**易方达稳健收益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：中国银行股份有限公司**

**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。

基金托管人中国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 | 15,359,170,916.53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 | 2,945,904,371.78份 | 12,397,538,619.59份 | 15,727,925.16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7月1日-2020年9月30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 | 98,424,740.93 | 441,327,962.11 | 538,083.71 |
| 2.本期利润 | 95,554,707.54 | 415,486,495.85 | 485,206.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0318 | 0.0323 | 0.0306 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,931,937,530.36 | 16,576,473,473.14 | 21,000,027.68 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3347 | 1.3371 | 1.3352 |

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 | 2.16% | 0.37% | -1.49% | 0.16% | 3.65% | 0.21% |
| 过去六个月 | 2.22% | 0.30% | -3.17% | 0.17% | 5.39% | 0.13% |
| 过去一年 | 6.95% | 0.30% | 0.18% | 0.15% | 6.77% | 0.15% |
| 过去三年 | 19.38% | 0.30% | 5.11% | 0.12% | 14.27% | 0.18% |
| 过去五年 | 34.05% | 0.27% | 2.61% | 0.12% | 31.44% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 169.23% | 0.29% | 13.02% | 0.13% | 156.21% | 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 | 2.23% | 0.37% | -1.49% | 0.16% | 3.72% | 0.21% |
| 过去六个月 | 2.37% | 0.30% | -3.17% | 0.17% | 5.54% | 0.13% |
| 过去一年 | 7.27% | 0.30% | 0.18% | 0.15% | 7.09% | 0.15% |
| 过去三年 | 20.40% | 0.30% | 5.11% | 0.12% | 15.29% | 0.18% |
| 过去五年 | 36.02% | 0.27% | 2.61% | 0.12% | 33.41% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 179.73% | 0.29% | 13.02% | 0.13% | 166.71% | 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 | 2.16% | 0.37% | -1.49% | 0.16% | 3.65% | 0.21% |
| 过去六个月 | 2.23% | 0.30% | -3.17% | 0.17% | 5.40% | 0.13% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 6.82% | 0.31% | 0.45% | 0.16% | 6.37% | 0.15% |

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9月30日）

易方达稳健收益债券B

（2008年1月29日至2020年9月30日）

易方达稳健收益债券C

（2019年10月24日至2020年9月30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169.23%，B类基金份额净值增长率为179.73%，同期业绩比较基准收益率为13.02%。C类基金份额净值增长率为6.82%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

# §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、易方达信用债债券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、易方达瑞富灵活配置混合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、易方达岁丰添利债券型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、易方达富惠纯债债券型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、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、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、副总经理级高级管理人员、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、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、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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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**

受益于良好的疫情控制效果，2020年三季度国内经济基本面维持平稳复苏的走势。工业增加值增速在5-6%附近，环比增速有所波动，但整体表现较为平稳。结构上看，房地产投资保持了较高的增速水平，且在新开工增速提升的情况下，7、8月份同比增速进一步提高到11.8%的较高水平；制造业投资在三季度持续回升，截至8月底已经基本接近去年11月份的水平，体现出经济主体自身的的活跃程度在增强；基建投资则持续有小幅回落，但增速水平仍然保持在去年11月份以来的趋势值之上。从需求端来看，房地产和汽车消费仍然维持较好水平，以餐饮为代表的终端需求的恢复在7月份开始有所加速。未来随着出行和场景消费行政限制的放松，需求端的恢复有望持续。进出口方面，由于海外经济重启，国内快速恢复的供给能力带动出口增速大幅回升，进口数据也有一定程度的恢复，但整体的贸易顺差数据维持高位。

货币政策三季度继续向中性方向回归。银行间存款类金融机构以利率债为质押的7天回购利率（DR007）中枢水平自6月份快速上升至2.2%附近后，三季度基本在该水平保持平稳。信用扩张方面，央行基本保持了相对宽松的信贷环境，但是信用扩张速度有所放缓，体现出政策层面回归中性的意图。不过从社融数据的结构来看，非金融企业和居民部门的中长期贷款持续明显多增，反映经济主体的信心在逐渐恢复，这与制造业投资以及终端需求的恢复一致，说明经济的自身动能在持续增强。

