

March



KIS Index Report

KOBI 30

KOBI 120

KOBI 120 국공채

KOBI 퇴직연금지수

KOBI Market지수



KIS자산평가
MOODY'S 계열

Beyond Pricing, www.bond.co.kr

서울특별시 영등포구 국제금융로6길 38 한국화재보험협회빌딩 4층

Contents

차 례

작성자 : 송주영 3215-1493

index@kispricing.com

시황 및 지수별 요약

Index Summary

월간 Rebalancing 및 성과 분석

- 1. KOB130
- 2. KOB120
- 3. KOB120국공채
- 4. KOB1퇴직연금지수
- 5. KOB1 Market Index

3월 Basket List & Information

- 1. KOB130 Basket List
- 2. KOB120 Basket List
- 3. KOB120국공채 Basket List
- 4. KOB1퇴직연금지수 Basket List
- 5. KOB1 Market Index Basket List

Index Summary

시 황

2월 채권시장은 미 연준의 연내 인하 가능성과 QT 속도 조절 논의 기대, 미 재무부 국채발행계획 등의 대외 요인이 영향을 미치면서 혼조세로 출발 하였다. 2월 중순 경에는 미국 고용보고서에서 신규고용자수가 35 만 3 천명으로 전월과 시장 예상치를 크게 상회하며 견조한 흐름을 보인 영향과 미 연준 위원들의 매파적인 발언으로 미 연준의 금리 인하 기대가 축소되면서 미국채 금리가 상승하였다. 이에 연동되어 국고채 금리 또한 장기물 중심으로 상승 압력을 보였다. 2월 금통위는 만장일치로 9연속 금리를 동결(3.50%)하였다. 성장률과 헤드라인 물가 전망은 기존 전망을 유지했고, 근원 물가 전망은 2.3%에서 2.2%로 0.1%p 하향 조정했다.

국채 시장은 전구간에서 금리가 상승하였다. 통안 1 년은 전월 대비 7.5bp 상승, 2년은 전월 대비 15bp 상승했다. 국고 3년 물은 전월 대비 14.2bp 상승했고, 국고 5년은 전월 대비 14.5bp 상승했다. 국고 10년은 전월 대비 13bp 상승했다. 국고 3/5년 스프레드는 0.3bp 확대된 3.8bp를 기록했고 5/10 년 스프레드는 1.5bp 축소된 3.5bp를 기록했다. 국고 3/10년 스프레드는 1.2bp 축소된 7.3bp 를 기록하며 마감했다. 회사채 3년 만기 AAA 등급의 국고 대비 크레딧 스프레드는 전월 대비 4.5bp 하락한 45.8bp를 나타냈고, A0 등급은 크레딧 스프레드는 전월 대비 9.2bp 하락한 154.5bp를 나타냈다.

2월 총수익지수는 지수별로 다른 방향을 보였다. 종합채권지수는 전월 대비 0.43% 하락하였으며, 종합채권지수와 비슷한 듀레이션인 KOB1 Market지수도 전월 대비 0.52% 하락하였다. 지수 중 가장 긴 듀레이션을 지닌 KOB1퇴직연금지수는 전월 대비 0.8% 하락하였으며, 상대적으로 듀레이션이 짧은 KOB130도 전월대비 0.03% 하락하였다. KOB120지수는 전월 대비 0.11% 상승하였으며, KOB120국공채지수는 전월 대비 0.10% 상승하였다. 같은 기간 동안 듀레이션은 모두 하락하였다. 종합채권지수는 전월 대비 0.09 하락하였고, KOB1 Market지수는 전월 대비 0.07 하락하였다. KOB1 퇴직연금지수는 전월 대비 0.12 하락하였다. KOB120지수는 전월 대비 0.01 하락했다. KOB130지수는 전월 대비 0.01 하락하였고, KOB120국공채지수는 전월 대비 0.01 하락하였다.

성과 분석 요약 (2024년 02월 21일 현재)

		한경-KIS-Reuters 채권지수	KOB130	KOB120	KOB120 국공채	KOB1퇴직 연금지수	KOB1 Market Index
듀레이션	1개월 전	5.45	1.81	0.96	0.91	8.41	5.40
	현재	5.36	1.81	0.95	0.90	8.30	5.33
	증감	-0.09	-0.01	-0.01	-0.01	-0.12	-0.07
총수익률	연간	4.90%	4.03%	3.91%	3.71%	5.56%	4.79%
	월간	-0.43%	-0.03%	0.11%	0.10%	-0.80%	-0.52%
월간 수익률 분석	자본손익	-0.60%	-0.21%	-0.04%	-0.04%	-0.96%	-0.68%
	이자수익	0.20%	0.18%	0.15%	0.14%	0.18%	0.18%
	재 투자수익	-0.04%	0.00%	0.00%	0.00%	-0.02%	-0.02%

※ 연간 수익률 : 최근 1년 간의 수익률, 월간 수익률 : 당월 첫 영업일부터의 수익률

1. KOBİ 30

지수 Rebalancing

편출 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	교체 사유
1	국채	3~5Y	KR103501GC90	국고03125-2709(국고22-8)	20220910	20270910	Duration조정
2	통안채	~1Y	KR310101GC79	통안03330-2407-02	20220702	20240702	Duration조정
3	은행채	1~2Y	KR310210GC44	산금22신이0300-0425-2	20220425	20250425	Duration조정
4	회사채	2~3Y	KR6055551D98	신한금융지주160-1	20230920	20260920	Duration조정

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기
1	국채	3~5Y	KR103501GD99	국고03500-2809(국고23-6)	20230910	20280910	4.55
2	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680-2501-02	20230102	20250102	0.87
3	은행채	1~2Y	KR310204GE24	산금24신이0200-0215-1	20240215	20260215	1.98
4	회사채	2~3Y	KR6055551E14	신한금융지주162-1	20240130	20270130	2.94

듀레이션 예측

구분	변경 전 (3/3)	예 상 (3/4)	내 용
듀레이션	1.88	1.87	익월 바스켓 변경일(2024-03-04)에는 1.87 내외에서 듀레이션이 결정될 것으로 예상됨.

섹터/만기별 종목 수

섹터 / 만기	~1Y	1~2Y	2~3Y	3~5Y	계
국고채	0	3	3	2	8
특수채	0	0	0	3	3
통안채	5	5	0	0	10
은행채	2	2	2	0	6
회사채	0	0	3	0	3
계	7	10	8	5	30

섹터/만기별 가중치(%)

섹터 / 만기	~1Y	1~2Y	2~3Y	3~5Y	계
국고채	0.0	15.0	15.0	10.0	40.0
특수채	0.0	0.0	0.0	6.0	6.0
통안채	15.0	15.0	0.0	0.0	30.0
은행채	6.0	6.0	6.0	0.0	18.0
회사채	0.0	0.0	6.0	0.0	6.0
계	21.0	36.0	27.0	16.0	100.0

지수 주요 특징

개 요

기준일	2001.01.02
구분	Bellwether Index
발표 주기	일간
바스켓 교체	월간
가중치	섹터별 비중

특 정

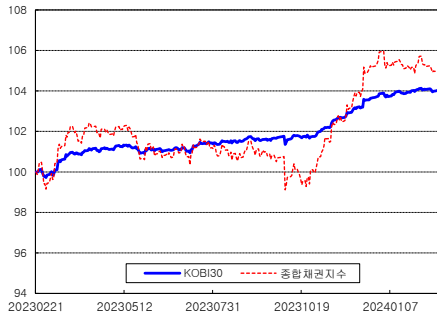
KOBİ30은 채권의 인덱스 펀드 운용을 목적으로 설계된 지수(Bellwether Index)이다. 유동성이 높은 30개 채권으로 구성되어있어 지수의 복제가 용이하도록 하였으며, 소수의 종목으로 채권 시장의 변동을 파악하는데 이용할 수 있다. 유동성이 높은 지표채권 위주로 지수를 구성하였으며, 국고채 선물을 이용한 Hedge 전략 구사가 가능하다.

산정 방식 및 구성 종목

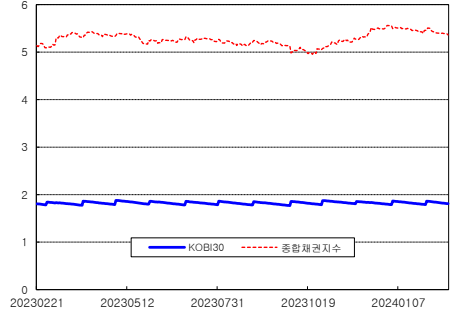
가중치	섹터별 차등 비중
가중치	전체 시장의 시가총액비중이 반영된 섹터별 비율을 사용
가중치	국채는 5%, 통안채 및 은행채는 3%, 특수채 및 회사채는 2%의 가중치를 두어 전체 시장의 발행 규모를 반영
듀레이션	1.80 ± 0.10
종목 수	30개
바스켓 교체	매월 첫 영업일(전월 종목의 10% 이내)
주 산정방식	발행잔액 및 최근 3개월간 유통량을 고려하여 유동성, 듀레이션을 기준으로 선택
주 산정방식	CALL채투자지수, 순가격지수, 0채투자지수, 시장가격지수

Performance Analysis

종합채권지수 대비 풀재투자지수 추이



종합채권지수 대비 듀레이션 추이



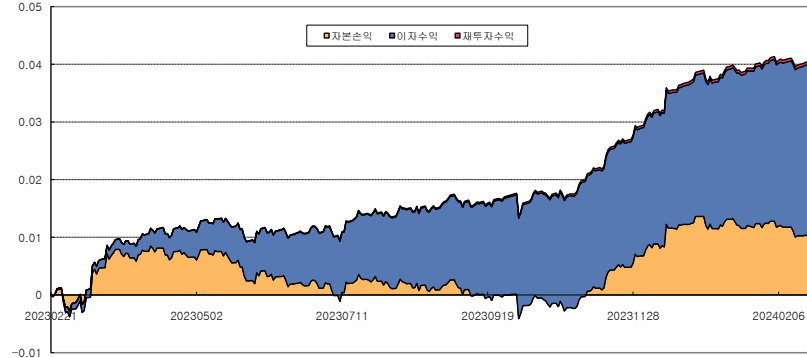
누적 수익률

구분	1 month	3 months	Ytd.	1 year	2 year	3 year	Inception
KOBİ30	0.15%	0.13%	1.31%	4.03%	4.98%	4.43%	138.90%
종합채권지수	-0.21%	-1.00%	2.06%	4.90%	3.02%	-0.10%	160.82%

* Ytd.(Year to date) : 연초 기준 수익률

* Inception : 최초 지수값 기준 수익률(2001년 1월 2일 기준)

수익률 분석



월별 수익률 분석 (당월은 20일 기준)

* 연환산 수익률이 아닌 월초부터 1달간의 수익률임

구분	총수익	자본손익	이자수익	채투자수익	풀재투자지수		
					기준시점	비교시점	듀레이션
02월	-0.03%	-0.21%	0.18%	0.00%	238.98	238.90	1.81
01월	0.16%	-0.11%	0.27%	0.00%	238.60	238.98	1.79
12월	0.94%	0.68%	0.25%	0.01%	236.36	238.57	1.79
11월	1.09%	0.87%	0.21%	0.01%	233.77	236.31	1.81
10월	0.01%	-0.25%	0.25%	0.01%	233.65	233.67	1.79

