



# Methodology Book of

KEBI (Korea Economic Bond Index)

---

2018.06

## 1. KEBI F3 (Korea Economic Bond Index)

- ETF 벤치마크 지수 제공을 위한 지수로 KTB 3년 국채선물(근월물) 바스켓 3종목과 동일하게 구성됩니다.
- 향후 ETF 설정 예정 시 ETF운용에 적합하도록 공시주기, 리밸런싱 주기, 종목별 투자비중 등 변경 할 예정 입니다.

## 2. 지수 상세 정보

구 분	내 용
지수명	· KEBI F3 Index (KEBI 국고채 F3 Index)
지수유형	· 실시간 지수
지수목표	· 향후 ETF 벤치마크 지수 제공을 위한 Index 구축
기준일	· 2009.9.14(100pt)
공시주기	· 09시부터 15시 15분까지 5분 간격 공시 · 시초가: 09시부터 계산하여 09:05분에 최초공시 · 종가지수: 18시 발표(KAP의 최종가격을 지수에 적용)
목표 듀레이션	· 2.5~2.8년 수준
채권종목	· KTB 3년 국채선물(근월물) 바스켓 3종목 · 바스켓 구성: 3년물 2종목, 5년물 1종목
신용등급	· 국고채
가중치부여방식	· 각 종목별 액면금액 동일 비중(채권 3종목은 종목별 1/3)
채권단가	· T+1
리밸런싱 (Basket 교체)	· 분기별(3,6,9,12월 세 번째 화요일)
대표지수	· 총수익지수(Total return index)
주요지수	· 시장가격지수(Gross price index), 순가격지수(Clean price index)
이자재투자방식	· YTM 재투자