

中证财新锐联基石经济指数介绍

指数简介

- 以中证全指成分股为样本空间，应用 Smart Beta 策略构建方法；
- 选取企业规模评分最大、基本面最健康、风险最低的 300 只绩优股票组合，并依据企业规模评分进行相应权重配比；
- 财新锐联基石经济指数反映中国实体经济优质大中型企业成长，分享中国基石经济增长红利；
- 具有高投资容量、高流动性和低周转率的特性。

指数基本信息¹ (至 2017 年 6 月 30 日)

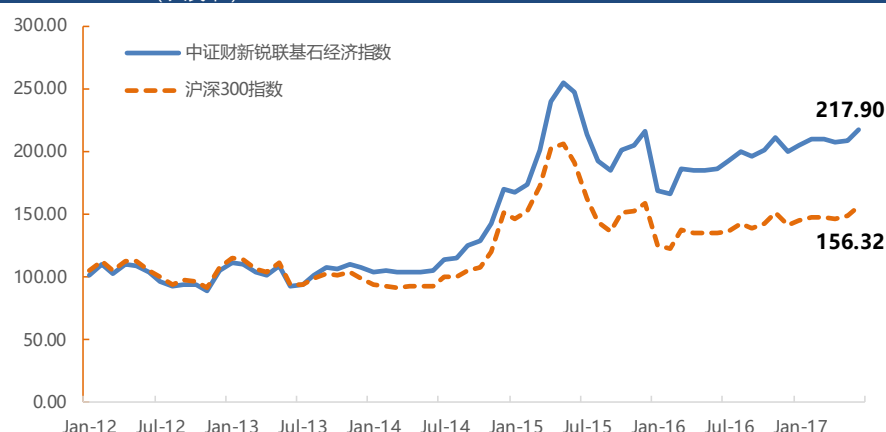
指数基本信息

全称	简称	发布日期	股票总数	沪市股票总数	深市股票总数
中证财新锐联基石经济	CX基石	2016/12/23	295	202	93
万德代码	彭博代码	基期	市值统计	沪深总市值 (亿元)	沪深流通市值 (亿元)
930927.CSI	SH930927	2005/6/30	最大值	18711.33	4896.48
上次定期调样日期	下次定期调样日期	调样频率	最小值	53.51	15.52
2017/6/12	2018/6/12	每年	平均值	870.10	265.51
样本数目	标的市场	货币	中位数	315.33	122.31
至多300	A股市场	人民币	加权值	2360.16	753.53

指数价格回报表现及风险指标² (至 2017 年 6 月 30 日)

累计价格收益走势

2012.1 - 2017.6 (人民币)



指数年度价格收益

年度	沪深300	中证财新锐联基石经济
2016	-11.28%	-7.52%
2015	5.58%	27.66%
2014	51.66%	57.84%
2013	-7.65%	2.80%
2012	7.55%	4.48%
2011	-25.01%	-24.12%
2010	-12.51%	-0.23%
2009	96.71%	112.10%
2008	-65.95%	-60.26%
2007	161.55%	181.55%
2006	121.02%	113.79%

价格收益表现

截止2017年6月	持有期收益	年化收益			
		今年以来	近一年	近三年	近五年
沪深300指数	10.77%	16.26%	19.20%	8.30%	12.64%
中证财新锐联基石经济指数	8.88%	16.93%	27.77%	16.06%	20.15%

基本面指标

近十二个月				
股息率	市盈率	市净率	市现率	市销率
1.93%	13.74	1.59	5.61	1.42
2.23%	11.74	1.49	4.96	1.52

