

# MSCI 한국 모멘텀 지수 (KRW)

MSCI 한국 모멘텀 지수는 MSCI 한국 지수를 기반으로 하며 한국시장의 대형주 및 중형주를 캡처해 내는 기본지수입니다. MSCI 한국 모멘텀 지수는 높은 거래 유동성, 투자 능력 및 적절한 지수 회전율을 유지하면서 높은 모멘텀 가격을 가진 유가증권을 강조함으로써 주식의 모멘텀 전략 성과를 반영하도록 설계되었습니다.

## 지수누적성과 - 총수익률(KRW)(2001년 5월 - 2016년 5월)



## 연간실적(%)

연도	MSCI 한국모멘텀지수	MSCI 한국지수
2015	27.48	-0.04
2014	0.85	-6.99
2013	6.10	2.70
2012	11.65	12.89
2011	0.90	-10.43
2010	33.48	23.92
2009	44.93	59.08
2008	-36.16	-39.54
2007	72.49	33.45
2006	4.70	4.14
2005	68.58	54.29
2004	5.43	6.74
2003	49.38	36.57
2002	-5.55	-1.92

## 지수성과 - 총수익률 (%) (2016년 5월 31일)

Index	1 Mo	3 Mo	1Y	YTD	연간으로 환산한 수익률			기초조건 (2016년 5월 31일)				
					3Y	5Y	10Y	1995년 5월 31일이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 한국모멘텀지수	1.58	4.44	3.92	-0.26	11.01	3.12	13.52	9.15	1.12	22.96	17.29	2.70
MSCI 한국지수	-0.31	4.33	-4.14	1.47	-1.10	-1.42	5.24	7.37	1.80	10.58	10.14	0.92

MSCI 한국 모멘텀 지수는 2013년 12월 11일에 발표되었습니다. 출시 날짜 이전의 데이터는 백테스트(back-tested) 데이터입니다(즉, 인덱스가 그 기간에 존재했다는 가정하에 실적이 어떻게 나왔는지를 계산합니다). 백 테스트(back-tested) 데이터와 실제 결과 사이에 실질적 차이가 종종 나타납니다. 과거실적--실제 또는 백 테스트(back-tested)--은 미래실적을 예시하거나 보장하지 않습니다.

## 지수위험과 수익률특성(1995년5월31일-2016년5월31일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전을 (%)	연간표준편차 (%)			최대낙폭	
				3Y	5Y	10Y	%	기간 YYYY-MM-DD
<b>MSCI</b> 한국모멘텀지수	<b>0.98</b>	<b>14.36</b>	<b>108.23</b>	<b>13.94</b>	<b>14.55</b>	<b>23.13</b>	<b>55.59</b>	<b>2007-11-06 — 2008-10-24</b>
<b>MSCI 한국지수</b>	<b>1.00</b>	<b>0.00</b>	<b>3.95</b>	<b>10.91</b>	<b>13.22</b>	<b>18.41</b>	<b>52.71</b>	<b>2007-10-11 — 2008-11-20</b>

<sup>1</sup> 12개월

<sup>2</sup> 월간 총 수익률을 바탕으로 함

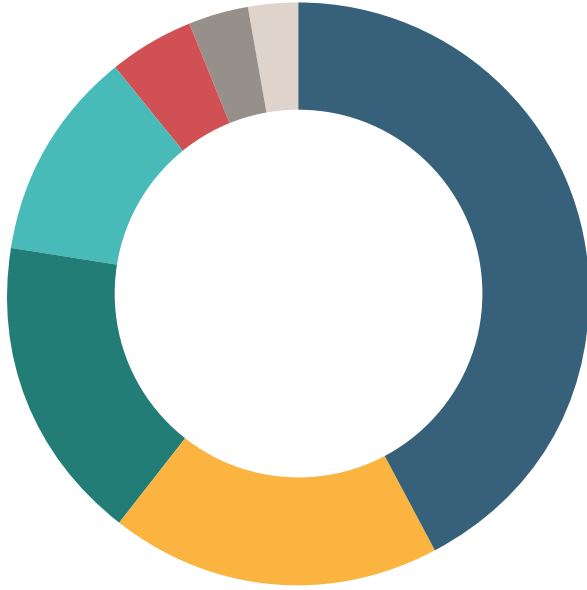
## 지수특성

	<b>MSCI</b> 한국모멘텀지수	<b>MSCI</b> 한국지수
종목수	<b>25</b>	<b>107</b>
	비중(%)	
최대	<b>13.12</b>	<b>22.33</b>
최소	<b>1.03</b>	<b>0.09</b>
평균	<b>4.00</b>	<b>0.93</b>
중간값	<b>2.73</b>	<b>0.42</b>

## 상위 10 종목

	지수비중 (%)	기본지수비중 (%)	산업분야
케이티앤지 (한국담배인삼공사)	13.12	2.19	필수소비재
LG화학	10.59	1.97	소재
아모레퍼시픽(NEW)	9.41	2.10	필수소비재
엘지생활건강	9.02	1.55	필수소비재
한미약품(NEW)	6.46	0.52	건강관리
한국항공우주산업	5.72	0.61	산업재
셀트리온	4.44	1.07	건강관리
한미사이언스	3.52	0.28	건강관리
BGF리테일	3.17	0.30	필수소비재
씨제이(주)	2.88	0.49	산업재
<b>총계</b>	<b>68.32</b>	<b>11.08</b>	

## 산업분야별 비중



- 필수소비재 42.42%
- 소재 18.29%
- 건강관리 17.03%
- 산업재 11.55%
- 금융 4.61%
- 자유소비재 3.43%
- 에너지 2.67%

## 지수 방법론

모멘텀의 가치는 최근 주식의 12개월 및 6개월간의 지역 가격 성능을 결합하여 MSCI 기본지수 각 주식을 위해 결정됩니다. 이 모멘텀 가치는 주식의 모멘텀 점수를 결정하기 위해 리스크 조정을 합니다. 가장 높은 모멘텀 점수를 가진 고정된 수의 유가증권은 일반적으로 기본지수의 시가총액의 30%를 커버하며 각 MSCI 모멘텀 지수에 포함됩니다. 지수의 구성요소는 시가총액 및 모멘텀 스코어의 상중에 의해 가중됩니다. 광범위한 MSCI 모멘텀 지수를 위해 성분 비중을 5%로 제한하고 있습니다. 이 지수는 반기별로 재조정되고 있으며, 또한 시장변동성의 급증에 의해 일어나며 임시 재조정이 발생할 수 있습니다.

## 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.

©2016 MSCI Inc. All rights reserved | CFS0916