

上海证券报社基金评价业务信息披露

(仅开展评奖业务)

一、公司声明

本公司承诺按照信息披露材料的内容开展基金评价业务，不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性负责。

二、信息披露

(一) 基本情况

机构基本情况表

公司名称	上海证券报社有限公司	公司网址	http://www.cnstock.com/
注册地址	中国上海 浦东杨高南路 1100 号	邮编	200127
办公地址	上海市浦东新区东园路 18号中国金融信息中心		200120
成立时间	1993. 6. 11	注册资本	5000 万元
总资产	21. 43亿元	净资产	12. 06亿元
法定代表人	叶国标	总经理	
基金评价业务 开始时间	2004 年	基金评价业务部 门名称	基金部
基金评价业务范 围	基金和基金公司评奖	基金评价人数	5
基金评价结果发	上海证券报	基金评价结果	中国证券网 (http://www.cnstock.com/)

布渠道		发布网址（如有	
联系电话	400-820-0277	传真	400-820-0277

注：“基金评价业务范围”包括基金评级、单一指标排名、基金管理公司评级、评奖。

（二）评价人员情况

基金评价从业人员情况表

评价业务负责人：		
姓名	执业资格证书编号	主要从业经历
吴晓婧	证券市场基础知识 (2010053105525601) 证券投资基金 (2010033103702705)	2008.7—至今 上海证券报从事基金报道
基金评价人员：		
姓名	执业资格证书编号	主要从业经历
赵明超	证券市场基础知识 (2011033104042801) 证券投资基金 (2012093103515105)	2004.7-2008.12 大河网 2009.1-8 珠海特区报社 2012.7-至今 上海证券报社
王彭	证券市场基础知识 (2010108515497501) 证券投资分析 (2010128113067804) 基金法律法规、职业道德与 业务规范 (201612313964544031) 证券投资基金基础知识 (201612314087964031)	2008.11-2011.12 CAI Business Indepth Limited（香港工作经历） 研究部助理研究员 2012.2-2013.7 时富（中国）金融服务集团有限 公司 研究部研究员 2013.7-至今 上海证券报社 基金部记者
陈玥	证券市场基础知识 (20073100153301) 证券投资基金	2008.5—至今 上海证券报社基金报道

	(2008103102529805)	
陆海晴	证券市场基本法律法规 (20170431000057981760 310000) 金融市场基础知识 (2017043100006029472 0310000)	2018年7月至今 上海证券报从事基金报道

注：“主要从业经历”是指从事金融业务相关的工作经历。

2009093101341301

(三) 基金评价业务情况

2、基金（基金管理公司）评奖的情况（评级、评奖机构填写）

1) 基金（基金管理公司）评奖基本情况（包括但不限于奖项名称、数量、主办方、数据或技术支持单位、参选的基本条件）；

上海证券报“金基金奖”评奖方案（2021）

上海证券报“金基金”奖评奖方案

一、基金评奖的基本情况（包括但不限于以下内容）

1、奖项的名称、主办、协办以及数据支持单位；

奖项名称：第#届中国“金基金”奖评选

主办单位：上海证券报社

技术支持单位：中国银河证券股份有限公司
晨星资讯（深圳）有限公司
上海证券有限责任公司

2、审核与评选的方式；

对于评选范围内的基金公司和基金产品，采取定量评价为主，定性评价为辅的评价方式。定性部分主要根据包括评奖专家委员会投票结果得出。（具体方法及流程见下文《基

金评奖理论方法及数据说明》)

3、评选的宗旨与原则；

中国基金业的进步除了内生发展之外，外在推动的作用也非常重要。我们力图通过“金基金”奖评选，以及《上海证券报》的广泛影响力，推动基金公司在切实注重保护持有人利益的前提下，做好投资、合规、风控、创新等关乎公司长远发展的基础性工作，实现平稳发展、和谐发展和绿色发展。

公开、公正、客观和权威，注重长期性、一致性原则和对投资者利益的保护及对契约的尊重是我们遵守的基本评奖原则，我们将通过严格的制度和流程确保上述原则的贯彻。

“金基金年度基金公司奖”方面，突出对投资者利益的保护，鼓励基金管理人追求短期中期与长期、股票债券等多品种均衡协调发展模式，强调长期投资业绩和合规门槛。

“金基金产品奖”方面除了较为优秀的业绩外，我们把基金是否忠实履行基金契约、是否具备清晰的投资理念、是否保持稳定鲜明的投资风格、是否具有持续的净值增长能力和良好的风险控制能力等列作重要考核指标。推崇基金风格多样化，在同等业绩的前提下，更加注重较低换手率和交易费率的基金。

4、参选的条件；

参选“金基金公司奖”的基金管理人的基础要求是需经中国证监会批准成立运营且管理基金产品满一年，且包括评奖年度在内的最近一年内该公司没有被中国证监会等监管部门公开处罚的记录。各个公司奖项还有个性化的参选条件。

“金基金产品奖”，由“上证基金量化评分体系”根据不同基金类别产生相应的综合评分排名，前10%进入初选范围（不低于3倍获奖基金数），经主办方会同技术支持机构根据基金业绩表现、契约忠实程度、风险控制能力、合法合规操作水平等指标筛选产生“金基金产品奖”的候选名单。

其他事项：

（一）主做股票的基金，建仓期统一为三个月。主做债券的基金，建仓期统一为一个月。指数型基金，建仓期统一为一个月。

（二）在满足了建仓期的条件之后，实际运作时间满三年以上的基金，列入评选范围。

（三）基金数量少于10只的类别，不作为参评对象。

5：评委会专家

“金基金”奖评选专家委员会构成：相关政府部门专家、商业银行基金托管部负责人、国内基金研究资深人士及上海证券报社负责人。

评委会专家主要为评奖理论和方法体系提供咨询，同时负责奖项合规审查工作及部分定性评价部分的投票工作。

2) 评奖的理论基础、应用的指标体系和方法。

金基金-公司奖

基金公司奖共8项，分别为“金基金-TOP公司大奖”、“金基金-股票投资回报奖”、“金基金-债券投资回报奖”、“金基金-海外投资回报奖”、“金基金-成长公司奖”、“金基金-被动投资公司奖”、“金基金-养老投资公司奖”、“金基金-社会责任投资（ESG）基金管理公司奖”。

整体说明：2020年修订版的《证券投资基金评价业务管理暂行办法》明确了对基金管理人可以进行“投资管理能力”评价。“投资能力+投资者收益”等于投资回报，投资回报是指基金投资者的回报。此次修订恰好突出了上证报基金公司奖项名称的初心与本质。

关于投资者收益评价的说明。这是新增指标，8个奖项的投资者收益评价均按照同样的思路。采用基金管理人旗下参评基金利润评价来反映投资者整体收益情况。利润评价又分为利润总额评价与利润收益率评价两部分。