债券市场收益率在三季度出现持续快速回升。政策性金融债收益率平坦化上行55-65BP，国债上行30-50BP。信用债表现相对较好，1年和5年端AAA品种利差分别压缩22BP和27BP，3年端AAA品种由于绝对利差水平不高，且二季度压缩较为明显，本季度变动不大。级别利差水平压缩显著，3年期限AA-与AAA的级别利差在三季度压缩30BP。

权益市场在7月上旬出现明显上涨后维持了振荡走势。整个季度来看，沪深300指数上涨10.17%，创业板指上涨5.6%。结构上看，休闲服务、军工、电器设备、汽车、食品饮料等行业涨幅较高，达到20-30%；通信、商业贸易、计算机等行业表现较差，整个季度下跌3-8%。

操作上，组合在三季度保持了相对偏长的有效久期，积极进行信用债个券置换，提升持仓个券的投资性价比。权益方面，组合保持了相对偏高的股票和转债仓位。权益仓位与债券久期形成一定的风险对冲，股债对冲效果在三季度有明显改善。

**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1.3347元，本报告期份额净值增长率为2.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.49%；B类基金份额净值为1.3371元，本报告期份额净值增长率为2.23%，同期业绩比较基准收益率为-1.49%；C类基金份额净值为1.3352元，本报告期份额净值增长率为2.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.49%。

# §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 | 2,959,227,666.16 | 10.70 |
|  | 其中：股票 | 2,959,227,666.16 | 10.70 |
| 2 | 固定收益投资 | 23,832,702,082.14 | 86.21 |
|  | 其中：债券 | 23,099,145,082.14 | 83.55 |
|  | 资产支持证券 | 733,557,000.00 | 2.65 |
| 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 | 546,738,968.68 | 1.98 |
| 7 | 其他资产 | 307,703,697.87 | 1.11 |
| 8 | 合计 | 27,646,372,414.85 | 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 | 87,254,838.33 | 0.43 |
| C | 制造业 | 1,583,746,331.89 | 7.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 42,588,306.37 | 0.21 |
| E | 建筑业 | 153,846,887.56 | 0.75 |
| F | 批发和零售业 | 2,332,909.20 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 328,551,161.04 | 1.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,231,319.70 | 0.01 |
| J | 金融业 | 581,427,432.86 | 2.83 |
| K | 房地产业 | 158,654,287.33 | 0.77 |
| 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 | 18,594,191.88 | 0.09 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 2,959,227,666.16 | 14.41 |

**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 | 000401 | 冀东水泥 | 16,580,974 | 257,170,906.74 | 1.25 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 10,026,249 | 152,098,197.33 | 0.74 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 1,996,703 | 144,960,637.80 | 0.71 |
| 4 | 600690 | 海尔智家 | 5,824,794 | 127,097,005.08 | 0.62 |
| 5 | 002250 | 联化科技 | 5,083,668 | 125,515,762.92 | 0.61 |
| 6 | 600115 | 东方航空 | 24,409,817 | 120,584,495.98 | 0.59 |
| 7 | 601012 | 隆基股份 | 1,536,690 | 115,267,116.90 | 0.56 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 1,455,137 | 110,968,747.62 | 0.54 |
| 9 | 600703 | 三安光电 | 4,411,916 | 107,783,107.88 | 0.53 |
| 10 | 002375 | 亚厦股份 | 10,817,502 | 107,525,969.88 | 0.52 |

**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 | 3,748,602,000.00 | 18.26 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,058,583,000.00 | 5.16 |
|  | 其中：政策性金融债 | 1,038,549,000.00 | 5.06 |
| 4 | 企业债券 | 4,341,878,145.80 | 21.15 |
| 5 | 企业短期融资券 | 231,132,000.00 | 1.13 |
| 6 | 中期票据 | 10,828,786,000.00 | 52.75 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,870,265,936.34 | 13.98 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 19,898,000.00 | 0.10 |
| 10 | 合计 | 23,099,145,082.14 | 112.52 |

