

S&P 멀티에셋 지수 방법론

2025년 12월

이 문서는 오직 편의를 위해서 한국어로 번역되었습니다. 이 문서의 한국어와 영문버전에 차이가 있다면, 영문버전이 우선합니다. 해당 영문버전은 www.spglobal.com/spdji에서 확인할 수 있습니다.

목차

서문	3
주요 내용	3
계산 통화 및 추가 지수 수익률 시리즈	3
지수 세부정보	4
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 75/25 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	4
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 50/50 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	4
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 60/40 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	4
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 40/60 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	4
S&P 500 and S&P Bitcoin 75/25 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	5
S&P 500 and S&P Bitcoin 지수 (USD)	6
S&P 500 and iBoxx ALBI South Korea 3-10yr 30/70 Blend 지수 (KRW)	7
S&P Global Agribusiness Composite 지수	8
S&P 500 and Short-Term Treasury 30/70 Blend 지수	9
S&P 500 and Short-Term Treasury 50/50 Blend 지수	10
S&P 500 and iBoxx USD Treasuries Current 10 Year 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid	11
S&P 500 and iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid	12
Dow Jones U.S. Dividend 100 and iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid	13
S&P 500 and U.S. Treasury Bill 0-3 Month 50/50 Blend 지수	14
S&P 500 and Brazil Sovereign Inflation-Linked Bond 40/60 Blend 지수 (BRL) TR	15
iBoxx USD Liquid Investment Grade BRL Hedge Carry 지수 (BRL)	16
iBoxx USD Liquid High Yield BRL Hedge Carry 지수 (BRL)	17
Dow Jones Korea Dividend 30 and Short-Term Korea Sovereign Bond 50/50 Blend Indices 지수	18
S&P 500 and S&P GSCI Physical Gold 90/10 Blend 지수 (USD)	19
S&P 500 and S&P Cryptocurrency Top 10 75/25 Blend 지수 (USD)	20

S&P 500 and S&P Ether Futures 75/25 Blend 지수 (USD)	21
S&P 500 and S&P Ethereum 75/25 Blend 지수 (USD)	22
S&P 500 and S&P Solana Futures 75/25 Blend 지수(USD)	23
S&P 500 and S&P Solana Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)	24
S&P 500 and S&P XRP Futures 75/25 Blend 지수(USD) ER	25
S&P 500 and S&P XRP Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)	26
iBoxx Sovereigns Japan Current & CDX North America IG Blend 지수	27
S&P Global BMI and Cryptocurrency Broad Digital Asset 지수 (USD)	28
S&P 500 (KRW) and Gold (USD) 100/100 Blend 지수	29
S&P 500 (KRW) and Gold (USD) 50/50 Blend 지수	30
S&P 다우존스 지수 연락처	31
연락처	31
S&P 다우존스 지수 부인조항	32
성과 공개/백테스트된 데이터	32
지식재산권 고지/면책조항	33
ESG 지수 면책조항	35

서문

주요 내용

S&P 다우존스 지수의 멀티에셋 지수는 다양한 자산군의 기존 S&P 또는 다우존스 브랜드 지수를 결합하여 구성 지수별로 각 지수의 고유한 방법론 페이지에서 정의된 가중치로 결합하여 단일 지수를 구성하는 가중수익률 지수이다.

이후 페이지에서 별도로 명시하지 않는 한, 지수는 기초지수의 방법론과 아래 표에 나열된 문서에 문서화된 표준 정책 및 절차를 따른다. 이러한 정책 및 절차에는 기업행동 처리 및 재계산이 포함되나 이에 국한되지 않는다.

재조정. 이 방법론에 포함된 지수들은 각 지수의 방법론 페이지에 명시된 일정에 따라 재조정된다. 별도로 명시되지 않은 경우, 이 방법론의 구성 지수들은 각 기초지수의 방법론 문서에 명시된 일정에 따라 재조정된다.

지원 문서	URL
S&P 다우존스 지수의 주가지수 정책 및 관행 방법론	Equity Indices Policies & Practices
S&P 다우존스 지수의 채권지수 정책 및 관행 방법론	Fixed Income Policies & Practices
S&P 다우존스 지수의 상품지수 정책 및 관행 방법론	Commodities Indices Policies & Practices
S&P DJI 디지털 상품 정책 및 관행 방법론 및 지수 계산 방법론	S&P DJI Digital Assets Policies, Practices, & Mathematics Methodology
S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론	Index Mathematics Methodology

계산 통화 및 추가 지수 수익률 시리즈

본 방법론에 기술되어 있는 지수 이외에 지수의 추가적인 수익률 시리즈 버전을 사용할 수 있다. 해당 버전에는 통화, 통화헤지, 감액, 공정가격, 인버스, 레버리지, 위험통제 버전이 포함되지만 이에 한정되지 않는다. 사용 가능한 지수 목록에 대해서는 [S&P DJI 방법론 및 규제 현황 데이터베이스](#) 참조 요망

다양한 지수 유형에 대한 자세한 정보는 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론 참조 요망.

감액, 동적 헤지, 공정가치, 위험통제지수를 포함한 특정 유형의 지수를 계산하는 데 필요한 입력사항은 www.spglobal.com/spdji/에서 제공하는 매개변수 문서 참조 요망.

지수위원회는 예정된 재조정 일자나 그 전후에 발생하는 휴장일을 비롯한 여러 이유로 인해 재조정일을 변경할 수 있다. 그러한 변경사항은 가능하면 적절한 사전통보 기일과 함께 발표한다.

본 문서는 지수의 적격성 요건, 정책, 절차에 대한 완전한 이해를 돕기 위해 www.spglobal.com/spdji/에서 확인할 수 있는 기초지수의 방법론 문서와 함께 읽어야 한다.

지수 세부정보

S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 75/25 Blend 지수 (USD) (맞춤형)

S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 50/50 Blend 지수 (USD) (맞춤형)

S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 60/40 Blend 지수 (USD) (맞춤형)

S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 40/60 Blend 지수 (USD) (맞춤형)

지수 목적. 이들 지수는 아래에 정의된 구성 주식 및 선물 지수의 혼합으로 이루어진 멀티에셋 전략의 가중 수익률 성과를 측정한다.

구성 지수. 아래 표 참조 요망.

지수명	구성 지수		
	지수명	지수코드	가중치
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 75/25 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Bitcoin Futures 지수 (USD) ER	SPBTCFUE	25%
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 50/50 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	S&P 500 지수	500	50%
	S&P Bitcoin Futures 지수 (USD) ER	SPBTCFUE	50%
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 60/40 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	S&P 500 지수	500	60%
	S&P Bitcoin Futures 지수 (USD) ER	SPBTCFUE	40%
S&P 500 and S&P Bitcoin Futures 40/60 Blend 지수 (USD) (맞춤형)	S&P 500 지수	500	40%
	S&P Bitcoin Futures 지수 (USD) ER	SPBTCFUE	60%

구성 지수에 대한 정보는 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P 선물지수 방법론 참조 요망.

