

# 易方达裕祥回报债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：二〇二四年十月二十五日

## § 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 2024 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 2024 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 | 15,926,379,519.65 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。<br>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 | 15,606,800,998.97 份   | 319,578,520.68 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<br>(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日) |
|--------|---|

|                | 易方达裕祥回报债券<br>A    | 易方达裕祥回报债券<br>C |
|----------------|-------------------|----------------|
| 1.本期已实现收益      | 230,418,423.10    | 10,391,404.12  |
| 2.本期利润         | 586,848,568.75    | -2,171,837.99  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0340            | -0.0033        |
| 4.期末基金资产净值     | 25,134,053,251.75 | 511,926,482.34 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.610             | 1.602          |

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      | 2.61%  | 0.33%     | 3.11%      | 0.20%         | -0.50% | 0.13% |
| 过去六个月      | 3.84%  | 0.28%     | 4.23%      | 0.16%         | -0.39% | 0.12% |
| 过去一年       | 6.37%  | 0.25%     | 6.47%      | 0.15%         | -0.10% | 0.10% |
| 过去三年       | 10.04% | 0.26%     | 9.10%      | 0.16%         | 0.94%  | 0.10% |
| 过去五年       | 39.93% | 0.30%     | 21.32%     | 0.17%         | 18.61% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 83.87% | 0.33%     | 39.96%     | 0.17%         | 43.91% | 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

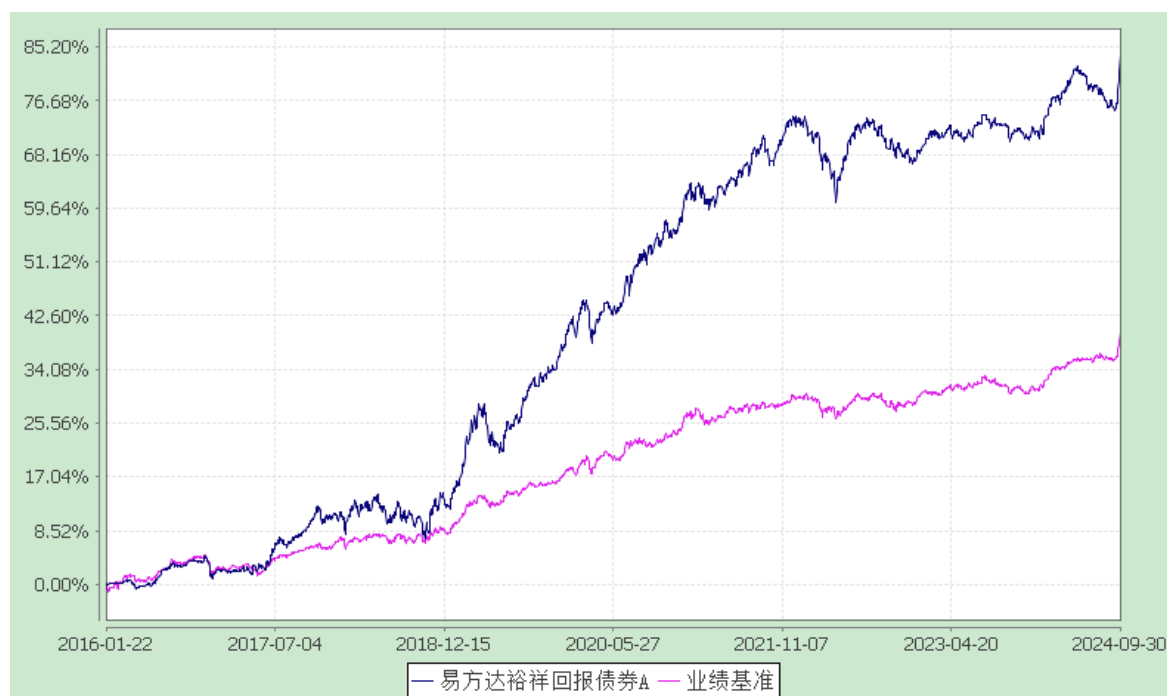
|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.56% | 0.34% | 3.11% | 0.20% | -0.55% | 0.14% |
| 过去六个月      | 3.66% | 0.28% | 4.23% | 0.16% | -0.57% | 0.12% |
| 过去一年       | 5.99% | 0.25% | 6.47% | 0.15% | -0.48% | 0.10% |
| 过去三年       | -     | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去五年       | -     | -     | -     | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 6.74% | 0.22% | 7.40% | 0.14% | -0.66% | 0.08% |

