

# MSCI 신흥국 지수 (USD)

MSCI 신흥국 지수는 23개의 신흥시장 국가를 대표하는 대형주와 중형주로 구성되어 있습니다. 이 지수는 837 개의 주식들로 이루어져 있으며 각 국의 유통량을 기준으로 조정된 시가총액의 약 85%를 다룹니다.

지수누적성과 - 총수익률(USD)(2001년2월 - 2016년2월)



연간실적(%)

연도	MSCI 신흥국 지수 (MSCI EM)	MSCI 전세계지수 (MSCI ACWI)	MSCI 투자가능한 전세계지수-소형주포함 (MSCI ACWI IMI)
2015	-14.60	-1.84	-1.68
2014	-1.82	4.71	4.36
2013	-2.27	23.44	24.17
2012	18.63	16.80	17.04
2011	-18.17	-6.86	-7.43
2010	19.20	13.21	14.87
2009	79.02	35.41	37.18
2008	-53.18	-41.85	-42.01
2007	39.82	12.18	11.66
2006	32.55	21.53	21.49
2005	35.54	11.37	12.06
2004	25.95	15.75	16.93
2003	56.28	34.63	36.18
2002	-6.00	-18.98	-17.26

지수성과 - 총수익률 (%) (2016년 2월 29일)

Index	1 Mo	3 Mo	1Y	YTD	연간으로 환산한 수익률			기초조건 (2016년2월29일)				
					3Y	5Y	10Y	1994년 5월 31일이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 신흥국 지수 (MSCI EM)	-0.15	-8.65	-23.13	-6.62	-8.58	-5.08	2.15	4.44	3.01	12.61	10.89	1.32
MSCI 전세계지수 (MSCI ACWI)	-0.63	-8.25	-11.83	-6.60	4.22	4.27	4.10	6.43	2.81	16.97	14.42	1.89
투자가능한 전세계지수-소형주포함 (MSCI ACWI IMI)	-0.47	-8.38	-11.79	-6.68	4.27	4.28	4.28	6.39	2.73	17.73	14.68	1.84

\* EM(Emerging Market 신흥시장)에 포함되는 나라: 브라질, 칠레, 중국, 콜롬비아, 체코, 이집트, 그리스, 헝가리, 인도, 인도네시아, 말레이시아, 멕시코, 페루, 필리핀, 폴란드, 러시아, 카타르, 남아프리카공화국, 대만, 태국, 터키 그리고 아랍에미리트.

MSCI 신흥시장 지수는 1988년 6월 30일에 발표되었습니다. 출시 날짜 이전의 데이터는 백 테스트(back-tested) 데이터입니다 (즉, 인덱스가 그 기간에 존재했다는 가정하에 실적이 어떻게 나왔는지를 계산합니다). 백 테스트(back-tested) 결과와 실제 실적 사이에 실질적 차이가 종종 발생합니다. 과거실적--실제 또는 백 테스트(back-tested)--은 미래실적을 예시하거나 보장하지 않습니다.

## 지수 위험과 수익률 특성 (2016년 2월 29일)

	매매회전율 (%)	매매회전율 (%)			샤프지수				최대낙폭	
		3Y	5Y	10Y	3Y	5Y	10Y	1994년 5월 31일 이후	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI 신흥국 지수 (MSCI EM)	8.49	14.61	17.96	23.46	-0.55	-0.21	0.15	0.38	65.14	2007-10-29 — 2008-10-27
MSCI 전세계지수 (MSCI ACWI)	3.05	11.36	13.34	16.93	0.40	0.36	0.24	0.29	58.06	2007-10-31 — 2009-03-09
투자가능한 전세계지수-소형주포함 (MSCI ACWI IMI)	2.88	11.31	13.42	17.13	0.41	0.36	0.25	0.29	58.28	2007-10-31 — 2009-03-09

<sup>1</sup> 12개월

<sup>2</sup> 월간 총 수익률을 바탕으로 함

<sup>3</sup> BBA 라이브 1개월 수치를 바탕으로 함

## 지수특성

MSCI 유럽	
종목수	835
시가총액(USD 백만)	
지수	3,206,372.76
최대	110,449.13
최소	335.75
평균	3,839.97
중간값	1,968.99