지수 구성: 각 재조정 시점에 지수는 각 구성 지수로 이루어진다.

지수 가중치: 각 재조정 시점에 각 구성 지수의 가중치는 위 표에 명시된 값으로 재설정한다.

지수 계산: 지수 계산에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론의 *가중수익률 지수* 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

재조정. 지수는 매월 재조정되며, 해당 월의 마지막 거래일 장 마감 후에 효력이 발생한다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

S&P 500 and S&P Bitcoin 75/25 Blend 지수 (USD) (맞춤형)

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수에 75%, S&P Bitcoin 지수에 25% 가중치를 두는 멀티에셋 전략의 가중수익률 성과를 측정한다.

기초 지수. S&P 500 지수 및 S&P Bitcoin 지수. 기초지수에 대한 자세한 내용은 www.spglobal.com/spdji/에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P 디지털 시장 지수 방법론 참조 요망.

기초 지수	지수코드	재조정 시점의 가중치
S&P 500 지수	500	75%
S&P Bitcoin 지수	SPBTC	25%

지수 계산. 지수는 가중수익률 방식으로 계산한다.

지수 계산에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 구성 지수의 가중치를 다음과 같이 재설정하여 월별 재조정을 실시한다.

- S&P 500 지수는 75%로 재설정
- S&P Bitcoin 지수는 25%로 재설정

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 기초지수들 중 하나라도 거래되는 모든 영업일에 지수는 계산한다. 오직 한 가지 기초지수만 거래될 경우, 거래가 이루어지지 않은 구성지수 값은 이전 거래일 값을 그대로 사용한다.

S&P 500 and S&P Bitcoin 지수 (USD)

지수 목표. 지수는 기초지수 구성종목의 성과를 측정한다.

기초 지수. S&P 500 지수 및 S&P Bitcoin 지수. 기초지수에 대한 자세한 내용은 www.spglobal.com/spdji/에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P 디지털 시장 지수 방법론 각각 참조 요망.

기초 지수	지수 코드
S&P 500 지수 (가격수익률)	500
S&P Bitcoin 지수	SPBTC

지수 구축. 각 재조정 시, 지수는 기초지수 구성종목으로 구성한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 기초지수를 따른다.

지수 편입. 기초지수 편입 종목은 지수에 동시에 편입된다.

지수 편출. 기초지수에서 편출된 구성종목은 지수에서 동시에 편출된다.

지수 계산. 지수는 S&P 500 구성종목의 경우 유동주식수 조정 시가총액(FMC)를 사용하여 계산하고, 비트코인의 경우 지수시가총액을 사용하여 계산한다.

계산 일정. 지수는 기초지수들 중 하나라도 거래되는 모든 영업일에 지수는 계산한다. 오직 한 가지 기초지수만 거래될 경우, 거래가 이루어지지 않은 구성지수 값은 이전 거래일 값을 그대로 사용한다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

S&P 500 and iBoxx ALBI South Korea 3-10yr 30/70 Blend 지수 (KRW)

지수 목표. 지수는 S&P 500(T-1)지수 (원화)에 30%, iBoxx ALBI South Korea 3-10 년 지수에 70% 가중치를 두는 멀티에셋 전략의 가중수익률 성과를 측정한다.

기초 지수. S&P 500 (T-1) 지수 (KRW) 및 iBoxx ALBI South Korea 3-10 년 지수.

기초 지수에 대한 자세한 정보는 아래 참조 요망.

- **S&P 500 (T-1) 지수 (KRW):** S&P 미국지수 방법론은 www.spglobal.com/spdji/에서 확인할 수 있다.
- **iBoxx ALBI South Korea 3-10yr 지수:** IHS Markit iBoxx ALBI 지수 가이드는 [여기](#)에서 확인할 수 있다.

기초 지수	지수 코드	재조정 시점의 가중치
S&P 500 (T-1) 지수 (원화)	SPXKHKP	30%
iBoxx ALBI South Korea 3-10yr 지수	IBXXKR3T_NC	70%

지수 계산. 지수는 가중수익률 방식으로 계산한다.

지수 계산에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 반기별로 재조정하고, 6 월과 12 월의 세 번째 월요일 이후, 미국시장 마감 후 한국시장 개장 전에 효력이 발생한다.

수시 재조정: 반기 재조정 외에도 주식 구성종목의 비중이 전체 지수 비중의 35%를 초과하거나 25% 미만으로 떨어질 경우 수시 재조정이 시행된다. 이러한 조건이 발생하면, 각 구성종목은 정해진 30% 주식 및 70% 채권 가중치로 가중치를 다시 부여하고 가중치 재부여 조건 발생 후 이틀 뒤 시장 개장 시점부터 효력이 발생한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 한국 원화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 한국 휴일 일정을 따르며 연중 매일 계산한다.

S&P Global Agribusiness Composite 지수

지수 목표. 지수는 농업 관련 주식 및 상품선물 구성지수의 동일가중 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다. 주식 구성지수는 S&P Global Agribusiness Equity 지수이다. 상품선물 구성지수는 S&P GSCI 농산물 및 축산물 선물계약으로 구성된 S&P GSCI Agriculture and Livestock 지수이다.

구성 지수. 각 재조정 시점에 아래 표에 있는 구성지수는 동일가중치를 적용한다.

구성지수	지수 코드	지수 가중치
S&P GSCI Agriculture & Livestock ER 지수	SPGSALP	50%
S&P Global Agribusiness Equity 지수	SPAGREDP	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P GSCI 방법론 및 S&P 테마지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방식으로 계산한다.

지수 계산에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 반기별로 재조정하고, 그 효력은 5 월과 11 월 세 번째 금요일 장 마감 후 발생한다. 재조정 기준일은 4 월과 10 월 세 번째 금요일 장 마감 후이다. 지수 지분은 재조정 효력일 7 영업일 전 가격을 기준으로 할당된다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러 및 유로로 계산한다.

계산 일정. 지수는 미국 주식시장이 개장하는 연중 모든 영업일에 계산한다.

S&P 500 and Short-Term Treasury 30/70 Blend 지수

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수(주식 구성 지수)와 S&P U.S. Ultra Short Treasury Bill & Bond 지수 (채권 구성 지수) 간의 30/70 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 지수	500	30%
채권	S&P U.S. Ultra Short Treasury Bill & Bond 지수	SPUSBUS	70%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P 글로벌 채권지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴일 일정을 따른다.

S&P 500 and Short-Term Treasury 50/50 Blend 지수

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수(주식 구성 지수)와 S&P U.S. Ultra Short Treasury Bill & Bond 지수 (채권 구성 지수) 간의 50/50 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 지수	500	50%
채권	S&P U.S. Ultra Short Treasury Bill & Bond 지수	SPUSBUS	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P Global Bond 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴일 일정을 따른다.