### 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 9 月 30 日)



易方达裕祥回报债券 C

(2023 年 3 月 8 日至 2024 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 83.87%，同期业绩比较基准收益率为 39.96%；C 类基金份额净值增长率为 6.74%，同期业绩比较基准收益率为 7.40%。

## § 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、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式（自 2019 年 10 月 15 日至 2024 年 08 月 14 日）、易方达安泽 180 天持有债 | 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 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 券的基金经理，固定收益全策略投资部总经理、固定收益及多资产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、易方达安瑞短债债券、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 28 次，其中 26 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，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

三季度经济数据较二季度继续走弱。生产端来看，7 月规模以上工业增加值同比增长 5.1%，环比增长 0.35%，8 月同比增长 4.5%，环比增长 0.32%，工业生产保持平稳增长，但增速较二季度有所下行；从工业品价格方面来看，7、8 月 PPI（生产者价格指数）同比增速分别为-0.8%、-1.8%，环比增速分别为-0.2%、-0.7%，工业企业整体体现出降价去库的倾向，对生产端继续构成拖累。需求端来看，7、8 月固定资产投资累计同比增速分别为 3.6%、3.4%，保持平稳增长但趋势延续下行；社会消费品零售总额当月同比增速分别为 2.7%、2.1%，消费增速低位震荡，其中服务消费增速高于商品消费增速；外贸增势较好，出口增速整体平稳。综合来看，三季度尽管国内外环境更趋复杂严峻，同时高温天气和暴雨洪涝等自然灾害持续对经济活动造成影响，但经济运行总体平稳，转型升级稳步推进，经济运行延续稳中有进发展态势。同时，国内需求不足等问题还在显现，新旧动能转换存在阵痛。

政策方面，9 月 26 日中共中央政治局召开会议，聚焦当前经济形势和经济工作，体现出对稳增长的关切和决心。会议认为经济运行出现一些新的情况和问题，提出要正视困难、坚定信心，切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感，努力完成全年经济增长目标。货币政策方面，政治局会议强调加大货币政策的逆周期调节力度，要降低存款准备金率，实施有力度的降息，且明确表示此后仍有降息空间。财政政策方面，会议强调保证必要的财政支出，切实做好基层“三保”工作；要发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，更好发挥政府投资带动作用；要促进房地产市场止跌回稳；要将促消费和惠民生结合起来，提出“提升消费结构”和“培育新型消费业态”。预计后续会迎来相应政策的落地和落实。



市场表现方面，债券收益率三季度整体震荡，利率债表现优于信用债。资金方面，三季度 R007（银行间市场 7 天回购利率）平均水平较二季度微幅下行。现券方面，三季度以来债券供需矛盾有所缓解，债券收益率趋于震荡，9 月末 10 年国债收益率收于 2.15%，10 年国开债收益率收于 2.25%，分别较二季度末下行 5.4bp、4.6bp；信用利差中枢明显上行，3 年 AAA 中短票收益率较二季度末上行 18.8bp，利差走阔 42bp，中低评级信用利差走阔程度稍高，3 年 AA 中短票利差走阔 49bp。

股票方面，三季度权益市场呈现“U”型态势，先跌后涨，9 月最后一周快速反弹。较二季度末，沪深 300 指数上涨 16.1%，中证 1000 指数上涨 16.6%，创业板指数上涨 29.2%。三季度申万行业中非银、地产、综合、商贸零售涨幅靠前，煤炭、石油石化、公用事业涨幅靠后。

转债方面，7 月-9 月中旬受到正股表现疲软以及转债信用风险事件的影响，转债市场整体下跌。9 月中下旬以来转债市场在风险偏好修复下显著回暖，收复三季度前期跌幅，成交活跃度回升。三季度中证转债指数较二季度末上涨 0.58%，同期上证指数上涨 12.4%，万得全 A 指数上涨 17.7%。

回顾来看，今年以来债券市场收益率整体震荡下行，债券组合的持有期收益中包含了较多的资本利得收益，这使得债券基金的年化收益水平较难在未来持续。从市场指数来看，中债综合财富指数截至 9 月底的收益率为 4.69%，其中票息收益贡献了 1.82%，资本利得收益贡献了 2.87%；中债优选投资级财富指数的收益率为 3.35%，其中票息收益贡献了 1.84%，资本利得收益贡献了 1.51%。资本利得收益波动性相对较大，建议投资者理性看待债券基金的投资收益。

