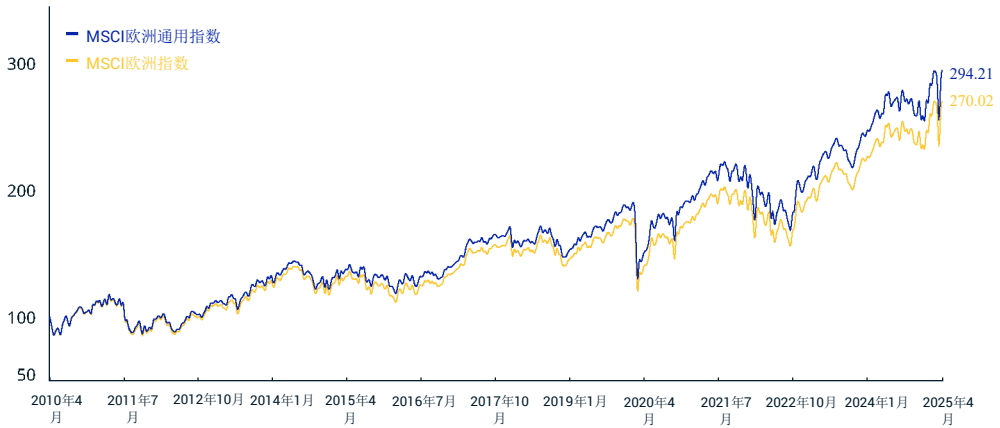


MSCI欧洲通用指数（人民币）

MSCI欧洲通用指数基于母指数MSCI欧洲指数构建，涵盖欧洲15个发达市场大盘股和中盘股证券。该指数旨在反映以下投资策略的表现：通过偏离自由流通市值加权的方式，寻求投资于不仅具备稳健的ESG表现，并且在改善ESG表现方面展现积极趋势的公司，同时仅对MSCI欧洲指数进行最小程度的成分股剔除。

有关指数方法论的完整描述，请参阅[指数方法 - MSCI](#)。

累计指数表现 – 净收益（人民币）（2010年4月 – 2025年4月）



年度表现（%）

年份	MSCI欧洲通用指数	MSCI欧洲指数
2024	5.61	4.76
2023	22.82	22.31
2022	-8.70	-7.35
2021	13.87	13.34
2020	2.00	-1.06
2019	27.36	25.58
2018	-10.22	-10.24
2017	17.91	17.61
2016	5.20	6.59
2015	3.75	1.69
2014	-3.02	-3.85
2013	22.54	21.69
2012	18.21	17.92
2011	-13.95	-15.05

指数表现 – 净收益(%)（2025年4月30日）

	年化							
	1个月	3个月	1年	年初至今	3年	5年	10年	2009年11月30日以来
MSCI欧洲通用指数	4.67	7.38	13.38	13.94	14.75	13.69	7.87	7.05
MSCI欧洲指数	4.53	7.86	14.03	14.73	14.71	13.48	7.36	6.44

基本面（2025年4月30日）

股息收益率 (%)	市盈率	远期市盈率	市净率
3.19	15.25	13.85	2.11
3.18	15.31	13.85	2.09

指数风险及回报指标（2009年11月30日至2025年4月30日）

	贝塔系数	跟踪误差 (%)	换手率 (%) ¹	年化标准差(%) ²			最大回撤率 (%)	期间 (年-月-日)
				3年	5年	10年		
MSCI欧洲通用指数	0.99	0.95	7.04	15.49	15.96	14.81	33.89	2020-02-19–2020-03-18
MSCI欧洲指数	1.00	0.00	3.64	15.53	15.93	14.84	34.92	2019-12-27–2020-03-18

¹过去12个月

²基于月度净收益数据

*发达市场国家（地区）包括：奥地利、比利时、丹麦、芬兰、法国、德国、爱尔兰、意大利、荷兰、挪威、葡萄牙、西班牙、瑞典、瑞士和英国。

自2025年2月3日起，MSCI ESG通用指数更名为MSCI通用指数。

MSCI欧洲通用指数于2017年2月8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结果存在重大误差。过去的市场表现——无论是实际业绩或回溯业绩——均不代表或保证未来市场表现。

