

언론사 담당자 연락처:

Stephanie Ho, +852 2973 4655 또는 stephanie.ho@morningstar.com

Bianca Yu, +852 2973 4646 또는 bianca.yu@morningstar.com

**모닝스타,
저탄소위험 인덱스 패밀리 출시**
저탄소 경제로의 전환에 부합하는 회사에 초점을 맞춤
*신규 인덱스 패밀리는 탄소 발자국을 뛰어넘어
기업의 미래 포지셔닝을 평가*

서울, 2019년 1월 31일—독립 투자 리서치 서비스를 제공하는 선도 업체인 Morningstar, Inc.(나스닥: MORN)는 Morningstar Low Carbon Risk Index Family를 발표했다. 이것은 여러 지역의 주식에 다양하게 투자할 수 있고, 저탄소 경제로의 전환에 부합하는 기업에 초점을 맞춘 새 인덱스 그룹이다. 이 인덱스는 서스테널리티क्स([Sustainalytics](#))가 실시하는 탄소 위험 평가를 바탕으로 하며, 포트폴리오 수준의 관점에서 탄소 위험과 화석 연료 배출의 감소를 목표로 하는 최적화 프로세스를 통해 생성된다.

"기후 변화는 투자자에게 영향을 미치는 주요 문제입니다."라고 모닝스타의 인덱스 총괄 책임자 산제이 아리아(Sanjay Arya)는 말한다. 투자자는 새로 출시된 인덱스 패밀리를 통해 저탄소 경제에 적응하여 장기적 전략을 토대로 비즈니스를 관리하는 기업을 평가한 후, 이에 따라 기업에 투자할 수 있습니다. 환경에 대한 우려, 선관의무 또는 투자 실적 등 어떤 동기로 시작되었건, 모닝스타 저탄소 위험 인덱스는 수익을 희생시키지 않고도 탄소 배출을 줄일 수 있는 여러 옵션을 제공합니다."

신규 백서인 "저탄소 경제에 대비하기: 기후 변화 시대에 투자하기"에서는 Morningstar Low Carbon Risk Index Family가 저탄소 경제로의 전환에 부합하는 기업에 초점을 맞춤으로써 시급한 기후 변화 문제에 어떻게 대처하는지 설명한다. 이 인덱스는 더 낮은 기후 관련 위험을 반영할 뿐 아니라 매력적인 투자 속성도 보여준다. 전체 백서는 [여기](#)에서 다운로드할 수 있다.

"이 인덱스는 탄소 발자국이라는 일반적인 접근 방식을 뛰어 넘습니다. 탄소발자국은 현재 배출량을 반영한 탄소 위험 분석의 시작에 불과한 지표입니다." 라고 모닝스타 인덱스 전략가 댄 레프코비츠(Dan Lefkowitz)는 말한다. "새로운 모닝스타 저탄소 위험 인덱스는 서스테널리티क्स의 탄소 위험 평가를 활용하는 최초의 인덱스입니다. 이러한 탄소 위험

평가는 기업의 전체적 탄소 배출뿐만 아니라 배출 관리까지 평가함으로써 기업이 저탄소 경제에서의 생존과 성공을 위해 포지셔닝되어 있는지를 최종 평가합니다."

새 인덱스 패밀리인 모닝스타가 환경 문제를 우려하는 투자자를 지원하기 위해 한 단계 더 발전했음을 보여주는 상품이다. 모닝스타는 2018년에 펀드에 대한 모닝스타 저탄소 지정과 [모닝스타 포트폴리오 탄소 위험 점수](#)를 도입하여 투자자가 포트폴리오의 탄소 위험을 평가할 수 있는 방법론을 마련했다. 2016년에는 모닝스타 지속가능성 등급([Morningstar Sustainability Rating™](#))을 개시하여 투자자가 ESG(환경, 사회, 및 지배구조) 요인에 근거하여 펀드를 평가할 수 있게 지원했다. 이후에도 지속가능한 투자에 관한 사고 리더십 및 연구 내용을 지속적으로 공개하고 있다. 모닝스타 인덱스의 구성에 대해서는 [여기](#)에서, 사회책임 투자에 대한 모닝스타의 약속에 대해서는 [여기](#)에서 자세히 알아볼 수 있다. [Twitter](#)에서 해시태그 #MstarESG로 관련 트윗을 살펴볼 수 있다.

방법론

모닝스타 저탄소 위험 인덱스는 해당되는 광역 시장 벤치마크의 대형주 및 중형주 부문에서 산출된다. 예를 들어 모닝스타 글로벌 시장 저탄소 위험 인덱스의 구성 요소는 개발 및 신흥 시장 전반에 걸친 글로벌 주식 시가 총액의 90%를 대상으로 한 모닝스타 글로벌 시장 대형-중형주 인덱스에서 산출된다. 기업이 자격을 갖추려면 130개 산업 그룹에 속한 4,000개 이상의 기업에 대해 [탄소 연구](#)를 실시하는 서스테널리티크스의 탄소 위험 평가를 거쳐야 한다.

인덱스는 모닝스타 포트폴리오 탄소 위험 점수와, 모닝스타 포트폴리오 화석 연료 개입의 12개월 이동평균으로 구성된다. 화석 연료 개입은 화석 연료 집약 산업에 대한 구성 요소 수준 배출의 가중평균이다. 각 인덱스의 주식 수는 가변적이며 자격 요건, 최적화 프로세스의 결과 및 가중치가 고려된다.

인덱스는 분기마다 재조정(3월, 6월, 9월, 12월에 가중치 재설정)되며, 반년마다 재구성(6월, 12월의 세 번째 금요일 다음에 오는 월요일마다 멤버십 재설정)된다. 재구성에 사용되는 탄소 위험 점수 데이터는 5월과 11월의 마지막 거래일 기준이다.

Morningstar는 2017년에 환경, 사회 및 지배구조에 대한 연구 및 평가의 글로벌 제공업체인 Sustainalytics Holding B.V.에 처음 투자했으며 현재 약 40%를 소유하고 있다. 이 투자의 일환으로 Morningstar는 Sustainalytics 이사회 대표권을 비롯한 다양한 권리를 획득했다.

###

©2019 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.
MORN-P