

东兴基金管理有限公司公募基金产品风险等级评估说明

根据《证券期货投资者适当性管理办法》(证监会令[第130号])、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引(试行)》(中证协发[2017]153号)、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引(试行)》(中基协发[2017]4号)等监管规定及《东兴基金管理有限公司销售适应性管理办法》、《东兴基金管理有限公司基金产品或者服务风险等级评估指引》，特制定本说明。本说明适用于东兴基金管理有限公司(以下简称“公司”)发行的向投资者公开募集的公募基金产品(以下简称“公募产品”或“产品”)。

一、评估产品风险等级时考虑的评价因素：

(一) 综合考虑因素

产品开展风险等级初评时，将考虑以下因素：

- 1、投资产品或者服务的最低金额：产品风险评分随最低金额的提高而降低。
- 2、募集方式：募集方式为公开募集的产品风险评分较高。
- 3、运作方式：产品风险评分随开放程度或频率的提高而提高。
- 4、产品或服务存续期限：产品风险评分随存续期限的提高而提高。
- 5、结构复杂性：产品风险评分随产品结构复杂程度的提高而降低。
- 6、杠杆情况：产品风险评分随杠杆水平的提高而降低。
- 7、投资方向和投资范围：产品投资于固定收益类比例越高、权

益类比例越低，风险评分越高；产品投资于固定收益类比例越低、权益类比例越高，风险评分越低。

8、估值复杂度：产品风险评分随估值复杂的程度提高而降低。

9、存在本金损失的可能性：产品风险评分随本金损失的可能性提高而降低。

10、同类产品过往业绩：产品风险评分与同类产品过往业绩呈正相关关系，同类产品过往业绩越好，产品风险评分越高。

11、管理人情况：管理人各方面情况越好，产品风险评分越高。

产品开展风险等级复评时，除考虑上述第1项-8项及第11项的因素外，还将考虑以下因素：

1、投资标的流动性及衍生品情况：产品投资的标的流动性越好、衍生品比例越低，风险评分越高；产品投资的标的流动性越差、衍生品比例越高，风险评分越低。

2、最大回撤：产品风险评分随评估区间的最大回撤程度的提高而降低。

3、年化波动率：产品风险评分随评估区间的年化波动率的提高而降低。

（二）审慎评估因素（扣分项）

若产品存在跨境因素、合同存在特殊免责条款或不存在公开交易市场，或因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及具有其他有可能构成投资风险的因素，则产品的风险评分相应扣减。

另外，行业协会等自律组织认定的高风险产品，将直接评定为高风险等级。

二、产品风险评分

按以上因素对公司发行的公募产品进行风险评分，根据评分结果将产品划分为以下五个等级，具体划分标准如下：

- 1、低风险等级（R1）：风险评分 \geq 90分；
- 2、中低风险等级（R2）：80分 \leq 风险评分 $<$ 90分；
- 3、中风险等级（R3）：70分 \leq 风险评分 $<$ 80分；
- 4、中高风险等级（R4）：50分 \leq 风险评分 $<$ 70分；
- 5、高风险等级（R5）：风险评分 $<$ 50分。

三、公司现有产品评级

基金代码	基金简称	基金类型	风险评级
002759.OF	东兴安盈宝货币 A	货币型	低风险等级（R1）
002760.OF	东兴安盈宝货币 B	货币型	低风险等级（R1）
003545.OF	东兴兴利债券 A	债券型	中低风险等级（R2）
009617.OF	东兴兴利债券 C	债券型	中低风险等级（R2）
011024.OF	东兴兴利债券 D	债券型	中低风险等级（R2）
007091.OF	东兴兴福一年定开债 A	债券型	中低风险等级（R2）
015542.OF	东兴兴福一年定开债 C	债券型	中低风险等级（R2）
007769.OF	东兴兴瑞一年定开债 A	债券型	中低风险等级（R2）
007394.OF	东兴兴财短债 A	债券型	中低风险等级（R2）
007395.OF	东兴兴财短债 C	债券型	中低风险等级（R2）
008165.OF	东兴鑫远三年定开债	债券型	中低风险等级（R2）
013164.OF	东兴兴盈三个月定开债 A	债券型	中低风险等级（R2）
013165.OF	东兴兴盈三个月定开债 C	债券型	中低风险等级（R2）

014716.OF	东兴兴源债券 A	债券型	中低风险等级 (R2)
014717.OF	东兴兴源债券 C	债券型	中低风险等级 (R2)
013428.OF	东兴鑫享 6 个月滚动持有债券发起式 A	债券型	中低风险等级 (R2)
013429.OF	东兴鑫享 6 个月滚动持有债券发起式 C	债券型	中低风险等级 (R2)
015243.OF	东兴连裕 6 个月滚动持有债券 A	债券型	中低风险等级 (R2)
015244.OF	东兴连裕 6 个月滚动持有债券 C	债券型	中低风险等级 (R2)
001708.OF	东兴改革精选混合	混合型	中高风险等级 (R4)
002182.OF	东兴蓝海财富混合	混合型	中高风险等级 (R4)
004696.OF	东兴量化优享混合	混合型	中高风险等级 (R4)
004840.OF	东兴品牌精选混合 A	混合型	中高风险等级 (R4)
006442.OF	东兴品牌精选混合 C	混合型	中高风险等级 (R4)
004695.OF	东兴未来价值混合 A	混合型	中高风险等级 (R4)
007550.OF	东兴未来价值混合 C	混合型	中高风险等级 (R4)
009327.OF	东兴兴晟混合 A	混合型	中高风险等级 (R4)
009328.OF	东兴兴晟混合 C	混合型	中高风险等级 (R4)
012297.OF	东兴宸瑞量化混合 A	混合型	中高风险等级 (R4)
012298.OF	东兴宸瑞量化混合 C	混合型	中高风险等级 (R4)
013166.OF	东兴宸祥量化混合 A	混合型	中高风险等级 (R4)
013167.OF	东兴宸祥量化混合 C	混合型	中高风险等级 (R4)
009116.OF	东兴中证消费 50 指数 A	股票型	中高风险等级 (R4)
009117.OF	东兴中证消费 50 指数 C	股票型	中高风险等级 (R4)

四、其他说明

当基金产品信息发生变化时，公司将及时重新评估其风险等级，同时公司定期对存续基金产品的风险进行评价更新。

本说明由东兴基金管理有限公司负责解释和修订。