





DAOL Daily Bond Morning Brief

- 금리방향: 하락(3Y), 상승(10Y)
- ■일드커브: 스티프닝
- ■스프레드(bp): 국5/3 13.8 (-0.9) 국10/3: 29.8 (1.3) 국10/5: 16.0 (2.2) 국30/10: -11.3 (-1.3)

KR Market

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.000	-4.0	-26.0	-30.0
통안1Y	2.625	-1.2	-3.2	-6.8
통안2Y	2.580	-2.4	-6.0	-7.7
국고3Y	2.496	-0.4	-0.5	-2.0
국고5Y	2.635	-1.2	-4.0	5.3
국고10Y	2.794	0.9	5.2	15.4
국고20Y	2.710	-1.4	-5.9	14.3
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.206	-1.0	-3.5	-1.6
회사채 AA- 3Y	3.165	-0.7	-2.0	-1.0
회사채 BBB+ 3Y	6.503	-1.1	-2.4	-3.7
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	107.0	7.0	7.0	
LKTBF 10Y	118.0	10.0	-2.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,521.9	0.03	5.13	4.30
KOSDAQ	723.5	0.54	5.37	9.36
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,460.5	0.38	-0.42	2.35
원/100엔	923.6	0.09	-1.58	-2.31

	IRS	(%)	1D(bp)	CRS(<u>(</u> %)	1D(bp)	Sprea	ad(bp)	1D(bp)
I	1Y	2.668	-2.5	1Y	2.620	-2.5	IRS-통1	4.3	-1.3
	2Y	2.578	-3.0	2Y	2.525	-2	IRS-통2	-0.2	-0.6
	3Y	2.570	-1.8	3Y	2.535	-1	IRS-국3	7.4	-1.4
	5Y	2.610	-1.0	5Y	2.585	-1	IRS-국5	-2.5	0.2
	10Y	2.688	-0.5	10Y	2.595	-1	IRS-국10	-10.7	-1.4

US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.264	-2.3	2.0	11.7
UST5Y	4.461	-0.2	9.0	36.2
UST10Y	4.690	-0.2	12.8	46.2
UST30Y	4.938	0.4	15.8	51.8

KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	2.832	-4.1	-12.7	-17.5	-38.6	-77.8
특수채 AAA 3Y	2.791	-0.5	-2.9	-4.7	-42.3	-84.3
특수채 AAA 5Y	2.905	-1.2	-5.5	3.4	-34.8	-71.9
은행채 AAA 1Y	2.845	-2.7	-11.4	-14.8	-37.6	-76.7
은행채 AAA 3Y	2.827	-0.8	-2.2	-4.1	-41.3	-91
은행채 AAA 5Y	2.957	-1.4	-4.2	5.5	-34.9	-88.6
금융채 AA 1Y	3.078	-2.5	-11.5	-12.8	-24.5	-74.1
금융채 AA 3Y	3.114	-1.0	-3.5	-1.6	-31.1	-91.6
금융채 AA 5Y	3.288	-1.7	-4.5	6.0	-33.2	-88
금융채 AA- 1Y	3.156	-2.5	-11.5	-12.3	-25.6	-82.4
금융채 AA- 3Y	3.206	-1.0	-3.5	-1.6	-31.8	-104.1
금융채 AA- 5Y	3.396	-1.7	-4.5	6.0	-33.4	-97.4
금융채 A+ 1Y	3.849	-1.5	-9.5	-12.3	-32.6	-100.7
금융채 A+ 3Y	4.073	-0.5	-3.0	-2.4	-39.5	-107.9
금융채 A+ 5Y	4.516	-1.2	-4.0	6.0	-34.4	-82.7
금융채 A 1Y	4.566	-1.5	-9.5	-12.3	-33.1	-98.7
금융채 A 3Y	4.866	-0.5	-3.0	-2.4	-39.5	-104.4
금융채 A 5Y	5.200	-1.2	-4.0	6.0	-34.4	-81.7
금융채 A- 1Y	5.138	-1.5	-9.5	-12.3	-32.6	-97.7
금융채 A- 3Y	5.506	-0.5	-3.0	-2.4	-38.5	-100.4
금융채 A- 5Y	5.841	-1.2	-4.0	6.0	-34.4	-80.9
회사채 AAA 1Y	3.006	-1.6	-6.6	-11.6	-24.5	-75.8
회사채 AAA 3Y	3.002	-1.2	-2.3	-1.1	-36.5	-79.3
회사채 AAA 5Y	3.060	-1.3	-4.6	5.1	-34.4	-77.8
회사채 AA+ 1Y	3.040	-1.7	-7.4	-10.6	-23.8	-79.4
회사채 AA+ 3Y	3.090	-0.8	-2.1	-1.0	-34.7	-81.6
회사채 AA+ 5Y	3.159	-1.4	-4.4	5.3	-32.5	-85.5
회사채 AA 1Y	3.068	-1.7	-7.3	-10.4	-23.2	-80.7
회사채 AA 3Y	3.117	-0.8	-2.1	-1.1	-35.0	-82.9
회사채 AA 5Y	3.219	-1.5	-4.4	5.4	-32.6	-85.8
회사채 AA- 1Y	3.097	-1.7	-7.4	-10.4	-23.3	-81.8
회사채 AA- 3Y	3.165	-0.7	-2.0	-1.0	-35.0	-84.6
회사채 AA- 5Y	3.324	-1.4	-4.4	5.6	-32.3	-86.4

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목 명	만기	발행금액	발행금리
1월 6일	월	국고채	2Y	14,000	2.670
1월 6일	월	통안채	91d	12,000	2.830
1월 7일	화	국고채	30y	40,000	2.705
1월 8일	수	통안채	1y	8,000	2.640
	1		l		

