
Index Methodology Book

WICS 섹터 지수 (WICS Sector Index)

FnGuide

Last updated: April, 2022

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

Table of Contents

지수 개요	2
지수 구성요소	3
Wics 분류 절차	3
지수 편입 대상 종목	3
지수 편입 제외 대상 예시	3
지수채용비중	3
종목 관리 및 유지	4
정기변경	4
특별변경	4
별첨 1. 유동주식비율 적용	5
별첨 2. WICS Classification	6

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

지수 개요

WICS(WISE Industry Classification Standard) sector Index 의 Sector는 국제적으로 통용되는 분류 기준을 국내 실정에 맞게 재구성하여 크게 대분류, 중분류, 소분류, 세분류로 나누어진다.

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

지수 구성요소

■ WICS 분류 절차

1. <http://dart.fss.or.kr/>(전자공시시스템)내에 공시된 해당기업에 관한 '사업보고서'를 검색
2. 해당기업의 총 '매출액'을 구성하는 사업 중 비중도가 가장 큰 사업이 해당 기업의 섹터로 분류되어 1차검증이 이루어짐
3. 1차 검증 뒤, '사업설명서' 본문에 기재되어 있는 동사(유사) 업종에 관련된 기업리스트와 비교하여 2차 검증이 이루어짐
4. 2차 검증 후에도 섹터 정의가 불분명할 경우, 해당 기업 웹사이트 등을 참고하여 최종 WICS 섹터 결정.

■ 지수 편입 대상 종목

지수 편입 종목은 코스피, 코스닥 시장으로 신규 상장하는 보통주를 기준으로 하며 아래 조건에 해당하는 경우에만 일반적으로 WICS 분류를 진행하여 지수에 편입하고 그 외의 경우에는 편입시키지 않는다.

1. 코넥스 -> 코스닥 이전상장하는 종목
2. 기업분할 생길시 분할종목
3. 스펙합병으로 코스닥, 코스피 시장으로 상장하는 종목

■ 지수 편입 제외 대상 예시

1. 투자회사(MF), ETF, DR, 펀드, 해외주권 등
2. 우선주
3. 코넥스 상장 기업

■ 지수채용비중

1. 시가총액 가중비중
2. 유동주식비율 적용

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

종목 관리 및 유지

■ 정기변경

WICS 섹터 지수는 매 6월, 12월 옵션 만기일 익일에 지수의 정기변경을 실시한다. 정기변경 시점의 편입 / 편출 종목을 결정하기 위해 전 종목에 대하여 WICS분류를 재검증한다. 기업의 매출액 구조가 변경이 생겨 해당기업의 WICS분류가 변경될 경우, 해당분류의 매출액이 가장 높게 5반기이상 지속될 경우에만 해당기업을 정기변경 대상에 포함시킨다.

■ 특별변경

WICS 섹터 지수의 편입 기업에 대하여 관리종목 지정, 정리매매, 화의신청 등의 이벤트가 발생할 경우 특별변경을 고려하여 WICS 섹터 지수의 구성 종목을 관리한다.

1) 관리종목 지정

관리종목 지정 관련하여 다음 2가지 중 해당하는 이벤트를 적용한다.

① 관리종목 지정

관리종목으로 지정 이후 해당 종목의 매매거래가 재개되고 2매매거래일이 경과한 다음날부터 WICS 섹터 지수 구성종목에서 제외한다. 단, 사유 발생 시점부터 15일(주식시장 매매거래일) 경과시점까지 해당 종목의 매매거래정지가 재개되지 않을 경우, 16일째에 지수에서 제외한다.

② 관리종목 해제

구성종목 제외 전 관리종목에서 해제될 경우 편입이 유지되고, 구성종목 제외 후 해제될 경우 다음 정기변경일까지 WICS 섹터 지수 구성종목에서 제외한다.

2) 정리매매

관리종목 이외의 경우, 정리매매일부터 WICS 섹터 지수 구성종목에서 제외한다.

3) 화의신청

화의신청 종목으로 공시된 경우 공시일로부터 WICS 섹터 지수 구성종목에서 제외한다.

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

별첨1. 유동주식비율 적용

유동주식비율은 산출된 유동주식수를 기준으로 지수산정주식수 대비 비율을 산출한 값을 의미하며, 최대 주주 및 자사주, 우리사주, 보호예수 주식수를 고려한 유동주식비율(Free Float Rate)을 지수산정에 필요한 시가총액에 적용한다.

* 산정방식: 유동주식비율 서비스

[유동주식비율 산식]

$$= (\text{지수산정주식수} - \text{최대주주} - \text{공동주주} - \text{자사주} - \text{우리사주} - 5\% \text{이상 정부출연기관}^1 \text{ 주식수} - \text{보호예수 주식수}^2 - \text{해외DR 주식수}^3) \times 100 / \text{지수산정주식수}$$

적용 유동주식비율 방식 변경:

지수시작일 ~ 2017.09.14

* 적용 지수 유동주식비율: 유동주식비율은 종목별로 5단위로 올림하여 적용함

EX> 유동주식비율이 63.33%였다면, 지수 산정을 위한 유동주식비율은 65%

2017.09.15 이후

* 적용 지수 유동주식비율: 유동주식비율은 종목별로 1단위로 올림하여 적용함

EX> 유동주식비율이 63.33%였다면, 지수 산정을 위한 유동주식비율은 64%

1 정부출연기관: <https://www.gov.kr/nlogin/veraport> 에 명시된 중앙행정기관 및 지방자치단체의 경우 적용합니다.

2 보호예수 주식수는 2018.09 정기변경일부터 유동주식비율 계산시 고려됨

3 해외DR 주식수는 2019.06 정기변경일부터 유동주식비율 계산시 고려됩니다.

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

별첨2. WICS classification

- WICS Sector 는 10개의 대분류, 28개의 중분류와 79개의 소분류로 구성되어 있습니다.

대분류	중분류	대분류	중분류
에너지	에너지	건강관리	건강관리장비와서비스
소재	소재		제약과생물공학
산업재	자본재	금융	은행
	상업서비스와공급품		증권
	운송		다각화된금융
경기관련소비재	자동차와부품	IT	보험
	내구소비재와의류		부동산
	호텔,레스토랑,레저 등		소프트웨어와서비스
	소매(유통)		기술하드웨어와장비
	교육서비스		반도체와반도체장비
필수소비재	식품과기본식품소매	커뮤니케이션서비스	전자와전기제품
	식품,음료,담배		디스플레이
	가정용품과개인용품		전기통신서비스
		유틸리티	미디어와엔터테인먼트
			유틸리티

FnGuide에서 제공하는 모든정보는 신뢰할 수 있는 자료로부터 얻어진 것이나 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 그러므로, 투자자 자신의 판단과 책임하에 종목선택이나 투자시기에 대한 최종결정이 이루어져야 합니다. 따라서, 본서비스에서 제공하는 모든 정보는 어떠한 경우에도 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙 자료로 사용될 수 없습니다. 또한, 본 서비스상의 모든 정보는 FnGuide 고객에게만 제공되는 것으로 당사의 동의 없이 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 등의 행위는 법으로 금지되어 있습니다.