



· 금리방향: 상승(3Y), 하락(10Y) ■일드커브: 플래트닝

■스프레드(bp): 국5/3 9.3 (-1.0) 국10/3: 21.5 (-2.5) 국10/5: 12.2 (-1.5) 국30/10: -12.7 (2.5)

# **DAOL Daily Bond Morning Brief**

#### 주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	<del>종목</del> 명	만기	발행금액	발행금리
2월 3일	월	국고채	2y	10,000	2.635
2월 3일	월	통안채	91d	3,800	2.850
2월 4일	화	국고채	30y	29,000	2.735
2월 4일	화	국고채	30y	29,000	2.730
2월 5일	수	통안채	2y	20,000	2.640

KR Market				
KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	2.990	-2.0	-4.0	-6.0
통안1Y	2.627	-0.4	-2.8	-1.0
통안2Y	2.660	1.5	4.0	3.5
국고3Y	2.588	1.6	2.8	7.7
국고5Y	2.680	0.5	-2.0	1.8
국고10Y	2.803	-0.9	-5.8	0.9
국고20Y	2.736	-0.3	-6.4	-0.2
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.176	1.0	0.7	-5.5
회사채 AA- 3Y	3.173	1.2	1.7	-1.6
회사채 BBB+ 3Y	6.526	1.4	1.1	-0.3
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.8	-4.0	-5.0	
LKTBF 10Y	118.8	15.0	58.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,536.8	1.10	0.00	1.79
KOSDAQ	740.3	1.28	1.59	3.07
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,447.7	0.24	1.15	-0.40
원/100엔	948.5	0.71	2.87	2.74

IRS	(%)	1D(bp)	CRS(	<u>(</u> %)	1D(bp)	Sprea	ıd(bp)	1D(bp)
1Y	2.708	1.5	1Y	2.680	0.5	IRS-통1	8.1	1.9
2Y	2.610	2.0	2Y	2.550	0	IRS-통2	-5.0	0.5
3Y	2.588	1.2	3Y	2.570	-0.5	IRS-국3	-0.1	-0.4
5Y	2.593	1.0	5Y	2.590	-0.5	IRS-국5	-8.8	0.5
10Y	2.643	0.5	10Y	2.555	-0.5	IRS-국10	-16.1	1.4

#### US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM		1W	1M
UST2Y	4.216	2.5	0.5	-7.9
UST5Y	4.275	2.6	-5.3	-19.2
UST10Y	4.438	1.6	-8.1	-24.9
UST30Y	4.640	0.2	-12.3	-27.5

