

长城泰利纯债债券型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 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。

本报告期自 2020 年 02 月 25 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 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 其他指标..... | 11 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| § 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..... | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| § 5 托管人报告 | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 19 |
| § 6 审计报告 | 20 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 20 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 20 |
| § 7 年度财务报表 | 23 |
| 7.1 资产负债表..... | 23 |
| 7.2 利润表..... | 24 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 25 |
| 7.4 报表附注..... | 26 |
| § 8 投资组合报告 | 52 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 52 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 52 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 53 |
| 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..... | 53 |

| | |
|---|-----------|
| 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..... | 53 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 54 |
| 8.11 投资组合报告附注..... | 54 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 57 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 57 |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况..... | 57 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 58 |
| § 11 重大事件揭示..... | 59 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 59 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 59 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 60 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 60 |
| 11.8 其他重大事件..... | 61 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 62 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 62 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 63 |
| § 13 备查文件目录..... | 64 |
| 13.1 备查文件目录..... | 64 |
| 13.2 存放地点..... | 64 |
| 13.3 查阅方式..... | 64 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|-------------|
| 基金名称 | 长城泰利纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长城泰利债券 | |
| 基金主代码 | 009001 | |
| 交易代码 | 009001 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 2 月 25 日 | |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 13,998,449,328.04 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长城泰利债券 A | 长城泰利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 009001 | 009002 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,998,433,095.80 份 | 16,232.24 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得超越业绩比较基准的稳定回报。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产和现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例。</p> <p>2、组合久期配置策略</p> <p>本基金将根据宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险，并根据市场利率变化动态积极调整债券组合的平均久期及期限分布。</p> <p>3、信用债投资策略</p> <p>本基金的信用债投资策略主要包括信用利差曲线配置和信用债券精选两个方面。</p> <p>4、骑乘策略</p> <p>本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。</p> <p>5、杠杆投资策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、</p> |

| | |
|--------|---|
| | 资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |

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 | | 长城基金管理有限公司 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 车君 | 周直毅 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 021-68475608 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | custody@bosscn.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 95594 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 021-68476936 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 42 层 |
| 邮政编码 | | 518026 | 200120 |
| 法定代表人 | | 王军 | 金煜 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ccfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层 |
| 注册登记机构 | 长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 |

§ 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 | 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---|-----------|
| | 长城泰利债券 A | 长城泰利债券 C |
| 本期已实现收益 | 153,608,773.55 | 25,083.76 |
| 本期利润 | -18,360,885.44 | 20,154.31 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0014 | 0.0144 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.14% | 1.31% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.00% | -0.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末 | |
| 期末可供分配利润 | -28,906,941.82 | -32.58 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0021 | -0.0020 |
| 期末基金资产净值 | 13,969,526,153.98 | 16,199.66 |
| 期末基金份额净值 | 0.9979 | 0.9980 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2020 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.00% | -0.20% |

注：①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。

②上述基金业绩指标不包括持有人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。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用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。

④本基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城泰利债券 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 | 1.17% | 0.04% | 0.64% | 0.04% | 0.53% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.70% | 0.07% | -0.85% | 0.07% | 1.55% | 0.00% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 | 0.00% | 0.07% | -1.26% | 0.09% | 1.26% | -0.02% |

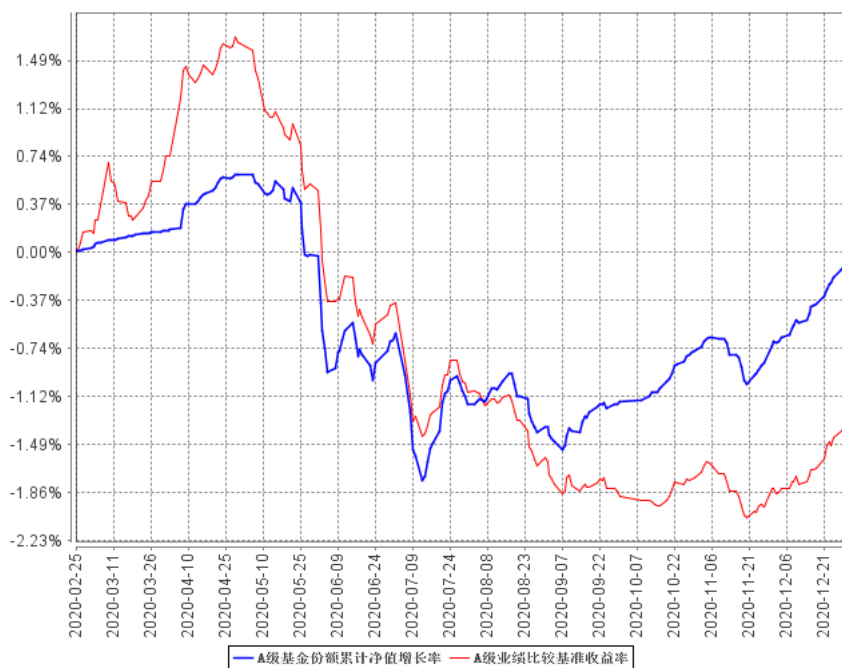
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

