

ESG Wannabe

SK증권 신성장산업분석팀

그린솔루션/항공우주/스몰캡. 나승두, 3773-8891

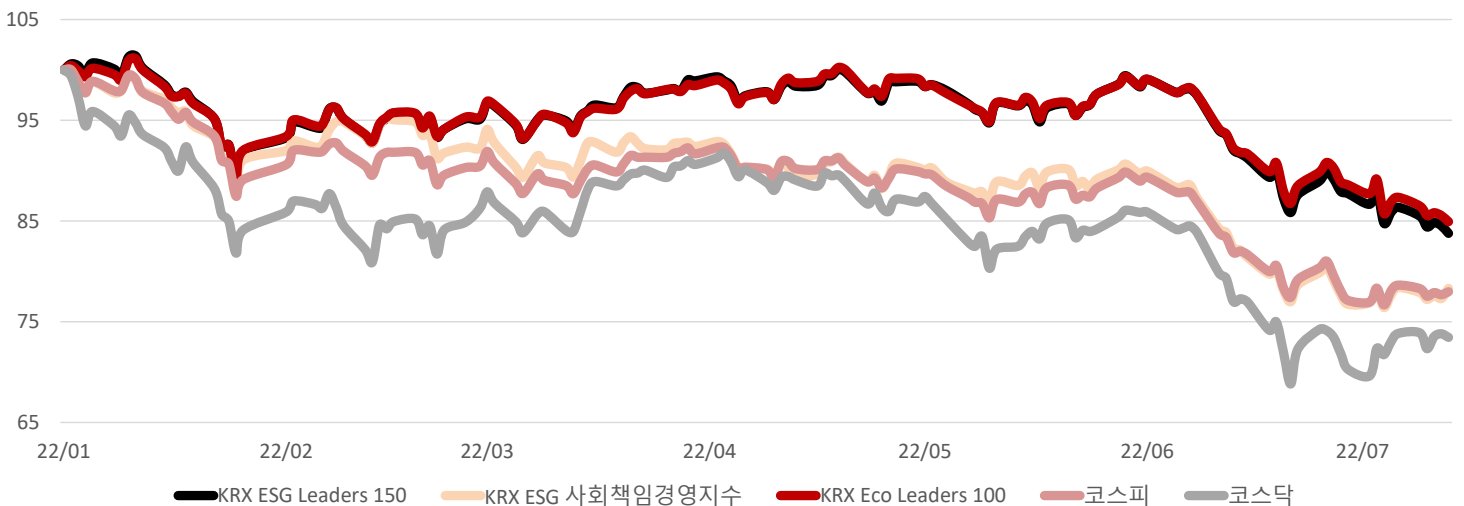


시장 Outperform한 ESG 지수

● 연초 이후 -20%대 하락한 증시 대비 선방

- 2022년 개장 이후 7/15 종가 기준 코스피와 코스닥은 각각 -22.0%, -26.5% 하락
- 같은 기간 KRX Eco Leaders 100 지수 -15.1%, KRX ESG Leaders 150 지수 -16.2% 하락하며 지수 대비 선방
- KRX Eco Leaders 100, ESG 3요소 중 환경점수 우수 및 개선 종목(코스피+코스닥 100개)으로 구성
지수 특징 종목, 셀트리온(시총 26조 2,530억), 녹십자(2조 1,500억), 농심(1조 7,06억), 신성이엔지(3,610억)
- KRX ESG Leaders 150, 개별 종목의 ESG 통합점수 비중 가중 방식으로 150개 종목 선정
지수 특징 종목, 카카오(31조 1,910억), HMM(11조 30억), 안랩(8,750억), SK디앤디(4,970억)
- ESG 지수의 공통적 특징, 유동성 풍부해야 하고, 도박/담배/주류/군수산업 관련 매출 비중 20% 미만이어야 함
- 한편, KRX ESG 사회책임경영 지수 연초 이후 -21.7% 하락하며 지수 대비 성과 가장 저조
- 여타 지수 대비 사회적책임점수 상위 중소형종목 비중 높지만, 시총 규모 큰 기업들의 영향 더 받기 때문
- **ESG 실천 적극적인 종목 중심 Portfolio 구성 시 시장 Outperform 할 수 있음 증명, 사회적책임 더욱 강화 필요**

연초 이후 국내 증시 및 ESG 주요 지수 추이 (2022년 1월 1일 100 기준)





Compliance Notice

- 작성자는 본 조사분석자료에 게재된 내용들이 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며, 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 신의 성실하게 작성되었음을 확인합니다.
- 본 보고서에 언급된 종목의 경우 당사 조사분석담당자는 본인의 담당종목을 보유하고 있지 않습니다.
- 본 보고서는 기관투자가 또는 제 3자에게 사전 제공된 사실이 없습니다.
- 당사는 본 보고서의 발간시점에 해당종목을 1% 이상 보유하고 있지 않습니다.
- 종목별 투자의견은 다음과 같습니다.
- 투자판단 3단계(6개월 기준) 15%이상→매수 / 15%~15%→중립 / -15%미만→매도