

易方达稳健收益债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：二〇二三年十月二十五日

§ 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 2023 年 10 月 23 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 2023 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 | 44,637,418,078.62 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 | 1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的投资价值，确定各类资产的配置比例。2、本基金在固定收益投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和信用债券投资四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金 |

| | | | |
|-----------------|---|---------------------|------------------|
| | 将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，降低流动性风险。3、本基金通过对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性等因素的分析，判断一、二级市场价差的大小，制定新股申购策略；本基金二级市场股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，选择价值被市场低估的企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。 | | |
| 业绩比较基准 | 中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，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 | 10,047,745,086.60 份 | 34,314,954,933.97 份 | 274,718,058.05 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 |
| | (2023 年 7 月 1 日-2023 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 | 94,535,054.55 | 335,537,084.33 | 2,497,043.41 |
| 2.本期利润 | 18,432,370.10 | 51,778,003.17 | -639,185.82 |
| 3.加权平均基金份额 本期利润 | 0.0018 | 0.0016 | -0.0023 |
| 4.期末基金资产净值 | 13,895,539,114.39 | 47,771,207,007.09 | 380,286,240.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3830 | 1.3921 | 1.3843 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 | 0.18% | 0.17% | 0.23% | 0.08% | -0.05% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.44% | 0.20% | 1.22% | 0.08% | -0.78% | 0.12% |
| 过去一年 | 1.56% | 0.23% | 2.77% | 0.10% | -1.21% | 0.13% |
| 过去三年 | 12.26% | 0.23% | 10.19% | 0.12% | 2.07% | 0.11% |
| 过去五年 | 32.61% | 0.27% | 13.88% | 0.12% | 18.73% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 202.22% | 0.28% | 24.54% | 0.12% | 177.68% | 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 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|

| | | ② | 率③ | 率标准差 ④ | | |
|------------|---------|-------|--------|-----------|---------|-------|
| 过去三个月 | 0.24% | 0.17% | 0.23% | 0.08% | 0.01% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.58% | 0.20% | 1.22% | 0.08% | -0.64% | 0.12% |
| 过去一年 | 1.87% | 0.23% | 2.77% | 0.10% | -0.90% | 0.13% |
| 过去三年 | 13.26% | 0.23% | 10.19% | 0.12% | 3.07% | 0.11% |
| 过去五年 | 34.55% | 0.27% | 13.88% | 0.12% | 20.67% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | 216.81% | 0.28% | 24.54% | 0.12% | 192.27% | 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 | 0.18% | 0.17% | 0.23% | 0.08% | -0.05% | 0.09% |
| 过去六个月 | 0.44% | 0.20% | 1.22% | 0.08% | -0.78% | 0.12% |
| 过去一年 | 1.59% | 0.23% | 2.77% | 0.10% | -1.18% | 0.13% |
| 过去三年 | 12.31% | 0.23% | 10.19% | 0.12% | 2.12% | 0.11% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 19.97% | 0.25% | 10.69% | 0.13% | 9.28% | 0.12% |

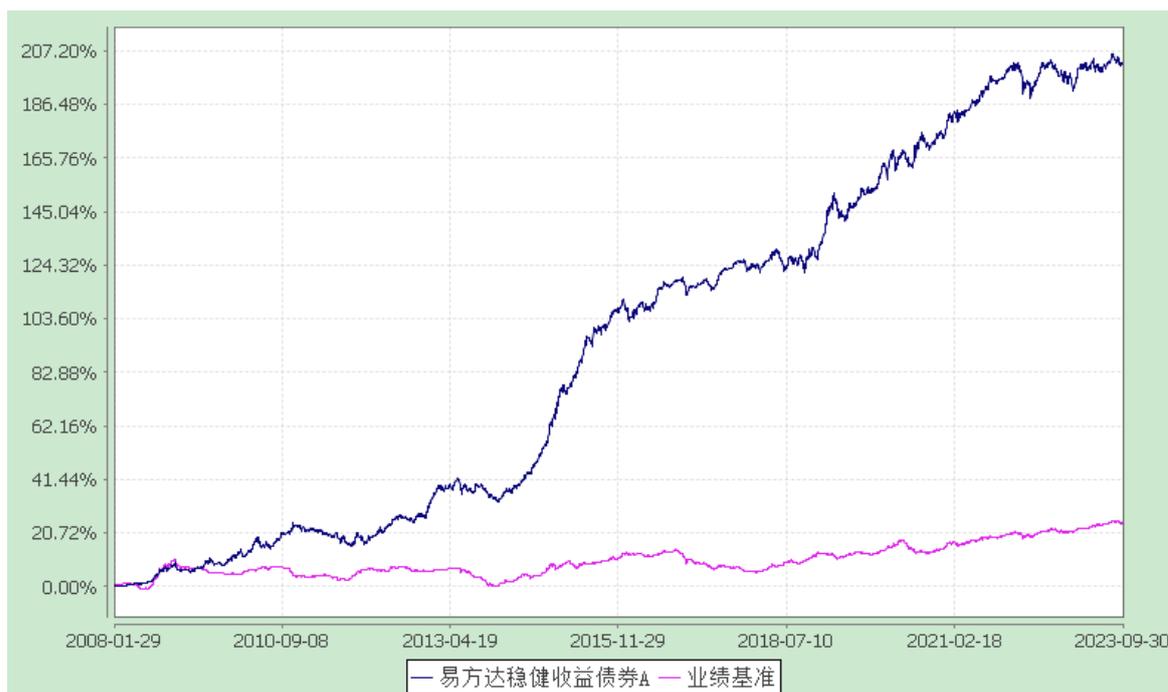
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

