季度转债表现出较强的防御属性，中证转债指数下跌 0.52%，同期上证指数下跌 2.86%。7 月以来正股带动转债上涨，估值小幅提升；8 月在股票市场下跌的背景下，转债的估值和绝对价格回撤低于预期，表现出一定的韧性；9 月份可转债指数跌幅较大，估值出现一定压缩。

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，三季度上半段伴随债券收益率下行，组合逐步兑现部分债券仓位的收益，小幅降低组合久期，下半段伴随债券收益率上行，组合择优配置中短期限的中高等级信用债，并结合相对价值变化不断优化券种结构。股票方面，组合 8 月以来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，三季度权益资产给组合净值带来了不错的正收益。转债方面，组合基本维持可转债仓位。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 1.558 元，本报告期份额净值增长率为 0.52%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%；C 类基金份额净值为 1.556 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-0.03%。

#### 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	5,765,753,405.58	16.52
	其中：股票	5,765,753,405.58	16.52
2	固定收益投资	28,943,295,904.76	82.94
	其中：债券	28,659,084,582.79	82.12
	资产支持证券	284,211,321.97	0.81
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	18,515,351.80	0.05
7	其他资产	169,434,846.08	0.49
8	合计	34,896,999,508.22	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	436,450,124.69	1.37
C	制造业	3,558,911,982.14	11.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	251,583,330.00	0.79
E	建筑业	102,970,812.94	0.32
F	批发和零售业	87,575,861.12	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	330,322,426.13	1.03
H	住宿和餐饮业	1,609,280.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	216,958,600.32	0.68

J	金融业	342,676,299.57	1.07
K	房地产业	178,248,711.62	0.56
L	租赁和商务服务业	128,070,655.31	0.40
M	科学研究和技术服务业	24,201,239.96	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	20,679,436.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,031,793.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	81,462,852.78	0.25
S	综合	-	-
	合计	5,765,753,405.58	18.05

### 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	333,882,680.96	1.04
2	601799	星宇股份	2,196,200	333,822,400.00	1.04
3	600660	福耀玻璃	5,822,147	214,953,667.24	0.67
4	600426	华鲁恒升	6,424,032	206,211,427.20	0.65
5	601088	中国神华	5,831,600	181,945,920.00	0.57
6	600690	海尔智家	7,441,372	175,616,379.20	0.55
7	300124	汇川技术	2,403,074	159,780,390.26	0.50
8	003816	中国广核	46,500,000	146,010,000.00	0.46
9	601111	中国国航	17,289,034	139,695,394.72	0.44
10	601166	兴业银行	7,859,682	128,034,219.78	0.40

### 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	16,242,885,905.62	50.84
	其中：政策性金融债	1,903,003,076.85	5.96

4	企业债券	2,902,156,922.87	9.08
5	企业短期融资券	554,377,201.63	1.74
6	中期票据	5,771,591,315.01	18.06
7	可转债（可交换债）	3,188,073,237.66	9.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,659,084,582.79	89.70

#### 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	1,302,358,904.11	4.08
2	2128039	21 中国银行二级 03	9,500,000	995,286,890.41	3.11
3	2228004	22 工商银行二级 01	8,500,000	874,531,139.73	2.74
4	2128042	21 兴业银行二级 02	7,600,000	793,817,084.93	2.48
5	2228003	22 兴业银行二级 01	7,400,000	764,242,602.74	2.39

#### 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	92,639,194.52	0.29
2	135519	荟臻 022A	500,000	49,951,290.41	0.16
3	260258	耘睿 102A	300,000	30,019,775.34	0.09
4	112561	22 和闽优	200,000	20,607,271.23	0.06
5	189329	21 工鑫 5A	200,000	20,338,400.00	0.06
6	189951	21 十局优	200,000	20,195,731.51	0.06
7	180204	22 葛洲优	200,000	20,125,526.58	0.06
8	183144	21 水八 04	100,000	10,308,804.93	0.03
9	156659	PR 产 1A	100,000	10,019,034.85	0.03
10	YA1265	济建 5 优	100,000	10,006,292.60	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外汇管理局宁波市分局、中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。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外汇管理局上海市分局的处罚。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。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	1,047,862.04
2	应收证券清算款	106,135,337.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,251,646.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	169,434,846.08

