

易方达稳健收益债券型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 易方达稳健收益债券 |
| 基金主代码 | 110007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008 年 1 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 13,382,880,535.02 份 |
| 投资目标 | 通过主要投资于债券品种，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、股票主动投资以及新股（含增发）申购之间的配置：1、主要基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2、基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等， |

| | | | |
|-----------------|---|---------------------|-----------------|
| | 预测新股申购的收益率以及风险；3、股票市场走势的预测；4、可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。 | | |
| 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低于混合型基金、股票型基金，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 | 中国银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达稳健收益债券 A | 易方达稳健收益债券 B | 易方达稳健收益债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 110007 | 110008 | 008008 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,680,634,088.51 份 | 10,690,402,088.18 份 | 11,844,358.33 份 |

注：1.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稳健收益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。

2.自 2019 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 10 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 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日) | | |
| | 易方达稳健收益 | 易方达稳健收益 | 易方达稳健收益 |

| | 债券 A | 债券 B | 债券 C |
|--------------------|------------------|-------------------|---------------|
| 1.本期已实现收益 | 20,428,711.37 | 94,823,485.48 | 95,292.95 |
| 2.本期利润 | 107,294,411.92 | 452,058,003.81 | 516,189.07 |
| 3.加权平均基金份额 本期利润 | 0.0387 | 0.0395 | 0.0402 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,575,612,562.82 | 14,296,645,605.23 | 15,805,719.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3339 | 1.3373 | 1.3345 |

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

易方达稳健收益债券 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 | 2.89% | 0.22% | 2.46% | 0.11% | 0.43% | 0.11% |
| 过去六个月 | 5.11% | 0.31% | 0.93% | 0.14% | 4.18% | 0.17% |
| 过去一年 | 6.13% | 0.31% | 1.78% | 0.16% | 4.35% | 0.15% |
| 过去三年 | 23.64% | 0.30% | 9.24% | 0.12% | 14.40% | 0.18% |
| 过去五年 | 31.64% | 0.27% | 2.70% | 0.12% | 28.94% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 177.02% | 0.29% | 15.80% | 0.13% | 161.22% | 0.16% |

易方达稳健收益债券 B

| 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 | 2.96% | 0.22% | 2.46% | 0.11% | 0.50% | 0.11% |
| 过去六个月 | 5.26% | 0.31% | 0.93% | 0.14% | 4.33% | 0.17% |
| 过去一年 | 6.44% | 0.31% | 1.78% | 0.16% | 4.66% | 0.15% |
| 过去三年 | 24.69% | 0.30% | 9.24% | 0.12% | 15.45% | 0.18% |
| 过去五年 | 33.58% | 0.27% | 2.70% | 0.12% | 30.88% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 188.02% | 0.29% | 15.80% | 0.13% | 172.22% | 0.16% |

易方达稳健收益债券 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 | 2.90% | 0.22% | 2.46% | 0.11% | 0.44% | 0.11% |
| 过去六个月 | 5.12% | 0.31% | 0.93% | 0.14% | 4.19% | 0.17% |
| 过去一年 | 6.15% | 0.31% | 1.78% | 0.16% | 4.37% | 0.15% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 9.91% | 0.29% | 2.91% | 0.15% | 7.00% | 0.14% |