S&P 500 and iBoxx USD Treasuries Current 10 Year 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수(주식 구성 지수)와 iBoxx USD Treasuries Current 10 Year 지수 (채권 구성 지수) 간의 50/50 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다. 주식 구성 지수는 가격수익률로 계산하고 채권 구성 지수는 총수익률로 계산한다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 지수	500	50%
채권	iBoxx USD Treasuries Current 10 Year 지수	GB00BQNC3835	50%

구성 지수에 대한 정보는 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 iBoxx USD On-the-Run Treasuries 지수 가이드 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 분기 마지막 영업일 이후 분기별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴일 일정을 따른다.

S&P 500 and iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수(주식 구성 지수)와 iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 지수(채권 구성 지수) 간의 50/50 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다. 주식 구성 지수는 가격수익률로 계산하고 채권 구성 지수는 총수익률로 계산한다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 지수	500	50%
채권	iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 지수	GB00B05D1V12	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 iBoxx USD Benchmark 지수 가이드 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴일 일정을 따른다.

Dow Jones U.S. Dividend 100 and iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 50/50 Blend 지수 (USD) PR/TR Hybrid

지수 목표. 지수는 Dow Jones U.S. Dividend 100 지수(주식 구성 지수)와 iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 지수(채권 구성 지수) 간의 50/50 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다. 주식 구성 지수는 가격수익률로 계산하고 채권 구성 지수는 총수익률로 계산한다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	Dow Jones U.S. Dividend 100 지수	DJUSDIV	50%
채권	iBoxx \$ Treasuries 7-10Y 지수	GB00B05D1V12	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 Dow Jones Dividend 지수 방법론 및 iBoxx USD Benchmark 지수 가이드 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴일 일정을 따른다.

S&P 500 and U.S. Treasury Bill 0-3 Month 50/50 Blend 지수

지수 목표. 지수는 S&P 500 지수(주식 구성 지수)와 S&P U.S. Treasury Bill 0-3 Month 지수 (채권 구성 지수) 간의 50/50 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매일 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 지수	500	50%
채권	S&P U.S. Treasury Bill 0-3 Month 지수	SPBDUB3	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P Global Bill 지수 시리즈 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산한다. 뉴욕증권거래소(NYSE) 휴장일 일정을 따른다.

S&P 500 and Brazil Sovereign Inflation-Linked Bond 40/60 Blend 지수 (BRL) TR

지수 목표. 지수는 S&P 500 Brazilian Real 지수 (TR) (주식 구성 지수)와 S&P/B3 Brazil Sovereign Inflation-Linked Series B 1-5 Year Bond 지수 (채권 구성 지수) 간의 40/60 주식-채권 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다. 주식 구성 지수와 채권 구성 지수 모두 총수익률로 계산한다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
주식	S&P 500 Brazilian Real (TR) 지수	SPXPTXBT	40%
채권	S&P/B3 Brazil Sovereign Inflation-Linked Series B 1-5 Year Bond 지수	SPBNB15	60%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 확인할 수 있는 S&P 미국지수 방법론 및 S&P/B3 Brazil Bond 지수 시리즈 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

재조정. 지수는 매월 마지막 영업일에 월별로 재조정한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 브라질 레알화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 두 기초 지수가 모두 거래되는 모든 영업일에 계산한다.

iBoxx USD Liquid Investment Grade BRL Hedge Carry 지수 (BRL)

지수 목표. 지수는 CETIP 은행 간 금리(DIAR), iBoxx \$ Liquid Investment Grade 지수 TR(BRL), S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수(BRL) ER 사이에서 현금/채권/선물을 70/30/-30 으로 배분한 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성 지수. 재조정 시마다 구성 지수는 아래 표의 배분 비율에 따라 가중치를 다시 적용한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
채권	현금 (DIAR) ¹	--	70%
채권	iBoxx \$ Liquid Investment Grade 지수 TR (BRL)	IBULIGBT	30%
선물	S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수 (BRL) ER	SPBBUMFP	-30% ²

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 iBoxx USD Liquid Investment Grade 방법론 및 S&P/B3 Futures 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

재조정. 선물 롤오버 날짜에 매달 재조정되는데, 이 날짜는 미니선물계약의 마지막 거래일 2 영업일 전이다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

계산 통화. 지수는 브라질 레알로 계산한다.

계산 일정. 지수는 S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수 (BRL) ER 에 사용되는 휴장일 일정을 따른다.

¹ DIAR= 3. CETIP 의 일일 은행 간 익일물 금리는 증권예탁금융결제센터 ("CETIP")에서 매일 계산되는 연이율로, 브라질 내 모든 은행 간 익일물 거래의 평균 금리를 나타낸다. 적용되는 일수계산방식은 ACTBD/252 이다. 자세한 내용은 www.cetip.com.br 참조 요망.

² 마이너스 가중치 배분은 S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수(BRL) ER 구성 지수에 대한 매도 노출을 나타낸다.

iBoxx USD Liquid High Yield BRL Hedge Carry 지수 (BRL)

지수 목표. 지수는 CETIP 은행 간 금리(DIAR), iBoxx \$ High Yield Liquid Grade 지수 TR(BRL), S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수(BRL) ER 사이에서 현금/채권/선물을 30/70/-70 으로 배분한 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성 지수. 재조정 시마다 구성 지수는 아래 표의 배분 비율에 따라 가중치를 다시 적용한다.

자산군	구성 지수	지수 코드	가중치 배분
채권	현금 (DIAR)*3	--	30%
채권	iBoxx \$ Liquid High Yield 지수	IBULHYBT	70%
선물	S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수 (BRL) ER	SPBBUMFP	-70% ⁴

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 iBoxx \$ Liquid HY 방법론 및 S&P/B3 Futures 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

재조정. 선물 롤오버 날짜에 매달 재조정되는데, 이 날짜는 미니선물계약의 마지막 거래일 2 영업일 전이다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

계산 통화. 지수는 브라질 레알화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수 (BRL) ER 에 사용되는 휴장일 일정을 따른다.

³ DIAR= 3. CETIP 의 일일 은행 간 익일물 금리는 증권예탁금융결제센터 (“CETIP”)에서 매일 계산되는 연이율로, 브라질 내 모든 은행 간 익일물 거래의 평균 금리를 나타낸다. 적용되는 일수계산방식은 ACTBD/252 이다. 자세한 내용은 www.cetip.com.br 참조 요망.

⁴ 마이너스 가중치 배분은 S&P/B3 BRL-USD Mini Futures 지수(BRL) ER 구성 지수에 대한 매도 노출을 나타낸다.

