



Methodology Book of

KAP MKBP 1Year Index

2018.06

1. 매경BP 1년 지수 (MKBP 1Year Bond Index)

- 국내 채권시장의 채권운용이 대부분 1년 미만의 단기로 운용되는 관행을 감안하여 듀레이션이 1년이 되도록 종합채권지수를 재구성한 지수입니다.
- 목표 듀레이션이 1년이라는 지수의 특성에 따라 잔존만기 3개월 ~ 3년 구간의 시장분포를 파악한 후 잔존만기 별 분포에 따라 가중치를 부여하는 방식으로 구성됩니다.

2. 지수 상세 정보

구 분	내 용
지수명	· 매경 BP 1년 지수 (MKBP 1 Year Bond Index)
유형	· 종합채권지수
목표	· 목표 듀레이션을 1년으로 설정하여 단기운용지표로 활용
기준일	· 2001.1.2(100pt)
공시주기	· 매일 증가기준 공시
목표 듀레이션	· 1년
채권종목	· 6,600 종목 내외 신용등급 A-이상의 국내 채권
채권만기	· 3M 초과 ~ 3Y 이하 (3M ~ 1Y: 55%, 1Y ~ 2Y: 40%, 2Y ~ 3Y: 5%)
신용등급	· A- 이상
가중치 부여방식	· 시가총액 비중 (Market Weight)
채권단가	· 영업일(T) 단가 적용
Rebalancing	· 매일(일별)
포트폴리오 제외	· 만기 3개월 이하, 사모, 후순위, FRN, 주식관련채권, 옵션부채권, 물가연동채권, 미상환잔액 10억 미만
기타사항	· 신규발행 종목: 익일 지수 산정 대상포함 · 신용등급 변동: 변경일 당일 해당 신용등급으로 평가