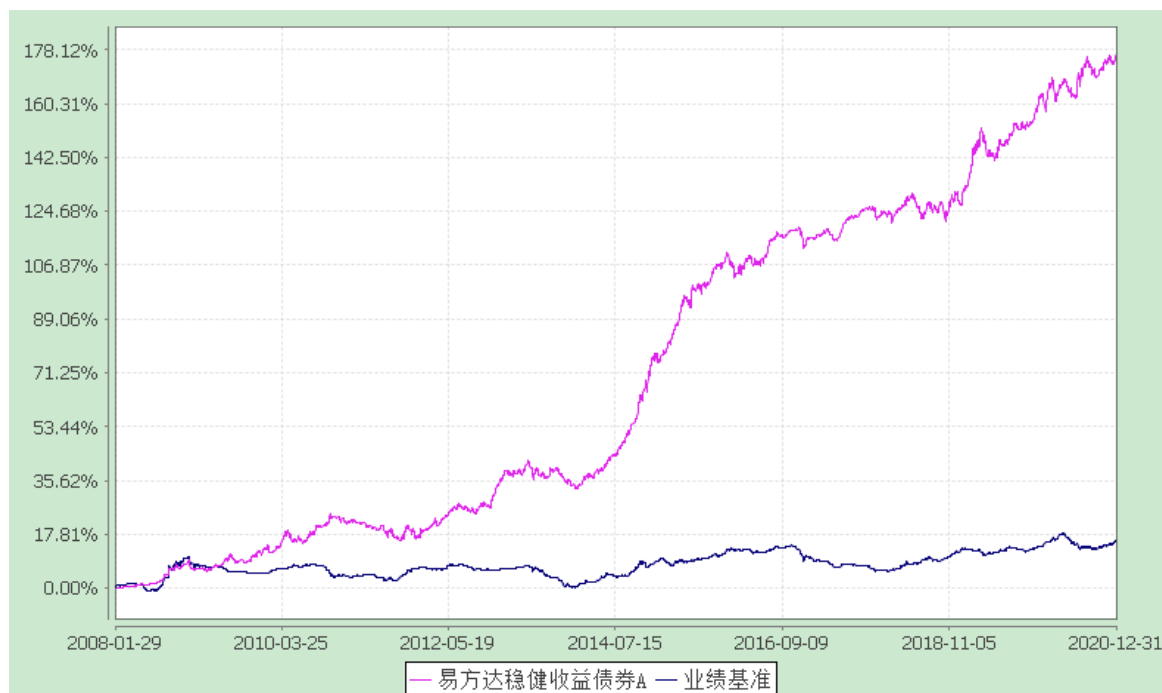
注：自 2020 年 7 月 9 日起，本基金业绩比较基准由“中债总指数（全价）”变更为“中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%”。本基金是债券型基金，投资于债券等固定收益品种不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类品种不高于基金资产的 20%。在业绩比较基准中增加股票部分的基准，能够更加真实、客观地反映本基金的风险收益特征；而将债券部分的基准由反映利率债走势的中债总指数修改为反映境内债券市场走势的中债新综合指数，更贴近本基金的投资范围与投资策略，并可提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性。基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.2 自基金转型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

易方达稳健收益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

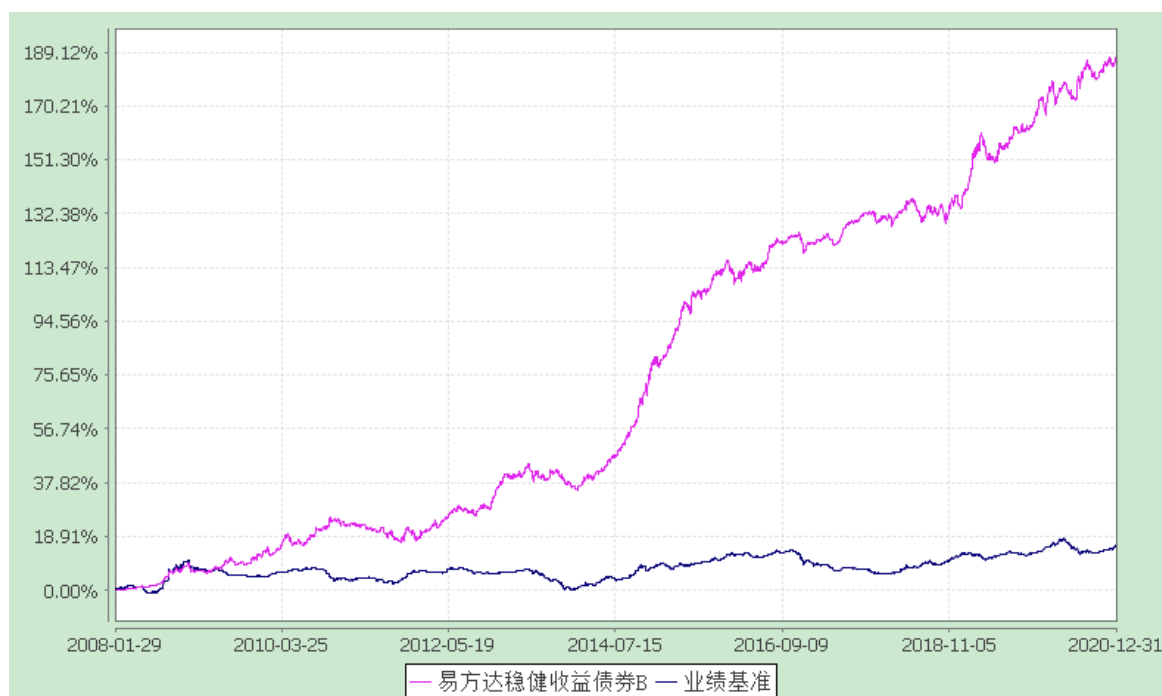
易方达稳健收益债券 A

(2008 年 1 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 B

(2008 年 1 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 C

(2019 年 10 月 24 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：1.本基金转型日期为 2008 年 1 月 29 日。

