

易方达稳健收益债券型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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：二〇二四年三月二十九日

§ 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 2024 年 3 月 27 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 2023 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	23
§ 5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
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	24
§ 6 审计报告	24
6.1 审计意见	24
6.2 形成审计意见的基础	24
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	24
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	25
§ 7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	27
7.3 净资产变动表	29
7.4 报表附注	30
§ 8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况	67
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	67
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	68

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	73
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	73
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	73
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12	投资组合报告附注	73
§ 9	基金份额持有人信息	80
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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情况	81
§ 10	开放式基金份额变动	81
§ 11	重大事件揭示	82
11.1	基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4	基金投资策略的改变	82
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8	其他重大事件	84
§ 12	备查文件目录	86
12.1	备查文件目录	86
12.2	存放地点	86
12.3	查阅方式	86

§ 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	39,667,780,640.79 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	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	8,914,611,252.93 份	30,584,865,525.71 份	168,303,862.15 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。

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	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。

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 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	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	葛海蛟

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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 40-43 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）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 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	2023 年			2022 年			2021 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 C	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	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
本期已实现收益	266,320,559.22	893,311,438.40	6,546,727.18	268,765,433.13	828,519,845.54	5,029,267.86	334,739,125.82	1,164,482,546.77	4,394,021.39
本期利润	242,534,605.31	524,352,100.82	2,318,362.37	-564,059,388.18	-1,436,148,775.39	-11,348,329.29	651,568,839.56	2,107,669,256.29	9,180,239.48
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0171	0.0098	-0.0442	-0.0413	-0.0458	0.1140	0.1191	0.1113
本期加权平均净值利润率	1.79%	1.24%	0.71%	-3.24%	-3.02%	-3.36%	8.18%	8.55%	7.94%
本期基金份额净值增长率	1.89%	2.18%	1.90%	-2.74%	-2.44%	-2.71%	8.66%	8.99%	8.68%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末			2022 年末			2021 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 C	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	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
期末可供分配利润	188,166,380.41	932,703,192.35	3,795,147.48	565,248,042.84	1,605,618,454.25	11,722,566.09	933,039,458.32	2,514,324,585.81	16,456,335.30
期末可供分配基金份额利润	0.0211	0.0305	0.0225	0.0559	0.0610	0.0571	0.0669	0.0699	0.0678
期末基金资产净值	11,621,540,727.99	40,180,709,580.10	219,639,182.18	13,543,907,257.64	35,398,679,442.01	275,405,805.79	19,631,671,705.61	50,788,047,510.74	341,987,978.25
期末基	1.3037	1.3137	1.3050	1.3398	1.3457	1.3409	1.4075	1.4114	1.4083

基金份额净值									
3.1.3 累计期末指标	2023 年末			2022 年末			2021 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 C	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	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
基金份额累计净值增长率	198.31%	212.94%	18.42%	192.78%	206.25%	16.21%	201.02%	213.92%	19.45%

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.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	-1.29%	0.24%	0.54%	0.09%	-1.83%	0.15%
过去六个月	-1.12%	0.21%	0.77%	0.09%	-1.89%	0.12%
过去一年	1.89%	0.22%	3.12%	0.09%	-1.23%	0.13%
过去三年	7.69%	0.23%	8.13%	0.12%	-0.44%	0.11%
过去五年	31.39%	0.26%	11.26%	0.12%	20.13%	0.14%
自基金合同生效起至今	198.31%	0.28%	25.22%	0.12%	173.09%	0.16%

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	-1.22%	0.24%	0.54%	0.09%	-1.76%	0.15%
过去六个月	-0.98%	0.21%	0.77%	0.09%	-1.75%	0.12%
过去一年	2.18%	0.22%	3.12%	0.09%	-0.94%	0.13%
过去三年	8.65%	0.23%	8.13%	0.12%	0.52%	0.11%

过去五年	33.34%	0.26%	11.26%	0.12%	22.08%	0.14%
自基金合同生效起至今	212.94%	0.28%	25.22%	0.12%	187.72%	0.16%

易方达稳健收益债券 C

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	-1.29%	0.24%	0.54%	0.09%	-1.83%	0.15%
过去六个月	-1.12%	0.21%	0.77%	0.09%	-1.89%	0.12%
过去一年	1.90%	0.22%	3.12%	0.09%	-1.22%	0.13%
过去三年	7.74%	0.23%	8.13%	0.12%	-0.39%	0.11%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	18.42%	0.25%	11.29%	0.13%	7.13%	0.12%

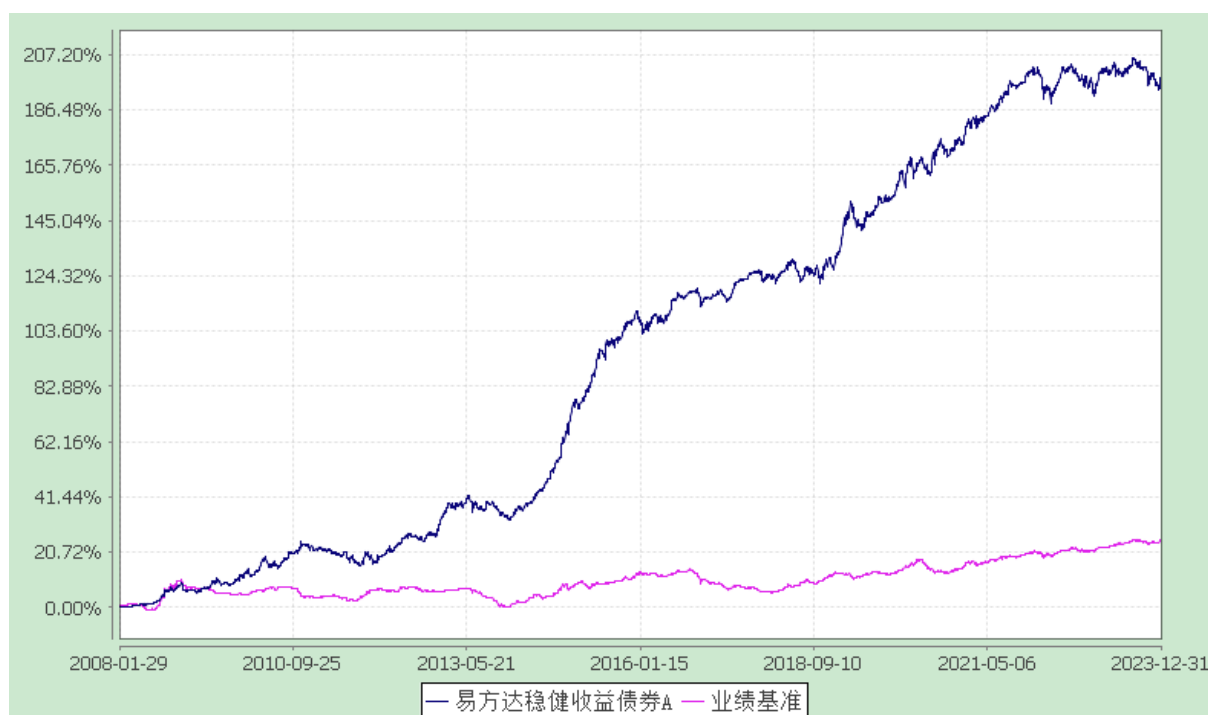
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

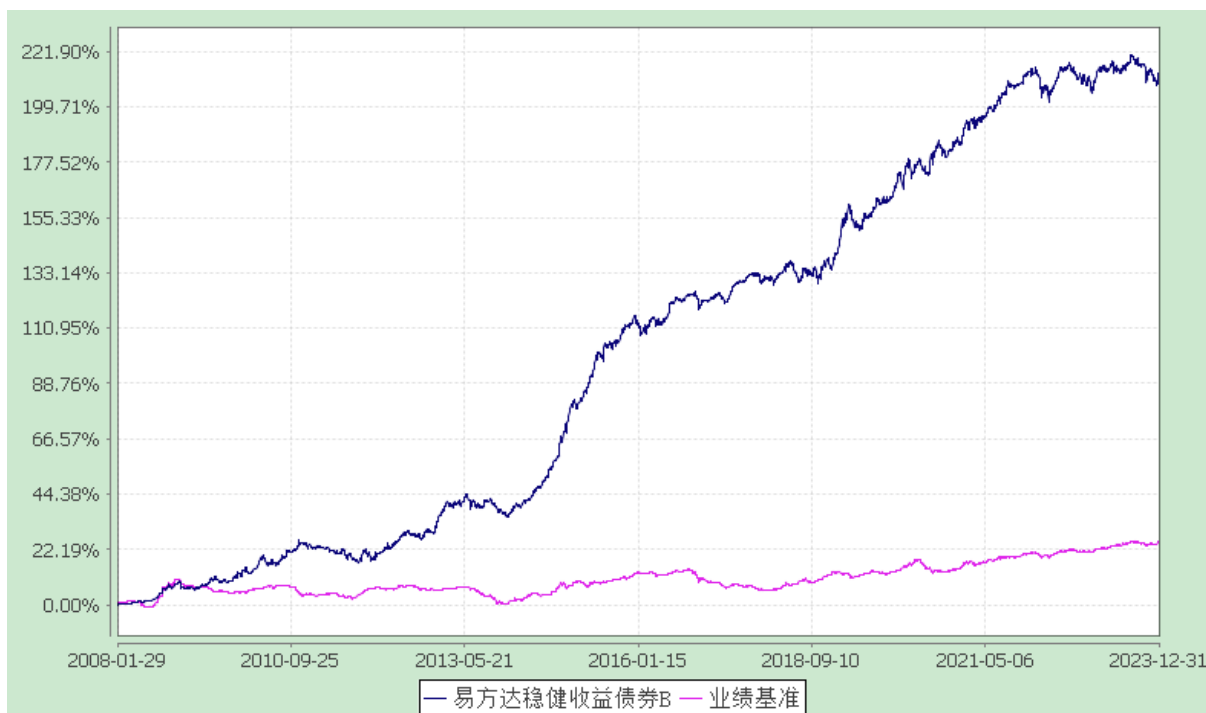
易方达稳健收益债券 A

(2008 年 1 月 29 日至 2023 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 B

(2008 年 1 月 29 日至 2023 年 12 月 31 日)



易方达稳健收益债券 C

(2019 年 10 月 24 日至 2023 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)”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。

