…… 1
…… 4
……10
……12
……14
……24
……30
……31
……33
……42
……43
……44
……46
……55
……59
……61
……62
……65
……68
……70
……71

……72

……76

1

2

36 36

11 11

24 92

[2020]95 95

[2020]112 112

3

24 95 112

24

95 112

1 11

24 95 112

2

3

4

5

6

7

8 36 2016 12 20

114 2018 2 1

9 11 2011 1 11

58

5 1

24

10 24 2013 3 22

11 92 2016 9 28

12

13 95 2020 12 30

2021 1 1

14 112 2020 12 30

2021 1 1

15

16

17

18

19

20

21

22 /

/ /

23 /

/

24

25

26

27

28

29

30

31

32

33

34

35

36

37

38 T

39 T+n T n

40

41

42

43

44

45

10%

46

47

48

49

50

51

52

53

/

54

/

，

1

2

4 /

1

1

2

2

/ /

/

T 3

T

3

/

/ T

T+1 T

T+1

/ /

/

/ /

/

/

4

5

T T+1

2

3

= /

2

4

= /T

T

2

5

= ×T

2

/

/

1

2

3

4 /

5

6

7

1-7 /

/

/ /

/ /

/

3

4

5

6

4

1

10%

2

1

2

10%

3 2

20

20

3

3

/ /

1 /

2 /

3 /

/

/

1 2 27 28

0153

010-65051166

24 95 112

1

2

3

4

5

6

7 /

8

9

10

11

12

13

1

2

3

4

5

6 24 95 112

7

8

9

10

11 24 95 112

12

24 95 112

13

14

15

15

16

17

18

19

20

21

22

24 95 112

1

2

3

4

5

6

7

24 95 112

1

2

3

4 24 95 112

5

6

7

8

9

10

11

12

24

95 112

1

2

3

4

1

2

3

15

4

5

A

1

40% 80%

20%

20%

40%

5%

2 1

2

3

3

中金丰泽股票专项型

AAA

2

AAA

10

1

2 AAA

3

11

1

2

3

4 AA+

AA+

1 150

200

2

150

200

5 4 1

6

100

7

50%

1.5

12

1

2

3

A

4

5

2

13

14

10

30

10

3

11 24 95 112

15

16

1

2

3

4

1

2

3

4

5

10

8841429.WI

			37
			6
			10
2015 10 -- 2015			

/

10 -

22 -

1

1

2

3

4

2

1

2

3

3

4

5

6

7

8

2

T+1

4

4

1

2

1

2

3

4

5

6

7

3

1

2

3

4

4

1

2

3

1

2

3

1 11

2

1

2

3

4

5

6

7

1

0.6%

T= E1×R/

T

E1

R

15

2

0.03%

C=E2×S/

C

E2

S

5

3 11

24 95 112

1

2

3

4 24 95 112

15

15

1

2

3

4

1

2

3

4

5

1.

2. ( )

1 1 12 31

10 22 -

1

2

1

4

5

1

1

2

3

4

15

2

1

2

3

4

5

15

2 3

3 1 2

1

2

3

1

2

3 3 3

24

95 112

1

2 /

3

1

2

3

4

5

1

2

3

4

1

2