## 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	217,310,700.08	0.68
2	110072	广汇转债	174,510,371.21	0.55
3	110079	杭银转债	120,464,181.98	0.38
4	118031	天 23 转债	109,079,094.47	0.34
5	127018	本钢转债	93,457,961.59	0.29
6	113065	齐鲁转债	88,603,696.31	0.28
7	127049	希望转 2	82,746,709.72	0.26
8	113641	华友转债	74,734,998.60	0.23
9	127067	恒逸转 2	62,584,807.77	0.20
10	110081	闻泰转债	62,550,097.09	0.20
11	110047	山鹰转债	61,387,488.67	0.19
12	113059	福莱转债	59,534,215.31	0.19
13	113054	绿动转债	59,271,566.19	0.19
14	123149	通裕转债	58,202,275.92	0.18
15	127045	牧原转债	55,816,436.29	0.17
16	128023	亚太转债	55,092,575.45	0.17
17	127016	鲁泰转债	54,899,103.17	0.17
18	113033	利群转债	50,052,997.80	0.16
19	110087	天业转债	49,515,736.18	0.15
20	127061	美锦转债	48,095,444.64	0.15
21	128129	青农转债	45,635,372.87	0.14
22	110045	海澜转债	38,126,971.50	0.12
23	110043	无锡转债	36,880,548.13	0.12
24	110089	兴发转债	34,982,177.14	0.11
25	113060	浙 22 转债	33,956,977.42	0.11
26	128109	楚江转债	33,477,620.73	0.10
27	113056	重银转债	32,888,554.72	0.10
28	123113	仙乐转债	32,737,094.22	0.10
29	118024	冠宇转债	31,406,622.83	0.10
30	110088	淮 22 转债	28,333,901.92	0.09
31	127040	国泰转债	28,007,391.91	0.09
32	113651	松霖转债	26,347,824.00	0.08
33	127073	天赐转债	26,051,401.16	0.08
34	123099	普利转债	24,774,258.28	0.08
35	110086	精工转债	24,077,116.29	0.08
36	113653	永 22 转债	22,366,303.34	0.07
37	123049	维尔转债	21,090,578.62	0.07
38	113609	永安转债	20,830,646.57	0.07

39	113048	晶科转债	20,502,793.37	0.06
40	113542	好客转债	19,997,964.25	0.06
41	127068	顺博转债	19,554,880.41	0.06
42	123132	回盛转债	18,509,650.63	0.06
43	113623	凤 21 转债	18,472,339.71	0.06
44	113062	常银转债	18,297,091.06	0.06
45	127044	蒙娜转债	18,286,646.64	0.06
46	127043	川恒转债	18,163,251.33	0.06
47	127031	洋丰转债	17,508,639.63	0.05
48	127025	冀东转债	16,674,975.67	0.05
49	127076	中宠转 2	15,897,984.37	0.05
50	113545	金能转债	14,646,441.99	0.05
51	118022	锂科转债	14,608,409.16	0.05
52	123119	康泰转 2	14,515,019.83	0.05
53	118013	道通转债	14,376,403.74	0.04
54	113649	丰山转债	13,856,223.31	0.04
55	113643	风语转债	13,692,072.23	0.04
56	113058	友发转债	13,202,983.10	0.04
57	128105	长集转债	12,987,349.19	0.04
58	113045	环旭转债	12,857,484.59	0.04
59	128108	蓝帆转债	12,778,633.78	0.04
60	113051	节能转债	12,725,128.27	0.04
61	113606	荣泰转债	12,564,908.22	0.04
62	113644	艾迪转债	12,250,868.08	0.04
63	118026	利元转债	11,592,085.87	0.04
64	123150	九强转债	11,454,912.73	0.04
65	113064	东材转债	11,239,151.14	0.04
66	123172	漱玉转债	11,137,332.83	0.03
67	113666	爱玛转债	11,109,460.85	0.03
68	110093	神马转债	11,056,257.75	0.03
69	111000	起帆转债	11,002,874.99	0.03
70	113631	皖天转债	10,982,640.19	0.03
71	118017	深科转债	10,978,386.36	0.03
72	123170	南电转债	10,949,162.10	0.03
73	113639	华正转债	10,867,029.71	0.03
74	128134	鸿路转债	10,688,285.78	0.03
75	123157	科蓝转债	10,629,391.01	0.03
76	127019	国城转债	10,470,855.93	0.03
77	127039	北港转债	10,442,990.34	0.03
78	118023	广大转债	10,100,039.21	0.03
79	128026	众兴转债	10,062,577.80	0.03
80	123151	康医转债	9,404,312.81	0.03
81	127056	中特转债	9,309,237.32	0.03