2. KOB120

지수 Rebalancing

편출 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	교체 사유
1	통안채	~1Y	KR310101ADC9	통안DC024-0305-0910	20231205	20240305	잔존만기감소
2	통안채	~1Y	KR310101AE16	통안DC024-0402-0910	20240102	20240402	잔존만기감소
3	통안채	~1Y	KR310101GC46	통안02780-2404-02	20220402	20240402	잔존만기감소
4	통안채	~1Y	KR310101GD37	통안03790-2403-01	20230309	20240309	잔존만기감소
5	통안채	~1Y	KR310102ADC7	통안DC024-0312-0910	20231212	20240312	잔존만기감소
6	통안채	~1Y	KR310103ADC5	통안DC024-0319-0910	20231219	20240319	잔존만기감소
7	은행채	~1Y	KR310208GA57	산금20신이0400-0512-3	20200512	20240512	잔존만기감소
8	은행채	~1Y	KR310211GC43	산금22신이0200-0427-2	20220427	20240427	잔존만기감소
9	특수채	~1Y	KR350107GC53	한국전력1197	20220510	20240510	잔존만기감소
10	은행채	~1Y	KR356209G442	산금(정금)114신이1000-0425-2	20140425	20240425	잔존만기감소
11	은행채	~1Y	KR381009GD56	농업금융채권(은행)2023-05에1Y-I	20230523	20240523	잔존만기감소
12	은행채	~1Y	KR6000019D58	신한은행27-05-에1-A	20230523	20240523	잔존만기감소
13	회사채	~1Y	KR6064311D67	한국남부발전69-1	20230608	20240607	Duration조정
14	회사채	1~2Y	KR6139481C47	이마트23-1	20220427	20250427	잔존만기감소

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기
1	통안채	~1Y	KR310102AE23	통안DC024-0514-0910	20240213	20240514	0.23
2	통안채	~1Y	KR310103AE22	통안DC024-0521-0910	20240220	20240521	0.25
3	통안채	~1Y	KR310105AE12	통안DC024-0430-0910	20240130	20240430	0.19
4	통안채	~1Y	KR310101AE24	통안DC024-0507-0910	20240206	20240507	0.21
5	통안채	1~2Y	KR310101GE10	통안03340-2601-02	20240102	20260102	1.87
6	특수채	~1Y	KR350105GC14	한국전력1121	20220110	20250110	0.89
7	특수채	~1Y	KR351601GC37	중소벤처기업진흥채권758(사)	20220304	20250304	1.04
8	은행채	~1Y	KR310215GDB6	산금23신이0103-1121-1	20231121	20250221	1.00
9	은행채	~1Y	KR310201GD36	산금23신이0200-0303-1	20230303	20250303	1.03
10	은행채	~1Y	KR310210GB29	산금21신이0400-0218-2	20210218	20250218	0.99
11	은행채	~1Y	KR6060004D26	국민은행4302이표일(03)2-24	20230224	20250224	1.01
12	은행채	~1Y	KR6060004D75	국민은행4307이표일(03)1.5-20	20230720	20250120	0.91
13	회사채	2~3Y	KR6011172C26	롯데케미칼58-2	20220228	20270226	3.01
14	회사채	~1Y	KR6397291B83	신보2021제14차유1-1(사)	20210827	20240827	0.52

듀레이션 예측

구분	변경 전 (3/3)	예 상 (3/4)	내 용
듀레이션	0.95	1.00	익월 바스켓 변경일(2024-03-04)에는 1.00 내외에서 듀레이션이 결정될 것으로 예상됨.

섹터/만기별 종목 수 및 가중치(종목 수 / 가중치 %)

섹터/만기	~1Y	1-2Y	2-3Y	계
국고채	3 / 2.5	5 / 4.2	5 / 4.2	13 / 10.8
특수채	11 / 9.2	7 / 5.8	1 / 0.8	19 / 15.8
통안채	26 / 21.6	6 / 5.0	0 / 0.0	32 / 26.6
은행채	21 / 17.5	13 / 10.8	2 / 1.7	36 / 30.0
기타금융채	2 / 1.7	2 / 1.7	0 / 0.0	4 / 3.3
회사채&ABS	6 / 5.0	6 / 5.0	4 / 3.3	16 / 13.3
계	69 / 57.5	39 / 32.5	12 / 10.0	120 / 100.0

지수 주요 특징

개 요	
기준일	2001.01.01
구분	Bellwether Index
발표 주기	일간
바스켓 교체	월간
가중치	섹터별 비중

특 점

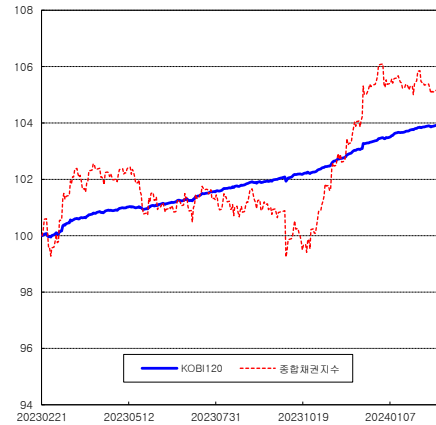
KOB120은 인덱스 펀드의 운용 및 성과평가를 합리적으로 하기 위한 목적으로 설계된 지수(Bellwether Index)이다. 국내 채권펀드가 시장 평균 듀레이션 보다 낮은 1년 내외로 운용되는 특성을 반영하여, 3년 미만의 운용 가능한 채권 120개 종목을 구성되어있다. 바스켓은 매월 첫 영업일에 전월 종목의 10% 이내에서 유동성과 듀레이션을 고려하여 리밸런싱(rebalancing)하고 있다.

산정 방식 및 구성 종목

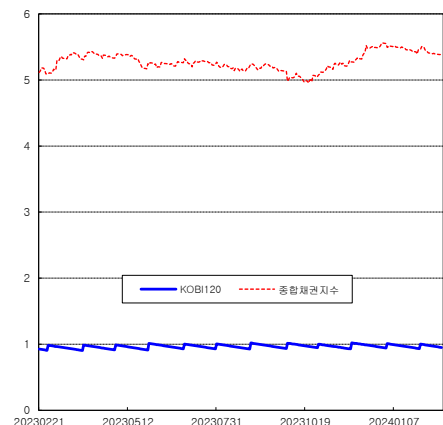
가중치	종목별, 섹터별 동일 비중	섹터	국채, 특수채, 통안채, 은행채, 기타금융채, 회사채 및 ABS(A등급 이상)
듀레이션	1.00 ± 0.15	바스켓 교체	매월 첫 영업일(전월 종목의 10% 이내)
종목 수	120개	발행잔액 및 유통량을 고려하여	유동성, 듀레이션을 기준으로 선택
만기	잔존만기 1개월 이상 3년 미만의 채권	주산정방식	CALL재투자지수, 순가격지수, 0채투자지수, 시장가격지수

Performance Analysis

종합채권지수 대비 풀재투자지수 추이



종합채권지수 대비 듀레이션 추이



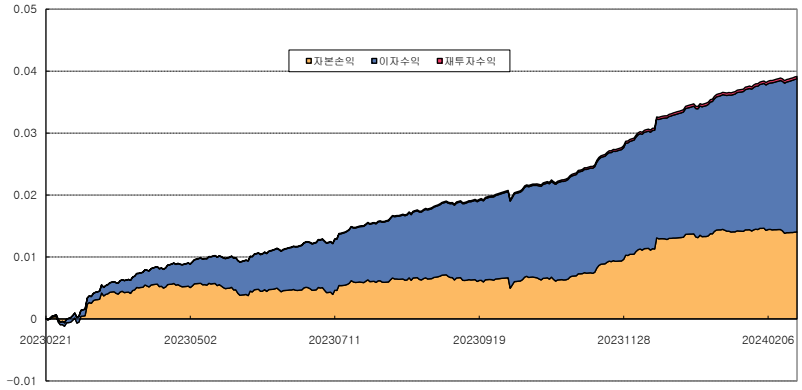
누적 수익률

구분	1 month	3 months	Ytd.	1 year	2 year	3 year	Inception
KOB120	0.24%	0.43%	1.17%	3.91%	5.97%	6.33%	123.74%
종합채권지수	-0.21%	-1.00%	2.06%	4.90%	3.02%	-0.10%	161.19%

※ Ytd.(Year to date) : 연초 기준 수익률

※ Inception : 최초 지수값 기준 수익률(2001년 1월 1일 기준)

수익률 분석



월별 수익률 분석 (당월은 20일 기준)

※ 연환산 수익률이 아닌 월초부터 1달간의 수익률임

구분	총수익	자본손익	이자수익	채투자수익	풀재투자지수		
					기준시점	비교시점	비교시점
02월	0.11%	-0.04%	0.15%	0.00%	223.49	223.74	0.95
01월	0.31%	0.08%	0.23%	0.00%	222.79	223.48	0.93
12월	0.55%	0.33%	0.22%	0.01%	221.55	222.77	0.95
11월	0.58%	0.38%	0.20%	0.01%	220.21	221.50	0.93
10월	0.20%	-0.03%	0.22%	0.01%	219.74	220.18	0.95

3. KOB120 국공채

지수 Rebalancing

편출 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	교체 사유
1	통안채	~1Y	KR310101ADC9	통안DC024-0305-0910	20231205	20240305	잔존만기감소
2	통안채	~1Y	KR310101AE16	통안DC024-0402-0910	20240102	20240402	잔존만기감소
3	통안채	~1Y	KR310101GC46	통안02780-2404-02	20220402	20240402	잔존만기감소
4	통안채	~1Y	KR310101GD37	통안03790-2403-01	20230309	20240309	잔존만기감소
5	통안채	~1Y	KR310102ADC7	통안DC024-0312-0910	20231212	20240312	잔존만기감소
6	통안채	~1Y	KR310103ADC5	통안DC024-0319-0910	20231219	20240319	잔존만기감소
7	은행채	~1Y	KR310208GA57	산금20신이0400-0512-3	20200512	20240512	잔존만기감소
8	은행채	~1Y	KR310211GC43	산금22신이0200-0427-2	20220427	20240427	잔존만기감소
9	특수채	~1Y	KR350107GC53	한국전력1197	20220510	20240510	잔존만기감소
10	은행채	~1Y	KR356209G442	산금(청금)14신이1000-0425-2	20140425	20240425	잔존만기감소

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기
1	통안채	~1Y	KR310102AE23	통안DC024-0514-0910	20240213	20240514	0.23
2	통안채	~1Y	KR310103AE22	통안DC024-0521-0910	20240220	20240521	0.25
3	통안채	~1Y	KR310105AE12	통안DC024-0430-0910	20240130	20240430	0.19
4	통안채	~1Y	KR310101AE24	통안DC024-0507-0910	20240206	20240507	0.21
5	통안채	1~2Y	KR310101GE10	통안03340-2601-02	20240102	20260102	1.87
6	특수채	~1Y	KR350105GC14	한국전력1121	20220110	20250110	0.89
7	특수채	~1Y	KR351601GC37	중소벤처기업진흥채권758(사)	20220304	20250304	1.04
8	은행채	~1Y	KR310215GDB6	산금23신이0103-1121-1	20231121	20250221	1.00
9	은행채	~1Y	KR310201GD36	산금23신이0200-0303-1	20230303	20250303	1.03
10	은행채	~1Y	KR310210GB29	산금21신이0400-0218-2	20210218	20250218	0.99

듀레이션 예측

구분	변경 전 (3/3)	예 상 (3/4)	내 용
듀레이션	0.90	0.95	익월 바스켓 변경일(2024-03-04)에는 0.95 내외에서 듀레이션이 결정될 것으로 예상됨.

