

易方达稳健收益债券型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年四月十九日

§ 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 4 月 16 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 2021 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	15,503,781,514.03 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，属证券投资基金中的低风险品种，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	3,335,016,550.48 份	12,130,107,748.31 份	38,657,215.24 份

注：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 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)		
	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
1.本期已实现收益	40,683,728.47	186,379,105.76	269,577.26
2.本期利润	81,370,690.85	330,656,556.57	451,289.79
3.加权平均基金份额	0.0289	0.0283	0.0235

本期利润			
4.期末基金资产净值	4,508,705,832.66	16,429,700,227.97	52,285,968.09
5.期末基金份额净值	1.3519	1.3545	1.3526

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	2.18%	0.30%	0.55%	0.17%	1.63%	0.13%
过去六个月	5.14%	0.26%	3.02%	0.14%	2.12%	0.12%
过去一年	7.48%	0.28%	-0.25%	0.16%	7.73%	0.12%
过去三年	24.92%	0.31%	8.53%	0.13%	16.39%	0.18%
过去五年	35.34%	0.26%	2.99%	0.12%	32.35%	0.14%
自基金合同生效起至今	183.06%	0.29%	16.44%	0.13%	166.62%	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	2.27%	0.30%	0.55%	0.17%	1.72%	0.13%
过去六个月	5.30%	0.26%	3.02%	0.14%	2.28%	0.12%
过去一年	7.80%	0.28%	-0.25%	0.16%	8.05%	0.12%
过去三年	26.01%	0.31%	8.53%	0.13%	17.48%	0.18%

过去五年	37.35%	0.26%	2.99%	0.12%	34.36%	0.14%
自基金合同生效起至今	194.55%	0.29%	16.44%	0.13%	178.11%	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	2.19%	0.30%	0.55%	0.17%	1.64%	0.13%
过去六个月	5.15%	0.26%	3.02%	0.14%	2.13%	0.12%
过去一年	7.50%	0.28%	-0.25%	0.16%	7.75%	0.12%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.32%	0.29%	3.48%	0.15%	8.84%	0.14%

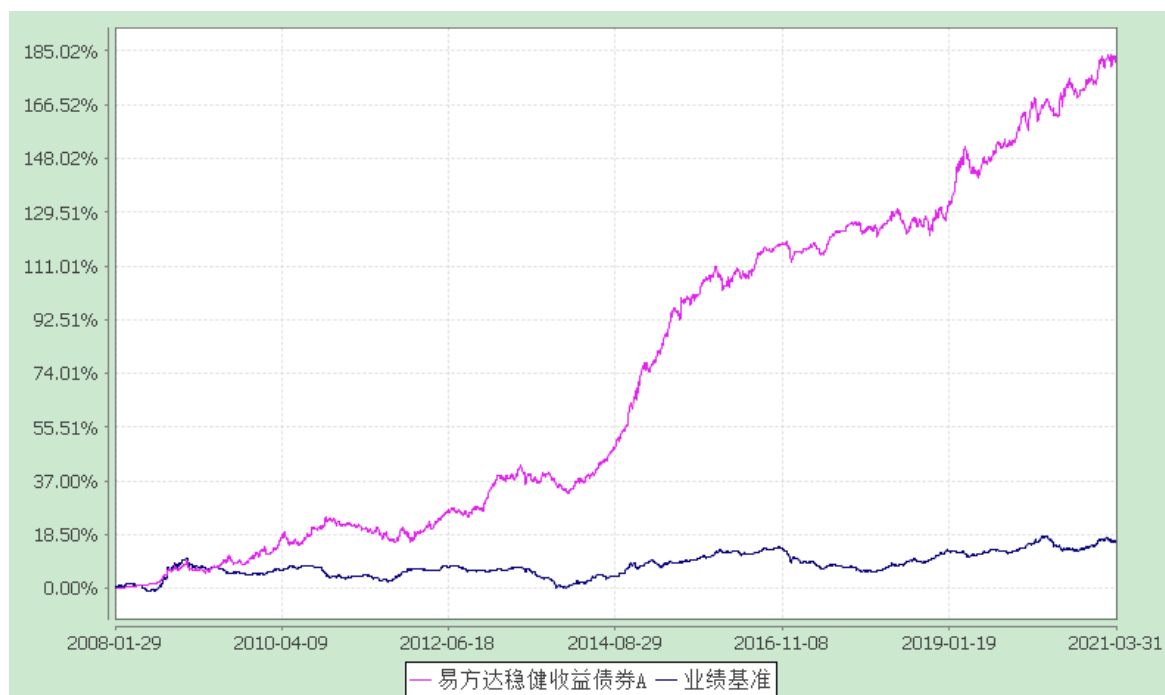
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