长城泰利债券 C

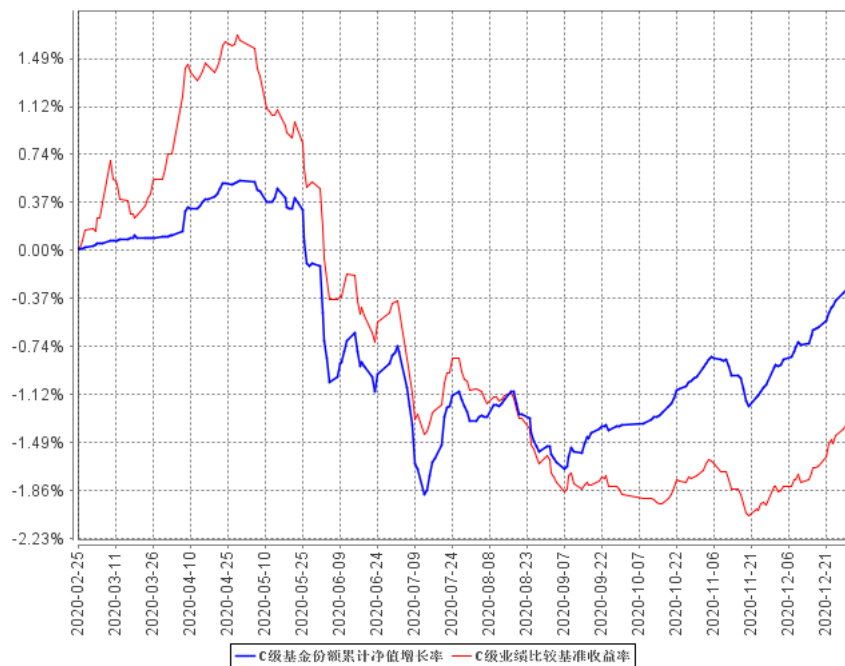
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 1.17% | 0.04% | 0.64% | 0.04% | 0.53% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.61% | 0.07% | -0.85% | 0.07% | 1.46% | 0.00% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -0.20% | 0.07% | -1.26% | 0.09% | 1.06% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



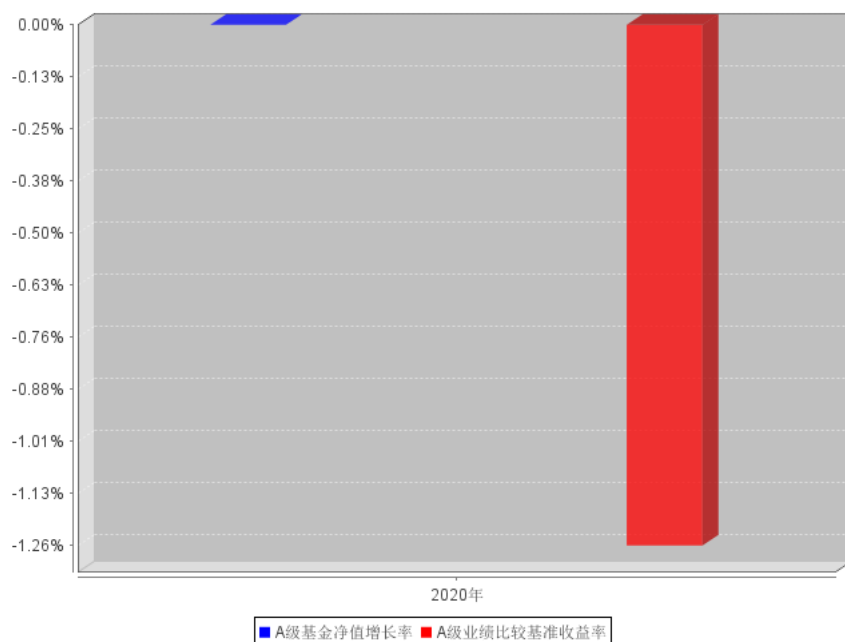
注：①本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

