

6 Jan. 2025



DAOL Daily Bond Morning Brief

주간 인챀 일정 및 결과

·액 발행금리

· 금리방향: 하락(3Y), 상승(10Y) ■ 일드커브: 스티프닝

- ■스프레드(bp): 국5/3 16.5 (-0.8) 국10/3: 29.5 (5.5) 국10/5: 13.0 (6.3) 국30/10: -9.0 (-4.0)

KR Market

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.150	-11.0	-29.0	-13.0
통안1Y	2.634	-2.3	-6.0	-6.8
통안2Y	2.616	-2.4	-14.1	-8.2
국고3Y	2.470	-3.1	-15.5	-15.5
국고5Y	2.635	-4.0	-15.0	-0.7
국고10Y	2.765	2.3	-12.0	0.0
국고20Y	2.739	-3.0	-13.2	6.4
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.206	-3.5	-16.0	-4.6
회사채 AA- 3Y	3.151	-3.4	-15.5	-7.0
회사채 BBB+ 3Y	6.494	-3.3	-15.6	-9.0
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.9	4.0	30.0	
LKTBF 10Y	118.0	33.0	121.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,441.9	1.79	1.54	-0.90
KOSDAQ	705.8	2.79	5.97	4.23
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,468.4	0.12	0.06	4.13
원/100엔	935.1	-0.36	0.38	-0.56

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Sprea	ad(bp)	1D(bp)
1Y	2.763	-1.5	1Y	2.660	-3	IRS-통1	12.9	0.8
2Y	2.618	-2.5	2Y	2.525	-2	IRS-통2	0.2	-0.1
3Y	2.593	-2.8	3Y	2.525	-2.5	IRS-국3	12.3	0.3
5Y	2.608	-3.0	5Y	2.575	-1.5	IRS-국5	-2.7	1.0
10Y	2.668	-3.0	10Y	2.585	-1.5	IRS-국10	-9.8	-5.3

US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM		1W	1M
UST2Y	4.281	3.7	-5.1	14.9
UST5Y	4.414	4.3	-5.0	34.4
UST10Y	4.600	3.8	-2.7	41.8
UST30Y	4.812	3.2	-0.7	46.6

KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	2.918	-4.1	-11.1	-9.2	-25.8	-73.3
특수채 AAA 3Y	2.787	-3.3	-15.3	-10.5	-31.3	-80.4
특수채 AAA 5Y	2.917	-4.3	-14.8	-0.3	-24.5	-66.9
은행채 AAA 1Y	2.916	-4.3	-12.4	-8.4	-27.3	-74.5
은행채 AAA 3Y	2.816	-3.3	-15.7	-10.2	-31.2	-88.5
은행채 AAA 5Y	2.959	-4.0	-14.8	0.3	-25.4	-84.6
금융채 AA 1Y	3.153	-4.0	-11.5	-5.3	-13.8	-69.1
금융채 AA 3Y	3.114	-3.5	-16.0	-4.6	-21.4	-87.6
금융채 AA 5Y	3.293	-4.0	-15.0	1.5	-23.7	-83.7
금융채 AA- 1Y	3.231	-4.0	-11.5	-4.8	-14.9	-77.4
금융채 AA- 3Y	3.206	-3.5	-16.0	-4.6	-22.6	-99.9
금융채 AA- 5Y	3.401	-4.0	-15.0	1.5	-24.2	-93.1
금융채 A+ 1Y	3.904	-4.0	-11.5	-6.8	-23.9	-96.7
금융채 A+ 3Y	4.068	-3.5	-16.0	-5.9	-30.8	-104.7
금융채 A+ 5Y	4.516	-4.0	-15.0	1.0	-25.7	-78.9
금융채 A 1Y	4.621	-4.0	-11.5	-6.8	-24.4	-94.7
금융채 A 3Y	4.861	-3.5	-16.0	-5.9	-30.8	-101.2
금융채 A 5Y	5.200	-4.0	-15.0	1.0	-25.7	-77.9
금융채 A- 1Y	5.193	-4.0	-11.5	-6.8	-23.9	-93.7
금융채 A- 3Y	5.501	-3.5	-16.0	-5.9	-29.8	-97.2
금융채 A- 5Y	5.841	-4.0	-15.0	1.0	-25.7	-77.1
회사채 AAA 1Y	3.038	-3.4	-9.7	-9.8	-17.9	-76.3
회사채 AAA 3Y	2.993	-3.2	-14.9	-6.7	-27.7	-76.9
회사채 AAA 5Y	3.066	-4.0	-15.3	0.4	-25.1	-74.4
회사채 AA+ 1Y	3.079	-3.5	-9.8	-7.5	-16.0	-79.5
회사채 AA+ 3Y	3.076	-3.5	-15.5	-6.9	-26.0	-79
회사채 AA+ 5Y	3.163	-4.0	-15.5	0.6	-23.2	-82.1
회사채 AA 1Y	3.106	-3.5	-9.9	-7.2	-15.5	-80.9
회사채 AA 3Y	3.103	-3.5	-15.5	-7.0	-26.4	-80.3
회사채 AA 5Y	3.223	-4.0	-15.5	0.7	-23.3	-82.4
회사채 AA- 1Y	3.136	-3.5	-9.8	-7.1	-15.5	-81.9
회사채 AA- 3Y	3.151	-3.4	-15.5	-7.0	-26.4	-82.1
회사채 AA- 5Y	3.328	-4.0	-15.5	0.9	-23.2	-83

