



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

24 Sep. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 4.0 (0.7) 국10/3: 16.5 (1.0) 국10/5: 12.5 (0.3) 국30/10: -11.5 (0.5)	

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.530	0.0	0.0	2.0
통안1Y	2.869	0.2	-0.2	-16.6
통안2Y	2.920	2.0	1.0	-7.2
국고3Y	2.860	2.3	4.0	-5.7
국고5Y	2.903	3.3	7.3	-4.9
국고10Y	3.025	3.3	9.8	2.0
국고20Y	2.940	2.8	12.0	-7.2

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.473	1.3	1.5	-7.5
회사채 AA- 3Y	3.444	2.2	4.0	0.1
회사채 BBB+ 3Y	6.890	2.3	4.0	-8.1

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.23	-9	-13	
LKTBF 10Y	117.09	-26	-91	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2602.01	0.33	1.03	-3.69
KOSDAQ	755.12	0.91	2.99	-2.35

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1335.9	0.51	0.48	-0.22
원/100엔	929.79	0.32	-1.61	2.05

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.130	-0.250	1Y	2.765	-0.5	IRS-통1	26.1	-0.5
2Y	2.895	1.750	2Y	2.635	2.5	IRS-통2	-2.5	-0.2
3Y	2.828	2.500	3Y	2.64	4.5	IRS-국3	-3.2	0.2
5Y	2.798	2.750	5Y	2.68	4.5	IRS-국5	-10.6	-0.6
10Y	2.833	2.750	10Y	2.645	4.5	IRS-국10	-19.3	-0.6

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	3.589	-0.8	3.6	-32.8
UST5Y	3.507	0.6	10.3	-14.3
UST10Y	3.751	0.8	13.2	-5
UST30Y	4.093	0.7	16.3	0

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.220	-0.1	0.2	-6.5	-29.7	-74.8
특수채 AAA 3Y	3.130	2.2	3.6	-2.6	-25.5	-111.2
특수채 AAA 5Y	3.168	3.3	7.3	-0.2	-21.1	-111.8
은행채 AAA 1Y	3.239	0.1	0.0	-10.3	-27.3	-80.8
은행채 AAA 3Y	3.159	2.2	3.8	-4.8	-29.4	-120.8
은행채 AAA 5Y	3.224	3.4	7.5	-0.4	-24.7	-125.1
금융채 AA 1Y	3.343	-0.5	-1.0	-11.0	-29.2	-86.6
금융채 AA 3Y	3.364	1.8	2.0	-7.0	-23.9	-133.9
금융채 AA 5Y	3.545	3.0	6.5	-1.2	-24.8	-135.5
금융채 AA- 1Y	3.435	-0.5	-1.0	-9.0	-24.8	-95.7
금융채 AA- 3Y	3.473	1.3	1.5	-7.5	-23.5	-149.2
금융채 AA- 5Y	3.658	2.5	6.0	-2.2	-27.2	-144.9
금융채 A+ 1Y	4.203	-0.5	-1.0	-19.0	-42.6	-99.3
금융채 A+ 3Y	4.422	1.8	2.0	-12.2	-36.8	-133
금융채 A+ 5Y	4.788	3.0	6.5	-2.7	-28.9	-125.5
금융채 A 1Y	4.925	-0.5	-1.0	-19.0	-42.6	-96.3
금융채 A 3Y	5.215	1.8	2.0	-12.2	-36.8	-129
금융채 A 5Y	5.472	3.0	6.5	-2.7	-28.9	-124
금융채 A- 1Y	5.492	-0.5	-1.0	-19.0	-43.1	-95.8
금융채 A- 3Y	5.845	1.8	2.0	-12.2	-36.3	-126
금융채 A- 5Y	6.113	3.0	6.5	-2.7	-28.9	-123.2
회사채 AAA 1Y	3.255	0.2	0.6	-7.8	-32.8	-86.5
회사채 AAA 3Y	3.296	2.5	4.4	0.7	-23.5	-108.3
회사채 AAA 5Y	3.327	3.5	7.3	1.4	-20.1	-122.8
회사채 AA+ 1Y	3.275	0.0	0.3	-8.2	-33.4	-93.1
회사채 AA+ 3Y	3.360	2.1	4.0	0.0	-22.0	-117.1
회사채 AA+ 5Y	3.398	3.0	7.0	0.4	-22.2	-132.1
회사채 AA 1Y	3.297	0.0	0.2	-8.0	-33.3	-95.2
회사채 AA 3Y	3.396	2.2	3.9	-0.1	-22.5	-117.1
회사채 AA 5Y	3.463	3.0	7.0	0.5	-22.4	-131.9
회사채 A- 1Y	3.326	0.0	0.2	-8.1	-33.2	-96
회사채 A- 3Y	3.444	2.2	4.0	0.1	-22.1	-118.6
회사채 A- 5Y	3.567	3.0	7.0	0.5	-23.2	-132.4

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
9월 23일	월	국고채	10Y	16000	3.000
9월 23일	월	통안채	91d	8000	3.030

