



Methodology Book of

KAP MKBP 1Year Public Bond Index

---

2018.06

## 1. 매경BP 국공채1년 지수 (MKBP 1YR Public Bond Index)

- 매경BP 국공채1년지수는 신용등급이 높은 국공채(AAA 이상)를 위주로 구성된 지수 입니다.
- 목표 듀레이션은 매경BP 1년 지수와 동일한 1년입니다.

## 2. 지수 상세 정보

구 분	내 용
지수명	· 매경 BP 국공채 1년 지수(MKBP 1 Year Public Bond Index)
유형	· 종합채권지수
목표	· 목표 듀레이션을 1년으로 설정하여 단기운용지표로 활용
기준일	· 2001.1.2(100pt)
공시주기	· 매일 종가기준 공시
목표 듀레이션	· 1년
채권종목	· 900종목 내외 국채 및 AAA 등급 특수 금융채 및 공사채
채권만기	· 3M 초과 ~ 3Y 이하 (3M ~ 1Y: 55%, 1Y ~ 2Y: 40%, 2Y ~ 3Y: 5%)
신용등급	· 특수 금융채 및 공사채: AAA 이상
가중치 부여방식	· 시가총액 비중 (Market Weight)
채권단가	· 영업일(T) 단가 적용
Rebalancing	· 매일(일별)
포트폴리오 제외	· 국채/공사채 이외, 만기 3개월 이하, 사모, 후순위, FRN, 주식관련채권, 옵션부채권, 미상환잔액 10억 미만
기타사항	· 신규발행 종목: 익일 지수 산정 대상포함 · 신용등급 변동: 변경일 당일 해당 신용등급으로 평가 · 정금채: 평가는 분리, 지수는 기존 'C300(공사채 AAA 등급)' 유지