섹터/만기별 종목 수

섹터 / 만기	~1Y	1-2Y	2-3Y	계
국고채	3	5	5	13
특수채	11	7	1	19
통안채	26	6	0	32
산금채	9	6	1	16
계	49	24	7	80

섹터/만기별 가중치(%)

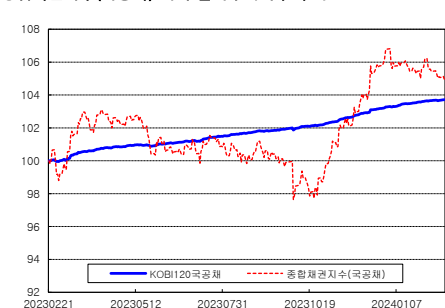
섹터 / 만기	~1Y	1-2Y	2-3Y	계
국고채	3.8	6.3	6.3	16.3
특수채	13.8	8.8	1.3	23.8
통안채	32.5	7.5	0.0	40.0
산금채	11.3	7.5	1.3	20.0
계	61.3	30.0	8.8	100.0

지수 주요 특징

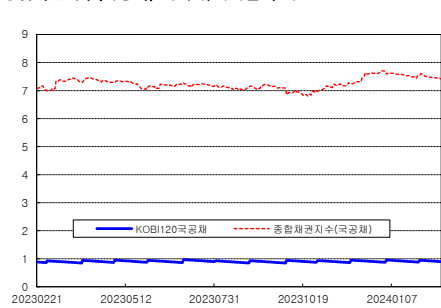
개 요		특 징
기준일	2001.01.01	KOB120국공채지수는 KOB120 종목 중에서, 기타금융채, 회사채 등을 제외한 국공채형 80 종목으로 재구성한 지수이다. 국채, 특수채, 통안채는 KOB120과 동일한 종목으로 구성하였으며, 은행채는 산금채만 포함하여 바스켓을 구성하였다.
구분	Bellwether Index	
발표 주기	일간	
바스켓 교체	월간	
가중치	섹터별 비중	
산정 방식 및 구성 종목		
가중치	종목별, 섹터별 동일 비중	섹터
듀레이션	0.95 ± 0.15	국채, 특수채, 통안채, 산금채
종목 수	80개	매월 첫 영업일(전월 종목의 10% 이내)
만기	잔존만기 1개월 이상 3년 미만의 채권	발행잔액 및 유통량을 고려하여 유동성, 듀레이션을 기준으로 선택
		주산정방식
		CALL재투자지수, 순가리지수, 0재투자지수, 시장가리지수

Performance Analysis

종합채권지수(국공채) 대비 콜재투자지수 추이



종합채권지수(국공채) 대비 듀레이션 추이



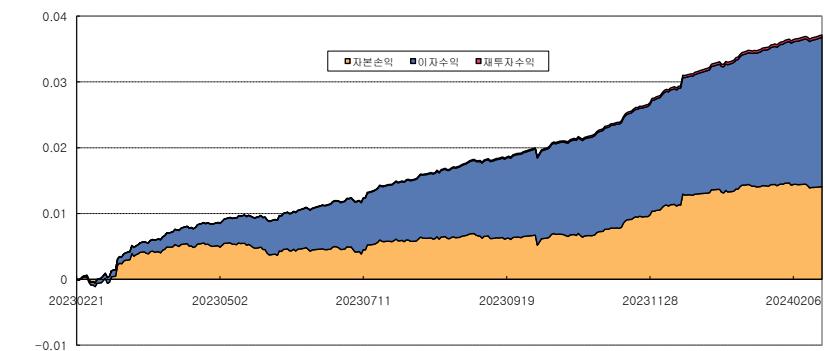
누적 수익률

구분	1 month	3 months	Ytd.	1 year	2 year	3 year	Inception
KOB120국공채	0.21%	0.39%	1.07%	3.71%	5.60%	5.95%	118.31%
종합채권지수	-0.49%	-1.76%	2.30%	4.94%	1.31%	-3.29%	166.27%

※ Ytd.(Year to date) : 연초 기준 수익률

※ Inception : 최초 지수값 기준 수익률(2001년 1월 1일 기준)

수익률 분석



월별 수익률 분석 (당월은 20일 기준)

※ 연환산 수익률이 아닌 월초부터 1달간의 수익률임

구분	총수익	자본손익	이자수익	재투자수익	콜재투자지수		듀레이션 비교시점
					기준시점	비교시점	
02월	0.10%	-0.04%	0.14%	0.00%	218.09	218.31	0.90
01월	0.29%	0.08%	0.21%	0.00%	217.45	218.08	0.88
12월	0.51%	0.31%	0.19%	0.01%	216.33	217.43	0.87
11월	0.53%	0.35%	0.17%	0.01%	215.14	216.28	0.86
10월	0.21%	0.00%	0.20%	0.00%	214.66	215.10	0.87

4. KOBİ 퇴직연금지수

지수 Rebalancing

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	교체사유
1	지방채	3~5Y	KR2001094B35	서울도시철도21-03	20210331	20280331	Duration조정
2	ABS	2~3Y	KR354418GE16	주택금융공사MBS2024-2(1~3)(사)	20240123	20270123	Duration조정
3	특수채	10Y~	KR356103GA80	토지주택채권371	20200827	20400827	Duration조정
4	회사채	2~3Y	KR6035422B24	네이버4-2	20210225	20260225	Duration조정

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기
1	지방채	3~5Y	KR2001024C13	서울도시철도22-01	20220131	20290131	4.94
2	ABS	2~3Y	KR354405GD87	주택금융공사MBS2023-22(1~3)(사)	20230811	20260811	2.47
3	특수채	10Y~	KR357102G935	한국해양진흥공사1-2	20190328	20490328	25.10
4	회사채	2~3Y	KR6373222E28	LG에너지솔루션3-2(녹)	20240216	20270216	2.99

듀레이션 예측

구분	변경 전 (3/3)	예 상 (3/4)	내 용
듀레이션	8.12	8.42	익월 바스켓 변경일(2024-03-04)에는 8.42 내에서 듀레이션이 결정될 것으로 예상됨.

섹터/만기별 종목 수

섹터 / 만기	2~3Y	3~5Y	5~7Y	7~10Y	10Y~	계
국고채	2	3	1	3	6	15
지방채	0	1	0	0	0	1
특수채	2	2	1	1	1	7
통안채	1	0	0	0	0	1
은행채	1	1	0	0	0	2
기타금융채	1	1	0	0	0	2
회사채(무보증)	2	1	1	1	1	6
ABS	1	0	0	0	0	1
계	10	9	3	5	8	35

섹터/만기별 가중치(%)

섹터 / 만기	2~3Y	3~5Y	5~7Y	7~10Y	10Y~	계
국고채	8.0	12.0	4.0	12.0	24.0	60.0
지방채	0.0	2.0	0.0	0.0	0.0	2.0
특수채	4.0	4.0	2.0	2.0	2.0	14.0
통안채	2.0	0.0	0.0	0.0	0.0	2.0
은행채	2.0	2.0	0.0	0.0	0.0	4.0
기타금융채	2.0	2.0	0.0	0.0	0.0	4.0
회사채(무보증)	4.0	2.0	2.0	2.0	2.0	12.0
ABS	2.0	0.0	0.0	0.0	0.0	2.0
계	24.0	24.0	8.0	16.0	28.0	100.0

지수 주요 특징

개 요

기준일	2001.01.02
구분	Bellwether Index
발표 주기	일간
바스켓 교체	월간
가중치	섹터별 비중

특 점

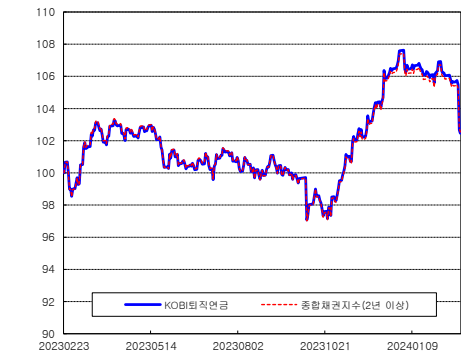
KOBİ퇴직연금지수는 퇴직연금을 위한 채권 Index Fund의 벤치마크로서, 장기 듀레이션을 타겟으로 하는 Fund의 운용 및 성과평가를 목적으로 설계된 지수(Bellwether Index)이다. 시장 평균 듀레이션보다 듀레이션을 장기화하였으며, 장기를 발행 및 비중이 꾸준히 증가하고 있는 국내 채권시장을 반영하도록 설계되었다. 국채는 4%, 그 외의 채권은 2%의 가중치를 두어 시장에서 차지하는 비중에 비해 중목 수가 적은 국채의 특성을 반영하였다.

산정 방식 및 구성 종목

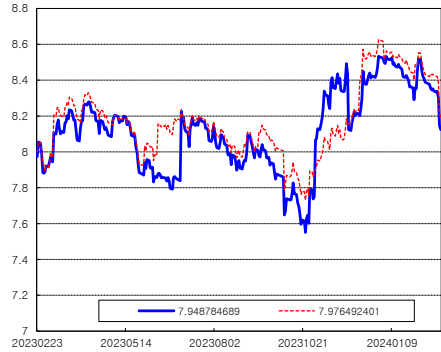
가중치	섹터별 차등 비중
	국채는 4%, 그외의 채권은 2%의 가중치를 두어 시장에서 차지하는 비중에 비해 중목 수가 적은 국채의 특성을 반영
듀레이션	2Y 초과 시장듀레이션 ± 0.10
바스켓 교체	매월 첫 영업일(전월 종목의 10% 이내), 발행잔액 및 최근 3개월간 유통량을 고려하여 유통성, 듀레이션을 기준으로 선택
주 산정 방식	순가격지수, 총수익지수, CALL재투자지수, 0재투자지수, 시장가격지수

Performance Analysis

종합채권지수(2년 이상) 대비 총수익지수 추이



종합채권지수(2년 이상) 대비 듀레이션 추이



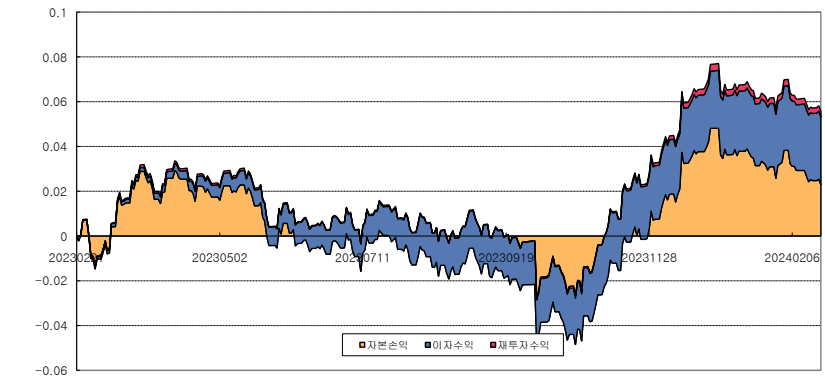
누적 수익률

구분	1 month	3 months	Ytd.	1 year	2 year	3 year	Inception
KOBİ퇴직연금지수	-0.57%	-1.99%	2.66%	5.56%	1.09%	-4.13%	181.21%
종합채권지수(2Y이상)	-0.53%	-2.00%	2.60%	5.35%	0.97%	-4.14%	186.75%