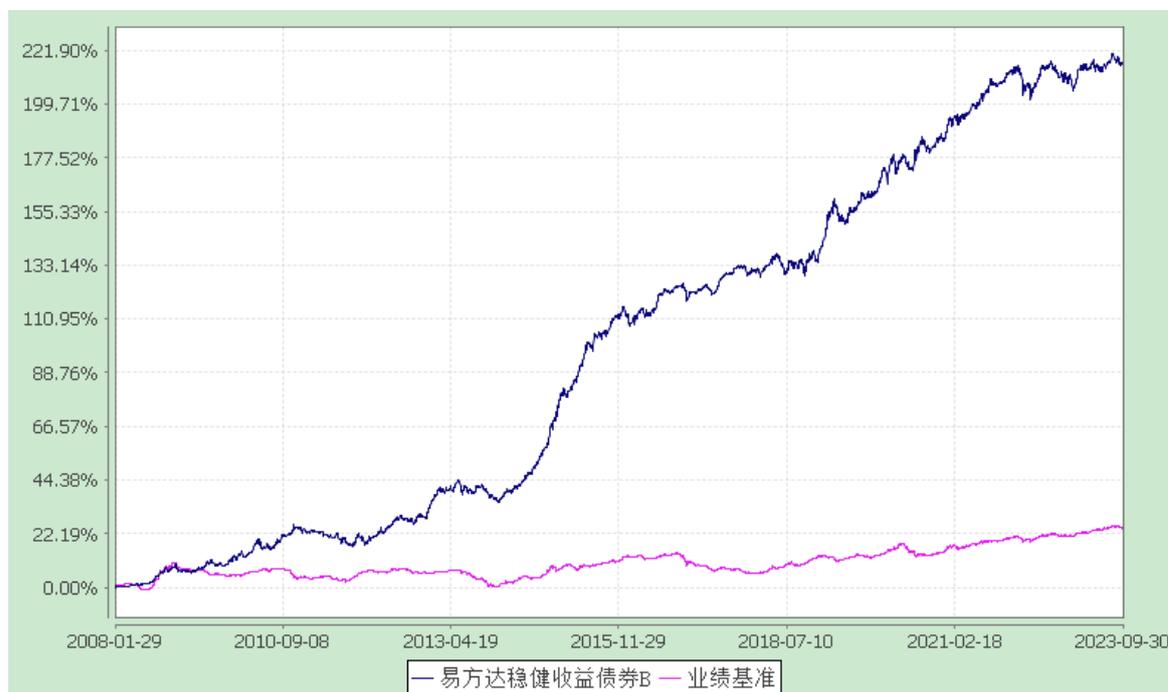
易方达稳健收益债券 A

(2008 年 1 月 29 日至 2023 年 9 月 30 日)



易方达稳健收益债券 B

(2008 年 1 月 29 日至 2023 年 9 月 30 日)



易方达稳健收益债券 C

(2019 年 10 月 24 日至 2023 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）”调整为“中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%”。基金业绩比较基准收益率在调整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 202.22%，同期业绩比较基准收益率为 24.54%；B 类基金份额净值增长率为 216.81%，同期业绩比较基准收益率为 24.54%；C 类基金份额净值增长率为 19.97%，同期业绩比较基准收益率为 10.69%。

§ 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 | 本基金的基金经理，易方 | 2012- | - | 17 年 | 硕士研究生，具有基金从业 |

| | | | | | |
|---|---|-------|--|--|--|
| 剑 | 达信用债债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员 | 02-29 | | | 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、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。 |
|---|---|-------|--|--|--|

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行业协会相关规定。

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、决策流程和交易流程，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 12 次，其中 9 次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，3 次为不同基金经理管理的基金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。