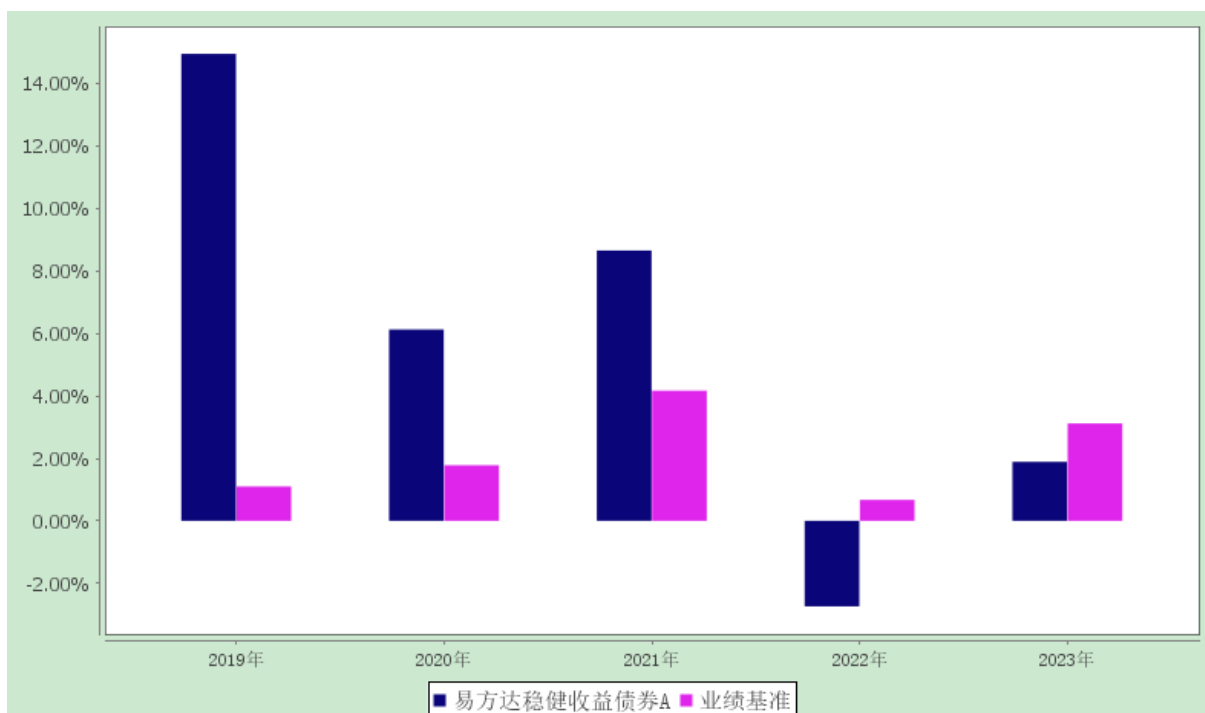
4.自基金转型至报告期末，A类基金份额净值增长率为198.31%，同期业绩比较基准收益率为25.22%；B类基金份额净值增长率为212.94%，同期业绩比较基准收益率为25.22%；C类基金份额净值增长率为18.42%，同期业绩比较基准收益率为11.29%。

3.2.3 过去五年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

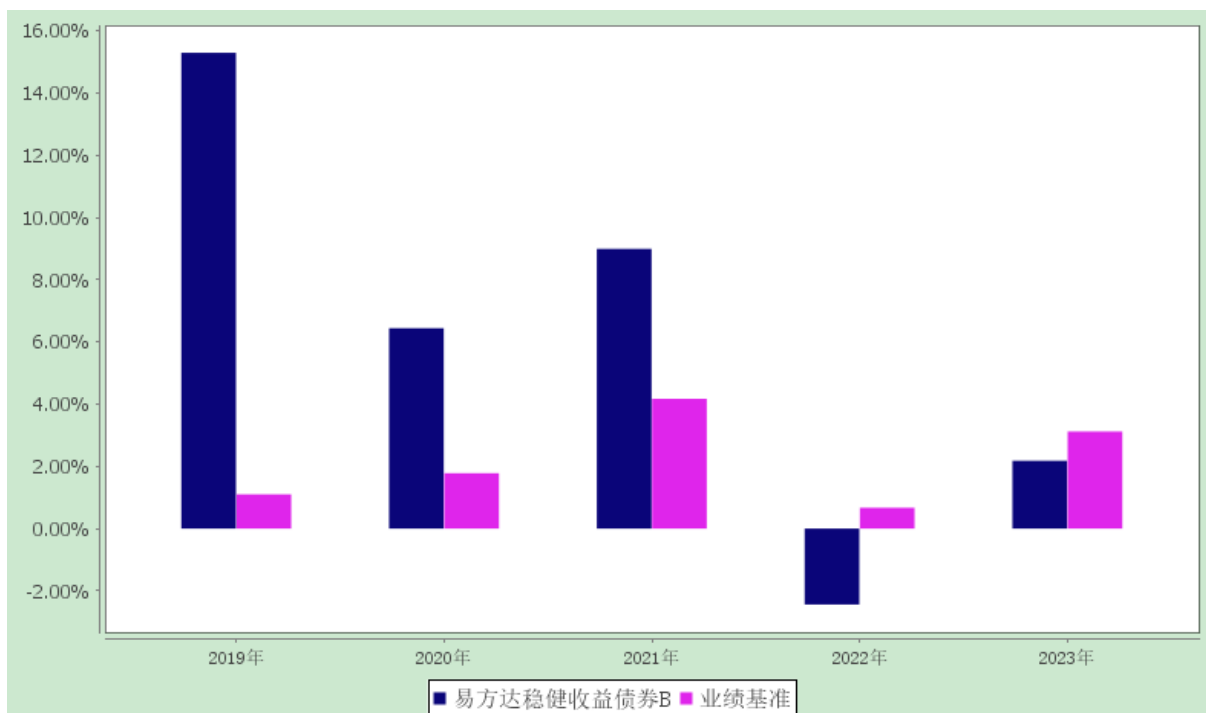
易方达稳健收益债券型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

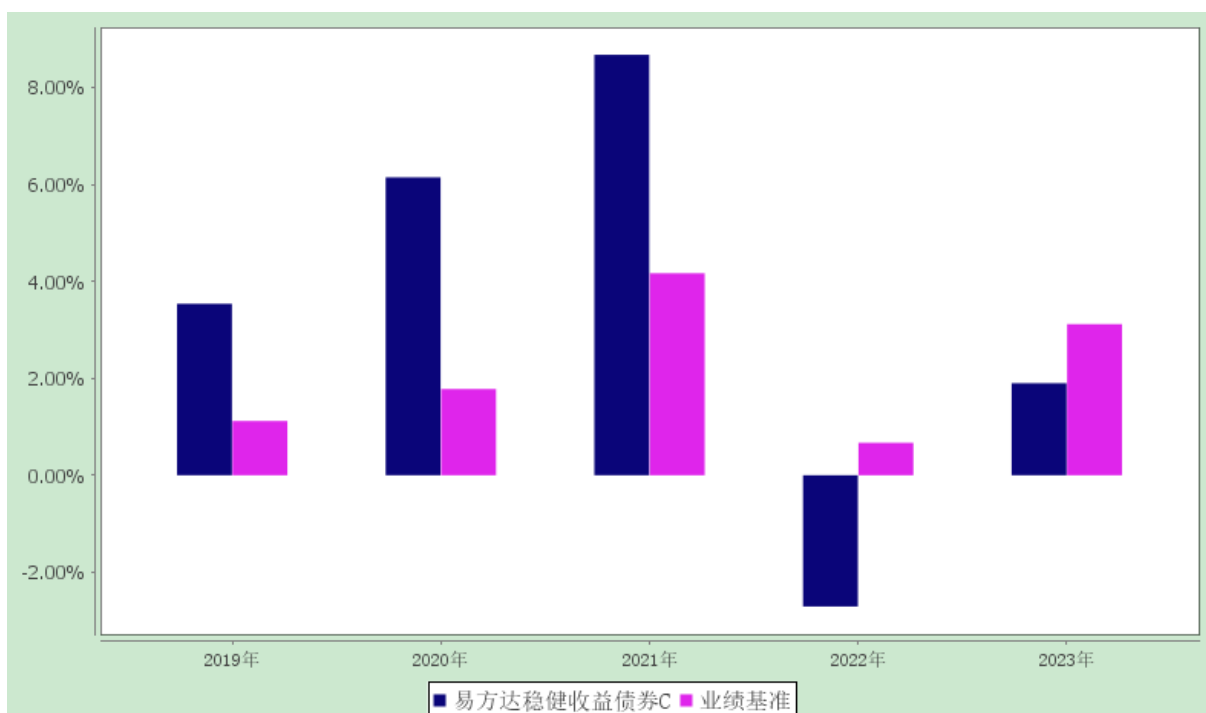
易方达稳健收益债券 A



易方达稳健收益债券 B



易方达稳健收益债券 C



注：1.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。

2.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%”。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调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2023年	0.610	338,624,800.87	221,746,795.40	560,371,596.27	-
2022年	0.300	298,039,125.44	146,829,771.53	444,868,896.97	-
2021年	0.410	282,456,738.12	119,913,848.09	402,370,586.21	-
合计	1.320	919,120,664.43	488,490,415.02	1,407,611,079.45	-

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
2023年	0.610	1,079,382,304.31	934,533,718.00	2,013,916,022.31	-
2022年	0.320	640,440,623.30	519,496,897.77	1,159,937,521.07	-
2021年	0.450	705,695,823.02	451,724,583.90	1,157,420,406.92	-
合计	1.380	2,425,518,750.63	1,905,755,199.67	4,331,273,950.30	-

易方达稳健收益债券 C

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
2023年	0.610	9,857,523.16	2,486,388.73	12,343,911.89	-
2022年	0.300	5,687,979.39	2,188,942.05	7,876,921.44	-
2021年	0.410	5,178,146.43	1,736,086.00	6,914,232.43	-
合计	1.320	20,723,648.98	6,411,416.78	27,135,065.76	-

§ 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，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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	2012-02-29	-	17 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、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。
纪玲云	本基金的基金经理助理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达恒固 18 个月封闭式债券的	2015-02-17	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、固定收益分类资产管理部负责人、投资经理，易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达科润混合（LOF）的基金经理。

	基金经理，固定收益分类资产管理部总经理				
李一硕	<p>本基金的基金经理助理，易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕如混合、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式的基金经理，易方达信用债债券（自 2015 年 02 月 17 日至 2023 年 04 月 28 日）、易方达裕惠定开混合发起式、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债的基金经理助理，固定收益特定策略投资部总经理</p>	2015-02-17	2023-04-29	15 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。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固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。</p>
胡文伯	<p>本基金的基金经理助理，易方达双债增强债券（自 2020 年 10 月 16 日至 2023 年 04 月 13 日）、易方达裕鑫债券、易方达鑫转招利混合、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达磐固六个月持有混合的基金经理，易方达裕惠定开混合发起式（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕如混合（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达瑞财混合（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达信用债债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达纯债 1 年定期开放债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕祥回报债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年</p>	2018-07-31	2023-01-01	9 年	<p>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固定收益研究员。</p>