通过年度管理人旗下参评基金利润总额/ 旗下参评基金年度平均规模合计值，计算出该基金管理人参评基金的利润收益率。然后再按照大的投资方向或者二级分类进行细分：（1）按照投资方向：旗下股票方向基金的利润率、旗下债券方向基金的利润率。（2）按照二级基金分类计算管理人的利润收益率，然后进行汇总。备注：每个二级基金分类在某年度的年度平均规模，是分类下每只基金年度平均规模的相加。

基金公司奖项统一由投资管理能力评价、投资者收益评价、规模管理能力评价三部分组成，三部分的权重比例统一为60%、20%、20%。各个公司奖项统一的权重比例，有助于公司奖项整体评奖思路的统一。

关于管理人参评资格与管理人旗下基金参评资格的维护确认说明。采取“双参评维护”机制：即首先是管理人参评某个管理人奖项，然后是管理人旗下相关基金参评该管理人奖项，二者都要维护。注意是先有管理人参评，然后才有管理人旗下基金参评，注意二者的逻辑顺序。

关于评奖年度与计算年度区别的说明。管理人参评资格维护的时间选项是评奖年度，管理人旗下基金参评资格维护的时间选项是计算年度。目前公司奖项的计算年度数量统一为5年与3年两档，综合性质评奖的计算年度数量统一为5年，专业性质评奖的计算年度数量统一为3年。

以TOP大奖2021年评奖年度为例，由于TOP奖是综合性质奖项，涉及过往5年自然年度的计算，因此2021年评奖年度下关联2021、2020、2019、2018、2017五个计算年度。以此类推，2022年评奖年度下关联2022、2021、2020、2019、2018五个计算年度。

标准分处理。8个公司奖项不同项目之间采取计算标准分和赋予不同权重比例进行处理。标准分又分为原始值标准分与排名标准分两种计算方式。

最后，随着目前基金数量达到1万多只，基金管理人数量达到150家左右，基金业务日益复杂，8个公司奖项的计算逻辑、步骤和过程尽量标准化、规范化，让不同奖项之间可比、可衡量，也方便进行计算机系统化处理。

1、金基金- TOP公司大奖

评奖理论

TOP公司大奖是一个综合性奖项，考察基金公司在评奖年度取得的领先同业的综合成就和对投资者创造收益的贡献程度。本奖项要求获奖者具备良好的投资业绩，切实保护持有人利益，具有较好的公众形象，主要关注点包括投资管理能力、投资者收益、规模管理能力等。

参评资格

管理人参评资格：首先对参评基金管理人进行合规评价，实施一票否决制度。包括含评奖年度在内的最近两年无监管部门处罚记录，无重大违规事项发生、无事后经证实的重大负面新闻等。旗下至少各有1只主动管理的股票方向基金、1只主动管理的债券方向基金，且需要正式运作满足5年。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度主动管理股票方向基金需满足3个月建仓期要求；计算年度主动管理债券方向基金需满足1个月建仓期要求。

获奖公司数量

全市场基金管理公司数量*10%。

方法说明

以定量评价为主，定性分析为辅。TOP大奖定量评价部分由基金管理人投资管理能力评价、投资者收益评价和规模评价三部分组成，投资管理能力评价权重为60%，投资者收益评价权重为20%，规模评价权重为20%。

投资管理能力评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个年度组成，权重分别为30%、20%、20%、20%和10%。

自然年度投资管理能力评价分为主动股票投资管理能力和主动债券投资管理能力的两个方面，二者之间取当年市场主动管理股票方向基金规模和主动管理债券方向基金规模的相对比例作为权重，2021评奖年度靠档简化后取80%与20%。

主动股票投资管理能力和主动债券投资管理能力的均采用中国银河证券基金研究中心的《基金管理人主动股票方向投资管理能力的（指数法）》和《基金管理人主动债券投资管理能力的（指数法）》的评价标准及其结果。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标。利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价5个自然年度，每个自然年度的权重均为20%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个自然年度组成，权重分别为20%、20%、20%、20%和20%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表1：TOP公司大奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
--------	--------	--------------	--------	--------	--------------	--------	--------	--------------

1	投资管理能 力评价	60	1.1	T年度投资管理能力评价	30	1.1.1	T年度主动股票管理能力评价	80
						1.1.2	T年度主动债券管理能力评价	20
			1.2	T-1年度投资管理能力评价	20	1.2.1	T-1年度主动股票管理能力评价	80
						1.2.2	T-1年度主动债券管理能力评价	20
			1.3	T-2年度投资管理能力评价	20	1.3.1	T-2年度主动股票管理能力评价	80
						1.3.2	T-2年度主动债券管理能力评价	20
			1.4	T-3年度投资管理能力评价	20	1.4.1	T-3年度主动股票管理能力评价	80
						1.4.2	T-3年度主动债券管理能力评价	20
			1.5	T-4年度投资管理能力评价	10	1.5.1	T-4年度主动股票管理能力评价	80
						1.5.2	T-4年度主动债券管理能力评价	20
2	投资者收益 评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	20	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	20	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	20	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
			2.4	T-3年度参评基金利润评价	20	2.4.1	T-3年度参评基金利润总额评价	50
						2.4.2	T-3年度参评基金利润率评价	50
			2.5	T-4年度参评基金利润评价	20	2.5.1	T-4年度参评基金利润总额评价	50
						2.5.2	T-4年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	20	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	20	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	20	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50
			3.4	T-3年度参评基金规模评价	20	3.4.1	T-3年度参评基金存量规模评价	50
						3.4.2	T-3年度参评基金增量规模评价	50
			3.5	T-4年度参评基金规模评价	20	3.5.1	T-4年度参评基金存量规模评价	50
						3.5.2	T-4年度参评基金增量规模评价	50

2、股票投资回报基金管理公司奖

评奖理论

评价基金公司为投资者创造股票投资收益的能力以及贡献度的绝对额，鼓励基金公司建立并不断完善科学系统的研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培育价值投资、稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：首先对参评公司进行合规评价，实施一票否决制度。包括含评奖年度在内的最近两年内无监管部门处罚记录，无重大违规事项发生、无事后经证实的重大负面新闻等。旗下至少有1只主动管理的股票方向基金，且管理运作需要5年。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度主动管理股票方向基金满足3个月建仓期。

获奖公司数量

全市场基金公司数量的5%。如遇到基金全行业出现大面积亏损，投资者损失较大等特殊情况，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

以定量评价为主，定性分析为辅，主要衡量基金管理人的股票方向基金主动投资管理能力和被动投资部分暂时不纳入评价。在主动投资能力得分接近的情况下，可参考被动投资能力。本项目采用中国银河证券基金研究中心的《基金管理人主动股票投资管理评价（指数法）》的评价标准及其结果。该体系主要考察基金管理人的股票投资主动管理能力。