Dow Jones Korea Dividend 30 and Short-Term Korea Sovereign Bond 50/50 Blend Indices 지수

지수 목표. 지수는 아래에 정의된 대로 주식 및 채권 구성 지수들의 혼합으로 이루어진 멀티에셋 전략의 가중수익률 성과를 측정한다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

구성 지수			
지수명	지수명	지수 코드	가중치
Dow Jones Korea Dividend 30 and Short-Term Korea Sovereign Bond 50/50 Blend 지수 (KRW)	Dow Jones Korea Dividend 30 PR	DJKRD3KP	50%
	South Korea Sovereign Bond 0-0.5Y PR	SPBKRSO0PNC	50%
Dow Jones Korea Dividend 30 and Short-Term Korea Sovereign Bond 50/50 Blend 지수 (KRW) TR	Dow Jones Korea Dividend 30 TR	DJKRD3KT	50%
	South Korea Sovereign Bond 0-0.5Y TR	SPBKRSO0	50%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 Dow Jones Dividend 지수 방법론 및 S&P South Korea Sovereign Bond 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 한국 원화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 연중 매일 계산하며, 한국 휴일 일정을 따른다.

S&P 500 and S&P GSCI Physical Gold 90/10 Blend 지수 (USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P GSCI Physical Gold 지수 간의 90/10 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

구성 지수. S&P 500 지수와 S&P GSCI Physical Gold 지수. 구성 지수에 대한 자세한 내용은 각각 S&P 미국 지수 방법론과 S&P GSCI 방법론 참조 요망. 해당 문서는 www.spglobal.com/spdji/에서 확인할 수 있다.

구성 지수	지수 코드	재조정 시 가중치
S&P 500 지수	500	90%
S&P GSCI Physical Gold 지수	SPGSPGU	10%

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

가중치 재부여. 지수는 구성 지수에 대해 분기 마지막 중복 거래일 증가 기준으로 위의 수준으로 분기별 가중치를 재부여한다.

또한 S&P GSCI Physical Gold 지수의 배분 비중이 5 거래일 연속으로 20%를 초과하는 경우, 지수는 분기 중에도 위의 수준으로 가중치를 재부여한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 두 구성 지수가 모두 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P Cryptocurrency Top 10 75/25 Blend 지수 (USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P Cryptocurrency Top 10 지수(USD) 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P Cryptocurrency Top 10 75/25 Blend 지수(USD)	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Cryptocurrency Top 10 지수(USD)	SPCC10U	25%
S&P 500 and S&P Cryptocurrency Top 10 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P Cryptocurrency Top 10 지수(USD)	SPCC10U	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Digital Assets 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P Ether Futures 75/25 Blend 지수 (USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P Ether Futures 지수(USD) ER 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P Ether Futures 75/25 Blend 지수(USD) ER	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Ether Futures 지수(USD) ER	SPETHFUE	25%
S&P 500 and S&P Ether Futures 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P Ether Futures 지수(USD) TR	SPETHFUT	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Futures 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P Ethereum 75/25 Blend 지수 (USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P Ethereum 지수(USD) 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P Ethereum 75/25 Blend 지수(USD)	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Ethereum 지수(USD)	SPETH	25%
S&P 500 and S&P Ethereum 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P Ethereum 지수(USD)	SPETH	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Digital Assets 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P Solana Futures 75/25 Blend 지수(USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P Solana Futures 지수(USD) ER 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P Solana Futures 75/25 Blend 지수(USD) ER	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Solana Futures 지수(USD) ER	SPSOLFUE	25%
S&P 500 and S&P Solana Futures 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P Solana Futures 지수(USD) TR	SPSOLFUT	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Futures 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P Solana Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P Solana Reference Price 지수 (USD) 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P Solana Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)	S&P 500 지수	500	75%
	S&P Solana Reference Price 지수(USD)	SPSOLN	25%
S&P 500 and S&P Solana Reference Price 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P Solana Reference Price 지수(USD)	SPSOLN	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Digital Assets 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P XRP Futures 75/25 Blend 지수(USD) ER

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P XRP Futures 지수(USD) ER 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P XRP Futures 75/25 Blend 지수(USD) ER	S&P 500 지수	500	75%
	S&P XRP Futures 지수(USD) ER	SPXRPFUE	25%
S&P 500 and S&P XRP Futures 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P XRP Futures 지수(USD) TR	SPXRPFUT	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Futures 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

S&P 500 and S&P XRP Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)

지수 목표. 이 지수는 S&P 500 지수와 S&P XRP Reference Price 지수(USD) 간의 75/25 배분 성과를 측정하는 가중수익률 지수이다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시, 구성 지수는 아래 표에 명시된 배분율로 가중치를 재부여한다.

지수명	구성 지수	지수코드	재조정 시 가중치
S&P 500 and S&P XRP Reference Price 75/25 Blend 지수(USD)	S&P 500 지수	500	75%
	S&P XRP Reference Price 지수(USD)	SPXRP	25%
S&P 500 and S&P XRP Reference Price 75/25 Blend 지수(USD) TR	S&P 500 지수(TR)	500TR	75%
	S&P XRP Reference Price 지수(USD)	SPXRP	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P 미국 지수 방법론 및 S&P Digital Assets 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매월 마지막 거래일 종가 기준으로 위의 수준으로 월별로 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 지수는 구성 지수 중 최소 하나라도 거래되는 모든 영업일에 산출한다.

iBoxx Sovereigns Japan Current & CDX North America IG Blend 지수

지수 목적. 아래에 정의된 바와 같이, 채권 지수와 신용부도스왑(CDS) 지수를 구성요소로 하는 멀티에셋 전략의 가중 수익률 성과를 측정한다.

구성종목 가중치. 매월 재조정 시점마다, 구성 지수들은 아래 표에 따라 가중치를 재조정한다.

지수명	구성 지수	지수코드	가중치
iBoxx Sovereigns Japan Current 20Y & CDX North America IG Blend 지수 (USD)	iBoxx Sovereigns Japan Current 20-Year 지수	IBA02227	50%
	CDX.NA.IG 7Y Long Mid Excess Return 지수	CI7LMER1	25%
	CDX.NA.IG 10Y Long Mid Excess Return 지수	CI1LMER1	25%
iBoxx Sovereigns Japan Current 30Y & CDX North America IG Blend 지수 (USD)	iBoxx Sovereigns Japan Current 30-Year 지수	IBA02230	50%
	CDX.NA.IG 7Y Long Mid Excess Return 지수	CI7LMER1	25%
	CDX.NA.IG 10Y Long Mid Excess Return 지수	CI1LMER1	25%

구성 지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 iBoxx Japan Sovereign 지수 방법론과 iTraxx / CDX Total and Excess Return 지수 방법론 참조 요망.

지수 계산. 지수는 가중수익률 방법론을 사용하여 계산한다.

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

계산 일정. 연중 매 거래일마다 일별로 산출하며 뉴욕증권거래소(NYSE)의 휴장일 일정을 따른다.

S&P Global BMI and Cryptocurrency Broad Digital Asset 지수 (USD)

지수 목적. 기초지수의 구성종목 성과를 측정한다.

기초지수. S&P Global BMI and Cryptocurrency Broad Digital Asset 지수. 기초지수의 구성종목 성과를 측정한다. 기초지수에 대한 정보는 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 the S&P Global BMI 지수 방법론과 S&P Digital Market 지수 방법론 참조 요망.

