

채권형 ETN 일일시장동향

기준일: 2025-01-14

단위: 백만원, %

| 거래대금 Top 5 | | | | 수익률 TOP 5 | | | |
|--------------------------|-----|---------|----------|-------------------------|-------|---------|----------|
| | 1D | 1W(Avg) | 1M Trend | | 1D | 1W(Avg) | 1M Trend |
| 1 메리츠 3X 레버리지 미국채30년 ETN | 502 | 762 | | 메리츠 3X 레버리지 국채30년 ETN | 2.64% | 0.95% | |
| 2 메리츠 3X 레버리지 국채30년 ETN | 403 | 317 | | 메리츠 레버리지 국채30년 ETN | 1.76% | 1.41% | |
| 3 메리츠 레버리지 미국채30년 ETN(H) | 180 | 240 | | 메리츠 레버리지 미국채30년 ETN(H) | 1.01% | -3.44% | |
| 4 메리츠 3X 레버리지 미국채10년 ETN | 126 | 754 | | 메리츠 미국 레버리지 인플레이션 국채 E1 | 0.85% | -0.76% | |
| 5 메리츠 인버스 3X 미국채10년 ETN | 67 | 17 | | 메리츠 3X 레버리지 미국채30년 ETN | 0.68% | -4.90% | |

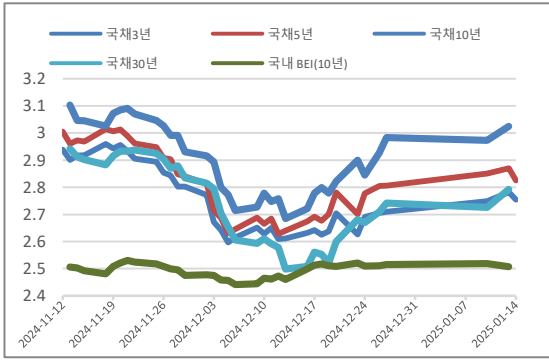
단위: pp

| 기초자산 가중평균 YTM | YTM(%) | 1D | 1M Chg |
|----------------------------|--------|-------|--------|
| 메리츠 인플레이션 국채 ETN 시리즈 | 0.42 | -0.05 | -0.13 |
| 메리츠 국채10년 ETN 시리즈 | 2.99 | -0.03 | -0.26 |
| 메리츠 국채30년 ETN 시리즈 | 2.71 | -0.04 | -0.11 |
| 메리츠 국채3년 ETN 시리즈 | 2.69 | -0.02 | -0.08 |
| 메리츠 국채5년 ETN 시리즈 | 2.75 | -0.02 | -0.11 |
| 메리츠 미국 인플레이션 국채 ETN(H) 시리즈 | 2.30 | -0.03 | -0.36 |
| 메리츠 미국채10년 ETN(H) 시리즈 | 4.76 | -0.03 | -0.55 |
| 메리츠 미국채30년 ETN(H) 시리즈 | 4.96 | -0.02 | -0.57 |
| 메리츠 KAP 3개월 통안채 ETN | 2.84 | 0.00 | 0.08 |
| 메리츠 KAP 6개월 통안채 ETN | 2.70 | 0.00 | 0.12 |
| 메리츠 KIS 1년 통안채 ETN | 2.65 | 0.01 | 1.53 |

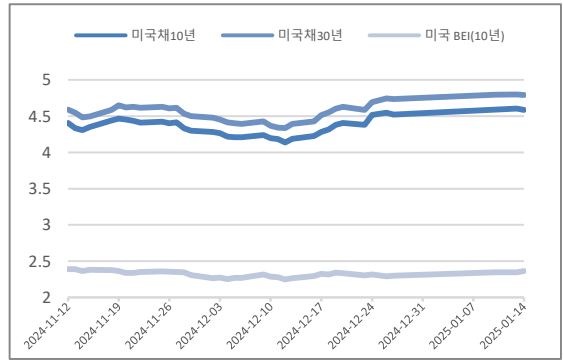
| BEI (Break-Even Inflation) | | 한국 | 미국 |
|----------------------------|--------|-----------|--------|
| BEI (=국채-물가채 금리) | 금리 | 2.57 | 2.46 |
| | 전일대비 | -0.01 | 0.00 |
| 물가 연동 수익률 | 적용월 | 2025년 1월 | |
| | CPI기준월 | 2025년 -1월 | |
| | 적용치 | 0.217% | 0.506% |
| | 연환산 기준 | 2.605% | 6.071% |