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

基本面在三季度呈现筑底回升的走势。经济数据自 6 月份开始呈现企稳迹象，主要体现为工业增加值、社会消费品零售额、基建投资、制造业投资等指标的环比修复，金融数据也出现改善。这一趋势在 7 月份有所反复，但是在 8 月份得以延续。我们认为经济企稳主要有几方面的原因：一是全球需求恢复带动中国出口，尤其是电子产品出口回升显著；二是随着地方债发行加速，三季度政府支出节奏加快带来基建投资和制造业投资增速的回升；三是新能源退税政策延续及各地加大汽车购置补贴使得汽车生产、零售等数据回暖；四是暑期档出行需求增加带来服务业生产活动强度回升。同时我们也观察到，地产相关政策虽然有所松动，但房地产销售数据改善不显著，地产投资也继续下行。房地产相关产业链条持续对经济造成负面拖累。

政策方面，三季度明显加大了逆周期调节的力度，各方面稳定经济稳定信心的政策陆续出台。央行在降息、降准的同时保持了银行间资金利率水平的稳定，非银资金成本甚至略有上行，债券市场整体杠杆率有所下降。另一方面财政支出发力后，信贷社融数据呈现显著改善。三季度政策积极程度整体强于二季度。后续随着地产政策的进一步放松、地方政府债务化解政策逐步推进，经济有望延续筑底回升的走势。

从债券市场的表现来看，三季度收益率先下后上，呈现平坦化特征。1-3 年国开

债收益率上行 8-16BP，4-5 年期国开债收益率上行 3-4BP，而超长端 20 年国开债收益率则下行 8BP。信用债收益率跟随利率债变动，AAA 评级 1-3 年期限信用债收益率上行 8-9BP，5 年期信用债收益率上行 2BP，10 年期信用债收益率反而下行 5BP。城投行业信用利差出现显著压缩，1-5 年期限 AA（2）评级相对于 AAA 信用债的信用利差下行 10-20BP。

三季度权益市场继续震荡下跌。沪深 300 指数下跌 3.98%，创业板指数下跌 9.53%。行业方面，非银金融、煤炭、石油石化行业表现相对较好，上涨 4-5%，而电力设备、传媒、计算机、通信等行业下跌较大，跌幅达到 10% 以上。可转债表现出一定的抗跌属性，中证转债指数下跌 0.52%。

操作上组合三季度进行了积极的资产配置调整。债券配置自 7 月中旬之后趋于谨慎。在 9 月份经济筑底趋势更为确定后，组合积极降低了债券久期，提升了股票和可转债仓位。本组合净值整体在三季度保持平稳。

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 1.3830 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；B 类基金份额净值为 1.3921 元，本报告期份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%；C 类基金份额净值为 1.3843 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 10,496,499,493.11 | 12.36 |
| | 其中：股票 | 10,496,499,493.11 | 12.36 |
| 2 | 固定收益投资 | 73,911,928,568.17 | 87.02 |

| | | | |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| | 其中：债券 | 72,950,452,056.16 | 85.88 |
| | 资产支持证券 | 961,476,512.01 | 1.13 |
| 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 | 470,060,729.01 | 0.55 |
| 7 | 其他资产 | 61,637,608.37 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 84,940,126,398.66 | 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 | 86,974,903.62 | 0.14 |
| B | 采矿业 | 263,608,612.80 | 0.42 |
| C | 制造业 | 6,373,024,605.62 | 10.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 159,123,539.72 | 0.26 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,387,755,131.77 | 2.24 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 912,561,541.80 | 1.47 |
| J | 金融业 | 591,339,874.73 | 0.95 |
| K | 房地产业 | 260,304,441.76 | 0.42 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 429,059,050.06 | 0.69 |
| 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 | 32,747,791.23 | 0.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 10,496,499,493.11 | 16.92 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 600018 | 上港集团 | 71,730,700 | 369,413,105.00 | 0.60 |
| 2 | 000786 | 北新建材 | 11,635,446 | 349,645,152.30 | 0.56 |
| 3 | 600941 | 中国移动 | 3,353,665 | 324,701,845.30 | 0.52 |
| 4 | 600660 | 福耀玻璃 | 8,784,623 | 324,328,281.16 | 0.52 |
| 5 | 601298 | 青岛港 | 50,363,599 | 320,312,489.64 | 0.52 |
| 6 | 600150 | 中国船舶 | 10,784,259 | 300,880,826.10 | 0.48 |
| 7 | 600873 | 梅花生物 | 30,579,133 | 294,171,259.46 | 0.47 |
| 8 | 601728 | 中国电信 | 50,145,950 | 290,345,050.50 | 0.47 |
| 9 | 601598 | 中国外运 | 58,087,320 | 288,693,980.40 | 0.47 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 158,819 | 285,643,912.45 | 0.46 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例(%) |
|----|-----------|-------------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 38,560,258,044.36 | 62.15 |
| | 其中：政策性金融债 | 6,192,317,265.92 | 9.98 |
| 4 | 企业债券 | 5,549,602,705.15 | 8.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | 664,122,432.26 | 1.07 |
| 6 | 中期票据 | 14,100,074,854.86 | 22.72 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 14,076,394,019.53 | 22.69 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|-------------------|--------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 72,950,452,056.16 | 117.57 |

