



Methodology Book of
KAP 1-5년 AAA 공사은행채 지수

2022.11

1. KAP 1-5 년 AAA 공사은행채 지수

- KAP 1-5 년 AAA 공사은행채 지수는 잔존만기 1-5 년인 공사채와 은행채 AAA 로 구성되어 있는 지수임.
- 동 지수는 미상환잔액 500 억원 미만, FRN, 주식관련채권, 후순위채, 사모채권, 옵션부채권 은 구성종목에서 제외하고 있음.
- 동 지수의 채권 구성종목은 1,300 여 종목 (22.10 월말 기준)으로 시가총액(Market Weight) 비중 방식으로 산출되고 있음.

2. 지수 상세 정보

구분	특징
지수명	• KAP 1-5년 AAA 공사은행채 지수
종류	• 채권 증가 지수
공시주기	• 매 영업일 18시 30분 증가지수 공시
기준일	• 2015년 12월 31일(100pt)
적용채권단가	• T+1 영업일 단가
듀레이션	• 2.26y (22.10월말 기준)
지수 구성	<ul style="list-style-type: none"> • 잔존만기 1-5년인 공사채와 은행채AAA 종목들로 지수를 구성함. • 채권 구성종목은 1,300여 종목 (22.10월말 기준) • 시가총액 비중 (Market Weight) <ul style="list-style-type: none"> - 전일시가총액 : 채권지수, 일별 수익률 - 당일시가총액 : YTM, Duration, Convexity 등 보조지표 • 편입 제한 미상환잔액 500억원 미만, FRN, 주식관련채권, 옵션부채권, 사모채권, 후순위채 제외
리밸런싱	• Daily
대표지수	• 총수익지수(Total Return Index)
주요지수	• 시장가격지수(Gross Price Index), 순가격지수(Clean Price Index)
보조지표	• 평균 Duration, 평균 Convexity, 평균 YTM
발표기관	• 한국자산평가