主动股票投资管理评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个自然年度组成，权重分别为30%、20%、20%、20%和10%。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价5个自然年度，每个自然年度的权重均为20%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个自然年度组成，权重分别为20%、20%、20%、20%和20%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表2：股票投资回报奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
1	主动股票投资管理评价	60	1.1	T年度主动股票管理能力评价	30	1.1.1	T年度主动股票管理能力评价	30
			1.2	T-1年度主动股票管理能力评价	20	1.2.1	T-1年度主动股票管理能力评价	20
			1.3	T-2年度主动股票管理能力评价	20	1.3.1	T-2年度主动股票管理能力评价	20
			1.4	T-3年度主动股票管理能力评价	20	1.4.1	T-3年度主动股票管理能力评价	20
			1.5	T-4年度主动股票管理能力评价	10	1.5.1	T-4年度主动股票管理能力评价	10
2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	20	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	20	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	20	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
			2.4	T-3年度参评基金利润评价	20	2.4.1	T-3年度参评基金利润总额评价	50
						2.4.2	T-3年度参评基金利润率评价	50

			2.5	T-4年度参评基金利润评价	20	2.5.1	T-4年度参评基金利润总额评价	50
						2.5.2	T-4年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	20	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	20	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	20	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50
			3.4	T-3年度参评基金规模评价	20	3.4.1	T-3年度参评基金存量规模评价	50
						3.4.2	T-3年度参评基金增量规模评价	50
			3.5	T-4年度参评基金规模评价	20	3.5.1	T-4年度参评基金存量规模评价	50
						3.5.2	T-4年度参评基金增量规模评价	50

3、债券投资回报奖

评奖理论

评价基金管理人为投资者创造债券投资收益的能力以及贡献度的绝对金额，鼓励基金管理人建立并不断完善科学系统的债券投资研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培育价值投资、稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：首先对参评管理人进行合规评价，实施一票否决制度。包括含评奖年度在内的最近两年内无监管部门处罚记录，无重大违规事项发生、无事后经证实的重大负面新闻等。旗下至少有1只主动管理的债券方向基金，且管理运作满5年。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度主动管理债券方向基金满足1个月建仓期。

获奖公司数量

全市场基金管理人数量的4%。如遇到基金全行业出现大面积亏损，投资者损失较大等特殊情况，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

以定量评价为主，定性分析为辅，主要衡量基金管理人债券方向基金主动投资管理能力，被动投资部分暂时不纳入评价。在主动投资能力得分接近的情况下，可参考被动投资能力。本项目采用中国银河证券基金研究中心的《基金管理人主动债券投资管理综合能力综评价（指数法）》的评价标准及其结果。

主动债券投资管理评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个自然年度组成，权重分别为30%、20%、20%、20%和10%。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价5个自然年度，每个自然年度的权重均为20%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、T-3年度、T-4年度合计5个自然年度

组成，权重分别为20%、20%、20%、20%和20%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表3：债券投资回报奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例
1	主动债券投资管理 能力评价	60	1.1	T年度主动债券管理能力评价	30	1.1.1	T年度主动债券管理能力评价	30
			1.2	T-1年度主动债券管理能力评价	20	1.2.1	T-1年度主动债券管理能力评价	20
			1.3	T-2年度主动债券管理能力评价	20	1.3.1	T-2年度主动债券管理能力评价	20
			1.4	T-3年度主动债券管理能力评价	20	1.4.1	T-3年度主动债券管理能力评价	20
			1.5	T-4年度主动债券管理能力评价	10	1.5.1	T-4年度主动债券管理能力评价	10
2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	20	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	20	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	20	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
			2.4	T-3年度参评基金利润评价	20	2.4.1	T-3年度参评基金利润总额评价	50
						2.4.2	T-3年度参评基金利润率评价	50
			2.5	T-4年度参评基金利润评价	20	2.5.1	T-4年度参评基金利润总额评价	50
						2.5.2	T-4年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	20	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	20	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	20	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50
			3.4	T-3年度参评基金规模评价	20	3.4.1	T-3年度参评基金存量规模评价	50
						3.4.2	T-3年度参评基金增量规模评价	50
			3.5	T-4年度参评基金规模评价	20	3.5.1	T-4年度参评基金存量规模评价	50
						3.5.2	T-4年度参评基金增量规模评价	50

4、海外投资回报奖

评奖理论

评价基金管理人为投资者创造海外投资收益的能力以及贡献度的绝对金额，鼓励基金管理人建立并不断完善科学系统的海外投资的研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培育价值投资、稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：首先对参评管理人进行合规评价，实施一票否决制度。包括含评奖年度在内的最近两年内无监管部门处罚记录，无重大违规事项发生、无事后经证实的重大负面新闻等。旗下至少有1只QDII股票方向基金或者港股通股票方向基金，且管理运作3年。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度满足3个月建仓期的QDII股票方向基金与港股通股票方向基金。

获奖公司数量

全市场基金公司数量的4%。如遇到基金全行业出现大面积亏损，投资者损失较大等特殊情况，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

以定量评价为主，定性分析为辅，有两种方法可以衡量基金公司海外投资管理能力。第一是根据旗下QDII股票方向基金或者港股通股票方向基金相对基准的超额收益和信息比率来衡量；第二是根据相对比较细致分类基础上的同类型收益率排名评价。被动投资部分暂时不纳入评价，在主动投资能力得分接近的情况下，可参考被动投资能力。

海外投资管理能力评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度组成，权重分别为40%、30%、30%。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价3个自然年度，每个自然年度的权重分别为40%、30%、30%。年度利润评价中利润总额评价与利润率评价权重均为50%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表4：海外投资回报奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例
1	海外投资管理能力评价	60	1.1	T年度海外投资管理能力评价	40	1.1.1	T年度同类型基金收益率排名评价	40
			1.2	T-1年度海外投资管理能力评价	30	1.2.1	T-1年度同类型基金收益率排名评价	30
			1.3	T-2年度海外投资管理能力评价	30	1.3.1	T-2年度同类型基金收益率排名评价	30
2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	40	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	30	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50

			2.3	T-2年度参评基金利润评价	30	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	40	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	30	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	30	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50

5、成长基金管理公司奖

评奖理论

本奖项主要是考察中小规模基金管理人的综合表现、成长性以及贡献度的绝对金额。

参评资格

管理人参评资格：首先对参评基金管理人进行合规评价，实施一票否决制度。包括含评奖年度在内的最近两年内无监管部门处罚记录，无重大违规事项发生、无后经证实的重大负面新闻等。

