

证券时报“中国基金业明星基金奖”评奖方案

一、基本情况

Table with 2 columns: 机构基本情况表, 基金评价业务开始时间, 基金评价业务范围, 基金评价结果发布渠道, 联系电话

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

Table with 3 columns: 基金评价从业人员情况表, 姓名, 执业资格证书编号, 主要从业经历

三、基金评价业务情况

2、基金(基金管理公司)评奖的情况

1)基金(基金管理公司)评奖基本情况

(1)、评奖概要

奖项名称:中国基金业明星基金奖

主办方:证券时报社

数据支持单位:晨星资讯(深圳)有限公司

(2)、审核与评选的方式

评选的组织机构:

本评选的组织机构由评选工作小组、数据支持机构和专家委员会组成。

评选的方式:

首先由评选工作小组、数据支持机构和专家委员会共同确定评奖规则及方法,其次由数据支持机构提供数据并根据评奖规则进行统计计算,最后由基金评选工作小组根据数据支持机构的计算结果确定获奖名单。

(3)、评选宗旨

本评选的宗旨是从保护投资者利益角度出发,为投资者选择基金公司和投资基金产品提供有价值的参考;促进投资者教育工作的开展,引导投资者形成长期、理性的投资理念;鼓励和倡导基金公司将投资者利益放在第一位,为投资者提供符合产品风险收益特征的长期、稳健、持续的业绩回报;引导基金行业形成严格遵守契约、充分履行信托责任的诚信文化,促进基金业长期健康发展。

(4)、参选基本条件

单只基金奖项参选基本条件

参选的基金须符合监管机构相关规定,并且符合以下条件:

1)根据公开法定信息,评奖期内参评的基金没有受到监管部门处罚,未出现重大工作失误;

2)根据公开法定信息,评奖期内任何未能遵守其契约的基金不得参与评选;

3)根据公开法定信息,评奖期内在运作过程中明显违背其产品基本特征和概念的基金不得参评。

基金公司奖项参选基本条件

参选的基金公司须符合监管机构相关规定,并且符合以下条件:

1)根据公开法定信息,当年参评的基金公司没有受到监管部门处罚,没有出现老鼠仓、不公平交易、利益输送等重大违规行为,旗下基金没有出现过违背契约的行为;

2)根据公开法定信息,当年参评的基金公司没有因损害投资者利益等情况涉及法律纠纷。

3)根据公开法定信息,在参评年度内,发生总经理变动,并且不少于1名副总经理或督察长变动的基金公司不参评基金公司奖。

6)、奖项设置和名额

Table with 3 columns: 奖项名称, 涉及基金类型, 获奖名额

2)基金(基金管理公司)评奖的理论基础、应用的指标体系和办法。

1、单只基金奖

单只基金奖分为一年期明星基金奖、三年持续回报明星基金奖、五年持续回报明星基金奖。

一年期明星基金奖评奖方法(股票型、积极混合、平衡混合、积极债券、普通债券)

在符合参选条件和基金分类的基础上,我们根据基金的信息比率、夏普比率、詹森指数和下行风险共四方面,综合考虑某只基金在同类型基金中的表现,四者的权重分别为40%、30%、20%和10%。

Table with 3 columns: 评价衡量指标, 指标意义, 标准分占权重

Table with 3 columns: 评价衡量指标, 指标意义, 标准分占权重

具体计算流程如下:

第一步:确定参选基金。

按照基金契约,提取所有符合基金契约规定的基金,剔除不符合基金契约规定的基金。

第二步:公式与计算方法

按照如下公式计算基金评价得分(基金评价得分=18),其中:CSp为基金评价得分,CSp为基金评价得分。

(1)基金评价得分计算公式:CSp = 18 * (1 - 0.1 * (1 - CS))

(2)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(3)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(4)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(5)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(6)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(7)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(8)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(9)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(10)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(11)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(12)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(13)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(14)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(15)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(16)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(17)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(18)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(19)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(20)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(21)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(22)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(23)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(24)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(25)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(26)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(27)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(28)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(29)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(30)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(31)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(32)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(33)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(34)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(35)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(36)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(37)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(38)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(39)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(40)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(41)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(42)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(43)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(44)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(45)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(46)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(47)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(48)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(49)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(50)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

(51)基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

基金评价得分计算公式:CS = 1 / (1 + 0.01 * (1 - CS))

