

MSCI 推出新一代股票因子模型

模型增加了最新的拥挤度、机器学习和可持续发展因子

纽约, 2022 年 6 月 15 日 – 为全球投资界提供关键决策支持工具和服务的领先提供商 MSCI Inc. (纽约证券交易所代码: MSCI), 今天宣布推出新一代 [MSCI 股票因子模型](#)。

这些模型旨在帮助机构投资者更好地了解随着市场条件变化而驱动投资组合风险和绩效的因子; 这些模型具有三个新的因子:

- 可持续发展因子包括 ESG 因子和碳效率因子, 后者衡量公司相对于其规模的排放量
- 拥挤度因子使用多种方法来评估股票相对于其自身历史是如何定价的
- 机器学习因子利用数据科学和自然语言处理来评估影响股票回报的不同变量之间的关系

最新股票模型基于 MSCI 长达 50 年的因子研究经验开发, 并且考虑了一些世界上大型的机构投资者的咨询意见。新模型让机构投资者在新加的和已经熟悉的因子维度上构建投资组合; 对行业同行和基准进行比较; 通过改进 IPO 处理, 扩大覆盖范围和动态行业风险分析, 来提高投资组合的透明度。

四个新模型包括 MSCI 全球股票因子模型和 MSCI 美国股票因子模型, 它们是针对长期投资者设计的。MSCI 全球股票因子交易模型和 MSCI 美国股票因子交易模型则适用于管理投资期限相对较短的策略投资者。新模型将通过多种渠道提供, 包括 Snowflake 的数据云, 指定第三方合作伙伴, 以及直接通过 MSCI 自有的 Barra Portfolio Manager 和 BarraOne® 平台。

新的 MSCI 股票因子模型还评估了合并前的特殊目的收购公司 (SPAC), 扩大了投资者的投资机会集, 并改进了一些现有因子的计算方式。

MSCI 股票投资组合管理和股票因子模型主管 Mark Carver 表示: “投资者一再告诉我们, 这些模型中的新风险衡量指标, 加上可持续性因子的引入, 对于不断发展的投资环境至关重要。我们非常高兴能够引入这些创新因子模型, 并相信它们能让客户更好地了解其投资组合风险和回报的驱动因素, 构建差异化的投资组合, 并高效响应不断变化的市场动态。”

-完-

关于 MSCI

MSCI 是全球领先的投资决策支援工具和服务供应商。我们在研究、资料和技术方面拥有超过 50 年的专业知识, 致力帮助客户理解及分析风险和回报的关键驱动因素, 建立更有效的投资组合, 从而实现更好

的投资决策。我们开发了行业领先的研究增强型解决方案，让客户洞悉并提高投资过程的透明度。如欲了解更多信息，请浏览 www.msci.com。

媒体查询

MSCI
Terry LEE
Terry.Lee@msci.com

哲基杰讯

北京

Sissi FENG 冯程程
sissi.feng@citigatedewerogerson.com
+86 10 6567 5061

上海

Maggie XU 许丛一
maggie.xu@citigatedewerogerson.com
+86 21 6391 2177

Kathryn TSE 谢瑶珧
kathryn.tse@citigatedewerogerson.com
+86 10 6567 7550

Christine ZHANG 张雨嫣
christine.zhang@citigatedewerogerson.com
+86 21 3311 0263

MSCI全球客户服务部

clientservice@msci.com

欧洲、中东及非洲地区

+44 20 7618.2222

美洲地区

+1 888 588 4567

亚太地区

+852 2844 9333

The information contained herein (the "Information") may not be reproduced or disseminated in whole or in part without prior written permission from MSCI. The Information may not be used to verify or correct other data, to create any derivative works, to create indexes, risk models, or analytics, or in connection with issuing, offering, sponsoring, managing or marketing any securities, portfolios, financial products or other investment vehicles. Historical data and analysis should not be taken as an indication or guarantee of any future performance, analysis, forecast or prediction. None of the Information or MSCI index or other product or service constitutes an offer to buy or sell, or a promotion or recommendation of, any security, financial instrument or product or trading strategy. Further, none of the Information or any MSCI index is intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such. The Information is provided "as is" and the user of the Information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the Information. NONE OF MSCI INC. OR ANY OF ITS SUBSIDIARIES OR ITS OR THEIR DIRECT OR INDIRECT SUPPLIERS OR ANY THIRD PARTY INVOLVED IN MAKING OR COMPILING THE INFORMATION (EACH, AN "INFORMATION PROVIDER") MAKES ANY WARRANTIES OR REPRESENTATIONS AND, TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, EACH INFORMATION PROVIDER HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING WARRANTIES OF MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING AND TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, IN NO EVENT SHALL ANY OF THE INFORMATION PROVIDERS HAVE ANY LIABILITY REGARDING ANY OF THE INFORMATION FOR ANY DIRECT, INDIRECT, SPECIAL, PUNITIVE, CONSEQUENTIAL (INCLUDING LOST PROFITS) OR ANY OTHER DAMAGES EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES. The foregoing shall not exclude or limit any liability that may not by applicable law be excluded or limited. Privacy notice: For information about how MSCI collects and uses personal data, please refer to our Privacy Notice at <https://www.msci.com/privacy-pledge>.