管理人参评资格：截止评奖年度末，公募管理开始日期起算运作时间满3年；评奖年度期初有效资产管理规模在行业后三分之二的中小规模基金管理人；评奖年度期末非货币市场基金资产规模超过100亿。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度主动管理股票方向基金需满足3个月建仓期要求；计算年度主动管理债券方向基金需满足1个月建仓期要求。

获奖公司数量

全市场基金公司数量*5%，如果缺少符合条件的基金公司，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

以定量评价为主，定性分析为辅。评奖指标分为投资管理能力评价、投资者收益评价、增量规模评价三部分组成，权重分别为60%、20%、20%。

投资管理能力评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度、合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。

自然年度投资管理能力评价分为主动股票投资管理能力评价和主动债券投资管理能力评价两个方面，二者之间取当年市场主动管理股票方向基金规模和主动管理债券方向基金规模的相对比例作为权重，2021评奖年度靠档简化取80%与20%。主动股票投资管理能力评价和主动债券投资管理能力评价均采用中国银河证券基金研究中心的《基金管理人主动股票方向投资管理能力评价（指数法）》和《基金管理人主动债券投资管理能力评价（指数法）》的评价标准及其结果。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价3个自然年度，每个自然年度的权重分别为40%、30%、30%。年度利润评价中利润总额评价与利润率评价权重均为50%。

增量规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。

表5：成长公司奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
1	投资管理能力评价	60	1.1	T年度投资管理能力评价	40	1.1.1	T年度主动股票管理能力评价	80
						1.1.2	T年度主动债券管理能力评价	20
			1.2	T-1年度投资管理能力评价	30	1.2.1	T-1年度主动股票管理能力评价	80
						1.2.2	T-1年度主动债券管理能力评价	20
			1.3	T-2年度投资管理能力评价	30	1.3.1	T-2年度主动股票管理能力评价	80
						1.3.2	T-2年度主动债券管理能力评价	20
2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	40	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	30	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	30	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
3	增量规模评价	20	3.1	T年度参评基金增量规模评价	40	3.1.1	T年度参评基金增量规模评价	40
			3.2	T-1年度参评基金增量规模评价	30	3.2.1	T-1年度参评基金增量规模评价	30
			3.3	T-2年度参评基金增量规模评价	30	3.3.1	T-2年度参评基金增量规模评价	30

6、被动投资基金管理公司奖

评奖理论

本奖项主要是考察基金管理人的股票方向被动管理能力、综合表现以及贡献度的绝对金额。鼓励基金公司建立并不断完善科学系统的被动投资研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培育稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：截止评奖年度年末，管理人被动管理运作时间满3年，其中满1年的股票指数基金产品不少于3只，管理股票指数基金资产规模不低于10亿。参评基金是指股票ETF基金、标准股票指数基金、增强股票指数基金。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度参评的股票ETF基金、标准股票指数基金、增强股票指数基金满足1个月建仓期要求。

获奖公司数量

全市场基金公司数量*5%，如果缺少符合条件的基金公司，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

投资管理能力评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。

被动管理基金产品分股票ETF基金、标准指数股票型基金和增强指数股票型基金三类。ETF评价指标是跟踪误差和流动性指标（季度平均规模）；标准指数评价指标是跟踪误差（80%）

与信息比率（20%）；增强指数评价指标是信息比率（80%）与超额收益（20%）。在自然年度内对上述三类基金评价，三类基金权重分别是70%、20%、10%。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价3个自然年度，每个自然年度的权重分别为40%、30%、30%。年度利润评价中利润总额评价与利润率评价权重均为50%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表6、被动投资基金公司奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
1	被动投资管理能力评价	60	1.1	T年度股票被动管理能力评价	40	1.1.1	T年度股票ETF基金评价	70
						1.1.2	T年度标准指数股票型基金评价	20
						1.1.3	T年度增强指数股票型基金评价	10
			1.2	T-1年度股票被动管理能力评价	30	1.2.1	T-1年度股票ETF基金评价	70
						1.2.2	T-1年度标准指数股票型基金评价	20
						1.2.3	T-1年度增强指数股票型基金评价	10
			1.3	T-2年度股票被动管理能力评价	30	1.3.1	T-2年度股票ETF基金评价	70
						1.3.2	T-2年度标准指数股票型基金评价	20
						1.3.3	T-2年度增强指数股票型基金评价	10
2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	40	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	30	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	30	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	40	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	30	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	30	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50

7、养老投资基金管理人奖

评奖理论

本奖项主要是考察基金管理人的养老投资能力、综合业绩表现以及贡献度的绝对金额。鼓励基金公司建立并不断完善科学系统的养老投资研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培

育稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：截止评奖年度年末，管理人旗下满3年的养老目标基金产品不少于1只。

参评管理人旗下基金参评资格：计算年度满足1个月建仓期要求的养老目标基金。

获奖公司数量

全市场基金公司数量*5%，如果缺少符合条件的基金公司，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

养老投资管理评价对象是养老目标基金，又分为养老目标日期基金和养老目标风险基金。分别计算参评基金管理人旗下养老目标基金在同类型中的业绩排名标准分，多只基金则取算术平均值。目标日期基金与目标风险基金的权重分别为50%、50%。评价三年，T年度（评奖年度）权重为40%、T-1年度为30%、T-2年度为30%。

投资者收益评价采用管理人旗下参评基金利润评价指标，利润评价又区分为利润总额评价与利润率评价两部分，权重分别为50%、50%。评价3个自然年度，T年度、T-1年度、T-2年度的权重分别为40%、30%、30%。年度利润评价中利润总额评价与利润率评价权重均为50%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表7、养老投资管理评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
1	养老投资管理 能力评价	60	1.1	T年度养老投资管理 能力评价	40	1.1.1	T年度同类型养老目标风险基金收 益率排名评价	50
						1.1.2	T年度同类型养老目标日期基金收 益率排名评价	50
			1.2	T-1年度养老投资管理 能力评价	30	1.2.1	T-1年度同类型养老目标风险基金收 益率排名评价	50
						1.2.2	T-1年度同类型养老目标日期基金收 益率排名评价	50
			1.3	T-2年度养老投资管理 能力评价	30	1.3.1	T-2年度同类型养老目标风险基金收 益率排名评价	50
						1.3.2	T-2年度同类型养老目标日期基金收 益率排名评价	50
2	投资者收益评 价	20	2.1	T年度参评基金利润评 价	40	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评 价	30	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评 价	30	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评 价	40	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评 价	30	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评 价	30	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50

8、社会责任投资（ESG）基金管理人奖

评奖理论

本奖项主要是考察基金管理人的社会责任投资情况和投资者收益情况。鼓励基金管理人建立并不断完善科学系统的绿色投资研究方法、投资决策流程和投资管理制度，培育稳健投资、长期投资和理性投资的基本理念，通过成熟稳定的投资风格，创造良好投资业绩，回报投资者的信任。

