

MSCI 한국가치가중지수 (KRW)

MSCI 한국가치가중지수는 기본지수에 가중된 기존의 시가총액을 기반으로 하며, 한국의 대형주와 중형주를 포함하고 있는 MSCI 한국 지수입니다. MSCI 한국가치가중지수는 보다 낮은 평가를 통해 주식을 강조하기 위해 기본지수의 각 유가증권을 재가중됩니다. 이 지수의 가중치는 기초회계데이터를 사용하여 시장가격(시가)보다는 매출, 주당순자산, 수익 및 현금수익이 결정됩니다.

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



연간실적(%)

연도	MSCI 한국가치가중지수	MSCI 한국지수
2015	-2.59	-0.04
2014	-8.56	-6.99
2013	4.14	2.70
2012	12.71	12.89
2011	-13.05	-10.43
2010	26.84	23.92
2009	69.27	59.08
2008	-38.25	-39.54
2007	32.26	33.45
2006	6.67	4.14
2005	54.88	54.29
2004	12.55	6.74
2003	41.01	36.57
2002	5.28	-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 11월 30일 이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 한국가치가중지수	-1.16	4.76	-3.28	2.96	-1.53	-1.60	5.82	8.09	2.10	10.29	8.70	0.72
MSCI 한국지수	-0.31	4.33	-4.14	1.47	-1.10	-1.42	5.24	7.24	1.80	10.58	10.14	0.92

MSCI 한국가치가중지수는 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 11월 30일-2016년 5월 31일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전을 (%)	연간표준편차 (%)			최대낙폭	
				3Y	5Y	10Y	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI 한국가치가중지수	1.03	5.89	16.42	12.39	14.18	19.18	51.52	2007-10-11 — 2008-11-20
MSCI 한국지수	1.00	0.00	3.95	10.91	13.22	18.41	52.71	2007-10-11 — 2008-11-20

¹ 12개월

² 월간 총 수익률을 바탕으로 함

지수특성

	MSCI 한국가치가중지수	MSCI 한국지수
종목수	107	107
	비중(%)	
최대	26.86	22.33
최소	0.01	0.09
평균	0.93	0.93
중간값	0.31	0.42

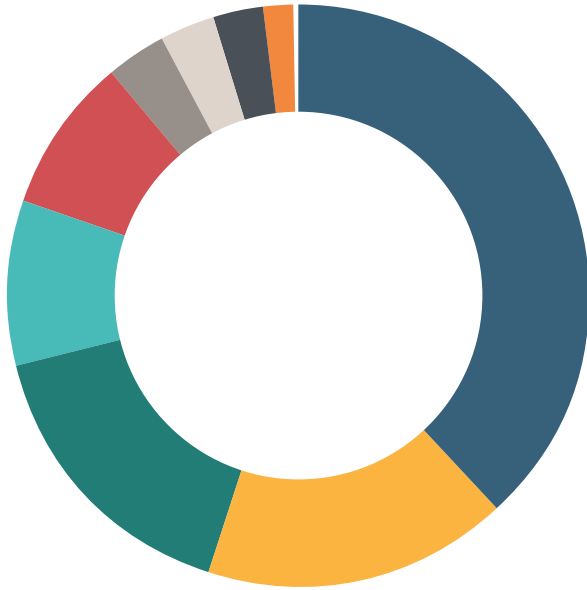
상위 10 종목

	지수비중 (%)	기본지수비중 (%)	산업분야
삼성전자주식회사	26.86	22.33	정보기술
현대자동차주식회사	5.10	3.36	자유소비재
포스코	4.98	2.27	소재
삼성전자우	4.66	3.41	정보기술
신한금융그룹	3.30	2.64	금융
KB금융그룹	3.16	2.06	금융
현대모비스	2.95	2.72	자유소비재
하나금융지주	2.65	1.20	금융
SK하이닉스	2.50	2.61	정보기술
기아자동차	2.48	1.92	자유소비재
총계	58.62	44.52	

산업분야별 비중

지수 방법론

각 MSCI 가치가중지수는 MSCI 기본지수에 가중된 시가총액으로부터 구성됩니다. MSCI 가치가중지수 방법론은 매출, 장부 가액(복밸류), 수익 및 현금수익 이 4가지 회계변수에 따라서 기본지수의 재가중된 각 구성요소에 의해 낮은 평가를 받은 주식쪽으로 기본지수를 효과적으로 기울입니다. 가치가중지수는 첫번째로 각 구성성분에 대한 각 회계변수의 가중치(또는 3년의 평균 가중치)를 독립적으로 산출합니다. 이러한 가중치들은 최종 구성요소 레벨의 가치 가중치 결정을 위해 평균화됩니다. 이 지수는 5월 및 11월에 반기별로 재조정됩니다.



- 정보기술 38.26%
- 자유소비재 16.84%
- 금융 16.27%
- 소재 9.14%
- 산업재 8.48%
- 에너지 3.27%
- 필수소비재 3.04%
- 유틸리티 3.02%
- 통신서비스 1.43%
- 건강관리 0.26%

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.

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