只有5只、7只和7只,都不足10只,没有达到证监会对基金评奖所要求的每类基金数量底线,因此暂时不予评奖。

货币市场基金主要作为市场的流动性管理工具,暂时不予评奖。创新型基金不具有可比性,暂时不予评奖。

带有特殊策略的基金如生命周期类基金、绝对回报类基金将从相应类别中独立出来,由于数量有限暂时不予评奖。

IV、基金评奖的数据支持

本评选所需的数据,由数据支持方(晨星资讯公司)利用自己的数据库加上其它基金公开信息进行统计计算,基金评价小组对计算结果进行复核,确定无差异后再予采用。

作为国际著名的专业基金评价机构,晨星资讯公司凭借丰富的基金评价经验和强大的数据处理能力,参与了本次评选活动。指标选取以及数据计算等一系列工作,为本次评选提供专家支持。晨星资讯公司具有五年以上中国基金评级经验,数据完整可靠,专业基金评级机构的充分参与与增强了证券时报基金评奖工作的专业性和客观性。

2009年度中国基金业明星基金奖获奖名单(排名不分先后)

2009年度十大明星基金公司: 银华基金 兴业全球基金 国泰基金 广发基金 鹏华基金 汇丰晋信基金 中邮创业基金 光大保德信基金 新华基金 银河基金 2009年度三年持续回报股票型明星基金奖 兴业全球视野 博时主题行业 富兰克林海弹性市值 交银施罗德成长 华宝兴业先进成长 汇丰晋信龙腾 2009年度三年持续回报积极混合型明星基金奖 华夏大盘精选 华夏红利 中银中国精选 摩根士丹利华鑫资源优选 国泰金龙行业精选 2009年度三年持续回报平衡混合型明星基金奖 博时平衡配置 银河稳健 华夏经典配置 2009年度股票型明星基金奖 银华价值优选 兴业社会责任 新华优选成长 银华领先策略 华商盛世成长 国泰金牛创新 光大保德信新增长 银华富裕主题 华夏复兴

2009年度积极混合型明星基金奖 新华优选分红 富国天瑞强势地区精选 东方精选 国泰金马稳健回报 国泰金鹏蓝筹价值

2009年度平衡混合型明星基金奖 富国天成红利灵活配置 诺安灵活配置 华宝兴业宝康灵活配置 汇丰晋信动态策略

2009年度积极债券型明星基金奖 鹏华丰收 银华增强收益 2009年度普通债券型明星基金奖 中银稳健增利 银河信添利

3、基金(基金管理公司)评奖或评奖的程序和发布方式。1)评奖程序

本报明星基金评奖的方式主要采取基金评选小组和专家委员会一起确立评奖规则,数据支持单位按照评奖规则进行相应指标计算,本报评奖小组根据数据支持单位提供的计算结果直接确定获奖名单。具体评奖程序如下:

第一,在每个自然年度结束后,本报评选工作小组负责联系业内有关专家,在前一年的基础上做适当微调后确定专家评审委员会名单;

第二,征求专家委员会的意见和倡议,结合基金公司和业内的反馈意见,决定是否对评奖规则进行调整。如果进行调整,将按照证监会和证券业协会的有关规定上报审批;

第三,在确定好评奖规则后,确定具备参选条件的基金和基金公司,向数据支持单位发送评奖指标计算指令,数据支持单位进行计算。本报利用自有数据库同步进行计算;

第四,数据支持单位向本报评奖小组提供各个指标计算结果,在和本报计算结果核对无误后。本报评奖小组和数据支持单位同时根据评奖规则进行综合计算,产生各个奖项的获奖名单;

第五,本报评奖小组提供的获奖名单和数据支持单位提供的获奖名单进行对照,确保获奖名单的准确和一致;

第六,经复核无误后,本报通过报纸、官方网站和其他合作门户网站同时对外公布评奖结果、评奖方案、重要计算过程。

2)发布方式

本报“中国基金业明星基金奖”评选结果将公开在报纸、网络和通过短信发布,同时还将在颁奖典礼上再次发布。

报纸方面“中国基金业明星基金奖”评选结果在《证券时报》头版上发布,同时还将在《中国基金》周刊上推出获奖名单的系列采访报道。

网站方面“中国基金业明星基金奖”的评选结果在证券时报网站和国内主要财经和门户网站进行发布,证券时报网站均会对获奖名单做深入报道。

短信方面“中国基金业明星基金奖”的评选结果以彩信方式通知各参评公司。

4、为避免与评级或评奖对象产生利益冲突采取的措施。本报的基金评奖从制度设计和执行制度两个方面防范与评奖对象的利益冲突;制度设计上,本评选的基础数据提供、组织机构、评选流程、人员管理四个方面的设计可以有效防范与评奖对象间的利益冲突,在执行中严格按照操作规范执行。