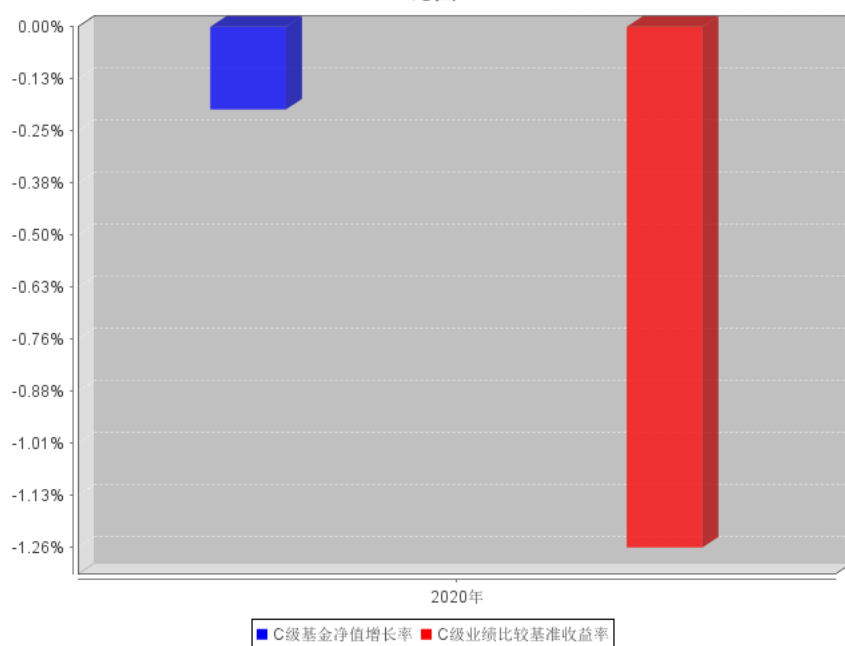
③本基金合同于 2020 年 2 月 25 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| |
|----------|
| 长城泰利债券 A |
|----------|

| 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 |
|------|-------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2020 | 0.0210 | 58,793,436.02 | 0.27 | 58,793,436.29 | |
| 合计 | 0.0210 | 58,793,436.02 | 0.27 | 58,793,436.29 | |

§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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、

长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城泰丰纯债债券型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开债指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金。

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 | | |
| 张棣 | 长城增强收益债券、长城稳固收益债券、长城久瑞债券、长城泰利债券、长城久悦债券、长城中债 1-3 年政金债指数、长城中债 3-5 年国开债指数的基金经理 | 2020 年 2 月 25 日 | - | 6 年 | 男，淮南师范学院经济学学士、西南财经大学经济学硕士。2014 年 7 月进入长城基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理、“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”、“长城久信债券型证券投资基金”的基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期，无基金经理兼任投资经理情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价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% 的现象。

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 2020 年，年初受新冠疫情影响，债券收益率大幅下行，4 月底随着国内疫情得到阶段性控制，货币政策边际收敛，债券收益率逐步走高，至年末已基本回到 2019 年底疫情前水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值 A 级增长率为 0.00%，C 级净值增长率为 -0.20%，本基金比较基准收益率为 -1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年二季度开始，在国内疫情基本控制之后，货币宽松和财政政策刺激的滞后作用逐步显现，投资、出口、消费出现环比改善。伴随着企业利润改善和库存回补，当前国内经济复苏平稳，海外需求在疫苗推进和财政刺激下也向复苏方向发展。但同时我们也关注到经济数据复苏的斜率开始放缓、社融增速开始见顶回落以及国内外疫情出现反复等扰动因素。

在 12 月举行的中央经济会议中，关于货币政策方面提出“宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性；保持对经济恢复的必要支持力度，政策操作上要更加精准有效，不急转弯，把握好政策时度效；合理把握宏观调控节奏和力度”。这些说法预示 2021 年政策总体还是会呈现稳健中性和相机抉择、精准灵活的特点。

在经济结构性调整，长期经济增长中枢下行的背景下，债券资产仍具备较好的长期配置价值。在经过去年二季度以来的收益率上行后，债券资产收益率已经出现比较充分的调整，收益率历史分位数有了较大程度提升。机构久期整体处于历史地位，债券市场供给量同比下降，供需结构的优化也将对债券市场形成一定支撑。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内