#### KR Credit Market Bond Yield(%, bp)

Boria field(%, bp)	rielu	יטו	1 00	TIVI	SIVI	
특수채 AAA 1Y	2.788	-0.4	-2.5	-9.8	-39.9	-81.5
특수채 AAA 3Y	2.839	1.6	2.8	2.7	-29.7	-73.9
특수채 AAA 5Y	2.918	0.0	-2.9	-1.8	-26.6	-66.3
은행채 AAA 1Y	2.838	-0.7	-2.4	-5.4	-39.5	-79.7
은행채 AAA 3Y	2.881	1.5	2.6	3.3	-29.1	-82.8
은행채 AAA 5Y	2.976	0.3	-2.4	-1.0	-26.5	-84.6
금융채 AA 1Y	2.963	-1.5	-5.5	-16.0	-37.4	-76.4
금융채 AA 3Y	3.086	1.0	0.7	-5.3	-29.5	-86.6
금융채 AA 5Y	3.293	0.0	-3.0	-2.7	-26.7	-87.4
금융채 AA- 1Y	3.029	-1.5	-5.5	-17.2	-38.7	-85.9
금융채 AA- 3Y	3.176	1.0	0.7	-5.5	-30.1	-100.6
금융채 AA- 5Y	3.401	0.0	-3.0	-2.7	-26.7	-96.3
금융채 A+ 1Y	3.724	-1.5	-5.5	-15.0	-41.1	-109.5
금융채 A+ 3Y	4.065	1.0	0.7	-2.8	-32.2	-107.8
금융채 A+ 5Y	4.526	0.0	-3.0	-1.7	-27.2	-82.9
금융채 A 1Y	4.441	-1.5	-5.5	-15.0	-41.1	-107.5
금융채 A 3Y	4.858	1.0	0.7	-2.8	-32.2	-104.3
금융채 A 5Y	5.210	0.0	-3.0	-1.7	-27.2	-81.9
금융채 A- 1Y	5.013	-1.5	-5.5	-15.0	-41.1	-106.5
금융채 A- 3Y	5.498	1.0	0.7	-2.8	-31.7	-100.8
금융채 A- 5Y	5.851	0.0	-3.0	-1.7	-27.2	-81.1
회사채 AAA 1Y	2.930	-1.2	-4.8	-9.8	-30.5	-78.4
회사채 AAA 3Y	3.008	1.2	1.7	-2.3	-28.9	-76.5
회사채 AAA 5Y	3.065	0.5	-1.9	-2.6	-27.9	-76
회사채 AA+ 1Y	2.967	-1.6	-4.9	-9.7	-29.2	-83.5
회사채 AA+ 3Y	3.099	1.3	1.7	-1.5	-27.3	-80.1
회사채 AA+ 5Y	3.154	0.7	-1.6	-3.6	-27.0	-84.8
회사채 AA 1Y	2.996	-1.6	-4.9	-9.5	-28.7	-84.7
회사채 AA 3Y	3.126	1.3	1.8	-1.5	-27.6	-81.6
회사채 AA 5Y	3.216	0.7	-1.7	-3.4	-26.9	-85
회사채 AA- 1Y	3.027	-1.6	-4.9	-9.4	-28.5	-85.6
회사채 AA- 3Y	3.173	1.2	1.7	-1.6	-27.7	-83.4
회사채 AA- 5Y	3.320	0.6	-1.7	-3.5	-26.8	-85.8

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10	기개 조모

선일 수요 재권 말행 결과 (말행 근	·백 상위 10	)개 <del>송목</del> )				
<del>종</del> 목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신 <del>용등</del> 급
재정2025-0010-0063	국채	2025-04-10(목)	20,000	2.980	2.829	-
한국전력1461	특수채	2028-02-06(일)	3,000	-	2.823	AAA
한국전력1460	특수채	2027-02-06(토)	2,000	-	2.819	AAA
한국전력1462	특수채	2030-02-06(수)	2,000	-	2.918	AAA
토지주택채권512	특수채	2030-02-06(수)	2,000	2.868	2.918	AAA
자산관리공사제111회(사)	특수채	2030-02-06(수)	1,000	-	2.918	AAA
국민은행4502이(01)1변-06	금융채	2026-02-06(금)	1,000	3.090	2.845	AAA
도로공사923	특수채	2045-02-06(월)	600	-	2.915	AAA
현대카드926-2	금융채	2028-02-04(금)	500	3.012	3.016	AA+
현대카드926-3	금융채	2030-02-06(수)	300	3.119	3.100	AA+