参评资格

管理人参评资格：截止评奖年度年末，管理人旗下满3年的ESG基金产品不少于1只。

管理人旗下基金参评资格：计算年度满足3个月建仓期要求的ESG基金。

获奖公司数量

全市场基金公司数量*5%，如果缺少符合条件的基金公司，本奖项可少选或者空缺。

方法说明

本奖项旨在评价基金管理人在ESG方向基金的数量、资产规模与持股市值与投资者收益情况。

首先根据中国银河证券基金研究中心的ESG基金业务规则内容，对全市场基金中符合ESG条件的基金标注ESG标签，具体分为环境与低碳基金（ESG-E）、社会责任基金（ESG-S）、公司治理基金（ESG-G）、ESG基金（ESG-ESG）。维护规则是基金名称中含有上述字眼，以及招募说明书本意是ESG方向的，采取人工逐一维护的机制。

其次评价体系分为一级项目社会责任投资能力评价、ESG基金投资者收益评价、规模评价3部分，权重分别是60%、20%、20%。

社会责任投资能力评价，由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度评价组成，权重分别为40%、30%、30%。在自然年度内对参评基金管理人旗下ESG基金的基金数量、基金资产净值、基金持股市值分别计算基金数量标准分、基金资产净值标准分、基金持股市值标准分，权重分别为20%、30%、50%。

ESG基金投资者收益评价，评价3个自然年度，T年度（评奖年度）权重40%、T-1年度权重30%、T-2年度权重30%。对参评基金管理人旗下ESG基金的利润总额、利润率分别计算标准分，权重分别为50%、50%。

规模评价由T年度（评奖年度）、T-1年度、T-2年度合计3个自然年度组成，权重分别为40%、30%、30%。自然年度中由存量规模评价与增量规模评价组成，权重分别为50%、50%。

表8、社会责任投资奖评奖指标体系

一级项目编号	一级项目名称	一级项目权重比例 (%)	二级项目编号	二级项目名称	二级项目权重比例 (%)	三级项目编号	三级项目名称	三级项目权重比例 (%)
1	社会责任投资管理 能力评价	60	1.1	T年度社会责任投资管理 能力评价	40	1.1.1	T年度ESG基金数量 评价	20
						1.1.2	T年度ESG基金资产 净值评价	30
						1.1.3	T年度ESG基金持股 市值评价	50
			1.2	T-1年度社会责任投资管理 能力 评价	30	1.2.1	T-1年度ESG基金数量 评价	20
						1.2.2	T-1年度ESG基金资产 净值评价	30
						1.2.3	T-1年度ESG基金持股 市值评价	50
			1.3	T-2年度社会责任投资管理 能力 评价	30	1.3.1	T-2年度ESG基金数量 评价	20
						1.3.2	T-2年度ESG基金资产 净值评价	30
						1.3.3	T-2年度ESG基金持股 市值评价	50

2	投资者收益评价	20	2.1	T年度参评基金利润评价	40	2.1.1	T年度参评基金利润总额评价	50
						2.1.2	T年度参评基金利润率评价	50
			2.2	T-1年度参评基金利润评价	30	2.2.1	T-1年度参评基金利润总额评价	50
						2.2.2	T-1年度参评基金利润率评价	50
			2.3	T-2年度参评基金利润评价	30	2.3.1	T-2年度参评基金利润总额评价	50
						2.3.2	T-2年度参评基金利润率评价	50
3	规模评价	20	3.1	T年度参评基金规模评价	40	3.1.1	T年度参评基金存量规模评价	50
						3.1.2	T年度参评基金增量规模评价	50
			3.2	T-1年度参评基金规模评价	30	3.2.1	T-1年度参评基金存量规模评价	50
						3.2.2	T-1年度参评基金增量规模评价	50
			3.3	T-2年度参评基金规模评价	30	3.3.1	T-2年度参评基金存量规模评价	50
						3.3.2	T-2年度参评基金增量规模评价	50

金基金-基金产品奖

一、评选宗旨

“金基金产品奖”的评奖原则和方法：遵循长期性、公正性、客观性、一致性、公开性的原则开展评奖活动。评奖采取以定量为主、定性合规评价为辅的原则，突出客观性和公正性。把基金是否忠实履行基金契约、是否具备清晰的投资理念、是否保持稳定鲜明的投资风格、是否具有持续的净值增长能力和良好的风险控制能力等列作重要考核指标。推崇基金风格多样化，在同等业绩的前提下，更加注重较低换手率水平和交易费率的基金。

二、评奖指标和计算方法（理论基础）

“金基金产品奖”的评奖以客观评分（定量）为主，专家的主观评分为辅。专家的主观评分，仅限于相关基金在履行诚信、守约、审慎、勤勉、尽责义务时，或在合规风险控制方面存在瑕疵时，依规则扣减评分。

“金基金产品奖”的各类奖项，针对各类不同基金，形成不同的关注重点。主动型股票基金、偏股型混合基金重点考察基金净值增长水平、风险调整后收益和换手率，力求避免单纯考察基金净值增长、忽视投资风险和交易成本。灵活配置型基金突出业绩表现和资产配置能力，不考察换手率指标。债券基金突出债券部分的投资能力，在考察投资收益的同时，考察净值波动率。此外，三年期基金均增加考察基金下行风险指标，体现长期投资中控制净值风险对于投资者的重要性。

“金基金产品奖”对基金是否忠实履行契约、是否存在高风险操作等危害投资者长期利益的情况予以高度关注。在“上证基金量化评分体系”中设定一定权重，对产品明显偏离契约要求、基金投资存在风险操作的基金，波动率和换手率高且无超额收益的基金，在风险指标中予以关注。

“金基金产品奖”的参考计算指标如下：

基金期间净值增长水平： $R = \left[\prod_{i=1}^n (1 + R_i) \right] - 1$ ，其中n为衡量期间内的有交易的周数。

基金期间风险调整后收益： $Sharpe = \frac{R_i - R_f}{\sigma_i}$ 其中， σ_i 是基金的收益率的标准差； R_f 是无风险收益。

基金净值的期间波动水平： $\sigma_i = \sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^{n_1} (R_i - \bar{R})^2}$ ，其中，n为衡量期间内的有交易的周数； R_i 为第i周的收益率； \bar{R} 为收益率的均值。