*한/미 국채 10년&인플레이션 국채 지수 내 최근 발행 종목 간 금리 차 적용

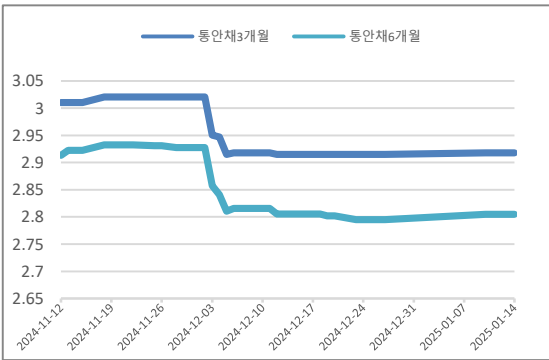
참고 그래프



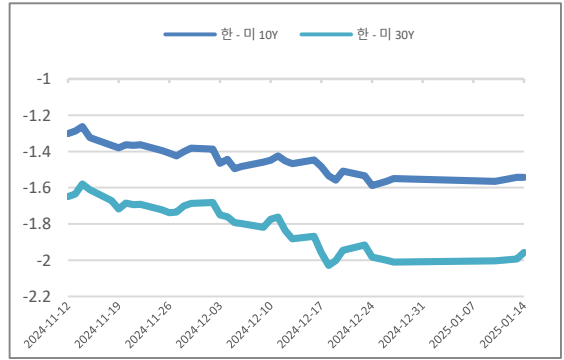
국채 3·5·10·30년 및 10년 BEI 추이



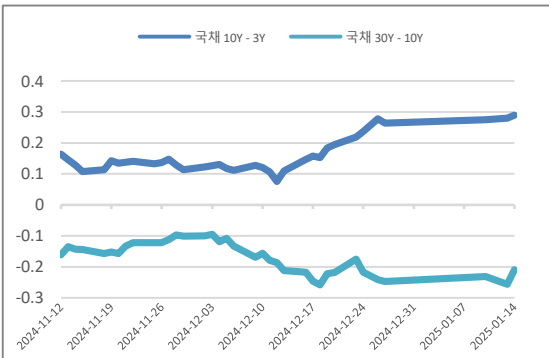
미국채 10·30년 및 10년 BEI 추이



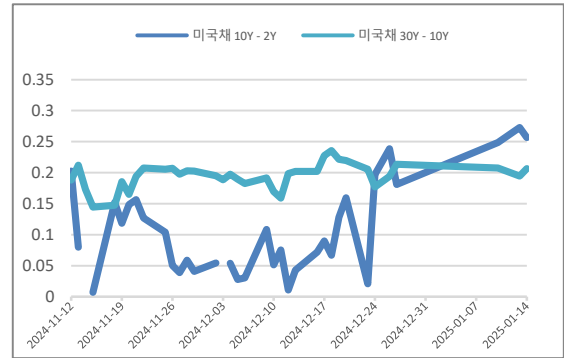
통안채 3·6개월 금리 추이



한-미 10년 및 30년 스프레드 추이



국채 10Y-3Y 및 30-10Y 커브 추이



미국채 10Y-2Y 및 30-10Y 커브 추이

상세 구성종목 및 금리(YTM)