	12月31日)、易方达裕景添利6个月定期开放债券(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达富惠纯债债券(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达恒益定开债券发起式(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达恒信定开债券发起式(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达恒惠定开债券发起式(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达恒利3个月定开债券发起式(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达安源中短债债券(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达永旭定期开放债券(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达中债新综指发起式(LOF)(自2019年09月12日至2022年12月31日)、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式(自2019年11月08日至2022年12月31日)、易方达增强回报债券(自2020年08月28日至2022年12月31日)、易方达恒盛3个月定开混合发起式(自2021年03月02日至2022年12月31日)、易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达磐恒九个月持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达悦安一年持有债券的基金经理助理				
刘柱	本基金的基金经理助理,易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式(自2019年09月21日至2023年01月18日)、易方达瑞财混合(自2022年04月02日至2023年01月18日)、易方达恒盛3个月定开混合发起式(自2022年04月02日至2023年01月18日)的基金经理助理	2019-09-21	2023-01-19	11年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任中债资信评估有限责任公司公用事业二部信用评级分析师,易方达基金管理有限公司固定收益研究员。
田	本基金的基金经理助理,易方达双	2023-	-	6年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾

鑫	债增强债券的基金经理，易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达裕惠定开混合发起式、易方达裕如混合、易方达裕祥回报债券、易方达增强回报债券、易方达安益 90 天持有债券的基金经理助理，固定收益分类资产研究管理部总经理助理、固定收益研究员	01-14			任普特南投资管理公司量化分析师，上海壹账通金融科技有限公司高级数据挖掘工程师，易方达基金管理有限公司投资经理助理。
高梦文	本基金的基金经理助理，易方达信用债债券、易方达富财纯债债券、易方达恒裕一年定开债券发起式、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达恒久 1 年定期债券、易方达富华纯债债券、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、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达裕惠定开混合发起式、易方达裕如混合、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达裕浙 3 个月定开债券、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达恒茂 39 个月定开债券发起式、易方达恒智 63 个月定开债券发起式、易方达纯债债券的基金经理助理，投资支持经理	2023-04-11	-	11 年	大学本科，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益交易员。
赖科	本基金的基金经理助理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式的基金经理助理，固定收益策略研究员	2023-05-04	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任广发期货有限公司业务经理，中信期货有限公司研究员，华泰长城期货有限公司研究员。
李冠霖	本基金的基金经理助理，易方达纯债债券的基金经理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式的基金经理助理	2023-05-25	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任恒泰证券股份有限公司投资经理助理，易方达基金管理有限公司固定收益交易员、投资经理助理、投资经理。
李	本基金的基金经理助理，固定收益	2023-	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

昭函	策略研究员	10-12			任民生证券股份有限公司固定收益分析师。
鲍昀骁	本基金的基金经理助理，易方达裕惠定开混合发起式、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达双债增强债券、易方达裕如混合、易方达裕祥回报债券、易方达安益 90 天持有债券、易方达增强回报债券的基金经理助理，固定收益策略研究员	2023-11-17	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。

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/基金经理助理，“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。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、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）、境外投资、衍生品等投资管理活动，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。

公平交易的管控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，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中

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；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；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 and 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、反向交易、异常交易监控分析机制，对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，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，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 47 次，其中 40 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，7 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。

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

回顾 2023 年初，我们曾认为疫情结束后经济活力会迅速恢复。然而各类需求在经过一季度短暂反弹后，都呈现出疲软走势。首先，房地产市场需求持续收缩。尽管决策层出台了一系列放松政策，但并未扭转居民购房需求下滑的趋势。其次，2023 年全球贸易量出现了收缩，受此影响中国出口相较疫情期间更加疲弱，这使得总需求不足的情况进一步加剧。第三，部分行业出现的产能过剩问题导致了物价下行、企业盈利偏弱，从而引发整体社会预期走弱。下半年伴随基建和制造业投资发力、全球出口周期回升等因素的影响，整体经济增长有所改善，但是房地产行业持续低迷以及企业盈利能力难以回暖等问题使得微观主体预期依然偏弱。

在社会预期不断走弱的环境下，政策保持了积极平稳的节奏。财政政策在下半年开始有效发力，拉动经济回到更合理的增长水平，确保完成全年经济增长目标，并通过特别国债的发行为 2024 年蓄力。货币政策则保持定力，在引导银行存、贷款利率下行的同时，保持银行间资金利率中枢在合理水平，持续引导金融机构减少金融空转，资金回归实体经济，取得了较好的效果。

市场方面，在 1-2 月份有小幅抬升后，2023 年债券市场收益率呈现振荡走低的态势，全年走出一波牛市行情。10 年期国开债收益率全年下行 31BP。除了中枢水平的下降，2023 年债券市场更主要的机会来自各类型利差的全面压缩。首先是各类投资级信用债券的利差压缩，包括商业银行二级资本债和永续债、产业永续债、证券公司次级债等品种，其中 3 年期 AAA 级产业永续债与国开债的利差全年压缩了 60BP。其次是期限利差，尤其是超长端利率债与中短端品种的压缩，30 年期国债与 3 年期国债利差全年压缩了 25BP。第三是城投行业利差的压缩。2023 年 8 月份之后跟随城投一揽子化债政策的推出，城投债券的信用利差大幅降低。截至年底，2 年 AA-级城投与 AAA 级中期票据曲线的利差压降了 232BP。

权益市场延续下跌走势，沪深 300 指数全年下跌 11.38%，创业板指数全年下跌 19.41%。行业方面有所分化，通信和传媒全年分别上涨 25.8%和 16.8%，计算机、电子、石油石化、煤炭、家用电器等也获得 3-9%的正收益；美容护理、商贸零售、地产、电力设备等板块下跌较多，跌幅达到 26-32%。中证转债指数先涨后跌，全年下跌 0.48%，表现出一定的抗跌性。

操作上，本组合 2023 年债券部分一季过度低配久期错失部分收益，尤其是信用债券利差压缩的收益。4 月份和 12 月份之后组合积极增加久期和债券仓位，把握住一定的久期带来的资本利得收益。从结构上看组合超配了二级资本债、产业永续债和 30 年国债品种，获取了较好的类属利差和期限利差压缩的收益。权益方面，组合保持了一定的股票和可转债仓位，在 2023 年全年的下跌行情中承担了一定的净值波动，但是股票和可转债资产通过积极的结构调整，相比沪深 300 指数和中证可转债指数都取得正回报，且可转债全年对组合的业绩贡献为正。

4.4.2 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 1.3037 元，本报告期份额净值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准收益率为 3.12%；B 类基金份额净值为 1.3137 元，本报告期份额净值增长率为 2.18%，同期业绩比较基准收益率为 3.12%；C 类基金份额净值为 1.3050 元，本报告期份额净值增长率为 1.90%，同期业绩比较基准收益率为 3.12%。

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，中国经济正处于结构化转型加速推进的阶段。随着地产行业的调整以及地方政府隐性债务管控的不断推进，原先非常重要的经济需求端的支撑正在面临全面收缩的挑战，实体经济正

处于结构转型的阵痛期。同时外部环境的不确定性加剧了市场主体的风险意识，客观上加剧了社会预期走弱。

我们认为这些影响在 2024 年还将持续。经济可能仍然表现为需求相对不足的情况，主要体现在几个方面：第一，地产行业的下滑仍在进行中。由此导致的地产投资本身的下行以及对行业上下游产业链、对居民未来收入预期的影响，房价下跌带来的财富缩水的影响，都还在发酵的过程中。第二，在逆全球化的大背景下，政治格局纷繁复杂，外部的不确定因素大幅增加，外需对国内经济的提振作用预计长期处于下行的通道。第三，从国内的情况来看，部分中端制造业处于投资相对过剩的状态，这使得供大于需的情况有所加剧，企业的盈利能力走弱。

从政策方面来讲，我们可以动用的空间并不多。由于前些年地方政府债务的扩张，客观上使财政政策扩张的空间较为有限。另一方面，货币政策受到海外高利率带来的汇率贬值的制约，整体力度也较难快速扭转市场预期。因此政策推动的经济持续上升的效果还有待观察。

对应到资本市场，我们认为在整体经济预期不振的环境里，债券利率水平可能呈现中枢下行且波动性下降的走势。品种方面，由于产业类信用债净供给持续萎缩，而城投债供给也呈现下降走势，投资级品种的利差可能持续在低位维持。股票市场的不确定性相对更大一些，但是目前的估值处于极低水平，阶段性和结构性行情仍然可以预期。另外，可转债由于受到债底保护，继续大幅向下的空间较为有限，而向上则有望跟随权益市场的反弹而上涨，是一个赔率较好的品种。

虽然我们认为大的经济市场环境有利于债券市场的投资，但是收益率下行之路也不会一帆风顺，阶段性会受到政策预期、资金成本波动等因素的影响。权益市场也不会一路下跌，阶段性和结构性行情依然存在。在实际投资中，本基金将继续坚持稳健的投资风格，积极调整资产配置，把握市场的投资机会，也密切关注各项风险。权益方面，组合将继续深耕个股，精选主体，积极挖掘有安全边际且有增长潜力的品种长期持有。可转债品种，组合将逢低积极参与。债券方面，组合会积极管理好久期和流动性，寻找高性价比品种积极配置，提升久期和类属策略对组合超额收益的贡献，综合提升组合长期获取收益的能力。

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，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续督促廉洁从业、执业操守和道德规范等规定贯彻落实，积极开展形式多

样的文化宣导，引导员工树立正确的价值观、事业观、职业观，不断推动建设风清气正的公司及行业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段，协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制，共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统，提升投资合规监控工作效能，有效保障各类资产组合的合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，提升产品合规审查质效；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，坚持以投资者视角审核基金宣传推介材料，持续加强对网络直播、自媒体账号、对外言论发布、投资者交流等重点领域的合规管理。深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化水平和合规风险控制能力，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，探索优化风险评估识别方法，加强客户尽职调查，全面提高反洗钱工作的履职质效。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，聘请律师事务所完成年度合规有效性评估工作，从不同视角更加全面审视公司合规内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人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，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，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

备投资、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直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限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 449,122,786.01 元；本报告期内已实施的利润分配为 560,371,596.27 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 1,767,971,528.80 元；本报告期内已实施的利润分配为 2,013,916,022.31 元。

易方达稳健收益债券 C：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 9,683,435.63 元；本报告期内已实施的利润分配为 12,343,911.89 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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(2024)第 24364 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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

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(包括披露)、结构和内容，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

