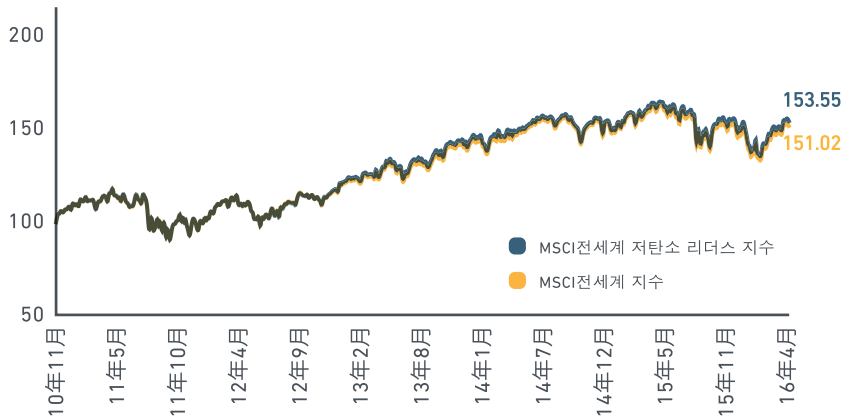


MSCI 전세계 저탄소 리더스 지수(USD)

MSCI전세계 저탄소 리더스 지수는 기존 지수로서 MSCI 전세계 지수를 기반으로 하며, 또한 23개의 선진시장 및 23개의 신흥시장 국가들의 대형주와 중형주를 포함합니다. 이 지수는 탄소 노출의 이차원을 다룹니다- 탄소배출 및 화석연료 매장량- 탄소 위험성에 대한 클라이언트 포트폴리오의 노출을 제한하는 효과적인 툴을 제공합니다. 시가총액의 달러당 탄소 보유량의 최대 소유자와 가장 높은 탄소 배출 강도의 기업을 제외하고, 이 지수는 최소 50%의 탄소발자국 감소 달성을 목표로 합니다. 이 지수는 또한 MSCI 전세계 지수에 대한 추적오차를 최소화함으로써 다양하고 일관된 시장의 노출 유지를 목표로 합니다. MSCI 글로벌 저탄소 리더스 지수는 MSCI ESG 리서치의 MSCI ESG 탄소 측정기준 데이터를 사용합니다.

지수누적성과 - 총수익률(USD)(2010년11월-2016년4월)



연간실적 (%)

연도	MSCI전세계 저탄소 리더스 지수	MSCI전세계 지수
2015	1.02	-1.84
2014	4.37	4.71
2013	24.46	23.44
2012	17.39	16.80
2011	-6.88	-6.86

지수성과 - 총수익률 (%) (2016년4월29일)

	1 Mo	3 Mo	1 Yr	YTD	연간				기본조건			
					3 Yr	5 Yr	10 Yr	2010년 11월 30일 이후	배당수익률 (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
MSCI전세계 저탄소 리더스 지수	1.56	8.31	-4.70	1.69	5.86	5.58	na	8.24	2.68	18.51	15.07	2.00
MSCI전세계 지수	1.54	8.44	-5.13	1.93	5.62	5.26	na	7.91	2.67	18.97	15.36	2.00

기본조건(2016년4월29일)

지수 위험고 수익률 특성(2010년11월30일 - 2016년4월29일)

	베타	추적오차 (%)	매매회전율 (%) ¹	연간표준편차 (%) ²			샤프지수 ^{2,3}				최대낙폭	
				3Yr	5Yr	10Yr	3Yr	5Yr	10Yr	2010년 11월 30일 이후	%	기간 YYYY-MM-DD
MSCI전세계 저탄소 리더스 지수	1.00	0.49	12.45	12.06	13.66	na	0.51	0.45	na	0.64	18.52	2015-05-21—2016-02-11
MSCI전세계 지수	1.00	0.00	3.18	11.98	13.61	na	0.50	0.43	na	0.62	18.91	2015-05-21—2016-02-11

¹ 12개월 ² 월간 총 수익률을 바탕으로 함 ³ BBA라이브 1개월 수치를 바탕으로 함

DM(Dveloped 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.