전일 주요 채권 발행	결과 (발행 금인	! 상위 10개 송목)

신일 수요 세권 일행 결과 (일행 금액 성위 TO개 용목)								
종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신 용등 급		
산금25신할0100-0103-2	금융채	2026-01-03(토)	5,000	2.790	2.917	AAA		
국민은행4501이표일(03)1-03	금융채	2026-01-03(토)	3,000	2.940	2.959	AAA		
주택금 융공 사192(사)	특수채	2027-01-03(일)	2,500	2.800	2.886	AAA		
산금25변이0003-0103-1M	금융채	2025-04-03(목)	2,000	3.195	3.257	AAA		
공급망안정화기금2501가-이표-	금융채	2027-07-03(토)	2,000	2.780	-	-		
한국수출입금융2501나-할인-1	금융채	2026-01-03(토)	1,900	2.780	2.959	AAA		
우리금융캐피탈518-2	금융채	2027-06-03(목)	600	3.300	3.272	AA-		
우리금융캐피탈518-1	금융채	2027-02-03(수)	400	3.265	3.234	AA-		
우리금융캐피탈518-3	금융채	2027-07-02(금)	400	3.309	3.281	AA-		
에스씨엘사이언스3CB	회사채	2030-01-03(목)	140	2.000	-	-		

즈체벽 혀문 수매스/수매도 혀화

주체별 현물 순매수/순매	(십억	계약,%,	년)						
은행 순매수 상위 5건		***************************************	000000000000000000000000000000000000000	***************************************	은행 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.68	221	1.4	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.71	-90	4.2
주택금융공사192(사)	27-01-03	2.80	110	2.0	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.66	-60	3.2
국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.63	100	0.9	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.68	-40	3.7
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.94	64	9.4	국고03000-2909(24-7)	29-09-10	2.64	-40	4.7
국고01500-3012(20-9)	30-12-10	2.84	71	5.9	한국전력1403	27-07-12	2.91	-30	2.5
수량 합기	예 및 가중 평균	잔존만기	566	2.9	수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기	-260	3.8

