

德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金

2021 年年度报告更正公告

德邦基金管理有限公司于 2022 年 3 月 31 日在本公司网 [www.dbfund.com.cn] 和中国证监会基金电子披露网站 [http://eid.csrc.gov.cn/fund] 上发布了《德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告》。现对报告中“7.4.13.4.1.1 利率风险敞口”部分进行更正，更正后的内容如下：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	833,992.88	-	-	-	-	-	833,992.88
结算备付金	254,622,274.31	-	-	-	-	-	254,622,274.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-205,619,442.45	205,619,442.45
其他资产	-	-	-	-	-14,157,583,751.03	-	-14,157,583,751.03
资产总计	255,456,267.19	-	-	-	-14,157,583,751.03	205,619,442.45	14,618,659,460.67
负债							
卖出回购金融资产款	6,438,995,167.50	-	-	-	-	-	6,438,995,167.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-	79,198.25	79,198.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,044,397.61	1,044,397.61

应付托管费	-	-	-	-	-	348,132.53	348,132.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	149,034.26	149,034.26
应付利息	-	-	-	-	-	685,144.24	685,144.24
其他负债	-	-	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	6,438,995,167.50	-	-	-	-	2,514,906.89	6,441,510,074.39
利率敏感度缺口	-6,183,538,900.31	-	-	-	-14,157,583,751.03	203,104,535.56	8,177,149,386.28
上年度末 2020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	21,583.02	-	-	-	-	-	21,583.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-154,310,162.41	154,310,162.41
其他资产	-	-	-	-	-10,623,594,723.92	-	-10,623,594,723.92
资产总计	21,583.02	-	-	-	-10,623,594,723.92	154,310,162.41	10,777,926,469.35
负债							
卖出回购金融资产款	2,745,197,407.45	-	-	-	-	-	2,745,197,407.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,132.19	2,132.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,023,500.05	1,023,500.05
应付托管费	-	-	-	-	-	341,166.67	341,166.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	157,596.18	157,596.18

应付利息	-	-	-	-	-	206,364.80	206,364.80
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	2,745,197,407.45	-	-	-	-	1,930,759.89	2,747,128,167.34
利率敏感度缺口	-2,745,175,824.43	-	-	-10,623,594,723.92	-	152,379,402.52	8,030,798,302.01

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

除以上更正事项外，其他内容保持不变。由此给投资人带来的不便，本公司深表歉意。

特此公告。

德邦基金管理有限公司

2022年10月11日