

基金大额交易分析

第一层因子

11 巨额赎回

12 超额申购

第二层因子

21 分级基金

22 非分级基金

第三层因子

31 货币类基金

32 非货币类基金

第四层因子

41 单份额基金巨额赎回

42 基金巨额赎回

43 基金超额申购

TA-决策层

51 赎回费归基金资产过高

52 超巨额赎回时赎回款利息过高

53 超过集中度限制

54 无影响

FA-决策层

61 FA计提基金相关费用过高

62 基金7日可变现资产不满足

63 基金估值跟市值偏差大

64 无影响

FM-决策层

71 基金存在流通性差债券或股票

72 下一个交易日持仓股票/债券可能暴跌

73 无影响

结果

1 净值下一个交易日无剧烈波动

2 净值下一个交易日剧烈波动

3 万份收益下一个交易日剧烈波动

4 万份收益下一个交易日无剧烈波动

5 剩余份额持有人利益受损

6 剩余份额持有人利益不受损

7 基金赎回款无法支付

8 基金流动性风险

解决方案

1 交易正常处理

2 交易撤单

3 交易申请比例确认

4 赎回款项延期支付

5 公司自有资金申购提高流动性

6 调整基金估值方法

7 高位数净值确认