易方达稳健收益债券型证券投资基金
2017 年年度报告

2017 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

送出日期：二〇一八年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 19
§6 审计报告 19
6.1 审计意见 19
6.2 形成审计意见的基础 19
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 19
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 20
§7 年度财务报表 21
7.1 资产负债表 21
7.2 利润表 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 24
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55

8.6 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 56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 56
8.8 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贵金属投资明细 56
8.9 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 56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 56
8.12 投资组合报告附注 56
§9 基金份额持有人信息 57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 58
§10 开放式基金份额变动 58
§11 重大事件揭示 59
11.1 基金份额持有人大会决议 59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
11.4 基金投资策略的改变 59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 59
11.8 其他重大事件 60
§12 备查文件目录 65
12.1 备查文件目录 65
12.2 存放地点 65
12.3 查阅方式 65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达稳健收益债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	7,920,968,089.10 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的交易代码	110007	110008
报告期末下属分级基金的份额总额	1,786,701,533.43 份	6,134,266,555.67 份

2.2 基金产品说明

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	中债总指数（全价）
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	王永民

负责人	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	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 A	易方达稳健收益债券 B	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B

本期已实现收益	100,767,389.75	368,508,820.50	103,024,755.12	298,474,777.61	250,403,375.72	370,766,873.57
本期利润	105,574,581.85	380,483,199.71	17,104,548.41	32,047,676.62	322,543,969.70	490,187,363.09
加权平均基金份额本期利润	0.0537	0.0580	0.0068	0.0048	0.2296	0.2342
本期加权平均净值利润率	4.18%	4.49%	0.52%	0.36%	16.06%	16.31%
本期基金份额净值增长率	4.55%	4.85%	1.85%	2.17%	20.63%	20.82%
3.1.2 期末数据和指标	**2017 年末**		**2016 年末**		**2015 年末**	
	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 A	易方达稳健收益债券 B	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
期末可供分配利润	178,126,843.42	654,138,182.66	306,191,512.73	781,944,342.43	886,403,192.89	1,829,070,951.81
期末可供分配基金份额利润	0.0997	0.1066	0.1378	0.1459	0.2968	0.3005
期末基金资产净值	2,327,602,205.95	8,036,563,891.66	2,966,506,607.57	7,202,637,952.51	4,512,510,226.76	9,223,248,904.53
期末基金份额净值	1.3027	1.3101	1.3354	1.3438	1.5112	1.5153
3.1.3 累计期末指标	**2017 年末**		**2016 年末**		**2015 年末**	
	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 A	易方达稳健收益债券 B	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B
基金份额累计净值增长率	124.06%	130.98%	114.31%	120.29%	110.43%	115.62%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.65%	0.20%	-1.42%	0.09%	0.77%	0.11%
过去六个月	1.35%	0.15%	-1.83%	0.07%	3.18%	0.08%
过去一年	4.55%	0.14%	-4.26%	0.09%	8.81%	0.05%
过去三年	28.45%	0.27%	-1.75%	0.11%	30.20%	0.16%
过去五年	67.64%	0.30%	0.02%	0.12%	67.62%	0.18%
自基金合同生效起至今	124.06%	0.28%	6.00%	0.13%	118.06%	0.15%

易方达稳健收益债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.58%	0.20%	-1.42%	0.09%	0.84%	0.11%
过去六个月	1.50%	0.15%	-1.83%	0.07%	3.33%	0.08%
过去一年	4.85%	0.14%	-4.26%	0.09%	9.11%	0.05%
过去三年	29.43%	0.27%	-1.75%	0.11%	31.18%	0.16%
过去五年	70.36%	0.30%	0.02%	0.12%	70.34%	0.18%
自基金合同生效起至今	130.98%	0.29%	6.00%	0.13%	124.98%	0.16%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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

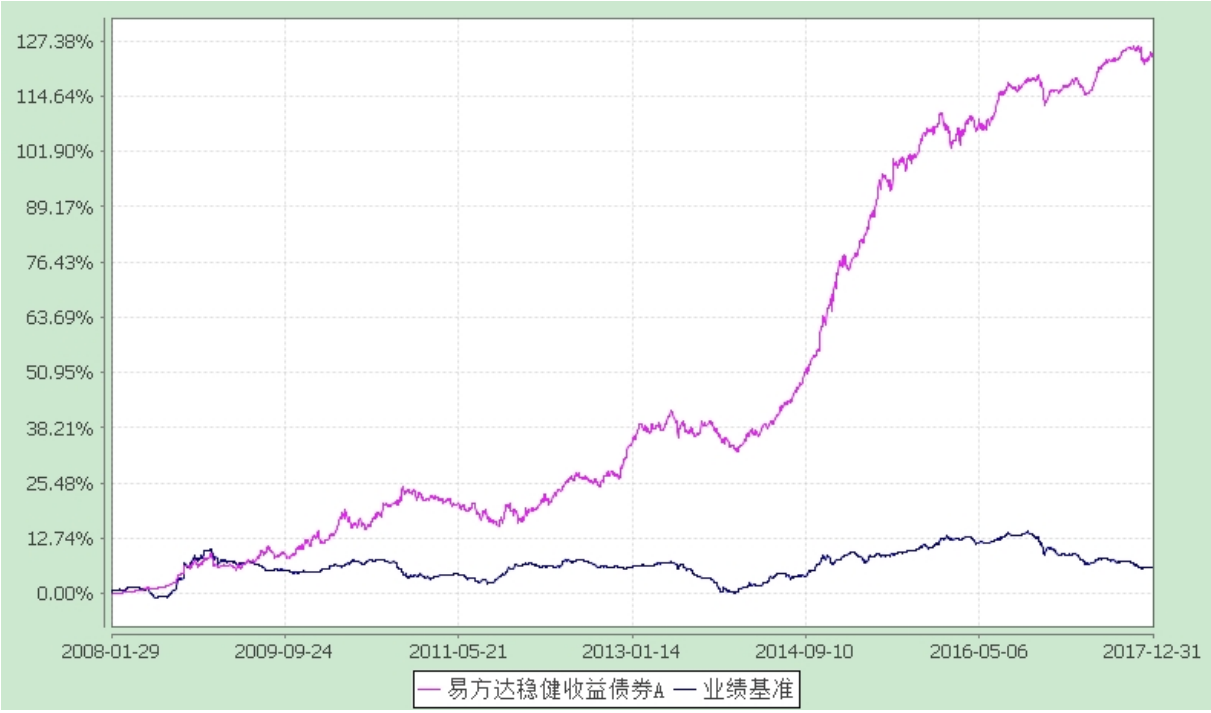
易方达稳健收益债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008 年 1 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日）