报告期内，组合基于对经济基本面走势的判断，以及细分资产的相对估值水平，积极应对并调整资产配置。操作方面，三季度组合在债券收益率下行的过程中逐步降低信用品种的仓位和信用利差久期，并根据相对价值变化不断优化信用券种结构，同时通过利率品种阶段性增厚收益。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显著正向贡献。转债方面，组合自 5 月起逐步降低转债仓位，三季度维持低仓位，整体对组合收益有正向贡献。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 1.610 元，本报告期份额净值增长率

为 2.61%，同期业绩比较基准收益率为 3.11%；C 类基金份额净值为 1.602 元，本报告期份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为 3.11%。

#### 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              | 5,102,138,865.43  | 18.99        |
|    | 其中：股票             | 5,102,138,865.43  | 18.99        |
| 2  | 固定收益投资            | 21,328,770,420.73 | 79.39        |
|    | 其中：债券             | 21,154,879,609.52 | 78.74        |
|    | 资产支持证券            | 173,890,811.21    | 0.65         |
| 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      | 72,522,920.73     | 0.27         |
| 7  | 其他资产              | 363,680,549.19    | 1.35         |
| 8  | 合计                | 26,867,112,756.08 | 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              | 603,120,896.14   | 2.35  |
| C | 制造业              | 3,358,448,023.97 | 13.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 111,993,008.40   | 0.44  |
| E | 建筑业              | 109,059,061.52   | 0.43  |
| F | 批发和零售业           | -                | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 338,574,725.26   | 1.32  |
| H | 住宿和餐饮业           | 52,377,494.00    | 0.20  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 157,617,765.85   | 0.61  |
| J | 金融业              | 91,472,276.90    | 0.36  |
| K | 房地产业             | 150,724,218.48   | 0.59  |
| L | 租赁和商务服务业         | 128,751,394.91   | 0.50  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -                | -     |
| 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               | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -                | -     |
| S | 综合               | -                | -     |
|   | 合计               | 5,102,138,865.43 | 19.89 |

### 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  | 600031 | 三一重工 | 11,730,091 | 221,464,118.08 | 0.86         |
| 2  | 600426 | 华鲁恒升 | 8,110,632  | 212,417,452.08 | 0.83         |
| 3  | 600938 | 中国海油 | 6,924,542  | 208,082,487.10 | 0.81         |
| 4  | 600176 | 中国巨石 | 17,133,011 | 201,484,209.36 | 0.79         |
| 5  | 600298 | 安琪酵母 | 5,231,058  | 190,515,132.36 | 0.74         |
| 6  | 600690 | 海尔智家 | 5,915,872  | 190,195,284.80 | 0.74         |
| 7  | 300124 | 汇川技术 | 2,803,074  | 175,051,971.30 | 0.68         |
| 8  | 600600 | 青岛啤酒 | 2,102,517  | 164,732,206.95 | 0.64         |
| 9  | 600004 | 白云机场 | 15,184,419 | 158,829,022.74 | 0.62         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 10 | 601857 | 中国石油 | 17,266,853 | 155,747,014.06 | 0.61 |
|----|--------|------|------------|----------------|------|

## 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      | 2,031,563,703.81  | 7.92         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 8,820,549,417.29  | 34.39        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,479,090,058.43  | 5.77         |
| 4  | 企业债券      | 2,385,202,052.30  | 9.30         |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,064,253,634.32  | 4.15         |
| 6  | 中期票据      | 4,419,728,345.16  | 17.23        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,433,582,456.64  | 9.49         |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 21,154,879,609.52 | 82.49        |

## 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  | 6,300,000 | 660,372,127.87 | 2.57         |
| 2  | 092280033 | 22 宁波银行二级资本债 01 | 6,000,000 | 616,631,276.71 | 2.40         |
| 3  | 092280014 | 22 上海银行二级资本债 01 | 5,900,000 | 612,970,073.97 | 2.39         |
| 4  | 232480020 | 24 兴业银行二级资本债 01 | 4,600,000 | 464,155,123.29 | 1.81         |
| 5  | 092280131 | 22 建行二级资本债 02A  | 4,000,000 | 418,629,508.20 | 1.63         |

