

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