MSCI 全球可投资市场未来出行指数(美元)

MSCI 全球可投资市场未来出行指数基于母指数MSCI 全球可投资市场指数，涵盖23个发达市场 (DM) 和25个新兴市场 (EM) 的大盘股、中盘股和小盘股证券*。该指数旨在代表有望从储能技术、自动驾驶汽车、共享出行和新型交通方式中获得可观收入的公司的业绩。

累计指数表现—总回报率（美元）

(2013年5月至2024年3月)

年度表现 (%)

年份	MSCI 全球可投资市场未来出行指数	MSCI 全球可投资市场指数
2023	34.52	22.18
2022	-33.40	-18.00
2021	29.56	18.71
2020	71.08	16.81
2019	29.67	27.04
2018	-21.72	-9.61
2017	45.08	24.58
2016	16.89	8.96
2015	-3.69	-1.68
2014	3.02	4.36

指数表现—总收益 (%)（2024 年 3 月 29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	年化 2013 年 5 月 31 日以来
MSCI 全球可投资市场未来出行指数	2.20	8.38	22.26	8.38	5.75	20.22	13.14	14.42
MSCI 全球可投资市场指数	3.22	7.83	23.04	7.83	6.81	11.10	8.98	9.63

基本面数据（2024 年 3 月 29日）

	股息收益率 (%)	市盈率	远期市盈率	市净率
MSCI 全球可投资市场未来出行指数	1.53	21.89	18.16	2.60
MSCI 全球可投资市场指数	1.94	21.32	17.62	2.84

指数风险及回报指标（2013 年 5 月 31 日至 2024 年 3 月 29 日）

	贝塔系数	跟踪误差 (%)	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	夏普比率 [2,3] 2013 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全球可投资市场未来出行指数	1.42	11.77	21.81	26.53	29.06	23.80	0.24	0.71	0.58	0.64	39.60	2020/02/20—2020/03/18
MSCI 全球可投资市场指数	1.00	0.00	2.51	16.73	18.06	14.96	0.32	0.56	0.55	0.61	34.47	2020/02/12—2020/03/23

[1] 过去 12 个月

[2] 基于月度净收益数据

[3] 自2021年9月1日起基于纽约美联储担保隔夜融资利率(SOFR)，此日期前基于一个月洲际交易所伦敦银行同业拆放利率(ICE LIBOR)

*发达市场包括：澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、香港、爱尔兰、以色列、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英国和美国。新兴市场包括：巴西、智利、中国、哥伦比亚、捷克共和国、埃及、希腊、匈牙利、印度、印度尼西亚、韩国、科威特、马来西亚、墨西哥、秘鲁、菲律宾、波兰、卡塔尔、俄罗斯、沙特阿拉伯、南非、台湾、泰国、土耳其和阿拉伯联合酋长国。

MSCI 全球可投资市场未来出行指数于2019年9月23日发布。发布日期之前的数据是经过回测的数据（即假设指数存在，则在该时间段内的估算值）。回溯测试表现结果与实际结果往往存在实质性差别。过往表现—无论是实际表现或回溯测试表现—不代表或保证未来表现。

Information Classification: GENERAL

2024年3月29日

指数指标

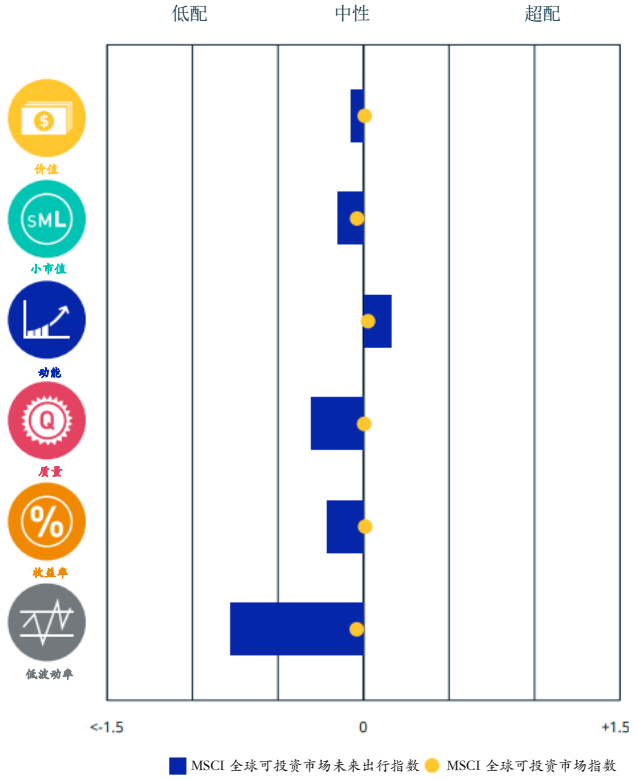
	MSCI全球可投资市场未来出行指数	MSCI 全球可投资市场指数
成分股个数	310	9,033