1)评奖的方式客观公正

本报“中国基金业明星基金奖”采用的基础数据统计由第三方机构——晨星资讯(深圳)有限公司提供,本报基金数据库进行复核检查;本报评选工作小组和专家委员会负责评奖规则的制定和完善;获奖名单是在数据提供方的基础上,按照既定的评奖规则直接产生的,这种制度设计从根本上保证了评选结果的客观、真实、可靠、公正和可核查性。

2)评奖的组织机构健全

本报“中国基金业明星基金奖”设立三个执行机构:评选工作小组,负责评选的规则制定、日常事务和组织工作,成员由证券时报相关人员组成;

数据支持机构:为整个评奖活动提供基础数据;

评选专家委员会:由一线基金投资和研究人员组成,担任基金评奖规则的专家咨询顾问角色,并监督评奖的过程。其成员主要来自银行基金托管部门、保险公司的投资机构、券商研究机构、基金评价机构、券商FOF管理机构等相关部门负责人或研究人员组成,这个评奖工作的三层组织结构可以保证“中国基金业明星基金奖”结果的客观和独立性。

3)评奖的人员独立

本报实行“中国基金业明星基金奖”的相关业务人员与本报商业经营业务的人员严格分开的制度,评奖业务人员的工作绩效考核严格独立于经营工作业务考核,两类工作考核无任何关联。

4)评奖结果直接产生于客观数据

本报“中国基金业明星基金奖”的评奖结果取决于评奖规则和基础数据,在评奖规则和基础数据确定的情况下,就无法更改地决定了最终的评奖结果,此评选制度最大程度减少了主观因素的影响。

四、关联关系

本机构为基金管理机构提供信息披露和宣传栏目,应披露基金管理机构名称、信息披露或宣传栏目内容。

本报是证监会指定信息披露媒体,为以下60家基金公司提供信息披露服务:

宝盈基金、博时基金、长城基金、长盛基金、长信基金、大成基金、东方基金、东吴基金、富国基金、工银瑞信基金、光大保德信基金、广发基金、国海富兰克林基金、国联安基金、国泰基金、国投瑞银基金、海富通基金、华安基金、华宝兴业基金、华富基金、华商基金、华夏基金、汇丰晋信基金、汇添富基金、嘉实基金、建信基金、交银施罗德基金、金鹰基金、金元比联基金、景顺长城基金、民生加银基金、摩根士丹利华鑫基金、南方基金、农银汇理基金、诺安基金、诺德基金、鹏华基金、浦银安盛基金、融通基金、上投摩根基金、申万巴黎基金、泰达宏利基金、泰信基金、天弘基金、天治基金、万家基金、新华基金、信达澳银基金、兴业全球基金、易方达基金、益民基金、银河基金、银华基金、华泰柏瑞基金、招商基金、中海基金、中欧基金、中银基金、中邮创业基金。

本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。

三年持续回报明星基金奖评奖方法(股票型、积极混合、平衡混合)

通过综合考察基金的长期回报能力、业绩稳定性等方面因素设定筛选条件来评出这一奖项,筛选条件如下:

表4 三年持续回报明星基金奖评奖方法(股票型、积极混合、平衡混合)

Table with 2 columns: 序号, 筛选条件

具体计算流程如下:

第一步 确定参选基金:按照分类方法,提取所有截至当年底成立满三年的基金,剔除评奖期内不符合参选条件的基金,共M只;

第二步 按照上述方法和公式(一年期评奖方法),计算出各只基金在同类型基金中过去三年每年的综合得分CSp;

第三步 按照上述方法和公式(一年期评奖方法),计算出各只基金在同类型基金中过去三年累计的综合得分CSp;

第四步 根据表格4设定的筛选条件,选出各类型基金中同时满足三个条件的基金,授予三年持续回报明星基金奖。

五年持续回报明星基金奖评奖方法(股票型、积极混合、平衡混合)

通过综合考察基金的长期回报能力、业绩稳定性等方面因素设定筛选条件来评出这一奖项,筛选条件如下:

表5 五年持续回报明星基金奖评奖方法(股票