* Ytd.(Year to date) : 연초 기준 수익률

* Inception : 최초 지수값 기준 수익률(2001년 1월 2일 기준)

수익률 분석



월별 수익률 분석 (당월은 20일 기준)

* 연환산 수익률이 아닌 월초부터 1달간의 수익률임

구분	총수익	자본손익	이자수익	재투자수익	총수익지수		듀레이션
					기준시점	비교시점	비교시점
02월	-0.80%	-0.96%	0.18%	-0.02%	283.47	281.21	8.30
01월	-1.27%	-1.52%	0.29%	-0.04%	286.91	283.28	8.35
12월	4.28%	4.03%	0.09%	0.16%	275.10	286.88	8.53
11월	4.55%	4.31%	0.07%	0.17%	262.99	274.96	8.44
10월	-1.41%	-1.67%	0.32%	-0.06%	265.76	262.01	7.75

5. KOSPI Market Index

지수 Rebalancing

편출 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	교체 사유
1	통안채	~1Y	KR310102GB95	통안1510~2409-03	20210903	20240903	Duration 조정
2	특수채	1~2Y	KR350703GA46	도로공사730	20200409	20250409	Duration 조정
3	은행채	1~2Y	KR381003GD37	농업금융채권(은행)2023-03이2Y-C	20230324	20250324	Duration 조정
4	회사채	~1Y	KR6388911B58	신보2021제8차유1~1(사)	20210528	20240528	Duration 조정

편입 리스트

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기
1	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680~2501-02	20230102	20250102	0.87
2	은행채	1~2Y	KR310204GE24	산금24신이0200~0215-1	20240215	20260215	1.98
3	특수채	1~2Y	KR350106GD20	한국전력1358	20230210	20260210	1.97
4	회사채	~1Y	KR6000662A28	에스케이하이닉스221~2	20200214	20250214	0.98

듀레이션 예측

구분	변경 전 (3/3)	예 상 (3/4)	내 용
듀레이션	5.33	5.40	익월 바스켓 변경일(2024-03-04)에는 5.40 내외에서 듀레이션이 결정될 것으로 예상됨.

섹터/만기별 종목 수

섹터 / 만기	~1Y	1~2Y	2~3Y	3~5Y	5Y~	계
국고채	0	1	1	2	6	10
특수채	1	2	1	1	2	7
통안채	1	2	0	0	0	3
은행채	4	4	2	1	0	11
회사채(무보증)&ABS	2	3	2	1	1	9
계	8	12	6	5	9	40

섹터/만기별 가중치(%)

섹터 / 만기	~1Y	1~2Y	2~3Y	3~5Y	5Y~	계
국고채	0.0	4.6	4.6	9.2	27.6	46.0
특수채	1.8	3.6	1.8	1.8	3.6	12.6
통안채	1.8	3.6	0.0	0.0	0.0	5.4
은행채	7.2	7.2	3.6	1.8	0.0	19.8
회사채(무보증)&ABS	3.6	5.4	3.6	1.8	1.8	16.2
계	14.4	24.4	13.6	14.6	33.0	100.0

지수 주요 특징

개 요

기준일	2005.01.01
구분	Bellwether Index
발표 주기	일간
바스켓 교체	월간
가중치	섹터별 비중

특 징

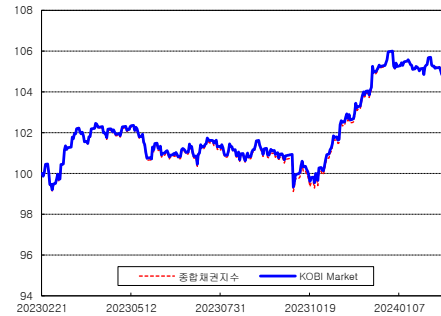
KOSPI Market Index는 40개의 유동적인 종목으로 국내 채권 시장을 Tracking하도록 설계된 Bellwether Index이다. 종합채권지수의 듀레이션을 타겟으로 하며, 유동성이 우수한 종목을 편입하도록 설계되었다.
국채는 4.6%, 그 외의 채권은 1.8%의 가중치를 두어 시장에서 차지하는 비중에 비해 종목 수가 적은 국채의 특성을 반영하였다.

산정 방식 및 구성 종목

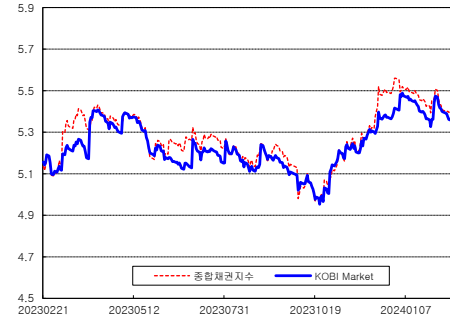
가중치	섹터별 차등 비중 국채는 4.6%, 그 외의 채권은 1.8%의 가중치를 두어 시장에서 차지하는 비중에 비해 종목 수가 적은 국채의 특성을 반영
듀레이션	KIS종합채권지수 듀레이션 ± 0.10
종목 수	40개
바스켓 교체	매월 첫 영업일(전월 종목의 10% 이내) 발행잔액 및 최근 3개월간 유통량을 고려하여 유동성, 듀레이션을 기준으로 선택
주 산정 방식	순가격지수, 총수익지수, CALL재투자지수, 0재투자지수, 시장가격지수

Performance Analysis

종합채권지수 대비 총수익지수 추이



종합채권지수 대비 듀레이션 추이



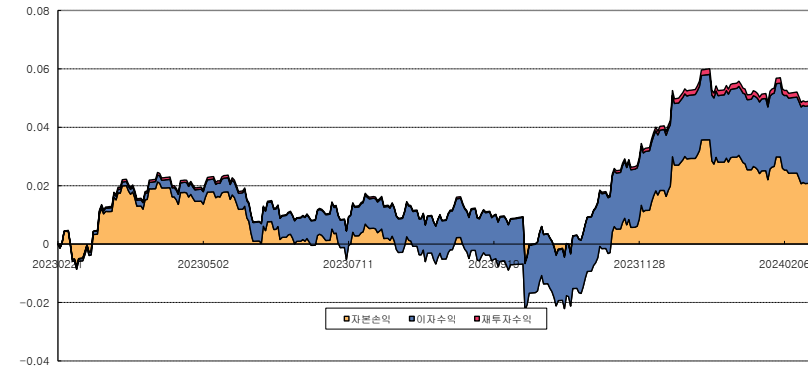
누적 수익률

구분	1 month	3 months	Ytd.	1 year	2 year	3 year	Inception
KOSPI Market	-0.32%	-1.14%	1.81%	4.79%	2.84%	-0.37%	87.49%
종합채권지수	-0.21%	-1.00%	2.06%	4.90%	3.02%	-0.10%	92.82%

※ Ytd.(Year to date) : 연초 기준 수익률

※ Inception : 최초 지수값 기준 수익률(2005년 1월 1일 기준)

최근 1년간 누적 수익률 분석



월별 수익률 분석 (당월은 20일 기준)

※ 연환산 수익률이 아닌 월초부터 1달간의 수익률임

구분	총수익	자본손익	이자수익	재투자수익	총수익지수		듀레이션
					기준시점	비교시점	
02월	-0.52%	-0.68%	0.18%	-0.02%	188.49	187.51	5.33
01월	-0.66%	-0.90%	0.27%	-0.02%	189.68	188.44	5.36
12월	2.63%	2.39%	0.16%	0.08%	184.80	189.66	5.41
11월	2.85%	2.62%	0.12%	0.11%	179.58	184.71	5.23
10월	-0.77%	-1.01%	0.27%	-0.04%	180.57	179.18	5.00

1. KOBIS30 Basket List

1. 총 30 종목

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
1	국채	1~2Y	KR103501GC66	국고03125-2506(국고22-4)	20220610	20250610	1.30	1.26	5%	3.13%	이표채	128,600	55.99
2	국채	1~2Y	KR103503GD97	국고03625-2509(국고23-8)	20230910	20250910	1.55	1.47	5%	3.63%	이표채	65,720	107.42
3	국채	1~2Y	KR103501GCC0	국고04250-2512(국고22-13)	20221210	20251210	1.80	1.71	5%	4.25%	이표채	148,580	151.26
4	국채	2~3Y	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	20230610	20260610	2.30	2.19	5%	3.13%	이표채	142,510	294.85
5	국채	2~3Y	KR103501GB91	국고01750-2609(국고21-7)	20210910	20260910	2.55	2.44	5%	1.75%	이표채	123,860	40.29
6	국채	2~3Y	KR103501GDC8	국고03875-2612(국고23-10)	20231210	20261210	2.80	2.62	5%	3.88%	이표채	75,150	629.40
7	국채	3~5Y	KR103501GC33	국고02375-2703(국고22-1)	20220310	20270310	3.05	2.88	5%	2.38%	이표채	172,430	72.21
8	국채	3~5Y	KR103501GD99	국고03500-2809(국고23-6)	20230910	20280910	4.55	4.11	5%	3.50%	이표채	103,960	494.98
9	통안채	~1Y	KR310102GD77	통안03600-2407-01	20230709	20240709	0.38	0.38	3%	3.60%	이표채	18,400	3.86
10	통안채	~1Y	KR310101GD94	통안03670-2409-01	20230909	20240909	0.55	0.54	3%	3.67%	이표채	9,100	10.44
11	통안채	~1Y	KR310101GCA2	통안04120-2410-02	20221002	20241002	0.62	0.60	3%	4.12%	이표채	86,100	21.14
12	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680-2501-02	20230102	20250102	0.87	0.84	3%	3.68%	이표채	97,000	83.97
13	통안채	~1Y	KR310102GE19	통안03320-2501-01	20240109	20250109	0.88	0.86	3%	3.32%	이표채	12,500	34.20
14	통안채	1~2Y	KR310102GC37	통안02320-2503-03	20220303	20250303	1.03	1.01	3%	2.32%	이표채	43,200	54.17
15	통안채	1~2Y	KR310101GD45	통안03280-2504-02	20230402	20250402	1.12	1.08	3%	3.28%	이표채	107,000	57.71
16	통안채	1~2Y	KR310101GD78	통안03670-2507-02	20230702	20250702	1.37	1.32	3%	3.67%	이표채	110,900	112.76
17	통안채	1~2Y	KR310102GC94	통안03950-2509-03	20220903	20250903	1.53	1.47	3%	3.95%	이표채	62,200	16.48
18	통안채	1~2Y	KR310101GDA0	통안04020-2510-02	20231002	20251002	1.62	1.55	3%	4.02%	이표채	79,900	394.84
19	은행채	~1Y	KR310220G998	산금19신이0500-0930-1	20190930	20240930	0.61	0.60	3%	1.52%	이표채	1,200	133.33
20	은행채	~1Y	KR310216GDA6	산금23신이0101-1025-1	20231025	20241125	0.76	0.74	3%	4.09%	이표채	2,000	17.50
21	은행채	1~2Y	KR310203GD67	산금23신이0200-0609-2	20230609	20250609	1.30	1.25	3%	3.85%	이표채	2,000	110.00
22	은행채	1~2Y	KR310204GE24	산금24신이0200-0215-1	20240215	20260215	1.98	1.91	3%	3.60%	이표채	4,500	72.22
23	은행채	2~3Y	KR310206GD49	산금23신이0300-0421-1	20230421	20260421	2.17	2.07	3%	3.61%	이표채	5,500	13.64
24	은행채	2~3Y	KR310214GC65	산금22신이0400-0621-3	20220621	20260621	2.33	2.20	3%	4.05%	이표채	1,500	0.00
25	특수채	3~5Y	KR350201GD65	서울교통공사2023-1	20230607	20280607	4.30	3.88	2%	4.26%	이표채	3,500	32.86
26	특수채	3~5Y	KR351601GDA9	중소벤처기업진흥채권831(사)	20231005	20281005	4.62	4.13	2%	4.72%	이표채	1,000	20.00
27	특수채	3~5Y	KR356105GDB4	토지주택채권461	20231116	20281116	4.74	4.29	2%	4.12%	이표채	2,700	16.67
28	회사채	2~3Y	KR6063321DA8	한국수력원자력75-1	20231030	20261030	2.69	2.52	2%	4.57%	이표채	700	28.57