基金净值的下行风险：净值增长率低于无风险收益率时的标准差。数值越小越好。

$$DD = \sqrt{\frac{\sum (R_p - R_f)^2}{(n-1)}}, R_p < R_f$$

其中DD为下行风险； R_p 为基金周步长收益率； R_f 为周步长无风险收益率；n为样本数量。

指数基金追踪误差：基金跟踪误差 = $\sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^{n_1} (r_i - R_i)^2} \times 100\%$

r_i ：为基金第i日的收益率；

R_i ：为标的指数的第i日的收益率；

n：为衡量期间内的有交易的天数。

三、金基金产品奖设置奖项

金基金-主动型股票基金奖	(3年期、5年期、7年期、10年期)
金基金-指数基金奖	(3年期、5年期)
金基金-偏股型混合基金奖	(3年期、5年期、7年期)
金基金-灵活配置型基金奖	(3年期、5年期)
金基金-债券基金奖	(3年期、5年期、7年期、10年期)
金基金-分红基金奖	(3年期、5年期)
金基金-沪港深基金奖	(3年期、5年期)
金基金-责任投资 (ESG) 基金奖	(3年期)

四、评分细则

1、范围：只对当年末成立满3年及以上的基金评奖。

2、程序：金基金奖评奖流程为：根据不同基金类别产生相应的综合评分排名，前10%

进入初选范围，经主办方会同技术支持机构根据基金是否忠实契约、是否具备稳定基金投资风格、是否有不合规操作、是否有涉嫌风险操作、是否恪守投资者利益等指标筛选产生“金基金产品奖”的候选名单（不低于2倍获奖基金数），再由“上证基金量化评分体系”产生客观排名，排名靠前者当选“金基金产品奖”。

3、计算：金基金奖采取排名加权法，针对各项指标对同类别基金进行排序，每项指标的排名乘以该项指标权重，加总后得出总分值，最后对总分值进行排序，分数越少，排名越靠前。

4、评分要点

1) 金基金-主动型股票基金奖（3年期、5年期、7年期、10年期）

参评主动型股票基金3年期奖的产品，成立时间不少于三年，期间未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据相关评奖流程产生“主动型股票基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分。

2) 金基金-指数基金奖（3年期、5年期）

指数基金3年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于三年的标准指数基金，未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。指数基金5年期奖参评产品成立时间不少于五年，未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据“上证基金量化评分体系”和相关评奖流程产生“指数基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分。

3) 金基金-偏股型混合基金奖（3年期、5年期、7年期、10年期）

偏股型混合基金3年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于三年，期间未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据“上证基金量化评分体系”和相关评奖流程产生“偏股型混合基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分。

4) 金基金 — 灵活配置型基金奖 (3年期、5年期)

灵活配置型基金奖3年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于三年的灵活配置型基金，期间基金未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。灵活配置型基金5年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于五年，期间未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据相关评奖流程产生“灵活配置型基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分。

5) 金基金-债券基金奖 (3年期、5年期、7年期、10年期)

债券基金3年期奖须符合截至2018年12月31日，成立时间不少于三年，期间未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

债券基金的评奖进行了一定的产品分类，主要分为三类：1、纯债基金2、一级债基和二级债基3、可转债基金

评分方法：根据相关评奖流程产生“债券基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分。

6) 金基金-沪港深基金奖 (3年期、5年期)

沪港深基金奖3年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于三年的沪港深基金，期间基金未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。沪港深基金5年期奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于五年，期间未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据相关评奖流程产生“沪港深基金奖”的候选名单（不低于基金总数10%）。由专家组全面审核基金在忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生主观分。客观分和主观分合并后，根据“上证基金量化评分体系”加权产生总分，各年期排名前5名者为获奖基金。

7) 金基金-责任投资 (ESG) 基金奖 (3年期)

责任投资 (ESG) 基金奖须符合截至评奖上一个年度的12月31日，成立时间不少于三年的相关基金，期间基金未受监管机构监管谈话、警告、处罚等监管事项，并符合“金基金产品奖”相关条款要求。

评分方法：根据相关评奖流程产生“责任投资 (ESG) 基金奖”的候选名单。由相关

专家全面审核基金在责任投资方法、基金投资标的范畴、忠实契约、合规操作、审慎管理风险、勤勉维护投资者利益等方面中是否有瑕疵并产生各项的主观评分。各项分数加总合并后，加权产生总分，排名前5名者为获奖基金。

五、上证基金量化评分体系

“上证基金量化评分体系”遵循长期性原则、客观性原则、一致性原则，对基金的业绩、风控、理念、评分和契约等指标综合评分。

“上证基金量化评分体系”重点考察以下指标：

1、基金投资绩效：主动型基金重点考察中长期累计净值增长指标，风险调整后收益指标；指数基金重点考察年化跟踪误差、费用率；

2、基金公司风险管理能力：其中包括日常风险管理能力（净值年化波动率、下行风险指标）和基金运行合规水平（根据基金年报以及日常考察信息，给予打分）

3、股票投资换手率：（根据最近1年和3年的换手率计算），灵活配置型基金、债券基金不考察换手率。

4、基金的契约责任、投资风格稳定性和理念完备性（根据基金契约考察基金是否符合契约，基金风格是否漂移、是否存在风险操作等）

5、基金的绩效稳定性：尤其是3年期主动型基金，将增加考察基金的下行风险指标

各基金分类评分权重设置：

三年期奖：

主动型股票基金：基金期间净值增长率 30%+基金期间风险调整后收益 30%+基金超越基准收益率 30%+基金净值的下行风险10%

指数基金：基金跟踪误差 60% + 基金规模 40%

偏股型混合基金：基金期间净值增长率 30%+基金期间风险调整后收益 30%+基金超越基准收益率 30%+基金净值的下行风险10%

灵活配置型基金：基金期间净值增长率 40%+基金期间风险调整后收益 50%+基金净值的下行风险10%

债券基金：基金期间净值增长率 40%+基金期间风险调整后收益 50%+基金净值的下行风险10%

沪港深基金：基金期间净值增长率 40%+基金期间风险调整后收益 50%+基金净值的下行风险10%

五年期奖：

评价方法与三年期一致。

七年期奖：

评价方法与三年期、五年期一致。

十年期奖：

评价方法与五年期、七年期一致。

附加调整权重：10%，若基金存在严重偏离契约投资、潜在高风险的投资标的、高风险的投资行为等有违背信托责任、潜在损害持有人利益的风险行为，可依据严重性、中等严重、轻微等情况，允许向下调整其总排名1/10分位、1/20分位或1/50分位。

六、金基金. 投资回报奖

评奖理念

为了反映投资者真实的回报水平，我们以最近3年的基金加权平均利润率与基金利润为核心指标，以各50%的权重加权核定期间的投资者回报综合水平。

加权平均净值利润率是在投资者真实的资本投入基础上计算的，它不仅反应了基金的投资管理能力，也体现了投资者的择时损益。相对于基金收益率，这个指标与广大投资者的真实投资体验更为接近。除了投资者出于自身原因而进行的产品择时，管理人的产品营销理念、对投资者的服务意识以及对市场判断能力也会很大程度上对该指标值产生影响。通过该指标，我们期望能引导管理人在市场疯狂时主动放弃规模扩张的冲动，践行“逆向销售”，为投资者规避不必要的风险。也期望它们在市场极度悲观时，能够不遗余力的帮助投资者坚守长期投资理念，创新投资者陪伴方式，实现投资回报的最大化。