## 주체별 현물 순매수/순매도 현황 은행 순매수 상위 5건

		(십억기	1약,%,	년)
은행 순매도 상위 5건				
마기 종목	마기	스이류	스랴	자조미

근용 프레포 8페그만					도양 프레포 8페그만				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
기업은행(신)2502할1A-06	26-02-06	2.81	260	1.0	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.66	-120	29.6
국고02625-5503(25-2)	55-03-10	2.64	175	30.1	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.65	-48	29.1
토지주택채권512	30-02-06	2.87	160	5.0	산금23신미0400-0119-2	27-01-19	2.75	-50	2.0
자산관리공사제111회(사)	30-02-06	2.84	100	5.0	통안03340-2601-02	26-01-02	2.63	-40	0.9
한국전력1462	30-02-06	2.92	90	5.0	국민주택1종24-07	29-07-31	2.78	-40	4.5
수량 합기	예 및 가중 평균	잔존만기			수량 합기	계 및 가중 평균	잔존만기		
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03000-3412(24-13)	34-12-10	2.78	128	9.8	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.81	-159	9.3
도로공사924	35-02-06	2.97	68	10.0	신한은행28-12-미-2-A	26-12-09	2.82	-40	1.8
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.66	66	29.6	국고02375-2712(17-7)	27-12-10	2.66	-40	2.8
한국전력1461	28-02-06	2.86	30	3.0	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.76	-30	18.6
도로공사923	45-02-06	2.85	30	20.0	산금23신이0400-0105-1	27-01-05	2.75	-30	1.9
수량 합기	계 및 가중 평균	잔존만기			수량 합기	네 및 가중 평균	잔존만기		
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
재정2025-0010-0063	25-04-10	2.98	279	0.2	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.62	-61	1.8
기업은행(단)2410할304A-28	25-08-28	2.92	130	0.6	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.59	-42	2.3
기업은행(단)2409할336A-30	25-09-01	2.92	80	0.6	통안03340-2601-02	26-01-02	2.62	-40	0.9
기업은행(신)2306이2A-20	25-06-20	2.97	60	0.4	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.71	-31	4.1
신한은행28-03-이-1-C	25-03-12	3.03	50		신한캐피탈491-2	25-06-03	3.10	-30	0.3
수량 합기	예 및 가중 평균	잔존만기	599		수량 합	네 및 가중 평균	잔존만기		
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고02625-5503(25-2)	55-03-10	2.62	148	30.1	기업은행(단)2410할304A-28	25-08-28	2.94	-150	0.6
통안03340-2601-02	26-01-02	2.61	100	0.9	기업은행(신)2409할1A-06	25-09-06	2.92	-150	0.6
국고03750-3312(13-8)	33-12-10	2.83	40	8.8	기업은행(단)2409할334A-27	25-08-27	2.94	-100	0.6
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.82	31	8.8	기업은행(단)2409할336A-30	25-09-01	2.95	-100	0.6
국고02750-4412(14-7)	44-12-10	2.74	31	19.9	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.63	-70	29.6
수량 합기	계 및 가중 평균	· 잔존만기	349		수량 합기	계 및 가중 평균	잔존만기		

### 주체별

별 선물	물 순매수				(계약수)
분	은행	보험	자산 <del>운용</del>	외국인	증권/선물
	1 4 5 4	F40	1 215	1 500	1 540

구분	은행	보험	자산 <del>운용</del>	외국인	증권/선물
당일	-1,656	549	1,215	-1,589	1,540
5일누적	-4,576	-123	1,167	37,505	-34,195
		•			

#### (십억원) Fund Flow

구문	잔액	טו	1W	1M	YID
MMF*	209,909	5,637			38,851
채권형*	179,630	355			43,047
주식형*	131,417	659			27,549
저축성예금**	1,714,124			440	97,532
CD순발행**	60,271			-714	-10,304

<sup>\*</sup>는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

<sup>\*\*</sup>는 T-4일 기준

|--|

전일 주요 회사채 거래 내역				(십억원)	
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
SK303-1	AA+	2025-06-09	3.140	3.090	150
롯데웰푸드72-1	AAO	2028-02-04	3.006	3.040	130
하이트진로홀딩스175-2	A0	2027-09-10	3.590	3.490	120
현대제철140-2	AA0	2030-01-22	3.063	3.120	120
메리츠금융지주13-2	AA0	2026-12-07	3.196	3.080	90
하이트진로홀딩스175-1	AO	2026-09-11	3.423	3.370	80
한국서부발전62-1	AAA	2026-06-04	2.866	2.900	80
한국남동발전59-1(녹)	AAA	2026-05-29	2.866	2.900	80
멀티솔루션브라운2	-	2025-06-19	-	4.480	80
더블케이가산제일차1-2	AA-	2029-09-13	3.857	4.000	80
현대제철140-1	AAO	2028-01-22	2.969	3.000	60
메리츠증권2412-1	AA-	2027-12-17	3.215	3.110	60
기아284-2(녹)	AAA	2026-03-03	2.948	2.870	60
신한금융지주159-1	AAA	2026-08-28	2.838	2.840	60
호텔롯데71-1	AA-	2025-06-09	3.466	3.460	60
KT&G2-1	AAA	2025-09-12	3.010	2.980	50
삼성물산115-1	AA+	2026-09-10	2.974	2.950	50
유안타증권89-1	AA-	2026-02-13	3.193	3.100	50