部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

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。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2020 年进行了一次利润分配，分红金额为 58,793,436.29 元，其中现金分红 58,793,436.02 元，红利再投 0.27 元，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额合计为 58,793,436.29 元。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明(2021)审字第 60737541_H35 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长城泰利纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了长城泰利纯债债券型证券投资基金财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长城泰利纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城泰利纯债债券型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城泰利纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p> |
| 强调事项 | 不适用 |
| 其他事项 | 不适用 |
| 其他信息 | <p>长城泰利纯债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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</p> |

| | |
|-----------------|---|
| | <p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长城泰利纯债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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城泰利纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 评价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。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长城泰利纯债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</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>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长城泰利纯债债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>我们与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。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 吴翠蓉 陈小青 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京 |
| 审计报告日期 | 2021 年 3 月 29 日 |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城泰利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 4,700,851.09 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | 106,227.48 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 16,453,202,830.13 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 15,249,963,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | 1,203,239,830.13 |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 280,425,193.11 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 4,504.60 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 16,738,439,606.41 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 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 | | 2,763,995,114.23 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 9.91 |
| 应付管理人报酬 | | 2,356,031.79 |
| 应付托管费 | | 1,178,015.92 |
| 应付销售服务费 | | 0.85 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 129,626.65 |
| 应交税费 | | 460,021.39 |
| 应付利息 | | 734,432.03 |

| | | |
|---------------|----------|-------------------|
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 44,000.00 |
| 负债合计 | | 2,768,897,252.77 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 13,998,449,328.04 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -28,906,974.40 |
| 所有者权益合计 | | 13,969,542,353.64 |
| 负债和所有者权益总计 | | 16,738,439,606.41 |

注：1) 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，长城泰利债券 A 基金份额净值 0.9979 元，基金份额总额 13,998,433,095.80 份；长城泰利债券 C 基金份额净值 0.9980 元，基金份额总额 16,232.24 份。长城泰利债券份额总额合计为 13,998,449,328.04 份。

2) 本基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.2 利润表

会计主体：长城泰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|-----------------------|------------|--|
| | | 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 56,004,116.49 |
| 1.利息收入 | | 416,429,620.96 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 12,132,442.42 |
| 债券利息收入 | | 380,488,478.66 |
| 资产支持证券利息收入 | | 13,074,150.17 |
| 买入返售金融资产收入 | | 10,734,549.71 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -188,480,959.50 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -187,604,569.08 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.2 | -876,390.42 |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -171,974,588.44 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|----------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 30,043.47 |
| 减：二、费用 | | 74,344,847.62 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 23,339,575.80 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 11,424,668.68 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 3,248.89 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 153,235.54 |
| 5. 利息支出 | | 39,087,077.61 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 39,087,077.61 |
| 6. 税金及附加 | | 248,972.81 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 88,068.29 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -18,340,731.13 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -18,340,731.13 |

注：本基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城泰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日 | | |
|--|--|----------------|--------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 300,023,755.42 | - | 300,023,755.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -18,340,731.13 | -18,340,731.13 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 13,698,425,572.62 | 48,227,193.02 | 13,746,652,765.64 |
| 其中：1. 基金申购款 | 27,917,007,595.53 | 83,133,791.84 | 28,000,141,387.37 |
| 2. 基金赎回款 | -14,218,582,022.91 | -34,906,598.82 | -14,253,488,621.73 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -58,793,436.29 | -58,793,436.29 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 13,998,449,328.04 | -28,906,974.40 | 13,969,542,353.64 |

注：本基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

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：

| | | |
|-------------|--------------|--------------|
| _____ 王军 | _____ 邱春杨 | _____ 赵永强 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城泰利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）系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[2020]120 号文“关于准予长城泰利纯债债券型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自 2020 年 2 月 17 日至 2020 年 2 月 21 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 60737541_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金的基金合同于 2020 年 2 月 25 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 300,009,696.44 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 14,058.98 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 300,023,755.42 元，折合 300,023,755.42 份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 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

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理缴纳的增值税后的净额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提;

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提;

(4) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,具体收益分配方案详见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关公告,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权;由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,