기초지수	지수코드
S&P Global BMI 지수	SPCBMIRGLUSD
S&P Cryptocurrency Broad Digital Asset 지수 (USD)	SPCBDM

지수 구성. 각 재조정 시점마다 기초지수의 구성종목으로 구성한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

지수 편입. 기초지수에 신규 편입되는 종목은 동일한 시점에 본 지수에도 편입된다.

지수 편출. 기초지수에서 편출되는 종목은 동일한 시점에 본 지수에서도 편출된다.

지수 계산. S&P Global BMI 구성종목에 대해서는 유동주식수 조정 시가총액(FMC) 가중 방식을 적용하며, S&P Cryptocurrency Broad Digital Asset 지수 구성종목에 대해서는 지수시가총액 가중 방식을 사용하여 산출한다.

계산 일정. 기초지수 중 하나 이상이 거래되는 모든 영업일에 산출한다. 기초지수 중 하나만 거래되는 경우, 거래되지 않은 구성요소의 지수 값은 직전 거래일의 값을 그대로 반영한다.

계산 통화. 지수는 미 달러화로 계산한다.

S&P 500 (KRW) and Gold (USD) 100/100 Blend 지수

지수 목적. S&P 500 지수에 100%, S&P GSCI Gold ER 지수에 100%를 각각 편입하는 레버리지 멀티에셋 전략의 성과를 측정한다.

구성 지수. S&P 500 지수 및 S&P GSCI Gold ER 지수. 각 구성 지수에 대한 자세한 내용은 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P U.S. 지수 방법론과 S&P GSCI 지수 방법론 참조 요망.

구성 지수	통화	재조정 시가중치
S&P 500 지수	KRW	100%
S&P GSCI Gold ER 지수	USD	100%

지수 계산. 지수는 다음과 같이 산출한다.

$$Index_t = Index_{t-1} * \left(1 + 100\% * \left(\frac{S\&P\ 500\ (USD)_{t-1}}{S\&P\ 500\ (USD)_{t-2}} * \frac{3pm\ KST\ KRW\ FX_t}{3pm\ KST\ KRW\ FX_{t-1}} - 1 \right) + 100\% * \left(\frac{S\&P\ GSCI\ Gold\ ER\ (USD)_{t-1}}{S\&P\ GSCI\ Gold\ ER\ (USD)_{t-2}} - 1 \right) \right)$$

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 주식 레버리지 지수(차입비용 미반영) 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매일 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 일정. 구성 지수 중 하나라도 거래가 이루어지는 모든 영업일에 산출한다. 구성 지수 중 하나가 휴장일이고 다른 하나가 거래일인 경우, 휴장 중인 구성 지수는 해당 일자에 수익률을 기여하지 않는다. 지수는 각 구성 지수의 개별 휴장일 달력에 따라 시점 $t-1$ 및 $t-2$ 값을 각각 선택하여 사용한다. 지수 산출 시 적용되는 원화(KRW) 환율은 각 산출일 t 및 $t-1$ 기준으로 이용 가능한 최신 환율을 기준으로 한다.

S&P 500 (KRW) and Gold (USD) 50/50 Blend 지수

지수 목적. S&P 500 지수에 50%, S&P GSCI Gold ER 지수에 50%를 각각 편입하는 가중 수익 기반의 멀티에셋 전략의 성과를 측정한다.

구성 지수. S&P 500 지수 및 S&P GSCI Gold ER 지수. 각 구성 지수에 대한 자세한 내용은 각각 www.spglobal.com/spdji 에서 각각 확인할 수 있는 S&P U.S. 지수 방법론과 S&P GSCI 지수 방법론 참조 요망.

구성 지수	통화	재조정 시 가중치
S&P 500 지수	KRW	50%
S&P GSCI Gold ER 지수	USD	50%

지수 계산. 지수는 다음과 같이 산출한다.

$$Index_t = Index_{t-1} * \left(1 + 50\% * \left(\frac{S\&P\ 500\ (USD)_{t-1}}{S\&P\ 500\ (USD)_{t-2}} * \frac{3pm\ KST\ KRW\ FX_t}{3pm\ KST\ KRW\ FX_{t-1}} - 1 \right) + 50\% * \left(\frac{S\&P\ GSCI\ Gold\ ER\ (USD)_{t-1}}{S\&P\ GSCI\ Gold\ ER\ (USD)_{t-2}} - 1 \right) \right)$$

지수 계산 방법론에 대한 자세한 내용은 S&P 다우존스 지수의 지수 계산 방법론에 실린 가중수익률 섹션 참조 요망.

재조정. 지수는 매일 재조정한다.

지수 유지관리. 모든 지수 조정 및 기업행동 처리는 구성 지수를 따른다.

계산 일정. 구성 지수 중 하나라도 거래가 이루어지는 모든 영업일에 산출한다. 구성 지수 중 하나가 휴장일이고 다른 하나가 거래일인 경우, 휴장 중인 구성 지수는 해당 일자에 수익률을 기여하지 않는다. 지수는 각 구성 지수의 개별 휴장일 달력에 따라 시점 $t-1$ 및 $t-2$ 값을 각각 선택하여 사용한다. 지수 산출 시 적용되는 원화(KRW) 환율은 각 산출일 t 및 $t-1$ 기준으로 이용 가능한 최신 환율을 기준으로 한다.

S&P 다우존스 지수 연락처

연락처

지수와 관련된 문의는 index_services@spglobal.com 로 문의 요망.

S&P 다우존스 지수 부인조항

성과 공개/백테스트된 데이터

해당되는 경우 S&P 다우존스 지수 및 지수 관련 계열사('S&P DJI')는 고객이 투명성을 제공함으로써 다양한 날짜를 정의합니다. 지수값 초일은 주어진 지수에 대해 계산된 값(실시간 또는 백테스트)이 있는 첫 번째 날입니다. 기준일은 계산을 위해 지수가 고정값으로 설정된 날짜입니다. 출시일은 지수값이 처음 실시간으로 간주되는 날짜를 지정합니다. 지수 출시일 이전의 날짜 또는 기간 동안 제공된 지수값은 백테스트된 것으로 간주됩니다. S&P 다우존스 지수는 출시일을 지수값이 공개된, 예를 들어 기업의 공개 웹사이트 또는 외부업체에 대한 데이터 피드를 통해 알려진 날짜로 정의합니다. 2013년 5월 31일 이전에도 도입된 다우존스 브랜드 지수의 경우 출시일(2013년 5월 31일 이전에는 '도입일'로 불림)은 지수방법론에 더 이상의 변경이 허용되지 않는 날짜로 설정되지만, 지수의 공개 발표일 이전이었을 수 있습니다.

재조정 방식, 재조정 시기, 편입 및 편출 기준, 모든 지수 계산 등 지수에 대한 자세한 내용은 지수의 방법론을 참조하십시오.