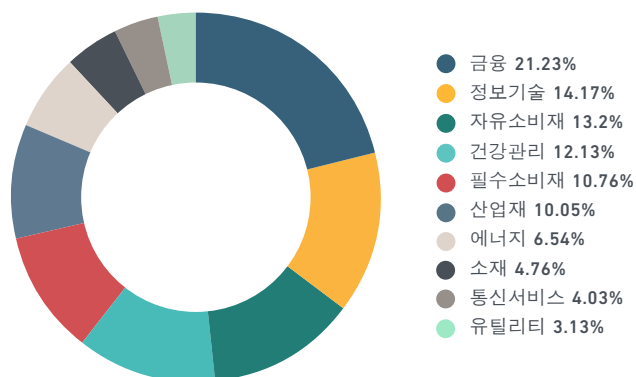
MSCI전세계 저탄소 리더스 지수는 2014년 9월 16일에 발표되었습니다. 출시 날짜 이전의 데이터는 백테스트(Back-tested) 데이터입니다(즉, 인덱스가 그 기간에 존재했다는 가정하에 실적이 어떻게 나왔는지를 계산합니다). 백 테스트(Back-tested) 데이터와 실제 결과 사이에 실질적 차이가 종종 나타납니다. 과거실적--실제 또는 백 테스트(back-tested)--은 미래실적을 예시하거나 보장하지 않습니다.

	MSCI전세계 저탄소 리더스 지수	MSCI전세계 지수
종목수	1,952	2,480
비중(%)		
최대	1.5	1.5
최소	0.03 bps	0.11 bps
평균	5.12 bps	4.03 bps
중간값	2.38 bps	1.61 bps

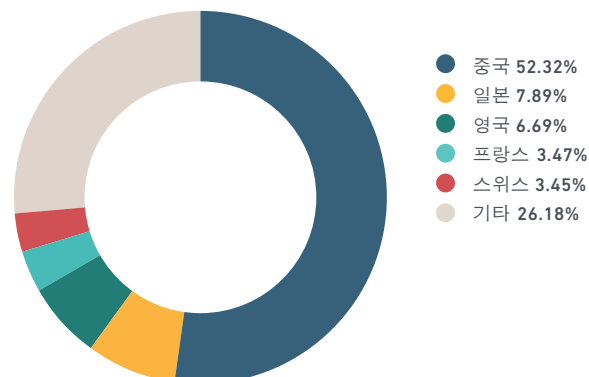
상위10종목

	국가	지수 비중 (%)	기존 지수 비중(%)	분야	분야 비중 (%)
애플	US	1.47	1.45	정보기술	10.4
엑슨 모빌	US	1.09	1.02	에너지	16.7
마이크로소프트	US	1.07	1.05	정보기술	7.5
존슨 앤 존슨	US	0.88	0.86	건강관리	7.3
제너럴일렉트릭	US	0.84	0.81	산업재	8.3
페이스북 A	US	0.76	0.74	정보기술	5.4
아마존닷컴	US	0.74	0.73	자유소비재	5.6
웰스파고사	US	0.70	0.67	금융	3.3
AT&T(에이티엔티)	US	0.69	0.66	통신서비스	17.1
네슬레	US	0.68	0.66	필수소비재	6.3
총계		8.92	8.67		

산업분류별 비중



국가별 비중



지수 방법론

이 방법론은 탄소 배출 강도에 근거하는 상위 **20%**의 기업과 모든 분야 비중의 최대**30%**를 제외합니다. 또한 이 방법론은 기존지수 매장량의 **50%**를 차지하거나, 시가총액의 달러 당 매장량이 가장 큰 소유자를 제외합니다. 이 지수는 벤치마크에 사전적인 추적 오차를 최소화하기 위해 반년마다 최적화됩니다. 다음과 같은 제약 조건이 적용됩니다:

- 매매회전율: 반기**10%**미만인 경우
- 분야: **2%**미만이거나 초과 비중인 경우, 에너지에 대한 제약이 없는 경우
- 국가: **2%**미만이거나 초과 비중인 경우

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 | CFS0516