

易方达稳健收益债券型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达稳健收益债券
基金主代码	110007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 1 月 29 日
报告期末基金份额总额	50,175,403,354.88 份
投资目标	通过主要投资于债券品种，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在固定收益品种、可转换债券、股票主动投资以及新股（含增发）申购之间的配置：1、主要基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2、基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等，

	预测新股申购的收益率以及风险；3、股票市场走势的预测；4、可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。		
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达稳健收益债券 A	易方达稳健收益债券 B	易方达稳健收益债券 C
下属分级基金的交易代码	110007	110008	008008
报告期末下属分级基金的份额总额	13,948,099,071.67 份	35,984,470,209.11 份	242,834,074.10 份

注：自 2019 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 10 月 24 日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)		
	易方达稳健收益 债券 A	易方达稳健收益 债券 B	易方达稳健收益 债券 C
1.本期已实现收益	72,342,233.43	218,712,066.90	1,296,524.93
2.本期利润	294,878,259.69	792,033,028.98	5,305,630.91
3.加权平均基金份额	0.0286	0.0294	0.0289

本期利润			
4.期末基金资产净值	19,631,671,705.61	50,788,047,510.74	341,987,978.25
5.期末基金份额净值	1.4075	1.4114	1.4083

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	1.87%	0.11%	1.27%	0.08%	0.60%	0.03%
过去六个月	4.43%	0.16%	2.09%	0.11%	2.34%	0.05%
过去一年	8.66%	0.20%	4.17%	0.13%	4.49%	0.07%
过去三年	32.58%	0.28%	7.18%	0.13%	25.40%	0.15%
过去五年	40.46%	0.26%	8.94%	0.12%	31.52%	0.14%
自基金合同生效起至今	201.02%	0.28%	20.62%	0.13%	180.40%	0.15%

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	1.95%	0.11%	1.27%	0.08%	0.68%	0.03%
过去六个月	4.58%	0.16%	2.09%	0.11%	2.49%	0.05%
过去一年	8.99%	0.20%	4.17%	0.13%	4.82%	0.07%
过去三年	33.76%	0.28%	7.18%	0.13%	26.58%	0.15%

过去五年	42.50%	0.26%	8.94%	0.12%	33.56%	0.14%
自基金合同生效起至今	213.92%	0.28%	20.62%	0.13%	193.30%	0.15%

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	1.87%	0.11%	1.27%	0.08%	0.60%	0.03%
过去六个月	4.43%	0.16%	2.09%	0.11%	2.34%	0.05%
过去一年	8.68%	0.20%	4.17%	0.13%	4.51%	0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.45%	0.25%	7.20%	0.14%	12.25%	0.11%

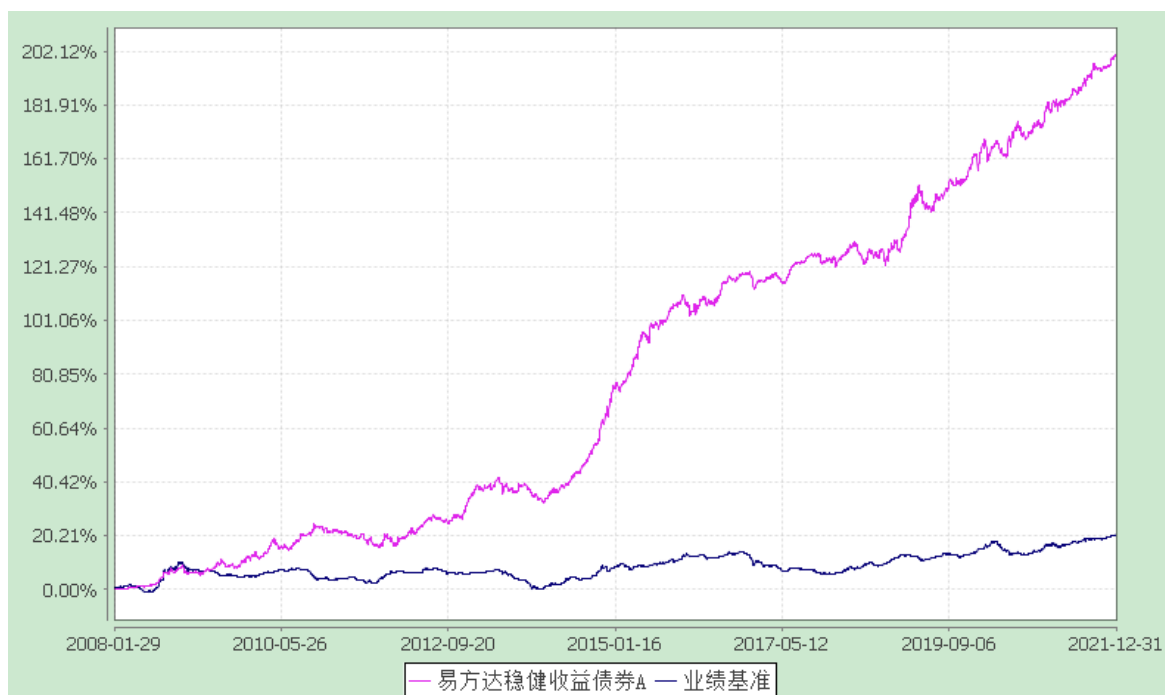
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达稳健收益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