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
29	회사채	2~3Y	KR6086792E18	하나금융지주61-2	20240117	20270115	2.90	2.73	2%	3.64%	이표채	2,000	65.00
30	회사채	2~3Y	KR6055551E14	신한금융지주162-1	20240130	20270130	2.94	2.77	2%	3.69%	이표채	1,000	60.00

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

2. KOB120 Basket List

2. 총 120 종목

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
1	국고채	~1Y	KR103502G495	국고03000-2409(국고14-5)	20140910	20240910	0.55	0.53	3.00%	이표채	136,080	12.63
2	국고채	~1Y	KR103504GC63	국고02875-2406(국고22-7)	20220610	20240610	0.30	0.30	2.88%	이표채	29,370	30.27
3	국고채	~1Y	KR103501GB67	국고01125-2406(국고21-4)	20210610	20240610	0.30	0.30	1.13%	이표채	150,758	33.02
4	국고채	1~2Y	KR103501GCC0	국고04250-2512(국고22-13)	20221210	20251210	1.80	1.71	4.25%	이표채	148,580	151.26
5	국고채	1~2Y	KR103501GA92	국고01125-2509(국고20-6)	20200910	20250910	1.55	1.51	1.13%	이표채	149,020	31.96
6	국고채	1~2Y	KR103501G562	국고02250-2506(국고15-2)	20150610	20250610	1.30	1.26	2.25%	이표채	147,010	5.11
7	국고채	1~2Y	KR103501GC66	국고03125-2506(국고22-4)	20220610	20250610	1.30	1.26	3.13%	이표채	128,600	55.99
8	국고채	1~2Y	KR103503GD30	국고03375-2503(국고23-3)	20230310	20250310	1.05	1.01	3.38%	이표채	114,680	29.25
9	국고채	2~3Y	KR103501GDC8	국고03875-2612(국고23-10)	20231210	20261210	2.80	2.62	3.88%	이표채	75,150	629.40
10	국고채	2~3Y	KR103501GB91	국고01750-2609(국고21-7)	20210910	20260910	2.55	2.44	1.75%	이표채	123,860	40.29
11	국고채	2~3Y	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	20230610	20260610	2.30	2.19	3.13%	이표채	142,510	294.85
12	국고채	2~3Y	KR1035017S39	국고05750-2603(국고06-1)	20060310	20260310	2.05	1.89	5.75%	이표채	66,492	3.42
13	국고채	2~3Y	KR103501GB34	국고01250-2603(국고21-1)	20210310	20260310	2.05	1.98	1.25%	이표채	165,490	42.13
14	통안채	~1Y	KR310102GC37	통안02320-2503-03	20220303	20250303	1.03	1.01	2.32%	이표채	43,200	54.17
15	통안채	~1Y	KR310102GE19	통안03320-2501-01	20240109	20250109	0.88	0.86	3.32%	이표채	12,500	34.20
16	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680-2501-02	20230102	20250102	0.87	0.84	3.68%	이표채	97,000	83.97
17	통안채	~1Y	KR310101GDB8	통안03730-2411-01	20231109	20241109	0.72	0.70	3.73%	이표채	10,200	62.55
18	통안채	~1Y	KR310101GCA2	통안04120-2410-02	20221002	20241002	0.62	0.60	4.12%	이표채	86,100	21.14
19	통안채	~1Y	KR310101GD94	통안03670-2409-01	20230909	20240909	0.55	0.54	3.67%	이표채	9,100	10.44
20	통안채	~1Y	KR310102GB95	통안01510-2409-03	20210903	20240903	0.53	0.52	1.51%	이표채	49,000	3.34
21	통안채	~1Y	KR310102GD77	통안03600-2407-01	20230709	20240709	0.38	0.38	3.60%	이표채	18,400	3.86
22	통안채	~1Y	KR310101GC79	통안03330-2407-02	20220702	20240702	0.37	0.36	3.33%	이표채	73,300	15.20
23	통안채	~1Y	KR310103AE22	통안DC024-0521-0910	20240220	20240521	0.25	0.24	3.43%	할인채	3,000	15.00
24	통안채	~1Y	KR310102AE23	통안DC024-0514-0910	20240213	20240514	0.23	0.23	3.42%	할인채	5,300	37.74
25	통안채	~1Y	KR310101GD52	통안03370-2405-01	20230509	20240509	0.22	0.22	3.37%	이표채	14,200	32.11
26	통안채	~1Y	KR310101AE24	통안DC024-0507-0910	20240206	20240507	0.21	0.21	3.42%	할인채	7,400	59.66
27	통안채	~1Y	KR310105AE12	통안DC024-0430-0910	20240130	20240430	0.19	0.19	3.37%	할인채	10,000	72.50
28	통안채	~1Y	KR310104AE13	통안DC024-0423-0910	20240123	20240423	0.17	0.17	3.42%	할인채	9,100	103.30

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
29	통안채	~1Y	KR310103AE14	통안DC024-0416-0910	20240116	20240416	0.15	0.15	3.35%	할인채	10,200	56.37
30	통안채	~1Y	KR310102AE15	통안DC024-0409-0910	20240109	20240409	0.13	0.13	3.37%	할인채	10,500	58.57
31	통안채	1~2Y	KR310101GE10	통안03340-2601-02	20240102	20260102	1.87	1.79	3.34%	이표채	52,000	369.71
32	통안채	1~2Y	KR310101GDA0	통안04020-2510-02	20231002	20251002	1.62	1.55	4.02%	이표채	79,900	394.84
33	통안채	1~2Y	KR310102GC94	통안03950-2509-03	20220903	20250903	1.53	1.47	3.95%	이표채	62,200	16.48
34	통안채	1~2Y	KR310101GD78	통안03670-2507-02	20230702	20250702	1.37	1.32	3.67%	이표채	110,900	112.76
35	통안채	1~2Y	KR310101GD45	통안03280-2504-02	20230402	20250402	1.12	1.08	3.28%	이표채	107,000	57.71
36	특수채	~1Y	KR350105GC14	한국전력1121	20220110	20250110	0.89	0.86	2.50%	이표채	2,700	70.46
37	특수채	1~2Y	KR350101G8C2	한국전력971	20181204	20251204	1.79	1.72	2.21%	이표채	2,000	12.5
38	특수채	~1Y	KR350901GA12	한국수자원공사256	20200110	20250110	0.89	0.87	1.66%	이표채	800	0.01
39	특수채	~1Y	KR350702G9C3	도로공사722	20191212	20241212	0.81	0.79	1.63%	이표채	1,900	23.63
40	특수채	~1Y	KR350701G4B7	도로공사610	20141106	20241106	0.71	0.69	2.69%	이표채	2,500	4
41	특수채	~1Y	KR350701GCA0	도로공사822	20221007	20241007	0.63	0.60	5.01%	이표채	700	0
42	특수채	~1Y	KR350701G998	도로공사713	20190905	20240905	0.54	0.52	1.42%	이표채	1,300	59.65
43	특수채	~1Y	KR350702GB87	도로공사772	20210820	20240820	0.5	0.49	1.54%	이표채	1,600	0
44	특수채	1~2Y	KR350701GCB8	도로공사825	20221111	20251111	1.72	1.62	5.50%	이표채	300	8.82
45	특수채	1~2Y	KR35070270A0	도로공사505	20101025	20251025	1.68	1.58	4.58%	이표채	1,300	0
46	특수채	1~2Y	KR350704GA37	도로공사727	20200326	20250326	1.1	1.06	1.66%	이표채	1,700	29.42
47	특수채	~1Y	KR351601GC37	중소벤처기업진흥채권758(사)	20220304	20250304	1.04	1.01	2.47%	이표채	1,300	15.38
48	특수채	~1Y	KR381102GA14	농금채(중앙회)2020-1이5Y-B	20200106	20250106	0.88	0.86	1.54%	이표채	2,000	0.49
49	특수채	~1Y	KR380701GDC8	농금채(경제)51-12이표12-1	20231215	20241215	0.82	0.79	3.79%	이표채	1,000	190
50	특수채	~1Y	KR354602G4B9	한국철도공사140	20141125	20241125	0.76	0.74	2.79%	이표채	2,000	0
51	특수채	~1Y	KR352703GBB4	국가철도공단채권367	20211117	20241117	0.74	0.73	2.20%	이표채	2,000	10
52	특수채	~1Y	KR351601GCB9	중소벤처기업진흥채권793(사)	20221101	20241101	0.7	0.68	5.60%	이표채	1,500	0
53	특수채	~1Y	KR350802GCA6	한국가스공사428	20221028	20241028	0.69	0.67	6.01%	이표채	1,400	32.19
54	특수채	~1Y	KR350801GC94	한국가스공사424	20220901	20240901	0.53	0.51	4.37%	이표채	800	81.29
55	특수채	~1Y	KR356105G483	토지주택채권284	20140828	20240828	0.52	0.51	3.21%	이표채	2,000	20
56	특수채	~1Y	KR352601GB85	세보기금특별계정채권2021-4(사)	20210820	20240820	0.5	0.49	1.55%	이표채	1,500	83.33
57	특수채	~1Y	KR354701GC63	부산교통공사2022-05	20220623	20240623	0.34	0.33	4.25%	이표채	300	133.33
58	특수채	1~2Y	KR381101GE11	농금채(중앙회)2024-1이2Y-A	20240105	20260105	1.87	1.79	3.66%	이표채	2,200	90.91
59	특수채	1~2Y	KR354421GD20	주택금융공사93(사)	20230227	20250827	1.52	1.46	3.76%	이표채	2,200	0
60	특수채	1~2Y	KR354401GC33	주택금융공사64(사)	20220307	20250307	1.05	1.02	2.49%	이표채	3,100	0