C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 4,700,851.09 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计： | 4,700,851.09 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年12月31日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
|---------------|-------|-------------------|-------------------|-----------------|
| 股票 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 504,677,804.65 | 501,123,000.00 | -3,554,804.65 |
| | 银行间市场 | 14,917,259,783.79 | 14,748,840,000.00 | -168,419,783.79 |
| | 合计 | 15,421,937,588.44 | 15,249,963,000.00 | -171,974,588.44 |
| 资产支持证券 | | 1,203,239,830.13 | 1,203,239,830.13 | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 16,625,177,418.57 | 16,453,202,830.13 | -171,974,588.44 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/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

注：本基金于本期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有因买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,820.43 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 267,600,928.19 |
| 应收资产支持证券利息 | 12,820,391.91 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 52.58 |
| 合计 | 280,425,193.11 |

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 129,626.65 |
| 合计 | 129,626.65 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------------|-------------------------|
| 预提审计费 | 35,000.00 |
| 预提中债登债券账户维护费 | 4,500.00 |
| 预提上清所债券账户维护费 | 4,500.00 |
| 合计 | 44,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 长城泰利债券 A | | |
|---------------|--|--------------------|
| 项目 | 本期 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 270,020,887.67 | 270,020,887.67 |
| 本期申购 | 27,916,860,936.49 | 27,916,860,936.49 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -14,188,448,728.36 | -14,188,448,728.36 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 13,998,433,095.80 | 13,998,433,095.80 |

金额单位：人民币元

| 长城泰利债券 C | |
|----------|----|
| 项目 | 本期 |

| | 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 30,002,867.75 | 30,002,867.75 |
| 本期申购 | 146,659.04 | 146,659.04 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -30,133,294.55 | -30,133,294.55 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 16,232.24 | 16,232.24 |

注：1) 本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

2) 本基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 300,009,696.44 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 14,058.98 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 300,023,755.42 元，折合 300,023,755.42 份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 长城泰利债券 A | | | |
|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 153,608,773.55 | -171,969,658.99 | -18,360,885.44 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 33,972,443.40 | 14,274,936.51 | 48,247,379.91 |
| 其中：基金申购款 | 61,640,384.83 | 21,493,276.37 | 83,133,661.20 |
| 基金赎回款 | -27,667,941.43 | -7,218,339.86 | -34,886,281.29 |
| 本期已分配利润 | -58,793,436.29 | - | -58,793,436.29 |
| 本期末 | 128,787,780.66 | -157,694,722.48 | -28,906,941.82 |

单位：人民币元

| 长城泰利债券 C | | | |
|----------------|------------|-----------|------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 25,083.76 | -4,929.45 | 20,154.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,932.98 | 4,746.09 | -20,186.89 |
| 其中：基金申购款 | 332.97 | -202.33 | 130.64 |
| 基金赎回款 | -25,265.95 | 4,948.42 | -20,317.53 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 150.78 | -183.36 | -32.58 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 11,868,126.61 |
| 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 | 263,490.62 |
| 其他 | 825.19 |
| 合计 | 12,132,442.42 |

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

注：本基金于本期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月25日(基金合同生效日)至 2020年12月31日 |
|-------------------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 14,356,843,591.77 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 14,325,578,893.86 |
| 减：应收利息总额 | 218,869,266.99 |
| 买卖债券差价收入 | -187,604,569.08 |

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 92,953,199.58 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 90,936,748.36 |
| 减：应收利息总额 | 2,892,841.64 |
| 资产支持证券投资收益 | -876,390.42 |

7.4.7.14 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金于本期无衍生金融工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金于本期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|----------------------------|---------------------------------|
| | 2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -171,974,588.44 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -171,974,588.44 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | -171,974,588.44 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------------|---------------------------------|
| | 2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 30,043.45 |
| 转出基金补偿收入 C 级 009002 | 0.02 |
| 合计 | 30,043.47 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 11,440.79 |
| 银行间市场交易费用 | 141,794.75 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 153,235.54 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|--|
| 审计费用 | 35,000.00 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 中债登债券账户服务费 | 13,500.00 |
| 银行费用 | 26,668.29 |
| 上清所债券账户服务费 | 12,000.00 |
| 其他 | 900.00 |
| 合计 | 88,068.29 |

7.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1、根据长城泰利纯债债券型证券投资基金分红公告，本基金于 2021 年 03 月 17 日进行了一次利润分配，分红金额为 30,796,549.93 元，符合基金合同的规定。