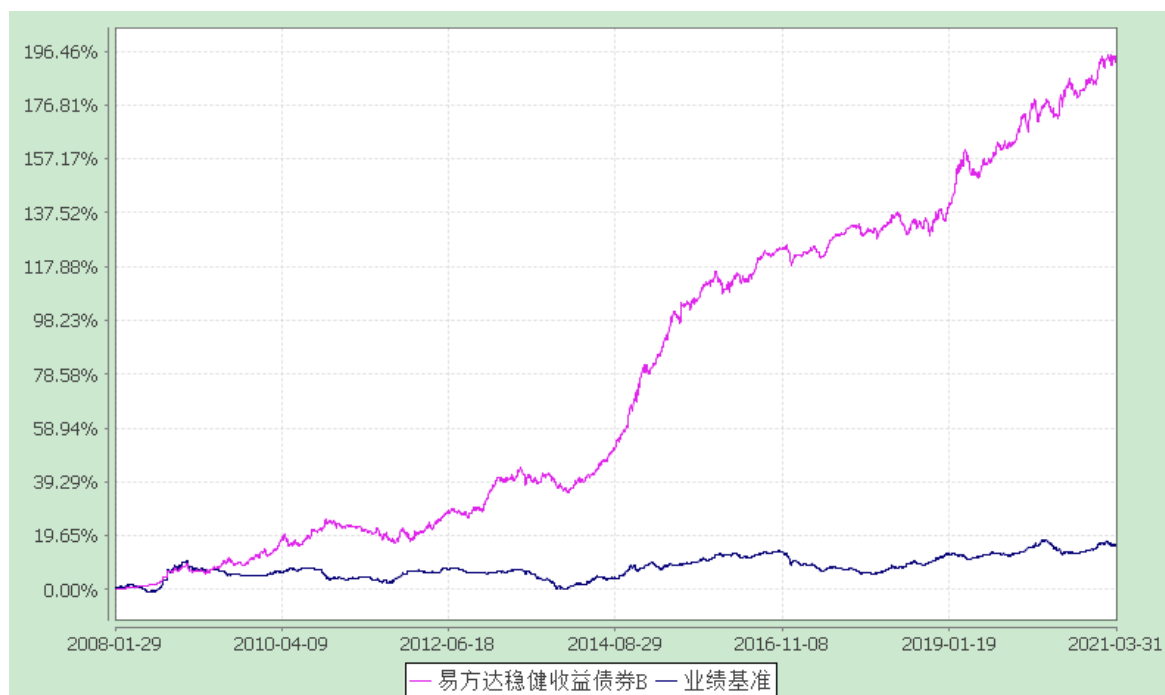
易方达稳健收益债券 A

(2008 年 1 月 29 日至 2021 年 3 月 31 日)



易方达稳健收益债券 B

(2008 年 1 月 29 日至 2021 年 3 月 31 日)



易方达稳健收益债券 C

(2019 年 10 月 24 日至 2021 年 3 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 183.06%，B 类基金份额净值增长率为 194.55%，同期业绩比较基准收益率为 16.44%。C 类基金份额净值增长率为 12.32%，同期业绩比较基准收益率为 3.48%。

§ 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	-	15 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、易方达裕惠回报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 3 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 1-2 月份延续了 2020 年底的复苏势头。工业增加值高速增长，制造业是主要动力。需求面，基建投资小幅回落，房地产销售和投资均保持较高水平，零售端受到就地过年影响而有所走弱。出口拉动作用较为明显。通胀方面保持平稳，但是消费端受服务业影响依然偏弱，中上游价格保持强劲增长，价格分化较大。社融数据 2 月份表现较好，降低了央行过度紧缩的担忧。

从政策面来看，虽然中国央行转向相对较早，但是目前尚未有进一步收紧的动作。体现在资金面上表现为资金利率波动加大，但中枢稳定；在信用层面上，社融数据收

缩相对平稳。总量紧缩政策相对温和，但是针对房地产和地方政府债务的结构性政策相对偏紧。这两方面收缩力度如果较大，可能对经济上行的幅度构成一些负面影响。

债券市场方面，基本面走势对收益率的影响不大，收益率变化主要跟随资金面的变化。资金利率水平变化较大。2020 年 12 月中旬至 2021 年 1 月中旬央行保持了偏低的利率水平带动市场收益率下行，1 月下旬之后跟随央行态度变化，资金面极度收紧，带动曲线出现明显的熊平行行情，这波调整直至 2 月份春节前，资金面持续保持宽松，收益率重新下行。信用债券方面，2 年以内品种表现相对较好，信用债券级别利差有所收窄。

