



Methodology Book of

KAP MKBP Short/Mid/Long-term Index

2018.06

1. 매경BP 단기/중기/장기 지수 (MKBP Short/Mid/Long-term Index)

- 목표 듀레이션에 따른 기간별 단기운용지표로 활용하기 위한 지수 입니다.

2. 지수 상세 정보

구 분	내 용		
지수명	· 매경 BP 단기지수	· 매경 BP 중기지수	· 매경 BP 장기지수
유형	· 종합채권지수		
특징	· 목표 듀레이션에 따라 기간별로 적합한 운용지표로 활용		
기준일	· 2001.1.2(100pt)		
공시주기	· 매일 증가기준 공시		
목표 듀레이션	· 0.6~0.75 년	· 1.7~1.85 년	· 8~9 년
채권종목	· 1,600 종목 내외 신용등급 A-이상의 국내 채권(2018.01.02 기준)		
	· 1,600 종목 내외	· 4,700 종목 내외	· 3,000 종목 내외
채권만기	· 6M 초과 ~ 1Y 이하	· 1Y 초과 ~ 3Y 이하	· 3Y 초과 ~
신용등급	· A- 이상		
가중치 부여방식	· 시가총액 비중 (Market Weight)		
채권단가	· 영업일(T) 단가 적용		
Rebalancing	· 매일(일별)		
포트폴리오 제외	· 만기 6 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		