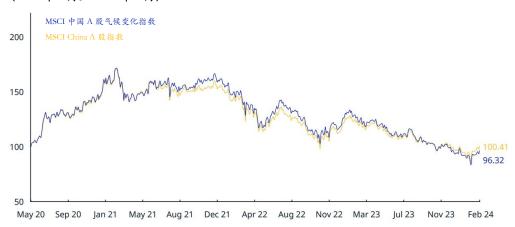
# MSCI 中国 A 股气候变化指数 (美元)

MSCI 中国 A 股气候变化指数基于其母指数 MSCI 中国 A 股指数,并且包括在沪深交易所上市的大中盘中国证券。该指数仅覆盖可通过"沪深股通"买卖的证券。该指数旨在代表根据与过渡至低碳经济相关的机会和风险重新确定证券权重的投资策略的表现,同时寻求在最低限度内剔除母指数的成分。

#### 累计指数表现-净收益 (美元)

(2020年5月至2024年2月)



#### 指数表现-净收益(%) (2024年2月29日)

基本面数据 (2024年2月29日)

					年化							
	1 个月	3个月	1年	年初至今	3年	5年	10年	2020年5月29 日以来	股息收益率 (%)	市盈率	远期市盈率	市净率
MSCI 中国 A 股气候变化指数	9.12	-2.75	-22.11	-1.09	-14.69	na	na	-0.99	2.05	15.54	11.97	1.70
MSCI China A 股指数	9.98	-0.83	-16.67	0.82	-13.26	na	na	0.11	2.44	14.90	11.26	1.57

### 指数风险及回报指标 (2020年5月29日至2024年2月29日)

		14 m2 10 4	<b>接手率</b> (%) <sup>1</sup>	年化标准差 (%) <sup>2</sup>		夏普比率 2.3				最大回撤率		
	贝塔系数	追踪误差 (%)		3年	5年	10年	3年	5年	10 年	2020年5月 29日以来	(%)	期间(年年年年/月月/日日)
MSCI 中国 A 股气候变化指数	1.00	2.97	24.81	21.87	na	na	-0.73	na	na	-0.02	49.66	2021-02-15—2024-02-02
MSCI China A 股指数	1.00	0.00	12.49	21.53	na	na	-0.67	na	na	0.03	47.54	2021-02-15—2024-02-02
			1过去1	2个月		2 基于月月	度净收益数据					

MSCI 中国 A 股气候变化指数于 2020 年 7 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

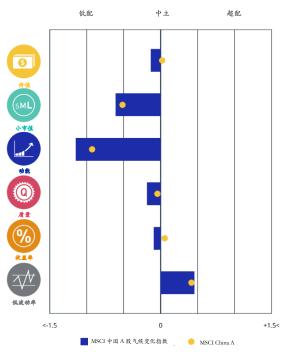
MSCI 中国 A 股 气候变化指数	MSCI China A 股指数			
466	563			
权重	(%)			
5.06	5.69			
0.00	0.03			
0.21	0.18			
0.09	0.10			
	<b>气候変化指数</b> 466 <b>収重</b> 5.06 0.00 0.21			

## 前十大权重股

	指数权	母指数	行业		
	重(%)	权重			
		(%)			
贵州茅台 A 股(HK-C)	5.06	5.69	日常消费品		
宁德时代 A 股(HK-C)	4.77	1.92	工业		
京沪高铁 A 股 (HK-C)	3.12	0.66	工业		
长江电力 A 股(HK-C)	2.85	1.64	公用事业		
比亚迪 A 股(HK-C)	2.66	0.93	非必需消费品		
五粮液 A 股(HK-C)	2.49	1.48	日常消费品		
中国招商银行 A 股 (HK-C)	2.09	1.77	金融		
国电南瑞 A 股(HK-C)	2.01	0.50	工业		
中国三峡 A 股 (HK-C)	1.93	0.35	公用事业		
中核集团 A 股 (HK-C)	1.92	0.44	公用事业		
总计	28.89	15.37			

# 因子-影响风险及回报的主要敞口

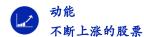
## MSCI FACTOR BOX



# **MSCI FaCS**

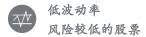








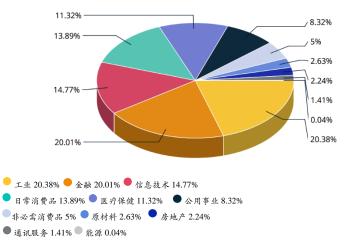




MSCI FaCS 提供相对于 宽基全球指数 MSCI ACWI IMI 的绝对因子敞口。

中立因子敞口(FaCS=0)表示 MSCI ACWI IMI。

# 各行业权重





#### FACTOR BOX 和 FaCS 方法论

MSCI FaCS 是一种评估和报告股票组合因子指标的标准方法(MSCI FaCS 方法论)。MSCI FaCS 囊括了多种因子组(例如价值、规模、动能、质量、收益率和波动率),这些因子组在学术文献中得到广泛记录,并被 MSCI 研究部确认为股票投资组合风险及回报之关键驱动因素。这些因子组通过汇总来自 Barra 最新的全球股票因子风险模型 GEMLT 的 16 个因子而构建(例如市净率、盈利/股息收益率、长期反转、杠杆、盈利波动率/质量、贝塔值),旨在使基金比较更加透明直观、便于使用。由 MSCI FaCS 支持的 MSCI Factor Box 提供可视化功能,旨在便捷比较基金/指数及其基准对于 6 个因子组的绝对敞口,历史证明这些因子组在长期内会带来超额市场回报。

#### 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。我们在研究、数据和技术方面拥有超过 45 年的专业经验,通过帮助客户了解和分析风险和回报的关键驱动因素,并自信地建立更有效的投资组合,推动客户作出更佳的投资决策。我们创造了行业领先的研究增强型解决方案,客户可利用这些解决方案来深入了解和提高整个投资流程的透明度。欲了解更多信息,请浏览 www.msci.com。

未经 MSCI 事先书面准许,不得复制或再分发本文所载信息("信息")的全部或部分。这些信息不得用于核实或更正其它数据、创建指数、风险模型或分析或用于发行、发售、保荐、管理或营销任何证券、投资组合、金融产品或其它投资工具。历史数据和分析不得被视作任何未来表现、分析、预测或预报的指示或保证。这些信息、MSCI 指数或其它产品或服务概不构成任何证券、金融工具或产品或交易策略的买卖要约、推广或推荐。此外,这些信息或任何 MSCI 指数无意构成作出(或不作出)任何类型投资决策的投资建议或推荐,并且不得作此依赖。这些信息按"现状"提供,并且用户承担使用或准许使用这些信息的全部风险。MSCI INC. 或其任何子公司或其直接或间接供应商或参与编写或编制信息的任何第三方(各称为"MSCI 方")概无作出任何保证或声明,并且在法律准许的最大范围内,各 MSCI 方特此明确否认所有暗示保证,包括有关适销性和适用于特定用途的保证。在不限制上述一般性及在法律准许的最大范围内,对于使用信息导致的任何直接、间接、特殊、惩诚性、后果性(包括利润损失)或任何其它损害,MSCI 方概不负责,即使已获告知此等损害的可能性亦为如此。上文不排除或限制适用法律禁止排除或限制的任何责任。

© 2021 年 MSCI Inc. 版权所有。

