

易方达裕丰回报债券型证券投资基金

2024 年第 1 季度报告

2024 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：二〇二四年四月二十日

§ 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 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达裕丰回报债券
基金主代码	000171
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 8 月 23 日
报告期末基金份额总额	10,851,500,095.43 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、本基金通过对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性等因素的分析，判断一、二级市场价差的大小，制定新股申购策略；本基金二级市场股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选成长性优势企业进行投资。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	中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%	
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	易方达裕丰回报债券 A	易方达裕丰回报债券 C
下属分级基金的交易代码	000171	016479
报告期末下属分级基金的份额总额	10,646,285,685.21 份	205,214,410.22 份

注：自 2022 年 8 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 24 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
--------	-----

	(2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)	
	易方达裕丰回报债券 A	易方达裕丰回报债券 C
1.本期已实现收益	206,198,084.59	3,076,924.62
2.本期利润	359,677,216.81	4,559,997.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0317	0.0248
4.期末基金资产净值	18,209,023,776.17	348,503,538.89
5.期末基金份额净值	1.710	1.698

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

易方达裕丰回报债券 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	1.91%	0.23%	2.12%	0.11%	-0.21%	0.12%
过去六个月	1.30%	0.21%	2.68%	0.10%	-1.38%	0.11%
过去一年	1.42%	0.18%	3.93%	0.09%	-2.51%	0.09%
过去三年	4.97%	0.24%	9.83%	0.11%	-4.86%	0.13%
过去五年	25.34%	0.29%	19.11%	0.10%	6.23%	0.19%
自基金合同生效起至今	117.71%	0.28%	55.76%	0.07%	61.95%	0.21%

易方达裕丰回报债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	1.80%	0.23%	2.12%	0.11%	-0.32%	0.12%
过去六个月	1.07%	0.21%	2.68%	0.10%	-1.61%	0.11%
过去一年	1.01%	0.18%	3.93%	0.09%	-2.92%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.77%	0.20%	4.61%	0.10%	-3.84%	0.10%

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

易方达裕丰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

易方达裕丰回报债券 A

(2013 年 8 月 23 日至 2024 年 3 月 31 日)



易方达裕丰回报债券 C

(2022 年 8 月 24 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：1.自 2022 年 8 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 24 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自 2020 年 7 月 9 日起，本基金业绩比较基准由“同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率（税后）+1.5%”调整为“中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 117.71%，同期业绩比较基准收益率为 55.76%；C 类基金份额净值增长率为 0.77%，同期业绩比较基准收益率为 4.61%。

§ 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	本基金的基金经理，易方达安心回报债券、易方达	2014-01-09	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯(深圳)

华	<p>丰和债券、易方达安盈回报混合、易方达新收益混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达全球配置混合（QDII）的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员</p>				<p>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、多资产投资业务总部总经理，易方达裕如混合、易方达新收益混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞选混合、易方达裕祥回报债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞程混合、易方达瑞弘混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达鑫转添利混合、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达丰华债券、易方达磐固六个月持有混合的基金经理。</p>
张雅君	<p>本基金的基金经理，易方达裕富债券、易方达招易一年持有混合、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合的基金经理，易方达安心回报债券、易方达丰和债券的基金经理助理，多资产公募投资部总经理、多资产研究部总经理</p>	2017-07-28	-	15 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、混合资产投资部总经理助理、多资产公募投资部负责人，易方达增强回报债券、易方达纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达裕祥回报债券、易方达富惠纯债债券、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒益定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式的基金经理。</p>

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合规守信情况的说明

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 10 次，其中 8 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

一季度国内经济环比改善，经济回升的幅度超出年初市场的预期，但经济内生动力依然较弱，市场价格指数依然低迷，资产价格对于经济的回升反映也较为平淡，债券收益率大幅度下行，债券收益率尤其是长债收益率不断地创出新低，收益率曲线极度平坦化；股票市场先跌后涨，一季度整体持平；房价持续下跌，一手房销售持续下滑。市场对于经济的中长期预期依然悲观。目前资产价格走势与宏观经济之间出现较大的背离，这种背离何时会收敛，及以何种方式收敛是未来市场走势的关键。

