

MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수 (USD)

MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수는 기존지수로서 **MSCI** 전세계지수를 기반으로 합니다 또한 23개의 선진시장 및 **23**개의 신흥시장 국가들의 대형주와 중형주를 포함합니다. 이 지수는 저탄소 경제의 변화와 관련된 잠재적인 위험을 관리 받고 싶어하는 투자자들을 위한 벤치마크입니다. 이 지수는 탄소 배출을 최소화하면서 추적오차 타겟의 **0.3% (0.3퍼센트)** 를 목표로 합니다. 낮은 탄소 배출(매출 기준)과 잠재적 저탄소 배출 (달러 당 시가총액) 기업 비중의 확대에 결과로, 이 지수는 광범위한 시장의 낮은 탄소 배출을 반영합니다. 이 지수는 **MSCI ESG** 리서치의 **MSCI ESG** 탄소지표 데이터를 사용합니다.

지수누적성과 - 총수익률(USD)(2010년 11월 - 2016년 2월)



연간실적(%)

연도	MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수	MSCI 전세계 지수
2015	-1.29	-1.84
2014	4.96	4.71
2013	23.56	23.44
2012	17.84	16.80
2011	-6.72	-6.86

지수성과 - 총수익률 (%) (2016년 2월 29일)

Index	1 Mo	3 Mo	1Y	YTD	연간으로 환산한 수익률				기초조건 (2016년 2월 29일)			
					3Y	5Y	10Y	2010년 11월 30일 이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수	-0.71	-8.35	-11.56	-6.73	4.44	4.71	NA	6.74	2.79	16.80	14.13	1.95
MSCI 전세계 지수	-0.63	-8.25	-11.83	-6.60	4.22	4.27	NA	6.38	2.81	16.97	14.42	1.89

* DM[Developed Market 선진시장] 포함되는 나라: 호주, 오스트리아, 벨기에, 캐나다, 덴마크, 핀란드, 프랑스, 독일, 홍콩, 아일랜드, 이스라엘, 이탈리아, 일본, 네덜란드, 뉴질랜드, 노르웨이, 포르투갈, 싱가포르, 스페인, 스웨덴, 스위스, 영국 그리고 미국.

* EM[Emerging Market 신흥시장]에 포함되는 나라: 브라질, 칠레, 중국, 콜롬비아, 체코, 이집트, 그리스, 헝가리, 인도, 인도네시아, 한국, 말레이시아, 멕시코, 페루, 필리핀, 폴란드, 러시아, 카르타, 남아프리카 공화국, 대만, 태국, 터키 그리고 아랍 에미리트.

MSCI전세계 저탄소 타겟 지수는 2014년 9월 23일에 발표되었습니다. 출시 날짜 이전의 데이터는 백테스트(Back-tested) 데이터입니다(즉, 인덱스가 그 기간에 존재했다는 가정하에 실제로 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.

지수 위험고 수익률 특성(2010년 11월 30일 – 2016년 2월 29일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전율 (%)			샤프지수					최대낙폭	
			매매회전율 (%)	3Y	5Y	10Y	3Y	5Y	10Y	2010년 11월 30일 이후	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수	1.00	0.39	15.43	11.40	13.34	NA	0.42	0.40	NA	0.54	18.96	2015-05-21 — 2016-02-11
MSCI 전세계 지수	1.00	0.00	3.05	11.36	13.34	NA	0.40	0.36	NA	0.51	18.91	2015-05-21 — 2016-02-11

¹ 12개월
² 월간 총 수익률을 바탕으로 함
³ BBA 라이브 1개월 수치를 바탕으로 함

지수특성

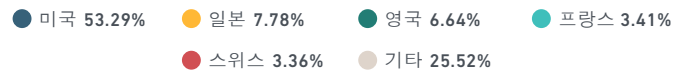
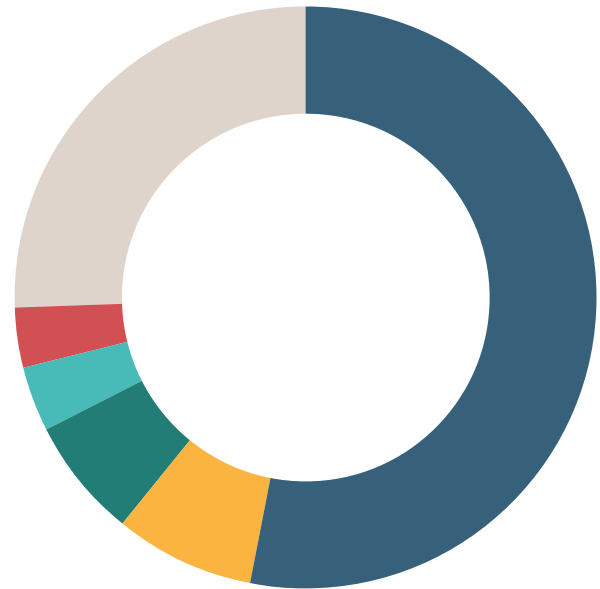
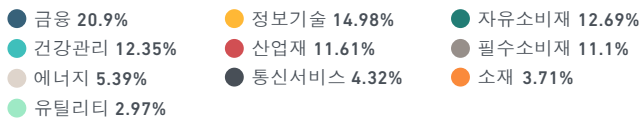
	MSCI 전세계 저탄소 타겟 지수	MSCI 전세계 지수
종목수	1,762	2,484
시가총액(USD 백만)		
최대	1.68	1.66
최소	0.00	0.00
평균	0.06	0.04
중간값	0.03	0.02

상위10 종목

	국가	지수 비중(%)	기존 지수 비중 (%)	분야
애플	US	1.68	1.66	정보기술
마이크로소프트	US	1.19	1.16	정보기술
존슨 앤 존슨	US	0.91	0.88	건강관리
제너럴일렉트릭	US	0.88	0.83	산업재
AT&T(에이티엔티)	US	0.73	0.68	통신서비스
웰스파고사	US	0.72	0.69	금융
페이스북 A	US	0.71	0.69	정보기술
프록터 앤드 갬블(P&G)	US	0.70	0.66	필수소비재
네슬레	CH	0.70	0.68	필수소비재
아마존닷컴	US	0.67	0.66	자유소비재
총계		8.89	8.59	

산업분류별 비중

국가별 비중



INDEX METHODOLOGY

각 반기지수검토따라, MSCI 글로벌 저탄소 타겟 지수는 다음의 최적화된 목표 및 제약 사항에 따라 반복과 투자 가능성 달성을 목표로 하고 있는 최적화된 프로세스를 사용하여 구성합니다:

- 기존지수에 비례하게 추척오차를 0.3%(30 basis point)로 제한하여 탄소 노출을 줄입니다.

- 지수 구성의 최대 비중을 20번으로 제한하며, 기존지수의 비중입니다.

- MSCI글로벌 저탄소 타겟 지수의 국가별 비중은 기존지수 국가별 비중의 +/- 2%이상 벗어나지 않습니다.

- MSCI 글로벌 저탄소 타겟 지수의 사업부문별 비중은 기존지수 사업부문별 비중의 +/- 2%이상 벗어나지 않으며, 어떠한 제약조건이 없는 에너지 사업부문을 제외합니다

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