	权重 (%)	
最高	7.79	3.67
最低	0.00	0.00
平均	0.32	0.01
中位数	0.04	0.00

前十大权重股

	市场	指数权重 (%)	母指数权重 (%)	行业
NVIDIA	美国	7.79	2.75	信息技术
ADVANCED MICRO DEVICES	美国	6.46	0.36	信息技术
UBER TECHNOLOGIES	美国	6.11	0.18	工业
TAIWAN SEMICONDUCTOR MFG	台湾	5.80	0.74	信息技术
TOYOTA MOTOR CORP	日本	5.43	0.33	非日常生活消费品
TEXAS INSTRUMENTS	美国	3.70	0.20	信息技术
EATON CORP PLC	美国	3.65	0.15	工业
TESLA	美国	3.24	0.62	非日常生活消费品
O'REILLY AUTOMOTIVE	美国	3.10	0.08	非日常生活消费品
HITACHI	日本	2.84	0.11	工业
总计		48.13	5.52	

因子——影响风险及回报的主要敞口 MSCI FACTOR BOX



MSCI FaCS

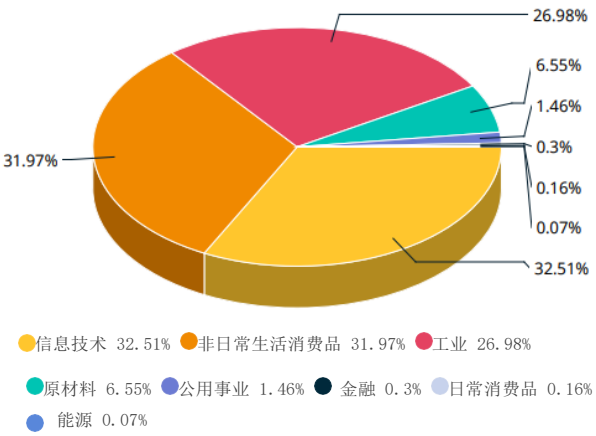
- 价值
- 估值较低的股票
- 小市值
- 小型公司
- 动能
- 不断上涨的股票
- 质量
- 资产负债表稳健的股票
- 股息率
- 派发现金流
- 低波动率
- 风险较低的股票

相对于全球指数 MSCI ACWI IMI，MSCI FaCS 提供绝对的因子敞口。

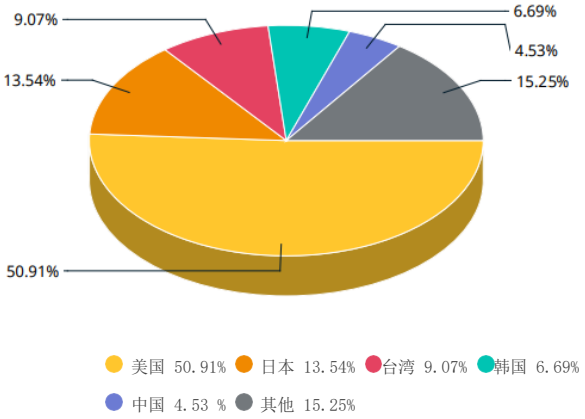
中性因子敞口(FaCS = 0)表示 MSCI ACWI IMI。

2024年3月29日

各行业权重



国家/地区权重



2024年3月29日

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）。MSCI FaCS 囊括了多种因子大类（例如价值、规模、动能、质量、收益率和波动率），这些因子大类在学术文献中得到广泛研究，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。这些因子大类通过整合来自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。基于MSCI FaCS 的 MSCI Factor Box 提供可视化功能，旨在便于比较基金/指数及其基准对于 6 个因子大类的绝对敞口，历史显示这些因子组在长期内带来超额市场回报。

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。 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意见或对作出（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。

© 2022 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。