具体来看，一季度经济两个比较显著的拉动因素，一是出口强于季节性数据，主要得益于人民币贬值以及低通胀带来的相对价格优势，带动中国出口份额提升；二是政府支出加速、企业中长期信贷有较强韧性，带动制造业投资回升，此外春节期间消费修复也贡献了短期脉冲效果。不过从目前财政情况来看，对重点化解地方债务地区的融资管控较为严格，年初以来前述地区基建活动明显回落，抵消了非化解地方债务地区建筑活动的高增，按照目前债务管控的力度推算，预计全年城投净融资的减少与去年特别国债投放的影响相互抵消，这会明显削弱后续财政扩张的力度。另外，地产还在恶化，虽然二手房销售有所回暖，但难以对新房形成传导，施工和新开工也在持续下滑。就业数据较为疲弱，居民信心不足，内生消费倾向依然维持低位。价格指标低位回升，剔除春节假期影响后核心 CPI（消费者物价指数）仍然低迷，特别是服务分项弱于季节性数据，劳动力价格疲弱的局面延续；PPI（生产者价格指数）剔除油价影响后，由中国自身供求关系决定的大宗商品价格也仍在低位。房地产产业链和“服务业就业-工资”的低迷压制了价格水平的回升，在缺乏外生政策刺激情况下，内生趋势较难扭转，低通胀的格局恐将在较长时间内延续。

在经济低位温和改善的环境下，权益市场整体维持震荡态势，1月在流动性冲击下出现较大回撤，2月之后超跌反弹，直至季末主要宽基指数修复至年初点位附近。行业层面，低增长、低通胀环境下，低波动、高分红策略持续有较好表现，尤其是供给并未大幅扩张、受价格压力影响较小的上游资源行业，此外受益于海外通胀环境的家电行业也有较好表现。

债券收益率快速下行，走出顺畅的牛市行情，10年期国债收益率一举突破历史低点，最低下探至 2.30% 以下。期限结构上，超长端的表现最为突出，30年期与 10年期国债收益率利差已经压缩至 20bp 以内的历史极端水平，这一方面是因为政府债券供给较少，而机构对长久期资产的配置需求强烈，另一方面部分非传统债券投资者通过 30 年国债期货参与债券市场行情，带动超长久期利率债和信用债活跃度大幅改善。整个季度，1年期、10年期和 30年期国债收益率分别下行 36bp、27bp 和 37bp，信用利差和期限利差均保持在历史较低水平。

转债市场跟随股票市场、特别是小盘股的下跌出现了估值压缩的情形，这不仅反应在转股溢价率的压缩，纯债溢价率的压缩同样明显。上证指数一季度上涨 2.23%，国证 2000 指数和中证转债指数分别下跌 8.83% 和 0.81%，由于转债市场剩余期限的持

续缩短，以及信用风险的逐渐演绎，转债市场内部价格的分化在逐渐加大。

报告期内，本基金规模有所下降。股票方面，随着投资者赎回而卖出银行、食品饮料、电气设备等，整体仓位变化不大，仍保持在较高的仓位。转债方面，仓位提升，主要出于一部分高质量公司转债风险收益比持续抬升的角度考量，同时策略上更积极注重凸性价格区间的变化，个券注重考量个股空间和转债溢价率的均衡。债券方面，年初考虑到经济基本面、市场风险偏好、债券供需格局等因素均较为有利，组合加仓超长及长久期利率品种，大幅提升久期水平，随着信用利差逐渐压缩至极低水平，将部分流动性溢价品种置换为利率品种以保持更好的流动性；收益率下行至低位后，季末适当降低债券久期，但仍保持中性偏长；一季度短端资金利率保持稳定、流动性宽松，组合始终保持较高的杠杆水平，同时关注信用风险，积极对持仓个券进行优化调整。

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 1.710 元，本报告期份额净值增长率为 1.91%，同期业绩比较基准收益率为 2.12%；C 类基金份额净值为 1.698 元，本报告期份额净值增长率为 1.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.12%。

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	3,547,601,259.36	15.27
	其中：股票	3,547,601,259.36	15.27
2	固定收益投资	19,385,115,345.66	83.43
	其中：债券	18,739,321,741.49	80.66
	资产支持证券	645,793,604.17	2.78

