

KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수 산출방법 (Methodology Book)

October 2024

1. 지수 소개

- A. 본 문서는 **KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수**(KEDI Nvidia U.S. 30Y Treasury Target Covered Call Balanced Index)를 산출하고 관리하는 데 사용되는 방법론에 대한 이해를 돕기 위하여 작성되었습니다.
- B. 본 지수는 엔비디아 주식과 KEDI 미국 30년 국채 커버드콜 17.14 지수 포트폴리오를 매수하는 혼합전략을 반영한 지수입니다.
- C. 본 지수는 혼합 포지션에서 발생한 현금(배당금, 옵션 매도 프리미엄 등)을 본 지수에 재투자하는 방식으로 산출된 총수익(Total Return)지수이며, 통화는 미국달러(USD)를 기준으로 합니다

구분	기준시점	기준지수	발표일	산출시간	산출주기
혼합전략지수	2016.01.07	1,000pt	2024.09.05	08:30AM(KST)	매일

2. 지수 구성방법

A. 엔비디아 매수

미국 증시에 상장된 엔비디아 종목을 매수합니다.

B. 하위 지수 매수

하위 지수인 KEDI 미국 30년 국채 커버드콜 17.14 지수의 포트폴리오를 매수합니다.

C. 종목 이벤트 처리 방법

지수를 구성하는 엔비디아와 하위지수의 변동으로 a) 지수의 성격에 어긋날 수 있거나, b) 운용상의 중대한 사유가 있거나, c) 영업손실 확대 등으로 해당 지수 관련 상품의 투자자 보호가 필요한 이벤트의 경우 지수위원회의 검토를 통해 처리될 수 있습니다.

3. 지수 산출방법

A. 계산 방법

KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수는 2016년 1월 7일의 지수를 기준지수 1,000으로 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 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수 증가
 $Index_{t-1}$: 직전 거래일의 KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수 증가
- 3) R_t : 지수산출일의 KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수 수익률
- 4) I_t : 엔비디아의 지수산출일 증가
- 5) B_t : 하위 지수의 지수산출일 증가
- 6) w_I : 엔비디아 편입 비중, w_B : 하위 지수의 편입 비중

B. 편입비중 산정 방법

KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수는 엔비디아와 하위 지수의 비중을 매일 3:7로 동일한 비중으로 조정하는 Constant Mix 방식을 적용합니다.

4. 유지 및 관리

A. 산출주기

KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수는 매 영업일 산출됩니다.

B. 휴일 산출규정

KEDI 엔비디아 미국 30년 국채 타겟 커버드콜 혼합 지수는 미국 영업일 기준으로 산출됩니다.

<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 3 자의 투자 상품에 대한 투자 의견을 표명하지 않으며, 지수 이용자와 제 3 자간에 서비스를 매개하여 발생한 분쟁에 관여할 법적 의무가 없습니다. 또한 투자행위 등으로 발생한 손실 등에 대하여 책임을 부담하지 않습니다.