权益市场在一季度先扬后抑，波动较大。年初至 2 月中旬，沪深 300 指数一度上涨超过 10%，后续逐步下跌，最终一季度下跌 3.13%，创业板指下跌 7%。行业钢铁、公用事业、银行、休闲服务等行业涨幅靠前，上涨 10-15%；国防军工、非银金融、通信、计算机等行业表现较差，跌幅达到 10-20%。中证转债指数下跌 0.4%，结构上偏债型和平衡型个券品种表现相对较好。

操作上，组合一季度信用债券部分保持了偏低久期和偏低的杠杆，长端利率债逐步跟随收益率下行有部分减仓，组合整体有效久期有所降低。股票仓位前高后低，有效降低了 2 月下旬以来权益市场波动给组合带来的负面影响。可转债坚持以偏债性个券持仓为主，仓位基本保持稳定。

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 1.3519 元，本报告期份额净值增长率为 2.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.55%；B 类基金份额净值为 1.3545 元，本报告期份额净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.55%；C 类基金份额净值为 1.3526 元，本报告期份额净值增长率为 2.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.55%。

§ 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	3,371,837,568.97	15.66

	其中：股票	3,371,837,568.97	15.66
2	固定收益投资	17,492,525,183.29	81.24
	其中：债券	17,068,025,783.29	79.27
	资产支持证券	424,499,400.00	1.97
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	271,800,727.70	1.26
	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	96,134,720.03	0.45
7	其他资产	298,558,607.99	1.39
8	合计	21,530,856,807.98	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	41,625,786.50	0.20
B	采矿业	97,207,050.19	0.46
C	制造业	1,689,123,640.76	8.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,152,121.11	0.10
E	建筑业	142,811,163.00	0.68
F	批发和零售业	1,757,696.43	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	301,582,687.21	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,769,792.30	0.01
J	金融业	915,879,158.11	4.36
K	房地产业	139,054,918.86	0.66
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	13,450.00	0.00
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	18,860,104.50	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,371,837,568.97	16.06

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	5,287,401	270,186,191.10	1.29
2	000401	冀东水泥	15,624,576	244,524,614.40	1.16
3	002142	宁波银行	6,225,164	242,034,376.32	1.15
4	601012	隆基股份	1,675,175	147,415,400.00	0.70
5	000333	美的集团	1,689,703	138,944,277.69	0.66
6	600519	贵州茅台	67,091	134,785,819.00	0.64
7	600115	东方航空	21,480,717	117,284,714.82	0.56
8	600585	海螺水泥	2,256,725	115,589,454.50	0.55
9	002415	海康威视	2,049,074	114,543,236.60	0.55
10	600690	海尔智家	3,626,716	113,081,004.88	0.54

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	1,103,944,000.00	5.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,601,874,000.00	12.40
	其中：政策性金融债	2,381,956,000.00	11.35
4	企业债券	3,097,266,085.80	14.76
5	企业短期融资券	49,671,000.00	0.24
6	中期票据	6,949,631,500.00	33.11

7	可转债（可交换债）	3,245,645,197.49	15.46
8	同业存单	-	-
9	其他	19,994,000.00	0.10
10	合计	17,068,025,783.29	81.31

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	210201	21 国开 01	7,500,000	748,650,000.00	3.57
2	200004	20 付息国债 04	6,900,000	648,669,000.00	3.09
3	200207	20 国开 07	6,000,000	598,320,000.00	2.85
4	200012	20 付息国债 12	4,000,000	407,280,000.00	1.94
5	190202	19 国开 02	3,400,000	340,986,000.00	1.62

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	169183	天信 9A	900,000	90,216,000.00	0.43
2	169548	建花 15A	700,000	70,840,000.00	0.34
3	165644	PR 安吉 4A	1,500,000	53,985,000.00	0.26
4	137094	厚德 05A	400,000	40,268,000.00	0.19
5	169296	智禾 05A	300,000	30,114,000.00	0.14
6	169382	长治 02A	200,000	20,100,000.00	0.10
7	179460	璀璨 16A	200,000	19,818,000.00	0.09
8	169272	博雅 1A	160,000	16,070,400.00	0.08
9	165814	PR 安吉 5A	300,000	11,964,000.00	0.06
10	169236	东借 06A1	100,000	10,143,000.00	0.05

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 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 元人民币”的行政处罚决定。

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 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。2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。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	672,804.51

2	应收证券清算款	28,985,420.96
3	应收股利	-
4	应收利息	228,973,956.74
5	应收申购款	39,926,425.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	298,558,607.99

