MORNINGSTAR®

News Release

미디어 담당자:

Andy Seunghye Jung 정승혜, CFA +82 2 3771 0730 또는 andy.jung@morningstar.com
Stephanie Ho, +852 2973 4655 또는 stephanie.ho@morningstar.com

즉시 배포용

기업, 펀드 및 자산운용사에 대한 모닝스타 지속가능성 평가, 상품과 서비스 전반에 도입

전략 및 자산운용사에 대한 모닝스타ESG 실천 의지 수준과, 기업에 대한 ESG 리스크 등급 평가를 통해 투자자들이ESG 투자 선택권을 비교하고 선별할 수 있게 됐다.

서울, 2021 년 5 월 13 일 -- 모닝스타(Morningstar, Inc.)(나스닥: MORN)는 독립 투자 리서치 분야의 선두 기업으로 이번 주부터 전략 및 자산운용사에 대한 모닝스타® ESG 실천 의지 수준(Morningstar® ESG Commitment Level for strategies and asset managers)과 기업에 대한 모닝스타® ESG 리스크 등급 평가(Morningstar® ESG Risk Rating Assessment for companies), 총 2 종의 새로운 환경, 사회, 거버넌스(ESG) 평가를 출시해 투자 리서치 플랫폼 모닝스타 디렉 SM(Morningstar Direct℠)과 투자자를 위한 웹사이트인 모닝스타닷컴®(Morningstar.com®)과 같은 자사의 주력 플랫폼 전반에 적용한다고 발표했다.

이번에 출시된 새로운 평가 지표는 투자 절차를 간소화하고 장기적인 의사 결정을 지원하기 위해 설계된 모닝스타의 독립적인 평가 도구에 추가된다. 이러한 평가 지표는 펀드에 대한 모닝스타® 지속가능성 등급™(Morningstar® Sustainability Rating™), 모닝스타® 포트폴리오 탄소 리스크 점수™(Morningstar® Portfolio Carbon Risk Score™), 모닝스타® 저탄소 지명™(Morningstar® Low Carbon Designation™), 모닝스타 지속가능 속성 SM(Morningstar Sustainable Attributes℠), 모닝스타 포트폴리오 상품 관여(Morningstar Portfolio Product Involvement) 수치, 프록시 데이터를 포함해 기존의 지속가능성 관련 투자 분석에 반영된다.

서스테널리틱스(Sustainalytics)의 마이클 잔츠(Michael Jantzi) CEO 는 "모든 유형의 투자자가 지속가능한 투자 선택지 선별과 실질적인 ESG 리스크 파악에 도움을 받고자 한다"며, "ESG 를 펀드 및 증권 수준 단계의 데이터와 인사이트를 모닝스타 플랫폼 전반에 연결하는 작업을 지속해

다면적인 ESG 이슈와 여러 접근법에서 발생하는 리스크와 기회를 명확히 하고 투자자가 현명한 선택을 할 수 있도록 돕고 있다"고 밝혔다.

모닝스타는 2020 년 7 월 ESG 리서치, 등급 평가, 데이터 분야에서 세계적으로 인정받는 선두 기업인 서스테널리틱스를 인수했다. 모닝스타는 이번 평가 도입을 통해 두 기업의 결합을 바탕으로 여러 자산군에 대해 모든 유형의 투자자가 편리하게 이용할 수 있는 지속가능한 투자 분석을 제공하는 강력한 역량을 보여줬다. 모닝스타는 2021 년 1 분기에 글로벌 지속가능 펀드에 유입된 자산이 2 조 달러에 이르렀다고 발표했는데, 이것은 지난 3 년간 꾸준한 성장세를 보이고 있다는 것을 증명한다.

전략 및 자산운용사 에 대한 모닝스타 ESG 실천 의지 수준

모닝스타 ESG 실천 의지 수준 평가는 약 900 개 펀드와 70 여 개 자산운용사를 대상으로 하며, 모닝스타 디렉 SM, 모닝스타 오피스 SM*(Morningstar Office SM*), 모닝스타닷컴® 프리미엄 회원을 대상으로 오늘부터 제공된다. 이번 달 후반부터는 모닝스타® 어드바이저 워크스테이션™(Morningstar® Advisor Workstation™)과 모닝스타® 애널리스트 리서치 센터™(Morningstar® Analyst Research Center™)에서도 제공된다(별표가 붙은 솔루션은 현재 아시아-인도 지역에서는 사용할 수 없다).

ESG 실천 의지 수준 평가는 모닝스타의 매니저 리서치 애널리스트가 어떤 전략과 자산운용사가 ESG 요소를 각자의 투자 과정에 얼마나 반영하고 있는지에 대한 정성적 분석 결과를 보여준다. 이 평가는 리더(Leader), 고급(Advanced), 기본(Basic), 저조(Low)의 네 가지 등급으로 나뉘며, 자산운용사 및 운용되는 투자 전략의 ESG 자원, 정책, 전문성을 파악해 간단하면서도 미래 지향적인 분석을 제공한다.

오늘 모닝스타 매니저 리서치팀은 251 개 펀드와 31 개 자산운용사를 대상으로 하는 ESG 실천 의지 수준 부여에 관한 2 차 자료를 발표했다. 1 차 자료는 2020 년 11 월에 공개됐다. 2 차 평가 자료에서 나타난 추세는 다음과 같았다.