## 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 | 87,283,312.75 | 0.34    |
| 2 | 260258 | 耘睿 102A   | 300,000 | 30,320,891.51 | 0.12    |
| 3 | 261755 | 24 海创 9A  | 200,000 | 20,336,598.36 | 0.08    |
| 4 | 180204 | 22 葛洲优    | 200,000 | 20,161,268.23 | 0.08    |
| 5 | 183144 | 21 水八 04  | 100,000 | 10,501,804.93 | 0.04    |
| 6 | 112813 | GC 曹 03A2 | 200,000 | 5,286,935.43  | 0.02    |

#### 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。兴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福建监管局的处罚。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。中国太平洋人寿保险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海南监管局、国家金融监督管理总局运城监管分局、国家外汇管理局上海市分局、汉中市略阳县消防救援大队的处罚。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   | 802,874.65     |
| 2  | 应收证券清算款 | 301,632,157.65 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | -              |
| 5  | 应收申购款   | 61,245,516.89  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 363,680,549.19 |

#### 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<br>净值比例(%) |
|----|--------|---------|----------------|------------------|
| 1  | 118031 | 天 23 转债 | 108,399,415.41 | 0.42             |
| 2  | 127049 | 希望转 2   | 78,038,016.28  | 0.30             |
| 3  | 113641 | 华友转债    | 72,467,881.60  | 0.28             |
| 4  | 110081 | 闻泰转债    | 72,179,415.45  | 0.28             |
| 5  | 127067 | 恒逸转 2   | 61,764,517.06  | 0.24             |
| 6  | 113054 | 绿动转债    | 57,191,375.39  | 0.22             |
| 7  | 113059 | 福莱转债    | 55,080,220.89  | 0.21             |
| 8  | 127061 | 美锦转债    | 54,498,495.92  | 0.21             |
| 9  | 127016 | 鲁泰转债    | 53,998,437.46  | 0.21             |
| 10 | 118000 | 嘉元转债    | 50,543,896.44  | 0.20             |
| 11 | 123149 | 通裕转债    | 48,362,859.79  | 0.19             |
| 12 | 110087 | 天业转债    | 44,942,265.87  | 0.18             |
| 13 | 113033 | 利群转债    | 44,277,847.72  | 0.17             |
| 14 | 118022 | 锂科转债    | 43,040,193.77  | 0.17             |
| 15 | 127030 | 盛虹转债    | 42,417,608.76  | 0.17             |
| 16 | 113650 | 博 22 转债 | 40,497,997.31  | 0.16             |
| 17 | 113051 | 节能转债    | 39,784,963.77  | 0.16             |
| 18 | 110089 | 兴发转债    | 39,450,818.96  | 0.15             |
| 19 | 113048 | 晶科转债    | 37,628,555.67  | 0.15             |
| 20 | 127040 | 国泰转债    | 32,950,980.37  | 0.13             |
| 21 | 123113 | 仙乐转债    | 32,512,223.36  | 0.13             |
| 22 | 127083 | 山路转债    | 32,099,397.21  | 0.13             |
| 23 | 127073 | 天赐转债    | 31,901,650.31  | 0.12             |
| 24 | 128109 | 楚江转债    | 31,794,819.05  | 0.12             |

