

MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数（美元）

MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数涵盖中国A股、B股、H股、红筹股、P股和外国上市股票（例如ADR）中具代表性的大盘股、中盘股和小盘股。该指数反映在美国、香港、上海和深圳上市的中国股份类别的机会集。它基于按照100%自由流通调整市值纳入MSCI中国 A股的MSCI全部中国股票整合概念。该指数旨在代表一系列公司的表现，这些公司根据基础指数方法论标准预计从以下领域取得重大收入：由于工业自动化、制造、运输、能源使用、能源存储、能源生产以及人工智能和机器学习的技术创新而导致的新产品和服务开发。

累计指数表现—净收益（美元）
（2018年5月至2021年3月）



年度表现(%)

年份	MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数	MSCI中国全股可投资市场指数
2020	148.35	32.30
2019	37.31	26.36

指数表现—净收益(%)（2021年3月31日）

	年化								股息收益率 (%)	基本面数据（2021年3月31日）		
	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		市盈率	远期市盈率	市净率
MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数	-13.16	-10.91	133.13	-10.91	na	na	na	27.83	0.16	38.11	34.69	4.80
MSCI中国全股可投资市场指数	-5.69	-1.58	43.35	-1.58	na	na	na	8.00	1.36	21.13	15.80	2.28

指数风险及回报指标（2018年5月31日-2021年3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	
				3年	5年	10年	3年	5年	10年		期间 (年年年年/月/日)	
MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数	1.39	18.07	36.03	na	na	na	na	na	na	0.87	38.40	2018/06/06 – 2018/10/29
MSCI中国全股可投资市场指数	1.00	0.00	11.21	na	na	na	na	na	na	0.40	28.43	2018/06/06 – 2018/10/29

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

MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数于2020年12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。



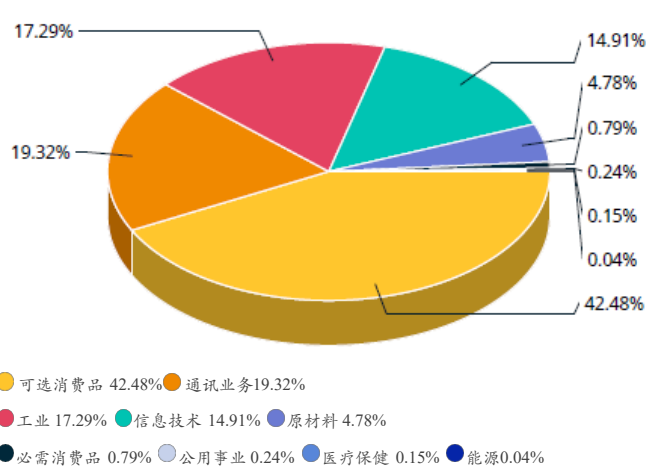
指数指标

	MSCI中国全股可投资市场自动化技术与产业创新指数	MSCI中国全股可投资市场指数
成分股个数	196	3,394
	权重 (%)	
最高	15.33	8.46
最低	0.01	0.00
平均	0.51	0.03
中位	0.07	0.00

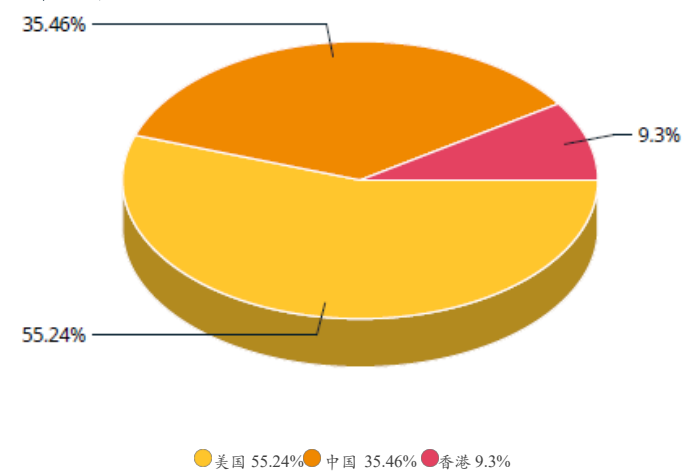
前十大权重股

	指数权重 (%)	母指数权重 (%)	行业
百度ADR	15.33	1.10	通讯业务
拼多多ADRA	9.45	0.99	可选消费品
京东ADR	8.92	1.37	可选消费品
蔚来汽车ADR宁德时代A股	8.51	0.64	工业
阿里巴巴集团ADR	8.43	8.05	可选消费品
蔚来汽车A ADR	7.56	0.94	可选消费品
小米公司B股	3.61	0.89	信息技术
网易ADR	3.52	0.80	通讯业务
比亚迪A股	2.52	0.26	可选消费品
比亚迪H股	2.51	0.31	可选消费品
总计	70.35	15.34	

各行业权重



上市国家/地区



指数构建方法论

该指数包括来自母指数且被确定对以下业务活动拥有较高敞口的公司：汽车自动驾驶、机器人技术、电池、3D打印、智能基础设施、替代能源、创新材料、太空探索、机器学习和人工智能。

该指数每半年调整一次（5月和11月），与母指数于5月和11月的半年度指数调整相符，并且相关变更分别于5月底和11月底实施。

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，请访问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，并且在法律允许的最大范围内，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允许的最大范围内，对于使用信息导致的任何直接、间接、特殊、惩戒性、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 MSCI Inc. 版权所有。