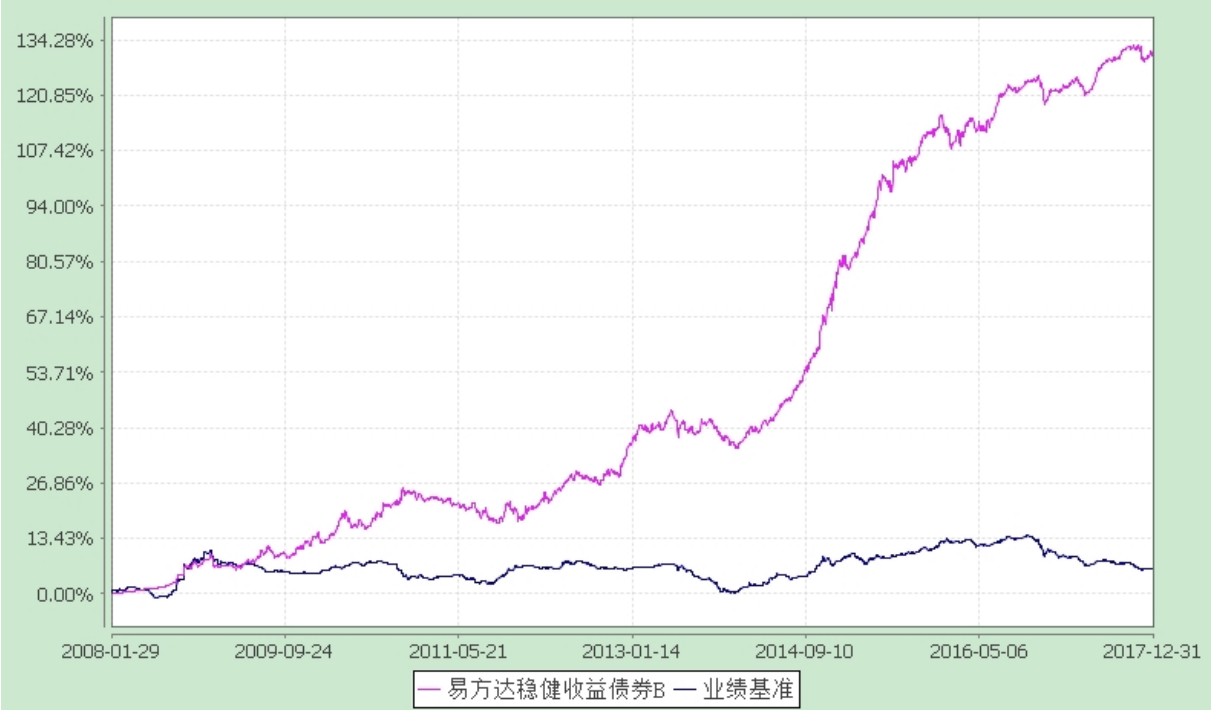
易方达稳健收益债券 A

（2008 年 1 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日）



易方达稳健收益债券 B

（2008 年 1 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日）



注：1.本基金转型日期为 2008 年 1 月 29 日。

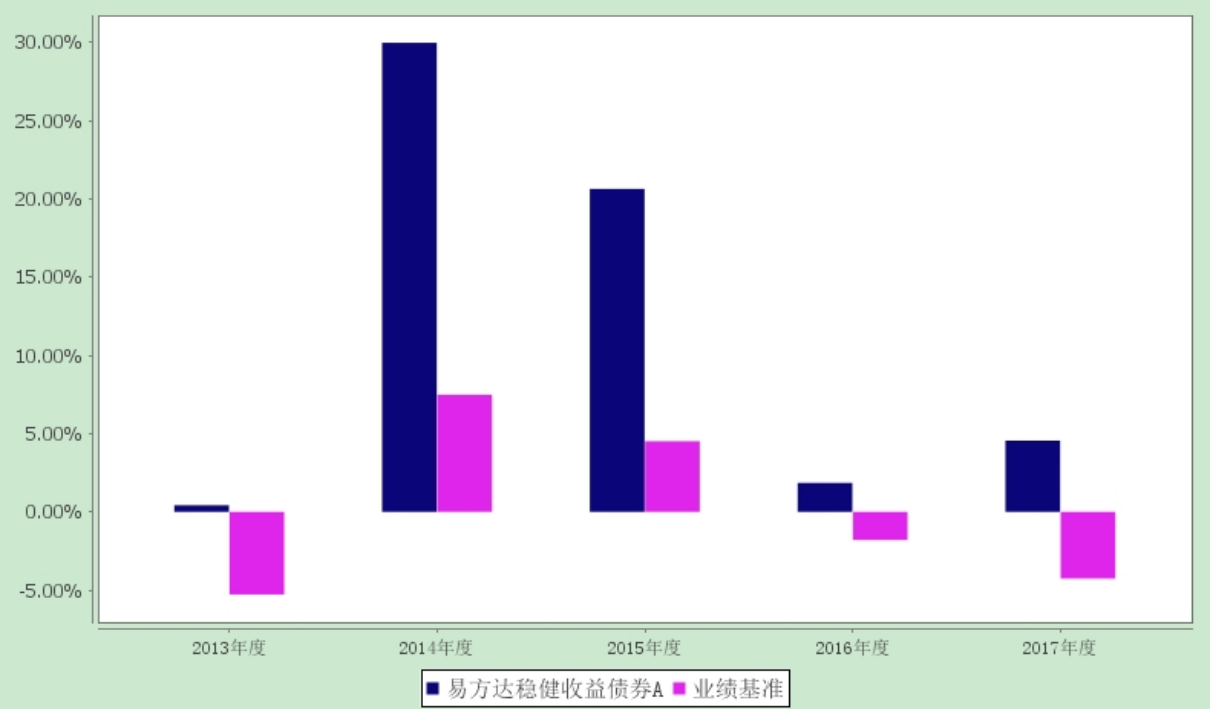
2.自基金转型至报告期末，A 级基金份额净值增长率为 124.06%，B 级基金份额净值增长率为 130.98%，同期业绩比较基准收益率为 6.00%。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

