

MSCI 中国A股人民币消费指数 (人民币)

MSCI 中国 A 股人民币消费指数涵盖在沪深交易所上市的中国证券中具代表性的中大盘股。该指数仅覆盖可通过“互联互通”买卖的证券。该指数专为中国国内投资者设计，使用中国 A 股上市股票和在岸人民币汇率计算。根据全球行业分类标准(GICS®)，本指数中的所有证券都归入可选消费品或必需消费品行业。

累计指数表现—价格收益 (人民币)
(2008 年 11 月 - 2021 年 5 月)



年度表现(%)

年份	MSCI 中国 A 股人民币消费指数	MSCI 中国 A 股人民币指数	MSCI 新兴市场指数
2020	70.45	31.41	8.76
2019	56.47	35.35	17.10
2018	-25.24	-27.95	-12.10
2017	41.33	19.67	25.89
2016	-6.36	-11.21	16.20
2015	20.18	6.76	-13.08
2014	15.82	48.05	-2.26
2013	5.52	-8.48	-7.67
2012	5.04	7.99	13.98
2011	-8.59	-22.14	-23.98
2010	-6.20	-16.46	12.32
2009	109.50	80.20	74.60

指数表现—价格收益率 (%) (2021 年 5 月 31 日)

	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	年化			
					3 年	5 年	10 年	2008 年 11 月 25 日以来
MSCI 中国 A 股人民币消费指数	5.44	4.11	65.07	4.81	26.90	25.80	14.52	18.00
MSCI 中国 A 股人民币指数	4.58	1.96	39.96	3.95	13.39	11.07	5.89	7.64
MSCI 新兴市场指数	0.37	1.18	31.67	3.66	6.86	10.48	1.47	7.81

指数风险及表现指标 (2021 年 5 月 31 日)

	换手率 (%) ¹	年化标准差 (%) ²			最大回撤率	
		3 年	5 年	10 年	(%)	期间 (年年年/月/月/日日)
MSCI 中国 A 股人民币消费指数	11.77	25.33	21.72	22.78	44.30	2015/06/12 — 2016/01/28
MSCI 中国 A 股人民币指数	12.45	18.69	16.03	22.62	47.99	2015/06/08 — 2019/01/03
MSCI 新兴市场指数	8.45	16.25	13.75	16.18	42.53	2011-04-08—2016-01-21

¹ 过去 12 个月

² 基于月度价格收益数据

中国 A 股以本币 (人民币) 报价。

MSCI 中国 A 股人民币消费指数在 2018 年 4 月 18 日发布。发布日期前的数据为回溯数据 (即计算指数在存续期前可能的市场表现)。回溯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溯数据——均不能表明或保证未来市场表现。



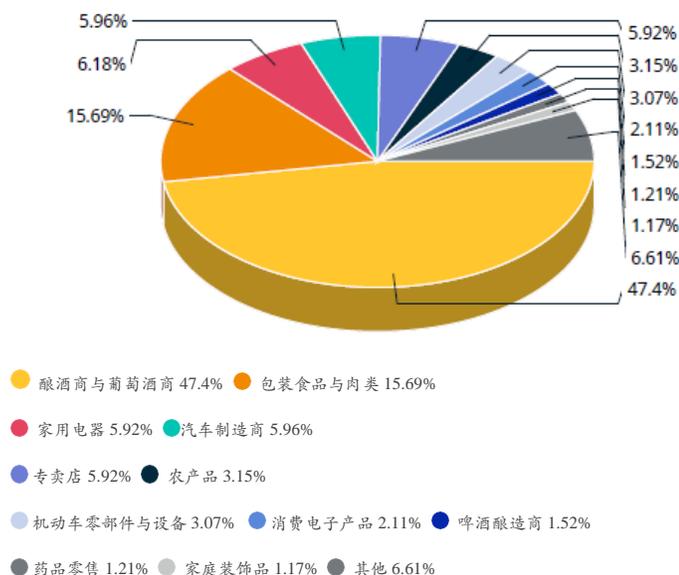
指数指标

MSCI 中国 A 股人民币消费指数	
成分股个数	88
市值 (百万元人民币)	
指数	3,543,655.53
最高	835,874.02
最低	3,775.84
平均	40,268.81
中位数	15,461.84

前十大权重股

	经自由流通调整市值 (十亿元人民币)	指数权重 (%)	行业
贵州茅台A	835.87	23.59	必需消费品
五粮液A	366.95	10.36	必需消费品
中国中免A	195.93	5.53	可选消费品
海天味业A	144.55	4.08	必需消费品
山西汾酒A	121.02	3.42	必需消费品
泸州老窖A	120.82	3.41	必需消费品
牧原股份A	100.46	2.84	必需消费品
洋河股份A	98.47	2.78	必需消费品
比亚迪A	97.20	2.74	可选消费品
美的集团A	85.55	2.41	可选消费品
总计	2,166.84	61.15	

子行业权重



指数构建方法论

MSCI 中国 A 股人民币指数源自 MSCI 中国 A 股国际指数，但仅纳入可通过“互联互通”投资的证券。该指数专为中国国内投资者设计，使用中国 A 股当地上市股票和在岸人民币汇率计算。另外，指数成分股按照证券经自由流通调整的市值加权及根据外国纳入因子(FIF)计算，并且受限于外国持股限制(FOL)。MSCI 中国 A 股人民币指数与 MSCI 全球可投资市场指数同时再平衡，并且使用相同的价格和数据截止日期。

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/或分析不得视为对将来任何的表现、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建议或对作出（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其任何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。