MSCI中国全股可投资市场颠覆性科技指数（美元）

MSCI中国全股可投资市场颠覆性科技指数涵盖中国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。该指数旨在代表与“颠覆性科技”相关主题或被称为“颠覆性科技”的主题相一致之公司的表现。

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颠覆性科技指数	MSCI中国全股可投资市场指数
2020	69.71	32.30
2019	31.03	26.36

指数表现－净收益(%)（2021年3月31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	2018年5月31日以来	股息收益率(%)	市盈率	远期市盈率	市净率
MSCI中国全股可投资市场颠覆性科技指数	-7.85	-5.03	73.19	-5.03	na	na	na	12.52	0.54	52.19	30.67	4.17
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

基本面数据（2021年3月31日）

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] 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	最大回撤率 2018年5月31日以来(%)	最大回撤率	最大回撤率 期间（年年年年/月月/日日）
MSCI中国全股可投资市场颠覆性科技指数	1.24	11.62	47.43	na	na	na	na	na	na	0.51	36.98	2018/05/31－2018/10/29
MSCI中国全股可投资市场指数	1.00	0.00	10.94	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颠覆性科技指数于2020年12月18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。

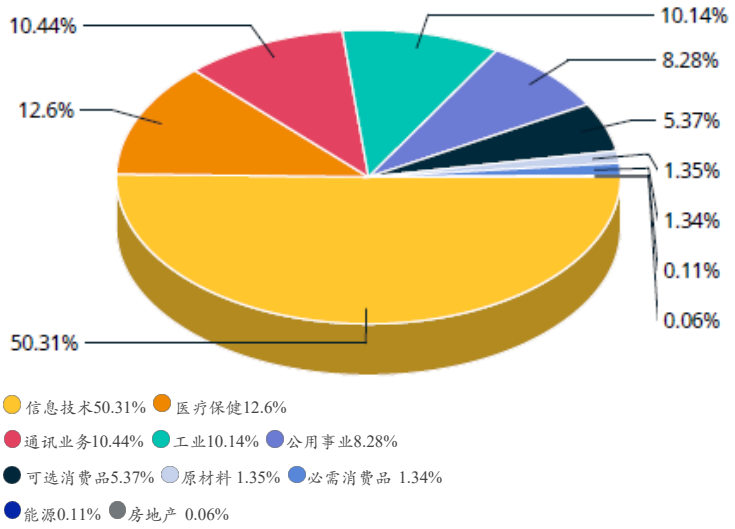
指数指标

	MSCI中国全股可投资市场颠覆性科技指数	MSCI中国全股可投资市场指数
成分股个数	183	3,394
	权重（%）	
最高	10.22	8.46
最低	0.02	0.00
平均	0.54	0.03
中位	0.13	0.01

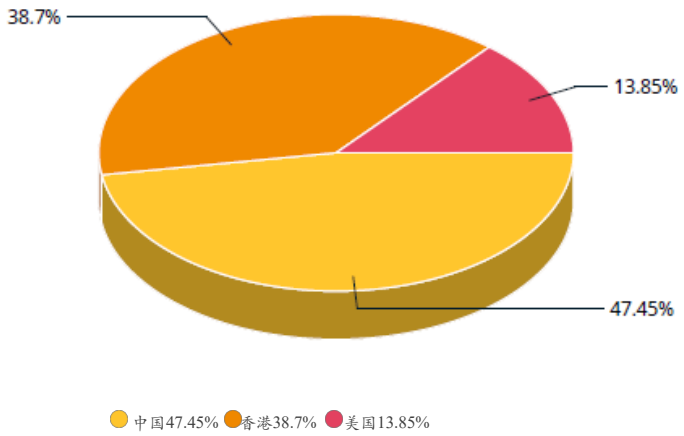
前十大权重股

	指数权重(%)	母指数权重(%)	行业
腾讯控股（中国）	10.22	8.46	通讯业务
小米公司B股	9.16	0.89	信息技术
长江电力A	5.43	0.40	公用事业
蔚来汽车A ADR	4.94	0.94	可选消费品
隆基绿能A股	3.05	0.28	信息技术
万国数据A ADR	2.88	0.14	信息技术
信义光能（中国）	2.64	0.13	信息技术
药明康德A股	2.45	0.26	医疗保健
再鼎医药ADR	2.33	0.18	医疗保健
阳光电源A股	2.00	0.09	工业
总计	45.11	11.76	

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：3D打印、物联网、云计算、金融科技、数字支付、医疗保健创新、机器人、网络安全、清洁能源和智能电网。

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、惩诫性、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。