82	118025	奕瑞转债	9,259,070.94	0.03
83	128138	侨银转债	9,240,389.08	0.03
84	123169	正海转债	9,152,447.56	0.03
85	132018	G 三峡 EB1	8,712,900.34	0.03
86	113596	城地转债	8,247,374.19	0.03
87	113628	晨丰转债	8,074,269.12	0.03
88	127027	能化转债	7,171,625.81	0.02
89	127053	豪美转债	7,019,175.43	0.02
90	128125	华阳转债	6,932,035.17	0.02
91	113656	嘉诚转债	6,889,846.35	0.02
92	123091	长海转债	6,784,640.84	0.02
93	118004	博瑞转债	6,646,620.82	0.02
94	127070	大中转债	6,346,889.88	0.02
95	123161	强联转债	6,140,321.69	0.02
96	118005	天奈转债	5,993,374.21	0.02
97	123004	铁汉转债	5,911,633.51	0.02
98	127055	精装转债	5,727,609.59	0.02
99	128097	奥佳转债	5,723,523.96	0.02
100	127052	西子转债	5,705,897.26	0.02
101	123165	回天转债	5,629,356.99	0.02
102	113621	彤程转债	5,627,092.94	0.02
103	123155	中陆转债	5,509,287.67	0.02
104	128127	文科转债	5,452,404.11	0.02
105	113657	再 22 转债	5,418,555.48	0.02
106	128044	岭南转债	5,412,375.81	0.02
107	118011	银微转债	5,212,909.90	0.02
108	127047	帝欧转债	4,525,684.93	0.01
109	127066	科利转债	4,357,340.58	0.01
110	113662	豪能转债	4,262,891.44	0.01
111	127082	亚科转债	4,251,438.73	0.01
112	113066	平煤转债	4,176,846.13	0.01
113	128017	金禾转债	3,999,080.72	0.01
114	123154	火星转债	3,916,151.48	0.01
115	123153	英力转债	3,697,464.35	0.01
116	127062	垒知转债	3,551,412.44	0.01
117	113659	莱克转债	3,085,988.12	0.01
118	113636	甬金转债	2,370,200.00	0.01
119	127042	嘉美转债	2,291,760.61	0.01
120	123064	万孚转债	2,230,976.07	0.01
121	123056	雪榕转债	2,222,109.59	0.01
122	113505	杭电转债	1,774,174.93	0.01
123	128119	龙大转债	1,734,477.63	0.01
124	113647	禾丰转债	944,965.85	0.00



125	111011	冠盛转债	832,810.72	0.00
126	118018	瑞科转债	417,084.53	0.00
127	127074	麦米转 2	180,091.33	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	18,222,228,226.32	45,420,151.23
报告期期间基金总申购份额	3,119,155,787.86	246,973,732.77
减：报告期期间基金总赎回份额	1,126,172,962.63	4,734,775.23
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	20,215,211,051.55	287,659,108.77

### § 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

二〇二三年十月二十五日