

# 中证财新锐联新动能指数介绍

## 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；
- 选取企业基本面健康，资产轻量化的至多 300 只绩优股票组合，并依据成长性评分以及流动性评分进行相应权重配比；
- 财新锐联新动能指数反映中国新经济产业成长走势，分享中国新经济增长红利；
- 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<sup>1</sup> (2017年6月)

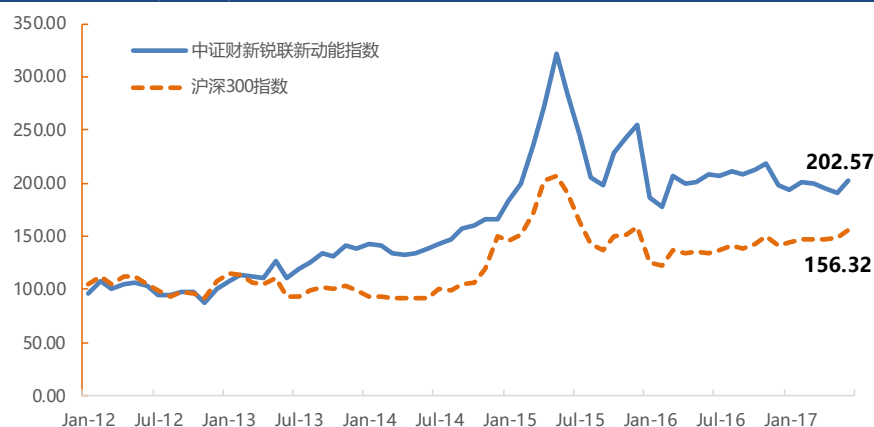
### 指数基本信息

全称	简称	发布日期	股票总数	沪市股票总数	深市股票总数
中证财新锐联新动能	CX新动能	2016/12/23	276	81	195
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)
930928.CSI	SH930928	2013/6/30	最大值	3627.71	1786.20
上次定期调样日期	下次定期调样日期	调样频率	最小值	50.43	12.07
2017/6/12	2018/6/12	每年	平均值	223.79	84.85
样本数目	标的市场	货币	中位数	126.26	49.87
至多300	A股市场	人民币	加权值	641.71	311.42

## 指数价格回报表现及风险指标<sup>2</sup> (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	中证财新锐联新动能
2016	-11.28%	-22.21%
2015	5.58%	53.06%
2014	51.66%	19.95%
2013	-7.65%	38.55%
2012	7.55%	0.25%
2011	-25.01%	-32.78%
2010	-12.51%	15.67%
2009	96.71%	131.39%
2008	-65.95%	-56.14%
2007	161.55%	177.50%
2006	121.02%	93.11%

### 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	2005年7月以来
沪深300指数	10.77%	16.26%	19.20%	8.30%	12.64%
中证财新锐联新动能指数	2.11%	-2.79%	13.46%	14.42%	20.73%

### 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
1.37%	27.48	3.53	57.26	2.66

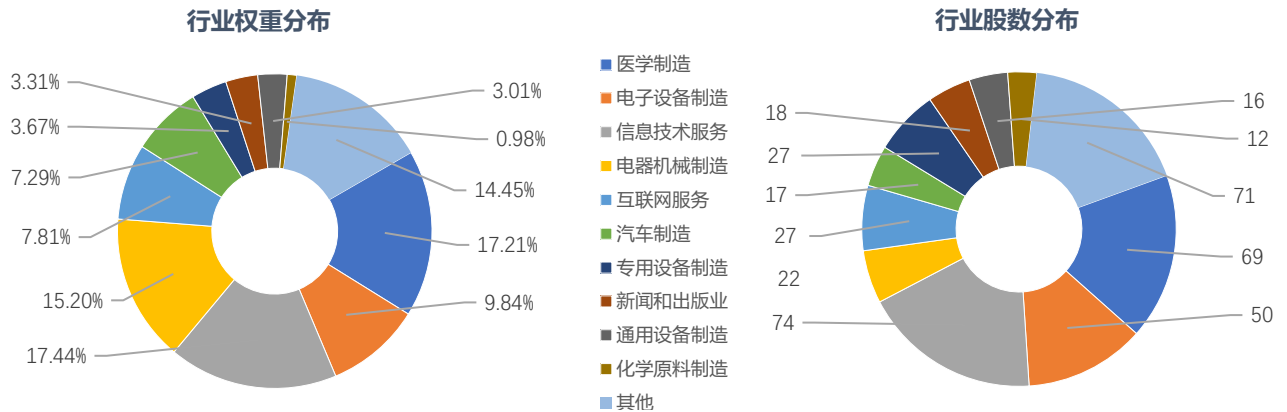
<sup>1</sup> 数据来源：财新数据科技。

<sup>2</sup> 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

截止2017年6月	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%
中证财新锐联新动能指数	51.55%	13.95%	-0.31	-12.64%	34.48%	33.73%	0.54	-65.95%

## 行业分布及权重股<sup>3,4</sup> (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
格力电器	000651.SZ	电器机械制造	2,477	1,786	8.88%
恒瑞医药	600276.SH	医学制造	1,425	744	4.14%
上汽集团	600104.SH	汽车制造	3,628	880	3.18%
青岛海尔	600690.SH	电器机械制造	918	450	2.38%
安信信托	600816.SH	其他金融业	619	228	1.37%
网宿科技	300017.SZ	信息技术服务	290	170	1.31%
科大讯飞	002230.SZ	信息技术服务	554	366	1.24%
航天信息	600271.SH	电子设备制造	384	201	1.17%
万达电影	002739.SZ	影视录音制作业	599	215	1.16%
汇川技术	300124.SZ	电器机械制造	425	237	1.09%
<b>合计</b>			<b>11,319</b>	<b>5,277</b>	<b>25.92%</b>

<sup>3</sup> 行业分类参照财新新经济行业分类(2016)

<sup>4</sup> 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)。