

FnGuide Total Bond Index Series Methodology Book

Updated June 2023

This material is confidential and proprietary and no part of this material should be reproduced, published in any form by any means electronic or mechanical including photocopy or any information storage or retrieval system nor should the material be disclosed to third parties without the written authorization of FnGuide Inc.

Contents

1. 지수 소개.....	3
2. 산출 방법.....	4

1. 지수 소개

FnGuide 종합채권 지수는 2012년 4월 1일 채권지수를 기준지수 100으로 하여, 가상의 채권 바스켓을 형성하여, 특정 기준 시점 대비 평가시점까지 채권시장의 수익률 변동 또는 가격변화를 일정시간 간격으로 산출하는 총수익 지수이다.

2. 산출 방법

FnGuide 종합채권 지수는 다음과 같은 방법으로 계산한다.

2.1 주요사항

- 기준일: 2012년 4월 1일
- 기준지수: 100
- 가중치: 가격 및 발행잔액에 따른 수정시가총액 비중
- 바스켓 교체일간
- 발표 주기: 일간
- 인덱스 그룹:
 - 01: 주신보계정
 - 02: 고유계정

2.2 산정방식

- 대표지수: 총수익지수(Total Return Index)
- 주요지수: 순가격지수, 콜재투자지수, 제로재투자지수(시장가격지수도 생성)
- 이자금액 실현 날짜: 실제 이표 지급일 사용 (T 일)
- 지수의 기준은 T+1 이자부단가 및 이표(T)
- 종목편출입

구분	내용	기준
편입	국고채, 통안채 통합발행물의 최초 발행시	발행일 익영업일
	국고채, 통안채 통합발행물의 추가 매출시	납입일
	국민주택채권 (발행일이 매월 말임)	발행일 익영업일
	국고채비경쟁인수, 물가연동국고채, 통안채 모집	납입일
편출	콜옵션 행사로 인한 조기 상환	옵션 행사일
	국고채 교환 및 바이백, 단순매입, 통안채 바이백	납입일
등급변경	등급상승에 따른 편입은 익영업일, 등급하락에 따른 편출은 분기말까지 편입 ¹	각주 참조

2.3 구성종목

- 01 주신보계정
 - 신용등급기준: AA-등급 이상
 - 발행잔액기준: 10억원 이상
 - 잔존 만기: 3개월 이상
 - 종목특성기준: 사모, 후순위, 후후순위, 변동금리(FRN), 옵션부채권(Option), 주관채 (CB, BW, EB), ELS, DLS, 스트립채권(이자, 원금), 물가연동채 제외
 - 만기구분기준: 3개월 이상 5년 이하

¹ 신용등급 하락 시 해당 분기 말에 일괄적으로 유니버스에서 제외

This material is confidential and proprietary and no part of this material should be reproduced, published in any form by any means electronic or mechanical including photocopy or any information storage or retrieval system nor should the material be disclosed to third parties without the written authorization of FnGuide Inc.

- 02 고유계정
 - 신용등급기준: AAA 등급 이상
 - 발행잔액기준: 10억원 이상
 - 잔존 만기: 3개월 이상
 - 종목특성기준: 사모, 후순위, 후후순위, 변동금리(FRN), 옵션부채권(Option), 주관채 (CB, BW, EB), ELS, DLS, 스트립채권(이자, 원금), 물가연동채 제외
 - 만기구분기준: 3개월 이상 3년 이하

2.4 수정 이력

- 발행일이 주말 및 공휴일인 종목 바스켓 편입기준 수정 (2015-12-31)

구분	변경 전	변경 후
발행일이 주말 및 공휴일인 경우	발행일 기준 2영업일 편입	발행일 기준 1영업일 편입