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
우리은행28-09-이표1.5-갑-23	금융채	2026-03-23(월)	5000	3.200	3.205	AAA
한국전력1423	특수채	2027-09-23(목)	4000	3.190	3.108	AAA
한국전력1422	특수채	2026-09-23(수)	3000	3.189	3.150	AAA
국민은행4409이표일(03)1.5-2	금융채	2026-03-23(월)	3000	3.200	3.205	AAA
신한은행28-09-이-1-B(변동)	금융채	2025-09-23(화)	2500	3.590	3.238	AAA
토지주택채권499	특수채	2027-03-23(화)	1000	3.108	3.138	AAA
농업금융채권(은행)2024-09-이	금융채	2025-12-23(화)	1000	3.220	3.221	AAA
한양87	회사채	2025-09-23(화)	210	8.500	-	-
키움캐피탈196	금융채	2026-03-23(월)	200	5.15	5.579	A-
쌍용씨앤이328	회사채	2026-09-23(수)	160	4.900	-	-

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억 계약 %, 년)

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
통안DC024-1224-0910	24-12-24	3.05	510	0.3	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.02	-179	9.7		
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.94	200	1.7	기업은행(신)2306012A-20	25-06-20	3.27	-50	0.7		
통안03200-2607-02	26-07-02	2.92	100	1.8	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.94	-40	4.0		
국민은행4409이표일(03)1.5-23	26-03-23	3.20	100	1.5	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.94	-40	4.5		
토지주택채권499	27-03-23	3.11	90	2.5	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.94	-40	3.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				1,000	1.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-349	6.5
보험/기업 순매수 상위 5건					보험/기업 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
한국전력1423	27-09-23	3.19	220	3.0	하나은행 조관부(신)43-030102-24(화)	30-03-24	3.60	-40	5.5		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.02	171	9.7	국고05500-2912(09-5)	29-12-10	3.01	-20	5.2		
한국전력1422	26-09-23	3.19	170	2.0	통안03200-2607-02	26-07-02	2.92	-20	1.8		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.03	56	9.2	국고03275-2712(17-7)	27-12-10	2.91	-20	3.2		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.89	53	30.0	하나은행 조관부(신)43-080102-13(화)	30-08-13	3.65	-20	5.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				670	7.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-120	4.9
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
신한은행28-09-이-1-B(변동)	25-09-23	3.59	170	1.0	우리은행27-09-이표1.25-갑-08	24-12-08	3.46	-65	0.2		
한국전력1311	24-11-10	3.63	80	0.1	국고05500-2803(08-2)	28-03-10	2.96	-30	3.5		
통안03200-2607-02	26-07-02	2.92	70	1.8	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.99	-28	19.0		
한국전력1422	26-09-23	3.19	60	2.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.94	-30	1.7		
농업금융채권(은행)2024-09-이1.25V-F	25-12-23	3.22	50	1.2	우리은행28-07-협인01-갑-03	25-07-03	3.33	-30	0.8		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				430	1.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-183	4.0
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
통안DC024-1224-0910	24-12-24	3.05	265	0.3	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.91	-24	29.5		
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.93	162	1.7	국고01875-5103(21-2)	51-03-10	2.86	-10	26.5		
국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.89	111	2.0	국고02000-3106(21-5)	31-06-10	2.98	-4.2	6.7		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.89	44	30.0	오토모피제철십자유1-28	24-10-18	0.00	0.0	0.1		
국고01750-2609(21-7)	26-09-10	2.91	40	2.0	국고03125-2709(22-8)	27-09-10	0.00	0.0	3.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				622	3.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-38	26.6

주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	4646	550	84	160	-5794
5일누적	3680	67	-453	5128	-9429

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	191486.3	655.1	3342.4	-8466.5	20428.8
채권형*	172249.2	134.7	-127.6	2130.1	35666
주식형*	116939.3	1042.8	1234.1	-1200	13071.6
저축성예금**	1684951.2	1178.3	7623.7	26694.4	68358.4
CD순발행**	61535.5	-1707.8	-2354	-5028.5	-9039.9

*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

**는 T-4일 기준

전일 주요 회사채 거래 내역

(십억원)

종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
하나금융지주62-1	AAA	2027-05-07	3.22	3.25	50
신한투자증권2402-2	AA0	2027-02-19	3.39	3.35	50
기아284-2(녹)	AA+	2026-03-03	3.285	3.31	30
S-Oil61-1	AA0	2029-09-03	3.288	3.31	30
신한금융지주144-1	AAA	2024-11-11	3.381	3.41	30
한양87	-	2025-09-23	-	8.5	21
크레딧에너지제철차1	-	2025-04-29	-	3.56	20
더퍼스트사이닝제철차3-2	-	2028-12-20	-	3.84	20
디에이치블록2	-	2028-11-03	-	3.8	20
하나금융지주61-2	AAA	2027-01-15	3.212	3.24	20
한국동서발전38-3(녹)	AAA	2031-06-10	3.256	3.29	20
쌍용씨앤이328	-	2026-09-23	-	4.9	16
한양86	-	2025-09-23	-	8.5	13
신한금융증권부(상)16(신중-영구	AA-	2099-12-31	3.985	4	12
씨제이제일제당28-1	AA0	2025-01-24	3.363	3.33	10
뉴테라제철차1-1	-	2025-04-18	-	4.21	10
더퍼스트사이닝제철차4	-	2028-12-20	-	4.16	10
케이카캐피탈29	BBB0	2026-01-23	-	5.74	10