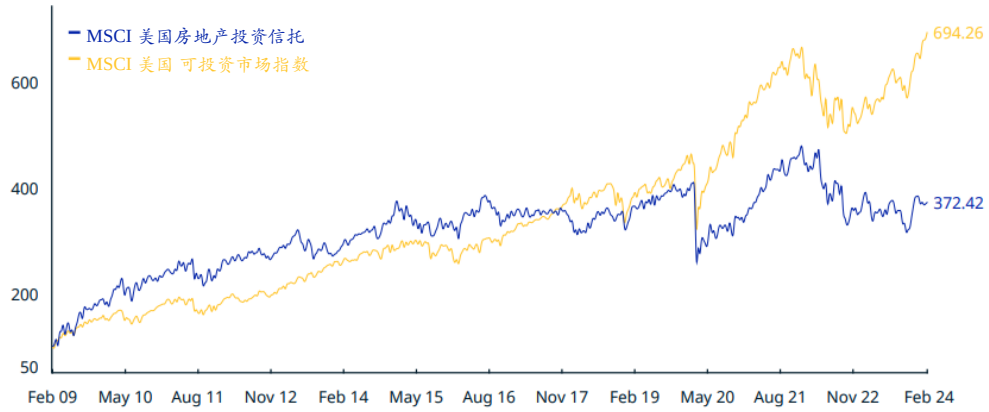
MSCI美国房地产投资信托指数（美元）

MSCI美国房地产投资信托指数是由股票房地产投资信托（REIT）组成的自由流通调整市值加权指数。该指数基于母指数MSCI 美国可投资市场指数（IMI），母指数涵盖美国市场的大盘股、中盘股和小盘股。该指数代表约99%的美国房地产投资信托投资样本空间，成分股是根据全球行业分类标准（GICS®）分类至股票房地产投资信托行业（在房地产板块内）、具有核心房地产敞口（即特种房地产投资信托中只有部分符合资格）且拥有房地产投资信托税务地位的证券。

累计指数表现—价格收益（美元）
（2009年2月至2024年 2月）



年度表现(%)

年份	MSCI美国房地产投资信托指数	MSCI 美国可投资市场指数
2023	8.96	24.21
2022	-27.33	-20.51
2021	38.77	24.43
2020	-11.11	18.99
2019	20.94	28.63
2018	-8.64	-6.97
2017	0.86	18.97
2016	4.22	10.31
2015	-1.51	-1.36
2014	25.28	10.36
2013	-1.39	30.74
2012	13.56	13.90
2011	4.71	-0.75
2010	23.53	14.99

指数表现—价格收益 (%)（2024年2月29日）

	1个月	3个月	1年	年初至今	年化 3年	年化 5年	年化 10年	年化 2005年6月17日以来
MSCI美国房地产投资信托指数	1.82	6.28	1.11	-2.51	1.03	0.54	2.28	2.09
MSCI 美国可投资市场指数	5.21	11.75	26.63	6.25	8.43	12.25	10.14	8.08

基本面数据（2024年2月29日）

	股息收益率(%)	市盈率	远期市盈率	市净率
MSCI美国房地产投资信托指数	4.13	38.94	38.32	2.02
MSCI 美国可投资市场指数	1.40	26.18	20.88	4.29

指数风险及回报指标（2024年2月29日）

	换手率(%)[1]	年化标准差（%）[2] 3年	年化标准差（%）[2] 5年	年化标准差（%）[2] 10年	夏普比率[2,3] 3年	夏普比率[2,3] 5年	夏普比率[2,3] 10年	夏普比率[2,3] 2005年6月17日以来	最大回撤率 (%)	最大回撤率 期间（年年年年/月月/日日）
MSCI美国房地产投资信托指数	2.17	21.29	20.93	17.98	0.04	0.04	0.14	0.14	76.67	2007/02/07 – 2009/03/06
MSCI 美国可投资市场指数	1.84	17.90	18.94	15.62	0.41	0.60	0.61	0.48	56.67	2007/10/09 – 2009/03/09

[1] 过去12个月　[2] 基于月度价格收益数据　[3] 基于洲际交易所1个月LIBOR

MSCI美国房地产投资信托指数于2005年6月20日发布。发布日期前的数据为回测数据（即计算指数在存续期前可能的市场表现）。回测数据经常会与实际数据存在误差。过去的市场表现——无论是实际数据或回测数据——均不能表明或保证未来市场表现。