지수 출시일 이전에 제공된 정보는 실제 성과가 아닌 가상의 백테스트 성과이며 출시일에 유효한 지수방법론을 기반으로 합니다. 하지만 이례적인 시장 기간 또는 일반적인 현재 시장환경을 반영하지 않는 기타 기간에 대해 백테스트된 이력을 생성할 때 지수방법론 규칙은 지수가 측정하도록 설계된 목표시장이나 지수가 포착하도록 설계된 전략을 시뮬레이션할 수 있을 만큼 충분히 큰 유가증권 유니버스를 포착하도록 완화될 수 있습니다. 예를 들어, 시가총액 및 유동성 임계값이 낮아질 수 있습니다. 또한 포크는 S&P Cryptocurrency 지수와 관련된 백테스트 데이터에 포함되지 않았습니다. S&P Cryptocurrency Top 5 & 10 Equal Weight 지수의 경우 방법론의 수탁 요소가 고려되지 않았습니다. 백테스트 기록은 출시일 현재 수탁 요소를 충족하는 지수 구성종목을 기반으로 합니다. 또한 백테스트 성과에서 기업행동 처리는 지수관리 결정을 복제하는 데 한계가 있기 때문에 실제 지수에 대한 처리와 다를 수 있습니다. 백테스트 성과는 성과에 긍정적인 영향을 미칠 수 있는 요인에 대한 지식과 사후판단 편익을 가진 지수방법론 적용 및 지수 구성종목 선택을 반영하며, 결과에 영향을 미칠 수 있고 생존종목/전망 편견을 반영하는 것으로 간주될 수 있는 모든 금융위험을 설명할 수 없습니다. 실제 수익률은 백테스트 수익률과 크게 다를 수 있으며 더 낮을 수 있습니다. 과거 성과는 미래 결과를 나타내거나 보장하지 않습니다.

일반적으로 S&P DJI가 백테스트된 지수 데이터를 생성할 때 S&P DJI는 실제 과거 구성종목 수준 데이터(예: 과거 가격, 시가총액, 기업행동 데이터)를 계산에 사용합니다. ESG 투자는 아직 개발 초기 단계에 있기 때문에 S&P DJI 지수를 계산하는 데 사용되는 특정 데이터 포인트는 전체 백테스트 이력 기간 동안 사용하지 못할 수 있습니다. 동일한 데이터 가용성 문제가 다른 지수에도 해당될 수 있습니다. 모든 관련 과거 기간에 대한 실제 데이터를 이용할 수 없는 경우, S&P DJI는 백테스트된 과거 성과 계산을 위해 데이터의 '역방향 데이터 가정'(또는 폴링백)을 사용하는 과정을 사용할 수 있습니다. '역방향 데이터 가정' 지수 구성 기업이 사용할 수 있는 가장 빠른 실제 실시간 데이터 포인트를 모든 이전 과거 지수성과 사례에 적용하는 과정입니다. 예를 들어, 역방향 데이터 가정은 본질적으로 현재 특정 비즈니스 활동에 관여하지 않는 기업('제품 관련'라고도 함)이 역사적으로 관련되지 않았으며, 유사하게 현재 특정 비즈니스 활동에 관여하고 있는 기업도 역사적으로 관련되어 있다고 가정합니다. 역방향 데이터 가정을 사용하면 실제 데이터만 사용하여 실현 가능한 것보다 더 많은 역사적 연도에 걸쳐 가상의 역방향 테스트로 확장할 수

있습니다. '역방향 데이터 가정'에 대한 자세한 내용은 FAQ를 참조하십시오. 백테스트 이력에서 역방향 가정을 사용하는 모든 지수의 방법론과 팩트시트는 명시적으로 그 내용을 기술합니다. 방법론에는 특정 데이터 포인트와 역방향 측 데이터가 사용된 관련 기간을 설명하는 표가 담긴 부록이 포함됩니다. 표시된 지수 수익률은 투자가 가능 자산/증권의 실제 거래 결과를 나타내지 않습니다. S&P DJI는 지수를 유지하고 표시되거나 논의된 지수 수준과 성과를 계산하지만 자산을 운용하지는 않습니다.

지수 수익률은 지수 성과를 추적하기 위한 투자펀드 또는 지수의 기초증권을 매수하기 위해 투자자가 지불할 수 있는 판매수수료 또는 수수료 지급을 반영하지 않습니다. 이러한 수수료와 요금을 부과하면 증권/펀드의 실제 및 백테스트된 성과가 표시된 지수 성과보다 낮을 수 있습니다. 간단한 예를 들어, 지수가 12개월 동안 미화 10만 달러 투자에 대해 10% 수익률을 거두고(미화 1만 달러) 기간 말에 투자금 플러스 누적 이익 금액에 실제 자산기반 수수료 1.5%가 부과된 경우(미화 1,650 달러)를 적용하면 해당 연도의 순수익률은 8.35%(또는 미화 8,350 달러)가 됩니다. 3년 동안 연 10% 수익률을 가정하고 연말에 연간 1.5% 수수료를 내면 누적 총수익률은 33.10%, 총 수수료는 미화 5,375 달러, 누적 순수익률은 27.2%(미화 27,200 달러)가 됩니다.

지식재산권 고지/면책조항

© 2025 S&P 다우존스 지수. All rights reserved. S&P, S&P 500, SPX, SPY, The 500, US500, US 30, S&P 100, S&P COMPOSITE 1500, S&P 400, S&P MIDCAP 400, S&P 600, S&P SMALLCAP 600, S&P GIVI, GLOBAL TITANS, DIVIDEND ARISTOCRATS, Select Sector, S&P MAESTRO, S&P PRISM, S&P STRIDE, GICS, SPIVA, SPDR, INDEXOLOGY, iTraxx, iBoxx, ABX, ADBI, CDX, CMBX, MBX, MCDX, PRIMEX, HHPI, SOVX는 S&P Global, Inc. ("S&P 글로벌") 또는 계열사의 등록상표입니다. DOW JONES, DJIA, THE DOW, DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE는 Dow Jones Trademark Holdings LLC("다우존스")의 상표입니다. 이러한 상표는 다른 것과 함께 S&P 다우존스 지수 LLC에게 그 사용이 허락되었습니다. S&P 다우존스 지수 LLC의 서면 허가 없이 전부 또는 일부의 재배포 또는 복사를 금지합니다. 본 문서는 S&P DJI가 필요한 라이선스를 보유하고 있지 않은 관할권에서는 서비스를 제안하지 않습니다. 특정 맞춤형 지수 계산 서비스를 제외하고, S&P DJI가 제공한 모든 정보는 특정 개인과 관계가 없으며, 일체의 개인, 법인 또는 개인 집단의 요구에 맞추어 제공되지 않습니다. S&P DJI는 제 3자에 대한 지수의 사용 허락 및 맞춤형 계산 서비스의 제공과 관련하여 보상을 받습니다. 어느 지수의 과거 성과가 미래의 성과를 표시하거나 보장하지는 않습니다.

