

KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수 산출방법 (Methodology Book)

April 2025

1. 지수 소개

- A. 본 문서는 **KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수**(KEDI Reits Real Estate Infrastructure TOP10 Balanced Index)를 산출하고 관리하는 방법론에 대한 이해를 돕기 위하여 작성되었습니다.
- B. KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수는 KEDI 리츠부동산인프라TOP10지수와 KIS채권지수의 포트폴리오를 50:50의 비율로 매수하는 채권혼합지수입니다.

구분	기준시점	기준지수	발표일	산출시간
혼합전략지수	2019.12.16	1,000pt	2025.04.15	20:00 (KST)

2. 지수 구성 방법

A. 하위 지수 매수

- 하위 지수인 KEDI 리츠부동산인프라TOP10 지수(이하 '하위지수1')의 포트폴리오를 매수합니다.
- 하위 지수인 KIS MSB 6M 지수(이하 '하위지수2')의 포트폴리오를 매수합니다.

3. 지수 산출 방법

A. 지수 값의 산출

KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수는 2019년 12월 16일의 지수를 기준지수 1000으로 하여 다음과 같은 방법으로 계산합니다.

$$Index_t = Index_{t-1} \times (1 + R_t)$$

$$R_t = \left(\left(\frac{I_t}{I_{t-1}} - 1 \right) \times w_i + \left(\frac{B_t}{B_{t-1}} - 1 \right) \times w_b \right)$$

- 1) t : 지수산출일, $t-1$: 직전 거래일
- 2) $Index_t$: 지수산출일의 KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수 증가
 $Index_{t-1}$: 직전 거래일의 KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수 증가
- 3) R_t : 지수산출일의 KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수 수익률
- 4) I_t : '하위지수1'의 t 일 증가
- 5) B_t : '하위지수2'의 t 일 증가

- 6) w_i : '하위지수1'의 편입 비중(50%)
- 7) w_b : '하위지수2'의 편입 비중(50%)

B. 편입비중 산정 방법

KEDI 리츠부동산인프라TOP10지수 포트폴리오와 KIS MSB 6M 지수 포트폴리오의 비중을 매일 5:5로 동일한 비중으로 조정하는 Constant Mix 방식을 적용합니다.

4. 지수 관리 및 유지

A. 산출주기

- i. KEDI 리츠부동산인프라TOP10채권혼합지수는 한국 영업일에 산출합니다.

B. 수시변경

- i. 합병/분할, 상장폐지 등 특정 기업 이벤트 발생에 대한 수시변경은 일반적으로 「기업 이벤트 적용 방법론」을 따릅니다.
- ii. 시장의 급격한 변화 또는 지수를 구성하는 종목에 a) 지수의 성격에 어긋날 수 있거나, b) 운용상의 중대한 사유가 있거나, c) 영업손실 확대 등의 사유 발생으로 해당 지수 관련 상품의 투자자 보호가 필요한 이벤트의 경우 지수위원회의 검토를 통해 처리될 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.