

KEDI 바이오 TOP10 레버리지(x2) 지수(총수익) 산출방법 (Methodology Book)

Sep 2024

1. 지수 소개

- A. 본 문서는 **KEDI 바이오 TOP10 레버리지(x2) 지수(총수익)**(KEDI Bio TOP10 Leverage(x2) Index(TR))를 산출하고 관리하는 방법론에 대한 이해를 돕기 위하여 작성되었습니다.
- B. KEDI 바이오 TOP10 레버리지(x2) 지수(총수익)는 기초지수인 KEDI 바이오 TOP10 지수(총수익)의 일간 수익률을 두 배로 연동하는 투자전략을 반영한 레버리지 지수입니다.
- C. KEDI 바이오 TOP10 레버리지(x2) 지수(총수익)는 총 수익지수(Total Return)입니다

구분	기준시점	기준지수	발표일	산출시간
레버리지 지수	2019.01.02	1,000pt	2024.08.20	8:30AM (KST)

2. 지수 구성 방법

A. 기초지수

본 레버리지 지수를 산출하기 위해 KEDI 바이오 TOP10 지수(총수익)를 기초지수로 활용합니다.

3. 지수 산출 방법

A. 지수 값의 산출

KEDI 바이오 TOP10 레버리지(x2) 지수(총수익)는 다음 수식을 이용하여 산출한 지수입니다. 지수 산출 기준일은 2019년 01월 02일이며, 기준지수는 1,000으로 설정하였습니다.

$$Lev(t = 0) = 1000$$

$$Lev(t) = Lev(t - 1) \left[1 + \left\{ K * \left(\frac{UnderlyingIndex_{(t)}}{UnderlyingIndex_{(t-1)}} - 1 \right) - (K - 1) * \frac{r}{365} * D_{(t,t-1)} \right\} \right]$$

t :	특정 시점 t
$Lev(t = 0)$:	레버리지 지수 Lev 의 기준 값 (1000)
$Lev(t)$:	t 시점 레버리지 지수의 산출 값
$Lev(t - 1)$:	$t-1$ 시점 레버리지 지수의 산출 값
K :	2 (기초지수 변화에 연동하는 배율)
$UnderlyingIndex_{(t)}$:	지수산출 시점의 기초지수
$UnderlyingIndex_{(t-1)}$:	직전거래일($t-1$) 기초지수의 증가 기준 산출 값
r :	금리(CD91일 금리)

$D_{(t,t-1)}$:

직전거래일(t-1)부터 지수산출시점 전일(휴장일 포함)까지의 일수

4. 지수 관리 및 유지

A. 정기변경일

본 지수는 기초지수인 KEDI 바이오 TOP10 지수(총수익)의 정기변경일 일정을 따릅니다.

B. 수시변경

합병/분할, 상장폐지 등 특정 기업 이벤트 발생에 대한 수시변경은 일반적으로 「기업 이벤트 적용 방법론」을 따릅니다. 영업 손실 등 운용 상의 중대한 사유가 있을 경우 KEDI 지수 위원회의 검토를 거쳐 수시변경을 수행할 수 있습니다.

<책임의 한계와 법적고지>

이 문서를 포함한 KEDI(한국경제신문지수)의 지수 콘텐츠는 (주)한국경제신문과 서면동의 없이 복제, 전송 또는 배포할 수 없습니다. KEDI의 지수 콘텐츠는 정보 제공이 목적이며 산출 및 공표와 관련한 정확성 및 완전성을 보증하지 않습니다. (주)한국경제신문은 KEDI 지수를 기반으로 한 제 3자의 투자 상품에 대한 투자 의견을 표명하지 않으며, 지수 이용자와 제 3자간에 서비스를 매개하여 발생한 분쟁에 관여할 법적 의무가 없습니다. 또한 투자행위 등으로 발생한 손실 등에 대하여 책임을 부담하지 않습니다.