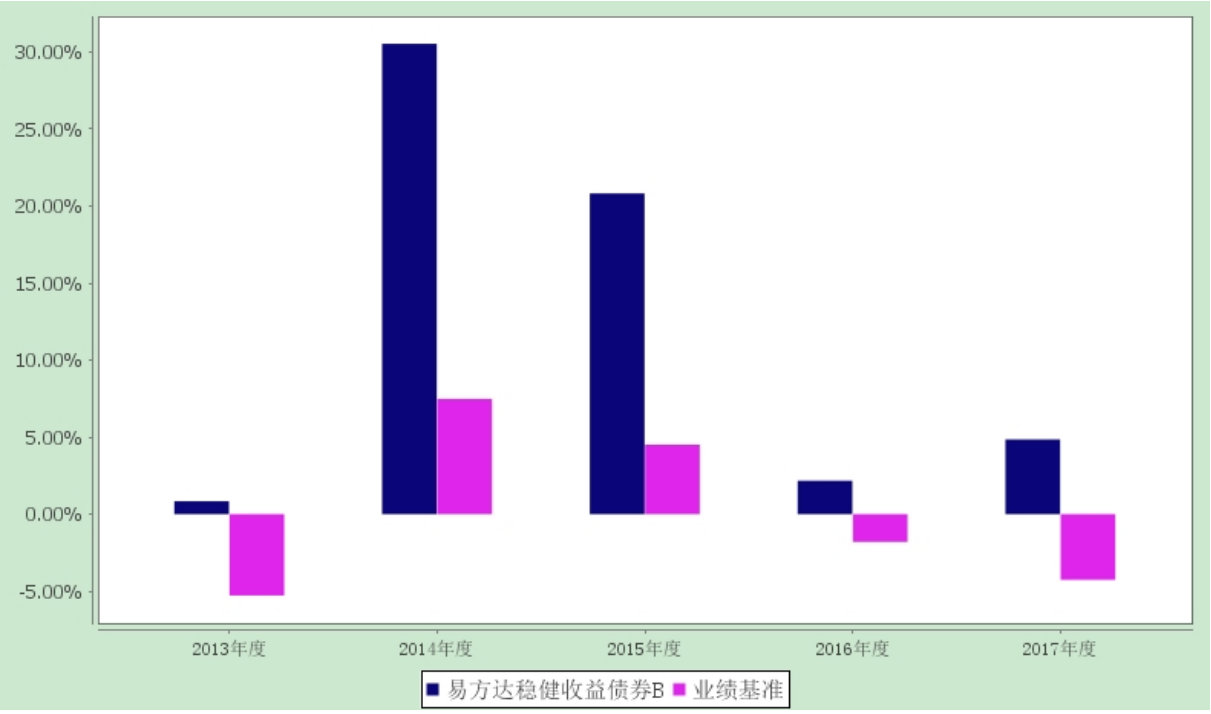
易方达稳健收益债券型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达稳健收益债券 A



易方达稳健收益债券 B



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、易方达稳健收益债券 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	0.900	95,265,889.40	103,380,375.84	198,646,265.24	-
2016 年	2.000	393,318,766.48	206,995,270.92	600,314,037.40	-
2015 年	0.950	44,092,906.94	26,845,906.43	70,938,813.37	-
合计	3.850	532,677,562.82	337,221,553.19	869,899,116.01	-

2、易方达稳健收益债券 B

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	0.950	412,608,774.38	155,131,330.64	567,740,105.02	-
2016 年	2.000	929,843,849.40	303,045,696.53	1,232,889,545.93	-
2015 年	1.000	65,622,594.88	21,901,045.81	87,523,640.69	-
合计	3.950	1,408,075,218.66	480,078,072.98	1,888,153,291.64	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2017 年 12 月 31 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 12338 亿元，其中公募基金规模 6077 亿元；服务各类客户总数 6703 万户，公募基金累计分红 931 亿元。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、易方达裕景添利 6 个月定期开放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、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型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、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2012-02-29	-	11 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、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 1 年定期开放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、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理助理	2015-02-17	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理兼固定收益研究员。
李一硕	本基金的基金经理助理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型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、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 9 月 9 日至 2017 年 3 月 6 日）、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	2015-02-17	-	9 年	硕士研究生，曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司研究员。

	经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 6 月 11 日至 2017 年 12 月 29 日）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 9 月 9 日至 2017 年 3 月 6 日）				
轩璇	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、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助理	2015-02-17	-	5 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究员。
苏宁	本基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、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助理	2015-02-17	-	6 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司交易员、研究员。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告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《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2017 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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%的交易共有 36 次，其中 33 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易， 3 次为不同基金经理管理的组合间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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年基本面数据较为平稳，但结构上呈现一定的波动，一季度冲高，二、三季度逐季下滑，四季度则出现较为明显的回升迹象。结构上，各项投资数据自 7 月份出现大幅下滑后，8 月份均出现不同程度的回升，制造业投资的回升较为显著，基建投资则在 12 月份出现较大幅度的下滑，可能与年底预算约束有关，房地产投资数据自 4 月份开始就有所放缓，8-10 月份有小幅回升，之后基本走平。融资数据方面，2017 年整体一直不弱，即使在 4、5 月份财政部增强对地方政府债务规模的管控之后也未看到融资数据的明显下降，直至 12 月份有较为明显的下滑，但是单月的变动可能与年底额度有关。

通胀方面，CPI 全年在 1-2%之间，主要受到较低的食品价格的压制。从变化上看，中上游价格的上涨持续对非食品的 CPI 有推动作用，另外能源价格上涨对通胀的向上影响在逐渐显现。

债券市场方面，2017 年在整体经济相对平稳的情况下，收益率出现大幅度的上升，10 年金融债上行 114BP，信用债上行 140BP 左右。曲线呈现较为明显的平坦化，1 年金融债上行 150BP。信用利差和级别利差整体上行不明显，仅高等级品种上行 20BP 左右。短端资金成本不断推高，同业存款和存单利率也持续上行推动债券市场收益率向上变动，半年存款在 2017 年年底最高上升至 5.7%的高点。

权益市场全年呈现结构分化的走势，沪深 300 指数、上证 50 指数全年上涨 22%和 25%，而创业板指数则下跌 10.7%，行业和个股表现差异较大。

操作上，组合在上半年保持了相对偏短的久期和偏低的仓位，主要针对季度末进行了一些波段操作；下半年，基于财政部开始收缩地方政府债务融资、打压地方基建投资的判断，组合陆续拉长了有效久期，在四季度承担了一定的资本利得损失。权益方面，全年保持在 10-20%之间的偏高的仓位，下半年基于经济下滑的判断，仓位在边际上有所下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级基金份额净值为 1.3027 元，本报告期份额净值增长率为 4.55%；B 级基金份额净值为 1.3101 元，本报告期份额净值增长率为 4.85%；同期业绩比较基准收益率为-4.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为 2018 年基本面可能仍然平稳。能否出现基本面的走弱，关键还在于政府针对地方政府债务的收缩程度与支持基建投资力度之间的平衡。近年来基建投资在经济整体投资增长的占比持续攀升，经济增长中投资对基建的依赖达到前所未有的新高，这使得经济增长受基建投