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	83,018,794.37	0.36
	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	141,285,330.15	0.61
7	其他资产	76,803,364.55	0.33
8	合计	23,233,824,094.09	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	226,427,860.80	1.22
C	制造业	1,996,966,556.39	10.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	162,350,505.45	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	205,075,418.38	1.11
J	金融业	874,057,529.84	4.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	82,723,388.50	0.45
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	3,547,601,259.36	19.12

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	600036	招商银行	11,606,127	373,717,289.40	2.01
2	600519	贵州茅台	209,709	357,113,456.10	1.92
3	000858	五粮液	2,284,166	350,642,322.66	1.89
4	600486	扬农化工	6,461,082	331,195,063.32	1.78
5	601658	邮储银行	51,502,835	244,638,466.25	1.32
6	002415	海康威视	7,389,781	237,655,356.96	1.28
7	600309	万华化学	2,845,950	235,644,660.00	1.27
8	600028	中国石化	35,434,720	226,427,860.80	1.22
9	688188	柏楚电子	745,241	205,075,418.38	1.11
10	600886	国投电力	10,787,409	162,350,505.45	0.87

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	2,427,651,263.74	13.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,751,550,571.22	63.32
	其中：政策性金融债	1,232,962,641.81	6.64
4	企业债券	588,389,576.97	3.17
5	企业短期融资券	183,521,183.61	0.99
6	中期票据	1,892,925,952.84	10.20
7	可转债（可交换债）	1,649,775,537.37	8.89
8	同业存单	-	-
9	其他	245,507,655.74	1.32
10	合计	18,739,321,741.49	100.98

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	240004	24 付息国债 04	24,100,000	2,427,651,263.74	13.08
2	2128051	21 工商银行二级 02	9,500,000	983,644,327.87	5.30
3	2128047	21 招商银行永续 债	7,400,000	769,789,488.52	4.15
4	2128030	21 交通银行二级	7,350,000	768,971,057.38	4.14
5	092280069	22 华夏银行二级 资本债 01	6,500,000	672,624,617.49	3.62

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	189847	21LJZ 优	1,600,000	160,969,400.99	0.87
2	260418	G 黄河优	800,000	82,075,629.59	0.44
3	112561	22 和闽优	600,000	61,402,671.59	0.33
4	135755	22 吉电优	400,000	41,191,402.19	0.22
5	199204	23 华兴优	400,000	40,216,854.73	0.22
6	199694	G23XH 优	300,000	31,395,981.37	0.17
7	112592	G 重庆优	200,000	20,664,446.03	0.11
8	180204	22 葛洲优	200,000	20,441,623.01	0.11
9	199670	23 中公 1A	200,000	20,407,994.52	0.11
10	193933	和皖 A	200,000	20,386,137.07	0.11

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，招商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深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、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	480,276.89
2	应收证券清算款	61,760,412.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,562,675.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	76,803,364.55

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	113060	浙 22 转债	115,583,762.36	0.62
2	113641	华友转债	111,033,986.01	0.60
3	113021	中信转债	98,076,378.24	0.53
4	110079	杭银转债	66,998,083.98	0.36
5	113056	重银转债	41,234,330.44	0.22
6	113050	南银转债	38,520,146.85	0.21
7	128048	张行转债	38,118,678.07	0.21
8	113037	紫银转债	38,041,059.78	0.20
9	128129	青农转债	34,199,054.52	0.18
10	113049	长汽转债	33,502,267.14	0.18
11	127049	希望转 2	31,297,529.26	0.17