지수에 직접 투자하는 것은 가능하지 않습니다. 지수가 나타내는 자산군에 대한 투자는 해당 지수를 기반으로 하는 투자기구를 통해 가능합니다. S&P DJI는 제 3자가 제공하고 지수의 성과에 기반한 투자수익을 제공하려는 투자펀드 또는 기타 투자기구를 후원, 지지, 판매, 홍보, 관리하지 않습니다. S&P DJI는 이러한 지수에 기반한 투자상품이 지수성과를 정확하게 추적하거나 플러스 투자수익을 제공할 것이라고 약속하지 않습니다. S&PDJI는 투자자문사, 상품거래 어드바이저, 수탁사, '프로모터'(1940년 투자회사법, 개정), 15 U.S.C. § 77k(a)에 열거된 '전문가'가 아니며, S&P DJI는 이러한 투자펀드 또는 기타 투자기구에 대한 투자자문 가능성을 나타내지 않습니다. 본 문서에 기술한 내용에 의존하여 이러한 투자펀드 또는 기타 투자기구에 대한 투자결정을 내려서는 안 됩니다. S&P DJI는 세무 자문사가 아닙니다. 지수 내에 증권, 상품, 암호화폐, 기타 자산이 포함되어 있다고 해서 S&P DJI가 해당 증권, 상품, 암호화폐, 기타 자산의 매수, 매도, 보유를 추천하는 것이 아니며 이를 투자나 매매 자문으로 간주해서도 안 됩니다.

본 자료는 믿을 수 있다고 간주되는 출처로부터 그리고 일반적으로 공개되는 정보를 기반으로 정보 제공 목적으로만 작성되었습니다. 자료에 포함된 내용(지수 데이터, 등급, 신용관련 분석과 데이터, 리서치, 밸류에이션, 모델, 소프트웨어 또는 기타 응용 및 이를 통한 결과) 또는 그 일부(이하 "컨텐츠")를 S&P DJI의 사전 서면 승인 없이 어떠한 형태와 수단으로도 수정, 역설계, 재생산, 배포될 수 없으며

데이터베이스 또는 정보검색 시스템에 보관할 수 없습니다. 불법적으로 또는 미승인 목적으로 콘텐츠를 사용할 수 없습니다. S&P DJI 와 제 3 자 데이터 제공자 및 라이선스 부여자(총괄하여 “S&P 다우존스 지수 당사자”)는 콘텐츠의 정확성, 완전성, 적시성, 가용성을 보장하지 않습니다. S&P 다우존스 지수 당사자는 콘텐츠를 사용하여 얻은 결과에 대해 원인에 상관 없이 오류 또는 누락에 대해 책임지지 않습니다. 콘텐츠는 “있는 그대로” “있는 곳”기준으로 제공됩니다. S&P 다우존스 지수 당사자는 특정 목적이나 용도에 대한 거래성이나 적합성에 대한 보증, 버그, 소프트웨어 오류, 결함이 없다는 보증, 콘텐츠의 제공이 중단되지 않을 것이라는 보증, 콘텐츠가 어떠한 소프트웨어나 하드웨어 구성에서도 가동될 것이라는 보증 등 명백하거나 묵시적인 그 어떤 보증도 하지 않습니다. 콘텐츠의 사용과 관련하여 어떠한 경우에도 S&P 다우존스 당사자는 직접, 간접, 우발적, 예시적, 보상적, 처벌적, 특별, 결과적 손해, 비용, 지출, 법률 비용, 손실(손실 소득, 손실 이익, 기회 비용을 포함하되 이들에 한정되지 않음) 등에 대해 해당 손해의 가능성을 조언 받았다고 하더라도 누구에게도 이를 책임지지 않습니다.

신용관련 정보 및 기타 분석(등급, 연구, 평가 포함)은 일반적으로 라이선스 제공자와 S&P 다우존스 지수의 계열사에서 제공하는데, 이 계열사는 S&P Global Market Intelligence 와 같은 S&P 글로벌의 다른 부문을 포함하되 이에 국한되지 않습니다. 콘텐츠에서 모든 신용관련 정보 및 기타 관련 분석 및 진술은 표시된 날짜의 의견 진술이며 사실 진술이 아닙니다. 모든 의견, 분석 및 등급 인증 결정은 유가증권 매수, 보유, 매도 또는 투자 결정에 대한 권고가 아니며 유가증권의 적합성을 다루지 않습니다. S&P 다우존스 지수는 어떤 형태나 형식으로든 발행된 후 콘텐츠를 업데이트할 의무를 지지 않습니다. 콘텐츠는 투자 및 기타 사업 결정을 내릴 때 사용자, 해당 경영진, 직원, 어드바이저 및/또는 고객의 기술, 판단, 경험에 의존해서는 안 되며 이를 대체할 수 없습니다. S&P DJI 는 수탁사 또는 투자어드바이저 역할을 하지 않습니다. S&P DJI 는 신뢰할 수 있다고 판단되는 출처로부터 정보를 얻었지만 S&P DJI 는 어떠한 정보라도 감사를 수행하거나 독립적인 검증을 수행하지 않습니다. S&P DJI 는 규제 또는 기타 이유로 언제든지 지수를 변경하거나 중단할 권리가 있습니다. S&P DJI 가 통제할 수 없는 외부 요인을 포함한 다양한 요소로 인해 지수에 대한 중대한 변경이 필요할 수 있습니다.

규제당국이 특정한 규제목적 위해 다른 관할권에서 발행된 신용등급을 한 관할권에서 승인하도록 허용하는 한, S&P Global Ratings 는 단독 재량으로 언제든지 그러한 승인을 할당, 철회, 보류할 수 있는 권리를 보유합니다. S&P Global Ratings 를 포함한 S&P 다우존스 지수는 승인에 대한 양도, 철회, 보류로 인해 발생하는 모든 의무와 이로 인해 피해를 입었다고 주장되는 모든 손해에 대한 책임도 부인합니다. S&P Global Ratings 를 포함한 S&P 다우존스 지수 LLC 의 계열사는 일반적으로 증권 발행자나 인수자 또는 채무자로부터 신용등급 및 특정 신용관련 분석에 대한 보상을 받을 수 있습니다. S&P Global Ratings 를 포함하여 S&P 다우존스 지수 LLC 의 해당 계열사는 의견 및 분석을 배포할 권리를 보유합니다. S&P Global Ratings 의 공개 신용등급 및 분석은 웹사이트 www.standardandpoors.com (무료), www.ratingsdirect.com, www.globalcreditportal.com (가입)에서 제공되며 S&P Global Ratings 간행물 및 제 3 자 재배포자를 포함한 다른 수단을 통해 배포될 수 있습니다. 당사의 신용평가 수수료에 대한 추가 정보는 www.standardandpoors.com/usratingsfees 에서 확인할 수 있습니다.

