

코스피 200 ESG 지수 방법론

(KOSPI 200 ESG Index Methodology)

2018. 12



한국거래소가 산출하는 지수 및 기타 지적재산권은 한국거래소의 소유입니다. 한국거래소가 산출하는 지수 및 기타 지적재산권을 이용하거나 배포하기 위해서는 한국거래소의 허가가 필요합니다. 본 정보는 향후 변경될 수 있으며, 자료의 내용을 무단으로 전제하거나 복사하여 어떠한 형태로든 재배포할 수 없습니다.

○ (지수개요) 코스피 200 ESG 지수는 코스피 200 구성종목중 한국기업지배구조원(이하 “지배구조원”이라 한다)이 평가한 ESG평가가 우수한 종목을 구성종목으로 하여 개별 종목의 유동시가총액을 가중하는 방식의 지수로서 아래 산출방법에 따라 산출한다.

○ (산출방법)

제1조 (심사대상종목) 코스피 200 ESG 지수 구성종목 선정을 위한 심사대상종목은 심사연도 10월 최종 매매거래일(이하 “심사기준일”이라 함) 현재 코스피 200 구성종목으로 한다. 다만, 구성종목으로 적합하지 아니하다고 인정되는 종목은 심사대상종목에서 제외할 수 있다.

제2조 (심사기준) 코스피 200 ESG 지수 구성종목 선정을 위한 심사기준은 다음과 같다.

1. ESG점수기준 : 심사기준일이 속하는 연도의 지배구조원이 제정한 「지배구조 평가 및 등급부여에 관한 기준」(이하 “등급부여에 관한 기준”이라 한다)에 따라 지배구조원이 ESG 평가를 한 종목의 사회, 지배구조, 환경 각 부문별 점수(이하 “사회점수, 지배구조점수 및 환경점수”라 한다)
2. 주된영업기준 : 심사기준일로부터 소급한 최근 사업연도 영업매출액비중

제3조 (구성종목의 선정) ① 코스피 200 ESG 지수의 구성종목으로 선정되기 위해서는 다음 각 호의 어느 하나에 해당하여야 한다.

1. 사회점수, 지배구조점수, 환경점수 중 두 개 부문의 순위가 상위 100위 이내일 것
2. 사회점수, 지배구조점수, 환경점수 중 어느 하나의 순위가 상위 50위 이내일 것

② 제1항의 요건을 충족한 종목 중 도박, 담배, 주류, 군수산업 관련 주된영업기준이 20% 이상인 종목은 구성종목에서 제외한다.

제4조 (정기변경) ① 코스피 200 ESG 지수 구성종목은 매년 1회 정기적으로 제1조부터 제3조까지의 기준에 따라 심사하여 변경한다.

- ② 정기변경일은 코스피 200 선물시장 12월 결제월 최종거래일의 다음 매매 거래일로 한다.

제5조 (수시변경) ① 코스피 200 ESG 지수 구성종목이 다음 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우에는 해당 호에서 정하는 시기에 해당 종목을 구성종목에서 제외할 수 있다.

1. 코스피 200지수의 구성종목에서 제외되는 경우 : 코스피 200지수의 구성종목에서 제외되는 일자
2. 상장폐지 결정, 관리종목 지정, 투자주의 환기종목 지정 등 「한국거래소 지수 산출기준(이하 “기준”이라 함)」 제45조제1항 각 호의 어느 하나에 해당하는 경우 : 해당 호에서 정하는 매매거래일
3. 지배구조원이 등급부여에 관한 기준에 따라 ESG 등급을 수시조정하는 경우로서 ESG통합등급이 B+ 미만일 경우 : 조정 내용을 통보 받은 날로부터 10매매거래일 이내

② ESG 등급에 영향을 미치는 사건이 발생할 경우 거래소가 판단하여 제6조의 개별 구성종목의 시가총액 비중을 조정할 수 있다.

③ 제1항에 따라 구성종목을 변경하는 경우 다음 정기변경시까지 구성종목을 편입하지 않는다.

④ 그 밖의 수시변경에 관한 사항은 기준 제45조제2항부터 제5항까지의 수시변경에 관하여 준용한다.

제6조 (지수산출) ① 코스피 200 ESG 지수는 매 정기변경일 전일의 종가를 기준으로 개별 구성종목의 시가총액 비중이 유동시가총액 비중과 동일하게 되도록 조정한 종목별가중치를 곱한 유동주식수를 사용하여 산출한다.

② 제1항에도 불구하고 매년 5월말과 11월말 기준으로 개별 구성종목의 3개월 평균 유동시가총액 비중이 100분의 27을 초과하는 경우 이를 초과하지 않도록 비중을 조정하고 나머지 구성종목에 배분한다.

○ (기타) 동 산출방법에서 정하지 아니한 사항 등 필요한 사항은 거래소의 지수산출업무를 담당하는 부서의 장이 정한다.