指数指标

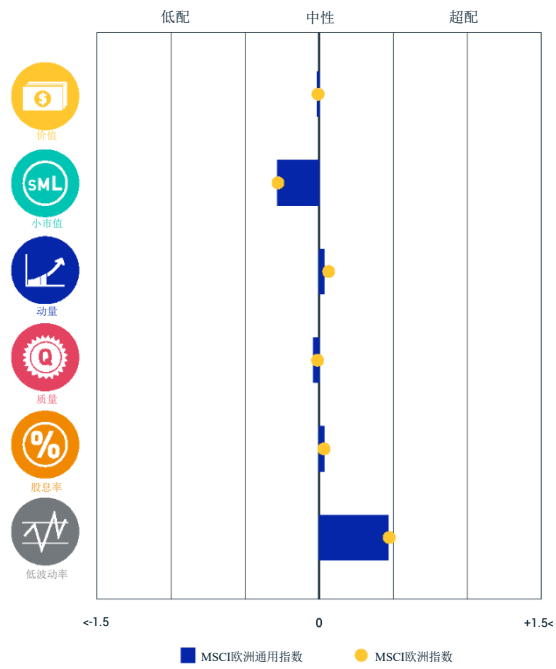
	MSCI欧洲通用指数	MSCI欧洲指数
成份股数量	397	399
权重(%)		
最高	3.08	2.58
最低	0.01	0.02
平均	0.25	0.25
中位数	0.11	0.11

前十大权重股

	国家/地区	指数权重(%)	母指数权重(%)	行业
思爱普	德国	3.08	2.58	信息技术
阿斯麦	荷兰	2.69	2.22	信息技术
诺华	瑞士	2.29	1.91	医疗保健
阿斯利康	英国	2.26	1.89	医疗保健
诺和诺德B股	丹麦	2.17	1.81	医疗保健
汇丰控股（英国）	英国	2.06	1.69	金融
西门子	德国	1.77	1.48	工业
安联	德国	1.65	1.36	金融
联合利华（英国）	英国	1.60	1.34	日常消费品
路威酩轩	法国	1.55	1.30	非日常生活消费品
总计		21.12	17.57	

因子—影响风险及回报的关键敞口

MSCI FACTOR BOX



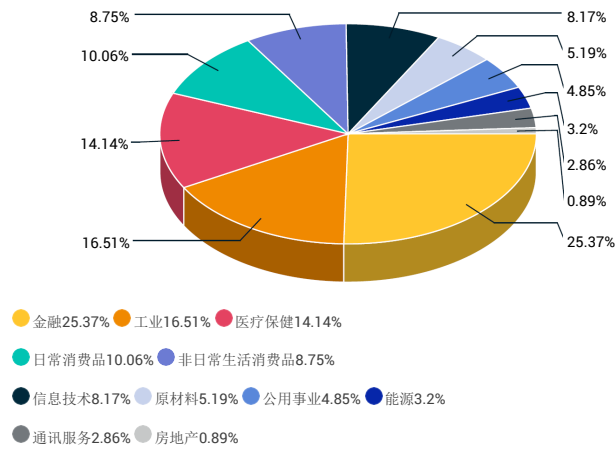
MSCI FaCS

- 价值
低估值的股票
- 小市值
小市值公司
- 动量
不断上涨的股票
- 质量
资产负债表稳健的股票
- 股息率
高现金流派发的股票
- 低波动率
低风险的股票

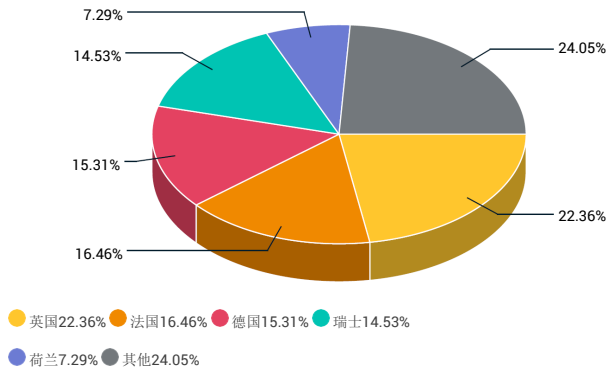
MSCI FaCS 提供相对于宽基全球指数MSCI全球可投资市场指数的绝对因子敞口。

中立因子敞口(FaCS=0)表示 MSCI 全球可投资市场指数。

行业权重



国家/地区权重



MSCI Factor Box 和 FaCS 框架（请参阅MSCI FaCS方法论的完整说明[链接](#)）

MSCI FaCS是评估和报告股票投资组合因子特征的标准方法。MSCI FaCS由因子大类（例如价值、规模、动量、质量、收益率和波动性）组成，这些因子大类已在学术文献中广泛研究，并被MSCI研究部确认为股票投资组合风险和回报的主要驱动因素。这些因子大类整合了最新的Barra全球股权因子风险模型GEMLT的16个因子（例如市净率、盈利/股息收益率、长期反转、杠杆率、盈利变动/质量、贝塔值）构建，旨在使基金对比透明和直观，便于使用。依托MSCI FaCS构建的MSCI Factor Box提供了可视化功能，旨在轻松比较基金/指数及其基准对于6个因子大类的绝对敞口，这些因子大类经历史验证，拥有长期的超额市场回报。

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45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，且不得被依赖于该等用途。信息皆“按原样”提供，信息使用者承担其可能对信息进行使用或允许进行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供应商或任何参与信息制作或编制的第三方（每个“MSCI方”）均不做任何保证或陈述，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。

© 2025 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。