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
61	특수채	2~3Y	KR353601GB83	경기주택도시공사21-08-42	20210813	20260813	2.48	2.40	1.94%	이표채	1,800	11.11
62	은행채	~1Y	KR310201GD36	산금23신이0200-0303-1	20230303	20250303	1.03	1.00	4.07%	이표채	3,000	60.00
63	은행채	~1Y	KR310215GDB6	산금23신이0103-1121-1	20231121	20250221	1.00	0.97	3.95%	이표채	3,100	87.10
64	은행채	~1Y	KR310210GB29	산금21신이0400-0218-2	20210218	20250218	0.99	0.98	1.24%	이표채	2,600	186.33
65	은행채	~1Y	KR310202AE14	산금24신할0100-0122-1	20240122	20250122	0.92	0.89	3.41%	할인채	3,500	78.57
66	은행채	~1Y	KR310202ADC5	산금23신할0100-1207-1	20231207	20241207	0.80	0.77	3.68%	할인채	2,900	110.34
67	은행채	~1Y	KR310205GCB9	산금22신이0200-1111-1	20221111	20241111	0.72	0.71	4.88%	이표채	6,200	51.61
68	은행채	~1Y	KR310213GB91	산금21신이0300-0915-2	20210915	20240915	0.57	0.56	1.70%	이표채	3,300	0.00
69	은행채	~1Y	KR310209GB89	산금21신이0300-0823-2	20210823	20240823	0.51	0.50	1.53%	이표채	1,300	15.47
70	은행채	~1Y	KR310214GB17	산금21신이0306-0127-1	20210127	20240727	0.43	0.43	1.18%	이표채	2,700	7.41
71	은행채	~1Y	KR310218GC61	산금22신이0200-0623-1	20220623	20240623	0.34	0.33	3.72%	이표채	6,000	47.50
72	은행채	~1Y	KR310216GC55	산금22신이0200-0530-1	20220530	20240530	0.27	0.27	3.01%	이표채	3,500	24.29
73	은행채	1~2Y	KR310203GDC0	산금23신이0200-1212-1	20231212	20251212	1.81	1.73	3.78%	이표채	3,400	104.41
74	은행채	1~2Y	KR310211GCB7	산금22신이0300-1125-1	20221125	20251125	1.76	1.67	4.75%	이표채	5,600	24.11
75	은행채	1~2Y	KR310207GD89	산금23신이0200-0814-1	20230814	20250814	1.48	1.43	3.95%	이표채	3,900	87.18
76	은행채	1~2Y	KR310212GD17	산금23신이0206-0119-3	20230119	20250719	1.41	1.36	3.60%	이표채	2,300	41.30
77	은행채	1~2Y	KR310213GC58	산금22신이0300-0520-1	20220520	20250520	1.25	1.22	3.31%	이표채	3,700	27.03
78	은행채	1~2Y	KR310206GC57	산금22신이0300-0510-1	20220510	20250510	1.22	1.19	3.28%	이표채	4,000	18.75
79	은행채	1~2Y	KR310207GD48	산금23신이0200-0424-1	20230424	20250424	1.17	1.14	3.53%	이표채	3,800	2.63
80	은행채	2~3Y	KR310208GDA3	산금23신이0300-1017-1	20231017	20261017	2.66	2.49	4.31%	이표채	3,600	63.89
81	은행채	~1Y	KR6060004D26	국민은행4302이표일(03)2-24	20230224	20250224	1.01	0.97	3.97%	이표채	3,000	46.67
82	은행채	~1Y	KR6060004D75	국민은행4307이표일(03)1.5-2C	20230720	20250120	0.91	0.89	3.88%	이표채	3,300	53.03
83	은행채	~1Y	KR60000031D52	우리은행27-05-이표1.5-갑-04	20230504	20241104	0.70	0.69	3.69%	이표채	3,600	56.94
84	은행채	~1Y	KR60000012D55	신한은행27-05-이-1.5-B	20230504	20241104	0.70	0.69	3.69%	이표채	4,000	80.00
85	은행채	~1Y	KR380804GCA6	한국수출입금융2210마-이표-2	20221018	20241018	0.66	0.64	5.17%	이표채	1,400	0.00
86	은행채	~1Y	KR380802GCA0	한국수출입금융2210다-이표-2	20221014	20241014	0.65	0.63	4.96%	이표채	2,300	13.04
87	은행채	~1Y	KR380802GC90	한국수출입금융2209다-이표-2	20220906	20240906	0.54	0.53	4.02%	이표채	2,300	0.00
88	은행채	~1Y	KR380601GC85	수산업금융채권(은행)22-8이2-18	20220818	20240818	0.49	0.48	3.63%	이표채	1,500	16.67
89	은행채	~1Y	KR60000015C79	신한은행26-07-이-2-A	20220714	20240714	0.40	0.39	3.75%	이표채	4,200	44.05
90	은행채	~1Y	KR6004946D66	하나은행46-06이1갑-27	20230627	20240627	0.35	0.34	3.87%	이표채	1,400	21.43
91	은행채	~1Y	KR6060005D66	국민은행4306이표일(03)1-14	20230614	20240614	0.31	0.31	3.82%	이표채	1,500	56.67
92	은행채	~1Y	KR6004948BB2	하나은행44-11이2.5갑-29	20211129	20240529	0.27	0.27	2.06%	이표채	1,000	0.00

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
93	은행채	1~2Y	KR6004946DC0	하나은행46-12이2갑-19	20231219	20251219	1.83	1.75	3.71%	이표채	1,300	276.92
94	은행채	1~2Y	KR6000111AB3	SC은행(이중상환)2020-0002	20201119	20251119	1.74	1.71	1.50%	이표채	1,600	0
95	은행채	1~2Y	KR6000013DB5	신한은행27-11-이-2-A	20231103	20251103	1.7	1.63	4.42%	이표채	5,000	102
96	은행채	1~2Y	KR6004944D76	하나은행46-07이2갑-20	20230720	20250720	1.41	1.36	3.93%	이표채	2,000	70
97	은행채	1~2Y	KR6004946D74	하나은행46-07이1.75갑-27	20230727	20250427	1.18	1.15	3.94%	이표채	1,200	75
98	은행채	1~2Y	KR381002GD46	업금융채권(은행)2023-04이2Y	20230407	20250407	1.13	1.09	3.62%	이표채	2,500	0
99	은행채	1~2Y	KR6060002D36	국민은행4303이표일(03)2-6	20230306	20250306	1.04	1.00	4.22%	이표채	3,500	5.71
100	은행채	2~3Y	KR381006GDA5	업금융채권(은행)2023-10이3Y	20231023	20261023	2.67	2.50	4.55%	이표채	2,300	19.57
101	기타금융채	~1Y	KR6029881CB4	현대캐피탈1950	20221102	20241101	0.7	0.68	5.97%	이표채	1,000	185
102	기타금융채	~1Y	KR6174145B92	우리카드204-2	20210916	20240913	0.56	0.55	1.97%	이표채	1,700	14.77
103	기타금융채	1~2Y	KR6167161D77	벤츠파이낸셜39	20230728	20250728	1.44	1.37	4.73%	이표채	1,300	0
104	기타금융채	1~2Y	KR6169373D51	메리츠캐피탈229-3	20230502	20250502	1.2	1.15	5.15%	이표채	3,000	0
105	회사채	~1Y	KR6021241C14	코웨이5-1	20220127	20250127	0.93	0.91	2.77%	이표채	2,300	67.39
106	회사채	~1Y	KR6034733768	SK280-3	20170601	20240601	0.28	0.27	2.67%	이표채	1,100	22.73
107	회사채	1~2Y	KR6035422B24	네이버4-2	20210225	20260225	2.01	1.96	1.60%	이표채	4,500	45.1
108	회사채	1~2Y	KR6069961DA5	현대백화점30-1	20231013	20251013	1.65	1.57	4.28%	이표채	800	50
109	회사채	2~3Y	KR6011172C26	롯데케미칼58-2	20220228	20270226	3.01	2.83	3.18%	이표채	1,100	0
110	회사채	~1Y	KR6089861C10	롯데렌탈56-1(녹)	20220126	20250124	0.92	0.91	2.93%	이표채	2,530	29.73
111	회사채	1~2Y	KR6181652A77	에스케이인천석유화학19-2	20200713	20250711	1.39	1.35	2.62%	이표채	600	34.35
112	회사채	2~3Y	KR6413682D67	에스케이스페셜티6-2	20230608	20260608	2.3	2.14	4.81%	이표채	1,100	0
113	회사채	~1Y	KR6397291B83	신보2021제14차유1-1(사)	20210827	20240827	0.52	0.51	1.77%	이표채	6,090	28.73
114	회사채	1~2Y	KR6440801C83	신보2022제15차유동화1-1(사)	20220826	20250826	1.51	1.44	4.55%	이표채	5,987	0
115	회사채	1~2Y	KR354403GC56	택금융공사MBS2022-9(1-3)(사)	20220513	20250513	1.23	1.19	3.39%	이표채	1,400	0
116	회사채	2~3Y	KR6467821D99	신보2023제15차유동화1-1(사)	20230926	20260926	2.6	2.43	4.44%	이표채	2,450	0
117	회사채	2~3Y	KR6454941D35	신보2023제2차유동화1-1(사)	20230328	20260328	2.1	2.00	3.84%	이표채	3,735	0
118	회사채	~1Y	KR6166262C11	농협금융지주34-2	20220113	20250113	0.9	0.88	2.46%	이표채	3,000	28.33
119	회사채	~1Y	KR6055551BB2	신한금융지주144-1	20211111	20241111	0.72	0.71	2.30%	이표채	1,700	17.88
120	회사채	1~2Y	KR6063321CC6	한국수력원자력69-1	20221220	20251220	1.83	1.73	4.55%	이표채	2,600	69.23

* 바스켓은 각 종목당 약 0.83%의 동일 비중으로 구성됨

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

3. KOB120 국공채 Basket List

3. 총 80 종목

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
1	국고채	~1Y	KR103502G495	국고03000-2409(국고14-5)	20140910	20240910	0.55	0.53	3.00%	이표채	136,080	12.63
2	국고채	~1Y	KR103504GC63	국고02875-2406(국고22-7)	20220610	20240610	0.30	0.30	2.88%	이표채	29,370	30.27
3	국고채	~1Y	KR103501GB67	국고01125-2406(국고21-4)	20210610	20240610	0.30	0.30	1.13%	이표채	150,758	33.02
4	국고채	1~2Y	KR103501GCC0	국고04250-2512(국고22-13)	20221210	20251210	1.80	1.71	4.25%	이표채	148,580	151.26
5	국고채	1~2Y	KR103501GA92	국고01125-2509(국고20-6)	20200910	20250910	1.55	1.51	1.13%	이표채	149,020	31.96
6	국고채	1~2Y	KR103501G562	국고02250-2506(국고15-2)	20150610	20250610	1.30	1.26	2.25%	이표채	147,010	5.11
7	국고채	1~2Y	KR103501GC66	국고03125-2506(국고22-4)	20220610	20250610	1.30	1.26	3.13%	이표채	128,600	55.99
8	국고채	1~2Y	KR103503GD30	국고03375-2503(국고23-3)	20230310	20250310	1.05	1.01	3.38%	이표채	114,680	29.25
9	국고채	2~3Y	KR103501GDC8	국고03875-2612(국고23-10)	20231210	20261210	2.80	2.62	3.88%	이표채	75,150	629.40
10	국고채	2~3Y	KR103501GB91	국고01750-2609(국고21-7)	20210910	20260910	2.55	2.44	1.75%	이표채	123,860	40.29
11	국고채	2~3Y	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	20230610	20260610	2.30	2.19	3.13%	이표채	142,510	294.85
12	국고채	2~3Y	KR1035017S39	국고05750-2603(국고06-1)	20060310	20260310	2.05	1.89	5.75%	이표채	66,492	3.42
13	국고채	2~3Y	KR103501GB34	국고01250-2603(국고21-1)	20210310	20260310	2.05	1.98	1.25%	이표채	165,490	42.13
14	통안채	~1Y	KR310102GC37	통안02320-2503-03	20220303	20250303	1.03	1.01	2.32%	이표채	43,200	54.17
15	통안채	~1Y	KR310102GE19	통안03320-2501-01	20240109	20250109	0.88	0.86	3.32%	이표채	12,500	34.20
16	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680-2501-02	20230102	20250102	0.87	0.84	3.68%	이표채	97,000	83.97
17	통안채	~1Y	KR310101GDB8	통안03730-2411-01	20231109	20241109	0.72	0.70	3.73%	이표채	10,200	62.55
18	통안채	~1Y	KR310101GCA2	통안04120-2410-02	20221002	20241002	0.62	0.60	4.12%	이표채	86,100	21.14
19	통안채	~1Y	KR310101GD94	통안03670-2409-01	20230909	20240909	0.55	0.54	3.67%	이표채	9,100	10.44
20	통안채	~1Y	KR310102GB95	통안01510-2409-03	20210903	20240903	0.53	0.52	1.51%	이표채	49,000	3.34
21	통안채	~1Y	KR310102GD77	통안03600-2407-01	20230709	20240709	0.38	0.38	3.60%	이표채	18,400	3.86
22	통안채	~1Y	KR310101GC79	통안03330-2407-02	20220702	20240702	0.37	0.36	3.33%	이표채	73,300	15.20
23	통안채	~1Y	KR310103AE22	통안DC024-0521-0910	20240220	20240521	0.25	0.24	3.43%	할인채	3,000	15.00
24	통안채	~1Y	KR310102AE23	통안DC024-0514-0910	20240213	20240514	0.23	0.23	3.42%	할인채	5,300	37.74
25	통안채	~1Y	KR310101GD52	통안03370-2405-01	20230509	20240509	0.22	0.22	3.37%	이표채	14,200	32.11
26	통안채	~1Y	KR310101AE24	통안DC024-0507-0910	20240206	20240507	0.21	0.21	3.42%	할인채	7,400	59.66
27	통안채	~1Y	KR310105AE12	통안DC024-0430-0910	20240130	20240430	0.19	0.19	3.37%	할인채	10,000	72.50
28	통안채	~1Y	KR310104AE13	통안DC024-0423-0910	20240123	20240423	0.17	0.17	3.42%	할인채	9,100	103.30