2.自 2019 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 10 月 24 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.自 2020 年 7 月 9 日起，本基金业绩比较基准由“中债总指数（全价）”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，投资于债券等固定收益品种不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类品种不高于基金资产的 20%。在业绩比较基准中增加股票部分的基准，能够更加真实、客观地反映本基金的风险收益特征；而将债券部分的基准由反映利率债走势的中债总指数修改为反映境内债券市场走势的中债新综合指数，更贴近本基金的投资范围与投资策略，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。

4.自基金转型至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 177.02%，B 类基金份额净值增长率为 188.02%，同期业绩比较基准收益率为 15.80%。C 类基金份额净值增长率为 9.91%，同期业绩比较基准收益率为 2.91%。

§ 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 | | |
| 胡剑 | 本基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员 | 2012-02-29 | - | 14 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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合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 32 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

经济基本面在四季度延续了复苏的趋势。工业增加值增速在 9-11 月份进一步上升至 7% 附近，体现出生产端的恢复力度较强。从需求方来看，基建投资表现较为平稳，房地产投资维持了偏高的增速，制造业投资则持续大幅回升，表现出加快复苏的势头。汽车、餐饮、服装等终端需求持续恢复，零售数据在四季度也加速回升，成为拉动经济增长的重要力量。出口数据则继续保持较高水平，体现出旺盛的海外需求与快速恢复的国内供给形成了较好的良性互动。

通胀方面，CPI 和 PPI 数据持续在低位，反映经济虽然快速恢复但仍在潜在产出

之下，这使得货币政策迅速收紧的必要性不强。融资方面，社融和信贷规模高位维持，整体收缩较为缓慢，且非金融企业和居民的中长期贷款同比多增保持在较高的水平，显示经济内生增长的融资需求较强。

债券市场方面，收益率快速上行的动力有所减弱。市场的主要矛盾从经济恢复、央行货币政策收紧切换到永煤违约带来的对国企、城投信用风险的担忧，信用利差尤其是中低等级级别利差出现快速上行。受此影响，央行调整了货币政策态度，从中性偏紧转为宽松，相应地，债券市场出现一波明显的陡峭化下行行情。收益率整体表现为先上后下，10 年国债整体下行 1BP，3 年 AAA 品种下行 19BP，但是 3 年 AA 上行 34BP。

权益市场在四季度维持振荡上行走势。整个季度来看，沪深 300 指数上涨 13.49%，创业板指上涨 15.72%。行业上基本延续了前期的分化走势，有色金属、电气设备、食品饮料、家用电器等行业涨幅较高，达到 20-30%；商业贸易、传媒、通信、计算机等行业表现较差，整个季度下跌 7-10%。

操作上，组合在四季度保持了相对偏长的有效久期，以超长期限利率债为主，在信用利差拉大的环境下整体表现较为稳健。权益方面，组合保持了相对偏高的股票仓位，转债仓位维持。权益仓位与债券久期形成一定的风险对冲，组合整体在四季度获取较为稳健的持有期收益。

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 1.3339 元，本报告期份额净值增长率为 2.89%，同期业绩比较基准收益率为 2.46%；B 类基金份额净值为 1.3373 元，本报告期份额净值增长率为 2.96%，同期业绩比较基准收益率为 2.46%；C 类基金份额净值为 1.3345 元，本报告期份额净值增长率为 2.90%，同期业绩比较基准收益率为 2.46%。

§ 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 | 3,478,813,831.45 | 15.48 |

| | | | |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| | 其中：股票 | 3,478,813,831.45 | 15.48 |
| 2 | 固定收益投资 | 17,980,741,423.35 | 79.99 |
| | 其中：债券 | 17,278,773,723.35 | 76.86 |
| | 资产支持证券 | 701,967,700.00 | 3.12 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 247,000,490.50 | 1.10 |
| | 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 | 279,676,236.43 | 1.24 |
| 7 | 其他资产 | 493,179,896.90 | 2.19 |
| 8 | 合计 | 22,479,411,878.63 | 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 | 88,547,452.45 | 0.50 |
| C | 制造业 | 1,750,529,313.17 | 9.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 47,050,056.07 | 0.26 |
| E | 建筑业 | 121,364,088.20 | 0.68 |
| F | 批发和零售业 | 1,616,192.85 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 298,254,162.54 | 1.67 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,342,259.70 | 0.01 |
| J | 金融业 | 1,011,118,342.17 | 5.65 |
| K | 房地产业 | 134,153,428.84 | 0.75 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| 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 | 23,838,535.46 | 0.13 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,478,813,831.45 | 19.45 |

