



Russell 1000® Universe

2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017*
Highest index returns														
Size 44.39	Yield Focused 25.41	Momentum Focused 16.97	Yield 22.72	Quality 11.56	Low Volatility Focused -27.04	Yield Focused 42.84	Size 27.76	Yield 11.06	Yield Focused 19.20	Momentum Focused 40.21	Low Volatility Focused 19.16	Volatility 3.06	Yield Focused 23.35	Quality 28.07
Momentum Focused 34.49	Low Volatility Focused 23.34	Comprehensive 15.28	Yield Focused 20.70	Momentum 9.13	Volatility -31.10	Size 41.73	Momentum Focused 25.62	Volatility 8.46	Size 19.19	Comprehensive 38.15	Volatility 15.85	Momentum 2.69	Value 18.66	Momentum 22.83
Low Volatility Focused 31.48	Comprehensive 21.33	Size 11.08	Value 19.43	Momentum Focused 7.09	Quality -31.14	Momentum Focused 37.34	Comprehensive 23.59	Quality 8.46	Value 18.82	Low Volatility Focused 37.56	Comprehensive 14.89	Quality 2.11	Yield 17.37	Russell 1000 21.69
Comprehensive 31.40	Momentum Focused 20.45	Low Volatility Focused 10.55	Volatility 18.29	Comprehensive 5.89	Comprehensive -31.37	Low Volatility Focused 32.21	Low Volatility Focused 23.49	Comprehensive 6.31	Momentum Focused 17.25	Size 36.60	Yield 14.03	Low Volatility Focused 2.08	Low Volatility Focused 16.22	Momentum Focused 21.07
Value 29.99	Size 18.00	Momentum 9.21	Low Volatility Focused 16.78	Russell 1000 5.77	Yield Focused -32.23	Comprehensive 32.17	Yield Focused 23.00	Low Volatility Focused 6.17	Low Volatility Focused 16.93	Value 36.38	Quality 13.33	Comprehensive 2.00	Size 15.99	Comprehensive 20.22
Yield Focused 29.94	Value 16.64	Value 8.35	Comprehensive 15.85	Value 3.92	Yield -32.46	Russell 1000 28.43	Value 20.13	Yield Focused 4.90	Comprehensive 16.51	Yield Focused 36.15	Russell 1000 13.24	Russell 1000 0.92	Comprehensive 13.07	Volatility 20.00
Russell 1000 29.89	Yield 12.79	Quality 7.54	Russell 1000 15.46	Volatility 3.70	Momentum Focused -35.95	Quality 26.72	Yield 17.34	Momentum Focused 3.70	Russell 1000 16.42	Momentum 33.58	Value 12.88	Yield 0.04	Momentum Focused 12.72	Value 19.74
Momentum 26.92	Volatility 11.77	Yield Focused 6.63	Momentum 14.59	Size 3.48	Momentum -36.66	Value 24.90	Momentum 17.07	Momentum 2.28	Quality 16.09	Russell 1000 33.11	Momentum 12.65	Momentum Focused -0.70	Russell 1000 12.05	Size 18.25
Yield 25.26	Momentum 11.64	Russell 1000 6.27	Momentum Focused 14.45	Low Volatility Focused 2.93	Value -36.74	Momentum 22.44	Russell 1000 16.10	Value 1.80	Momentum 15.45	Quality 31.66	Yield Focused 12.62	Size -2.26	Volatility 11.56	Low Volatility Focused 18.22
Quality 24.21	Russell 1000 11.40	Volatility 4.24	Quality 14.30	Yield 1.99	Size -37.58	Volatility 17.85	Quality 14.55	Russell 1000 1.50	Volatility 13.25	Volatility 29.61	Momentum Focused 12.30	Value -3.34	Quality 10.71	Yield 15.96
Volatility 20.59	Quality 10.50	Yield 3.85	Size 14.26	Yield Focused -2.26	Russell 1000 -37.60	Yield 17.02	Volatility 11.83	Size -1.17	Yield 11.84	Yield 28.60	Size 11.32	Yield Focused -7.49	Momentum 7.94	Yield Focused 15.64
Lowest index returns														

