

MSCI신흥국 ESG 지수(USD)

MSCI신흥국 ESG지수는 회사의 분야와 관련된 높은 환경과 사회 및 지배구조 성과 공개를 제공하는 가권지수입니다. MSCI 신흥국 ESG 지수는 23개 신흥시장 국가들의 대형주와 중형주의 기업으로 구성되어 있습니다. 이 지수는 기본이 되는 주식 시장에 대한 비교적 낮은 추적오차와 다양하고 다각적으로 유지 가능한 벤치마크를 추구하는 투자자를 위해 설계되었습니다. 이 지수는 MSCI 글로벌 유지 가능 지수 시리즈의 한 구성원입니다. 주식 선정은 MSCI ESG리서치 데이터를 기반으로 합니다.

지수누적성과 - 총수익률(USD)(2007년 9월-2016년 4월)



연간실적 (%)

연도	MSCI신흥국 ESG	MSCI신흥시장
2015	-11.99	-14.6
2014	5.2	-1.82
2013	1.63	-2.27
2012	21.64	18.63
2011	-12.78	-18.17
2010	25.88	19.2
2009	76.07	79.02
2008	-48.32	-53.18

지수성과 - 총수익률 (%) (2016년4월30일)

	1 Mo	3 Mo	1 Yr	YTD	연간			
					3 Yr	5 Yr	10 Yr	2007년9월28일 이후
MSCI신흥국ESG	0.3	12.85	-13.2	7.69	-0.32	0.37	na	2.93
MSCI신흥시장	0.56	13.72	-17.56	6.35	-4.23	-4.28	na	-1.53

指数风险与回报特征 (2016년4월30일)

	연간표준편차 (%) ¹				샤프지수 ^{2,3}				최대낙폭	
	매매회전율 (%) ¹	3Yr	5Yr	10Yr	3Yr	5Yr	10Yr	2007년9월28일 이후	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI신흥국ESG	10.19	15.42	16.9	na	0.04	0.09	na	0.21	61.79	2007-10-31—2008-10-27
MSCI신흥시장	8.45	16.65	18.71	na	-0.19	-0.15	na	0.03	65.14	2007-10-29—2008-10-27

¹ 1개월 ² 월간 총 수익률을 바탕으로 함 ³ BBA라이보 1개월 수치를 바탕으로 함

2010년 9월1일 FTSE KLD 지수가 MSCI ESG 지수로 전환 되었습니다. 이전의 KLD 지수는 시간이 지남에 따라 여러 제 3자 지수 산출을 포함하고 있었습니다. 그 결과MSCI ESG 지수의 히스토리는 다양한 출처로 부터 지속된 타임 시리즈 생성을 위해 수집되어 왔습니다 - 경우에 따라서 출처는 다양한 지수산출방법론을 따를 수 있습니다. MSCI ESG 지수들은MSCI ESG 리서치 주식회사와 MSCI 주식회사의 자회사들 통해 제공되는 데이터와 레이팅을 사용합니다.

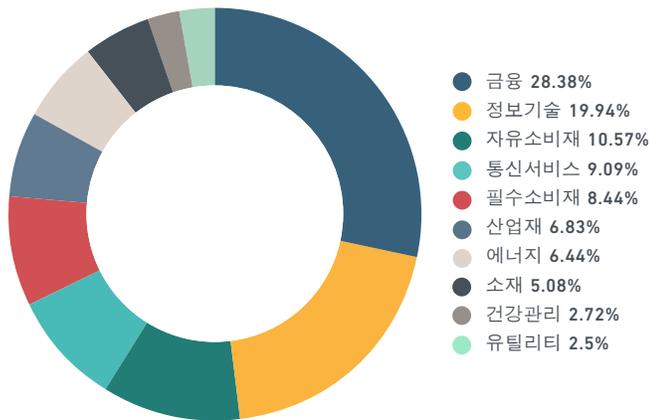
EM(Emerging Market 신흥시장) 에 포함되는 나라: 브라질,칠레,중국,콜롬비아,체코,이집트,그리스,헝가리,인도,인도네시아,한국,말레이시아,멕시코,페루,필리핀,폴란드,러시아,카타르, 남아프리카 공화국, 대만,태국,터키 그리고 아랍 에미리트.