指数指标

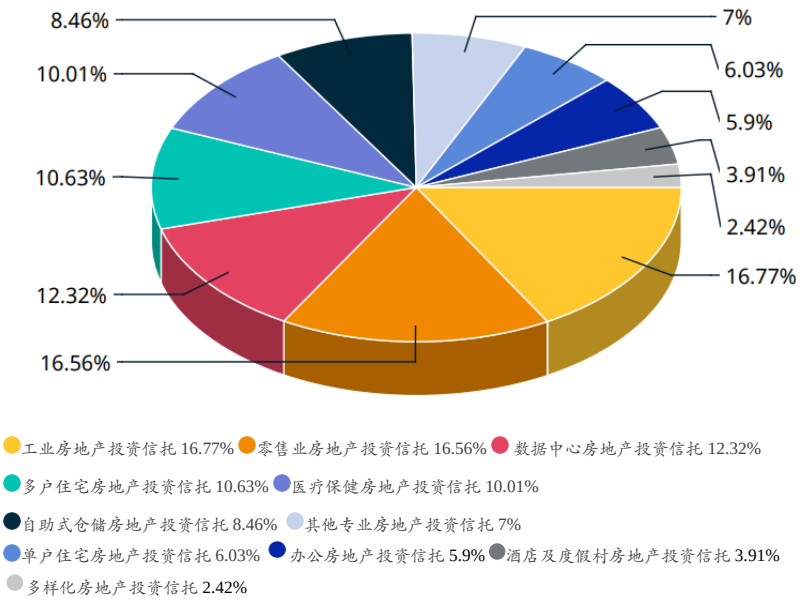
	MSCI美国房地产投资信托
成分股个数	118

	市值（百万美元）
指数	1,035,321.41
最高	123,123.09
最低	258.71
平均	8,773.91
中位数	2,911.25

前十大权重股

	自由流通调整市值（十亿美元）	指数权重(%)
PROLOGIS	123.12	11.89
EQUINIX	83.16	8.03
SIMON PROPERTY GROUP	48.47	4.68
WELLTOWER INC	47.81	4.62
PUBLIC STORAGE	44.92	4.34
DIGITAL REALTY TRUST	44.44	4.29
REALTY INCOME CORP	43.35	4.19
VICI PROPERTIES	30.33	2.93
EXTRA SPACE STORAGE	29.78	2.88
AVALONBAY COMMUNITIES	25.14	2.43
总计	520.53	50.28

子行业权重



关于MSCI

MSCI是为全球投资界提供关键决策支持工具和服务的领先供应商。 凭借在研究，数据和技术领域超过50年的专业知识，我们通过使客户理解和分析风险与回报的关键驱动因素，并有把握地构建更有效的投资组合，从而为更好的投资决策提供支持。 我们创建了业界领先的研究增强型解决方案，客户可以通过这些解决方案来了解并提高整个投资过程的透明度。如需了解详情，请访问www.msci.com。

未经MSCI事先书面同意，不得复制或再次传播全部或部分此处包含的信息（"信息"）。信息不得用于：验证或更正其他数据，创建指数，风险模型或分析，或用于与发行，提供，赞助，管理或营销任何证券，投资组合，金融产品或其他投资工具相关的任何用途。历史数据和分析不得视为对未来任何的表现，分析，预测或推测的指示或保证。信息，MSCI指数或其他产品或服务均不构成买卖，促销或推荐任何证券，金融工具或产品或交易策略的要约。此外，信息或任何MSCI指数均不旨在构成任何投资意见或对作出（或不作出）任何类型的投资决策的推荐，并且不得被依赖而用于该等用途。信息皆"按原样"提供，信息使用者承担其可能对信息进行的使用或所允许进行的使用而产生的所有风险。MSCI INC.或其任何附属公司或任何其直接或间接的供应商或任何参与信息的制作或编制的第三方（每个"MSCI方"）均不做任何保证或陈述，而且，在法律允许的最大范围内，每个MSCI方皆在此明确表明不就任何信息提供任何隐含的保证，包括对适销性和适用于特定用途的保证。在不限制任何上述内容的情况下，以及在法律允许的最大范围内，在任何情况下，任何MSCI方均不对就任何信息有关的任何直接，间接，特殊，惩罚性，后果性（包括利润损失）损失，或其他任何损失承担任何责任，即使其已经被通知了发生此类损失的可能性。上述内容并不排除或限制根据适用法律所不能排除或限制的任何责任。
© 2021 MSCI Inc. 版权所有，保留所有权利。
本文件原文为英文，中文译文与英文原文之间如有任何差异，应以英文版为准。。