

# 易方达裕丰回报债券型证券投资基金

## 2020 年第 3 季度报告

2020 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：二〇二〇年十月二十八日

## § 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 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 易方达裕丰回报债券  |
| 基金主代码      | 000171   |
| 交易代码       | 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 | 9,173,747,040.13 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       | 本基金密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在债券、股票和 |

|        |   |
|--------|---|
|        | 银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。债券投资方面，本基金主要通过久期配置、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；股票投资部分，主要采取“自下而上”的投资策略，精选高成长性的优势企业进行投资。 |
| 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  |

注：根据 2020 年 7 月 6 日发布的《易方达基金管理有限公司关于旗下三只基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，易方达基金管理有限公司决定变更易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金合同的业绩比较基准。上述基金业绩比较基准变更及基金合同的修订事宜自 2020 年 7 月 9 日起生效，具体详见公告。

### § 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>(2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | 125,759,995.26                          |
| 2.本期利润         | 540,308,383.78                          |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0660                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 18,014,485,706.05                       |

|            |       |
|------------|-------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.964 |
|------------|-------|

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

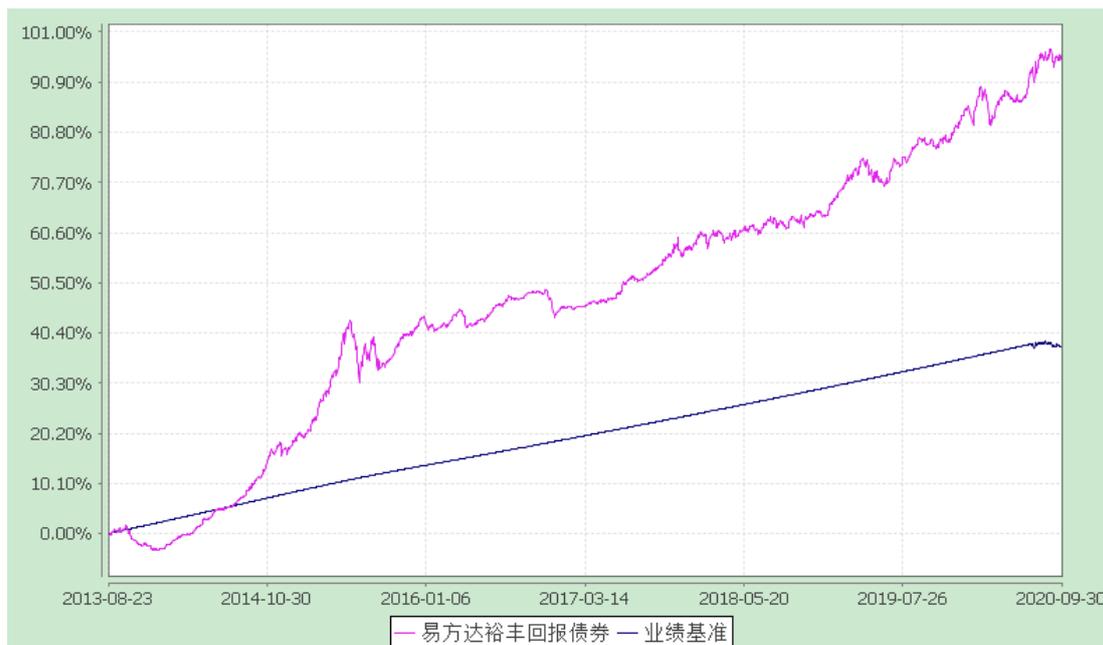
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 3.75%  | 0.40%     | -0.25%     | 0.13%         | 4.00%  | 0.27% |
| 过去六个月      | 6.86%  | 0.33%     | 0.83%      | 0.10%         | 6.03%  | 0.23% |
| 过去一年       | 10.15% | 0.33%     | 3.03%      | 0.07%         | 7.12%  | 0.26% |
| 过去三年       | 27.62% | 0.29%     | 12.30%     | 0.04%         | 15.32% | 0.25% |
| 过去五年       | 45.27% | 0.25%     | 22.44%     | 0.03%         | 22.83% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 96.40% | 0.29%     | 37.67%     | 0.03%         | 58.73% | 0.26% |

注：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%”变更为“中债新综合财富指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”。本基金是债券型基金，投资于债券资产不低于基金资产的 80%，投资于股票资产不高于基金资产的 20%。相比于“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%”，选取“沪深 300 指数收益率”、“中债新综合财富指数收益率”分别作为股票、债券部分的基准，并分别赋予 10%、90%的权重，更贴近本基金的投资范围、投资理念与投资策略，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征，并可提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分

