

苏新基金管理有限公司公募基金产品风险评价表

基金名称		
评价指标	基金产品风险评价内容	评价得分
基金类别	(1) 商品期货型基金、股票型基金、股票型 FOF：得分为 40 分； (2) 混合型基金：得分为 35 分； (3) 混合型 FOF：得分为 30 分； (4) 债券型基金、债券型 FOF：得分为 20 分； (5) 同业存单指数基金：得分为 3 分； (6) 货币型 FOF、货币型：得分为 1 分。 其他类型 FOF、QDII 产品根据投资方向、投资范围、投资比例等因素，参照以上基金类别进行打分。	
流动性与到期期限	(1) 封闭期在 1 年以上（含 1 年），同时在封闭期不能流通转让的，得分为 3 分； (2) 封闭期在 1 年以上（含 1 年），同时在封闭期能够流通转让的，得分为 2 分； (3) 封闭期在 1 年以下的，得分为 1 分； (4) 开放式基金，得分为 0 分。	
杠杆比例	(1) 总资产/净资产上限大于 140%，得分为 3 分； (2) 总资产/净资产上限小于等于 140%，得分为 0 分。	
投资门槛	(1) 投资最低金额 5 万元及以上的，得分为 1 分； (2) 投资最低金额 5 万元以下的，得分为 0 分。 同一基金风险收益特征类似的不同分类除外。	
募集方式	(1) 定制公募，得分为 1 分； (2) 非定制公募，得分为 0 分。	
违规行为	(1) 基金成立以来没有违规行为发生的，得分为 0 分； (2) 基金成立以来违规行为发生 1 次的，得分为 2 分； (3) 基金成立以来违规行为发生 2 次及以上的，得分为 5 分。	
历史规模	(1) 最新规模小于五千万元，得分为 2 分； (2) 最新规模大于等于五千万元，得分为 0 分。	
基金业绩	(1) 最近一年业绩在同类型基金中后 50%，得分为 3 分； (2) 最近一年业绩在同类型基金中前 50%，得分为 0 分。 无相关数据的，本项不计算。	
最近一年年化波动率	(1) 基金最近一年年化波动率>5%，风险评价得分为 2 分； (2) 基金最近一年年化波动率>1%，，风险评价得分为 1 分； (3) 基金最近一年年化波动率≤1%，风险评价得分为 0 分。 无相关数据的，本项不计算。	
持仓比例	产品成立不满一年的，根据产品法律文件中约定的各项投资比例限制按孰高原则进行打分。 常规股票、混合、债券型基金，根据基金过去一年平均股票持仓比例进行打分。 80% < 股票平均持仓 ≤ 100%，风险评价得分为 20 分；	

	60% < 股票平均持仓 ≤ 80%，风险评价得分为 15 分； 40% < 股票平均持仓 ≤ 60%，风险评价得分为 10 分； 20% < 股票平均持仓 ≤ 40%，风险评价得分为 5 分； 0% < 股票平均持仓 ≤ 20%，风险评价得分为 1 分； 股票平均持仓 = 0%，风险评价得分为 0 分。 基金中基金（FOF）及其他投资范围包含基金的基金，根据基金过去一年平均权益类资产持仓比例进行打分（权益类资产包括股票、股票型基金、混合型基金的合计）。无公开数据的，参考法律文件中投资比例限制按孰高打分。 80% < 权益类资产 ≤ 100%，风险评价得分为 20 分； 60% < 权益类资产 ≤ 80%，风险评价得分为 15 分； 40% < 权益类资产 ≤ 60%，风险评价得分为 10 分； 20% < 权益类资产 ≤ 40%，风险评价得分为 5 分； 0% < 权益类资产 ≤ 20%，风险评价得分为 1 分； 权益类资产平均持仓 = 0%，风险评价得分为 0 分。		
其他 附加项	A、发行人等相关主体的信用状况； B、存在本金损失的可能性，因杠杆交易等因素容易导致本金大部分或者全部损失的基金； C、投资品种的流动变现能力差，因无公开交易市场、参与投资者少等因素导致难以在短期内以合理价格顺利变现的基金； D、存在特殊免责条款、结构性安排、投资标的具有衍生品性质（用于套保或对冲的期货和期权除外）的情况的基金； E、可理解性差，因结构复杂、不易估值等因素导致普通人难以理解其条款和特征的基金； F、跨境因素，存在市场差异、适用境外法律等情形的跨境发行或者交易的基金； G、基金业协会认定的高风险基金； H、其他基金的特定安排有可能构成投资风险的因素。 出现以上情况时，每一项单独评分，得分 5-20 分。_____		
产品评级		最终得分	

评价人：

复核人：

评价时间：

注：根据基金产品各项风险评价得分加总值，确定风险等级：

- （1）低风险等级：分值低于 10 分（含）的评定为低风险等级 R1；
- （2）中低风险等级：分值介于 11~40 分（含）的评价为中低风险等级 R2；
- （3）中风险等级：分值介于 41~70 分（含）的评定为中风险等级 R3；
- （4）中高风险等级：分值介于 71~85 分（含）的评定为中高风险等级 R4；
- （5）高风险等级：分值高于 86 分（含）的评定为高风险等级 R5。