

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：得分为 60 分； (2) 股票型基金、股票型 FOF：得分为 45 分； (3) 偏股混合型基金、偏股混合型 FOF：得分为 40 分； (4) 其他混合型基金、其他混合型 FOF：得分为 35 分； (5) 债券型基金、债券型 FOF：得分为 20 分； (6) 同业存单指数基金：得分为 3 分； (7) 货币型 FOF、货币型：得分为 1 分。 其中，偏股混合型基金是指股票投资占基金资产比例不低于 60% 的公募混合型基金；偏股混合型 FOF 是指权益类资产投资占基金资产比例不低于 60% 的公募混合型 FOF 基金。 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(权益类资产比例根据具体基金合同中定义口径计算)。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	
风险等级划分标准	风险等级风险评分终值区间 R1 (0, 10]; R2 (10, 40]; R3 (40, 60]; R4 (60, 80]; R5 80 (不含) 以上		

评价人:

复核人:

评价时间: 年 月 日