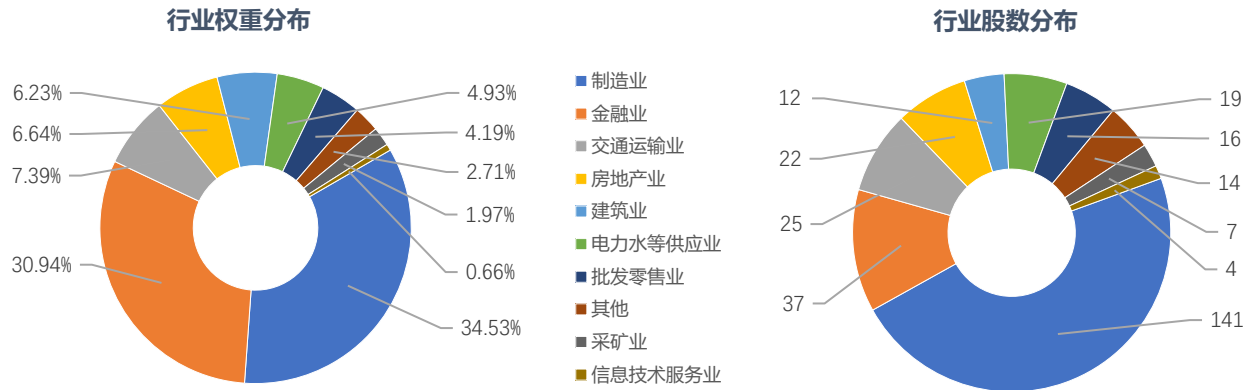
¹ 数据来源：财新数据科技。

² 数据来源：财新数据科技，2016.12.23 以前为回测数据，由中证指数公司和财新锐联提供。过去回报不代表未来收益。

风险信息

	近一年				2005年7月以来			
	周转率	波动率	夏普比率	最大回撤	周转率	波动率	夏普比率	最大回撤
沪深300指数	11.48%	11.58%	1.28	-6.44%	18.99%	32.25%	0.31	-70.75%
中证财新锐联基石经济指数	31.67%	10.18%	1.52	-5.21%	31.36%	30.80%	0.57	-65.98%

行业分布及权重股^{3,4} (2017年6月)



前十大权重股

股票简称	股票代码	行业	总市值(亿元)	流通市值(亿元)	权重
中国平安	601318.SH	金融业	8,239	4,448	5.49%
招商银行	600036.SH	金融业	5,654	2,627	2.56%
兴业银行	601166.SH	金融业	3,438	2,477	1.92%
农业银行	601288.SH	金融业	11,498	1,254	1.87%
交通银行	601328.SH	金融业	4,604	1,494	1.84%
中国建筑	601668.SH	建筑业	2,835	1,210	1.69%
工商银行	601398.SH	金融业	18,711	1,132	1.66%
民生银行	600016.SH	金融业	2,930	2,287	1.52%
浦发银行	600000.SH	金融业	3,609	1,970	1.34%
中国银行	601988.SH	金融业	10,981	764	1.20%
合计			72,499	19,666	21.09%

³ 行业分类参照财新新经济行业分类(2016)

⁴ 数据来源: 财新数据科技, 财新锐联; 前十大权重股及行业分布均基于2017年6月最新一期成分股。

关于财新锐联

财新锐联指数科技公司由财新智库与锐联财智合资，于 2017 年正式成立。财新锐联结合了财新智库集团的数据、研究、传播能力和锐联在智能贝塔、因子投资和指数设计上的专业能力。合资公司由许仲翔博士担任首席指数设计师，段嘉尚博士作为首席执行官。许仲翔博士同时为锐联财智的创始人和董事长，也是锐联资产管理公司的联合创始人和副董事长。段嘉尚博士同时为锐联财智的董事总经理。更多资讯请关注微信公众号：**当 Alpha 遇上 Beta** (caixinsmartbeta).



如需了解更多信息，敬请垂询：

锐联财智 Jacob Chi

电话：+886 972893653

邮箱：Jacob.Chi@rayliantadvisors.com

财新锐联 余方妍

电话：+86 15257490227

邮箱：fangyanyu@caixin.com

财新锐联 阮伟佳

电话：+86 13564580486

电邮：weijiaruan@caixin.com

免责声明

财新锐联(北京)指数科技有限公司(“财新锐联”)将尽合理的商业努力确保指数相关数据的准确性和可靠性，但并不对此予以担保。任何人因该等指数数据不准确、缺失或因依赖其任何内容而造成的任何损失和损害，财新锐联概不承担责任(无论其为侵权、违约或其他责任)。

财新锐联并未就指数及/或本文件中的任何信息做出过任何明示或暗示的保证，包括对其准确性、完整性、及时性、特定目的的适用性、安全性及非侵权等的保证。任何人因上述信息不准确、缺失或因依赖其任何内容而造成的任何损失和损害，财新锐联概不承担责任(无论其为侵权、违约或其他责任)。