别根据相应的指标计算。

### 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  
(2013 年 8 月 23 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：1.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%”变更为“中债新综合财富指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%”。本基金是债券型基金，投资于债券资产不低于基金资产的 80%，投资于股票资产不高于基金资产的 20%。相比于“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%”，选取“沪深 300 指数收益率”、“中债新综合财富指数收益率”分别作为股票、债券部分的基准，并分别赋予 10%、90%的权重，更贴近本基金的投资范围、投资理念与投资策略，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征，并可提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 96.40%，同期业绩比较基准收益率为 37.67%。

## § 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 |        |   |
| 张清华 | 本基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、混合资产投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员 | 2014-01-09  | -    | 13 年   | 硕士研究生,具有基金从业资格。曾任晨星资讯(深圳)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固定收益基金投资部总经理、投资经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转增利混合型 |

|     |   |            |   |      |   |
|-----|---|------------|---|------|---|
|     |   |            |   |      | 证券投资基金基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理。  |
| 张雅君 | 本基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、混合资产投资部总经理助理 | 2017-07-28 | - | 11 年 | 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、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理。 |

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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、规范化的投资研究和决策流程、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，均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。

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

债券市场方面，三季度在经济持续修复、央行货币政策向常态化回归、市场风险偏好逐渐抬升的背景下，债券收益率呈现震荡上行的态势。7 月市场主要受风险偏好变化的影响，表现出明显的“股债跷跷板”效应，月初股市大涨，债券情绪较弱，长端利率快速上行，下半月随着风险偏好的回落和部分配置力量出现，债市有所回暖，长端利率向下修复。8 月后，经济中观指标短期呈现出较好的改善，同时银行超储率处于偏低水平、同业存单发行利率快速上行，引发市场对流动性的担忧，中短端利率上行幅度大于长端，债券收益率曲线演绎熊平行行情。直到月末附近，资金面紧张态势才有所好转，短端利率上行斜率才略有趋缓。进入

9 月后，经济基本面仍在改善、信用扩张继续，同业存单利率持续上行，同时债市供给增加、季末资金面趋紧，债市继续弱势运行。整个季度来看，10 年期国债和国开债收益率分别大幅上行 30BP 和 60BP，信用债亦跟随无风险利率整体震荡上行，且上行幅度更大，信用利差整体走阔。

权益市场方面，三季度前两月市场整体收涨，各类风格及指数品种均有较好表现，但 9 月以来市场情绪转为谨慎，更多表现为结构性行情的演绎。从二季度末开始，在国内外经济修复和流动性宽松的环境下，金融股快速拉涨带动 A 股走出一波短暂的“全面牛市”行情，风险偏好持续提升，增量资金快速进场，各板块均有较好表现。但市场的短期过热引发监管对部分杠杆行为的警惕，这对市场风险偏好形成压制，7 月中下旬两市交易量见顶。进入 8 月，主板和创业板整体均处于震荡上行状态，市场由流动性驱动逐步过渡为盈利驱动，风格上也表现出成长价值平衡以及大盘股和中小盘股的平衡，部分低估值金融、周期类品种估值有所修复。9 月份之后，美股波动、海外疫情二次爆发以及 A 股整体偏高的估值导致市场情绪持续谨慎，股市呈现下跌趋势，并出现一定程度的风格切换：年初以来持续强势的大消费板块出现明显回调，低估值、顺周期板块则维持震荡，直到 9 月底大消费短期调整结束，风格才较前期略有反转，市场重新回到平衡状态。

报告期内，组合规模有较大幅增长，权益仓位仍维持偏高水平。股票方面，增持光伏、电子，减持家电、交运等行业。转债方面，减持进入赎回期的转债，并增持部分弹性品种。债券方面，组合进一步降低了仓位和久期水平，以获取票息收益为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.964 元，本报告期份额净值增长率为 3.75%，同期业绩比较基准收益率为-0.25%。

## § 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 | 3,301,282,123.89 | 16.42        |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 3,301,282,123.89  | 16.42  |
| 2 | 固定收益投资            | 16,406,944,169.19 | 81.61  |
|   | 其中：债券             | 15,770,683,669.19 | 78.45  |
|   | 资产支持证券            | 636,260,500.00    | 3.17   |
| 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      | 129,785,227.54    | 0.65   |
| 7 | 其他资产              | 264,883,395.77    | 1.32   |
| 8 | 合计                | 20,102,894,916.39 | 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              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 2,764,417,243.31 | 15.35        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| 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  | -                | -            |
| J  | 金融业              | 144,584,231.88   | 0.80         |
| 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       | 213,437,042.00   | 1.18         |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| 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       | 178,843,606.70   | 0.99  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 3,301,282,123.89 | 18.33 |