2、截至财务报表批准日，除上述利润分配事项外，本基金无其他需要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 |
|--------------------|---------------------|
| 长城基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海银行 | 基金托管人 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人股东 |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人股东 |
| 中原信托有限公司 | 基金管理人股东 |
| 北方国际信托股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 长城嘉信资产管理有限公司 | 基金管理人控股子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
|-------|--|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 长城证券 | 1,313,555,810.54 | 100.00% |

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | |
|-------|--|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 长城证券 | 40,381,412,000.00 | 100.00% |

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 23,339,575.80 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10.16 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,424,668.68 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 | | |
|----------------|--|----------|----------|
| | 2020 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长城泰利债券 A | 长城泰利债券 C | 合计 |
| 长城基金管理有限公司 | - | 3,223.95 | 3,223.95 |
| 合计 | - | 3,223.95 | 3,223.95 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

本基金基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，无上年度可比期间数据。

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

注：本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

注：本基金于本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

注：本基金的基金管理人于本期末未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末亦未持有本基金份额。本基金基金合同于 2020 年 2 月 25 日生效，无上年度可比期间数据。

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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末未持有本基金份额。本基金基金合同于 2020 年 02 月 25 日生效，无上年度可比期间数据。

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 2020年2月25日(基金合同生效日)至2020年12月31日 | |
|-------|---------------------------------------|---------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海银行 | 4,700,851.09 | 11,868,126.61 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

长城泰利债券A

金额单位：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 | 2020年 5月7日 | - | 2020年 5月7日 | 0.0210 | 58,793,436.02 | 0.27 | 58,793,436.29 | |
| 合计 | - | - | | 0.0210 | 58,793,436.02 | 0.27 | 58,793,436.29 | |

注：本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2020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**

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本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2020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为人民币2,763,995,114.23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 |
|--------|----------|----------------|--------|--------------|------------------|
| 180212 | 18 国开 12 | 2021 年 1 月 5 日 | 100.86 | 790,000.00 | 79,679,400.00 |
| 140222 | 14 国开 22 | 2021 年 1 月 5 日 | 106.17 | 770,000.00 | 81,750,900.00 |
| 190305 | 19 进出 05 | 2021 年 1 月 4 日 | 100.46 | 3,160,000.00 | 317,453,600.00 |
| 160207 | 16 国开 07 | 2021 年 1 月 5 日 | 100.50 | 800,000.00 | 80,400,000.00 |
| 180304 | 18 进出 04 | 2021 年 1 月 4 日 | 100.52 | 80,000.00 | 8,041,600.00 |
| 150210 | 15 国开 10 | 2021 年 1 月 4 日 | 103.61 | 280,000.00 | 29,010,800.00 |
| 190208 | 19 国开 08 | 2021 年 1 月 4 日 | 100.92 | 9,500,000.00 | 958,740,000.00 |
| 180204 | 18 国开 04 | 2021 年 1 月 5 日 | 103.66 | 800,000.00 | 82,928,000.00 |
| 140229 | 14 国开 29 | 2021 年 1 月 4 日 | 103.78 | 500,000.00 | 51,890,000.00 |
| 180210 | 18 国开 10 | 2021 年 1 月 4 日 | 103.33 | 9,470,000.00 | 978,535,100.00 |
| 150314 | 15 进出 14 | 2021 年 1 月 4 日 | 102.88 | 500,000.00 | 51,440,000.00 |
| 190207 | 19 国开 07 | 2021 年 1 月 4 日 | 100.59 | 70,000.00 | 7,041,300.00 |
| 200403 | 20 农发 03 | 2021 年 1 月 4 日 | 99.57 | 2,400,000.00 | 238,968,000.00 |
| 合计 | | | | 29,120,000 | 2,965,878,700.00 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金于本期末未持有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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 4,700,851.09 | - | - | - | - | - | 4,700,851.09 |
| 存出保证金 | 106,227.48 | - | - | - | - | - | 106,227.48 |
| 交易性金融 资产 | 623,859,000.00 | 2,255,729,000.00 | 2,144,400,330.13 | 9,345,822,500.00 | 2,083,392,000.00 | - | 16,453,202,830.13 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 280,425,193.11 | 280,425,193.11 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 4,504.60 | 4,504.60 |
| 资产总计 | 628,666,078.57 | 2,255,729,000.00 | 2,144,400,330.13 | 9,345,822,500.00 | 2,083,392,000.00 | 280,429,697.71 | 16,738,439,606.41 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金 融资产款 | 2,763,995,114.23 | - | - | - | - | - | 2,763,995,114.23 |

| | | | | | | | |
|---------|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|------------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 9.91 | 9.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,356,031.79 | 2,356,031.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 1,178,015.92 | 1,178,015.92 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 0.85 | 0.85 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 129,626.65 | 129,626.65 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 734,432.03 | 734,432.03 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 460,021.39 | 460,021.39 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 44,000.00 | 44,000.00 |
| 负债总计 | 2,763,995,114.23 | - | - | - | - | 4,902,138.54 | 2,768,897,252.77 |
| 利率敏感度缺口 | -2,135,329,035.66 | 2,255,729,000.00 | 2,144,400,330.13 | 9,345,822,500.00 | 2,083,392,000.00 | | |

