东方阿尔法基金管理有限公司

基金风险评级和投资者风险承受能力说明

（2022 年第 3 次更新）

一、产品风险等级

为有效落实投资者适当性管理制度，维护投资者合法权益，根据《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令第 130 号）、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引》（中基协发〔2017〕4 号）等相关要求，产品风险评价结果以产品风险等级来具体反映，共划分为以下五个等级：

（一）低风险等级（R1）；

（二）中低风险等级（R2）；

（三）中风险等级（R3）；

（四）中高风险等级（R4）；

（五）高风险等级（R5）。

二、基金产品风险等级评价方法

基金产品风险等级的评价标识综合考量的因素，包括但不限于以下几个方面：

（一）基金产品法律文件所明示的投资方向、投资范围和投资比例；

（二）基金产品募集方式及最低认购/申购金额；

（三）基金产品运作方式；

（四）基金产品存续期限；

（五）基金产品历史规模和持仓比例；

（六）产品投资者情况，主要指数量持有人结构和数量

（七）基金产品过往业绩及基金净值的历史波动程度；

（八）基金产品成立以来有无违规行为发生；

（九）基金产品估值政策、程序和定价模式；

（十）基金产品申购和赎回安排；

（十一）基金产品杠杆运作情况。

基金产品存在下列因素的，将审慎评估其风险等级：

（一）基金合同表述复杂，存在免责条款、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；

（二）基金规模过大，影响面广，可能触巨额赎回，易引发群体事件的；

（三）基金的投资品种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；

（四）基金的投资标的流动性差、存在非标准资产投资导致不宜估值的；

（五）基金的投资杠杆达到相关要求上限、投资单一标的集中度过高的。

三、投资者风险承受能力说明

根据相关监管规定，基金募集机构要设计风险测评问卷，按照风险承受能力的测评结果，将普通投资者由低到高至少分为C1（含风险承受能力最低类别）、C2、C3、C4、C5五种类型：

（一）保守型投资者（C1），建议投资者可购买或接受R1风险等级的基金产品或服务；

（二）稳健型投资者（C2），建议投资者可购买或接受R2及以下风险等级的基金产品或服务;

（三）平衡型投资者（C3），建议投资者可购买或接受R3及以下风险等级的基金产品或服务

（四）积极型投资者（C4），建议投资者可购买或接受 R4 及以下风险等级的基金产品或服务；

（五）进取型投资者（C5），建议投资者可购买或接受 R5 及以下风险等级的基金产品或服务。

投资人在选择和购买我司旗下基金产品或服务时，需根据自身风险承受能力的测评结果，理性选择适合自己风险承受能力的产品和服务。

表 1： 基金产品风险等级与投资者风险承受能力等级匹配表

投资者类型 基金风险等级	保守型（C1）	稳健型（C2）	平衡型（C3）	积极型（C4）	进取型（C5）
低风险（R1）	√	√	√	√	√
中低风险（R2）	不匹配 禁止购买	√	√	√	√
中风险（R3）	不匹配 禁止购买	不匹配	√	√	√
中高风险（R4）	不匹配 禁止购买	不匹配	不匹配	√	√
高风险（R5）	不匹配 禁止购	不匹配	不匹配	不匹配	√

	买				

注：最低风险承受能力（C1 中的最低风险承受能力）客户只能购买 R1 级产品

表 2：东方阿尔法基金旗下基金产品风险等级划分名录（2022.06.30 更新）：

基金类型	基金简称	基金代码	产品风险等级					较之上一期等级是否变动
			R1	R2	R3	R4	R5	
混合类	东方阿尔法精选混合 A	005358			√			否
	东方阿尔法精选混合 C	005359			√			
	东方阿尔法优选混合 A	007518			√			
	东方阿尔法优选混合 C	007519			√			
	东方阿尔法优势产业混合 A	009644			√			
	东方阿尔法优势产业混合 C	009645			√			
	东方阿尔法招阳混合 A	011184			√			
	东方阿尔法招阳混合 C	011185			√			
	东方阿尔法产业先锋 A	011704			√			
	东方阿尔法产业先锋 C	011705			√			
	东方阿尔法医疗健康混合发起 A	014841				√		
	东方阿尔法医疗健康混合发起 C	014842				√		
权益类	东方阿尔法基金精选 1 期	SCB639				√		否
	东方阿尔法高端制造 1 期	SVJ768				√		/
	东方阿尔法智选 1 期	SVN833				√		/