*来源： FTSE Russell. Data as of December 29, 2017. 下面表格列出了子图中所引用此性能的指数，包括他们的的启动日期。在此日期之前的任何回报都是模拟的。

下面表格列出了子图中所引用此性能的指数，包括他们的的启动日期。在此日期之前的任何回报都是模拟的。

指数	发布月份	指数	发布月份	指数	发布月份
Russell 1000 Comprehensive Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Quality Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Index	Dec-1978
Russell 1000 Low Volatility Focused Factor Index	Nov-2015	Russell 1000 Size Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Yield Factor Index	Sep-2015
Russell 1000 Momentum Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Value Factor Index	Sep-2015	Russell 1000 Yield Focused Factor Index	Nov-2015
Russell 1000 Momentum Focused Factor Index	Nov-2015	Russell 1000 Volatility Factor Index	Sep-2015		



Russell 1000® Universe

有关我们指数的更多信息，请访问：ftserussell.com

© 2017年伦敦证券交易所集团公司及其附属企业("LSE Group")。LSE Group包含(1)FTSE International Limited ("FTSE")、(2) Frank Russell Company ("Russell")、(3) FTSE TMX Global Debt Capital Markets Inc. 及FTSE TMX Global Debt Capital Markets Limited (合称"FTSE TMX") 和(4) MTSNext Limited ("MTSNext")。版权所有。

FTSE Russell®为FTSE、Russell、FTSE TMX和MTS Next Limited的商号名称。"FTSE®"、"Russell®"、"FTSE Russell®"、"MTS®"、"FTSE TMX®"、"FTSE4Good®" 及"ICB®" 和本文使用的全部其他商标与服务标记（不论是否已经注册）均为LSE Group附属企业或其相关特许人持有或许可的商标和/或服务标记，并由FTSE、Russell、MTSNext或FTSE TMX持有或由其授权使用。

所有信息只作说明用途。虽已尽力确保本文所提供的全部信息准确，但LSE Group任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人概不就本文任何错误或由于使用本文或其所载的任何信息或数据而引起的任何损失承担责任。

LSE Group任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人概不就使用[插入指数名称] [指数]产生的后果或出于任何特定目的而使用 [指数] 的适用性或适合性，做出任何明示或暗示的声明、预测、保证或陈述。

LSE Group任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人并不提供任何投资建议，且本[通信] 文件中的内容亦不得作为任何理财或投资的建议。LSE Group任何成员公司或其各自的董事、主管人员、雇员、合伙人或特许人并不就投资任何资产提供意见。不应依赖本文任何信息做出投资某类资产的决定。不能直接投资于指数。把资产纳入指数并不代表建议购买、出售或持有该资产。不应在未取得经过认证的专业人士提供具体法律、税务和投资建议的情况下，根据本文所载的一般信息行事。

未预先取得LSE Group附属企业的书面同意，任何人士不得以任何形式或以任何手段、电子、机械、影印、录制或其他方法，复制、储存于检索系统或传送本文件的任何部份。如要使用及发布LSE Group的指数数据和使用其指数开发金融产品，必须取得FTSE、Russell、FTSE TMX、MTSNext和/或其特许人的授权。

过往表现并非未来业绩的保证。所提供的图表只作说明用途。所显示的指数回报未必代表可投资资产的实际交易结果。个别显示的回报可能反映回溯测试表现。所有在指数成立日期前的表现均为回溯测试表现。回溯测试表现并非实际表现，而是假设表现。回溯测试的计算方法与指数正式推出时所使用的计算方法相同。不过，回溯测试数据可能在参考事后认识的情况下应用指数计算方法，而指数的过往计算结果或会按月出现转变，主要受到修订计算指数时所用的相关经济数据所影响。