

S&P ESG 지수 시리즈, S&P ESG Tilted 지수 시리즈, S&P Equal Weight ESG Leaders Select 지수, S&P Gender Equality & Inclusion Equal Weight 지수의 적격성 요건에 대한 협의 결과

2022년 4월 1일, 암스테르담: S&P 다우존스 지수('S&P DJI')는 S&P ESG 지수 시리즈, S&P ESG Tilted 지수 시리즈, S&P Equal Weight ESG Leaders Select 지수, S&P Gender Equality & Inclusion Equal Weight 지수의 잠재적 변경사항에 대해 시장참가자들과 [협의](#)를 진행했습니다.

S&P DJI는 이들 지수에 사용된 적격성 요건을 변경할 것입니다. 변경사항은 아래에 자세히 설명되어 있습니다.

UN 글로벌컴팩트(UNGC)에 근거한 편출

S&P DJI는 UNGC 데이터 제공업체를 Arabesque에서 Sustainalytics로 변경하고 Sustainalytics가 규정을 준수하지 않는 것으로 간주하는 기업은 편출합니다.¹ 이러한 변경은 연속형 데이터 집합 사용에서 이산형 데이터 집합으로 세트로 이동하는 것을 목표로 합니다.

사업활동에 근거한 편출

S&P DJI는 정의된 특정 사업활동에 대한 기업의 관여에 근거하여 추가, 확장, 수정적인 제외를 도입할 것입니다.² 추가적인 제외는 오일샌드, 소형화기, 군용계약을 포함하고 확장된 제외는 논쟁의 여지가 있는 무기를 포함하며 수정된 제외는 담배를 포함합니다. 이러한 변경사항은 현재 제외 항목에 대한 피드백에 따라 제안되었습니다. 또한 직접적인 관여수준 임계값이 0이 아닌 범주에는 상당한 소유권 제외가 더 이상 적용되지 않습니다. 이러한 변경사항은 기업이 직접 관여하는 것보다 간접적인 관여수준 결과로 잠재적으로 더 가혹하게 대우 받을 수 있는 상황을 방지하기 위해서입니다. 다음 페이지 표에는 변경사항이 자세히 설명되어 있습니다.

¹ 이는 이미 Sustainalytics 데이터를 사용하고 있는 S&P/NZX Portfolio ESG Tilted 지수에는 적용되지 않습니다.

² 이는 자체 사업활동 제외 집합이 있는 S&P 500 Equal Weight ESG Leaders Select 지수에는 적용되지 않습니다.