T 7 1 1	1 * 15 5				та.ы	コメンマラご		-200	3.0	
보험/기금 순매수 상위 5건	보험/기금 순매수 상위 5건 보험/기금 순매도 상위 5건									
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.92	56	9.4	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.62	-100	0.9	
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.95	40	8.9	농금채(중앙회)2020-12이5Y-A	25-12-15	2.85	-60	0.9	
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.69	30	29.2	통안03570-2603-03	26-03-03	2.62	-50	1.2	
공급망안정화기금2501가-이표-2.5	27-07-03	2.78	30	2.5	국고02625-2806(18-4)	28-06-10	2.68	-41	3.4	
통안02800-2610-02	26-10-02	2.66	20	1.7	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.68	-40	1.4	
人랴 하7	바마 가즈 펴고	사조마기			人랴 하	게 미 가즈 퍼규	자조마기		1.4	

투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
산금25변이0003-0103-1M	25-04-03	3.20	170	0.2	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.65	-25	1.9
국고03000-2909(24-7)	29-09-10	2.64	115	4.7	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.94	-19	8.9
주택금융공사192(사)	27-01-03	2.80	110	2.0	현대커머설502	25-07-15	3.33	-20	0.5
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.61	79	2.4	우리금융캐피탈496-1	25-06-30	3.29	-20	0.5
한국수출입금융2501나-할인-1	26-01-03	2.85	60	1.0	KB증권43-1	25-07-31	3.24	-20	0.6
시랴 하7	비미 가즈 펴고	자조마기			소랴 하	계 및 가주 평규	자조마기		2.4

외국인 순매수 상위 5건	국인 순매수 상위 5건 외국인 순매도 상위 5건									
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고03000-2909(24-7)	29-09-10	2.65	151	4.7	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.68	-48	29.7	
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.68	70	1.4	국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.48	-29	2.9	
국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.65	40	3.2	국고05750-2603(06-1)	26-03-10	2.69	-25	1.2	
국고04250-2512(22-13)	25-12-10	2.64	40	0.9	국고02375-2712(17-7)	27-12-10	2.60	-20	2.9	
국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.70	14	27.2	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	2.85	-17	5.9	
수량 힙	계 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기			

주체별 선물 순매수												
구분	은행	보험	자산 운용	외국인	증권/선물							
당일	4,212	280	-1,357	-1,706	-1,888							
5일누적	1,180	1,475	1,616	-10,630	5,372							

(십억원) Fund Flow

구문	잔액	10	1W	1M	YID
MMF*	172,507	4,780	-4,619	-25,434	1,449
채권형*	169,628	787	-4,893	-8,285	33,044
주식형*	124,563	-1,180	-472	3,522	20,696
저축성예금**	1,725,583	3,384	10,841	20,120	108,990
CD순발행**	59,879	254	-38	-884	-10,696

^{*}는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

저인 즈이 히사채 거래 내연

	(입작권)
퍼그사이르	n India E

전일 주요 회사채 거래 내역					(십억원)
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
현대해상3(후)	AA0	2031-05-04	3.696	3.7	120
미래에셋증권57-1	AA0	2025-01-24	3.402	3.22	80
현대백화점30-1	AA+	2025-10-13	3.105	3.04	80
KB증권42-1	AA+	2025-06-26	3.369	3.28	60
우리금융지주11-2	AAA	2026-06-02	2.974	2.91	60
LG유플러스110-1	AA0	2025-01-26	3.304	3.26	50
한국서부발전47-1	AAA	2025-12-22	3.023	2.94	50
한국남동발전61-1(연)	AAA	2027-07-30	2.962	2.96	50
연합자산관리32	AA0	2026-01-12	3.157	3.12	50
KT196-1	AAA	2025-01-27	3.237	3.27	42
SK303-1	AA+	2025-06-09	3.322	3.22	40
현대트랜시스44-1	AA-	2025-03-14	3.363	3.38	40
LG유플러스115-1	AA0	2025-11-13	3.096	3.03	40
한국동서발전48-2(녹)	AAA	2027-05-03	2.953	2.93	40
한국서부발전57-1(녹)	AAA	2025-01-17	3.294	3.26	40
한국남동발전60-1	AAA	2026-06-25	2.939	2.9	40
여주에너지서비스1-1	AA0	2025-08-27	3.308	3.23	40
GS건설141	AO	2025-02-28	4.203	4.19	30

^{**}는 T-4일 기준