|    |        |         |               |      |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 25 | 127089 | 晶澳转债    | 28,916,650.44 | 0.11 |
| 26 | 127045 | 牧原转债    | 28,553,151.63 | 0.11 |
| 27 | 128125 | 华阳转债    | 28,256,567.85 | 0.11 |
| 28 | 113542 | 好客转债    | 27,390,321.54 | 0.11 |
| 29 | 113584 | 家悦转债    | 26,334,305.67 | 0.10 |
| 30 | 123076 | 强力转债    | 26,080,512.41 | 0.10 |
| 31 | 123104 | 卫宁转债    | 25,956,804.07 | 0.10 |
| 32 | 123122 | 富瀚转债    | 25,906,463.21 | 0.10 |
| 33 | 113623 | 凤 21 转债 | 24,550,132.70 | 0.10 |
| 34 | 113058 | 友发转债    | 24,492,497.14 | 0.10 |
| 35 | 118034 | 晶能转债    | 24,001,125.21 | 0.09 |
| 36 | 113609 | 永安转债    | 22,374,906.85 | 0.09 |
| 37 | 118005 | 天奈转债    | 21,745,534.91 | 0.08 |
| 38 | 113653 | 永 22 转债 | 21,613,619.08 | 0.08 |
| 39 | 113045 | 环旭转债    | 20,398,667.90 | 0.08 |
| 40 | 128116 | 瑞达转债    | 20,287,689.31 | 0.08 |
| 41 | 110086 | 精工转债    | 19,314,870.77 | 0.08 |
| 42 | 127043 | 川恒转债    | 18,776,043.17 | 0.07 |
| 43 | 127031 | 洋丰转债    | 18,686,563.17 | 0.07 |
| 44 | 113624 | 正川转债    | 18,684,503.42 | 0.07 |
| 45 | 113666 | 爱玛转债    | 18,543,465.62 | 0.07 |
| 46 | 123132 | 回盛转债    | 18,314,795.63 | 0.07 |
| 47 | 128117 | 道恩转债    | 17,570,881.49 | 0.07 |
| 48 | 123180 | 浙矿转债    | 17,490,210.80 | 0.07 |
| 49 | 127068 | 顺博转债    | 17,206,378.55 | 0.07 |
| 50 | 113644 | 艾迪转债    | 16,378,423.71 | 0.06 |
| 51 | 123126 | 瑞丰转债    | 15,917,016.67 | 0.06 |
| 52 | 127076 | 中宠转 2   | 15,235,551.78 | 0.06 |
| 53 | 118042 | 奥维转债    | 15,120,517.30 | 0.06 |
| 54 | 118035 | 国力转债    | 14,995,591.71 | 0.06 |
| 55 | 113068 | 金铜转债    | 14,420,137.97 | 0.06 |
| 56 | 113606 | 荣泰转债    | 14,273,607.31 | 0.06 |
| 57 | 113632 | 鹤 21 转债 | 13,694,173.18 | 0.05 |
| 58 | 118013 | 道通转债    | 13,669,047.28 | 0.05 |
| 59 | 123119 | 康泰转 2   | 13,665,253.42 | 0.05 |
| 60 | 113545 | 金能转债    | 12,935,194.48 | 0.05 |
| 61 | 113647 | 禾丰转债    | 12,560,993.08 | 0.05 |
| 62 | 127039 | 北港转债    | 12,541,985.49 | 0.05 |
| 63 | 123142 | 申昊转债    | 11,997,385.47 | 0.05 |
| 64 | 128134 | 鸿路转债    | 11,542,433.51 | 0.05 |
| 65 | 128097 | 奥佳转债    | 11,065,258.47 | 0.04 |
| 66 | 110093 | 神马转债    | 10,774,788.00 | 0.04 |
| 67 | 113061 | 拓普转债    | 10,734,101.00 | 0.04 |