## 상위 10 종목

	국가	시가총액 (USD 십억)	지수비중 (%)	산업분야
대만 TSMC	TW	110.45	3.44	정보기술
삼성전자(주)	KR	105.23	3.28	정보기술
텐센트 홀딩스	CN	94.34	2.94	정보기술
차이나 모바일	CN	64.93	2.03	통신서비스
중국건설은행 H	CN	49.24	1.54	금융
나스퍼스 N	ZA	47.58	1.48	자유소비재
중국공상은행(ICBC) H	CN	36.43	1.14	금융
알리바바 그룹 홀딩스 ADG	CN	34.58	1.08	정보기술
홍하이 정밀공업 주식회사	TW	33.78	1.05	정보기술
인포시스	CN	29.73	0.93	금융
총계		606.29	18.91	

산업분야별 비중

국가별 비중



- 금융 27.01%
- 정보기술 20.81%
- 자유소비재 9.79%
- 필수소비재 8.49%
- 에너지 7.47%
- 통신서비스 7.08%
- 산업재 6.9%
- 소재 6.46%
- 유틸리티 3.22%
- 중국 24.28%
- 한국 15.41%
- 대만 12.91%
- 건강관리 2.77%
- 인도 8.05%
- 남아프리카공화국 6.92%
- 기타 32.43%

**INDEX METHODOLOGY**

이 지수는 MSCI 글로벌 투자 가능 시장 지수(GIMI) 방법론에 기반을 두고 있습니다. GIMI 방법론은 종합적이고 일관적인 지수 산출 방식으로 거시적 국제적 관점을 반영하며 지역 간 다양한 시가총액 크기, 사업군 및 스타일 비교를 가능하게 합니다. 이 방법론은 관련 투자 기회의 빈틈없는 범위를 제공하는 것이 목적으로써 지수 유동성, 투자가능여부와

복제(추종) 가능성에 큰 중점을 두고 설정합니다. 이 지수는 2월,5월,8월 그리고 11월 분기별로 검토하고 있으며 주식시장의 변화를 신속하게 반영하되 지수의 지나친 턴오버는 제한하는것을 목표로 삼고 있습니다. 지수는 반기지수검토기간인 5월과 11월동안에 재조정되며 대형주 및 중형주 경계점이 다시 계산됩니다.

**ABOUT MSCI**

For more than 40 years, MSCI's research-based indexes and analytics have helped the world's leading investors build and manage better portfolios. Clients rely on our offerings for deeper insights into the drivers of performance and risk in their portfolios, broad asset class coverage and innovative research. Our line of products and services includes indexes, analytical models, data, real estate benchmarks and ESG research. MSCI serves 97 of the top 100 largest money managers, according to the most recent P&I ranking. For more information, visit us at [www.msci.com](http://www.msci.com).

The information contained herein (the "Information") may not be reproduced or disseminated in whole or in part without prior written permission from MSCI. The Information may not be used to verify or correct other data, to create indexes, risk models, or analytics, or in connection with issuing, offering, sponsoring, managing or marketing any securities, portfolios, financial products or other investment vehicles. Historical data and analysis should not be taken as an indication or guarantee of any future performance, analysis, forecast or prediction. None of the Information or MSCI index or other product or service constitutes an offer to buy or sell, or a promotion or recommendation of, any security, financial instrument or product or trading strategy. Further, none of the Information or any MSCI index is intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such. The Information is provided "as is" and the user of the Information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the Information. NONE OF MSCI INC. OR ANY OF ITS SUBSIDIARIES OR ITS OR THEIR DIRECT OR INDIRECT SUPPLIERS OR ANY THIRD PARTY INVOLVED IN THE MAKING OR COMPILING OF THE INFORMATION (EACH, AN "MSCI PARTY") MAKES ANY WARRANTIES OR REPRESENTATIONS AND, TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, EACH MSCI PARTY HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING WARRANTIES OF MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING AND TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, IN NO EVENT SHALL ANY OF THE MSCI PARTIES HAVE ANY LIABILITY REGARDING ANY OF THE INFORMATION FOR ANY DIRECT, INDIRECT, SPECIAL, PUNITIVE, CONSEQUENTIAL (INCLUDING LOST PROFITS) OR ANY OTHER DAMAGES EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES. The foregoing shall not exclude or limit any liability that may not by applicable law be excluded or limited.