

미국달러선물지수(F-USDKRW) _ 주가지수개요

미국달러선물지수(F-USDKRW) 는 KRX 미국달러선물시장에 상장된 최근월종목의 가격을 대상으로 산출되는 지수로서 미국달러 및 인버스 ETF 등의 추적 대상지수로 활용됩니다. 미국달러선물지수(F-USDKRW)는 2007 년 1 월 2 일을 1,000p 로 하여 2010 년 1 월 18 일 부터 산출·발표하고 있습니다.

일반사항

- **주가지수 명칭** : 미국달러선물지수(F-USDKRW)
- **용도** : 미국달러 및 인버스 ETF 등의 추적 대상지수로 활용
- **산출방법** : 미국달러선물시장에 상장된 최근월종목의 가격을 기준으로 다음과 같이 산출

$$F-USDKRW = \frac{\text{비교시점의 선물계약금액}}{\text{기준시점의 선물계약금액}} \times 1000$$

여기서, 선물계약금액은 '미국달러선물가격 x 거래승수(1 만)'

- **기준월물 교체(Roll-over)** : 결제월물 교체시 물량부담을 줄이기 위해 최종거래일 2 일전(T-2 일)부터 이월
 - 최종거래일(T 일) : 차근월종목 가격 사용
 - 최종거래일 전일(T-1 일) : 차근월물(2/3) · 최근월물(1/3) 가중평균가격 사용
 - 최종거래일 전전일(T-2 일) : 차근월물(1/3) · 최근월물(2/3) 가중평균가격 사용
- **기준일** : 2007 년 1 월 2 일
- **기준지수** : 1,000