资力度变化的影响非常大。由于大部分的基建投资自身现金流难以覆盖成本，大规模的基建投资意味着持续累积的债务缺口，这一模式难以长期持续。短期来看，基建投资下滑的幅度仍取决于中央层面“去杠杆”和“稳增长”的平衡。目前我们观察到，针对地方政府债务控制的力度较强，但同时中央也并未放弃经济增长目标，“稳中求进”依然是工作的总基调，似乎短期也难以看到基建投资的大幅下行。房地产投资方面，目前居民的购房意愿依然较高，而棚改等政策力度依然不低，在库存不高的情况下，预计2018年整体的房地产投资依然平稳。制造业投资的同比增速已经在筑底，难以回到前期的下行通道，未来的不确定性主要在于上升的幅度。

另外一个风险点在于通胀，我们观察到2017年四季度以来油价已经开始成为助推通胀上行的因素，未来对通胀上行的牵引值得关注。

在基本面没出现大幅走弱的情况下，整体的监管政策和货币政策不会出现明显变化，债券市场的结构性问题依然存在，债券市场收益率水平难以看到明显的下行空间，但由于整体绝对收益水平较高，配置价值依然较为显著。

权益资产方面，虽然整体估值水平有所上行，但结构性机会仍然存在，2018年本组合将继续精选行业和个股，为组合提供一定的绝对收益增厚，同时对冲一定的经济上行风险。

实际操作中，本组合计划维持目前中性偏低一些的久期水平，根据市场情况适度调整结构，优选一些性佳比高的个券，同时积极调整组合的流动性和灵活性，等待经济下行信号进一步增加久期和仓位。权益方面，精选行业和个股，积极增厚组合收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

（1）结合《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等新法规的实施和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

（2）严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等

违法违规行为。

（3）继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，认真贯彻落实流动性风险管理规定的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

（4）有计划、有重点地对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

（5）积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

（6）督促落实投资者适当性管理新规，推动投资者适当性管理制度、相关销售流程规范及系统的修订、更新，持续检讨完善客户投诉处理机制流程，切实保障投资者合法权益。

（7）深入贯彻落实“风险为本”的监管要求，加强洗钱风险评估和监测防控，围绕“三号令”的落实进一步完善反洗钱可疑交易监测和配套工作机制，探索建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理体系，同时不断夯实反洗钱工作基础，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

（8）紧跟法规监管要求、市场变化和业务发展，不断优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。

（9）不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

截至 2017 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和

基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达稳健收益债券 A：根据相关法律法规及《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期内应分配利润 106,876,106.06 元；本报告期内 2017 年 1 月 12 日已实施的利润分配 198,646,265.24 元是对 2016 年度利润进行的分配；本报告期末应分配尚未实施的利润为 106,876,106.06 元，本基金已于 2018 年 1 月 12 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.61 元，总分配金额为 106,705,877.84 元，本基金已于 2018 年 1 月 19 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.01 元，总分配金额为 1,666,124.76 元

易方达稳健收益债券 B：根据相关法律法规及《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期内应分配利润 392,482,909.60 元；本报告期内 2017 年 1 月 12 日已实施的利润分配 567,740,105.02 元是对 2016 年度利润进行的分配；本报告期末应分配尚未实施的利润为 392,482,909.60 元，本基金已于 2018 年 1 月 12 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.65 元，总分配金额为 402,260,258.64 元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达稳健收益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽

的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21319 号

易方达稳健收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了易方达稳健收益债券型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达稳健收益债券型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达稳健收益债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达稳健收益债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达稳健收益债券型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达稳健收益债券型证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达稳健收益债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达稳健收益债券型证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交

易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)　　中国注册会计师

薛竞　周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 23 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	18,810,444.66	11,229,384.22
结算备付金		74,401,181.18	95,653,109.02
存出保证金		416,237.23	1,053,879.40
交易性金融资产	7.4.7.2	11,837,734,078.64	11,230,238,116.18
其中：股票投资		1,165,421,948.14	1,798,483,656.88
基金投资		-	-
债券投资		10,672,312,130.50	9,431,754,459.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	11,987,637.98	19,690,149.54
应收证券清算款		6,609,958.75	15,935,992.96

应收利息	7.4.7.5	276,934,592.99	213,025,001.38
应收股利		-	-
应收申购款		2,700,154.60	2,330,782.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	2,984.20	2,984.20
资产总计		**12,229,597,270.23**	**11,589,159,399.83**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 12 月 31 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,843,176,369.74	1,300,108,463.83
应付证券清算款		184,125.83	-
应付赎回款		9,473,609.18	105,137,312.25
应付管理人报酬		5,360,025.73	6,875,066.51
应付托管费		1,786,675.22	2,291,688.83
应付销售服务费		596,055.26	836,631.13
应付交易费用	7.4.7.7	834,354.87	2,618,635.35
应交税费		976,646.00	976,646.00
应付利息		2,379,774.84	506,770.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	663,535.95	663,625.63
负债合计		**1,865,431,172.62**	**1,420,014,839.75**
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,920,968,089.10	7,581,244,150.94
未分配利润	7.4.7.10	2,443,198,008.51	2,587,900,409.14
所有者权益合计		**10,364,166,097.61**	**10,169,144,560.08**

负债和所有者权益总计		**12,229,597,270.23**	**11,589,159,399.83**

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，A 级基金份额净值 1.3027 元，B 级基金份额净值 1.3101 元；基金份额总额 7,920,968,089.10 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 级基金份额总额 1,786,701,533.43 份，B 级基金份额总额 6,134,266,555.67 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		**664,454,741.61**	**235,426,230.12**
1.利息收入		559,122,835.82	574,914,435.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,165,148.74	2,810,734.07
债券利息收入		553,247,165.95	567,971,965.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,710,521.13	4,131,736.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		86,202,358.59	5,160,093.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	326,496,745.56	-52,943,743.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-268,239,870.30	34,392,558.11
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	27,945,483.33	23,711,278.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	16,781,571.31	-352,347,307.70
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,347,975.89	7,699,008.38
减：二、费用		**178,396,960.05**	**186,274,005.09**
1．管理人报酬		65,928,563.63	73,482,437.23
2．托管费		21,976,187.77	24,494,145.69
3．销售服务费		7,598,670.85	9,994,812.94
4．交易费用	7.4.7.18	6,194,357.34	8,491,727.08
5．利息支出		76,174,482.87	69,260,277.91
其中：卖出回购金融资产支出		76,174,482.87	69,260,277.91
6．其他费用	7.4.7.19	524,697.59	550,604.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**486,057,781.56**	**49,152,225.03**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**486,057,781.56**	**49,152,225.03**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	**本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	7,581,244,150.94	2,587,900,409.14	10,169,144,560.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	486,057,781.56	486,057,781.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填	339,723,938.16	135,626,188.07	475,350,126.23