### 5.3 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  | 601012 | 隆基股份 | 5,334,515 | 400,141,970.15 | 2.22         |
| 2  | 603806 | 福斯特  | 5,336,470 | 381,826,192.30 | 2.12         |
| 3  | 600486 | 扬农化工 | 2,990,531 | 262,269,568.70 | 1.46         |
| 4  | 300628 | 亿联网络 | 3,610,847 | 217,770,182.57 | 1.21         |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 2,102,828 | 213,437,042.00 | 1.18         |
| 6  | 600763 | 通策医疗 | 836,891   | 178,843,606.70 | 0.99         |
| 7  | 600161 | 天坛生物 | 4,026,263 | 160,043,954.25 | 0.89         |
| 8  | 000860 | 顺鑫农业 | 2,574,917 | 154,907,006.72 | 0.86         |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 1,895,938 | 144,584,231.88 | 0.80         |
| 10 | 002250 | 联化科技 | 5,605,261 | 138,393,894.09 | 0.77         |

### 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      | 910,111,800.00   | 5.05         |
|    | 其中：政策性金融债 | 910,111,800.00   | 5.05         |
| 4  | 企业债券      | 5,170,312,661.10 | 28.70        |
| 5  | 企业短期融资券   | 439,081,000.00   | 2.44         |
| 6  | 中期票据      | 7,385,408,000.00 | 41.00        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,865,770,208.09 | 10.36        |

|    |      |                   |       |
|----|------|-------------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -                 | -     |
| 9  | 其他   | -                 | -     |
| 10 | 合计   | 15,770,683,669.19 | 87.54 |

## 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 102001593 | 20 诚通控股 MTN001 A | 2,300,000 | 229,701,000.00 | 1.28                 |
| 2  | 200306    | 20 进出 06         | 2,100,000 | 208,866,000.00 | 1.16                 |
| 3  | 113011    | 光大转债             | 1,723,590 | 203,073,373.80 | 1.13                 |
| 4  | 132018    | G 三峡 EB1         | 1,734,600 | 201,560,520.00 | 1.12                 |
| 5  | 101900731 | 19 豫高管 MTN002    | 1,700,000 | 171,037,000.00 | 0.95                 |

## 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | YA0161 | 荟享 043A  | 400,000 | 40,000,000.00 | 0.22                 |
| 2  | 165515 | 天信 3A    | 300,000 | 29,994,000.00 | 0.17                 |
| 3  | 169003 | 智禾 02A   | 300,000 | 29,937,000.00 | 0.17                 |
| 4  | 169017 | 光借 5A    | 300,000 | 29,898,000.00 | 0.17                 |
| 5  | 165209 | PR 安吉 3A | 580,000 | 28,570,800.00 | 0.16                 |
| 6  | 165814 | PR 安吉 5A | 400,000 | 23,448,000.00 | 0.13                 |
| 7  | 138260 | 链融 18A1  | 200,000 | 20,120,000.00 | 0.11                 |
| 8  | 138332 | 19 桃源 2A | 200,000 | 20,114,000.00 | 0.11                 |
| 9  | 138325 | 国链 17A1  | 200,000 | 20,112,000.00 | 0.11                 |
| 10 | 138407 | 联易融 18   | 200,000 | 20,094,000.00 | 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 2019 年 12 月 27 日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款 180 万元”的行政处罚决定：1、授信审批不审慎；2、为还款来源不清晰的项目办理业务；3、总行对分支机构管控不力承担管理责任。2020 年 2 月 10 日，中国人民银行对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款 1820 万元”的行政处罚决定：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易。2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款 160 万元”的行政处罚决定：光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送（一）分户账明细记录应报未报；（二）关键且应报字段漏报或填报错误；（三）向检查组提供与事实不符的材料；（四）账户设置不能如实反映业务实际。

本基金投资光大转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除光大转债外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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   | 1,104,027.13  |
| 2  | 应收证券清算款 | 38,573,544.24 |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 3 | 应收股利  | -              |
| 4 | 应收利息  | 202,139,791.63 |
| 5 | 应收申购款 | 23,066,032.77  |
| 6 | 其他应收款 | -              |
| 7 | 待摊费用  | -              |
| 8 | 其他    | -              |
| 9 | 合计    | 264,883,395.77 |