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 | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 10,700,000 | 1,117,610,895.89 | 1.80 |
| 2 | 2028013 | 20 农业银行二级 01 | 10,400,000 | 1,058,125,551.91 | 1.71 |
| 3 | 230301 | 23 进出 01 | 9,400,000 | 953,109,147.54 | 1.54 |
| 4 | 2028018 | 20 交通银行二级 | 9,000,000 | 917,027,114.75 | 1.48 |
| 5 | 230410 | 23 农发 10 | 8,900,000 | 894,337,412.57 | 1.44 |

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 | 135099 | 22 金泰优 | 1,700,000 | 170,417,664.11 | 0.27 |
| 2 | 135909 | 济建 4 优 | 800,000 | 81,480,153.42 | 0.13 |
| 3 | 193797 | 21 工鑫 8A | 600,000 | 62,001,889.31 | 0.10 |
| 4 | 260271 | 23 和远 A2 | 500,000 | 49,828,493.15 | 0.08 |
| 5 | 199272 | 23 北辰 A | 400,000 | 40,530,082.19 | 0.07 |
| 6 | 135947 | 荟享 101A | 400,000 | 40,372,401.10 | 0.07 |
| 7 | 143041 | 荟享 102A | 400,000 | 40,250,334.25 | 0.06 |
| 8 | 199057 | 耘睿 083A | 400,000 | 40,215,693.15 | 0.06 |
| 9 | 260255 | 耘睿 101A | 400,000 | 40,026,218.08 | 0.06 |
| 10 | 260418 | G 黄河优 | 400,000 | 39,952,070.14 | 0.06 |

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,873,566.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,329,600.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 56,434,441.64 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 61,637,608.37 |

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 | 113050 | 南银转债 | 466,821,137.39 | 0.75 |
| 2 | 118031 | 天 23 转债 | 445,969,068.87 | 0.72 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 357,679,509.16 | 0.58 |
| 4 | 127045 | 牧原转债 | 353,137,118.69 | 0.57 |
| 5 | 127049 | 希望转 2 | 302,736,330.20 | 0.49 |
| 6 | 113062 | 常银转债 | 243,830,955.00 | 0.39 |
| 7 | 113059 | 福莱转债 | 222,300,484.68 | 0.36 |
| 8 | 113065 | 齐鲁转债 | 221,508,726.50 | 0.36 |

