

PRESS RELEASE

S&P DJI, S&P 모멘텀 지수를 통해 팩터 기반 지수 확대

새로운 지수군을 통해 투자자는 모멘텀 팩터를 정확하게 파악할 수 있다

2014년 12월 3일 뉴욕 - 금융 시장 지수의 전세계 선두적인 공급회사 중 하나인 S&P 다우존스지수 (S&P DJI) 는 오늘 S&P 모멘텀 지수의 출시를 발표했다. S&P 모멘텀 지수는 상대적 실적에서 지속성을 보여주며 전세계 주식 시장에서 증권의 실적을 측정하도록 설계된 완전히 새로운 팩터 기반의 지수군이다. 이번 출시는 모멘텀에 있어 중요하고 문서로 잘 정의된 팩터를 파악함으로써 S&P DJI 의 세계적 수준의 팩터 기반 지수를 보다 강화한다.

모멘텀 팩터는 과거 수익률을 기반으로 주식의 순위를 결정한 상대적 강점이 향후 2-12 개월의 상대적 실적을 예측한다는 이론을 반영한다. S&P 모멘텀 지수는 높은 리스크를 조정한 가격 수익률 모멘텀 스코어를 갖는 종목만으로 구성되어 있다. 룰 기반의 투명한 방법론을 통해 다양한 시장에서 모멘텀을 측정하면서 이와 동시에 합리적인 수준의 유동성, 역량, 회전율을 확보하는 것이 목표이다.

“기존에 구축한 팩터 기반의 지수에 S&P 모멘텀 지수를 추가하게 되어 자랑스럽게 생각한다”고 S&P DJI 의 전략 지수 담당 디렉터인 비닛 스리바스타바는 말한다. “기존 우리의 단일 팩터 지수에 대한 보완으로서 이번 최근 시리즈는 대체 베타 전략의 전략적 배분 포트폴리오에 내에서 모멘텀을 활용하려는 투자자에게 또는 시장 상황이 좋을 때 세부 전략에 있어 더 큰 선택 방안을 제공한다.

S&P 모멘텀 지수는 전세계 주식 시장 실적을 측정하는 룰 기반의 포괄적인 지수 S&P 글로벌 BMI 의 종목으로 구성되어 있다. 현재 S&P 모멘텀 지수군은 다음과 14 개 헤드라인 지수로 구성되어 있다:

1. S&P 모멘텀 글로벌 중대형주
2. S&P 모멘텀 선진국 중대형주
3. S&P 모멘텀 선진국 미국 제외 중대형주
4. S&P 모멘텀 선진국 일본 제외 중대형주
5. S&P 모멘텀 신흥국 중대형주
6. S&P 모멘텀 유럽 중대형주
7. S&P 모멘텀 아시아 중대형주
8. S&P 모멘텀 아시아 일본 제외 중대형주
9. S&P 모멘텀 일본 중대형주
10. S&P 모멘텀 미국 중대형주
11. S&P 모멘텀 중국 A-주식
12. S&P 모멘텀 남아프리카
13. S&P 500 모멘텀
14. S&P 유럽 350 모멘텀

보다 자세한 내용은 다음에서 확인한다: www.spdji.com.

S&P Dow Jones Indices에 관하여

The McGraw-Hill Companies의 자회사인 S&P Dow Jones Indices LLC는 지수 기반의 개념, 데이터, 연구를 위한 세계에서 가장 큰 글로벌 자원이다. S&P 500®, Dow Jones Industrial Average®와 같은 상징적인 금융 시장 지수의 출처인 S&P Dow Jones Indices LLC는 115년 이상 기관 투자자와 개인 투자자의 요구를 충족시키는 혁신적이고 투명한 솔루션을 만들어왔다. 더 많은 자산이 전세계 그 어떤 공급자보다 우리의 지수에 기반하여 상품에 투자되고 있다. 전세계 다양한 자산군을 다루는 100만 개 이상의 지수를 통해 S&P Dow Jones Indices LLC는 투자자가 시장을 가늠하고 거래하는 방식을 정의한다. S&P Dow Jones Indices LLC에 대한 보다 자세한 정보는 www.spdji.com을 참고한다.

S&P®는 McGraw Hill Financial의 일부인 Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P")의 등록 상표이다. Dow Jones®는 Dow Jones Trademark Holdings LLC("Dow Jones")의 등록 상표이다. 이들 상표는 S&P Dow Jones Indices LLC에게 라이선스를 부여하였다. 지수에 직접 투자하는 것은 가능하지 않다. S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P, 이들의 각 계열사(총괄적으로 "S&P Dow Jones Indices")는 제3자가 지수의 실적에 기반하여 투자 수익률을 제공하려는 투자 펀드 또는 기타 투자 수단을 후원, 지지, 판매, 홍보하지 않는다. 본 문서는 S&P Dow Jones Indices가 필요한 라이선스를 갖고 있지 않은 지역에서 서비스 제안에 해당되지 않는다. S&P Dow Jones Indices는 지수를 제3자에게 라이선스 부여하는 것과 관련하여 보수를 받는다.

보다 자세한 사항은 아래로 연락바랍니다:

Beomsuk Kim
Head of S&P Dow Jones Indices, Korea
beomsuk_kim@spdji.com
+82 2 2022-2311

Alex Yang
Communications Manager, Asia Pacific
S&P Dow Jones Indices
(+852) 2532 8001
alex.yang@spdji.com