

关于西部利得尊逸三年定期开放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《西部利得尊逸三年定期开放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	3,355,436.25	-	-	-	3,355,436.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	310,257,447.36	-	-	-	310,257,447.36
应收利息	-	-	-102,281,621.65	-	102,281,621.65
其他资产	296,376,698.18	5,022,028,090.26	-	-	5,318,404,788.44
资产总计	609,989,581.79	5,022,028,090.26	-	-102,281,621.65	5,734,299,293.70
负债					
卖出回购金融资产款	1,466,012,522.88	-	-	-	1,466,012,522.88
应付管理人报酬	-	-	-	524,081.42	524,081.42
应付托管费	-	-	-	174,693.81	174,693.81
应付交易费用	-	-	-	158,822.68	158,822.68
应付利息	-	-	-	246,769.45	246,769.45
其他负债	-	-	-	106,961.50	106,961.50
负债总计	1,466,012,522.88	-	-	1,211,328.86	1,467,223,851.74
利率敏感度缺口	-856,022,941.09	5,022,028,090.26	-	-101,070,292.79	4,267,075,441.96
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	1,015,023,259.84	-	-	-	1,015,023,259.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,669,720,864.60	-	-	-	1,669,720,864.60
应收利息	-	-	-	22,215,241.03	22,215,241.03
其他资产	495,488,595.21	1,005,726,394.89	-	-	1,501,214,990.10
资产总计	3,180,232,719.65	1,005,726,394.89	-	22,215,241.03	4,208,174,355.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	898,195.74	898,195.74

应付托管费	-	-	-	299,398.57	299,398.57
应付交易费用	-	-	-	16,554.18	16,554.18
负债总计	-	-	-	1,214,148.49	1,214,148.49
利率敏感度缺口	3,180,232,719.65	1,005,726,394.89	-	21,001,092.54	4,206,960,207.08

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