| | | | | |
|----|--------|---------|----------------|------|
| 9 | 127018 | 本钢转债 | 196,572,476.29 | 0.32 |
| 10 | 113056 | 重银转债 | 183,733,475.34 | 0.30 |
| 11 | 127073 | 天赐转债 | 176,989,634.10 | 0.29 |
| 12 | 113641 | 华友转债 | 175,378,765.82 | 0.28 |
| 13 | 110093 | 神马转债 | 163,823,057.45 | 0.26 |
| 14 | 127061 | 美锦转债 | 163,024,257.33 | 0.26 |
| 15 | 110043 | 无锡转债 | 158,938,968.95 | 0.26 |
| 16 | 127030 | 盛虹转债 | 154,156,468.03 | 0.25 |
| 17 | 118022 | 锂科转债 | 147,413,171.98 | 0.24 |
| 18 | 127040 | 国泰转债 | 138,320,825.92 | 0.22 |
| 19 | 110064 | 建工转债 | 131,037,306.77 | 0.21 |
| 20 | 110089 | 兴发转债 | 127,971,713.19 | 0.21 |
| 21 | 110085 | 通 22 转债 | 126,033,987.12 | 0.20 |
| 22 | 127067 | 恒逸转 2 | 124,455,329.94 | 0.20 |
| 23 | 113049 | 长汽转债 | 121,612,580.76 | 0.20 |
| 24 | 127039 | 北港转债 | 117,775,787.60 | 0.19 |
| 25 | 113048 | 晶科转债 | 116,462,302.62 | 0.19 |
| 26 | 113623 | 凤 21 转债 | 112,790,459.62 | 0.18 |
| 27 | 127052 | 西子转债 | 108,958,444.67 | 0.18 |
| 28 | 110087 | 天业转债 | 108,683,097.75 | 0.18 |
| 29 | 113045 | 环旭转债 | 106,972,681.85 | 0.17 |
| 30 | 128109 | 楚江转债 | 106,497,753.58 | 0.17 |
| 31 | 123128 | 首华转债 | 105,754,769.18 | 0.17 |
| 32 | 113659 | 莱克转债 | 104,019,548.39 | 0.17 |
| 33 | 127025 | 冀东转债 | 104,002,475.57 | 0.17 |
| 34 | 113640 | 苏利转债 | 94,777,518.17 | 0.15 |
| 35 | 113619 | 世运转债 | 92,499,010.37 | 0.15 |
| 36 | 110088 | 淮 22 转债 | 92,489,235.83 | 0.15 |
| 37 | 127070 | 大中转债 | 90,833,502.88 | 0.15 |
| 38 | 113064 | 东材转债 | 90,784,471.38 | 0.15 |
| 39 | 113637 | 华翔转债 | 88,212,159.77 | 0.14 |
| 40 | 113051 | 节能转债 | 87,273,991.52 | 0.14 |
| 41 | 110086 | 精工转债 | 84,808,324.24 | 0.14 |
| 42 | 128127 | 文科转债 | 84,400,053.22 | 0.14 |
| 43 | 127075 | 百川转 2 | 80,444,776.16 | 0.13 |
| 44 | 113054 | 绿动转债 | 77,792,982.12 | 0.13 |
| 45 | 118019 | 金盘转债 | 77,454,594.99 | 0.12 |
| 46 | 123119 | 康泰转 2 | 76,824,668.50 | 0.12 |
| 47 | 127066 | 科利转债 | 76,734,912.14 | 0.12 |
| 48 | 118013 | 道通转债 | 76,578,327.12 | 0.12 |
| 49 | 123169 | 正海转债 | 76,029,056.22 | 0.12 |
| 50 | 127074 | 麦米转 2 | 75,860,429.03 | 0.12 |
| 51 | 123165 | 回天转债 | 73,880,567.03 | 0.12 |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 52 | 123120 | 隆华转债 | 72,454,589.70 | 0.12 |
| 53 | 123146 | 中环转 2 | 71,771,233.60 | 0.12 |
| 54 | 113663 | 新化转债 | 71,526,734.53 | 0.12 |
| 55 | 113060 | 浙 22 转债 | 71,322,536.39 | 0.11 |
| 56 | 127027 | 能化转债 | 71,180,216.31 | 0.11 |
| 57 | 118026 | 利元转债 | 70,927,587.74 | 0.11 |
| 58 | 127033 | 中装转 2 | 68,732,416.54 | 0.11 |
| 59 | 127026 | 超声转债 | 68,116,427.96 | 0.11 |
| 60 | 113655 | 欧 22 转债 | 67,853,393.73 | 0.11 |
| 61 | 118027 | 宏图转债 | 67,774,462.02 | 0.11 |
| 62 | 128121 | 宏川转债 | 67,152,943.70 | 0.11 |
| 63 | 123161 | 强联转债 | 66,152,160.03 | 0.11 |
| 64 | 123147 | 中辰转债 | 64,567,792.25 | 0.10 |
| 65 | 123158 | 宙邦转债 | 64,146,315.37 | 0.10 |
| 66 | 118023 | 广大转债 | 63,453,652.24 | 0.10 |
| 67 | 111004 | 明新转债 | 63,424,011.31 | 0.10 |
| 68 | 123144 | 裕兴转债 | 63,046,011.95 | 0.10 |
| 69 | 111001 | 山玻转债 | 62,422,102.48 | 0.10 |
| 70 | 113017 | 吉视转债 | 61,921,973.38 | 0.10 |
| 71 | 123115 | 捷捷转债 | 61,336,384.57 | 0.10 |
| 72 | 128119 | 龙大转债 | 61,031,744.38 | 0.10 |
| 73 | 127060 | 湘佳转债 | 59,670,843.59 | 0.10 |
| 74 | 127050 | 麒麟转债 | 58,167,334.59 | 0.09 |
| 75 | 127082 | 亚科转债 | 57,840,634.74 | 0.09 |
| 76 | 128105 | 长集转债 | 57,414,481.45 | 0.09 |
| 77 | 118020 | 芳源转债 | 56,528,328.62 | 0.09 |
| 78 | 127044 | 蒙娜转债 | 53,620,010.65 | 0.09 |
| 79 | 113638 | 台 21 转债 | 53,576,282.73 | 0.09 |
| 80 | 118033 | 华特转债 | 53,427,596.17 | 0.09 |
| 81 | 110072 | 广汇转债 | 53,024,239.97 | 0.09 |
| 82 | 127071 | 天箭转债 | 52,283,218.45 | 0.08 |
| 83 | 110045 | 海澜转债 | 51,276,891.37 | 0.08 |
| 84 | 113600 | 新星转债 | 50,421,549.37 | 0.08 |
| 85 | 113632 | 鹤 21 转债 | 49,792,192.53 | 0.08 |
| 86 | 123063 | 大禹转债 | 48,691,958.84 | 0.08 |
| 87 | 113596 | 城地转债 | 48,400,825.55 | 0.08 |
| 88 | 123087 | 明电转债 | 48,192,350.79 | 0.08 |
| 89 | 113629 | 泉峰转债 | 47,825,916.05 | 0.08 |
| 90 | 127068 | 顺博转债 | 47,373,941.02 | 0.08 |
| 91 | 127031 | 洋丰转债 | 45,997,384.80 | 0.07 |
| 92 | 113609 | 永安转债 | 45,825,786.10 | 0.07 |
| 93 | 127055 | 精装转债 | 45,797,851.72 | 0.07 |
| 94 | 123149 | 通裕转债 | 44,495,409.47 | 0.07 |