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|---------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时 | |
| 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（2020年12月31日） |
| | 利率上升 25 个基点 | -101,071,130.34 |
| | 利率下降 25 个基点 | 102,422,082.26 |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于 2020 年 12 月 31 日，本基金面临

的整体其他价格风险列示如下：

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 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 16,453,202,830.13 | 117.78 |
| 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 | 16,453,202,830.13 | 117.78 |

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本期末，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固定收益品种，未持有股票投资、权证投资等其他交易性金融资产，因此无重大的其他价格风险。本基金基金合同于 2020 年 2 月 25 日生效，无上年度末比较数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、存出保证金、其他应收款项类投资、卖出回购金融资产以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第二层次的余额为人民币 16,453,202,830.13 元，无划分为第一层次及第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 16,453,202,830.13 | 98.30 |
| | 其中：债券 | 15,249,963,000.00 | 91.11 |
| | 资产支持证券 | 1,203,239,830.13 | 7.19 |
| 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 | 4,700,851.09 | 0.03 |
| 8 | 其他各项资产 | 280,535,925.19 | 1.68 |
| 9 | 合计 | 16,738,439,606.41 | 100.00 |

8.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末投资股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末投资股票。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 8,613,993,500.00 | 61.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,477,234,000.00 | 32.05 |
| 4 | 企业债券 | 752,842,000.00 | 5.39 |
| 5 | 企业短期融资券 | 80,044,000.00 | 0.57 |
| 6 | 中期票据 | 3,025,738,500.00 | 21.66 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 2,777,345,000.00 | 19.88 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 15,249,963,000.00 | 109.17 |

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 | 180210 | 18 国开 10 | 11,000,000 | 1,136,630,000.00 | 8.14 |
| 2 | 190208 | 19 国开 08 | 9,500,000 | 958,740,000.00 | 6.86 |
| 3 | 112003008 | 20 农业银行 CD008 | 8,000,000 | 781,040,000.00 | 5.59 |
| 4 | 1928005 | 19 浦发银行小微债 01 | 7,000,000 | 706,370,000.00 | 5.06 |
| 5 | 2028029 | 20 交通银行 01 | 6,000,000 | 598,260,000.00 | 4.28 |

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 | 169931 | 东花 20A1 | 2,670,000 | 267,000,000.00 | 1.91 |
| 2 | 138809 | 厚德 04A | 1,700,000 | 170,000,000.00 | 1.22 |
| 3 | 169548 | 建花 15A | 1,400,000 | 140,000,000.00 | 1.00 |
| 4 | 137047 | 厚德 07A | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.72 |
| 4 | 137032 | 厚德 06A | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.72 |
| 4 | 169306 | 兴辰 1A | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.72 |
| 4 | 137087 | 厚德 08A | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.72 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 5 | 168585 | 天信 6A | 890,000 | 89,000,000.00 | 0.64 |
| 5 | 168589 | 天信 7A | 890,000 | 89,000,000.00 | 0.64 |
| 6 | 139944 | 蚁信 09A | 500,000 | 48,239,830.13 | 0.35 |

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券除国家开发银行、农业银行、浦发银行、交通银行、中信银行、民生银行发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资等案由，于 2020 年 12 月 25 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中国农业银行股份有限公司（简称农业银行）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送等案由，于 2020 年 4 月 22 日被中国银保监会处以罚款。

中国农业银行股份有限公司（简称农业银行）因向关系人发放信用贷款等案由，于 2020 年 7 月 13 日被中国银保监会处以罚款。

中国农业银行股份有限公司（简称农业银行）因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）案由，于 2020 年 12 月 7 日被中国银保监会处以罚款。

根据上海银保监局公布的行政处罚信息公开表：

上海浦东发展银行股份有限公司（简称浦发银行）因未按专营部门制规定开展同业业务等案由，于 2020 年 8 月 10 日被上海银保监局处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