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	213,142,150.00	1.02
2	110059	浦发转债	197,765,282.00	0.94
3	132014	18 中化 EB	187,963,408.00	0.90
4	110053	苏银转债	173,408,776.20	0.83
5	127012	招路转债	131,495,845.52	0.63
6	132018	G 三峡 EB1	131,133,452.80	0.62
7	113026	核能转债	124,226,576.60	0.59
8	110045	海澜转债	104,572,275.20	0.50
9	113024	核建转债	85,658,685.00	0.41
10	128129	青农转债	72,104,867.70	0.34
11	128081	海亮转债	67,235,382.50	0.32
12	128035	大族转债	60,595,214.64	0.29
13	110064	建工转债	60,400,257.10	0.29
14	113037	紫银转债	58,933,201.60	0.28
15	132017	19 新钢 EB	56,158,713.00	0.27
16	110041	蒙电转债	55,577,769.30	0.26
17	110061	川投转债	53,520,646.20	0.25
18	113014	林洋转债	53,020,667.70	0.25
19	127018	本钢转债	52,552,268.40	0.25
20	113534	鼎胜转债	47,321,836.50	0.23
21	113034	滨化转债	43,122,424.70	0.21
22	128032	双环转债	41,142,370.44	0.20
23	127007	湖广转债	38,945,536.50	0.19
24	110073	国投转债	37,864,505.80	0.18
25	113039	嘉泽转债	36,351,489.20	0.17
26	110043	无锡转债	36,180,319.00	0.17

27	132020	19 蓝星 EB	36,088,200.00	0.17
28	113017	吉视转债	35,775,460.00	0.17
29	113009	广汽转债	33,879,261.00	0.16
30	123010	博世转债	31,842,372.20	0.15
31	113530	大丰转债	30,805,830.00	0.15
32	128128	齐翔转 2	30,803,619.63	0.15
33	113525	台华转债	28,943,292.00	0.14
34	110048	福能转债	26,183,671.80	0.12
35	127016	鲁泰转债	25,312,491.12	0.12
36	110034	九州转债	24,923,794.40	0.12
37	128116	瑞达转债	22,564,520.96	0.11
38	113036	宁建转债	21,094,306.80	0.10
39	113012	骆驼转债	19,936,515.60	0.09
40	128013	洪涛转债	19,302,308.80	0.09
41	113578	全筑转债	18,922,688.00	0.09
42	113603	东缆转债	17,311,457.20	0.08
43	127014	北方转债	16,043,164.00	0.08
44	113519	长久转债	15,817,758.00	0.08
45	128026	众兴转债	15,749,631.66	0.08
46	128063	未来转债	15,662,804.48	0.07
47	128037	岩土转债	15,471,832.20	0.07
48	128117	道恩转债	15,029,938.60	0.07
49	127021	特发转 2	14,962,470.75	0.07
50	113535	大业转债	14,402,721.60	0.07
51	113528	长城转债	14,126,936.00	0.07
52	113033	利群转债	13,675,200.20	0.07
53	128015	久其转债	13,409,079.20	0.06
54	110056	亨通转债	13,267,378.20	0.06
55	128044	岭南转债	11,987,762.84	0.06
56	128023	亚太转债	11,838,686.10	0.06
57	113549	白电转债	8,967,148.40	0.04
58	128033	迪龙转债	8,864,856.74	0.04
59	110071	湖盐转债	7,859,200.00	0.04
60	128072	翔鹭转债	7,614,341.70	0.04
61	120002	18 中原 EB	6,194,160.00	0.03
62	113601	塞力转债	6,110,947.70	0.03
63	113532	海环转债	5,059,151.70	0.02
64	123028	清水转债	4,578,480.40	0.02
65	128069	华森转债	4,566,276.00	0.02
66	113505	杭电转债	4,240,196.10	0.02
67	123023	迪森转债	4,162,477.92	0.02
68	123061	航新转债	3,502,765.20	0.02
69	123044	红相转债	3,103,200.00	0.01

70	110052	贵广转债	2,945,708.00	0.01
71	113567	君禾转债	2,302,652.50	0.01
72	123039	开润转债	1,517,056.54	0.01
73	128100	搜特转债	1,441,710.00	0.01
74	123011	德尔转债	1,151,865.36	0.01
75	110051	中天转债	840,928.60	0.00
76	113508	新风转债	816,748.00	0.00
77	128105	长集转债	692,338.50	0.00
78	128070	智能转债	351,322.00	0.00
79	113030	东风转债	28,571.20	0.00
80	128131	崇达转 2	7,908.80	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 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000401	冀东水泥	244,524,614.40	1.16	重大事项停牌

§ 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	2,680,634,088.51	10,690,402,088.18	11,844,358.33
报告期期间基金总申购份额	1,467,163,523.22	3,696,856,942.47	28,958,155.95
减：报告期期间基金总赎回份额	812,781,061.25	2,257,151,282.34	2,145,299.04
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	3,335,016,550.48	12,130,107,748.31	38,657,215.24

§ 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

二〇二一年四月十九日