| 기초지수 | 종목코드 | 종목명 | 비중 | 금리(YTM) | 전일대비 |
|---|--------------|-----------------------|-------|---------|--------|
| KAP 인플레이션 국채 TR 지수 (메리츠 인플레이션 국채 ETN 시리즈) | KR103503GA66 | 물가01125-3006(20-5) | 20% | 0.347 | -0.045 |
| | KR103503GC64 | 물가01625-3206(22-6) | 30% | 0.222 | -0.050 |
| | KR103503GE62 | 물가00750-3406(24-6) | 50% | 0.562 | -0.043 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 0.417 | -0.046 |
| KAP 국채10년 TR 지수 (메리츠 국채10년 ETN 시리즈) | KR103502GD64 | 국고03250-3306(국고23-5) | 20% | 2.987 | -0.033 |
| | KR103502GDC6 | 국고04125-3312(국고23-11) | 30% | 2.997 | -0.033 |
| | KR103502GE63 | 국고03500-3406(국고24-5) | 50% | 2.980 | -0.035 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.987 | -0.034 |
| KAP 국채30년 TR 지수 (메리츠 국채30년 ETN 시리즈) | KR103502GD31 | 국고03250-5303(국고23-2) | 12% | 2.715 | -0.045 |
| | KR103502GD98 | 국고03625-5309(국고23-7) | 26% | 2.715 | -0.045 |
| | KR103502GE30 | 국고03250-5403(국고24-2) | 42% | 2.707 | -0.040 |
| | KR103502GE97 | 국고02750-5409(국고24-8) | 20% | 2.687 | -0.048 |
| 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.706 | -0.043 | |
| KAP 국채3년 TR 지수 (메리츠 국채3년 ETN 시리즈) | KR103501GD65 | 국고03125-2606(국고23-4) | 20% | 2.680 | -0.030 |
| | KR103501GDC8 | 국고03875-2612(국고23-10) | 30% | 2.707 | -0.023 |
| | KR103501GE64 | 국고03250-2706(국고24-4) | 50% | 2.687 | -0.020 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.692 | -0.023 |
| KAP 국채5년 TR 지수 (메리츠 국채5년 ETN 시리즈) | KR103501GD32 | 국고03250-2803(국고23-1) | 12% | 2.720 | -0.015 |
| | KR103501GD99 | 국고03500-2809(국고23-6) | 26% | 2.745 | -0.015 |
| | KR103501GE31 | 국고03250-2903(국고24-1) | 42% | 2.772 | -0.018 |
| | KR103501GE98 | 국고03000-2909(국고24-7) | 20% | 2.737 | -0.018 |
| 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.752 | -0.017 | |
| KAP 미국 인플레이션 국채 TR 지수 시리즈 (메리츠 미국 인플레이션 국채 ETN(H)) | US91282CHP95 | TIPS 1.375 07/15/33 | 20% | 2.262 | -0.028 |
| | US91282CJY84 | TIPS 1.75 01/15/34 | 30% | 2.319 | -0.031 |
| | US91282CLE92 | TIPS 1.875 07/15/34 | 50% | 2.300 | -0.030 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.298 | -0.030 |
| KAP 미국채10년 TR 지수 (메리츠 미국채10년 ETN(H) 시리즈) | US91282CJZ59 | T 4 02/15/34 | 20% | 4.752 | -0.033 |
| | US91282CKQ32 | T 4 3/8 05/15/34 | 30% | 4.755 | -0.032 |
| | US91282CLF67 | T 3 7/8 08/15/34 | 50% | 4.759 | -0.033 |

| | | | | | |
|---|--------------|-------------------|------|-------|--------|
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 4.756 | -0.033 |
| KAP 미국채30년 TR 지수 (메리츠 미국채30년 ETN(H) 시리즈) | US912810TX63 | T 4 1/4 02/15/54 | 20% | 4.971 | -0.024 |
| | US912810UA42 | T 4 5/8 05/15/54 | 30% | 4.964 | -0.025 |
| | US912810UC08 | T 4 1/4 08/15/54 | 50% | 4.960 | -0.025 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 4.963 | -0.025 |
| KAP 통안채 3개월 총수익 지수 | KR310101GD45 | 통안03280-2504-02 | 40% | 2.805 | 0.000 |
| | KR310101GE51 | 통안03430-2505-01 | 30% | 2.810 | 0.000 |
| | KR310104AEC1 | 통안DC025-0325-0910 | 30% | 2.920 | 0.000 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.841 | 0.000 |
| KAP 통안채 6개월 총수익 지수 | KR310101GD78 | 통안03670-2507-02 | 40% | 2.715 | 0.000 |
| | KR310102GC94 | 통안03950-2509-03 | 30% | 2.660 | 0.000 |
| | KR310102GE76 | 통안03230-2507-01 | 30% | 2.720 | 0.000 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.700 | 0.000 |
| KIS 통안채 1년 총수익지수 | KR310101GDA0 | 통안04020-2510-02 | 40% | 2.622 | 0.010 |
| | KR310101GE93 | 통안02890-2509-01 | 30% | 2.655 | 0.010 |
| | KR310102GC94 | 통안03950-2509-03 | 30% | 2.680 | 0.010 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 2.652 | 0.010 |
| KIS 미국채 10Y TR 지수 | US91282CHT18 | T 3 7/8 08/15/33 | 20% | 4.749 | 0.139 |
| | US91282CJZ59 | T 4 02/15/34 | 20% | 4.752 | -0.033 |
| | US91282CKQ32 | T 4 3/8 05/15/34 | 20% | 4.755 | -0.032 |
| | US91282CLF67 | T 3 7/8 08/15/34 | 20% | 4.759 | -0.033 |
| | US91282CLF67 | T 4 3/8 05/15/34 | 20% | 4.750 | 0.140 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 4.753 | 0.036 |
| KIS 미국채 30Y TR 지수 | US912810UC08 | T 4 1/4 08/15/54 | 20% | 4.948 | 0.118 |
| | US912810TX63 | T 4 1/4 02/15/54 | 20% | 4.971 | -0.024 |
| | US912810UA42 | T 4 5/8 05/15/54 | 20% | 4.964 | -0.025 |
| | US912810UC08 | T 4 1/4 08/15/54 | 20% | 4.960 | -0.025 |
| | US912810UA42 | T 4 5/8 05/15/54 | 20% | 4.958 | 0.141 |
| | 지수 (기초자산 평균) | | 100% | 4.960 | 0.037 |