
	<h1>보도자료</h1>			
	보도	배포 즉시	배포	
담당부서	경영지원본부 인덱스사업부	문의	손승태 팀장(051-662-2371) 김연진 팀원(051-662-2375)	

제 목 : 한국거래소, 「5년 국채선물 추종 지수」 2종 발표

- **(개요)** 한국거래소(이사장 손병두)는 6월 14일(월)부터 전략형 국채선물지수인 「5년 국채선물 추종 지수」 2종을 발표할 예정
- **(지수 컨셉)** 5년 국채선물 추종 지수는 3년 국채선물과 10년 국채선물을 혼합하여 5년 국채선물의 성과를 유사하게 복제함
 - 파생상품시장에 상장된 5년 국채선물은 유동성 부족으로 해당 선물의 가격을 이용한 지수와 금융상품 개발에 제약이 있음
 - 이에, 3년 국채선물지수와 10년 국채선물지수를 각각 7:3의 비율로 혼합하여 5년 국채선물의 듀레이션 추종할 수 있도록 설계하였음
 - 또한, 5년 국채선물 추종지수의 당일 수익률과 정반대의 수익률에 연동하는 「5년 국채선물 추종 인버스지수」를 동시에 개발함
- **(기대 효과)** 향후 금리인상시 5년 국채선물의 듀레이션과 유사한 국채 포트폴리오를 보유한 기관투자자에게 적절한 헷지수단을 제공하고, 금리인상을 전망하는 투자자에게 인버스 투자기회를 제공할 것으로 기대

※ 한국거래소 보도자료는 인터넷(<http://www.krx.co.kr>)에 수록되어 있습니다.