

# MSCI 한국동일비중지수 (KRW)

MSCI 한국동일가중치지수는 기본지수에 가중된 시가총액에 대한 대체 가중 계획을 나타내는 MSCI 한국 지수입니다. 이 지수는 한국시장의 대형주 및 중형주와 같이 기존지수와 같은 구성요소를 포함하고 있습니다. 그러나 각 분기별 재조정일에 모든 지수의 구성요소는 동등하게 가중되며, 효과적으로 각 성분의 시가(높거나 낮은)의 영향을 제거합니다. 재조정하는 동안 지수 구성 비중은 가격 성능으로 인해 변동할 것입니다.

## 지수누적성과 - 총수익률(KRW)(2001년 1월 - 2016년 6월)



## 연간실적(%)

연도	MSCI 한국동일비중지수	MSCI 한국지수
2015	4.10	-0.04
2014	-5.79	-6.99
2013	3.49	2.70
2012	8.93	12.89
2011	-16.88	-10.43
2010	31.04	23.92
2009	52.47	59.08
2008	-41.55	-39.54
2007	49.36	33.45
2006	10.20	4.14
2005	73.71	54.29
2004	9.69	6.74
2003	48.79	36.57
2002	-11.57	-1.92

## 지수성과 - 총수익률 (%) (2016년 6월 30일)

Index	1 Mo	3 Mo	1Y	YTD	연간으로 환산한 수익률			기초조건 (2016년 2월 29일)				
					3Y	5Y	10Y	1998년 12월 31일 이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 한국동일비중지수	-3.30	-3.23	-7.05	-0.68	2.83	-2.23	6.40	9.61	1.62	17.78	11.19	0.90
MSCI 한국지수	0.62	-0.50	0.08	2.10	1.60	-0.70	5.45	10.42	1.78	10.31	10.11	0.93

MSCI 한국동일비중지수는 2013년 7월 12일에 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(1998년 12월 31일-2016년 6월 30일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전을 (%)	연간표준편차 (%)			최대낙폭	
				3Y	5Y	10Y	%	기간 YYYY-MM-DD
<b>MSCI</b> 한국동일비중지수	1.02	12.39	30.58	10.05	13.61	21.01	58.80	2007-11-06 — 2008-10-27
<b>MSCI</b> 한국지수	1.00	0.00	4.86	10.06	13.15	18.40	52.71	2007-10-11 — 2008-11-20

<sup>1</sup> 12개월

<sup>2</sup> 월간 총 수익률을 바탕으로 함

## 지수특성

	<b>MSCI</b> 한국동일비중지수	<b>MSCI</b> 한국지수
종목수	107	107
	비중(%)	
최대	1.21	22.95
최소	0.09	0.11
평균	0.93	0.93
중간값	0.97	0.38

## 상위 10 종목

	지수비중 (%)	기본지수비중 (%)	산업분야
SK HYNIX	1.21	2.99	정보기술
HANMI PHARM CO (NEW)	1.16	0.58	건강관리
KOREA AEROSPACE IND	1.15	0.68	산업재
HYOSUNG CORP	1.11	0.42	소재
S1 CORPORATION	1.10	0.33	산업재
KT&G CORP (KOREA TOBACCO)	1.10	2.53	필수소비재
POSCO DAEWOO	1.09	0.18	산업재
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	1.09	0.22	산업재
SAMSUNG CARD CO	1.09	0.23	금융
KOREA ZINC	1.08	0.68	소재
총계	11.18	8.84	

## 산업분야별 비중



- 산업재 21.9%
- 금융 17.56%
- 자유소비재 16.66%
- 필수소비재 12.99%
- 정보기술 10%
- 소재 8.98%
- 건강관리 4.22%
- 통신서비스 2.89%
- 에너지 2.8%
- 유틸리티 2%

## INDEX METHODOLOGY

각 MSCI 동일가중지수는 기본지수에 가중된 시가총액과 같은 구성요소를 포함하며, 기본지수의 분기 및 반기별 인덱스 리뷰와 같으며 2월, 5월, 8월 및 11월에 재조정됩니다. 기업 이벤트 또한 일반적으로 기본지수와 동일가중지수에 동시 반영됩니다. 그러나 모든 동일가중지수의 구성요소들은 각 분기별 재조정일에 동일하게 가중됩니다. 이는 지수평가에

더 우세한 영향을 주는 대형주의 구성요소를 가진 기본지수에 비하여 소형주 지수 구성요소에 대해선 큰 위험을 주는 경향을 가지고 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