交通银行股份有限公司（简称交通银行）因中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在相关违法违规行等案由，于 2020 年 4 月 20 日被中国银保监会处以罚款。

根据北京银保监局公布的行政处罚信息公开表：

中信银行股份有限公司（简称中信银行）因内控管理不严、违规经营等案由，于 2020 年 2 月 20 日被北京银保监局处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中信银行股份有限公司（简称中信银行）因中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在相关违法违规行等案由，于 2020 年 4 月 20 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

中国民生银行股份有限公司（简称民生银行）因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等案由，于 2020 年 2 月 10 日被中国人民银行处以罚款。根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中国民生银行股份有限公司（简称民生银行）因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资等案由，于 2020 年 7 月 14 日被中国银保监会处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对 18 国开 10、19 国开 08、20 农业银行 CD008、19 浦发银行小微债 01、20 交通银行 01、20 中信银行二级、19 交通银行 01、18 民生银行 02 进行了投资。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.11.3 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 | 106,227.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 280,425,193.11 |
| 5 | 应收申购款 | 4,504.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 280,535,925.19 |

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 |
| 长城泰利债券 A | 168 | 83,324,006.52 | 13,998,429,170.33 | 99.99997% | 3,925.47 | 0.00003% |
| 长城泰利债券 C | 85 | 190.97 | - | - | 16,232.24 | 100.00000% |
| 合计 | 253 | 55,329,839.24 | 13,998,429,170.33 | 99.99986% | 20,157.71 | 0.00014% |

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长城泰利债券 A | 0 |
| | 长城泰利债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长城泰利债券 A | 0 |
| | 长城泰利债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城泰利债券 A | 长城泰利债券 C |
|------------------------------------|-------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2020 年 2 月 25 日）基金份额总额 | 270,020,887.67 | 30,002,867.75 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 27,916,860,936.49 | 146,659.04 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 14,188,448,728.36 | 30,133,294.55 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 13,998,433,095.80 | 16,232.24 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生不再担任长城基金管理有限公司总经理，由董事长王军先生代为履职。

自 2020 年 6 月 19 日起，彭洪波先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生、金树良先生、杨玉成先生、杨超先生不再担任公司董事，由张文栋先生、朱静女士、韩飞先生担任公司董事。

自 2020 年 6 月 19 日起，鄢维民先生不再担任公司独立董事。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任长城基金管理有限公司总经理，董事长王军先生不再代任。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任公司董事。

自 2020 年 8 月 24 日起，温子健先生担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020 年 3 月，许卿斌同志不再担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已进行备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金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

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币叁万伍千元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增长城证券 2 个专用交易单元，截止本报告期末共计 2 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

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 |
| 长城证券 | 1,313,555,810.54 | 100.00% | 40,381,412,000.00 | 100.00% | - | - |

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 | 长城泰利纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告 | 证券时报及本基金经理人网站 | 2020年2月26日 |
| 2 | 长城泰利纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定投业务的公告 | 证券时报及本基金经理人网站 | 2020年3月3日 |
| 3 | 关于长城泰利纯债债券型证券投资基金 A 类份额暂停申购、转换转入和定投业务的公告 | 证券时报及本基金经理人网站 | 2020年4月11日 |
| 4 | 长城泰利纯债债券型基金调整基金费率、调整申购金额并相应修改基金合同及招募说明书的公告 | 证券时报及本基金经理人网站 | 2020年4月16日 |
| 5 | 长城泰利纯债债券型证券投资基金收益分配公告 | 证券时报及本基金经理人网站 | 2020年5月7日 |
| 6 | 长城基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站 | 2020年5月27日 |
| 7 | 长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站 | 2020年7月1日 |
| 8 | 长城基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并更新、完善身份信息以免影响业务办理的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站 | 2020年7月3日 |
| 9 | 长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站 | 2020年12月31日 |

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------------|------|-------------------|-------------------|-------------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20200304-20200407 | - | 50,002,194.44 | 50,002,194.44 | - | - |
| | 2 | 20200304-20201231 | - | 13,998,429,170.33 | - | 13,998,429,170.33 | 99.9999% |
| | 3 | 20200304-20200513 | - | 13,998,429,170.33 | 13,998,429,170.33 | - | - |
| | 4 | 20200304-20200326 | - | 50,002,194.44 | 50,002,194.44 | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20% 的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项。如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城泰利纯债债券型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城泰利纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn