

# MSCI中国A股气候变化指数（J系列） （美元）

MSCI中国A股气候变化指数（J系列）基于母指数MSCI中国A股指数（J系列），涵盖在上海和深圳交易所上市的大盘股和中盘股。该指数仅覆盖可通过“互连互通”机制买卖的证券。

该指数旨在代表一种投资策略的表现，该策略根据向低碳经济转型相关的机会和风险重新对证券加权，同时尽量减少从母指数中的删除。。MSCI J系列指数不剔除受到美国行政命令13959影响的证券。

累计指数表现—净收益（美元）（2020年5月至2024年3月）



年度表现 (%)

年份	MSCI中国A股气候变化 (J系列)	MSCI China A (J系列)
2023	-17.10	-12.63
2022	-26.19	-25.86
2021	7.21	3.62

## 指数表现—净收益 (%) (2024年 3月 29日)

基本面数据 (2021年11月30日)

指数	1个月	3个月	1年	年初至今	年化			2020年 5月29日以来	股息收益率 (%)	市盈率	远期市盈率	市净率
					3年	5年	10年					
MSCI 中国A股气候变化指数 (J系列)	-0.31	-1.52	-21.64	-1.52	-12.29	不适用	不适用	-0.53	2.04	15.17	11.95	1.69
MSCI中国A股指数 (J系列)	-0.19	0.61	-16.40	0.61	-11.07	不适用	不适用	0.47	2.41	14.95	11.50	1.58

## 指数风险及回报指标 (2020年5月29日至2024年5月29日)

指数	B系数	跟踪误差 (%)	换手率 (%) <sup>1</sup>	年化标准差 (%) <sup>2</sup>			夏普比率 <sup>2,3</sup>			自 2020年 5月 29 日,	最大回撤率 (%)	期间 (年/月/日)
				3年	5年	10年	3年	5年	10年			
MSCI 中国A股气候变化指数 (J系列)	1.01	2.79	26.58	21.37	不适用	不适用	-0.63	不适用	不适用	-0.01	48.72	2021-02-15—2024-02-02
MSCI中国A股指数 (J系列)	1.00	0.00	13.47	21.07	不适用	不适用	-0.57	不适用	不适用	0.04	46.80	2021-02-15—2024-02-02

<sup>1</sup> 过去12个月 (ICE LIBOR) <sup>2</sup> 基于月度净收益数据 <sup>3</sup> 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

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，用户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。

MSCI中国A股气候变化指数（J系列）于2021年1月6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——均不能代表或保证未来表现。

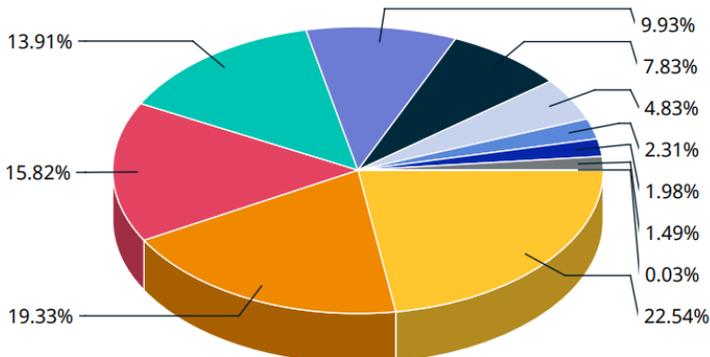
### 指数指标

	MSCI 中国 A 股 气候变化指数 (J 系列)	MSCI 中国股指数 (J 系列)
成分股个数	440	539
	<b>权重 (%)</b>	
最高	5.68	5.52
最低	0.00	0.03
平均	0.23	0.19
中位数	0.09	0.11

### 前十大权重股

	指数 权重 (%)	母指数 权重 (%)	行业
宁德时代 A (HK-C)	5.68	2.16	工业
贵州茅台 A (HK-C)	5.20	5.52	日常消费品
京沪高铁 (HK-C)	2.96	0.64	工业
比亚迪 A (HK-C)	2.76	0.95	非日常生活消费品
长江电力 (HK-C)	2.70	1.57	公用事业
五粮液 A (HK-C)	2.56	1.54	日常消费品
阳光电源 A (HK-C)	2.17	0.40	工业
招商银行 A (HK-C)	2.10	1.71	金融
隆基绿能 A (HK-C)	2.08	0.38	信息技术
国电南瑞 A (HK-C)	2.01	0.50	工业
总计	30.21	15.37	

### 各行业权重



- 工业 22.54%
- 金融 19.33%
- 信息技术 15.82%
- 日常消费品 13.91%
- 医疗保健 9.93%
- 公用事业 7.83%
- 非日常生活消费品 4.83%
- 材料 2.31%
- 房地产 1.98%
- 通讯服务 1.49%
- 能源 0.03%

## 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](http://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。

© 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。