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 | 600036 | 招商银行 | 6,255,501 | 274,929,268.95 | 1.54 |
| 2 | 002142 | 宁波银行 | 7,563,464 | 267,292,817.76 | 1.49 |
| 3 | 000401 | 冀东水泥 | 15,624,576 | 221,087,750.40 | 1.24 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 1,996,703 | 196,555,443.32 | 1.10 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 8,823,149 | 170,639,701.66 | 0.95 |
| 6 | 600690 | 海尔智家 | 5,125,894 | 149,727,363.74 | 0.84 |
| 7 | 601636 | 旗滨集团 | 10,430,998 | 133,516,774.40 | 0.75 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 1,352,290 | 124,681,138.00 | 0.70 |
| 9 | 002250 | 联化科技 | 5,083,668 | 121,957,195.32 | 0.68 |
| 10 | 600703 | 三安光电 | 4,411,916 | 119,165,851.16 | 0.67 |

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 | 2,444,466,000.00 | 13.67 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 989,567,000.00 | 5.53 |
| | 其中：政策性金融债 | 969,565,000.00 | 5.42 |
| 4 | 企业债券 | 3,270,815,631.50 | 18.28 |
| 5 | 企业短期融资券 | 49,785,000.00 | 0.28 |
| 6 | 中期票据 | 7,891,376,000.00 | 44.12 |

| | | | |
|----|-----------|-------------------|-------|
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,612,782,091.85 | 14.61 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 19,982,000.00 | 0.11 |
| 10 | 合计 | 17,278,773,723.35 | 96.59 |

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 | 200004 | 20 付息国债 04 | 19,700,000 | 1,835,646,000.00 | 10.26 |
| 2 | 200012 | 20 付息国债 12 | 4,800,000 | 487,248,000.00 | 2.72 |
| 3 | 200201 | 20 国开 01 | 3,200,000 | 320,032,000.00 | 1.79 |
| 4 | 160206 | 16 国开 06 | 2,500,000 | 250,225,000.00 | 1.40 |
| 5 | 101901376 | 19 华能水电 MTN003 | 2,200,000 | 218,944,000.00 | 1.22 |

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 | 169721 | 东花 19A1 | 900,000 | 90,180,000.00 | 0.50 |
| 2 | 169183 | 天信 9A | 900,000 | 89,937,000.00 | 0.50 |
| 3 | 169548 | 建花 15A | 700,000 | 70,266,000.00 | 0.39 |
| 4 | 165644 | PR 安吉 4A | 1,500,000 | 67,755,000.00 | 0.38 |
| 5 | 138393 | 云庐 2A1 | 400,000 | 40,300,000.00 | 0.23 |
| 6 | 138396 | 绿金 8A1 | 400,000 | 40,288,000.00 | 0.23 |
| 7 | 137094 | 厚德 05A | 400,000 | 40,160,000.00 | 0.22 |
| 8 | 169296 | 智禾 05A | 300,000 | 30,063,000.00 | 0.17 |
| 9 | 138407 | 联易融 18 | 200,000 | 20,148,000.00 | 0.11 |
| 10 | 169382 | 长治 02A | 200,000 | 20,078,000.00 | 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 2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计 100 万元”的行政处罚决定：1.2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2.2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。

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。

本基金投资招商银行、宁波银行、光大转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、宁波银行、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 | 834,509.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | 101,401,308.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 240,609,850.12 |
| 5 | 应收申购款 | 150,334,228.83 |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 493,179,896.90 |