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,763,563.40	1,949,430.41
结算备付金		307,171,969.80	724,795,145.75
存出保证金		1,982,817.68	2,675,205.74
交易性金融资产	7.4.7.2	71,070,206,765.63	52,724,822,773.74
其中：股票投资		8,645,960,151.69	8,593,536,308.62
基金投资		-	-
债券投资		61,860,595,904.57	43,561,096,871.01
资产支持证券投资		563,650,709.37	570,189,594.11
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		482,527,946.26	375,894,401.45
应收股利		-	-
应收申购款		89,464,102.19	20,412,695.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		71,954,117,164.96	53,850,549,652.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		19,056,361,260.31	3,811,676,912.67
应付清算款		-	67,987,125.13
应付赎回款		831,141,420.16	706,594,056.94
应付管理人报酬		28,130,923.19	27,049,583.80
应付托管费		9,376,974.41	9,016,527.91
应付销售服务费		3,126,802.20	3,648,257.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,948,319.00	2,132,476.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,141,975.42	4,452,206.91
负债合计		19,932,227,674.69	4,632,557,147.38
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	39,667,780,640.79	36,618,744,643.20
未分配利润	7.4.7.8	12,354,108,849.48	12,599,247,862.24
净资产合计		52,021,889,490.27	49,217,992,505.44
负债和净资产总计		71,954,117,164.96	53,850,549,652.82

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.3037 元，B 类基金份额净值 1.3137 元，C 类基金份额净值 1.3050 元；基金份额总额 39,667,780,640.79 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 8,914,611,252.93 份，B 类基金份额总额 30,584,865,525.71 份，C 类基金份额总额 168,303,862.15 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,613,600,018.13	-1,199,557,115.89
1.利息收入		8,965,688.10	10,941,749.32
其中：存款利息收入	7.4.7.9	7,083,977.92	10,091,850.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,881,710.18	849,898.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,996,681,547.36	1,891,661,018.04
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-238,571,330.64	-972,947,057.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,028,332,334.25	2,548,428,831.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	29,406,998.46	48,381,157.60
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	177,513,545.29	267,798,086.03
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-396,973,656.30	-3,113,871,039.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,926,438.97	11,711,156.14
减：二、营业总支出		844,394,949.63	811,999,376.97
1. 管理人报酬		336,016,297.04	393,277,912.41
2. 托管费		112,005,432.31	131,092,637.38
3. 销售服务费		41,631,810.16	53,451,235.68

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		351,691,009.78	230,112,383.04
其中：卖出回购金融资产支出		351,691,009.78	230,112,383.04
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,641,638.54	3,655,174.31
8. 其他费用	7.4.7.18	408,761.80	410,034.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		769,205,068.50	-2,011,556,492.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		769,205,068.50	-2,011,556,492.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		769,205,068.50	-2,011,556,492.86

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达稳健收益债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	36,618,744,643.20	12,599,247,862.24	49,217,992,505.44
二、本期期初净资产	36,618,744,643.20	12,599,247,862.24	49,217,992,505.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,049,035,997.59	-245,139,012.76	2,803,896,984.83
（一）、综合收益总额	-	769,205,068.50	769,205,068.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,049,035,997.59	1,572,287,449.21	4,621,323,446.80
其中：1.基金申购款	28,864,485,022.09	11,058,507,886.78	39,922,992,908.87
2.基金赎回	-25,815,449,024.50	-9,486,220,437.57	-35,301,669,462.07

款			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-2,586,631,530.47	-2,586,631,530.47
四、本期期末净资产	39,667,780,640.79	12,354,108,849.48	52,021,889,490.27
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	50,175,403,354.88	20,586,303,839.72	70,761,707,194.60
二、本期期初净资产	50,175,403,354.88	20,586,303,839.72	70,761,707,194.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,556,658,711.68	-7,987,055,977.48	-21,543,714,689.16
(一)、综合收益总额	-	-2,011,556,492.86	-2,011,556,492.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-13,556,658,711.68	-4,362,816,145.14	-17,919,474,856.82
其中：1.基金申购款	28,023,167,700.00	10,569,686,763.05	38,592,854,463.05
2.基金赎回款	-41,579,826,411.68	-14,932,502,908.19	-56,512,329,319.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-1,612,683,339.48	-1,612,683,339.48
四、本期期末净资产	36,618,744,643.20	12,599,247,862.24	49,217,992,505.44

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：陈荣，会计机构负责人：王永铨

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类别。不收取申购费用、收取销售服务费的基金份额类别称为 A 类;收取申购费用、不收取销售服务费的基金份额类别称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类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类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

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。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、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净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的

基金，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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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则按直线法计算。

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。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

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对应类别的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)本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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) 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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债金融估值中心有限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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	2,763,563.40	1,949,430.41
等于：本金	2,719,395.10	1,892,992.15
加：应计利息	44,168.30	56,438.26
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	2,763,563.40	1,949,430.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,725,178,783.09	-	8,645,960,151.69	-1,079,218,631.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,187,696,802.34	115,946,194.85	19,343,639,326.25	-960,003,670.94
	银行间市场	41,782,407,074.50	469,169,338.32	42,516,956,578.32	265,380,165.50
	合计	61,970,103,876.84	585,115,533.17	61,860,595,904.57	-694,623,505.44
资产支持证券		556,306,899.43	4,383,709.37	563,650,709.37	2,960,100.57
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		72,251,589,559.36	589,499,242.54	71,070,206,765.63	-1,770,882,036.27
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,346,132,887.56	-	8,593,536,308.62	-752,596,578.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,038,152,926.03	137,399,633.12	19,643,745,184.95	-531,807,374.20
	银行间市场	23,664,761,909.23	342,319,186.06	23,917,351,686.06	-89,729,409.23
	合计	43,702,914,835.26	479,718,819.18	43,561,096,871.01	-621,536,783.43
资产支持证券		566,863,017.60	3,101,594.11	570,189,594.11	224,982.40
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	53,615,910,740. 42	482,820,413.29	52,724,822,773.74	-1,373,908,379.97

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

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 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,408.08	3,353.48
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,900,567.34	4,211,853.43
其中：交易所市场	1,259,323.56	3,705,926.35
银行间市场	641,243.78	505,927.08
应付利息	-	-
预提费用	237,000.00	237,000.00
合计	2,141,975.42	4,452,206.91

7.4.7.7 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
----	----

	2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,108,672,863.03	10,108,672,863.03
本期申购	5,209,195,439.19	5,209,195,439.19
本期赎回（以“-”号填列）	-6,403,257,049.29	-6,403,257,049.29
本期末	8,914,611,252.93	8,914,611,252.93

易方达稳健收益债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,304,685,284.67	26,304,685,284.67
本期申购	23,457,080,214.36	23,457,080,214.36
本期赎回（以“-”号填列）	-19,176,899,973.32	-19,176,899,973.32
本期末	30,584,865,525.71	30,584,865,525.71

易方达稳健收益债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,386,495.50	205,386,495.50
本期申购	198,209,368.54	198,209,368.54
本期赎回（以“-”号填列）	-235,292,001.89	-235,292,001.89
本期末	168,303,862.15	168,303,862.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	565,248,042.84	2,869,986,351.77	3,435,234,394.61

本期期初	565,248,042.84	2,869,986,351.77	3,435,234,394.61
本期利润	266,320,559.22	-23,785,953.91	242,534,605.31
本期基金份额交易产生的变动数	-83,030,625.38	-327,437,303.21	-410,467,928.59
其中：基金申购款	367,191,461.25	1,598,707,705.46	1,965,899,166.71
基金赎回款	-450,222,086.63	-1,926,145,008.67	-2,376,367,095.30
本期已分配利润	-560,371,596.27	-	-560,371,596.27
本期末	188,166,380.41	2,518,763,094.65	2,706,929,475.06

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	1,605,618,454.25	7,488,375,703.09	9,093,994,157.34
本期期初	1,605,618,454.25	7,488,375,703.09	9,093,994,157.34
本期利润	893,311,438.40	-368,959,337.58	524,352,100.82
本期基金份额交易产生的变动数	447,689,322.01	1,543,724,496.53	1,991,413,818.54
其中：基金申购款	1,845,154,199.04	7,170,894,261.49	9,016,048,460.53
基金赎回款	-1,397,464,877.03	-5,627,169,764.96	-7,024,634,641.99
本期已分配利润	-2,013,916,022.31	-	-2,013,916,022.31
本期末	932,703,192.35	8,663,140,862.04	9,595,844,054.39

易方达稳健收益债券 C

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	11,722,566.09	58,296,744.20	70,019,310.29
本期期初	11,722,566.09	58,296,744.20	70,019,310.29
本期利润	6,546,727.18	-4,228,364.81	2,318,362.37
本期基金份额交易产生的变动数	-2,130,233.90	-6,528,206.84	-8,658,440.74
其中：基金申购款	14,931,845.51	61,628,414.03	76,560,259.54

基金赎回款	-17,062,079.41	-68,156,620.87	-85,218,700.28
本期已分配利润	-12,343,911.89	-	-12,343,911.89
本期末	3,795,147.48	47,540,172.55	51,335,320.03

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	337,081.03	571,175.54
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,717,701.53	9,459,957.48
其他	29,195.36	60,717.92
合计	7,083,977.92	10,091,850.94

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-238,571,330.64	-972,947,057.15
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-238,571,330.64	-972,947,057.15

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,893,903,609.09	13,080,977,770.25
减：卖出股票成本总额	7,115,736,157.86	14,018,134,359.06
减：交易费用	16,738,781.87	35,790,468.34

买卖股票差价收入	-238,571,330.64	-972,947,057.15
----------	-----------------	-----------------

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,596,356,748.38	1,825,789,652.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	431,975,585.87	722,639,179.26
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,028,332,334.25	2,548,428,831.56

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	93,189,902,939.21	134,618,125,218.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	91,663,031,254.57	132,275,890,147.11
减：应计利息总额	1,093,335,802.44	1,617,761,590.53
减：交易费用	1,560,296.33	1,834,302.03
买卖债券差价收入	431,975,585.87	722,639,179.26

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	27,368,285.10	36,474,854.70
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	2,038,713.36	11,906,302.90

资产支持证券投资收益— —赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益— —申购差价收入	-	-
合计	29,406,998.46	48,381,157.60

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	715,026,616.38	1,443,347,265.68
减：卖出资产支持证券成本总额	701,012,727.18	1,407,512,495.00
减：应计利息总额	11,975,175.84	23,925,808.23
减：交易费用	-	2,659.55
资产支持证券投资收益	2,038,713.36	11,906,302.90

7.4.7.13 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。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	177,513,545.29	267,798,086.03
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	177,513,545.29	267,798,086.03

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-396,973,656.30	-3,113,871,039.39
——股票投资	-326,622,052.46	-1,713,772,495.71

——债券投资	-73,086,722.01	-1,391,656,215.99
——资产支持证券投资	2,735,118.17	-8,442,327.69
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-396,973,656.30	-3,113,871,039.39

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	4,926,346.75	11,711,060.25
其他	92.22	95.89
合计	4,926,438.97	11,711,156.14

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	117,000.00	117,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	31,500.00	33,450.00
银行汇划费	139,061.80	138,134.15
其他	1,200.00	1,450.00