| | | | | |
|-----|--------|----------|---------------|------|
| 95 | 113604 | 多伦转债 | 44,326,590.32 | 0.07 |
| 96 | 113610 | 灵康转债 | 44,199,866.13 | 0.07 |
| 97 | 113644 | 艾迪转债 | 44,081,004.19 | 0.07 |
| 98 | 127081 | 中旗转债 | 42,945,032.95 | 0.07 |
| 99 | 123164 | 法本转债 | 42,748,468.38 | 0.07 |
| 100 | 113608 | 威派转债 | 42,618,924.89 | 0.07 |
| 101 | 113606 | 荣泰转债 | 42,517,364.89 | 0.07 |
| 102 | 118024 | 冠宇转债 | 42,509,212.00 | 0.07 |
| 103 | 113666 | 爱玛转债 | 41,831,186.81 | 0.07 |
| 104 | 118010 | 洁特转债 | 41,295,583.97 | 0.07 |
| 105 | 113058 | 友发转债 | 40,923,872.91 | 0.07 |
| 106 | 111000 | 起帆转债 | 39,976,990.16 | 0.06 |
| 107 | 132020 | 19 蓝星 EB | 39,858,362.00 | 0.06 |
| 108 | 118028 | 会通转债 | 39,315,596.63 | 0.06 |
| 109 | 128034 | 江银转债 | 38,986,920.07 | 0.06 |
| 110 | 123090 | 三诺转债 | 38,654,206.74 | 0.06 |
| 111 | 113532 | 海环转债 | 38,570,335.29 | 0.06 |
| 112 | 123071 | 天能转债 | 38,515,106.68 | 0.06 |
| 113 | 128063 | 未来转债 | 38,210,651.14 | 0.06 |
| 114 | 123172 | 漱玉转债 | 37,837,869.98 | 0.06 |
| 115 | 123182 | 广联转债 | 37,443,208.42 | 0.06 |
| 116 | 113033 | 利群转债 | 37,006,190.93 | 0.06 |
| 117 | 123162 | 东杰转债 | 36,199,349.75 | 0.06 |
| 118 | 113505 | 杭电转债 | 35,038,802.83 | 0.06 |
| 119 | 123114 | 三角转债 | 34,575,832.17 | 0.06 |
| 120 | 127043 | 川恒转债 | 34,157,495.28 | 0.06 |
| 121 | 113656 | 嘉诚转债 | 33,414,948.55 | 0.05 |
| 122 | 111009 | 盛泰转债 | 33,192,398.03 | 0.05 |
| 123 | 123076 | 强力转债 | 32,836,677.52 | 0.05 |
| 124 | 110084 | 贵燃转债 | 32,745,687.75 | 0.05 |
| 125 | 113662 | 豪能转债 | 32,680,967.58 | 0.05 |
| 126 | 123168 | 惠云转债 | 32,508,622.51 | 0.05 |
| 127 | 118017 | 深科转债 | 32,385,015.80 | 0.05 |
| 128 | 127079 | 华亚转债 | 32,144,574.64 | 0.05 |
| 129 | 111002 | 特纸转债 | 31,279,149.75 | 0.05 |
| 130 | 123166 | 蒙泰转债 | 31,126,888.40 | 0.05 |
| 131 | 123160 | 泰福转债 | 31,104,388.51 | 0.05 |
| 132 | 127078 | 优彩转债 | 31,043,545.12 | 0.05 |
| 133 | 123163 | 金沃转债 | 30,837,140.69 | 0.05 |
| 134 | 123121 | 帝尔转债 | 30,564,384.57 | 0.05 |
| 135 | 123154 | 火星转债 | 29,942,599.34 | 0.05 |
| 136 | 123099 | 普利转债 | 28,390,449.45 | 0.05 |
| 137 | 123082 | 北陆转债 | 27,941,179.30 | 0.05 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 138 | 123106 | 正丹转债 | 27,716,776.83 | 0.04 |
| 139 | 118032 | 建龙转债 | 27,658,363.46 | 0.04 |
| 140 | 113639 | 华正转债 | 27,578,408.55 | 0.04 |
| 141 | 127019 | 国城转债 | 27,029,272.18 | 0.04 |
| 142 | 123167 | 商络转债 | 26,945,113.27 | 0.04 |
| 143 | 113061 | 拓普转债 | 26,731,136.96 | 0.04 |
| 144 | 123085 | 万顺转 2 | 26,157,890.44 | 0.04 |
| 145 | 123157 | 科蓝转债 | 25,631,806.00 | 0.04 |
| 146 | 123150 | 九强转债 | 23,509,233.97 | 0.04 |
| 147 | 113549 | 白电转债 | 23,314,835.21 | 0.04 |
| 148 | 118012 | 微芯转债 | 22,726,304.77 | 0.04 |
| 149 | 113667 | 春 23 转债 | 21,703,416.13 | 0.03 |
| 150 | 123170 | 南电转债 | 21,663,737.24 | 0.03 |
| 151 | 113601 | 塞力转债 | 21,527,508.36 | 0.03 |
| 152 | 123109 | 昌红转债 | 21,046,515.16 | 0.03 |
| 153 | 113021 | 中信转债 | 20,102,660.39 | 0.03 |
| 154 | 123091 | 长海转债 | 20,093,502.94 | 0.03 |
| 155 | 113066 | 平煤转债 | 20,038,961.90 | 0.03 |
| 156 | 128017 | 金禾转债 | 19,960,687.40 | 0.03 |
| 157 | 110063 | 鹰 19 转债 | 19,903,956.00 | 0.03 |
| 158 | 128134 | 鸿路转债 | 19,519,002.36 | 0.03 |