**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附息国债04 | 22,500,000 | 2,065,050,000.00 | 10.06 |
| 2 | 200008 | 20附息国债08 | 13,000,000 | 1,271,790,000.00 | 6.19 |
| 3 | 200201 | 20国开01 | 3,900,000 | 389,766,000.00 | 1.90 |
| 4 | 102000650 | 20中建MTN002 | 3,000,000 | 293,610,000.00 | 1.43 |
| 5 | 2000004 | 20抗疫国债04 | 3,000,000 | 291,510,000.00 | 1.42 |

**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 | YA0154 | 链融30A1 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.49 |
| 2 | 169183 | 天信9A | 900,000 | 90,000,000.00 | 0.44 |
| 3 | 165644 | PR安吉4A | 1,500,000 | 84,360,000.00 | 0.41 |
| 4 | 138393 | 云庐2A1 | 400,000 | 40,188,000.00 | 0.20 |
| 5 | 138396 | 绿金8A1 | 400,000 | 40,180,000.00 | 0.20 |
| 6 | YA0155 | 厚德05A | 400,000 | 40,000,000.00 | 0.19 |
| 7 | 137056 | 瑞新19A1 | 400,000 | 39,996,000.00 | 0.19 |
| 8 | 169296 | 智禾05A | 300,000 | 30,000,000.00 | 0.15 |
| 9 | 138261 | 联易融17 | 200,000 | 20,120,000.00 | 0.10 |
| 10 | 138407 | 联易融18 | 200,000 | 20,094,000.00 | 0.10 |

**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11月4日，国家税务总局北京市海淀区税务局对中国建筑股份有限公司未依法履行职责的行为进行罚款。2019年12月10日，昆明市水务局对中国建筑股份有限公司“未按照防洪审批方案施工影响姚安河行洪”的行为罚款四万元。2020年3月19日，西安市人力资源和社会保障局依据《西安市农民工工资保障办法》第二十三条第一项，对中国建筑股份有限公司“未按本办法规定预存农民工工资支付保证金”的行为罚款10000元。2020年5月7日，江西省交通建设工程质量监督管理局对中国建筑股份有限公司“中国建筑股份有限公司井冈山航电枢纽工程项目A1合同段从事电焊作业的陈子高未按照国家有关规定经专门的安全作业培训取得相应特种作业资格”的行为罚款2万元。2020年7月31日，门头沟区住建委对中国建筑股份有限公司因违反《中华人民共和国建筑法》第四十四条第一款、《北京市建设工程施工现场管理办法》第十三条第一款的行为，罚款1000元。

2019年11月2日，国家税务总局北京市海淀区税务局对唐山冀东水泥股份有限公司“违反税收管理，未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料”的行为，罚款50元。

本基金投资20中建MTN002、冀东水泥的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除20中建MTN002、冀东水泥外，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 | 955,425.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,507,605.25 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 297,624,874.26 |
| 5 | 应收申购款 | 6,615,792.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 307,703,697.87 |

