

키움퇴직연금증권모투자신탁[채권] 투자전략 추가 안내문

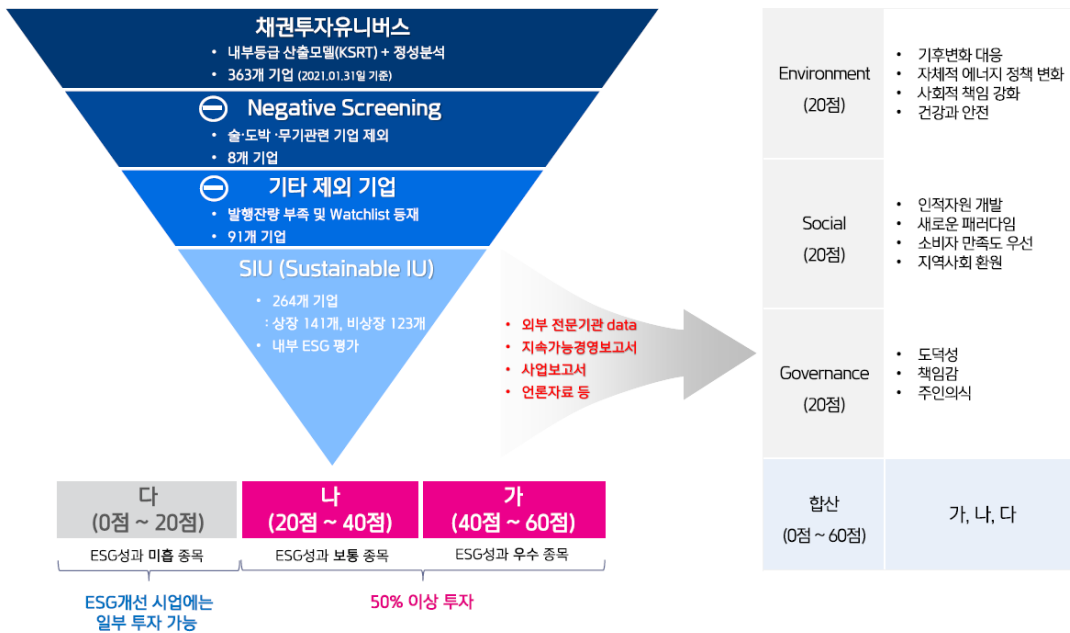
고객님, 안녕하세요?

키움퇴직연금증권모투자신탁[채권](이하 "동펀드") 투자전략 추가 및 투자신탁 명칭 변경 사항이 있어 고객님들께 말씀을 전하게 되었습니다.

동펀드는 모투자신탁으로서 채권에 투자자산총액의 60% 이상과 기타 자산군에 40% 이하를 투자하여 수익을 추구하는 펀드입니다. 최근 당사는 국제·국내 정세에 대두되고 있는 ESG(Environment, Social, Governance) 시장 성장과 맞물려 ESG 투자전략을 동 펀드에 접목하여 수익률 제고에 힘쓰고자 합니다. 이에 수익자님들께서도 아래 설명 드리는 상기 모투자신탁의 변경 사항을 참고하시어 펀드 투자 판단에 유의하시기 바랍니다.

- 아 래 -

- 변경 후 모투자신탁 명칭 : **키움 ESG 증권모투자신탁[채권]**
- 모투자신탁에 추가되는 투자 전략 : 아래 그림 참조



ESG에 기반한 ESG 채권유니버스 구성 방법론 및 관리원칙

ESG 채권유니버스 구성방법 및 관리원칙

1. Field survey (IR/NDR, 기업탐방 등), 산업매력도, 기업경쟁력 등의 산업별 전담체제를 통한 정성적 분석, 그리고 내부 계량평가 모델 (KRST, KCAT 등)을 활용한 정량적 분석을 활용하여 **채권유니버스** 구성
2. **채권유니버스에서 Negative Screening(술, 도박, 담배, 대량살상무기 등, 현재 풍산 등 8개사)과 투자가능성 평가(발행잔량 부족, Watch List제외 등 91개사)를 통해 ESG 채권유니버스 종목 선정**
3. ESG 채권유니버스 내에서 ESG 등급 평가 대상을 결정하고, 해당 기업들에 대해서 내부 ESG 평가표 작성
 - ✓ **자체 ESG 평가를 위해 외부전문기관의 ESG 평가 data를 참고하며, 언론자료, 사업보고서, 지속가능경영보고서 등을 점검하여 내부 ESG 평가 실시**
 - ✓ 외부전문기관의 ESG 평가 등급 (예시: 서스틴베스트 기준 7단계 중 'AA~B' 상위 등급)의 상위 등급 종목군 중심으로 재검증하되, 하위 등급(예시: 서스틴베스트 기준 'C~E') 또는 '무등급' 중 당사 ESG 등급평가 대상 기업에 대해서는 더욱 철저히 평가
 - ✓ 내부 ESG 등급은 '가~다'로 산출하며 '다' 등급은 투자가능 대상에서 원칙적으로 제외, 단, ESG개선기업 대상일 경우 투자 가능, E,S,G 중 항목별로 하나라도 심각한 손상이 있는 경우 투자 보류 조치
 - ✓ 내부 정기 분석은 연 1회 이루어지며, ESG 이슈가 있는 기업들은 수시 Update