合计	408,761.80	410,034.15
----	------------	------------

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	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
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	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
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券	19,532.00	0.00%	62,470.00	0.00%

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 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	11.72	0.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	37.49	0.00%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	336,016,297.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,114,092.26	58,008,529.12
应支付基金管理人的净管理费	294,902,204.78	335,269,383.29

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

每日应付的基金管理费=前一日该基金的资产净值×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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	112,005,432.31	131,092,637.38

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关联方名称	本期			
	2023年1月1日至2023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	易方达稳健收益债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	11,509,503.89	-	602,103.42	12,111,607.31
中国银行	510,254.58	-	-	510,254.58
广发证券	981,673.72	-	-	981,673.72
合计	13,001,432.19	-	602,103.42	13,603,535.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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	易方达稳健收益债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	7,620,345.73	-	393,304.23	8,013,649.96

公司				
中国银行	623,397.71	-	-	623,397.71
广发证券	1,805,559.89	-	-	1,805,559.89
合计	10,049,303.33	-	393,304.23	10,442,607.56

注：在通常情况下，本基金 A 类基金份额的销售服务年费率为 0.3%，B 类基金份额不计提销售服务费，C 类基金份额的销售服务年费率为 0.28%。

A 类/C 类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 类/C 类基金销售服务费 = 前一日 A 类/C 类基金份额的基金资产净值 × R ÷ 当年天数

R 为 A 类/C 类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销售服务费划付指令，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销售机构。

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 2023年1月1日至2023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	298,494,825.94	-	-	-	50,577,970.00 0.00	8,343,798 .56
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	600,110,267.40	-	-	-	27,343,950.00 0.00	1,690,669 .09

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

易方达稳健收益债券 C

无。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022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	2,763,563.40	337,081.03	1,949,430.41	571,175.54

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。

7.4.10.7 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					
2023年1月1日至2023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
中银国际证券股份有限公司	601096	宏盛华源	新股网上发行	500	850.00

公司					
上年度可比期间					
2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	新股网上发行	3,000	32,400.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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	2023-11-23	-	2023-11-23	0.330	187,012,995.30	121,549,045.70	308,562,041.00	-
2	2023-12-21	-	2023-12-21	0.280	151,611,805.57	100,197,749.70	251,809,555.27	-
合计				0.610	338,624,800.87	221,746,795.40	560,371,596.27	-

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	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	份额分 红数				
1	2023-11-23	-	2023-11-23	0.330	595,801,665.09	533,110,157.40	1,128,911,822.49	-
2	2023-12-21	-	2023-12-21	0.280	483,580,639.22	401,423,560.60	885,004,199.82	-
合计				0.610	1,079,382,304.31	934,533,718.00	2,013,916,022.31	-

易方达稳健收益债券 C

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	利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2023-11-23	-	2023-11-23	0.330	5,986,859.19	1,340,668.99	7,327,528.18	-
2	2023-12-21	-	2023-12-21	0.280	3,870,663.97	1,145,719.74	5,016,383.71	-
合计				0.610	9,857,523.16	2,486,388.73	12,343,911.89	-

7.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量（单位： 张）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
261121	岳阳 2 优	2023-12-07	1-6 个月 （含）	新发 流通 受限	100.00	100.18	100,000	10,000,000.00	10,017,884.93	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2023 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 15,196,703,453.61 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
2028013	20 农业银行 二级 01	2024-01-02	102.60	3,334,000	342,055,829.18
2028018	20 交通银行 二级	2024-01-02	102.75	2,176,000	223,591,491.15
2028033	20 建设银行 二级	2024-01-02	103.71	2,112,000	219,036,904.92
2028049	20 工商银行 二级 02	2024-01-02	103.12	422,000	43,515,486.99
210402	21 农发 02	2024-01-02	102.84	2,097,000	215,654,677.87
212380008	23 交行债 01	2024-01-02	101.15	971,000	98,220,629.51
2128025	21 建设银行 二级 01	2024-01-02	102.98	2,106,000	216,867,248.85
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024-01-02	102.41	422,000	43,218,186.84
2128049	21 建设银行 二级 05	2024-01-02	101.95	2,600,000	265,061,986.89
2128051	21 工商银行 二级 02	2024-01-02	101.94	1,983,000	202,145,654.66
220024	22 付息国债 24	2024-01-02	105.03	1,600,000	168,047,475.41
222380003	23 兴业银行 绿债 01	2024-01-02	102.24	2,400,000	245,384,786.89
2228004	22 工商银行 二级 01	2024-01-02	104.33	2,033,000	212,097,620.91
2228014	22 交通银行 二级 01	2024-01-02	104.64	983,000	102,865,159.73
2228017	22 邮储银行 二级 01	2024-01-02	104.88	1,667,000	174,840,917.48
2228024	22 工商银行 二级 03	2024-01-02	104.38	632,000	65,970,922.84

230009	23 付息国债 09	2024-01-02	107.19	14,100,000	1,511,376,688.52
230026	23 付息国债 26	2024-01-02	101.27	11,130,000	1,127,150,694.23
230205	23 国开 05	2024-01-02	104.72	2,938,000	307,678,116.61
230301	23 进出 01	2024-01-02	102.00	739,000	75,376,425.08
230406	23 农发 06	2024-01-02	101.32	3,200,000	324,229,508.20
230411	23 农发 11	2024-01-02	100.71	2,020,000	203,431,992.35
230421	23 农发 21	2024-01-02	100.57	3,300,000	331,893,262.30
232380076	23 建行二级 资本债 03A	2024-01-02	101.75	3,334,000	339,240,512.13
092280065	22 工行二级 资本债 03A	2024-01-03	101.37	958,000	97,113,747.80
2028024	20 中信银行 二级	2024-01-03	103.26	1,631,000	168,424,011.80
2028025	20 浦发银行 二级 01	2024-01-03	103.36	1,188,000	122,788,486.03
2028033	20 建设银行 二级	2024-01-03	103.71	3,199,000	331,770,387.70
2028041	20 工商银行 二级 01	2024-01-03	103.64	737,000	76,381,834.26
210207	21 国开 07	2024-01-03	102.00	800,000	81,602,360.65
210220	21 国开 20	2024-01-03	108.95	700,000	76,268,442.63
2128030	21 交通银行 二级	2024-01-03	103.13	264,000	27,225,238.03
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024-01-03	102.41	422,000	43,218,186.84
2128051	21 工商银行 二级 02	2024-01-03	101.94	632,000	64,425,644.85
220322	22 进出 22	2024-01-03	100.86	100,000	10,085,691.26
2228003	22 兴业银行 二级 01	2024-01-03	104.93	1,369,000	143,651,495.43
2228014	22 交通银行 二级 01	2024-01-03	104.64	2,527,000	264,435,664.93
2228039	22 建设银行 二级 01	2024-01-03	103.60	2,106,000	218,188,159.67
230026	23 付息国债 26	2024-01-03	101.27	13,884,000	1,406,052,132.86
230205	23 国开 05	2024-01-03	104.72	2,010,000	210,494,559.02
230206	23 国开 06	2024-01-03	101.29	700,000	70,905,754.10
230301	23 进出 01	2024-01-03	102.00	336,000	34,271,283.94
230304	23 进出 04	2024-01-03	101.04	2,000,000	202,077,704.92
230411	23 农发 11	2024-01-03	100.71	1,711,000	172,312,940.05

232380052	23 农行二级 资本债 02A	2024-01-03	102.04	824,000	84,084,517.16
232380069	23 建行二级 资本债 02A	2024-01-03	102.62	1,002,000	102,820,476.39
232380076	23 建行二级 资本债 03A	2024-01-03	101.75	3,159,000	321,433,946.56
232380078	23 交行二级 资本债 01A	2024-01-03	101.74	1,053,000	107,137,053.44
092280069	22 华夏银行 二级资本债 01	2024-01-04	101.56	1,686,000	171,237,069.84
2128002	21 工商银行 二级 01	2024-01-04	106.74	527,000	56,250,969.32
2128028	21 邮储银行 二级 01	2024-01-04	102.84	319,000	32,804,366.74
2128030	21 交通银行 二级	2024-01-04	103.13	2,579,000	265,961,700.33
2128032	21 兴业银行 二级 01	2024-01-04	103.29	1,348,000	139,233,932.94
2128033	21 建设银行 二级 03	2024-01-04	102.60	1,889,000	193,805,825.90
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024-01-04	102.41	3,884,000	397,771,179.37
2128051	21 工商银行 二级 02	2024-01-04	101.94	1,053,000	107,342,094.98
2228003	22 兴业银行 二级 01	2024-01-04	104.93	6,604,000	692,968,937.76
2228004	22 工商银行 二级 01	2024-01-04	104.33	608,000	63,431,064.20
2228024	22 工商银行 二级 03	2024-01-04	104.38	527,000	55,010,563.83
230026	23 付息国债 26	2024-01-04	101.27	1,600,000	162,034,241.76
230203	23 国开 03	2024-01-04	103.67	3,664,000	379,829,312.87
230205	23 国开 05	2024-01-04	104.72	3,222,000	337,419,636.39
230415	23 农发 15	2024-01-04	100.92	1,000,000	100,922,404.37
2028025	20 浦发银行 二级 01	2024-01-05	103.36	1,112,000	114,933,330.36
2028041	20 工商银行 二级 01	2024-01-05	103.64	1,685,000	174,631,466.40
2128025	21 建设银行 二级 01	2024-01-05	102.98	2,223,000	228,915,429.34
2128028	21 邮储银行	2024-01-05	102.84	1,685,000	173,276,984.21

	二级 01				
2228004	22 工商银行 二级 01	2024-01-05	104.33	1,895,000	197,700,438.58
2228014	22 交通银行 二级 01	2024-01-05	104.64	1,053,000	110,190,247.40
2228024	22 工商银行 二级 03	2024-01-05	104.38	2,223,000	232,046,458.03
230026	23 付息国债 26	2024-01-05	101.27	5,155,000	522,054,072.66
2028013	20 农业银行 二级 01	2024-01-09	102.60	1,112,000	114,087,007.21
2128030	21 交通银行 二级	2024-01-10	103.13	1,474,000	152,007,579.02
2128033	21 建设银行 二级 03	2024-01-10	102.60	632,000	64,841,335.08
合计				162,370,000	16,736,829,548.75

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 3,859,657,806.70 元，于 2024 年 1 月 2 日、2024 年 1 月 3 日、2024 年 1 月 8 日、2024 年 1 月 9 日、2024 年 1 月 12 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、基金投资部门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、监察合规管理部门、集中交易部门、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。日常经营活动中本基金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

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 2023 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 96.73%(2022 年 12 月 31 日：83.30%)。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	30,306,865.58	10,149,835.62
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	3,209,515,704.04	3,180,457,201.09
合计	3,239,822,569.62	3,190,607,036.71

