

东海基金管理有限责任公司旗下基金产品

风险等级划分说明

(2023年11月)

根据《证券投资基金销售适用性指导意见》、《证券期货投资者适当性管理办法》及《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》的相关要求，遵循基金产品的风险等级和投资者的风险承受能力类型匹配的原则，东海基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）通过定量和定性相结合的方法综合评定旗下基金产品风险等级。

1. 公司旗下基金产品的风险等级按照风险由低到高顺序，划分为以下五个等级：R1（低风险）、R2（中低风险）、R3（中风险）、R4（中高风险）和R5（高风险）。

2. 基金产品风险等级划分将综合考虑以下因素：

基金产品的结构（母子基金、平行基金），投资方向、投资范围和投资比例，募集方式及最低认购金额，运作方式，存续期限，过往业绩及净值的历史波动程度，成立以来有无违规行为发生，基金估值政策、程序和定价模式，申购和赎回安排，杠杆运用情况等。

3. 如基金产品存在下列因素的，将审慎评估其风险等级：

（1）基金产品存在特殊免责条款、结构性安排、投资标的具有衍生品性质等导致普通投资者难以理解的；

（2）基金产品或者服务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的；

（3）基金产品或者服务的投资标的流动性差、存在非标准资产投资导致不易估值的；

（4）基金产品或者服务投资杠杆达到相关要求上限、因杠杆交易等因素容易导致本金大部分或者全部损失的产品或者服务，或投资单一标的集中度过高的；

（5）产品或者服务的募集方式，涉及面广、影响力大的公募产品或者相关服务；

（6）产品或者服务的跨境因素，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产品或者服务；

（7）基金管理人（资产管理人）、实际控制人、高管人员涉嫌重大违法违规行为或正在接受监管部门或自律管理部门调查的；

（8）中国证券投资基金业协会认定的高风险基金产品或者服务；

（9）影响投资者利益的其他重大事项。

4. 公司根据基金产品风险因素与风险等级的相关性，对各项评估因素赋予1分-5分风

险分值，按照各因素不同权重加权计算，得到被评价基金产品的风险综合评价分数，最后根据风险综合评价分数划分相应风险等级。

5. 公司产品风险等级与投资者风险承受能力适当性匹配情况如下：

投资者风险承受能力类型	产品风险等级匹配
C1（保守型）	R1
C2（稳健型）	R1、R2
C3（平衡型）	R1、R2、R3
C4（成长型）	R1、R2、R3、R4
C5（积极型）	R1、R2、R3、R4、R5

风险提示：

1. 本公司对旗下基金产品的风险等级划分享有最终解释权。

2. 投资者购买基金后，所购买的基金产品风险等级可能因市场或运作情况等影响而发生调整，并可能超出投资者自身风险承受能力，从而可能产生不利后果和损失。投资者应及时关注基金风险等级的变化并谨慎决策，以确保自身的投资决策与风险承受能力相匹配。

3. 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件。敬请投资者关注投资风险。