점검 주기 및 방법
<ul style="list-style-type: none"> • 외부 연 2회(6월, 11월) : 서스틴베스트 ESG등급 발표 • 내부 연 1회(7월) : 사업보고서, 지속가능경영보고서 확인 • 수시 : 언론자료, 개별 기업탐방, 공시자료, 정부통계
점검 내용
<ul style="list-style-type: none"> • 기업가치와 ESG 변화에 영향을 미치는 변수 점검 • ESG 변화 추이와 향후 전개방향 분석 • Controversy issue 개선사항 점검
ESG 유니버스 구성 계획
<ul style="list-style-type: none"> • 현재 : 채권유니버스 363개사 중 95개 완료 • 계획 : 2021년 3월말까지 169개(상장 49개, 비상장 120개) 종목 추가평가 완료예정으로 완료 시 총 264개 유니버스 보유
신규종목 추가 편입·편출 원칙
<ul style="list-style-type: none"> • 편입 : 신규 발행 종목, 채권유니버스 내 유망종목 발굴 시 • 편출 : 회계적 이슈 발생 시, ESG상 중대한 변화 발생 시, 계속기업 가정이 불확실할 시
담당 인력
<ul style="list-style-type: none"> • Credit팀 : 채권유니버스 관리 및 내부 ESG 평가(비상장) • 주식리서치팀 : 내부 ESG 평가(상장) • 외부 리서치 : 외부전문기관 평가자료, 뉴스, 증권사 자료 등 • 채권운용본부장 : 유니버스 최종 결정

※ 기존 기업들을 평가하던 성장성 외의 기업들의 환경(Environmental), 사회(Social), 지배구조(Governance)에 대한 인식이 변화하게 되면서, ESG 관점에서 우수한 기업, 즉, 착한 기업이 소비자의 사랑을 받음과 동시에 수익률 관점에서도 매력적으로 변화하게 되었습니다. 이에 당사는 동 펀드 투자시, ESG 평가등급이 우량한 기업이 발행한 채권 및 어음과 ESG 목적채권에 투자자산의 50% 이상을 투자하는 전략을 추가하고자 합니다.

키움투자자산운용은 항상 고객님의께서 보내주신 기대와 성원에 부응하고자 한층 더 친절한 서비스와 만족스러운 상품으로 보답할 것을 약속 드립니다.

감사합니다.

키움투자자산운용 배상

키움퇴직연금증권모투자신탁[채권] 수익증권에 투자하는 펀드 리스트

1. 대상 펀드 리스트

No	펀드명
1	키움퇴직연금파이어니어증권자투자신탁제1호[채권] → 키움파이어니어ESG증권자투자신탁제1호[채권]
2	키움퇴직연금증권자투자신탁제A-1호[채권]
3	키움퇴직연금10증권자투자신탁제B-1호[채권혼합]
4	키움퇴직연금40증권자투자신탁제B-1호[채권혼합]
5	키움퇴직연금20증권자투자신탁제B-1호[채권혼합]
6	키움글로벌인덱스40증권자투자신탁제1호[채권혼합]
7	키움행복연금코리아증권전환형자투자신탁제1호[채권]
8	키움코리아증권전환형자투자신탁제1호[채권]
9	키움퇴직연금코리아인덱스40증권자투자신탁제1호[채권혼합]
10	키움행복연금2020증권전환형자투자신탁제1호[주식혼합-재간접형]
11	키움퇴직연금블루칩40증권자투자신탁제1호[채권혼합]
12	키움더드림중장기우량채증권자투자신탁제1호[채권] → 키움ESG중장기우량채증권자투자신탁제1호[채권]
13	키움파이어니어재형저축증권자투자신탁제1호[채권]
14	키움코리아인덱스15재형저축증권자투자신탁제1호[채권혼합]
15	키움인덱스55장기소득공제증권전환형자투자신탁제1호[주식혼합]
16	키움퇴직연금코어밸류40증권자투자신탁제1호[채권혼합]
17	키움차세대모빌리티30증권자투자신탁제1호[채권혼합]
18	키움작은거인장기소득공제증권자투자신탁[주식혼합]
19	키움작은거인50증권자투자신탁1호[채권혼합]
20	키움연금자자손손백년투자40전환형증권자투자신탁1호[채권혼합]
21	키움프런티어장기주택마련증권자투자신탁[채권]
22	키움장대장기소득공제증권자투자신탁[주식혼합]
23	키움고배당에이스30증권자투자신탁제1호[채권혼합]

2. 상기 ESG 투자 전략 추가 효력 발생일 : 2021년 4월 9일

3. 기타 문의 사항은 가까운 판매사 또는 당사 대표번호 02-789-0300 으로 연락 주시기 바랍니다.