각 활동의 독립성과 객관성을 유지하기 위해 S&P 글로벌은 다양한 부문과 사업부의 특정 활동을 서로 분리하여 유지합니다. 그 결과, S&P 글로벌의 특정 부문과 사업부는 다른 사업부에 없는 정보를 갖고 있을 수 있습니다. S&P 글로벌은 각 분석 과정과 관련하여 수령한 특정 비공개 정보의 기밀을 유지하기 위한 정책과 절차를 수립하였습니다.

또한 S&P 다우존스 지수는 증권 발행사, 투자자문사, 증권사, 투자은행, 기타 금융기관과 금융 중개회사 등 많은 조직에게 또는 이들 조직과 관련하여 광범위한 서비스를 제공하며, 이에 따라 S&P 다우존스 지수가 추천, 등급 산정, 모델 포트폴리오에 포함, 평가 또는 달리 언급하는 증권이나 서비스의 해당 조직 등 조직으로부터 수수료 또는 기타 경제적 이익을 받을 수 있습니다.

일부 지수는 세계산업분류기준(GICS®)을 사용하는데, 이 기준은 S&P 글로벌과 MSCI 이 개발했고 이 두 회사의 독점적 재산이며 상표입니다. MSCI, S&P DJI 또는 GICS 분류의 작성 또는 편집에 관련된 다른 어떤 당사자도 그러한 표준 또는 분류(또는 그 사용으로 얻은 결과)와 관련하여 명시적 또는 묵시적으로 보증하거나 진술을 하지 않으며, 그러한 모든 당사자는 그러한 표준 또는 분류와 관련하여 독창성, 정확성, 완전성, 상업성 또는 특정 목적에의 적합성에 대한 모든 보증을 명시적으로 포기합니다. 전술한 내용을 제한하지 않고 어떠한 경우에도 MSCI, S&P DJI, 그 계열사 또는 GICS 분류의 작성 또는 편집과 관련된 제 3 자는 어떠한 직접, 간접, 특수, 징벌적, 결과적(손실 이익 포함) 또는 그러한 손해 가능성을 통보 받았을지라도 기타 어떠한 손해에 대해서도 아무런 책임도 지지 않습니다.

S&P 다우존스 지수 상품은 해당 상품이 제공될 수 있는 계약조건의 적용을 받습니다. 라이선스는 이용하는 상품이나 서비스 표시, 파생제품 생성 및/또는 배포하기 위해서 S&P 다우존스 지수로부터 획득해야 하고, S&P 다우존스 지수 및/또는 지수 데이터에 기초하거나 적용됩니다.

ESG 지수 면책조항

S&P DJI 는 다음을 포함한 특정 환경, 사회, 지배구조(ESG) 지표 또는 이러한 지표 조합을 기준으로 지수 구성종목을 선택, 편출 및/또는 가중치를 부여하는 지수를 제공합니다. 환경 지표(효율적인 천연자원 사용, 폐기물 생산, 온실가스 배출, 생물 다양성에 대한 영향 등), 사회 지표(불평등, 인적자본에 대한 투자 등), 지배구조 지표(건전한 경영구조, 직원 관계, 직원 보수, 세금 준수, 인권 존중, 반부패 및 뇌물 방지 문제 등), 특정 지속가능성 또는 가치관련 기업 관련 지표(예: 논란이 되는 무기, 담배 제품, 연료탄 생산/유통) 또는 논란 모니터링(ESG 관련 사건에 관련된 기업을 확인하기 위한 언론매체 조사 포함).

S&P DJI ESG 지수는 지수 구성종목 선정 및/또는 가중치 부여에 ESG 지표와 점수를 사용합니다. ESG 점수 또는 등급은 환경, 사회, 기업 지배구조 문제와 관련하여 기업 또는 자산 성과를 측정하거나 평가하기 위한 것입니다.

S&P DJI ESG 지수에 사용되는 ESG 점수, 등급, 기타 데이터는 제 3 자(이러한 제 3 자는 S&P Global 의 독립 계열사 또는 비계열사)가 직간접적으로 제공하므로 S&P DJI ESG 지수의 ESG 요소 반영 능력은 이러한 제 3 자의 데이터 정확성과 가용성에 따라 달라질 수 있습니다.

ESG 점수, 등급, 기타 데이터는 보고(기업 또는 자산에 의해 공개되거나 공개적으로 이용가능하게 제공됨을 의미함), 모델링(데이터 생성에 프록시만을 사용하여 자체 모델링 프로세스를 사용하여 도출됨을 의미함) 또는 보고 및 모델링(보고 데이터와 모델링 데이터가 혼합되어 있거나 공급업체가 자체 점수 또는 결정 프로세스에서 보고 데이터/정보를 사용하여 도출됨을 의미함) 방식으로 제공될 수 있습니다.

외부 및/또는 내부 출처의 ESG 점수, 등급, 기타 데이터는 특히 잘 정의된 시장표준이 없고, ESG 요소와 고려사항을 평가하는 다양한 접근방식과 방법론이 존재하기 때문에 정성적, 판단적 평가를 기반으로 합니다. 따라서 모든 ESG 점수, 등급, 기타 데이터에는 주관성과 재량이라는 요소가 내재되어 있으며, ESG 점수, 등급 및/또는 데이터 소스마다 다른 ESG 평가 또는 추정 방법론이 사용될 수 있습니다. 특정 기업, 자산, 지수의 지속가능성 또는 영향력에 대해 사람마다(ESG 데이터 평가 또는 점수 제공자, 지수 관리자 또는 사용자 포함) 다른 결론에 도달할 수 있습니다.

제 3 자가 직간접적으로 제공한 ESG 점수, 등급 또는 기타 데이터를 지수가 사용하는 경우, S&P DJI 는 해당 ESG 점수, 등급, 데이터의 완전성에 대한 정확성에 대해 책임을 지지 않습니다. 'ESG', '지속가능성', '양호한 거버넌스', '부정적인 환경, 사회 및/또는 다른 영향 없음' 또는 이와 동등하게 표시된 기타 목표를 결정하기 위한 명확하고 최종적인 단일 테스트 또는 프레임워크(법적, 규제적 또는 기타)는 존재하지 않습니다. 따라서 동일한 투자, 상품 및/또는 전략에 대해 'ESG', '지속가능성', '양호한 지배구조', '부정적인

환경, 사회 및/또는 다른 영향 없음' 또는 이와 동등하게 분류되는 기타 목표에 대해 사람마다 다르게 분류할 수 있습니다. 더욱이 'ESG', '지속가능성', '양호한 거버넌스', '부정적인 환경, 사회 및/또는 다른 영향 없음' 또는 이와 동등하게 표시된 기타 목표에 대한 법적 및/또는 시장 입장은 특히 추가 규제 또는 업계 규칙 및 지침이 발표되고 ESG 지속가능 금융 프레임워크가 더욱 정교해면서 시간이 지남에 따라 변경될 수 있습니다.

잠재적 S&P DJI ESG 지수 사용자는 관련 지수방법론 및 관련 공시를 주의 깊게 읽고 해당 지수가 잠재적 사용 사례 또는 투자 목적에 적합한지 판단하는 것이 좋습니다.