

# 德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告更正公告

德邦基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 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 2022 年中期报告》。现对报告中“6.4.13.4.1.1 利率风险敞口”部分进行更正，更正后的内容如下：

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 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	1,429,779.12	-	-	-	-	-	1,429,779.12
结算备付金	103,152,210.28	-	-	-	-	-	103,152,210.28
债权投资	-	-	-2,076,268,171.82	12,464,158,270.63	-	-	-14,540,426,442.45
资产总计	104,581,989.40	-	-2,076,268,171.82	12,464,158,270.63	-	-	-14,645,008,431.85
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,008,132.10	1,008,132.10
应付托管费	-	-	-	-	-	336,044.05	336,044.05
应付清算款	-	-	-	-	-	560,037.78	560,037.78

卖出回购金融资产款	6,504,659,094.80	-	-	-	-	6,504,659,094.80	
其他负债	-	-	-	-	271,649.10	271,649.10	
负债总计	6,504,659,094.80	-	-	-	2,175,863.03	6,506,834,957.83	
利率敏感度缺口	6,400,077,105.40	-	-2,076,268,171.82	12,464,158,270.63	-2,175,863.03	8,138,173,474.02	
上年度末 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	-	-	-	-	-	-	
其他资产	-	-	-	-14,157,583,751.03	205,619,442.45	14,363,203,193.48	
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	-	-	-	-	79,198.25	79,198.25	

款						
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
其他 负债					1,043,178.50	1,043,178.50
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				-14,157,583,751.03	203,104,535.56	8,177,149,386.28

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