



Methodology Book of

KAP MK CABP 120 Index

2018.06

1. 매경 CABP120 지수 (MK CABP 120 Index)

- 매경 BP1년 지수를 추적하도록 구성된 지수입니다. 최소의 종목으로 전체 채권시장의 수익률을 추적합니다. 또한 포트폴리오 Rebalancing을 최소화하여 매매비용을 최소화 합니다.
- 종목별 최적비중 정보를 제공하여 채권형 인덱스펀드 운용에 활용할 수 있습니다.

2. 지수 상세 정보

구 분	내 용
지수명	· 매경 CABP120 지수(MK CABP 120 Index)
유형	· Tracker Index
목표	· 매경 BP1 년 지수를 추적
기준일	· 2001.1.2(100pt)
공시주기	· 매일 종가기준 공시
목표 듀레이션	· 1 년
채권종목	· 120 종목
신용등급 및 발행잔액	· A-이상
가중치 부여방식	· 동일투자비중(Equal Weight)
채권단가	· 영업일(T) 단가 적용
Rebalancing	· 매월 1 번째 영업일 (달력일 기준, 휴일 상관없음) · 동일종목교체비율 평균 8% 미만
Tracking 방안	· Sector-Based Indexing 및 Distribution-Based Indexing 결합 - 매경 BP1 년 지수의 Cell 별 특성치를 대표하는 종목 선정 - 발행량과 거래량 상위의 조건을 만족하는 종목 선정 - 단기물을 장기물로 교체함으로써 Rebalancing 횟수 감소
이자 재투자방식	· Call 재투자
포트폴리오 제외	· 만기 3 개월 이하, 사모, 후순위, FRN, 주식관련채권, 옵션부채권, 물가연동채권, 미상환잔액 10 억 미만
기타사항	· 신규발행 종목: 익일 지수 산정 대상포함 · 신용등급 변동: 변경일 당일 해당 신용등급으로 평가