

# MSCI 한국 리스크 가중지수 (KRW)

**MSCI** 한국 리스크 가중지수는 기본지수에 가중된 기존의 시가총액을 기반으로 하며, 한국의 대형주와 중형주를 포함하고 있는 **MSCI** 한국 지수입니다. 낮은 위험률을 가진 주식은 보다 높은 지수 가중치가 부여되기 위해서 단순한 구성이지만 효과적이고 투명한 프로세스를 사용하여 **MSCI** 한국 리스크 가중지수는 기본지수의 각 유가증권으로 재가중됩니다. 합리적인 유동성 및 능력을 유지하면서 이 지수는 역사적으로 기본지수에 비해 낮은 실현 변동성을 나타냅니다.

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



## 연간실적(%)

연도	MSCI 한국 리스크 가중지수	MSCI 한국지수
2015	3.46	-0.04
2014	-2.68	-6.99
2013	5.76	2.70
2012	9.72	12.89
2011	-10.35	-10.43
2010	28.34	23.92
2009	50.71	59.08
2008	-37.37	-39.54
2007	40.42	33.45
2006	9.11	4.14
2005	70.51	54.29
2004	15.57	6.74
2003	51.40	36.57
2002	-7.86	-1.92

## 지수성과 - 총수익률 (%) (2016년 5월 31일)

Index	1 Mo	3 Mo	1Y	YTD	연간으로 환산한 수익률			1995년 5월 31일 이후	기초조건 (2016년 5월 31일)			
					3Y	5Y	10Y		배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 한국 리스크 가중지수	-1.98	3.34	-6.29	1.93	2.49	0.80	7.36	5.99	1.91	14.97	10.61	0.86
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 한국리스크가중지수는 2012년 1월 16일에 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(1995년 5월 31일-2016년 5월 31일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전을 (%)	연간표준편차 (%)			최대낙폭	
				3Y	5Y	10Y	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI 한국 리스크 가중지수	0.96	12.27	29.56	9.84	11.42	17.76	51.20	2007-10-11 — 2008-10-24
MSCI 한국지수	1.00	0.00	3.95	10.91	13.22	18.41	52.71	2007-10-11 — 2008-11-20

<sup>1</sup> 12개월  
<sup>2</sup> 월간 총 수익률을 바탕으로 함

지수특성

	MSCI 한국 리스크 가중지수	MSCI 한국지수
종목수	107	107
비중(%)		
최대	2.48	22.33
최소	0.17	0.09
평균	0.93	0.93
중간값	0.81	0.42

상위10 종목

	지수비중 (%)	기본지수비중 (%)	산업분야
SK TELECOM CO	2.48	0.70	통신서비스
KT&G CORP (KOREA TOBACCO)	2.05	2.19	필수소비재
POSCO	1.90	2.27	소재
KT CORP	1.81	0.16	통신서비스
SAMSUNG CARD CO	1.71	0.21	금융
HANWHA LIFE INSURANCE	1.69	0.22	금융
LG CORP (NEW)	1.67	0.98	산업재
KB FINANCIAL GROUP	1.67	2.06	금융
SAMSUNG FIRE & MARINE	1.56	1.54	금융
HYUNDAI MARINE & FIRE	1.55	0.31	금융
총계	18.08	10.64	

## 산업분야별 비중

## 지수 방법론

각 MSCI 리스크 가중지수는 기본지수에 가중된 시가총액 구성요소의 재가중을 통해 구성됩니다. 기본지수의 각 유가증권에 리스크 가중치를 이끌어내기 위해 유가증권의 3년동간의 주간별 과거 지역 수익률을 첫번째로 산출합니다. 위험 가중치는 기본지수의 모든 구성요소의 증권 분산 역수의 합에 대한 증권분산 역수의 비율로 계산됩니다. 이 지수는 반기별 5월 및 11월에 재조정됩니다.



금융 22.37%	산업재 18.27%	자유소비재 16.39%
필수소비재 12.45%	소재 8.82%	정보기술 8.6%
통신서비스 5.05%	에너지 3.85%	유틸리티 2.42%
건강관리 1.78%		

## 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