

关于蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告内容更正公告

蜂巢基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于 2021 年 8 月 30 日在本公司网站和中国证监会基金电子披露网站上刊登的《蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告》有内容更正如下：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2021 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	2,366,266.00	-	-	-	2,366,266.00
存出保证金	34,802.36	-	-	-	34,802.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-328,616,197.49	328,616,197.49
其他资产	-	-	-14,239,803,905.70	-64,467,449.53	14,175,336,456.17
资产总计	2,401,068.36	-	-14,239,803,905.70	-264,148,747.96	14,506,353,722.02
负债					
卖出回购金融资产款	6,469,138,405.07	-	-	-	6,469,138,405.07
应付管理人报酬	-	-	-	996,004.73	996,004.73
应付托管费	-	-	-	332,001.57	332,001.57
应付交易费用	-	-	-	207,555.67	207,555.67
应付利息	-	-	-	1,939,912.24	1,939,912.24
其他负债	-	-	-	98,260.15	98,260.15
负债总计	6,469,138,405.07	-	-	3,573,734.36	6,472,712,139.43
利率敏感度缺口	-	-	-14,239,803,905.70	-260,575,013.60	8,033,641,582.59
6,466,737,336.71					
上年度末 2020 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	4,571,873.76	-	-	-	4,571,873.76
存出保证金	7,659.38	-	-	-	7,659.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	20,022,150.03	-	-	-	20,022,150.03
应收利息	-	-	-	-239,280,057.06	239,280,057.06

其他资产	-	-	13,333,201,148.70	-	13,333,201,148.70
资产总计	24,601,683.17	-	13,333,201,148.70	239,280,057.06	13,597,082,888.93
负债					
卖出回购金融资产款	5,562,153,385.17	-	-	-	5,562,153,385.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,023,726.00	1,023,726.00
应付托管费	-	-	-	341,242.00	341,242.00
应付交易费用	-	-	-	221,836.83	221,836.83
应付利息	-	-	-	1,278,853.98	1,278,853.98
其他负债	-	-	-	219,000.00	219,000.00
负债总计	5,562,153,385.17	-	-	3,084,658.81	5,565,238,043.98
利率敏感度缺口	-	-	13,333,201,148.70	236,195,398.25	8,031,844,844.95
	5,537,551,702.00				

除此之外，其他内容无变更。

由此给投资者带来的不便，本公司深表歉意。

蜂巢基金管理有限公司

2021年9月23日