- 전략의 등급을 보면, 평가한 140 개 전략 중 단 한 가지 전략에만 ESG 실천 수준 '리더'가 부여됐으며, 19 개 전략은 '고급'이 부여됐다. 59 개 전략은 '기본'을, 61 개 전략은 '저조'를 받았다. 이러한 분포가 나온 이유는 ESG 에 중점을 두지 않은 전략에 대한 표본 편향이 반영돼 있기 때문이다.
- 자산운용사 등급을 보면, 평가한 31 곳 중 호주의 Affirmative Investment Management 에만 최고의 영예인 '리더'를 부여했다. Amundi, BNP Paribas Asset Management, HSBC Global Asset Management, Jupiter, LGIM 5 개 자산운용사는 '고급'을 받았다.

- Allianz Global Investors, Invesco, JPMorgan, State Street, T. Rowe Price 등 최대 규모의 자산운용사(13 개)는' 기본'을 받았다. Franklin Templeton, Janus Henderson, Mellon Investments, VanEck 등 12 개 자산운용사는 '저조'를 받았다.

본 리포트에서 모닝스타 애널리스트들은 자산운용사의 모범 사례라고 생각하는 것을 설명하기도 했다. 업종이 계속해서 발전함에 따라 애널리스트들은 철학 및 프로세스, 리소스, 액티브 오너십(Active Ownership)이라는 각각의 특징에 대해 가장 강력한 접근법을 강조한다.

애널리스트들은 ESG 실천 의지 수준을 계속해서 더 많은 애널리스트 조사 대상 전략 및 자산운용사로 확대하고, 펀드에 대한 애널리스트 평가 등급™(Morningstar Analyst Rating™) 정규 업무의 일환으로 인정할 것이다.

ESG 실천 의지 수준에 대한 자세한 정보는 여기에서 확인할 수 있으며, 평가 방법론은 여기에서 확인할 수 있다.

모닝스타 기업에 대한 ESG 리스크 등급 평가

또한, 모닝스타는 오늘 투자자가 여러 업종 전반의 기업이 갖고 있는 종합적인 ESG 리스크를 쉽게 비교하고 맥락에 맞게 파악할 수 있도록 하는 모닝스타® ESG 리스크 등급 평가를 소개했다. 현재 모닝스타 디렉 SM과 모닝스타 오피스 SM*, 모닝스타® 어드바이저 워크스테이션™, 모닝스타닷컴® 프리미엄 회원 서비스를 통해 13,000 개 기업에 대한 모닝스타 ESG 등급 평가가 제공된다(별표가 붙은 솔루션은 현재 아시아-인도 지역에서는 사용할 수 없다). 또한, 이달 후반부터 모닝스타의 에쿼티 데이터 피드를 통해서도 만나볼 수 있다.

모닝스타® 기업에 대한 ESG 리스크 등급 평가는 서스테널리틱스의 ESG 리스크 등급(ESG Risk Ratings)을 시각적으로 표현한 것으로, 업종별로 실질적인 ESG 리스크에 대한 평가 대상 기업의 '노출' 수준과 해당 기업이 이러한 리스크를 얼마나 잘 '관리'하고 있는지를 측정한다. 이 특별한 접근법은 관리 개념과 노출을 결합해 절대적인 ESG 리스크를 평가한다.

이번에 새롭게 공개된 기업을 대상으로 하는 평가는 지난 2016 년 모닝스타와 서스테널리틱스가 시장 최초로 발표한 펀드 수준의 지속가능성 평가 등급인 모닝스타® 펀드에 대한 지속가능성™ 등급과 같이 쉽게 파악하고 비교가 가능한 글로브 아이콘을 사용한다. 이 평가는 한 개에서 다섯 개의 글로브를 사용한다. 각 등급은 리스크 거의 없음(글로브 다섯 개, 0~9.99), 리스크 낮음(네 개, 10~19.99), 리스크 중간(세 개, 20~29.99), 리스크 높음(두 개, 30~39.99), 리스크 심각(한 개, 40 이상)이다.

기업에 대한 ESG 리스크 등급 평가는 최근 모닝스타 주식 리서치 방법론에 공식적인 입력 자료로서 최근 통합된 서스테널리틱스의 ESG 리스크 리서치를 기반으로 구축된다. 모닝스타 기업에 대한 ESG 리스크 등급 평가에 대한 더 자세한 내용은 여기에서 확인할 수 있으며, 자주 묻는 질문은 여기에서 확인할 수 있다.

About Morningstar, Inc. and Morningstar Investment Management Asia Limited

모닝스타는 북미, 유럽, 호주, 아시아에서 활동하는 독립 투자 리서치의 선도적인 회사입니다. 모닝스타는 개인투자자, 자문사, 운용사, 은퇴 플랜 사업자 및 스폰서 뿐만 아니라 채권 및 사모 자본 시장에 참여하는 기관투자가에게 광범위한 상품과 서비스를 제공합니다. 모닝스타는 관리되는 투자 상품, 상장사, 사모펀드 시장, 채무증권, 실시간 글로벌 시장 데이터 등 광범위한 투자 상품에 대한 데이터와 연구 통찰력을 제공합니다. 모닝스타는 또한 투자자문 자회사를 통해 투자관리 서비스를 제공하고 있으며, 2020 년 9 월 30 일 현재 약 2,150 억 달러에 달하는 자산을 자문 및 관리하고 있습니다. 모닝스타는 전세계 29 개국에서 사업을 하고 있습니다.
자세한 회사 정보는 www.morningstar.com/company 에서 참조하십시오. 트위터에서도 모닝스타를 만나실 수 있습니다. Twitter @MorningstarInc 의 Morningstar 를 팔로우 하십시오.

###

©2021 Morningstar, Inc. All Rights Reserved.

MORN-R