| 159 | 113636 | 甬金转债 | 18,950,934.10 | 0.03 |
| 160 | 127005 | 长证转债 | 18,596,996.90 | 0.03 |
| 161 | 110047 | 山鹰转债 | 18,337,158.08 | 0.03 |
| 162 | 113661 | 福 22 转债 | 17,933,757.29 | 0.03 |
| 163 | 127038 | 国微转债 | 17,388,008.41 | 0.03 |
| 164 | 118006 | 阿拉转债 | 17,236,691.61 | 0.03 |
| 165 | 118011 | 银微转债 | 17,110,220.50 | 0.03 |
| 166 | 128144 | 利民转债 | 16,926,171.27 | 0.03 |
| 167 | 123178 | 花园转债 | 16,626,514.53 | 0.03 |
| 168 | 123152 | 润禾转债 | 16,518,772.00 | 0.03 |
| 169 | 113516 | 苏农转债 | 16,279,875.18 | 0.03 |
| 170 | 127042 | 嘉美转债 | 16,213,897.56 | 0.03 |
| 171 | 113621 | 彤程转债 | 15,935,782.60 | 0.03 |
| 172 | 128048 | 张行转债 | 15,700,222.18 | 0.03 |
| 173 | 123124 | 晶瑞转 2 | 15,018,775.84 | 0.02 |
| 174 | 113647 | 禾丰转债 | 14,905,069.64 | 0.02 |
| 175 | 128141 | 旺能转债 | 14,888,401.11 | 0.02 |
| 176 | 113643 | 风语转债 | 14,635,724.89 | 0.02 |
| 177 | 123132 | 回盛转债 | 14,323,794.54 | 0.02 |
| 178 | 113658 | 密卫转债 | 13,855,650.04 | 0.02 |
| 179 | 118005 | 天奈转债 | 13,741,862.47 | 0.02 |
| 180 | 123159 | 崧盛转债 | 13,696,661.46 | 0.02 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 181 | 118018 | 瑞科转债 | 13,132,304.71 | 0.02 |
| 182 | 123049 | 维尔转债 | 12,780,230.97 | 0.02 |
| 183 | 128130 | 景兴转债 | 12,116,464.75 | 0.02 |
| 184 | 110081 | 闻泰转债 | 12,060,509.92 | 0.02 |
| 185 | 127047 | 帝欧转债 | 12,040,222.71 | 0.02 |
| 186 | 123010 | 博世转债 | 11,927,135.75 | 0.02 |
| 187 | 127022 | 恒逸转债 | 11,338,238.08 | 0.02 |
| 188 | 113030 | 东风转债 | 11,324,924.88 | 0.02 |
| 189 | 111007 | 永和转债 | 11,137,780.05 | 0.02 |
| 190 | 113627 | 太平转债 | 10,871,576.70 | 0.02 |
| 191 | 118015 | 芯海转债 | 10,734,181.32 | 0.02 |
| 192 | 128143 | 锋龙转债 | 10,518,519.83 | 0.02 |
| 193 | 127053 | 豪美转债 | 10,486,738.95 | 0.02 |
| 194 | 128135 | 洽洽转债 | 10,458,111.86 | 0.02 |
| 195 | 111008 | 沿浦转债 | 10,377,461.33 | 0.02 |
| 196 | 118004 | 博瑞转债 | 10,183,147.21 | 0.02 |
| 197 | 123113 | 仙乐转债 | 9,980,349.10 | 0.02 |
| 198 | 113665 | 汇通转债 | 9,534,638.91 | 0.02 |
| 199 | 113628 | 晨丰转债 | 9,442,982.46 | 0.02 |
| 200 | 128123 | 国光转债 | 9,370,775.53 | 0.02 |
| 201 | 113591 | 胜达转债 | 9,008,035.15 | 0.01 |
| 202 | 111011 | 冠盛转债 | 8,791,383.59 | 0.01 |
| 203 | 123129 | 锦鸡转债 | 7,019,825.65 | 0.01 |
| 204 | 128083 | 新北转债 | 6,980,113.71 | 0.01 |
| 205 | 123131 | 奥飞转债 | 6,815,695.23 | 0.01 |
| 206 | 127062 | 垒知转债 | 6,093,547.81 | 0.01 |
| 207 | 123103 | 震安转债 | 5,847,740.94 | 0.01 |
| 208 | 113577 | 春秋转债 | 5,485,763.00 | 0.01 |
| 209 | 128033 | 迪龙转债 | 5,483,172.48 | 0.01 |
| 210 | 127054 | 双箭转债 | 5,445,647.87 | 0.01 |
| 211 | 128026 | 众兴转债 | 5,081,028.70 | 0.01 |
| 212 | 123035 | 利德转债 | 4,971,516.47 | 0.01 |
| 213 | 111003 | 聚合转债 | 4,941,156.19 | 0.01 |
| 214 | 127076 | 中宠转 2 | 4,821,266.03 | 0.01 |
| 215 | 113657 | 再 22 转债 | 4,526,866.06 | 0.01 |
| 216 | 113631 | 皖天转债 | 4,121,478.93 | 0.01 |
| 217 | 123151 | 康医转债 | 4,095,721.67 | 0.01 |
| 218 | 128097 | 奥佳转债 | 3,865,372.03 | 0.01 |
| 219 | 118009 | 华锐转债 | 3,691,675.79 | 0.01 |
| 220 | 113625 | 江山转债 | 3,616,085.77 | 0.01 |
| 221 | 123155 | 中陆转债 | 3,423,140.80 | 0.01 |
| 222 | 128042 | 凯中转债 | 2,594,460.93 | 0.00 |
| 223 | 123002 | 国祯转债 | 1,873,259.97 | 0.00 |