|     |        |         |               |      |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 68  | 113618 | 美诺转债    | 10,491,372.07 | 0.04 |
| 69  | 123193 | 海能转债    | 10,191,182.45 | 0.04 |
| 70  | 123233 | 凯盛转债    | 9,971,600.71  | 0.04 |
| 71  | 113643 | 风语转债    | 9,627,071.93  | 0.04 |
| 72  | 118041 | 星球转债    | 9,572,599.01  | 0.04 |
| 73  | 123172 | 漱玉转债    | 9,264,399.07  | 0.04 |
| 74  | 113657 | 再 22 转债 | 9,246,515.92  | 0.04 |
| 75  | 128071 | 合兴转债    | 9,168,259.55  | 0.04 |
| 76  | 127091 | 科数转债    | 8,501,557.77  | 0.03 |
| 77  | 123208 | 孩王转债    | 8,493,883.61  | 0.03 |
| 78  | 128142 | 新乳转债    | 8,318,190.34  | 0.03 |
| 79  | 118030 | 睿创转债    | 8,223,301.08  | 0.03 |
| 80  | 127042 | 嘉美转债    | 8,121,438.74  | 0.03 |
| 81  | 123169 | 正海转债    | 8,090,551.78  | 0.03 |
| 82  | 123151 | 康医转债    | 7,998,290.21  | 0.03 |
| 83  | 123109 | 昌红转债    | 7,850,431.29  | 0.03 |
| 84  | 123190 | 道氏转 02  | 7,788,413.54  | 0.03 |
| 85  | 113675 | 新 23 转债 | 7,274,331.22  | 0.03 |
| 86  | 113625 | 江山转债    | 7,145,877.73  | 0.03 |
| 87  | 128138 | 侨银转债    | 7,083,268.17  | 0.03 |
| 88  | 127044 | 蒙娜转债    | 6,891,487.12  | 0.03 |
| 89  | 118014 | 高测转债    | 6,809,688.22  | 0.03 |
| 90  | 118043 | 福立转债    | 6,686,166.91  | 0.03 |
| 91  | 123165 | 回天转债    | 6,595,941.60  | 0.03 |
| 92  | 118015 | 芯海转债    | 6,556,911.16  | 0.03 |
| 93  | 110095 | 双良转债    | 6,425,599.56  | 0.03 |
| 94  | 118010 | 洁特转债    | 6,422,768.74  | 0.03 |
| 95  | 127086 | 恒邦转债    | 6,360,973.20  | 0.02 |
| 96  | 128081 | 海亮转债    | 6,313,329.99  | 0.02 |
| 97  | 127052 | 西子转债    | 6,243,356.22  | 0.02 |
| 98  | 127055 | 精装转债    | 5,955,219.18  | 0.02 |
| 99  | 127070 | 大中转债    | 5,821,482.72  | 0.02 |
| 100 | 127082 | 亚科转债    | 5,668,199.73  | 0.02 |
| 101 | 123091 | 长海转债    | 5,619,811.85  | 0.02 |
| 102 | 128132 | 交建转债    | 5,209,776.86  | 0.02 |
| 103 | 123056 | 雪榕转债    | 5,146,772.30  | 0.02 |
| 104 | 113633 | 科沃转债    | 5,133,603.84  | 0.02 |
| 105 | 128074 | 游族转债    | 5,045,799.54  | 0.02 |
| 106 | 118024 | 冠宇转债    | 4,569,238.79  | 0.02 |
| 107 | 123162 | 东杰转债    | 4,529,902.56  | 0.02 |
| 108 | 127103 | 东南转债    | 4,475,604.78  | 0.02 |
| 109 | 127056 | 中特转债    | 4,387,344.12  | 0.02 |
| 110 | 111009 | 盛泰转债    | 4,386,417.80  | 0.02 |



|     |        |         |              |      |
|-----|--------|---------|--------------|------|
| 111 | 123155 | 中陆转债    | 4,341,514.25 | 0.02 |
| 112 | 123179 | 立高转债    | 4,106,614.86 | 0.02 |
| 113 | 123082 | 北陆转债    | 4,074,620.03 | 0.02 |
| 114 | 113569 | 科达转债    | 4,036,687.56 | 0.02 |
| 115 | 123215 | 铭利转债    | 4,016,430.50 | 0.02 |
| 116 | 113549 | 白电转债    | 3,632,644.71 | 0.01 |
| 117 | 123133 | 佩蒂转债    | 3,367,088.18 | 0.01 |
| 118 | 127035 | 濮耐转债    | 3,042,448.56 | 0.01 |
| 119 | 113636 | 甬金转债    | 2,939,961.26 | 0.01 |
| 120 | 113659 | 莱克转债    | 2,921,776.03 | 0.01 |
| 121 | 123154 | 火星转债    | 2,843,535.01 | 0.01 |
| 122 | 113670 | 金 23 转债 | 2,789,735.01 | 0.01 |
| 123 | 118032 | 建龙转债    | 2,707,346.47 | 0.01 |
| 124 | 128130 | 景兴转债    | 2,671,833.00 | 0.01 |
| 125 | 123163 | 金沃转债    | 2,633,560.03 | 0.01 |
| 126 | 127088 | 赫达转债    | 2,611,668.84 | 0.01 |
| 127 | 111018 | 华康转债    | 2,504,673.01 | 0.01 |
| 128 | 123130 | 设研转债    | 2,495,729.96 | 0.01 |
| 129 | 123189 | 晓鸣转债    | 2,491,817.98 | 0.01 |
| 130 | 123183 | 海顺转债    | 2,407,297.02 | 0.01 |
| 131 | 123039 | 开润转债    | 2,301,038.19 | 0.01 |
| 132 | 123064 | 万孚转债    | 2,194,059.44 | 0.01 |
| 133 | 113628 | 晨丰转债    | 2,092,287.67 | 0.01 |
| 134 | 118018 | 瑞科转债    | 1,926,373.75 | 0.01 |
| 135 | 113649 | 丰山转债    | 1,894,220.25 | 0.01 |
| 136 | 123186 | 志特转债    | 1,863,216.25 | 0.01 |
| 137 | 123161 | 强联转债    | 1,806,701.95 | 0.01 |
| 138 | 127060 | 湘佳转债    | 1,705,687.37 | 0.01 |
| 139 | 118006 | 阿拉转债    | 1,690,213.42 | 0.01 |
| 140 | 113681 | 镇洋转债    | 1,640,817.35 | 0.01 |
| 141 | 128119 | 龙大转债    | 1,577,639.11 | 0.01 |
| 142 | 113627 | 太平转债    | 1,505,840.20 | 0.01 |
| 143 | 113652 | 伟 22 转债 | 1,424,186.10 | 0.01 |
| 144 | 113656 | 嘉诚转债    | 1,394,574.81 | 0.01 |
| 145 | 118029 | 富淼转债    | 1,296,456.46 | 0.01 |
| 146 | 128144 | 利民转债    | 1,294,827.78 | 0.01 |
| 147 | 127087 | 星帅转 2   | 1,241,724.93 | 0.00 |
| 148 | 123166 | 蒙泰转债    | 1,007,577.62 | 0.00 |
| 149 | 123146 | 中环转 2   | 992,643.84   | 0.00 |
| 150 | 110076 | 华海转债    | 981,694.44   | 0.00 |
| 151 | 123144 | 裕兴转债    | 937,591.78   | 0.00 |
| 152 | 111004 | 明新转债    | 871,782.43   | 0.00 |
| 153 | 123220 | 易瑞转债    | 829,321.23   | 0.00 |

