

MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列) (美元)

MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列) 涵盖了中国 A 股、H 股、B 股、红筹股、民企股和海外上市中国股票 (例如美国存托凭证) 中的大盘股和中盘股。目前, 该指数包括的 A 股大盘、中盘股可通过互联互通机制交易, 以其自由流通量调整后市值的 20% 计算。该指数旨在代表一组公司的表现, 这些公司预计将通过科技创新开发新产品、新服务而获得可观收入, 这些科技创新预期将带来互联网和数字化、出行、自动化技术、工业自动化和数字医疗等领域的突破。

累计指数表现 — 净收益 (美元) (2018 年 5 月至 2021 年 5 月)



年度表现(%)

年份	MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列)	MSCI 中国指数
2020	110.26	29.49
2019	35.96	23.46

指数表现 - 净收益(%) (2021 年 5 月 31 日)

	年化							
	1 个月	3 个月	1 年	年初至今	3 年	5 年	10 年	2018 年 5 月 31 日以来
MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列)	-0.19	-11.86	73.45	-6.54	21.44	不适用	不适用	21.42
MSCI 中国指数	0.77	-4.25	38.70	1.73	8.37	不适用	不适用	8.36

基本面数据 (2021 年 5 月 31 日)

股息收益率 (%)	市盈率	远期市盈率	市净率
0.19	43.31	39.60	5.30
1.36	18.65	15.89	2.25

指数风险及回报指标 (2018 年 5 月 31 日至 2021 年 5 月 31 日)

	贝塔系数	追踪误差 (%)	换手率 (%) ¹	年化标准差 (%) ²			夏普比率 ^{2,3}			2018 年 5 月 31 日以来 (%)	最大回撤率 (%)	期间 (年年年/月月/日日)
				3 年	5 年	10 年	3 年	5 年	10 年			
MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列)	1.31	13.48	23.26	29.03	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	0.77	40.73	2018/06/12 — 2019/01/03
MSCI 中国指数	1.00	0.00	8.79	20.21	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	0.43	27.87	2018/06/07 — 2018/10/30

¹ 过去 12 个月

² 基于月度净收益数据

³ 基于洲际交易所 1 个月 LIBOR

A 股在中国注册, 在上海和深圳交易所进行交易, 以本地人民币报价。B 股在中国注册, 在上海和深圳交易所进行交易; 它们以外币 (上交所美元、深交所港币) 报价。H 股在中国注册, 在香港交易所交易。红筹股和民企股在中国境外注册, 在香港交易所进行交易。红筹股通常由国家或省市控制。民企股为中国非国有企业, 在大陆以外地区注册成立, 并在香港交易。A 股自 2018 年 6 月 1 日起计入。目前, A 股大盘股、A 股中盘股均包括在内, 占其自由流通量调整后市值的 20%。

MSCI J 系列指数不剔除受到美国行政命令 13959 影响的证券。MSCI 提醒将其指数用于任何目的 (包括指数化管理和主动型管理) 的用户, 他们负责确保遵守所有适用于其投资组合、交易和其它投资活动的制裁及任何其它规则、法规、禁令、法律以及其它限制。

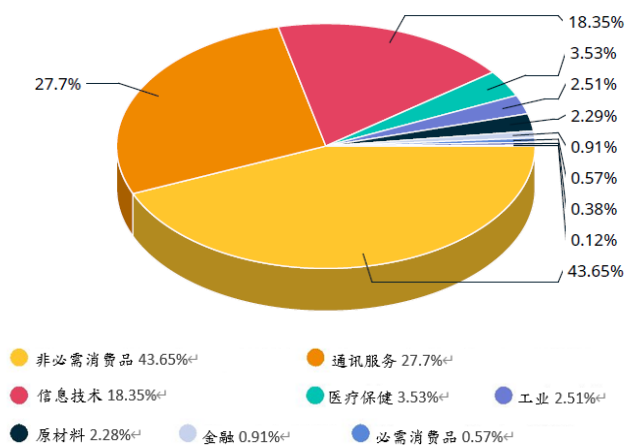
指数指标

	MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列)	MSCI 中国指数
成分股个数	100	747
权重 (%)		
最高	10.39	14.18
最低	0.02	0.00
平均	1.00	0.14
中位数	0.18	0.03

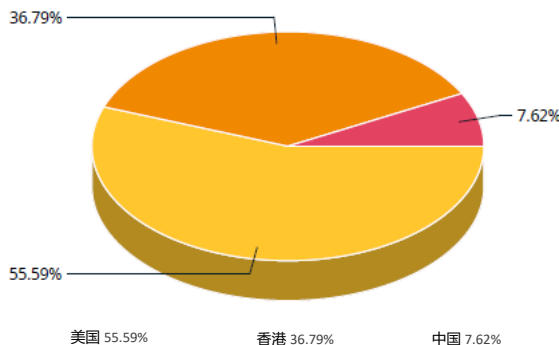
前十大权重股

	指数权重 (%)	母指数权重 (%)	行业
美团 B 股	10.39	4.22	非必需消费品
阿里巴巴集团 ADR	10.07	12.72	非必需消费品
腾讯控股 (中国)	9.92	14.18	通讯服务
拼多多 ADR A	7.67	1.69	非必需消费品
小米公司 B 股	7.57	1.67	信息技术
百度 ADR	6.62	1.63	通讯服务
网易 ADR	5.58	1.46	通讯服务
京东 ADR	4.53	1.97	非必需消费品
蔚来汽车 ADR	3.56	1.54	非必需消费品
贝壳找房 ADR	2.51	0.57	房地产
总计	68.42	41.67	

行业权重



上市地



指数构建方法论

MSCI 中国科技 100 指数 (J 系列) 是从母指数 MSCI 中国指数中选择股票构建的。该指数包括的公司预计将通过科技创新开发新产品、新服务而获得可观收入，这些科技创新预期将带来互联网和数字化、出行、自动化技术、工业自动化和数字医疗等领域的突破。根据发行人市值排名前 100 只证券被纳入最终指数。

指数在 5 月和 11 月每半年进行一次审查，以配合 5 月和 11 月对母指数的半年审查，并在 5 月底和 11 月底进行调整。MSCI J 系列指数不剔除受到美国行政命令 13959 影响的证券。

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

2021 年 5 月 31 日

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。