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
29	통안채	~1Y	KR310103AE14	통안DC024-0416-0910	20240116	20240416	0.15	0.15	3.35%	할인채	10,200	56.37
30	통안채	~1Y	KR310102AE15	통안DC024-0409-0910	20240109	20240409	0.13	0.13	3.37%	할인채	10,500	58.57
31	통안채	1~2Y	KR310101GE10	통안03340-2601-02	20240102	20260102	1.87	1.79	3.34%	이표채	52,000	369.71
32	통안채	1~2Y	KR310101GDA0	통안04020-2510-02	20231002	20251002	1.62	1.55	4.02%	이표채	79,900	394.84
33	통안채	1~2Y	KR310102GC94	통안03950-2509-03	20220903	20250903	1.53	1.47	3.95%	이표채	62,200	16.48
34	통안채	1~2Y	KR310101GD78	통안03670-2507-02	20230702	20250702	1.37	1.32	3.67%	이표채	110,900	112.76
35	통안채	1~2Y	KR310101GD45	통안03280-2504-02	20230402	20250402	1.12	1.08	3.28%	이표채	107,000	57.71
36	특수채	~1Y	KR350105GC14	한국전력1121	20220110	20250110	0.89	0.86	2.50%	이표채	2,700	70.46
37	특수채	1~2Y	KR350101G8C2	한국전력971	20181204	20251204	1.79	1.72	2.21%	이표채	2,000	12.5
38	특수채	~1Y	KR350901GA12	한국수자원공사256	20200110	20250110	0.89	0.87	1.66%	이표채	800	0.01
39	특수채	~1Y	KR350702G9C3	도로공사722	20191212	20241212	0.81	0.79	1.63%	이표채	1,900	23.63
40	특수채	~1Y	KR350701G4B7	도로공사610	20141106	20241106	0.71	0.69	2.69%	이표채	2,500	4
41	특수채	~1Y	KR350701GCA0	도로공사822	20221007	20241007	0.63	0.60	5.01%	이표채	700	0
42	특수채	~1Y	KR350701G998	도로공사713	20190905	20240905	0.54	0.52	1.42%	이표채	1,300	59.65
43	특수채	~1Y	KR350702GB87	도로공사772	20210820	20240820	0.5	0.49	1.54%	이표채	1,600	0
44	특수채	1~2Y	KR350701GCB8	도로공사825	20221111	20251111	1.72	1.62	5.50%	이표채	300	8.82
45	특수채	1~2Y	KR35070270A0	도로공사505	20101025	20251025	1.68	1.58	4.58%	이표채	1,300	0
46	특수채	1~2Y	KR350704GA37	도로공사727	20200326	20250326	1.1	1.06	1.66%	이표채	1,700	29.42
47	특수채	~1Y	KR351601GC37	중소벤처기업진흥채권758(사)	20220304	20250304	1.04	1.01	2.47%	이표채	1,300	15.38
48	특수채	~1Y	KR381102GA14	농금채(중앙회)2020-1이5Y-B	20200106	20250106	0.88	0.86	1.54%	이표채	2,000	0.49
49	특수채	~1Y	KR380701GDC8	농금채(경제)51-12이표12-1	20231215	20241215	0.82	0.79	3.79%	이표채	1,000	190
50	특수채	~1Y	KR354602G4B9	한국철도공사140	20141125	20241125	0.76	0.74	2.79%	이표채	2,000	0
51	특수채	~1Y	KR352703GBB4	국가철도공단채권367	20211117	20241117	0.74	0.73	2.20%	이표채	2,000	10
52	특수채	~1Y	KR351601GCB9	중소벤처기업진흥채권793(사)	20221101	20241101	0.7	0.68	5.60%	이표채	1,500	0
53	특수채	~1Y	KR350802GCA6	한국가스공사428	20221028	20241028	0.69	0.67	6.01%	이표채	1,400	32.19
54	특수채	~1Y	KR350801GC94	한국가스공사424	20220901	20240901	0.53	0.51	4.37%	이표채	800	81.29
55	특수채	~1Y	KR356105G483	토지주택채권284	20140828	20240828	0.52	0.51	3.21%	이표채	2,000	20
56	특수채	~1Y	KR352601GB85	세보기금특별계정채권2021-4(사)	20210820	20240820	0.5	0.49	1.55%	이표채	1,500	83.33
57	특수채	~1Y	KR354701GC63	부산교통공사2022-05	20220623	20240623	0.34	0.33	4.25%	이표채	300	133.33
58	특수채	1~2Y	KR381101GE11	농금채(중앙회)2024-1이2Y-A	20240105	20260105	1.87	1.79	3.66%	이표채	2,200	90.91
59	특수채	1~2Y	KR354421GD20	주택금융공사93(사)	20230227	20250827	1.52	1.46	3.76%	이표채	2,200	0
60	특수채	1~2Y	KR354401GC33	주택금융공사64(사)	20220307	20250307	1.05	1.02	2.49%	이표채	3,100	0

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
61	특수채	2~3Y	KR353601GB83	경기주택도시공사21-08-42	20210813	20260813	2.48	2.40	1.94%	이표채	1,800	11.11
62	은행채	~1Y	KR310201GD36	산금23신이0200-0303-1	20230303	20250303	1.03	1.00	4.07%	이표채	3,000	60.00
63	은행채	~1Y	KR310215GDB6	산금23신이0103-1121-1	20231121	20250221	1.00	0.97	3.95%	이표채	3,100	87.10
64	은행채	~1Y	KR310210GB29	산금21신이0400-0218-2	20210218	20250218	0.99	0.98	1.24%	이표채	2,600	186.33
65	은행채	~1Y	KR310202AE14	산금24신할0100-0122-1	20240122	20250122	0.92	0.89	3.41%	할인채	3,500	78.57
66	은행채	~1Y	KR310202ADC5	산금23신할0100-1207-1	20231207	20241207	0.80	0.77	3.68%	할인채	2,900	110.34
67	은행채	~1Y	KR310205GCB9	산금22신이0200-1111-1	20221111	20241111	0.72	0.71	4.88%	이표채	6,200	51.61
68	은행채	~1Y	KR310213GB91	산금21신이0300-0915-2	20210915	20240915	0.57	0.56	1.70%	이표채	3,300	0.00
69	은행채	~1Y	KR310209GB89	산금21신이0300-0823-2	20210823	20240823	0.51	0.50	1.53%	이표채	1,300	15.47
70	은행채	~1Y	KR310214GB17	산금21신이0306-0127-1	20210127	20240727	0.43	0.43	1.18%	이표채	2,700	7.41
71	은행채	~1Y	KR310218GC61	산금22신이0200-0623-1	20220623	20240623	0.34	0.33	3.72%	이표채	6,000	47.50
72	은행채	~1Y	KR310216GC55	산금22신이0200-0530-1	20220530	20240530	0.27	0.27	3.01%	이표채	3,500	24.29
73	은행채	1~2Y	KR310203GDC0	산금23신이0200-1212-1	20231212	20251212	1.81	1.73	3.78%	이표채	3,400	104.41
74	은행채	1~2Y	KR310211GCB7	산금22신이0300-1125-1	20221125	20251125	1.76	1.67	4.75%	이표채	5,600	24.11
75	은행채	1~2Y	KR310207GD89	산금23신이0200-0814-1	20230814	20250814	1.48	1.43	3.95%	이표채	3,900	87.18
76	은행채	1~2Y	KR310212GD17	산금23신이0206-0119-3	20230119	20250719	1.41	1.36	3.60%	이표채	2,300	41.30
77	은행채	1~2Y	KR310213GC58	산금22신이0300-0520-1	20220520	20250520	1.25	1.22	3.31%	이표채	3,700	27.03
78	은행채	1~2Y	KR310206GC57	산금22신이0300-0510-1	20220510	20250510	1.22	1.19	3.28%	이표채	4,000	18.75
79	은행채	1~2Y	KR310207GD48	산금23신이0200-0424-1	20230424	20250424	1.17	1.14	3.53%	이표채	3,800	2.63
80	은행채	2~3Y	KR310208GDA3	산금23신이0300-1017-1	20231017	20261017	2.66	2.49	4.31%	이표채	3,600	63.89