基金利润展现了基金运作期间的盈利水平。它即取决于管理人的资产管理能力，也受其对投资者服务体量的影响。再优秀的产品，若无法为尽可能多的投资者服务，也是无法对整个行业产生实质影响的。

参评资格

不含建仓期，完整运作满三年的主动投资股票基金、偏股混合基金、灵活配置基金；

最近一年单一持有人集中度不高于50%；

最近一年基金平均资产规模以及最近一期资产规模均不低于2亿元；

三年收益率必须超越业绩比较基准。

获奖公司数量

全市场基金公司数量*5%，如果缺少符合条件的基金公司，本奖项可少选或者空缺。

算法与指标说明

对投资者在基金投资过程中的综合回报水平，从以下两个角度考察。

指标名称	指标说明	权重
加权平均净值利润率	基于投资者真实的资本投入所获得的报酬水平。	50%
基金利润	基金为投资者创造的实际收益。	50%

1、加权平均净值利润率

$$\text{加权平均净值利润率: } WR = \frac{P}{NAV_0 + \sum_{i=1}^n \Delta NAV_i \times (n-i) / n}$$

其中：

P为本期基金净收益；

NAV_0 为期初基金资产净值；

n为报告期内所含交易天数；

i为报告期内的第i个交易日；

$\Delta NAV_i = i$ 交易日基金资产净值 - (i-1) 交易日基金资产净值。

$$\text{三年加权平均净值利润率} = \prod_{t=1}^3 (1 + WR_t) * W_t - 1$$

其中：

WR_t 为t年加权平均净值利润率

W_t 为t年平均资产净值占最近三年平均资产净值之和的权重

2、基金利润

$$\text{三年基金利润} = \sum_{t=1}^3 \text{基金利润}_t$$

四、奖项评定

A. 候选基金必须同时满足：

- 1、三年加权平均净值利润率同类排名在前1/3
- 2、最近一年的加权平均净值利润率同类排名在前1/2
- 3、三年综合总得分处于同类前列

B. 参考条件：

对考核期内单个年份加权平均净值利润率处于同类后1/3的产品谨慎评奖。

3、基金（基金管理公司）评级或评奖的程序和发布方式。

(1)评奖程序

金基金各奖项评选步骤

第一步，按照参评基金资格认定各项规定进行筛选，并按照“金基金奖分类体系”各类别参选基金名单。

第二步，根据不同类别参选基金数量，按照获奖名额设置标准，确定各类基金获奖只数。

第三步，依据金基金奖评选方法和评价指标体系，对参评基金进行定量评价。第

第四步，根据定量评价的结果，计算每只基金的综合得分，并据此评出各个类别中的优秀基金。

第五步，对初选结果进行校验和复审，并最终确定获奖名单。

“金基金”管理公司及各专项奖评选步骤

第一步，依据资格认定的标准对基金管理公司进行筛选，形成参选基金管理公司名单。

第二步，依据金基金奖评选方法和评价指标体系，对于入选基金管理公司，进行定量和定性评价。其中事先通过定量评价得分排序对参评基金公司进行筛选，仅对其中排名前 30%的基金公司进行定性评价。

第三步，根据定量定性评价结果，计算每家基金管理公司综合得分，并据此初选选出分数居前的基金管理公司。

第四步，对初选结果进行校验和复审，并最终确定各奖项获奖名单。

评奖业务整体流程：

①数据采集：

建立严格的数据采集和复核制度，由专人负责对采集数据的复核，确保相关数据的准确性、可靠性、完整性。

②数据分析：

根据《“金基金奖”评选规则》确定的评选步骤、筛选条件和评价指标体系进行评选，审核与风控重点是保证主协办机构严格执行《“金基金奖”评选规则》的规定，按统一框架评分。

③评奖结果的审核与发布：

评奖结果发布设置了严格的校正和复核程序，由主协办机构共同进行比对校验。复核内容包括：基金名称、基金分类、基金参评资格、基金业绩与规模等方面的数据、基金定期报告中与评奖有关的内容等。

④评奖标准、方法和作业程序的检讨评估制度及信息披露：

结合市场和行业变化情况，每年对评选办法进行回顾。如有必要，在保证整个评选体系稳定性的前提下，进行适当的微调，并按有关规定报批后调整。审核与风控重点是评奖标准、方法和作业程序的调整变化是否合理合规，并及时进行信息披露。

(2)发布方式

上海证券报关于“金基金奖”评奖结果的发布制度和程序具体如下：

上海证券报主办的“金基金奖”评奖结果的发布渠道和方式主要是通过上海证券报、中国证券网（<http://www.cnstock.com/>）及协办机构的网站，同时也邀请相关协作媒体及协作网站协助发布。

“金基金奖”每年度进行一次评选，评奖结果发布时间为完成评选及校正复核等程序后的第一个工作日；

“金基金奖”评选结果由主办机构发布，参与评选活动的基金评价人员不得以个人名义发布。

“金基金奖”评选结果在正式发布前，参与评选活动的基金评价机构与人员不得向外界透露评选结果。

4、为避免与评级或评奖对象产生利益冲突采取的措施。

上海证券报与基金管理公司及基金销售机构之间存在业务往来，但这并不影响报社新闻报道业务及基金评奖业务的客观性独立性。

“金基金奖”这一品牌对于上海证券报而言，其意义与价值在于牢固树立了上海证券报在中国基金业权威公正专业的形象。该评奖活动自设立以来始终坚持非盈利路线，贯彻了公开、公平、公正的评选原则，得到了基金行业及监管部门的高度认可。

为了进一步维护上海证券报权威主流媒体的品牌形象，保证“金基金奖”评选活动的客观性独立性，上海证券报建立健全了相应的具有“防火墙”作用的制度保障措施。

一是依据《上海证券报基金评奖业务管理与内控制度》，在自身基金评奖部门和经营部门之间建立了“防火墙”制度，在人员、业务、考核、物理空间等方面均实现了隔离。

由此通过自身基金评奖部门和经营部门之间的隔离，实现了报社基金评奖部门与基金管理公司及基金销售机构之间的隔离，保证其独立性客观性。

二是严格规定，上海证券报的“金基金奖”评选活动是非盈利性的，不与经营挂钩，评选活动经费由报社统一划拨；“金基金奖”评选坚持客观独立的立场，不得因经营部门或客户的不当要求改变评选结果；坚持中立的立场，公平对待所有的参评对象，不得因评选对象在报社投入的广告资源或信披资源的多少而差别对待；相关人员不得利用基金评奖业务活动向评价对象索取任何形式的好处或利益。