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 | 113011 | 光大转债 | 216,604,180.00 | 1.21 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 196,032,188.00 | 1.10 |
| 3 | 132014 | 18 中化 EB | 183,229,255.00 | 1.02 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 166,517,953.80 | 0.93 |
| 5 | 127012 | 招路转债 | 128,324,901.68 | 0.72 |
| 6 | 132018 | G 三峡 EB1 | 126,546,789.60 | 0.71 |
| 7 | 113026 | 核能转债 | 121,214,099.70 | 0.68 |
| 8 | 110045 | 海澜转债 | 98,502,703.60 | 0.55 |
| 9 | 113024 | 核建转债 | 83,511,046.50 | 0.47 |
| 10 | 128081 | 海亮转债 | 65,517,328.50 | 0.37 |
| 11 | 128035 | 大族转债 | 58,881,725.28 | 0.33 |
| 12 | 113014 | 林洋转债 | 58,321,147.50 | 0.33 |
| 13 | 132017 | 19 新钢 EB | 53,712,504.00 | 0.30 |
| 14 | 110043 | 无锡转债 | 53,474,381.10 | 0.30 |
| 15 | 110061 | 川投转债 | 48,957,665.40 | 0.27 |
| 16 | 110041 | 蒙电转债 | 42,646,553.70 | 0.24 |
| 17 | 113034 | 滨化转债 | 42,597,386.30 | 0.24 |
| 18 | 113009 | 广汽转债 | 37,475,581.00 | 0.21 |
| 19 | 128032 | 双环转债 | 37,117,491.02 | 0.21 |
| 20 | 113008 | 电气转债 | 34,945,748.80 | 0.20 |
| 21 | 132020 | 19 蓝星 EB | 32,866,668.00 | 0.18 |
| 22 | 113530 | 大丰转债 | 30,777,824.70 | 0.17 |
| 23 | 128018 | 时达转债 | 27,534,896.24 | 0.15 |
| 24 | 110034 | 九州转债 | 26,498,549.80 | 0.15 |
| 25 | 127016 | 鲁泰转债 | 25,200,285.84 | 0.14 |
| 26 | 128085 | 鸿达转债 | 24,317,021.33 | 0.14 |
| 27 | 110048 | 福能转债 | 24,270,532.00 | 0.14 |
| 28 | 128033 | 迪龙转债 | 22,823,427.36 | 0.13 |
| 29 | 113519 | 长久转债 | 19,884,268.80 | 0.11 |
| 30 | 128013 | 洪涛转债 | 18,675,198.40 | 0.10 |
| 31 | 113012 | 骆驼转债 | 18,110,809.30 | 0.10 |
| 32 | 128026 | 众兴转债 | 17,288,641.22 | 0.10 |

| | | | | |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 33 | 128063 | 未来转债 | 16,531,231.04 | 0.09 |
| 34 | 128037 | 岩土转债 | 15,160,318.80 | 0.08 |
| 35 | 113535 | 大业转债 | 14,600,477.60 | 0.08 |
| 36 | 113528 | 长城转债 | 14,425,842.00 | 0.08 |
| 37 | 128015 | 久其转债 | 13,275,152.40 | 0.07 |
| 38 | 128044 | 岭南转债 | 12,242,105.81 | 0.07 |
| 39 | 128023 | 亚太转债 | 12,038,901.90 | 0.07 |
| 40 | 113025 | 明泰转债 | 11,643,504.00 | 0.07 |
| 41 | 120002 | 18 中原 EB | 6,326,320.00 | 0.04 |
| 42 | 123010 | 博世转债 | 6,133,076.24 | 0.03 |
| 43 | 123028 | 清水转债 | 4,998,932.90 | 0.03 |
| 44 | 113508 | 新风转债 | 3,080,400.00 | 0.02 |
| 45 | 123023 | 迪森转债 | 2,997,692.60 | 0.02 |
| 46 | 110051 | 中天转债 | 838,257.20 | 0.00 |
| 47 | 113030 | 东风转债 | 29,386.00 | 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

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 | 易方达稳健收益 债券A | 易方达稳健收益 债券B | 易方达稳健收益债 券C |
|-----------------------------------|------------------|-------------------|----------------|
| 报告期期初基金份 额总额 | 2,945,904,371.78 | 12,397,538,619.59 | 15,727,925.16 |
| 报告期期间基金总 申购份额 | 408,673,273.40 | 1,512,702,033.34 | 1,874,486.23 |
| 减：报告期期间基 金总赎回份额 | 673,943,556.67 | 3,219,838,564.75 | 5,758,053.06 |
| 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 | 2,680,634,088.51 | 10,690,402,088.18 | 11,844,358.33 |

§ 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. 中国证监会批准易方达月月收益中短期债券投资基金募集的文件；
2. 中国证监会核准易方达月月收益中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议的批复；
3. 《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》；
4. 《易方达稳健收益债券型证券投资基金托管协议》；
5. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

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

二〇二一年一月二十一日