列）			
其中：1.基金申购款	5,450,088,801.89	1,596,460,968.59	7,046,549,770.48
2.基金赎回款	-5,110,364,863.73	-1,460,834,780.52	-6,571,199,644.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-766,386,370.26	-766,386,370.26
五、期末所有者权益（基金净值）	7,920,968,089.10	2,443,198,008.51	10,364,166,097.61
项目	**上年度可比期间** 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	9,072,802,436.01	4,662,956,695.28	13,735,759,131.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,152,225.03	49,152,225.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,491,558,285.07	-291,004,927.84	-1,782,563,212.91
其中：1.基金申购款	13,862,857,054.57	4,636,163,053.25	18,499,020,107.82
2.基金赎回款	-15,354,415,339.64	-4,927,167,981.09	-20,281,583,320.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,833,203,583.33	-1,833,203,583.33
五、期末所有者权益（基金净值）	7,581,244,150.94	2,587,900,409.14	10,169,144,560.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳 ，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

易方达稳健收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据原易方达月月收益中短期债券投资基金(以下简称“原易方达月月收益基金”)基金份额持有人大会 2007 年 12 月 21 日审议通过的《关于易方达月月收益中短期债券投资基金转型的议案》及经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]101 号《关于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有关变更基金类别决议的批复》核准，由原易方达月月收益基金转型而来。

根据《易方达月月收益中短期债券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并经中国证监会核准，基金管理人易方达基金管理有限公司将《易方达月月收益中短期债券投资基金基金合同》修订为《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》。《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》自 2008 年 1 月 29 日起生效，原《易方达月月收益中短期债券投资基金基金合同》同日失效。

本基金自 2008 年 1 月 29 日起，根据申购费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的级别。不收取申购费用、收取销售服务费的基金份额等级称为 A 级；收取申购费用、不收取销售服务费的基金份额等级称为 B 级。本基金 A 级、B 级两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 级基金份额和 B 级基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一级别的基金份额，但各级别基金份额之间不能相互转换。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应

收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包

括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

（1）基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为现金方式；

（2）同一级别基金份额享有同等分配权；

（3）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（4）基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

（5）如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

（6）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配

比例不低于可分配收益的 60%，不足部分于次年补足；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）于 2017 年 12 月 15 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 15 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 15 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	18,810,444.66	11,229,384.22
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月-1 年	-	-
存款期限 1 个月以内	-	-
其他存款	-	-
合计	18,810,444.66	11,229,384.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		933,662,309.08	1,165,421,948.14	231,759,639.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,500,318,821.70	1,460,340,630.50	-39,978,191.20
	银行间市场	9,416,097,076.05	9,211,971,500.00	-204,125,576.05
	合计	10,916,415,897.75	10,672,312,130.50	-244,103,767.25
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		11,850,078,206.83	11,837,734,078.64	-12,344,128.19
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,724,678,793.88	1,798,483,656.88	73,804,863.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,791,044,740.64	1,753,889,359.30	-37,155,381.34
	银行间市场	7,743,640,281.16	7,677,865,100.00	-65,775,181.16
	合计	9,534,685,021.80	9,431,754,459.30	-102,930,562.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		11,259,363,815.68	11,230,238,116.18	-29,125,699.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	11,987,637.98	-
合计	11,987,637.98	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	19,690,149.54	-
合计	19,690,149.54	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,617.13	35,260.99
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	33,480.60	43,063.66
应收债券利息	276,874,720.60	212,942,501.03
应收买入返售证券利息	20,587.26	3,701.40
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	187.40	474.30
合计	276,934,592.99	213,025,001.38

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
其他应收款	2,984.20	2,984.20
待摊费用	-	-
合计	2,984.20	2,984.20

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	688,730.23	2,494,477.68
银行间市场应付交易费用	145,624.64	124,157.67
合计	834,354.87	2,618,635.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	12,535.95	625.63
预提费用	401,000.00	413,000.00
合计	663,535.95	663,625.63

7.4.7.9 实收基金

易方达稳健收益债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,221,454,633.79	2,221,454,633.79
本期申购	1,182,343,703.82	1,182,343,703.82
本期赎回（以“-”号填列）	-1,617,096,804.18	-1,617,096,804.18
本期末	1,786,701,533.43	1,786,701,533.43

易方达稳健收益债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,359,789,517.15	5,359,789,517.15
本期申购	4,267,745,098.07	4,267,745,098.07
本期赎回（以“-”号填列）	-3,493,268,059.55	-3,493,268,059.55
本期末	6,134,266,555.67	6,134,266,555.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

易方达稳健收益债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	306,191,512.73	438,860,461.05	745,051,973.78

本期利润	100,767,389.75	4,807,192.10	105,574,581.85
本期基金份额交易产生的变动数	-30,185,793.82	-80,893,824.05	-111,079,617.87
其中：基金申购款	101,977,469.50	241,300,633.64	343,278,103.14
基金赎回款	-132,163,263.32	-322,194,457.69	-454,357,721.01
本期已分配利润	-198,646,265.24	-	-198,646,265.24
本期末	178,126,843.42	362,773,829.10	540,900,672.52

易方达稳健收益债券 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	781,944,342.43	1,060,904,092.93	1,842,848,435.36
本期利润	368,508,820.50	11,974,379.21	380,483,199.71
本期基金份额交易产生的变动数	71,425,124.75	175,280,681.19	246,705,805.94
其中：基金申购款	384,505,662.06	868,677,203.39	1,253,182,865.45
基金赎回款	-313,080,537.31	-693,396,522.20	-1,006,477,059.51
本期已分配利润	-567,740,105.02	-	-567,740,105.02
本期末	654,138,182.66	1,248,159,153.33	1,902,297,335.99

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	230,714.16	714,350.76
定期存款利息收入	-	330,750.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	921,749.36	1,741,880.25
其他	12,685.22	23,753.06
合计	1,165,148.74	2,810,734.07

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	2,329,941,923.64	2,594,093,859.79
减：卖出股票成本总额	2,003,445,178.08	2,647,037,603.09
买卖股票差价收入	326,496,745.56	-52,943,743.30

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,593,820,241.56	34,824,910,692.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,306,380,157.90	34,232,557,711.43
减：应收利息总额	555,679,953.96	557,960,422.64
买卖债券差价收入	-268,239,870.30	34,392,558.11

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	27,945,483.33	23,711,278.66
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	27,945,483.33	23,711,278.66

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	16,781,571.31	-352,347,307.70
——股票投资	157,954,776.06	10,956,983.03