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 | 228,898,339.60 | 1.11 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 197,014,274.60 | 0.96 |
| 3 | 132014 | 18中化EB | 180,599,170.00 | 0.88 |
| 4 | 110053 | 苏银转债 | 170,517,091.80 | 0.83 |
| 5 | 127012 | 招路转债 | 128,767,358.96 | 0.63 |
| 6 | 132018 | G三峡EB1 | 124,817,392.00 | 0.61 |
| 7 | 113026 | 核能转债 | 119,209,689.00 | 0.58 |
| 8 | 110045 | 海澜转债 | 98,848,255.80 | 0.48 |
| 9 | 113008 | 电气转债 | 92,020,561.20 | 0.45 |
| 10 | 113024 | 核建转债 | 84,885,206.00 | 0.41 |
| 11 | 113009 | 广汽转债 | 78,072,680.00 | 0.38 |
| 12 | 128081 | 海亮转债 | 68,761,807.40 | 0.33 |
| 13 | 113014 | 林洋转债 | 57,972,014.10 | 0.28 |
| 14 | 128035 | 大族转债 | 57,576,465.36 | 0.28 |
| 15 | 132017 | 19新钢EB | 52,827,705.00 | 0.26 |
| 16 | 110043 | 无锡转债 | 51,650,919.90 | 0.25 |
| 17 | 110061 | 川投转债 | 49,606,002.60 | 0.24 |
| 18 | 110041 | 蒙电转债 | 43,889,711.10 | 0.21 |
| 19 | 128032 | 双环转债 | 39,714,920.26 | 0.19 |
| 20 | 113545 | 金能转债 | 36,997,446.00 | 0.18 |
| 21 | 113530 | 大丰转债 | 32,174,978.00 | 0.16 |
| 22 | 128085 | 鸿达转债 | 32,144,877.66 | 0.16 |
| 23 | 128018 | 时达转债 | 27,470,348.72 | 0.13 |
| 24 | 110034 | 九州转债 | 25,997,078.70 | 0.13 |
| 25 | 110048 | 福能转债 | 25,071,632.30 | 0.12 |
| 26 | 128033 | 迪龙转债 | 23,146,238.40 | 0.11 |
| 27 | 123011 | 德尔转债 | 22,189,197.81 | 0.11 |
| 28 | 113519 | 长久转债 | 21,939,443.20 | 0.11 |
| 29 | 128013 | 洪涛转债 | 20,110,460.00 | 0.10 |
| 30 | 128019 | 久立转2 | 19,983,337.43 | 0.10 |
| 31 | 128063 | 未来转债 | 19,001,802.60 | 0.09 |
| 32 | 128042 | 凯中转债 | 18,456,094.64 | 0.09 |
| 33 | 113012 | 骆驼转债 | 17,593,169.80 | 0.09 |
| 34 | 128026 | 众兴转债 | 16,554,927.36 | 0.08 |
| 35 | 128037 | 岩土转债 | 15,350,688.10 | 0.07 |
| 36 | 113535 | 大业转债 | 15,222,648.40 | 0.07 |
| 37 | 123023 | 迪森转债 | 15,203,653.88 | 0.07 |
| 38 | 113025 | 明泰转债 | 15,146,687.50 | 0.07 |
| 39 | 113528 | 长城转债 | 14,881,456.00 | 0.07 |
| 40 | 128015 | 久其转债 | 13,798,560.20 | 0.07 |
| 41 | 128044 | 岭南转债 | 13,524,586.50 | 0.07 |
| 42 | 128023 | 亚太转债 | 11,770,711.60 | 0.06 |
| 43 | 113016 | 小康转债 | 10,860,339.20 | 0.05 |
| 44 | 123010 | 博世转债 | 6,512,533.61 | 0.03 |
| 45 | 123028 | 清水转债 | 6,409,339.80 | 0.03 |
| 46 | 120002 | 18中原EB | 6,265,840.00 | 0.03 |
| 47 | 113516 | 苏农转债 | 4,542,400.50 | 0.02 |
| 48 | 113508 | 新凤转债 | 2,804,320.00 | 0.01 |
| 49 | 132005 | 15国资EB | 1,898,115.50 | 0.01 |
| 50 | 110051 | 中天转债 | 840,928.60 | 0.00 |
| 51 | 113030 | 东风转债 | 31,612.00 | 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 | 3,538,081,558.25 | 13,949,185,729.41 | 20,017,493.08 |
| 报告期基金总申购份额 | 746,405,488.66 | 2,296,623,484.75 | 5,340,833.35 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 1,338,582,675.13 | 3,848,270,594.57 | 9,630,401.27 |
| 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 | 2,945,904,371.78 | 12,397,538,619.59 | 15,727,925.16 |

# §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**

**二〇二〇年十月二十八日**