| | | | | |
|-----|--------|----------|--------------|------|
| 224 | 123048 | 应急转债 | 1,358,788.64 | 0.00 |
| 225 | 128044 | 岭南转债 | 710,646.55 | 0.00 |
| 226 | 123126 | 瑞丰转债 | 581,573.36 | 0.00 |
| 227 | 113653 | 永 22 转债 | 474,960.11 | 0.00 |
| 228 | 113042 | 上银转债 | 125,428.92 | 0.00 |
| 229 | 132018 | G 三峡 EB1 | 94,273.14 | 0.00 |
| 230 | 127016 | 鲁泰转债 | 11,645.73 | 0.00 |
| 231 | 128037 | 岩土转债 | 1,200.17 | 0.00 |
| 232 | 128108 | 蓝帆转债 | 1,018.54 | 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 | 9,906,989,519.00 | 29,819,464,450.73 | 220,844,986.59 |
| 报告期期间基金总 申购份额 | 1,734,118,295.88 | 7,214,620,739.50 | 112,144,240.12 |
| 减：报告期期间基 金总赎回份额 | 1,593,362,728.28 | 2,719,130,256.26 | 58,271,168.66 |
| 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 | 10,047,745,086.60 | 34,314,954,933.97 | 274,718,058.05 |

§ 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
二〇二三年十月二十五日