12	123190	道氏转 02	30,248,927.23	0.16
13	128081	海亮转债	29,487,590.13	0.16
14	123210	信服转债	27,017,204.56	0.15
15	110062	烽火转债	26,448,252.00	0.14
16	128083	新北转债	26,327,200.18	0.14
17	123194	百洋转债	26,247,881.57	0.14
18	123119	康泰转 2	25,745,778.63	0.14
19	113033	利群转债	25,406,400.00	0.14
20	110073	国投转债	23,151,232.57	0.12
21	123035	利德转债	23,013,970.22	0.12
22	127089	晶澳转债	19,580,758.50	0.11
23	113058	友发转债	19,431,740.88	0.10
24	123221	力诺转债	19,334,822.34	0.10
25	118030	睿创转债	18,062,391.21	0.10
26	118019	金盘转债	17,326,855.11	0.09
27	110063	鹰 19 转债	16,734,013.59	0.09
28	123176	精测转 2	15,675,579.69	0.08
29	128130	景兴转债	15,396,265.28	0.08
30	127091	科数转债	15,099,660.50	0.08
31	110084	贵燃转债	15,013,411.72	0.08
32	127045	牧原转债	14,685,237.56	0.08
33	118043	福立转债	14,542,424.15	0.08
34	128119	龙大转债	14,340,709.65	0.08
35	113549	白电转债	13,988,459.90	0.08
36	128042	凯中转债	13,696,143.47	0.07
37	123131	奥飞转债	13,025,090.27	0.07
38	123213	天源转债	12,952,915.97	0.07
39	111017	蓝天转债	12,554,486.49	0.07
40	128141	旺能转债	12,442,742.86	0.07
41	123219	宇瞳转债	12,347,855.42	0.07
42	127050	麒麟转债	12,242,279.91	0.07
43	127040	国泰转债	12,234,649.40	0.07
44	123158	宙邦转债	11,566,045.96	0.06
45	123179	立高转债	11,274,933.15	0.06
46	110077	洪城转债	10,746,197.86	0.06
47	118012	微芯转债	9,984,821.88	0.05
48	110094	众和转债	9,206,422.64	0.05
49	111015	东亚转债	8,216,963.00	0.04
50	123133	佩蒂转债	7,785,707.57	0.04
51	113677	华懋转债	7,719,662.44	0.04
52	113044	大秦转债	7,465,116.98	0.04
53	123150	九强转债	7,223,086.47	0.04
54	123172	漱玉转债	6,747,879.12	0.04

55	110090	爱迪转债	6,547,529.82	0.04
56	128128	齐翔转 2	6,083,150.55	0.03
57	127018	本钢转债	5,984,208.88	0.03
58	113519	长久转债	5,837,790.39	0.03
59	132020	19 蓝星 EB	5,779,201.55	0.03
60	123208	孩王转债	5,762,858.03	0.03
61	118034	晶能转债	5,632,356.19	0.03
62	123184	天阳转债	4,600,347.85	0.02
63	128135	洽洽转债	4,177,346.27	0.02
64	113601	塞力转债	4,103,502.69	0.02
65	123170	南电转债	3,971,165.40	0.02
66	127063	贵轮转债	3,935,058.95	0.02
67	113649	丰山转债	3,928,065.89	0.02
68	113582	火炬转债	3,872,858.71	0.02
69	123048	应急转债	3,667,124.49	0.02
70	127035	濮耐转债	3,329,585.44	0.02
71	123174	精锻转债	3,016,858.54	0.02
72	113616	韦尔转债	2,997,411.23	0.02
73	113047	旗滨转债	2,613,511.45	0.01
74	123171	共同转债	2,505,038.47	0.01
75	123104	卫宁转债	2,391,337.21	0.01
76	113068	金铜转债	2,365,304.03	0.01
77	113062	常银转债	2,146,399.04	0.01
78	123108	乐普转 2	1,935,010.65	0.01
79	113584	家悦转债	1,877,541.42	0.01
80	123114	三角转债	1,397,988.09	0.01
81	123191	智尚转债	756,441.79	0.00
82	123117	健帆转债	555,337.87	0.00
83	123157	科蓝转债	446,209.25	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

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	易方达裕丰回报债 券A	易方达裕丰回报债 券C
报告期期初基金份额总额	12,300,761,278.27	219,047,808.36
报告期期间基金总申购份额	411,547,971.48	89,847,894.34

减：报告期期间基金总赎回份额	2,066,023,564.54	103,681,292.48
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	10,646,285,685.21	205,214,410.22

§ 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

单位：份

项目	易方达裕丰回报债券 A	易方达裕丰回报债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	441,917,163.95	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	65,000,000.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	376,917,163.95	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.5404	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2024-03-01	-65,000,000.00	-111,280,000.00	-
合计			-65,000,000.00	-111,280,000.00	

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达裕丰回报债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达裕丰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

二〇二四年四月二十日