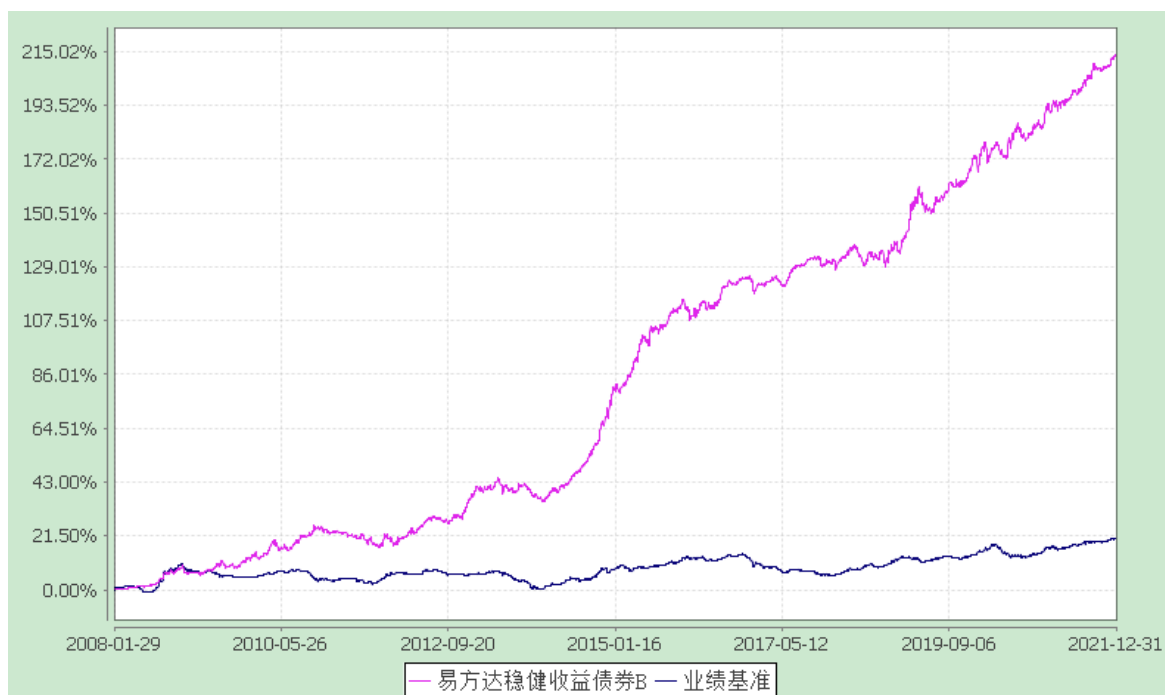
易方达稳健收益债券 A

(2008 年 1 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 B

(2008 年 1 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 C

(2019 年 10 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：1.本基金转型日期为 2008 年 1 月 29 日。

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

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

4.自基金转型至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 201.02%，B 类基金份额净值增长率为 213.92%，同期业绩比较基准收益率为 20.62%。C 类基金份额净值增长率为 19.45%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

§ 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 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒信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、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员	2012-02-29	-	15 年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达裕惠回报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、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、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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) 基金经理、易方

					达科润混合型证券投资基金 (LOF) 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、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 10 次，其中 9 次为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1 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

经济基本面在三季度大幅走弱之后，在 10、11 月份出现一定幅度的回升。受保供政策影响，生产端从 10 月份开始出现较为明显的反弹。零售数据也从前期大幅下滑中回升，10 月份基本消除了前期疫情带来的不良影响，11 月份进一步有所回升，

但回升速度有所下降。投资方面，房地产投资在 9 月、10 月仍有较为明显的下行，11 月份低位企稳；基建投资和制造业投资则连续小幅回升，但力度不大。出口数据持续较好，进口相对偏弱，但是在 11 月份也出现较大幅度回升。整体来看，四季度经济数据从之前大幅下滑的趋势中有所恢复。金融数据 10 月份改善，但 11 月份增速再度下降，整体数据受益于政府债和财政支出进度加快，但企业中长期贷款需求依然偏弱。价格数据相对平稳，中上游价格上涨趋势在 11 月份出现较为明显的缓解。

四季度政策面整体平稳，但是市场预期出现较大变化。12 月份中央经济工作会议传达了较强的稳增长预期。市场预期货币政策和财政政策均有望放松。2022 年上半年债券市场可能同时受到宽财政和宽货币两个方向的影响，后续将重点关注这两个方向的实际放松效果以及市场预期的变化情况。

市场方面，10 月上旬受资金相对紧张影响收益率出现一定幅度的上行，幅度在 15-20BP，10 月下旬之后受经济数据下行因素影响，收益率重回下行通道，并在 11 月初基本回到 9 月底的水平。12 月份经济工作会议打开降息空间之后，市场利率再度快速下行，3-5 年期限下行最为显著。

权益市场四季度先上后下，整体呈现振荡行情。沪深 300 指数上涨 1.52%，创业板指数上涨 2.40%。行业方面，传媒、国防军工、通信、轻工制造、电子、汽车等行业表现较好，涨幅达到 10-21%；煤炭、钢铁、石油化工等行业表现较差，跌幅达到 9-13%。转债市场持续表现较好，中证转债指数上涨 7.05%。

操作上，组合跟随申购积极进行了债券资产的配置，以中短端期限为主，久期维持中性水平，股票仓位维持在 10-15%之间，可转债小幅降低仓位。整体操作和表现稳健，获得了较好的持有期收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4075 元，本报告期份额净值增长率为 1.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%；B 类基金份额净值为 1.4114 元，本报告期份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%；C 类基金份额净值为 1.4083 元，本报告期份额净值增长率为 1.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%。

§ 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	8,485,247,272.11	11.70
	其中：股票	8,485,247,272.11	11.70
2	固定收益投资	62,267,437,092.68	85.83
	其中：债券	60,644,550,092.68	83.59
	资产支持证券	1,622,887,000.00	2.24
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	115,738,257.87	0.16
	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	223,019,514.11	0.31
7	其他资产	1,455,803,347.51	2.01
8	合计	72,547,245,484.28	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	500,120,868.80	0.71
B	采矿业	184,212,235.77	0.26
C	制造业	3,740,311,607.91	5.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	804,372,129.86	1.14
E	建筑业	784,030,400.73	1.11

F	批发和零售业	2,573,152.79	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	613,492,798.31	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,309,286.10	0.01
J	金融业	1,586,613,994.66	2.24
K	房地产业	233,332,909.86	0.33
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	30,877,887.32	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,485,247,272.11	11.99

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	600036	招商银行	10,959,090	533,817,273.90	0.75
2	002714	牧原股份	9,372,580	500,120,868.80	0.71
3	600011	华能国际	49,067,449	475,463,580.81	0.67
4	002142	宁波银行	11,805,330	451,908,032.40	0.64
5	600585	海螺水泥	11,053,299	445,447,949.70	0.63
6	000333	美的集团	5,490,603	405,261,407.43	0.57
7	600519	贵州茅台	181,019	371,088,950.00	0.52
8	000977	浪潮信息	10,197,334	365,370,477.22	0.52
9	601117	中国化学	31,093,224	361,718,688.00	0.51
10	000401	冀东水泥	27,154,290	324,765,308.40	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	1,688,870,000.00	2.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,286,228,000.00	39.97
	其中：政策性金融债	15,052,837,000.00	21.27
4	企业债券	9,431,024,036.60	13.33
5	企业短期融资券	1,059,984,000.00	1.50
6	中期票据	17,180,649,000.00	24.28
7	可转债（可交换债）	2,977,451,056.08	4.21
8	同业存单	-	-
9	其他	20,344,000.00	0.03
10	合计	60,644,550,092.68	85.70

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	210203	21 国开 03	40,500,000	4,135,455,000.00	5.84
2	210207	21 国开 07	24,900,000	2,516,145,000.00	3.56
3	210211	21 国开 11	17,700,000	1,768,407,000.00	2.50
4	2128046	21 浦发银行 02	15,000,000	1,506,000,000.00	2.13
5	200006	20 付息国债 06	13,000,000	1,280,500,000.00	1.81

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	2189478	21 建元 15A2_bc	4,000,000	381,880,000.00	0.54
2	193398	PR 产 3A	3,400,000	341,054,000.00	0.48
3	2189368	21 招银和家 4A2	2,290,000	229,458,000.00	0.32
4	169548	建花 15A	700,000	70,728,000.00	0.10
5	193797	21 工鑫 8A	600,000	60,300,000.00	0.09
6	193256	明远 03A3	500,000	50,245,000.00	0.07

7	137094	厚德 05A	400,000	40,140,000.00	0.06
8	136693	荟享 082A	400,000	40,116,000.00	0.06
9	189715	至远 04A2	400,000	40,032,000.00	0.06
10	169296	智禾 05A	300,000	30,225,000.00	0.04

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国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。上海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。

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	1,361,572.86
2	应收证券清算款	20,098,391.11
3	应收股利	-
4	应收利息	769,349,957.18
5	应收申购款	664,993,426.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,455,803,347.51

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	110059	浦发转债	203,445,979.00	0.29
2	113011	光大转债	195,866,970.00	0.28
3	110053	苏银转债	163,848,115.20	0.23
4	132018	G 三峡 EB1	150,274,984.00	0.21
5	127012	招路转债	146,232,131.04	0.21
6	113050	南银转债	137,962,303.20	0.19
7	110045	海澜转债	116,305,025.40	0.16
8	113026	核能转债	107,053,425.40	0.15
9	113042	上银转债	106,478,011.90	0.15
10	110073	国投转债	103,182,598.80	0.15
11	113024	核建转债	96,635,674.40	0.14
12	128081	海亮转债	95,181,888.90	0.13
13	128129	青农转债	73,783,442.70	0.10
14	110064	建工转债	71,752,189.00	0.10
15	132014	18 中化 EB	71,453,596.60	0.10
16	110061	川投转债	63,705,285.00	0.09
17	128035	大族转债	63,482,074.39	0.09
18	113037	紫银转债	62,789,995.70	0.09
19	123107	温氏转债	61,050,104.20	0.09
20	123076	强力转债	47,173,900.80	0.07
21	113530	大丰转债	37,004,336.40	0.05
22	123010	博世转债	36,590,136.88	0.05
23	132020	19 蓝星 EB	36,387,468.00	0.05
24	110043	无锡转债	35,296,219.00	0.05
25	132017	19 新钢 EB	32,296,320.00	0.05
26	110079	杭银转债	29,513,489.20	0.04
27	127016	鲁泰转债	28,472,089.80	0.04
28	128116	瑞达转债	28,046,085.12	0.04
29	127025	冀东转债	25,833,642.00	0.04
30	113036	宁建转债	24,212,928.60	0.03
31	110034	九州转债	24,097,842.00	0.03
32	127018	本钢转债	20,559,925.62	0.03
33	113519	长久转债	18,091,581.00	0.03
34	128037	岩土转债	18,004,845.20	0.03
35	128117	道恩转债	17,074,712.90	0.02

36	127021	特发转 2	16,763,843.25	0.02
37	113535	大业转债	15,585,822.00	0.02
38	113033	利群转债	15,121,168.80	0.02
39	113017	吉视转债	14,809,486.40	0.02
40	123108	乐普转 2	13,097,357.36	0.02
41	113549	白电转债	12,833,700.40	0.02
42	113608	威派转债	12,030,246.90	0.02
43	128063	未来转债	11,116,497.70	0.02
44	110056	亨通转债	10,547,662.40	0.01
45	128026	众兴转债	9,262,236.06	0.01
46	128044	岭南转债	9,086,516.91	0.01
47	113610	灵康转债	8,586,483.20	0.01
48	123085	万顺转 2	8,453,395.99	0.01
49	128015	久其转债	8,276,719.50	0.01
50	127014	北方转债	8,150,546.50	0.01
51	123082	北陆转债	7,914,189.35	0.01
52	113609	永安转债	7,849,522.80	0.01
53	123071	天能转债	7,565,638.98	0.01
54	128071	合兴转债	7,315,194.00	0.01
55	128130	景兴转债	7,311,058.80	0.01
56	128075	远东转债	7,242,265.60	0.01
57	113044	大秦转债	7,226,323.20	0.01
58	113601	塞力转债	7,191,538.20	0.01
59	110080	东湖转债	7,173,745.60	0.01
60	123106	正丹转债	7,085,343.66	0.01
61	120002	18 中原 EB	6,415,920.00	0.01
62	128023	亚太转债	6,092,244.00	0.01
63	128069	华森转债	5,802,732.00	0.01
64	113532	海环转债	5,653,628.70	0.01
65	128072	翔鹭转债	4,456,840.40	0.01
66	123044	红相转债	3,491,700.00	0.00
67	127022	恒逸转债	2,879,281.61	0.00
68	123023	迪森转债	2,858,628.36	0.00
69	113567	君禾转债	2,849,557.50	0.00
70	123039	开润转债	1,683,592.28	0.00
71	128070	智能转债	393,924.00	0.00
72	128131	崇达转 2	10,251.20	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

1	601117	中国化学	228,600,000.00	0.32	非公开发 行流通受 限
---	--------	------	----------------	------	-------------------

§ 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	7,955,288,439.39	22,442,714,490.38	138,420,101.96
报告期期间基金总 申购份额	8,580,168,049.46	17,524,123,763.11	128,532,519.02
减：报告期期间基 金总赎回份额	2,587,357,417.18	3,982,368,044.38	24,118,546.88
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	13,948,099,071.67	35,984,470,209.11	242,834,074.10

§ 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

二〇二二年一月二十一日