제품 관여	관여 범주 및 설명	S&P DJI 의 관여수준 임계값		S&P DJI 의 상당한 소유권 임계값		요약
		이전	업데이트	이전	업데이트	
논쟁의 여지가 있는 무기	맞춤형 및 필수: 기업은 핵심 무기 시스템 또는 무기의 치명적인 사용에 맞춤형 그리고 필수적으로 간주되는 핵심 무기 시스템의 구성요소/서비스에 관여합니다.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	변경 없음
	비맞춤형 또는 비필수형: 기업은 맞춤형으로 간주되지 않거나 무기의 치명적인 사용에 필수적이지 않은 핵심 무기 시스템에 대한 구성요소/서비스를 제공합니다.	N/A	>0%	N/A	≥25%	신규
연료 탄	추출: 기업은 연료탄을 추출합니다.	≥5%	≥5%	N/A	N/A	변경 없음
	발전: 기업은 연료탄에서 전기를 생산합니다.	≥5%	≥5%	N/A	N/A	변경 없음
담배제품	생산: 기업은 담배제품을 제조합니다.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	변경 없음
	관련 제품/서비스: 기업은 담배관련 제품/서비스를 제공합니다.	≥10%	≥5%	≥25%	N/A	개정
	소매판매: 소매: 담배제품 유통 및/또는 소매판매에서 매출을 올립니다.	≥10%	≥5%	≥25%	N/A	개정
오일샌드	추출: 기업은 오일샌드를 추출합니다.	N/A	≥5%	N/A	N/A	신규
소형화기	민간인 고객(공격형 무기): 기업은 공격형 무기를 제조하고 민간인 고객에게 판매합니다.	N/A	>0%	N/A	≥25%	신규
	민간인 고객(비공격형 무기): 기업은 소형화기(비공격형 무기)를 제조하고 민간인 고객에게 판매합니다.	N/A	>0%	N/A	≥25%	신규
	군대/법 집행기관 고객: 기업은 소형화기를 제조하고 군/법 집행 기관에 판매합니다.	N/A	>0%	N/A	≥25%	신규
	주요 구성요소: 기업은 소형 무기의 주요 구성요소를 제조하고 판매합니다.	N/A	>0%	N/A	≥25%	신규
	소매/유통(공격용 무기): 기업은 공격용 무기의 소매판매 및/또는 유통에 관여합니다.	N/A	≥5%	N/A	N/A	신규
	소매/유통(비공격용 무기): 기업은 비공격용 무기의 소매판매 및/또는 유통에 관여합니다.	N/A	≥5%	N/A	N/A	신규
	무기: 기업은 군용 무기 시스템 및/또는 통합된 맞춤형 구성요소 또는 이러한 무기를 제조합니다.	N/A	≥10%	N/A	N/A	신규
군용계약	무기관련 제품 및 서비스: 기업은 군용 무기를 지원하는 맞춤형 제품 및/또는 서비스를 제공합니다.	N/A	≥10%	N/A	N/A	신규

사업 관여 및 UNGC 제외에 대한 분기별 적격성 확인

S&P DJI 는 분기별 적격성 점검을 도입할 것이고, 이를 통해 현재 기업관여 또는 UNGC 적격성 기준에 부합하지 않는 것으로 확인된 현재 지수 구성종목은 지수에서 편출됩니다. 기업의 적격성에 대한 변경사항이 적시에 처리되도록 하는 것이 목적입니다. 편출될 수 있는 구성종목은 지수에 추가되지 않습니다.

시행시점

S&P DJI 는 2022 년 5 월 2 일 월요일 개장 이전에 발효되는 차기 재조정과 함께 관련하여 앞서 설명한 방법론 변경을 시행할 것입니다. 변경사항은 2022 년 4 월 22 일 금요일부터 고객에게 먼저 제공됩니다.

S&P DJI 웹사이트에 있는 방법론은 이러한 변경사항을 반영하기 위해 업데이트되고 있습니다.

www.spglobal.com/spdji 를 방문하시면 S&P 다우존스 지수에 대한 보다 자세한 정보를 얻을 수 있습니다.

S&P 다우존스 지수 소개

S&P 다우존스 지수는 지수를 기반으로 하는 필수적인 개념, 데이터, 리서치 부문에서 세계 최대 제공사이며, S&P 500[®] 지수와 Dow Jones Industrial Average[®] 지수와 같은 대표적인 금융시장 지표를 개발한 본산입니다. 전세계 다른 어떤 지수 제공사보다도 많은 자산이 당사 지수에 기초한 상품에 투자되고 있습니다. 1884년 Charles Dow가 첫 번째 지수를 개발한 이후 S&P DJI는 다양한 자산군에 걸쳐 지수를 혁신하고 개발함으로써 투자자들이 시장을 측정하고 거래하는 방식을 정의하는데 도움을 주고 있습니다.

S&P 다우존스 지수는 S&P 글로벌(NYSE: SPGI)의 한 부문으로 개인, 기업, 정부가 확신을 갖고 결정을 내릴 수 있도록 필수적인 정보를 제공합니다. 홈페이지(www.spglobal.com/spdji)를 방문하시면 보다 상세한 내용을 확인할 수 있습니다.

보다 자세한 정보:

S&P 다우존스 지수

index_services@spglobal.com