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。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	29,963,571,807.95	25,590,918,367.70
AAA 以下	13,102,744,368.07	9,172,073,619.98
未评级	15,554,457,158.93	5,607,497,846.62
合计	58,620,773,334.95	40,370,489,834.30

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	553,632,824.44	570,189,594.11
AAA 以下	10,017,884.93	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	563,650,709.37	570,189,594.11

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所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

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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 2023年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,763,563.40	-	-	-	2,763,563.40
结算备付金	307,171,969.80	-	-	-	307,171,969.80
存出保证金	1,982,817.68	-	-	-	1,982,817.68
交易性金融资产	5,072,163,114.61	27,953,696,099.45	29,398,387,399.88	8,645,960,151.69	71,070,206,765.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	482,527,946.26	482,527,946.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	89,464,102.19	89,464,102.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,384,081,465.49	27,953,696,099.45	29,398,387,399.88	9,217,952,200.14	71,954,117,164.96

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	19,056,361,260.31	-	-	-	19,056,361,260.31
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	831,141,420.16	831,141,420.16
应付管理人报酬	-	-	-	28,130,923.19	28,130,923.19
应付托管费	-	-	-	9,376,974.41	9,376,974.41
应付销售服务费	-	-	-	3,126,802.20	3,126,802.20
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,948,319.00	1,948,319.00
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,141,975.42	2,141,975.42
负债总计	19,056,361,260.31	-	-	875,866,414.38	19,932,227,674.69
利率敏感度缺口	-13,672,279,794.82	27,953,696,099.45	29,398,387,399.88	8,342,085,785.76	52,021,889,490.27
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,949,430.41	-	-	-	1,949,430.41
结算备付金	724,795,145.75	-	-	-	724,795,145.75
存出保证金	2,675,205.74	-	-	-	2,675,205.74
交易性金融资产	4,558,268,989.99	31,539,602,272.04	8,033,415,203.09	8,593,536,308.62	52,724,822,773.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	375,894,401.45	375,894,401.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,412,695.73	20,412,695.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,287,688,771.89	31,539,602,272.04	8,033,415,203.09	8,989,843,405.80	53,850,549,652.82
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	3,811,676,912.67	-	-	-	3,811,676,912.67
应付清算款	-	-	-	67,987,125.13	67,987,125.13
应付赎回款	-	-	-	706,594,056.94	706,594,056.94
应付管理人报酬	-	-	-	27,049,583.80	27,049,583.80
应付托管费	-	-	-	9,016,527.91	9,016,527.91
应付销售服务费	-	-	-	3,648,257.79	3,648,257.79
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,132,476.23	2,132,476.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,452,206.91	4,452,206.91
负债总计	3,811,676,912.67	-	-	820,880,234.71	4,632,557,147.38
利率敏感度缺口	1,476,011,859.22	31,539,602,272.04	8,033,415,203.09	8,168,963,171.09	49,217,992,505.44

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	462,328,215.20	181,960,806.36
2.市场利率上升25个基点	-451,534,039.16	-180,381,273.87	

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	8,645,960,151.69	16.62	8,593,536,308.62	17.46
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	8,645,960,151.69	16.62	8,593,536,308.62	17.46

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	7,012,271,226.94	6,940,959,993.84
	2.业绩比较基准下降 5%	-7,012,271,226.94	-6,940,959,993.84

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	22,313,640,326.68	18,804,156,565.86
第二层次	48,756,566,438.95	33,920,666,207.88
第三层次	-	-
合计	71,070,206,765.63	52,724,822,773.74

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券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，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收	-	-	-

益的利得或损失 (若有)			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	100,000,008.00	100,000,008.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	76,962,969.12	76,962,969.12
当期利得或损失总额	-	-23,037,038.88	-23,037,038.88
其中: 计入损益的利得或损失	-	-23,037,038.88	-23,037,038.88
计入其他综合收益的利得或损失 (若有)	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	8,645,960,151.69	12.02
	其中：股票	8,645,960,151.69	12.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,424,246,613.94	86.76
	其中：债券	61,860,595,904.57	85.97
	资产支持证券	563,650,709.37	0.78
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	309,935,533.20	0.43
8	其他各项资产	573,974,866.13	0.80
9	合计	71,954,117,164.96	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	74,947,517.64	0.14
B	采矿业	286,269,201.90	0.55
C	制造业	5,122,494,145.66	9.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	115,047,237.69	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,443,639,629.96	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	793,431,511.18	1.53
J	金融业	374,218,587.87	0.72
K	房地产业	90,754,086.58	0.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	322,457,181.83	0.62
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	22,701,051.38	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,645,960,151.69	16.62

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	600018	上港集团	69,408,300	340,100,670.00	0.65
2	600150	中国船舶	11,492,859	338,349,768.96	0.65
3	600941	中国移动	3,244,865	322,799,170.20	0.62
4	600660	福耀玻璃	8,500,874	317,847,678.86	0.61
5	601298	青岛港	48,810,399	301,648,265.82	0.58
6	601598	中国外运	56,210,920	294,545,220.80	0.57
7	601088	中国神华	9,131,394	286,269,201.90	0.55
8	600519	贵州茅台	165,319	285,340,594.00	0.55
9	600873	梅花生物	29,588,133	282,566,670.15	0.54
10	600685	中船防务	10,992,912	280,868,901.60	0.54
11	600026	中远海能	22,653,399	277,277,603.76	0.53
12	601728	中国电信	48,648,250	263,187,032.50	0.51
13	688007	光峰科技	10,038,092	259,785,820.96	0.50
14	002472	双环传动	8,717,588	226,831,639.76	0.44
15	601799	星宇股份	1,684,518	220,857,154.98	0.42
16	000333	美的集团	4,013,910	219,279,903.30	0.42
17	603259	药明康德	2,855,157	207,741,223.32	0.40
18	600690	海尔智家	9,087,816	190,844,136.00	0.37
19	600346	恒力石化	13,574,152	178,771,581.84	0.34

20	000933	神火股份	10,115,926	169,947,556.80	0.33
21	002821	凯莱英	1,399,855	162,523,165.50	0.31
22	600585	海螺水泥	7,134,143	160,946,266.08	0.31
23	000786	北新建材	6,881,116	160,742,869.76	0.31
24	603348	文灿股份	4,094,130	158,852,244.00	0.31
25	002415	海康威视	4,199,281	145,799,036.32	0.28
26	002410	广联达	7,697,360	131,932,750.40	0.25
27	603596	伯特利	1,716,363	118,943,955.90	0.23
28	300347	泰格医药	2,086,883	114,715,958.51	0.22
29	002906	华阳集团	2,998,039	105,680,874.75	0.20
30	600703	三安光电	7,302,422	101,138,544.70	0.19
31	002493	荣盛石化	9,755,721	100,971,712.35	0.19
32	300059	东方财富	6,871,602	96,477,292.08	0.19
33	002920	德赛西威	681,584	88,271,943.84	0.17
34	600383	金地集团	17,801,320	77,613,755.20	0.15
35	002714	牧原股份	1,819,998	74,947,517.64	0.14
36	002375	亚厦股份	16,032,485	72,627,157.05	0.14
37	601398	工商银行	12,636,577	60,402,838.06	0.12
38	603456	九洲药业	2,432,500	58,890,825.00	0.11
39	600030	中信证券	2,870,100	58,463,937.00	0.11
40	601601	中国太保	2,417,500	57,488,150.00	0.11
41	600104	上汽集团	4,053,523	54,844,166.19	0.11
42	603713	密尔克卫	1,011,943	53,845,487.03	0.10
43	601238	广汽集团	6,056,618	52,995,407.50	0.10
44	000858	五粮液	366,752	51,458,973.12	0.10
45	601975	招商南油	17,936,070	50,220,996.00	0.10
46	002202	金风科技	6,226,418	49,811,344.00	0.10
47	601111	中国国航	6,733,200	49,421,688.00	0.10
48	603565	中谷物流	5,988,601	49,286,186.23	0.09
49	601633	长城汽车	1,939,837	48,922,689.14	0.09
50	600036	招商银行	1,668,700	46,423,234.00	0.09
51	002179	中航光电	1,166,726	45,502,314.00	0.09
52	603486	科沃斯	1,081,730	44,826,891.20	0.09
53	002402	和而泰	3,135,842	44,811,182.18	0.09
54	300760	迈瑞医疗	152,120	44,206,072.00	0.08
55	603305	旭升集团	2,208,061	43,565,043.53	0.08
56	601117	中国化学	6,669,824	42,420,080.64	0.08
57	002532	天山铝业	6,619,400	39,782,594.00	0.08
58	601989	中国重工	9,303,500	38,423,455.00	0.07
59	603187	海容冷链	2,474,820	37,518,271.20	0.07
60	300124	汇川技术	554,948	35,039,416.72	0.07
61	601166	兴业银行	1,949,063	31,594,311.23	0.06
62	002250	联化科技	4,148,033	29,575,475.29	0.06

63	600029	南方航空	4,738,457	27,293,512.32	0.05
64	300850	新强联	846,054	26,929,898.82	0.05
65	002517	恺英网络	2,319,876	25,913,014.92	0.05
66	600426	华鲁恒升	933,760	25,762,438.40	0.05
67	002142	宁波银行	1,162,050	23,368,825.50	0.04
68	601012	隆基绿能	1,005,358	23,022,698.20	0.04
69	300015	爱尔眼科	1,434,959	22,701,051.38	0.04
70	603236	移远通信	410,785	22,079,693.75	0.04
71	002555	三七互娱	1,045,900	19,673,379.00	0.04
72	603606	东方电缆	437,341	18,696,327.75	0.04
73	002624	完美世界	1,457,839	17,260,813.76	0.03
74	000402	金融街	3,619,926	13,140,331.38	0.03
75	603444	吉比特	51,670	12,665,350.40	0.02
76	002180	纳思达	314,790	7,123,697.70	0.01
77	000877	天山股份	525,404	3,509,698.72	0.01
78	688653	康希通信	500	10,010.00	0.00
79	000651	格力电器	300	9,651.00	0.00
80	688472	阿特斯	500	6,315.00	0.00
81	601096	宏盛华源	500	2,800.00	0.00
82	301526	国际复材	500	2,765.00	0.00
83	301029	怡合达	78	2,010.84	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	600018	上港集团	502,519,712.44	1.02
2	301029	怡合达	375,421,578.18	0.76
3	601298	青岛港	346,103,857.88	0.70
4	600150	中国船舶	342,788,692.88	0.70
5	002472	双环传动	331,747,799.76	0.67
6	600026	中远海能	325,576,603.55	0.66
7	000786	北新建材	317,464,991.20	0.65
8	603596	伯特利	305,825,976.62	0.62
9	601598	中国外运	298,008,984.89	0.61
10	600685	中船防务	284,287,278.77	0.58
11	603348	文灿股份	277,340,310.70	0.56
12	002906	华阳集团	255,571,761.72	0.52
13	601088	中国神华	237,619,850.10	0.48