同时，“金基金奖”还通过合理的评选机构设置和评选流程管理，保证评选结果的客观公正。

一是评选工作组由主办机构上海证券报社，协办机构中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、晨星资讯（深圳）有限公司的相关专业人员共同组成。通过严格的评选流程管理，保证各协办机构按照《“金基金奖”评选规则》规定的评选方法和评选框架，在同一平台下展开评选工作，并对各自计算的初评

结果相互验证相互比对，确保更准确地反映评价对象的真实情况。

二是“金基金奖”自创立以来，一直坚持执行评奖标准、方法和作业程序的检讨评估制度。每年度召集1次评选工作小组会议，由主协办机构共同参加，结合中国基金业新的发展形势及相关问题，对评奖标准、方法和作业程序进行检讨评估，并依据检讨评估结果决定是否需要做出必要的调整和改进。

(四) 关联关系

1、同一股东持有基金评价机构、基金管理公司的股份均达到5%以上的，应披露该股东单位名称、持有的基金评价机构名称及股份、持有的基金管理公司名称及股份；

无。

2、本机构持有基金管理公司的股份达到5%以上，应披露基金管理公司名称及股份；

无。

3、本机构销售基金产品的，应披露签署了基金产品销售协议的基金管理公司名单及销售的基金产品数量；

无。

4、本机构为基金管理公司提供证券投资咨询服务或销售信息产品且获得收入的，应披露基金管理公司名称及服务内容；

无。

5、本机构为基金管理公司提供证券买卖交易席位及交易单元的，应披露基金管理公司名称；

无。

6、本机构有评价人员担任基金管理公司职务的，应披露基金管理公司名称和职务；

无。

7、本机构为基金管理公司提供信息披露和宣传栏目的，应披露基金管理公司名称，信息披露或宣传栏目内容。

上海证券报是中国证监会指定信息披露媒体，为以下140家基金公司提供信息披露服务：

安信基金管理有限责任公司、宝盈基金管理有限责任公司、北信瑞丰基金管理有限责任公司、博时基金管理有限责任公司、渤海汇金基金管理有限责任公司、财通基金管理有限责任公司、创金合信基金管理有限责任公司、淳厚基金管理有限责任公司、大成基金管理有限责任公司、德邦基金管理有限责任公司、东方阿尔法基金管理有限责任公司、东方基金管理有限责任公司、东海基金管理有限责任公司、东吴基金管理有限责任公司、方正富邦基金管理有限责任公司、蜂巢基金管理有限责任公司、富安达基金管理有限责任公司、富国基金管理有限责任公司、富荣基金管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限责任公司、光大保德信基金管理有限责任公司、

广发基金管理有限责任公司、国海富兰克林基金管理有限责任公司、国金基金管理有限责任公司、国开泰富基金管理有限责任公司、国联安基金管理有限责任公司、国融基金管理有限责任公司、国寿安保基金管理有限责任公司、国泰基金管理有限责任公司、国投瑞银基金管理有限责任公司、海富通基金管理有限责任公司、恒生前海基金管理有限责任公司、恒越基金管理有限责任公司、弘毅远方基金管理有限责任公司、红塔红土基金管理有限责任公司、红土创新、泓德基金管理有限责任公司、华安基金管理有限责任公司、华宝基金管理有限责任公司、华宸未来基金管理有限责任公司、华富基金管理有限责任公司、华润元大基金管理有限责任公司、华商基金管理有限责任公司、华泰柏瑞基金管理有限责任公司、华泰保兴基金管理有限责任公司、华夏基金管理有限责任公司、汇安基金管理有限责任公司、汇丰晋信基金管理有限责任公司、汇添富基金管理有限责任公司、嘉合基金管理有限责任公司、嘉实基金管理有限责任公司、建信基金管理有限责任公司、交银施罗德基金管理有限责任公司、金信基金管理有限责任公司、金鹰基金管理有限责任公司、金元顺安基金管理有限责任公司、景顺长城基金管理有限责任公司、九泰基金管理有限责任公司、凯石基金管理有限责任公司、民生加银基金管理有限责任公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限责任公司、南方基金管理有限责任公司、南华基金管理有限责任公司、农银汇理基金管理有限责任公司、诺安基金管理有限责任公司、诺德基金管理有限责任公司、鹏华基金管理有限责任公司、鹏扬基金管理有限责任公司、平安基金管理有限责任公司、浦银安盛基金管理有限责任公司、前海开源基金管理有限责任公司、融通基金管理有限责任公司、睿远基金管理有限责任公司、上投摩根基金管理有限责任公司、上银基金管理有限责任公司、申万菱信基金管理有限责任公司、太平基金（原中原英石）基金管理有限责任公司、泰达宏利基金管理有限责任公司、泰信基金管理有限责任公司、天弘基金管理有限责任公司、天治基金管理有限责任公司、万家基金管理有限责任公司、西部利得基金管理有限责任公司、先锋基金管理有限责任公司、新华基金管理有限责任公司、新疆前海联合基金管理有限公司、新沃基金管理有限责任公司、鑫元基金管理有限责任公司、信达澳银基金管理有限责任公司、兴证全球基金管理有限责任公司、兴业基金管理有限责任公司、兴银基金（原华福基金）管理有限责任公司、易方达基金管理有限责任公司、益民基金管理有限责任公司、银河基金管理有限责任公司、银华基金管理有限责任公司、英大基金管理有限责任公司、永赢基金管理有限责任公司、圆信永丰基金管理有限责任公司、长安基金管理有限责任公司、长城基金管理有限责任公司、长盛基金管理有限责任公司、长信基金管理有限责任公司、招商基金管理有限责任公司、浙商基金管理有限责任公司、中庚基金管理有限责任公司、中海基金管理有限责任公司、中航基金管理有限责任公司、中加基金管理有限责任公司、中金基金管理有限责任公司、中科沃土基金管理有限责任公司、中欧基金管理有限责任公司、中融基金管理有限责任公司、中信保诚基金（原信诚基金）管理有限责任公司、中信建投基金管理有限责任公司、中银基金管理有限责任公司、中邮创业基金管理有限责任公司、朱雀基金管理有限责任公司、华融基金管理有限责任公司、达诚基金管理有限公司、东兴基金管理有限公司、

瑞达基金管理有限公司、兴华基金管理有限公司、民生基金管理有限公司、汇泉基金管理有限公司、尚正基金管理有限公司、百嘉基金管理有限公司、贝莱德基金管理有限公司、路博迈基金管理(中国)有限公司、兴合基金管理有限公司、泰康基金管理有限公司、泉果基金管理有限公司。

上海证券报为以上基金公司提供的信息披露内容主要包括基金募集信息披露、基金运作信息披露和临时信息披露三大部分。

8、本机构认为应该披露的其他关联关系。

无。

上海证券报社

2021年12月31日