

关于西部利得沣泰债券型证券投资基金 2020 年中期报告的更正公告

西部利得基金管理有限公司于 2020 年 8 月 31 日在中国证监会基金信息电子披露网站和本公司官网发布了《西部利得沣泰债券型证券投资基金 2020 年中期报告》，现将第六章“半年度财务会计报告（未经审计）”中“6.4.13.4.1.1 利率风险敞口”变更如下：

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金利率风险敞口情况如下：

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,051,183.31	-	-	-	1,051,183.31
交易性金融资产	321,723,000.00	214,869,000.00	61,368,000.00	-	597,960,000.00
应收利息	-	-	-	9,055,287.14	9,055,287.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	322,774,183.31	214,869,000.00	61,368,000.00	9,055,287.14	608,066,470.45
负债					
卖出回购金融资产款	109,609,635.58	-	-	-	109,609,635.58
应付赎回款	-	-	-	1,015.54	1,015.54
应付管理人报酬	-	-	-	122,495.44	122,495.44
应付托管费	-	-	-	40,831.79	40,831.79
应付交易费用	-	-	-	19,877.38	19,877.38
应付利息	-	-	-	52,917.16	52,917.16
应交税费	-	-	-	39,235.23	39,235.23
其他负债	-	-	-	88,364.74	88,364.74
负债总计	109,609,635.58	-	-	364,737.28	109,974,372.86
利率敏感度缺口	213,164,547.73	214,869,000.00	61,368,000.00	8,690,549.86	498,092,097.59
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,289,126.94	-	-	-	6,289,126.94
交易性金融资产	418,974,000.00	62,028,000.00	-	-	481,002,000.00
应收利息	-	-	-	4,324,093.28	4,324,093.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	425,263,126.94	62,028,000.00	-	4,324,093.28	491,615,220.22
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	234,941.80	234,941.80
应付托管费	-	-	-	78,313.95	78,313.95

应付交易费用	-	-	-	4,251.18	4,251.18
应交税费	-	-	-	4,526.01	4,526.01
负债总计	-	-	-	322,032.94	322,032.94
利率敏感度缺口	425,263,126.94	62,028,000.00	-	4,002,060.34	491,293,187.28

除以上更正事项外，其他内容保持不变。由此给投资者带来不便，我们深表歉意。

特此公告。

西部利得基金管理有限公司

2020年9月17日