——债券投资	-141,173,204.75	-363,304,290.73
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	16,781,571.31	-352,347,307.70

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	2,347,975.89	7,684,008.38
其他	-	15,000.00
合计	2,347,975.89	7,699,008.38

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5,948,214.84	8,169,064.83
银行间市场交易费用	246,142.50	322,662.25
合计	6,194,357.34	8,491,727.08

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	101,000.00	113,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	86,297.59	100,204.24

银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,400.00	1,400.00
合计	524,697.59	550,604.24

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

易方达稳健收益债券 A：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2018 年 1 月 12 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.61 元，分配金额为 106,705,877.84 元；向截至 2018 年 1 月 19 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.01 元，分配金额为 1,666,124.76 元。

易方达稳健收益债券 B：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2018 年 1 月 12 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.65 元，分配金额为 402,260,258.64 元。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	65,928,563.63	73,482,437.23
其中：支付销售机构的客户维护费	3,159,716.72	3,755,941.97

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.6%的管理费年费率来计算，具体计算方法如下：

每日应付的基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,976,187.77	24,494,145.69

注：本基金的托管费按该基金前一日资产净值乘以0.2%的托管费年费率来计算。计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月前两个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日从基金资产中一次性支付给基金托管人。

7.4.10.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期

关联方名称	2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B	合计
易方达基金管理有限公司	3,859,716.23	-	3,859,716.23
中国银行	392,333.57	-	392,333.57
广发证券	26,965.50	-	26,965.50
合计	4,279,015.30	-	4,279,015.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达稳健收益债券A	易方达稳健收益债券B	合计
易方达基金管理有限公司	5,037,497.24	-	5,037,497.24
中国银行	583,493.79	-	583,493.79
广发证券	39,678.32	-	39,678.32
合计	5,660,669.35	-	5,660,669.35

注：本基金 A 级基金份额的销售服务年费率为 0.30%，B 级基金份额不计提销售服务费。A 级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

每日应支付的 A 级基金销售服务费＝前一日 A 级基金份额的基金资产净值×R÷当年天数

R 为 A 级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付给基金销售机构,于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	153,249,123.28	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

联方名称						
中国银行	-	-	-	-	2,299,220,000.00	132,582.58

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达稳健收益债券 A

无。

易方达稳健收益债券 B

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	18,810,444.66	230,714.16	11,229,384.22	714,350.76

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	1780258	17 青州建投债 02	分销	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单	总金额

				位：股/张）	
广发证券	112457	16 魏桥 05	分销	100,000	10,000,000.00
广发证券	1680038	16 普兰店债	分销	300,000	30,000,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7. 4. 11 利润分配情况

易方达稳健收益债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017-01-12	-	2017-01-12	0.900	95,265,889.40	103,380,375.84	198,646,265.24	-
合计				0.900	95,265,889.40	103,380,375.84	198,646,265.24	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2018 年 1 月 12 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.61 元，分配金额为 106,705,877.84 元；向截至 2018 年 1 月 19 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.01 元，分配金额为 1,666,124.76 元。

易方达稳健收益债券 B

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017-01-12	-	2017-01-12	0.950	412,608,774.38	155,131,330.64	567,740,105.02	-

合计			0.950	412,608,774.38	155,131,330.64	567,740,105.02	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2018 年 1 月 12 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.65 元，分配金额为 402,260,258.64 元。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002458	益生股份	2017-12-27	重大事项停牌	23.25	2018-01-30	20.93	85,860	1,721,271.48	1,996,245.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大事项停牌	32.14	2018-01-08	30.15	383,666	9,597,108.78	12,331,025.24	-
601619	嘉泽新能	2017-10-31	重大事项停牌	7.90	-	-	1,000	1,260.00	7,900.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,193,497,369.74 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
170210	17 国开 10	2018-01-02	93.34	3,500,000	326,690,000.00
170215	17 国开 15	2018-01-02	95.55	4,080,000	389,844,000.00
150207	15 国开 07	2018-01-04	99.94	130,000	12,992,200.00
170204	17 国开 04	2018-01-04	99.80	2,170,000	216,566,000.00
170210	17 国开 10	2018-01-05	93.34	3,100,000	289,354,000.00
合计				12,980,000	1,235,446,200.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 649,679,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购

期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 60.36%(2016 年 12 月 31 日：84.75%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	223,902,772.60	324,637,052.99
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	980,629,975.90	1,615,578,878.36

合计	1,204,532,748.50	1,940,215,931.35

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	2,265,426,548.91	1,989,727,147.07
AAA 以下	3,467,115,874.93	5,304,705,488.47
未评级	4,012,111,678.76	410,048,393.44
合计	9,744,654,102.60	7,704,481,028.98

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,810,444.66	-	-	-	18,810,444.66
结算备付金	74,401,181.18	-	-	-	74,401,181.18
存出保证金	416,237.23	-	-	-	416,237.23
交易性金融资产	1,564,992,147.50	5,082,777,100.85	4,024,542,882.15	1,165,421,948.14	11,837,734,078.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	11,987,637.98	-	-	-	11,987,637.98
应收证券清算款	-	-	-	6,609,958.75	6,609,958.75
应收利息	-	-	-	276,934,592.99	276,934,592.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,700,154.60	2,700,154.60
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,984.20	2,984.20
资产总计	1,670,607,648.55	5,082,777,100.85	4,024,542,882.15	1,451,669,638.68	12,229,597,270.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,843,176,369.74	-	-	-	1,843,176,369.74
应付证券清算款	-	-	-	184,125.83	184,125.83
应付赎回款	-	-	-	9,473,609.18	9,473,609.18
应付管理人报酬	-	-	-	5,360,025.73	5,360,025.73
应付托管费	-	-	-	1,786,675.22	1,786,675.22
应付销售服务费	-	-	-	596,055.26	596,055.26
应付交易费用	-	-	-	834,354.87	834,354.87

应交税费	-	-	-	976,646.00	976,646.00
应付利息	-	-	-	2,379,774.84	2,379,774.84
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	663,535.95	663,535.95
负债总计	1,843,176,369.74	-	-	22,254,802.88	1,865,431,172.62
利率敏感度缺口	-172,568,721.19	5,082,777,100.85	4,024,542,882.15	1,429,414,835.80	10,364,166,097.61
上年度末 2016 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	11,229,384.22	-	-	-	11,229,384.22
结算备付金	95,653,109.02	-	-	-	95,653,109.02
存出保证金	1,053,879.40	-	-	-	1,053,879.40
交易性金融资产	2,210,402,100.00	5,989,511,852.50	1,231,840,506.80	1,798,483,656.88	11,230,238,116.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	19,690,149.54	-	-	-	19,690,149.54
应收证券清算款	-	-	-	15,935,992.96	15,935,992.96
应收利息	-	-	-	213,025,001.38	213,025,001.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,330,782.93	2,330,782.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,984.20	2,984.20
资产总计	2,338,028,622.18	5,989,511,852.50	1,231,840,506.80	2,029,778,418.35	11,589,159,399.83
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,300,108,463.83	-	-	-	1,300,108,463.83
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	105,137,312.25	105,137,312.25

应付管理人报酬	-	-	-	6,875,066.51	6,875,066.51
应付托管费	-	-	-	2,291,688.83	2,291,688.83
应付销售服务费	-	-	-	836,631.13	836,631.13
应付交易费用	-	-	-	2,618,635.35	2,618,635.35
应交税费	-	-	-	976,646.00	976,646.00
应付利息	-	-	-	506,770.22	506,770.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	663,625.63	663,625.63
负债总计	1,300,108,463.83	-	-	119,906,375.92	1,420,014,839.75
利率敏感度缺口	1,037,920,158.35	5,989,511,852.50	1,231,840,506.80	1,909,872,042.43	10,169,144,560.08

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	106,102,820.82	55,812,559.73
	2.市场利率上升 25 个基点	-103,989,945.63	-54,940,854.17

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	1,165,421,948.14	11.24	1,798,483,656.88	17.69
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,165,421,948.14	11.24	1,798,483,656.88	17.69

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	81,572,984.46	101,557,167.48
	2.业绩比较基准下降5%	-81,572,984.46	-101,557,167.48

注：股票投资业绩基准取上证A指。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,258,784,472.30元，属于第二层次的余额为10,578,949,606.34元，无属于第

三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,814,223,797.28 元，第二层次 9,416,014,318.90 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同) 。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例

			（%）
1	权益投资	1,165,421,948.14	9.53
	其中：股票	1,165,421,948.14	9.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,672,312,130.50	87.27
	其中：债券	10,672,312,130.50	87.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	11,987,637.98	0.10
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	93,211,625.84	0.76
8	其他各项资产	286,663,927.77	2.34
9	合计	12,229,597,270.23	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,996,245.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	692,120,727.93	6.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,800.00	0.00
E	建筑业	43,755,428.32	0.42
F	批发和零售业	14,448,486.16	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	163,013,661.74	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,740,845.98	0.16
J	金融业	163,914,357.43	1.58
K	房地产业	44,578,575.03	0.43
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	10,195,200.55	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,634,620.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,165,421,948.14	11.24

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	5,972,645	217,643,183.80	2.10
2	601318	中国平安	1,670,208	116,881,155.84	1.13
3	601111	中国国航	7,162,940	88,247,420.80	0.85
4	601877	正泰电器	3,174,111	83,003,002.65	0.80
5	600196	复星医药	1,818,236	80,911,502.00	0.78
6	000402	金融街	4,012,473	44,578,575.03	0.43
7	002375	亚厦股份	5,818,541	43,755,428.32	0.42
8	300068	南都电源	2,710,716	43,588,313.28	0.42
9	603806	福斯特	1,228,480	41,891,168.00	0.40
10	600029	南方航空	3,373,258	40,209,235.36	0.39
11	002179	中航光电	983,860	38,744,406.80	0.37
12	600104	上汽集团	1,097,090	35,150,763.60	0.34
13	600887	伊利股份	982,869	31,638,553.11	0.31
14	601398	工商银行	3,990,313	24,739,940.60	0.24
15	600062	华润双鹤	950,256	23,518,836.00	0.23
16	601222	林洋能源	2,274,297	23,061,371.58	0.22
17	002250	联化科技	2,154,365	22,879,356.30	0.22
18	601601	中国太保	537,719	22,272,320.98	0.21
19	600115	东方航空	2,302,300	18,901,883.00	0.18
20	600519	贵州茅台	25,487	17,776,927.63	0.17
21	600125	铁龙物流	1,446,869	15,655,122.58	0.15
22	300015	爱尔眼科	475,150	14,634,620.00	0.14
23	600332	白云山	383,666	12,331,025.24	0.12
24	000501	鄂武商 A	687,929	10,979,346.84	0.11
25	002573	清新环境	448,535	10,195,200.55	0.10
26	002174	游族网络	393,200	8,768,360.00	0.08

27	000333	美的集团	146,772	8,135,571.96	0.08
28	002230	科大讯飞	134,807	7,972,485.98	0.08
29	000858	五粮液	84,051	6,713,993.88	0.06
30	002572	索菲亚	137,004	5,041,747.20	0.05
31	600697	欧亚集团	134,881	3,469,139.32	0.03
32	002458	益生股份	85,860	1,996,245.00	0.02
33	603305	旭升股份	1,000	38,050.00	0.00
34	002876	三利谱	500	29,925.00	0.00
35	000739	普洛药业	3,565	23,029.90	0.00
36	601878	浙商证券	1,000	16,620.00	0.00
37	600025	华能水电	3,000	15,900.00	0.00
38	601619	嘉泽新能	1,000	7,900.00	0.00
39	002807	江阴银行	500	4,140.00	0.00
40	601288	农业银行	47	180.01	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601111	中国国航	138,684,257.57	1.36
2	600500	中化国际	108,437,175.43	1.07
3	601877	正泰电器	93,602,945.60	0.92
4	000858	五 粮 液	73,858,948.46	0.73
5	600887	伊利股份	68,931,419.40	0.68
6	600125	铁龙物流	67,350,043.42	0.66
7	600196	复星医药	65,922,315.63	0.65
8	000402	金 融 街	62,990,215.16	0.62
9	000498	山东路桥	61,956,859.29	0.61
10	002573	清新环境	54,981,683.96	0.54
11	600332	白云山	52,470,519.95	0.52
12	600029	南方航空	45,973,060.50	0.45
13	601318	中国平安	42,976,793.72	0.42
14	002250	联化科技	38,087,075.97	0.37
15	002179	中航光电	36,942,349.95	0.36
16	601601	中国太保	34,492,019.00	0.34
17	000739	普洛药业	32,996,784.13	0.32
18	600062	华润双鹤	27,997,174.15	0.28
19	601222	林洋能源	24,993,674.00	0.25
20	300068	南都电源	24,965,187.11	0.25

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五 粮 液	199,862,478.02	1.97
2	000333	美的集团	179,249,343.02	1.76
3	600519	贵州茅台	172,706,402.02	1.70
4	600019	宝钢股份	142,693,194.44	1.40
5	601012	隆基股份	133,251,248.38	1.31
6	601006	大秦铁路	128,933,248.79	1.27
7	601318	中国平安	117,479,213.96	1.16
8	600104	上汽集团	116,955,580.77	1.15
9	600500	中化国际	103,273,347.28	1.02
10	601009	南京银行	99,908,523.60	0.98
11	601111	中国国航	88,611,729.36	0.87
12	002375	亚厦股份	85,784,835.95	0.84
13	600887	伊利股份	85,135,520.92	0.84
14	300068	南都电源	63,877,421.85	0.63
15	603806	福斯特	62,493,459.86	0.61
16	000498	山东路桥	54,239,189.14	0.53
17	600125	铁龙物流	53,448,415.33	0.53
18	600332	白云山	47,181,411.21	0.46
19	002573	清新环境	39,605,401.58	0.39
20	600221	海航控股	36,941,035.35	0.36

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,212,428,693.28
卖出股票收入（成交）总额	2,329,941,923.64

注："买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)

1	国家债券	37,940,000.00	0.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,483,791,000.00	43.26
	其中：政策性金融债	4,483,791,000.00	43.26
4	企业债券	3,878,597,475.60	37.42
5	企业短期融资券	560,314,000.00	5.41
6	中期票据	1,519,086,000.00	14.66
7	可转债（可交换债）	145,466,654.90	1.40
8	同业存单	-	-
9	其他	47,117,000.00	0.45
10	合计	10,672,312,130.50	102.97

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170210	17 国开 10	28,900,000	2,697,526,000.00	26.03
2	170215	17 国开 15	9,000,000	859,950,000.00	8.30
3	170204	17 国开 04	3,000,000	299,400,000.00	2.89
4	101761002	17 光大集团 MTN001	2,000,000	198,080,000.00	1.91
5	101759016	17 远洋集团 MTN001B	2,000,000	195,900,000.00	1.89

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	416,237.23
2	应收证券清算款	6,609,958.75
3	应收股利	-
4	应收利息	276,934,592.99
5	应收申购款	2,700,154.60
6	其他应收款	2,984.20
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	286,663,927.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128013	洪涛转债	19,970,779.85	0.19
2	127004	模塑转债	15,122,491.65	0.15
3	132007	16 凤凰 EB	14,851,200.00	0.14
4	113009	广汽转债	14,684,697.30	0.14
5	110032	三一转债	13,676,403.60	0.13
6	113011	光大转债	12,522,312.60	0.12
7	132004	15 国盛 EB	5,363,679.10	0.05
8	110033	国贸转债	2,623,686.30	0.03
9	132005	15 国资 EB	2,270,051.80	0.02

10	120001	16 以岭 EB	1,101,842.00	0.01
11	127003	海印转债	817,689.40	0.01
12	113010	江南转债	694,555.80	0.01
13	132003	15 清控 EB	609,280.50	0.01

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达稳健收益债券 A	65,407	27,316.67	694,386,877.70	38.86%	1,092,314,655.73	61.14%
易方达稳健收益债券 B	43,401	141,339.29	5,586,565,022.09	91.07%	547,701,533.58	8.93%
合计	108,808	72,797.66	6,280,951,899.79	79.30%	1,640,016,189.31	20.70%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达稳健收益债券 A	159,349.32	0.0089%
	易方达稳健收益债券 B	720.86	0.0000%
	合计	160,070.18	0.0020%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达稳健收益债券 A	0
	易方达稳健收益债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	易方达稳健收益债券 A	0

放式基金	易方达稳健收益债券 B	0
	合计	0

§10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
基金合同生效日（2008 年 1 月 29 日）基金份额总额	297,851,306.81	384,810,820.32
本报告期期初基金份额总额	2,221,454,633.79	5,359,789,517.15
本报告期基金总申购份额	1,182,343,703.82	4,267,745,098.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,617,096,804.18	3,493,268,059.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,786,701,533.43	6,134,266,555.67

§11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自转型之后连续 10 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 101,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	2,302,832,376.92	65.01%	2,144,629.20	65.01%	-
平安证券	1	1,239,477,560.00	34.99%	1,154,327.86	34.99%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

1） 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2） 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3） 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

1） 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2） 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	1,157,966,914.23	88.99%	124,162,100,000.00	93.13%	-	-
平安证券	143,242,935.09	11.01%	9,161,582,000.00	6.87%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达稳健收益债券型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-09
2	易方达基金管理有限公司关于在东海期货开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加东海期货申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-13
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-09
4	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-14
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加九江银行为销售机构、参加九江银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-15
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加龙江银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-16
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加青岛银行为销售机构、参加青岛银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-17
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-23
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2017-03-02

	式基金增加肯特瑞为销售机构、参加肯特瑞费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加龙江银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加朝阳永续为销售机构、参加朝阳永续申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-15
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信期货费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-20
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信证券（山东）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-20
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华龙证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-22
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-22
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加济安财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-27
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华林证券为销售机构、参加华林证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-30
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-30
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇丰银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-31
21	易方达基金管理有限公司关于易方达稳健收益债券型证券投资基金增加福建海峡银行为销售机构、参加福建海峡银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-31
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泛华普益费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-05
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购费率优惠活动的公	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-04-10

	告	理人网站	
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-13
25	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-22
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳新兰德费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-02
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中证金牛费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-05
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加财通证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加川财证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
32	易方达基金管理有限公司关于在中银国际证券开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加中银国际证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-19
33	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
34	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-30
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广东南粤银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-01
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-01
37	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行申购费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-07-01

	活动的公告	理人网站	
38	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加厦门银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-01
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-07
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联储证券为销售机构、参加联储证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-19
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中泰证券网上渠道申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-28
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华西证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-07-28
43	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华泰证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-01
44	易方达基金管理有限公司关于直销中心收款银行账户信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-04
45	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加挖财基金为销售机构、参加挖财基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-17
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加蛋卷基金为销售机构、参加蛋卷基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-08-18
47	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、赎回、转换、最低持有份额和定期定额投资数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-09-09
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江南农村商业银行网上银行、手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-09-11
49	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中正达广费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-09-11
50	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广州证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-09-20
51	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2017-09-26

	式基金参加平安银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加德州银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-09-28
53	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-10-19
54	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加万家财富为销售机构、参加万家财富申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-11-06
55	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加南京证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-11-24
56	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加湘财证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-01
57	易方达基金管理有限公司关于易方达资产管理有限公司股权结构等事项变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-02
58	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-12
59	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
60	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加苏州银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
61	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浙商银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
62	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2018 倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
63	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国邮政储蓄银行个人网上银行和手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
64	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-29
65	易方达基金管理有限公司关于公司旗下证券投资基金执行增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-12-30

§12备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 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；

2.《易方达稳健收益债券型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达稳健收益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.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；

6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一八年三月三十日