MSCI 신흥국ESG 지수는 2013년 6월 6일에 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.

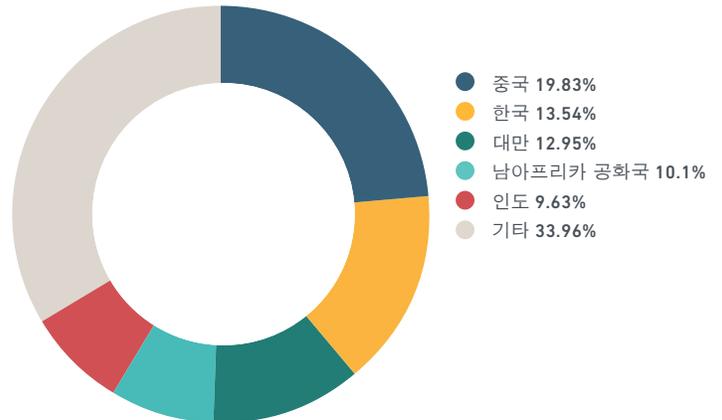
MSCI신흥국 ESG	
종목수	375
시가총액(USD 백만)	
지수	1,816,015.98
최대	114,565.44
최소	389.28
평균	4,842.71
중간값	2,374.84

국가	시가총액 (USD 십억)	지수 비중 (%)	분야	분야 비중(%)
타이완 세미컨덕터(TSMC)	TW 114.57	6.31	정보기술	31.6
텐센트 홀딩스 니(중국)	CN 105.92	5.83	정보기술	29.3
차이나 모바일	CN 70.44	3.88	통신서비스	42.7
나스퍼스 N	ZA 54.91	3.02	자유소비재	28.6
중국건설은행 H	CN 54.13	2.98	금융	10.5
인포시스	IN 33.47	1.84	정보기술	9.2
이타우 유니방쿠 PN	BR 28.93	1.59	금융	5.6
중국평안보험H	CN 24.63	1.36	금융	4.8
HDFC은행	IN 24.6	1.35	금융	4.8
LUKOIL HOLDING(RUB)	RU 21.58	1.19	에너지	18.4
총계	533.17	29.36		

산업분류별 비중



국가별 비중



지수 방법론

MSCI글로벌 투자가능 시장지수는MSCI ACWI로 구성되어 있는 기업의 지역지수 및 선진 시장과 신흥시장 국가를 포함하는 글로벌 주식지수에 대해 최고의 선발 과정을 적용하여 구성됩니다.

글로벌 유지 가능성 지수는 ESG 선택 과정에서 소개 된 체계적 위험을 제한하는 기본적인 지수들과 함께 일관된 영역 및 지역 가중치를 목표로 합니다. 이 방법론은 기존지수의 각 영역 및 지역 시가총액의 50%를 대표하는 가장 높은 ESG등급을 가지고 있는 기업들의 주식 포함을 목적으로 합니다. 글로벌 가능지수의 주식(구성요소)이 존재하지 않은 기업은 MSCI ESG 평가의 'BB' 또는 그 이상 및 영향력있는 모니터 스코어로부터 3점 또는 그 이상에게만 자격이 주어집니다. 글로벌 지속가능 지수를 위한 선택 분야는 MSCI 글로벌 투자가능 시장 지수의 주식(구성원)입니다. 이 지수는 조정된 변동시세의 가중 된 시가총액입니다. MSCI 글로벌 지속 가능 지수의 연간 평가는 5월에 열리며 8월, 11월 그리고 2월 재조정됩니다.

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.