|     |        |          |            |      |
|-----|--------|----------|------------|------|
| 154 | 113640 | 苏利转债     | 822,766.67 | 0.00 |
| 155 | 127066 | 科利转债     | 804,413.07 | 0.00 |
| 156 | 127046 | 百润转债     | 775,508.68 | 0.00 |
| 157 | 113665 | 汇通转债     | 765,158.81 | 0.00 |
| 158 | 118038 | 金宏转债     | 763,241.56 | 0.00 |
| 159 | 118009 | 华锐转债     | 602,053.66 | 0.00 |
| 160 | 113047 | 旗滨转债     | 583,528.62 | 0.00 |
| 161 | 123240 | 楚天转债     | 559,703.07 | 0.00 |
| 162 | 123184 | 天阳转债     | 527,793.21 | 0.00 |
| 163 | 113677 | 华懋转债     | 517,070.22 | 0.00 |
| 164 | 123185 | 能辉转债     | 508,307.32 | 0.00 |
| 165 | 127062 | 垒知转债     | 506,746.45 | 0.00 |
| 166 | 123065 | 宝莱转债     | 502,199.28 | 0.00 |
| 167 | 123171 | 共同转债     | 396,131.74 | 0.00 |
| 168 | 123175 | 百畅转债     | 392,083.47 | 0.00 |
| 169 | 123200 | 海泰转债     | 366,093.22 | 0.00 |
| 170 | 118011 | 银微转债     | 334,644.02 | 0.00 |
| 171 | 128066 | 亚泰转债     | 300,503.26 | 0.00 |
| 172 | 111001 | 山玻转债     | 250,793.27 | 0.00 |
| 173 | 123182 | 广联转债     | 218,327.35 | 0.00 |
| 174 | 127074 | 麦米转 2    | 167,448.92 | 0.00 |
| 175 | 118020 | 芳源转债     | 138,606.98 | 0.00 |
| 176 | 132026 | G 三峡 EB2 | 14,210.54  | 0.00 |
| 177 | 127018 | 本钢转债     | 952.26     | 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<br>券A    | 易方达裕祥回报债<br>券C   |
|-------------------------------|-------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 18,579,806,921.94 | 1,118,504,551.62 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 909,001,893.42    | 143,255,764.41   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 3,882,007,816.39  | 942,181,795.35   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                 | -                |

|             |                   |                |
|-------------|-------------------|----------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 15,606,800,998.97 | 319,578,520.68 |
|-------------|-------------------|----------------|

## § 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

二〇二四年十月二十五日