## 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<br>(%) |
|----|--------|----------|----------------|----------------------|
| 1  | 113011 | 光大转债     | 203,073,373.80 | 1.13                 |
| 2  | 132018 | G 三峡 EB1 | 201,560,520.00 | 1.12                 |
| 3  | 110053 | 苏银转债     | 160,747,000.00 | 0.89                 |
| 4  | 127005 | 长证转债     | 63,533,741.04  | 0.35                 |
| 5  | 113032 | 桐 20 转债  | 48,827,393.10  | 0.27                 |
| 6  | 110063 | 鹰 19 转债  | 40,242,410.00  | 0.22                 |
| 7  | 128102 | 海大转债     | 38,851,165.98  | 0.22                 |
| 8  | 113020 | 桐昆转债     | 38,471,382.40  | 0.21                 |
| 9  | 113550 | 常汽转债     | 34,532,500.00  | 0.19                 |
| 10 | 128085 | 鸿达转债     | 32,406,387.24  | 0.18                 |
| 11 | 128081 | 海亮转债     | 29,439,614.60  | 0.16                 |
| 12 | 128100 | 搜特转债     | 26,538,436.60  | 0.15                 |
| 13 | 113029 | 明阳转债     | 26,409,908.00  | 0.15                 |
| 14 | 110055 | 伊力转债     | 21,738,217.60  | 0.12                 |
| 15 | 110051 | 中天转债     | 20,227,742.00  | 0.11                 |
| 16 | 128074 | 游族转债     | 17,535,876.20  | 0.10                 |
| 17 | 110066 | 盛屯转债     | 17,321,743.60  | 0.10                 |
| 18 | 110045 | 海澜转债     | 16,804,582.80  | 0.09                 |
| 19 | 113008 | 电气转债     | 14,324,306.40  | 0.08                 |
| 20 | 110061 | 川投转债     | 14,296,451.40  | 0.08                 |
| 21 | 128083 | 新北转债     | 12,877,619.79  | 0.07                 |
| 22 | 110065 | 淮矿转债     | 11,840,000.00  | 0.07                 |
| 23 | 110047 | 山鹰转债     | 10,928,920.80  | 0.06                 |

|    |        |          |               |      |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 24 | 127013 | 创维转债     | 10,836,510.12 | 0.06 |
| 25 | 132014 | 18 中化 EB | 10,536,900.00 | 0.06 |
| 26 | 113528 | 长城转债     | 9,743,200.00  | 0.05 |
| 27 | 128034 | 江银转债     | 9,704,535.12  | 0.05 |
| 28 | 127014 | 北方转债     | 9,106,137.50  | 0.05 |
| 29 | 128098 | 康弘转债     | 8,499,212.50  | 0.05 |
| 30 | 127012 | 招路转债     | 8,481,445.81  | 0.05 |
| 31 | 113549 | 白电转债     | 8,011,911.40  | 0.04 |
| 32 | 113025 | 明泰转债     | 7,826,437.50  | 0.04 |
| 33 | 110056 | 亨通转债     | 7,642,148.40  | 0.04 |
| 34 | 110068 | 龙净转债     | 7,089,525.60  | 0.04 |
| 35 | 128050 | 钧达转债     | 6,964,444.50  | 0.04 |
| 36 | 113017 | 吉视转债     | 5,950,682.60  | 0.03 |
| 37 | 113516 | 苏农转债     | 5,214,023.10  | 0.03 |
| 38 | 132017 | 19 新钢 EB | 5,127,780.00  | 0.03 |
| 39 | 128075 | 远东转债     | 5,061,764.10  | 0.03 |
| 40 | 128078 | 太极转债     | 4,855,838.30  | 0.03 |
| 41 | 123002 | 国祯转债     | 4,568,010.60  | 0.03 |
| 42 | 110043 | 无锡转债     | 4,469,974.50  | 0.02 |
| 43 | 123038 | 联得转债     | 2,773,346.40  | 0.02 |
| 44 | 128018 | 时达转债     | 1,680,203.00  | 0.01 |
| 45 | 110041 | 蒙电转债     | 1,658,227.90  | 0.01 |
| 46 | 128019 | 久立转 2    | 1,360,531.80  | 0.01 |
| 47 | 128099 | 永高转债     | 675,391.64    | 0.00 |
| 48 | 123046 | 天铁转债     | 461,370.00    | 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<br>(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|--------------|----------|
| 1  | 603806 | 福斯特  | 113,843,900.00     | 0.63         | 大宗交易流通受限 |

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                         |                  |
|-------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额             | 7,569,434,341.05 |
| 报告期基金总申购份额              | 2,956,263,805.87 |
| 减：报告期基金总赎回份额            | 1,351,951,106.79 |
| 报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额             | 9,173,747,040.13 |

## § 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

二〇二〇年十月二十八日