* 바스켓은 각 종목당 약 1.25%의 동일 비중으로 구성됨

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

4. KOBİ퇴직연금지수 Basket List

4. 총 35 종목

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
1	국채	2~3Y	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	20230610	20260610	2.30	2.19	4%	3.13%	이표채	142,510	294.85
2	국채	2~3Y	KR103501GB91	국고01750-2609(국고21-7)	20210910	20260910	2.55	2.44	4%	1.75%	이표채	123,860	40.29
3	국채	3~5Y	KR103501GC90	국고03125-2709(국고22-8)	20220910	20270910	3.55	3.28	4%	3.13%	이표채	110,201	38.64
4	국채	3~5Y	KR103501GD32	국고03250-2803(국고23-1)	20230310	20280310	4.05	3.71	4%	3.25%	이표채	149,490	152.74
5	국채	3~5Y	KR103501GD99	국고03500-2809(국고23-6)	20230910	20280910	4.55	4.11	4%	3.50%	이표채	103,960	494.98
6	국채	5~7Y	KR103502GA67	국고01375-3006(국고20-4)	20200610	20300610	6.30	5.92	4%	1.38%	이표채	233,360	12.56
7	국채	7~10Y	KR103502GBC0	국고02375-3112(국고21-11)	20211210	20311210	7.80	6.98	4%	2.38%	이표채	162,590	28.07
8	국채	7~10Y	KR103502GC65	국고03375-3206(국고22-5)	20220610	20320610	8.30	7.13	4%	3.38%	이표채	143,647	25.08
9	국채	7~10Y	KR103502GD64	국고03250-3306(국고23-5)	20230610	20330610	9.30	7.90	4%	3.25%	이표채	155,700	188.29
10	국채	10Y~	KR103502GC32	국고02500-5203(국고22-2)	20220310	20520310	28.05	18.88	4%	2.50%	이표채	284,000	3.53
11	국채	10Y~	KR103502GC99	국고03125-5209(국고22-9)	20220910	20520910	28.55	18.21	4%	3.13%	이표채	166,859	6.36
12	국채	10Y~	KR103502GD31	국고03250-5303(국고23-2)	20230310	20530310	29.05	18.25	4%	3.25%	이표채	281,742	25.00
13	국채	10Y~	KR103502GD98	국고03625-5309(국고23-7)	20230910	20530910	29.55	18.03	4%	3.63%	이표채	187,301	222.33
14	국채	10Y~	KR103503GA90	국고01625-7009(국고20-10)	20200910	20700910	46.55	27.23	4%	1.63%	이표채	92,200	0.30
15	국채	10Y~	KR103505GC96	국고03500-7209(국고22-12)	20220910	20720910	48.55	23.31	4%	3.50%	이표채	38,580	20.60
16	지방채	3~5Y	KR2001024C13	서울도시철도22-01	20220131	20290131	4.94	4.77	2%	1.00%	복5단2	555	10.65
17	특수채	2~3Y	KR351603GB93	중소벤처기업진흥채권741(사)	20210917	20260917	2.57	2.48	2%	1.93%	이표채	2,800	0.00
18	특수채	2~3Y	KR354601GBA0	한국철도공사204	20211008	20261008	2.63	2.50	2%	2.23%	이표채	2,500	8.00
19	특수채	3~5Y	KR351605GC41	중소벤처기업진흥채권769(사)	20220420	20270420	3.16	2.98	2%	3.41%	이표채	1,700	0.00
20	특수채	3~5Y	KR350201GD65	서울교통공사2023-1	20230607	20280607	4.30	3.88	2%	4.26%	이표채	3,500	32.86
21	특수채	5~7Y	KR356102GB15	토지주택채권383	20210115	20310115	6.90	6.39	2%	1.84%	이표채	2,500	0.00
22	특수채	7~10Y	KR354602GDC0	한국철도공사244	20231213	20331213	9.81	8.07	2%	3.82%	이표채	2,200	104.55
23	특수채	10Y~	KR357102G935	한국해양진흥공사1-2	20190328	20490328	25.10	18.31	2%	2.01%	이표채	3,000	0.00
24	통안채	2~3Y	KR310102GD93	통안04000-2609-03	20230903	20260903	2.53	2.38	2%	4.00%	이표채	85,100	142.13
25	은행채	2~3Y	KR310208GD47	산금23신이0300-0426-1	20230426	20260426	2.18	2.08	2%	3.54%	이표채	5,900	29.66
26	은행채	3~5Y	KR310509GD50	기업은행(신)2305이5A-17	20230517	20280517	4.24	3.91	2%	3.69%	이표채	4,000	0.00
27	기타금융채	2~3Y	KR6032716DA7	신한카드2194	20231017	20261016	2.65	2.47	2%	4.81%	이표채	1,000	0.00
28	기타금융채	3~5Y	KR6008277D90	산은캐피탈715-7	20230912	20280912	4.56	4.03	2%	4.94%	이표채	1,000	0.00

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
29	회사채	2~3Y	KR6002381D54	케이씨씨75-1	20230531	20260529	2.27	2.12	2%	4.57%	이표채	2,750	34.55
30	회사채	2~3Y	KR6373222E28	LG에너지솔루션3-2(녹)	20240216	20270216	2.99	2.81	2%	3.89%	이표채	6,600	11.36
31	회사채	3~5Y	KR6097952E11	씨제이제일제당31-2	20240122	20290122	4.92	4.44	2%	3.95%	이표채	1,700	26.47
32	회사채	5~7Y	KR6028822AA5	증권금융채권2020-4-2	20201013	20301013	6.65	6.17	2%	1.78%	이표채	1,000	0.00
33	회사채	7~10Y	KR6055553C71	신한금융지주149-3	20220718	20320718	8.41	7.03	2%	4.14%	이표채	600	0.00
34	회사채	10Y~	KR6063323D57	한국수력원자력73-3(녹)	20230522	20430522	19.25	13.05	2%	4.06%	이표채	1,400	0.00
35	ABS	2~3Y	KR354405GD87	택금융공사MBS2023-22(1-3)(	20230811	20260811	2.47	2.34	2%	4.15%	이표채	3,800	0.00

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

5. KOBİ Market Index Basket List

5. 총 40 종목

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
1	국고채	1~2Y	KR103503GD97	국고03625-2509(국고23-8)	20230910	20250910	1.55	1.47	4%	3.63%	이표채	65,720	107.42
2	국고채	2~3Y	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	20230610	20260610	2.30	2.19	4%	3.13%	이표채	142,510	294.85
3	국고채	3~5Y	KR103501GD32	국고03250-2803(국고23-1)	20230310	20280310	4.05	3.71	4%	3.25%	이표채	149,490	152.74
4	국고채	3~5Y	KR103501GD99	국고03500-2809(국고23-6)	20230910	20280910	4.55	4.11	4%	3.50%	이표채	103,960	494.98
5	국고채	5Y~	KR103502GCC8	국고04250-3212(국고22-14)	20221210	20321210	8.80	7.29	4%	4.25%	이표채	142,052	54.18
6	국고채	5Y~	KR103502GD64	국고03250-3306(국고23-5)	20230610	20330610	9.30	7.90	4%	3.25%	이표채	155,700	188.29
7	국고채	5Y~	KR103502GA91	국고01500-4009(국고20-7)	20200910	20400910	16.55	13.99	4%	1.50%	이표채	113,780	7.54
8	국고채	5Y~	KR103503GB99	국고01875-4109(국고21-9)	20210910	20410910	17.55	14.24	4%	1.88%	이표채	91,830	21.79
9	국고채	5Y~	KR103504GC97	국고03250-4209(국고22-11)	20220910	20420910	18.55	13.55	4%	3.25%	이표채	114,818	34.41
10	국고채	5Y~	KR103502GC32	국고02500-5203(국고22-2)	20220310	20520310	28.05	18.88	4%	2.50%	이표채	284,000	3.53
11	특수채	~1Y	KR350116GC86	한국전력1263	20220822	20240822	0.50	0.48	2%	4.14%	이표채	1,800	8.37
12	특수채	1~2Y	KR356104GA48	토지주택채권356	20200422	20250422	1.17	1.15	2%	1.44%	이표채	2,000	0.00
13	특수채	1~2Y	KR350106GD20	한국전력1358	20230210	20260210	1.97	1.88	2%	3.83%	이표채	3,400	130.88
14	특수채	2~3Y	KR350702GB46	도로공사763	20210408	20260408	2.13	2.05	2%	1.74%	이표채	1,600	6.25
15	특수채	3~5Y	KR350106GC13	한국전력1122	20220110	20290110	4.89	4.49	2%	2.83%	이표채	2,000	0.00
16	특수채	5Y~	KR350702GD93	도로공사859	20230915	20430915	19.57	13.36	2%	4.03%	이표채	1,400	0.00
17	특수채	5Y~	KR352701GC83	국가철도공단채권381	20220818	20520818	28.49	17.72	2%	3.41%	이표채	1,600	0.00
18	통안채	~1Y	KR310101GD11	통안03680-2501-02	20230102	20250102	0.87	0.84	2%	3.68%	이표채	97,000	83.97
19	통안채	1~2Y	KR310101GD45	통안03280-2504-02	20230402	20250402	1.12	1.08	2%	3.28%	이표채	107,000	57.71
20	통안채	1~2Y	KR310101GD78	통안03670-2507-02	20230702	20250702	1.37	1.32	2%	3.67%	이표채	110,900	112.76
21	은행채	~1Y	KR310205GC66	산금22신이0200-0607-1	20220607	20240607	0.30	0.29	2%	3.21%	이표채	1,500	0.00
22	은행채	~1Y	KR310510AD79	기업은행(신)2307할1A-19	20230719	20240719	0.41	0.40	2%	3.66%	할인채	3,200	20.31
23	은행채	~1Y	KR310209GB89	산금21신이0300-0823-2	20210823	20240823	0.51	0.50	2%	1.53%	이표채	1,300	15.47
24	은행채	~1Y	KR310507GD52	기업은행(신)2305이1.5A-17	20230517	20241117	0.74	0.73	2%	3.67%	이표채	4,000	38.75
25	은행채	1~2Y	KR380804GC31	한국수출입금융2203카-이표-3	20220325	20250325	1.09	1.06	2%	2.68%	이표채	2,000	0.00
26	은행채	1~2Y	KR6000017D50	신한은행27-05-이-2-D	20230522	20250522	1.25	1.21	2%	3.85%	이표채	3,800	94.74
27	은행채	1~2Y	KR310214GB66	산금21신이0400-0617-2	20210617	20250617	1.32	1.29	2%	1.68%	이표채	5,600	7.14
28	은행채	1~2Y	KR310204GE24	산금24신이0200-0215-1	20240215	20260215	1.98	1.91	2%	3.60%	이표채	4,500	72.22

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액

구분	섹터	만기	채권코드	채권명	발행일	만기일	잔존만기	듀레이션	편입비중	표면금리	이표방식	발행잔액(억)	회전율
29	은행채	2~3Y	KR310514GD61	기업은행(신)2306이3A-15	20230615	20260615	2.32	2.19	2%	3.89%	이표채	3,800	52.63
30	은행채	2~3Y	KR310208GDA3	산금23신이0300-1017-1	20231017	20261017	2.66	2.49	2%	4.31%	이표채	3,600	63.89
31	은행채	3~5Y	KR356205G416	산금(정금)14신이1500-0109-2	20140109	20290109	4.88	4.41	2%	3.93%	이표채	1,500	6.67
32	회사채	~1Y	KR6055551BB2	신한금융지주144-1	20211111	20241111	0.72	0.71	2%	2.30%	이표채	1,700	17.88
33	회사채	~1Y	KR6000662A28	에스케이하이닉스221-2	20200214	20250214	0.98	0.97	2%	1.72%	이표채	3,600	32.15
34	회사채	1~2Y	KR6055551C32	신한금융지주146-1	20220323	20250323	1.09	1.06	2%	2.84%	이표채	2,800	10.71
35	회사채	1~2Y	KR6427201C45	신보2022제5차유동화1-1(사)	20220429	20250429	1.19	1.15	2%	3.67%	이표채	3,361	0.00
36	회사채	1~2Y	KR6175332A51	JB금융지주11-2	20200525	20250523	1.26	1.22	2%	1.84%	이표채	2,100	7.14
37	회사채	2~3Y	KR6035422B24	네이버4-2	20210225	20260225	2.01	1.96	2%	1.60%	이표채	4,500	45.10
38	회사채	2~3Y	KR6150351D32	삼척블루파워8	20230315	20260315	2.07	1.92	2%	6.96%	이표채	2,250	3.12
39	회사채	3~5Y	KR60867928C4	하나금융지주42-2	20181214	20281214	4.81	4.49	2%	2.28%	이표채	3,500	0.00
40	회사채	5Y~	KR6063323DB2	한국수력원자력76-3	20231110	20531110	29.72	16.75	2%	4.25%	이표채	800	0.00

※ 회전율 : 3개월 유통량 / 발행잔액