저이 ㅈㅇ 채귀 바해 겨규 /바해 그애 사이 10개 조모\

신일 주요 세권 일행 결과 (일행 는	에 성위 10	게 꽁목)				
종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
통안02640-2601-01	통안채	2026-01-09(금)	8,000	2.640	2.637	통안
산금25신이0200-0109-2	금융채	2027-01-09(토)	7,000	2.730	2.746	AAA
산금25신이0103-0109-1	금융채	2026-04-09(목)	3,000	2.780	2.786	AAA
한국수자원공사282	특수채	2027-07-09(금)	2,000	2.802	2.853	AAA
농금채(중앙회)2025-1이3Y-A	특수채	2028-01-09(일)	2,000	2.800	2.796	AAA
현대카드922-2	금융채	2029-01-09(화)	1,500	3.103	3.082	AA+
부산은행2025-01이1A-09	회사채	2026-01-09(금)	1,000	2.880	3.022	AAA
신한캐피탈507-5	금융채	2028-01-07(금)	1,000	3.157	3.213	AA-
JB 우리캐피탈529-4	금융채	2027-07-09(금)	1,000	3.224	3.216	AA-
하나카드274-1	금융채	2027-07-08(목)	1,000	3.090	-	AA

주체별 현물 순매수/순매도 현황

(신	М	뀖	야	9/	녀)

그 씨는 근본 분기 17 분기	0						(- 11 -1 , 10 ,	
은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
산금25신이0200-0109-2	27-01-09	2.73	400	2.0	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.63	-280	3.2
농금채(중앙회)2025-1이3Y-A	28-01-09	2.80	80	3.0	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	2.81	-80	5.9
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.89	69	9.4	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	2.75	-70	0.4
산금25신이0103-0109-1	26-04-09	2.78	70	1.2	통안DC025-0114-0910	25-01-14	3.11	-70	0.0
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.67	50	4.2	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.65	-40	3.7
수량 합2	ᅨ 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기	-540	
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건				
종목			수량	잔존만기	종목		수익률	수량	잔존만기
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.92	140	8.9	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.89	-157	9.4
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.71	106	29.7	국고02125-2706(17-3)	27-06-10	2.62	-70	2.4
한국수자원공사282	27-07-09	2.80	80	2.5	국고01250-2603(21-1)	26-03-10	2.58	-60	1.2
현대카드922-2	29-01-09	3.10	50	4.0	국고03000-2909(24-7)	29-09-10	2.64	-36	4.7
국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.70	39	28.2	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.57	-34	2.4
수량 합2	1 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.67	205	4.2	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.70	-251	29.2
산금25신이0200-0109-2	27-01-09	2.73	90	2.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.61	-53	1.9
하나카드274-2	27-07-09	3.09	90	2.5	국고02000-3106(21-5)	31-06-10	2.83	-41	6.4
비씨카드177-1	27-07-09	3.10	70	2.5	통안03570-2603-03	26-03-03	2.58	-30	1.1
BNK캐피탈370-2	27-02-10	3.21	70	2.1	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.89	-27	9.4
수량 합2	ᅨ 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.61	250	0.9	산금24신할0007-0829-1	25-03-28	3.13	-150	0.2
통안02640-2601-01	26-01-09	2.64	70	1.0	산금24신할0006-0906-1	25-03-06	3.09	-100	0.2
국고03625-5309(23-7)	53-09-10	2.71	20	28.7	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.93	-87	8.9
국고03125-2709(22-8)	27-09-10	2.65	20	2.7	통안03950-2509-03	25-09-03	2.67	-80	0.6
국고02375-2703(22-1)	27-03-10	2.67	20	2.2	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	3.28	-50	28.2
수량 합2	ᅨ 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		

주체별 선물 순매수

(계	약	수)

구분	은행	보험	자산 운용	외국인	증권/선물
당일	8,245	387	-1,925	502	-7,276
5일누적	15,581	1,524	-5,890	13,182	-24,196

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	202,343	954	35,383	8,789	31,285
채권형*	173,221	358	4,074	-5,472	36,638
주식형*	128,218	481	2,444	6,094	24,350
저축성예금**	1,725,583			6,214	108,990
CD순발행**	59,879			-2,291	-10,696

^{*}는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

저이 ㅈㅇ 하나네 거래 내여

전일 주요 회사채 거래 내역					(십억원)
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
부산은행2025-01이1A-09	AAA	2026-01-09	2.880	2.880	160
GS칼텍스141-2	AA+	2026-03-03	2.931	2.880	80
대상146-1	AA-	2025-01-17	3.219	3.240	80
가양가양제오차1	-	2029-12-21	-	3.950	60
롯데리츠7-1	AA-	2025-10-02	3.333	3.410	60
엘에스전선24-2	A+	2026-01-30	3.142	3.080	60
미래에셋증권65-1	AA0	2025-05-09	3.313	3.200	50
한국중부발전65-1	AAA	2032-01-17	3.091	3.120	50
한국중부발전31-3	AAA	2025-04-29	3.202	3.130	50
메리츠금융지주14-1	AA0	2025-07-25	3.427	3.290	50
키 움증 권6	AA-	2025-02-07	3.399	3.270	40
현대백화점28	AA+	2025-05-27	3.184	3.200	40
현대백화점29-2	AA+	2026-04-27	2.912	2.900	40
한국중부발전72-2(녹)	AAA	2028-07-06	2.947	2.930	40
한국중부발전37-1	AAA	2027-03-29	2.899	2.900	40
한국수력원자력74-1	AAA	2028-06-08	2.936	2.920	40
한국남동발전62-2	AAA	2029-08-21	2.978	2.960	40
그레이프제일차1-1	-	2028-06-20	-	4.600	40

^{**}는 T-4일 기준