

KRX 반도체 TR 레버리지 지수 방법론

KRX Semicon TR Leverage Index Methodology

2024. 12



- 이 문서를 포함한 KRX의 모든 지수컨텐츠(산출 지수 및 기타 지적재산권 포함)는 KRX의 사전 서면동의 없이 무단으로 전재하거나 복제, 전송, 출판, 배포 등을 할 수 없으며, 예고 또는 공지 없이 변경될 수 있습니다.
- KRX는 모든 지수컨텐츠를 오직 정보를 제공하기 위한 목적으로 생산하고 있으며 그 산출·공표·오류·누락·지연·중단 등과 관련하여 어떠한 정확성 및 완전성도 보증하지 않습니다.
- KRX는 지수컨텐츠에 기반한 제3자의 투자상품에 대한 어떠한 의견도 표명하지 않으며, 특정 자산의 지수 편입이 해당 자산에 대한 매수 추천을 의미하지 않습니다. 또한 과거의 지수 성과는 미래의 성과를 보장하지 않습니다.
- KRX는 지수컨텐츠를 이용한 투자행위 등으로 발생한 손실 등에 대하여 어떠한 책임도 부담하지 않습니다.

KRX 반도체 TR 레버리지 지수 방법론

1. 지수개요

KRX 반도체 TR 레버리지 지수는 KRX 반도체 TR 지수의 변화에 2배로 연동하는 지수로서 아래의 산출방법에 따라 산출합니다.

구분	기준시점	기준지수	발표일	산출시간	산출주기
레버리지지수	2011.1.3	1,789.32	2024.12.9	09:00:30~15:30:00	2초

2. 산출방법

KRX 반도체 TR 레버리지 지수는 다음의 산식에 따라 산출하며, 소수점 셋째 자리에서 반올림하여 소수점 둘째 자리로 표시합니다.

$$L_t = L_{t-1} \times \left[1 + \left\{ K \times \left(\frac{S_t}{S_{t-1}} - 1 \right) - (K-1) \times \frac{r_{t-1}}{365} \times D_{t,t-1} \right\} \right]$$

상기 산식에서 사용된 변수는 다음의 정의를 따릅니다.

1. t : 지수산출시점, $t-1$: 직전 거래일

2. L_t : 지수산출시점의 KRX 반도체 TR 레버리지 지수

L_{t-1} : 직전 거래일의 KRX 반도체 TR 레버리지 지수의 종가지수

3. K : 2 (KRX 반도체 TR 지수의 변화에 연동하는 배율)

4. S_t : 지수산출시점의 KRX 반도체 TR 지수

S_{t-1} : 직전 거래일의 KRX 반도체 TR 지수의 종가지수

5. r_{t-1} : 「과생상품지수 등 기본방법론」에서 정하는 금리

6. $D_{t,t-1}$: 직전 거래일($t-1$)부터 지수산출시점 전일(휴장일 포함)까지의 일수