

《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告》

更正公告

中信建投基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于 2017 年 3 月 31 日披露了《中信建投稳溢保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告》。现将相关内容更正如下：

更正前的内容为：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	-	-	-	-	-	-	5,837,937.34
结算备付金	-	-	-	-	-	-	217,126.65
存出保证金	-	-	-	-	-	-	31,360.99
交易性金融资产	-	-	-	88,588,000.00	-	10,473,920.00	887,612,920.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	39,700,419.55
应收利息	-	-	-	-	-	10,044,342.94	10,044,342.94
应收申购款	-	-	-	-	-	998.80	998.80
资产总计	-	-	-	88,588,000.00	-	20,519,261.74	943,445,106.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	87,745.99	87,745.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	960,084.07	960,084.07
应付托管费	-	-	-	-	-	160,014.03	160,014.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,004.46	64,004.46
其他负债	-	-	-	-	-	255,343.04	255,343.04
负债总计	-	-	-	-	-	1,527,191.59	1,527,191.59
利率敏感度缺口	-	-	-	88,588,000.00	-	18,992,070.15	941,917,914.68
上年度末 2015 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							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

更正后的内容为：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	5,837,937.34	-	-	-	5,837,937.34
结算备付金	217,126.65	-	-	-	217,126.65
存出保证金	31,360.99	-	-	-	31,360.99
交易性金融资产	788,551,000.00	88,588,000.00	-	-10,473,920.00	887,612,920.00
买入返售金融资产	39,700,419.55	-	-	-	39,700,419.55
应收利息	-	-	-	-10,044,342.94	10,044,342.94
应收申购款	-	-	-	998.80	998.80
资产总计	834,337,844.53	88,588,000.00	-	-20,519,261.74	943,445,106.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	87,745.99	87,745.99
应付管理人报酬	-	-	-	960,084.07	960,084.07
应付托管费	-	-	-	160,014.03	160,014.03
应付交易费用	-	-	-	64,004.46	64,004.46
其他负债	-	-	-	255,343.04	255,343.04
负债总计	-	-	-	1,527,191.59	1,527,191.59
利率敏感度缺口	834,337,844.53	88,588,000.00	-	-18,992,070.15	941,917,914.68
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

特此更正。由此给投资者带来的不便，深表歉意！

中信建投基金管理有限公司

2017年4月15日