14	002410	广联达	235,724,637.52	0.48
15	002920	德赛西威	229,270,849.74	0.47
16	603259	药明康德	212,254,930.78	0.43
17	000333	美的集团	208,271,466.00	0.42
18	600383	金地集团	205,661,974.22	0.42
19	600873	梅花生物	200,544,936.25	0.41
20	000933	神火股份	173,253,522.36	0.35

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	600941	中国移动	391,293,259.13	0.80
2	601728	中国电信	358,113,376.81	0.73
3	300059	东方财富	356,285,696.58	0.72
4	000977	浪潮信息	277,331,006.57	0.56
5	301029	怡合达	262,154,592.74	0.53
6	601111	中国国航	253,076,022.79	0.51
7	603596	伯特利	235,854,389.31	0.48
8	601799	星宇股份	208,734,954.63	0.42
9	600873	梅花生物	203,235,555.17	0.41
10	002415	海康威视	195,428,949.01	0.40
11	002920	德赛西威	187,828,116.84	0.38
12	000402	金融街	182,397,743.69	0.37
13	600660	福耀玻璃	181,984,001.79	0.37
14	600150	中国船舶	169,212,724.51	0.34
15	002906	华阳集团	151,118,958.22	0.31
16	300347	泰格医药	137,260,621.16	0.28
17	000786	北新建材	135,085,262.80	0.27
18	600018	上港集团	111,024,983.00	0.23
19	600346	恒力石化	107,535,847.84	0.22
20	688169	石头科技	107,281,774.24	0.22

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	7,494,782,053.39
卖出股票收入（成交）总额	6,893,903,609.09

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	5,831,551,608.98	11.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	27,240,638,689.22	52.36
	其中：政策性金融债	6,270,031,907.38	12.05
4	企业债券	3,966,978,372.74	7.63
5	企业短期融资券	387,307,798.91	0.74
6	中期票据	10,727,349,490.39	20.62
7	可转债（可交换债）	13,706,769,944.33	26.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,860,595,904.57	118.91

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	230026	23 付息国债 26	41,000,000	4,152,127,445.05	7.98
2	230009	23 付息国债 09	14,100,000	1,511,376,688.52	2.91
3	2128042	21 兴业银行二级 02	10,800,000	1,106,057,862.30	2.13
4	230205	23 国开 05	10,400,000	1,089,126,076.50	2.09
5	232380076	23 建行二级资本债 03A	10,200,000	1,037,868,393.44	2.00

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	135099	22 金泰优	1,700,000	171,540,513.77	0.33
2	260271	23 和远 A2	500,000	50,082,109.59	0.10
3	199272	23 北辰 A	400,000	40,786,082.19	0.08
4	260418	G 黄河优	400,000	40,575,853.15	0.08
5	199057	耘睿 083A	400,000	40,206,673.97	0.08
6	199694	G23XH 优	300,000	30,952,696.44	0.06
7	112152	信保 03 优	300,000	30,755,082.74	0.06
8	199666	23 海创优	300,000	30,179,440.18	0.06
9	199204	23 华兴优	300,000	29,835,318.23	0.06
10	136324	21 大悦 A	300,000	29,236,278.51	0.06
11	193933	和皖 A	200,000	20,240,427.92	0.04
12	199049	甬城投 A	200,000	20,085,616.46	0.04
13	199430	23 济建优	100,000	10,075,054.80	0.02
14	261121	岳阳 2 优	100,000	10,017,884.93	0.02
15	135921	诚至金通 1A	200,000	9,081,676.49	0.02

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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中，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国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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。

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	1,982,817.68
2	应收清算款	482,527,946.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	89,464,102.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	573,974,866.13

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	113050	南银转债	483,534,368.40	0.93
2	118031	天 23 转债	457,086,913.20	0.88
3	110079	杭银转债	433,620,893.89	0.83
4	127045	牧原转债	360,946,940.02	0.69
5	127049	希望转 2	301,828,212.14	0.58
6	113062	常银转债	257,011,898.46	0.49
7	113065	齐鲁转债	216,091,929.68	0.42
8	113059	福莱转债	209,396,770.07	0.40
9	127073	天赐转债	199,254,395.12	0.38
10	127018	本钢转债	184,582,986.71	0.35
11	113641	华友转债	172,019,980.80	0.33
12	127030	盛虹转债	164,488,193.22	0.32

13	110093	神马转债	160,813,426.00	0.31
14	127061	美锦转债	158,484,958.09	0.30
15	127083	山路转债	145,142,338.89	0.28
16	118022	锂科转债	139,735,332.03	0.27
17	127040	国泰转债	138,880,389.53	0.27
18	118034	晶能转债	133,949,073.33	0.26
19	110064	建工转债	127,213,756.61	0.24
20	110089	兴发转债	124,054,068.37	0.24
21	113049	长汽转债	121,088,197.09	0.23
22	113051	节能转债	120,994,192.93	0.23
23	113048	晶科转债	118,552,611.87	0.23
24	127067	恒逸转 2	116,286,545.52	0.22
25	113623	凤 21 转债	115,641,888.01	0.22
26	110085	通 22 转债	115,314,001.64	0.22
27	113045	环旭转债	112,950,103.81	0.22
28	127039	北港转债	106,681,996.36	0.21
29	128109	楚江转债	106,382,486.08	0.20
30	110087	天业转债	104,428,014.18	0.20
31	127052	西子转债	102,589,616.33	0.20
32	113064	东材转债	101,899,034.77	0.20
33	123128	首华转债	101,744,203.71	0.20
34	118019	金盘转债	100,438,111.17	0.19
35	127025	冀东转债	99,930,845.92	0.19
36	113659	莱克转债	95,308,703.03	0.18
37	127074	麦米转 2	92,398,350.60	0.18
38	113619	世运转债	91,455,474.78	0.18
39	113640	苏利转债	91,441,314.06	0.18
40	113637	华翔转债	88,313,848.56	0.17
41	127070	大中转债	85,775,162.33	0.16
42	128127	文科转债	83,202,306.60	0.16
43	127075	百川转 2	78,175,217.69	0.15
44	110086	精工转债	77,475,674.92	0.15
45	118026	利元转债	75,288,065.58	0.14
46	113054	绿动转债	74,922,893.99	0.14
47	123119	康泰转 2	73,299,878.34	0.14
48	123108	乐普转 2	73,188,179.15	0.14
49	123169	正海转债	73,056,400.52	0.14
50	127066	科利转债	72,526,778.11	0.14
51	113663	新化转债	71,919,311.73	0.14
52	123165	回天转债	70,927,667.54	0.14
53	113666	爱玛转债	69,987,201.96	0.13
54	118013	道通转债	69,583,075.07	0.13
55	123146	中环转 2	68,799,971.95	0.13

56	123120	隆华转债	68,519,489.20	0.13
57	113061	拓普转债	67,552,113.26	0.13
58	127026	超声转债	67,516,693.15	0.13
59	127033	中装转 2	67,036,272.60	0.13
60	123071	天能转债	66,041,135.24	0.13
61	127027	能化转债	65,876,663.25	0.13
62	123161	强联转债	65,465,830.04	0.13
63	110045	海澜转债	64,343,523.47	0.12
64	128119	龙大转债	62,425,527.42	0.12
65	118027	宏图转债	62,011,723.22	0.12
66	111001	山玻转债	61,163,930.08	0.12
67	128121	宏川转债	61,028,793.46	0.12
68	123144	裕兴转债	59,961,094.39	0.12
69	123115	捷捷转债	59,781,846.96	0.11
70	113655	欧 22 转债	59,625,084.31	0.11
71	118023	广大转债	59,548,257.36	0.11
72	127060	湘佳转债	58,363,427.46	0.11
73	111004	明新转债	57,731,566.04	0.11
74	128105	长集转债	56,710,928.12	0.11
75	127050	麒麟转债	55,902,923.41	0.11
76	113638	台 21 转债	54,438,699.02	0.10
77	118020	芳源转债	54,381,679.75	0.10
78	127071	天箭转债	52,279,095.49	0.10
79	110072	广汇转债	51,362,891.77	0.10
80	118033	华特转债	51,226,498.95	0.10
81	127082	亚科转债	50,459,286.08	0.10
82	127044	蒙娜转债	50,203,780.42	0.10
83	113600	新星转债	49,642,922.61	0.10
84	113596	城地转债	48,736,392.69	0.09
85	123147	中辰转债	48,641,712.43	0.09
86	123184	天阳转债	48,393,596.95	0.09
87	123087	明电转债	48,067,854.59	0.09
88	123063	大禹转债	47,830,595.69	0.09
89	123090	三诺转债	47,283,459.25	0.09
90	113629	泉峰转债	47,247,580.32	0.09
91	113609	永安转债	46,442,625.00	0.09
92	127031	洋丰转债	46,122,173.65	0.09
93	127055	精装转债	46,122,017.51	0.09
94	113632	鹤 21 转债	45,817,378.81	0.09
95	127068	顺博转债	44,713,779.32	0.09
96	113610	灵康转债	44,185,822.51	0.08
97	113058	友发转债	43,964,837.47	0.08
98	113644	艾迪转债	42,415,119.03	0.08

99	127081	中旗转债	41,955,015.81	0.08
100	113608	威派转债	41,622,658.65	0.08
101	123149	通裕转债	41,603,827.15	0.08
102	113606	荣泰转债	41,099,461.63	0.08
103	123190	道氏转 02	40,733,780.47	0.08
104	118010	洁特转债	40,501,490.45	0.08
105	111000	起帆转债	40,481,549.68	0.08
106	113532	海环转债	40,047,072.35	0.08
107	132020	19 蓝星 EB	38,990,849.27	0.07
108	128063	未来转债	38,162,740.77	0.07
109	123172	漱玉转债	38,085,754.85	0.07
110	123182	广联转债	36,280,205.47	0.07
111	123114	三角转债	35,002,296.52	0.07
112	123076	强力转债	34,648,107.23	0.07
113	113033	利群转债	34,584,121.07	0.07
114	113656	嘉诚转债	34,285,499.32	0.07
115	113505	杭电转债	34,218,624.75	0.07
116	127043	川恒转债	34,121,634.50	0.07
117	123162	东杰转债	33,171,432.81	0.06
118	113661	福 22 转债	33,111,445.15	0.06
119	123168	惠云转债	32,435,640.60	0.06
120	111009	盛泰转债	32,142,073.56	0.06
121	127078	优彩转债	31,691,054.10	0.06
122	110084	贵燃转债	31,502,443.61	0.06
123	123160	泰福转债	30,782,077.76	0.06
124	111002	特纸转债	30,485,376.43	0.06
125	127079	华亚转债	30,474,739.83	0.06
126	123166	蒙泰转债	30,340,481.59	0.06
127	123163	金沃转债	29,149,508.40	0.06
128	123186	志特转债	28,408,787.99	0.05
129	123121	帝尔转债	28,338,477.36	0.05
130	113662	豪能转债	28,270,768.68	0.05
131	123082	北陆转债	28,202,728.88	0.05
132	111011	冠盛转债	28,028,651.20	0.05
133	123154	火星转债	27,924,516.49	0.05
134	123106	正丹转债	27,714,764.77	0.05
135	123167	商络转债	26,901,275.64	0.05
136	118032	建龙转债	26,319,772.84	0.05
137	127019	国城转债	26,051,746.80	0.05
138	118025	奕瑞转债	26,040,373.39	0.05
139	123157	科蓝转债	25,955,356.74	0.05
140	123091	长海转债	24,874,792.40	0.05
141	123085	万顺转 2	24,280,439.89	0.05

142	118035	国力转债	23,503,947.17	0.05
143	127087	星帅转 2	22,341,174.63	0.04
144	118012	微芯转债	21,844,282.94	0.04
145	113639	华正转债	21,585,106.48	0.04
146	123109	昌红转债	21,510,708.41	0.04
147	123179	立高转债	21,445,246.88	0.04
148	113504	艾华转债	21,203,949.16	0.04
149	113601	塞力转债	21,008,661.39	0.04
150	123183	海顺转债	20,753,953.76	0.04
151	110043	无锡转债	20,643,728.48	0.04
152	123170	南电转债	20,119,887.32	0.04
153	118018	瑞科转债	19,619,289.40	0.04
154	128144	利民转债	19,504,023.21	0.04
155	123191	智尚转债	19,173,497.65	0.04
156	110063	鹰 19 转债	18,935,710.77	0.04
157	113625	江山转债	18,426,011.10	0.04
158	123150	九强转债	18,307,632.88	0.04
159	113636	甬金转债	18,073,558.31	0.03
160	127005	长证转债	17,889,895.37	0.03
161	110047	山鹰转债	17,688,271.58	0.03
162	128134	鸿路转债	17,354,691.99	0.03
163	118011	银微转债	17,309,980.16	0.03
164	123035	利德转债	17,182,303.40	0.03
165	118006	阿拉转债	17,048,074.12	0.03
166	123152	润禾转债	16,815,953.67	0.03
167	123178	花园转债	16,490,085.92	0.03
168	127042	嘉美转债	16,188,143.29	0.03
169	113055	成银转债	16,182,096.27	0.03
170	113516	苏农转债	15,903,877.49	0.03
171	123113	仙乐转债	15,668,490.51	0.03
172	127038	国微转债	14,846,940.63	0.03
173	113643	风语转债	14,772,460.73	0.03
174	128141	旺能转债	14,657,762.97	0.03
175	128048	张行转债	14,518,706.71	0.03
176	123124	晶瑞转 2	14,467,110.99	0.03
177	113647	禾丰转债	14,246,831.42	0.03
178	123132	回盛转债	13,945,592.67	0.03
179	118005	天奈转债	13,668,679.00	0.03
180	123159	崧盛转债	13,657,670.98	0.03
181	113658	密卫转债	13,242,474.49	0.03
182	123049	维尔转债	12,901,041.53	0.02
183	127076	中宠转 2	12,649,472.09	0.02
184	110081	闻泰转债	11,866,822.45	0.02

185	123010	博世转债	11,861,709.36	0.02
186	128130	景兴转债	11,716,735.31	0.02
187	127077	华宏转债	11,685,887.31	0.02
188	127047	帝欧转债	11,363,856.48	0.02
189	113670	金 23 转债	11,264,514.80	0.02
190	123130	设研转债	11,084,510.14	0.02
191	118015	芯海转债	11,013,243.89	0.02
192	111008	沿浦转债	11,000,846.99	0.02
193	128123	国光转债	10,958,901.04	0.02
194	118004	博瑞转债	10,849,969.01	0.02
195	127022	恒逸转债	10,691,328.43	0.02
196	113569	科达转债	10,682,622.79	0.02
197	123189	晓鸣转债	10,592,134.48	0.02
198	128132	交建转债	10,357,857.96	0.02
199	111007	永和转债	10,356,806.92	0.02
200	113627	太平转债	10,320,699.44	0.02
201	123199	山河转债	9,983,916.75	0.02
202	113628	晨丰转债	9,472,191.25	0.02
203	113665	汇通转债	9,185,949.79	0.02
204	127069	小熊转债	7,951,784.38	0.02
205	123185	能辉转债	7,531,756.85	0.01
206	111013	新港转债	7,359,621.86	0.01
207	123131	奥飞转债	7,011,261.07	0.01
208	113577	春秋转债	5,951,983.02	0.01
209	118003	华兴转债	5,868,068.99	0.01
210	127062	垒知转债	5,824,544.25	0.01
211	113667	春 23 转债	5,729,645.59	0.01
212	123103	震安转债	5,586,993.35	0.01
213	127054	双箭转债	5,334,882.83	0.01
214	111014	李子转债	5,328,004.93	0.01
215	123193	海能转债	5,005,222.15	0.01
216	111003	聚合转债	4,834,721.84	0.01
217	123133	佩蒂转债	4,418,207.08	0.01
218	113657	再 22 转债	4,357,790.83	0.01
219	127085	韵达转债	4,093,849.71	0.01
220	128083	新北转债	4,055,743.08	0.01
221	123151	康医转债	3,988,793.45	0.01
222	123142	申昊转债	3,944,978.45	0.01
223	128097	奥佳转债	3,746,707.01	0.01
224	118009	华锐转债	3,455,574.52	0.01
225	123155	中陆转债	3,280,884.58	0.01
226	113545	金能转债	3,255,922.30	0.01
227	127035	濮耐转债	3,248,202.92	0.01

228	123173	恒锋转债	2,977,671.63	0.01
229	128042	凯中转债	2,438,203.49	0.00
230	113621	彤程转债	1,752,343.85	0.00
231	123048	应急转债	1,322,229.42	0.00
232	128044	岭南转债	707,504.93	0.00
233	123126	瑞丰转债	579,516.69	0.00
234	113653	永 22 转债	478,748.45	0.00
235	113042	上银转债	126,627.76	0.00
236	132018	G 三峡 EB1	98,920.07	0.00
237	127016	鲁泰转债	11,315.35	0.00
238	128037	岩土转债	1,230.13	0.00
239	128108	蓝帆转债	1,023.07	0.00

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	609,501	14,626.08	3,512,713,805.59	39.40%	5,401,897,447.34	60.60%
易方达稳健收益 债券 B	641,774	47,656.75	27,406,445,768.24	89.61%	3,178,419,757.47	10.39%
易方达稳健收益 债券 C	2,283	73,720.48	90,385,442.39	53.70%	77,918,419.76	46.30%
合计	1,253,558	31,644.15	31,009,545,016.22	78.17%	8,658,235,624.57	21.83%

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	321,267.65	0.0036%
	易方达稳健收益债券 B	12,318,901.00	0.0403%
	易方达稳健收益债券 C	176,725.96	0.1050%
	合计	12,816,894.61	0.0323%

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	>100
	易方达稳健收益债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达稳健收益债券 A	0
	易方达稳健收益债券 B	>100
	易方达稳健收益债券 C	0
	合计	>100

§ 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	易方达稳健收益债券 C
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	10,108,672,863.03	26,304,685,284.67	205,386,495.50
本报告期基金总申购份额	5,209,195,439.19	23,457,080,214.36	198,209,368.54
减：本报告期基金总赎回份额	6,403,257,049.29	19,176,899,973.32	235,292,001.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额	8,914,611,252.93	30,584,865,525.71	168,303,862.15

总额			
----	--	--	--

§ 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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起王骏先生担任公司副总经理级高级管理人员（首席市场官）。本基金管理人于 2023 年 8 月 23 日发布公告，自 2023 年 8 月 21 日起刘晓艳女士担任公司董事长（联席），并仍担任公司总经理，原任公司副董事长职务自行免去；自 2023 年 8 月 21 日起吴欣荣先生担任公司执行总经理（总经理级），原任公司副总经理职务自行免去。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本基金自转型以来连续 16 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 117,000.00 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
财通证券	1	847,849,571.75	5.89%	508,709.77	5.31%	-
长江证券	1	3,627,099,216.59	25.21%	2,176,259.51	22.73%	-
东方财富	1	823,715,961.78	5.72%	494,239.49	5.16%	-
东方证券	2	2,450,958,190.36	17.03%	1,471,059.20	15.36%	-
东吴证券	1	668,683,762.11	4.65%	534,946.91	5.59%	-
广发证券	1	19,532.00	0.00%	11.72	0.00%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	298,312,625.19	2.07%	238,650.11	2.49%	-
国泰君安	1	3,565,312,074.45	24.78%	2,852,249.69	29.79%	-
华福证券	1	174,704,005.45	1.21%	139,763.28	1.46%	-
摩根大通	1	1,463,916,148.01	10.17%	878,361.64	9.17%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	291,617,503.63	2.03%	174,971.64	1.83%	-
粤开证券	1	176,433,281.16	1.23%	105,859.99	1.11%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司。

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；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
财通证券	1,899,202,991.01	4.60%	82,743,777,000.00	9.68%	-	-
长江证券	12,560,418,683.44	30.45%	298,833,431,000.00	34.97%	-	-
东方财富	2,176,943,404.74	5.28%	18,542,743,000.00	2.17%	-	-
东方证券	3,741,594,449.97	9.07%	47,189,787,000.00	5.52%	-	-
东吴证券	1,868,465,250.14	4.53%	23,432,648,000.00	2.74%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	203,251,907.12	0.49%	-	-	-	-
国泰君安	7,812,250,197.29	18.94%	225,672,824,000.00	26.41%	-	-
华福证券	6,436,022,552.88	15.60%	134,655,286,000.00	15.76%	-	-
摩根大通	2,157,502,506.48	5.23%	10,814,369,000.00	1.27%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	455,708,999.59	1.10%	5,377,000,000.00	0.63%	-	-
粤开证券	1,938,720,796.14	4.70%	7,307,000,000.00	0.86%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-14
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
4	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
5	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-11
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
7	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
8	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
9	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-25
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-07-20
11	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
12	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报	2023-08-30
14	易方达基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-09-02
15	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-12
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-10-25
17	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2023-11-17

		金电子披露网站	
18	易方达稳健收益债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-21
19	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-22
20	易方达稳健收益债券型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-23
21	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-16
22	易方达稳健收益债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-19
23	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-20
24	易方达稳健收益债券型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-21

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

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

二〇二四年三月二十九日