



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

11 Oct. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 상승(3Y), 상승(10Y)
- 일드커브: 플랫닝
- 스프레드(bp): 국5/3 4.5 (-2.0) 국10/3: 12.5 (-2.0)
국10/5: 8.0 (0.0) 국30/10: -18.2 (-2.4)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.500	-1.0	-2.0	-1.0
통안1Y	2.875	0.5	4.5	-3.0
통안2Y	2.955	1.7	14.5	-0.2
국고3Y	2.962	2.7	18.0	8.7
국고5Y	3.009	0.8	16.7	10.1
국고10Y	3.087	0.7	15.2	8.0
국고20Y	2.934	-1.3	9.8	1.0
KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.539	1.4	15.2	0.1
회사채 AA- 3Y	3.536	2.9	15.8	8.9
회사채 BBB+ 3Y	6.982	2.6	17.2	6.3
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.79	-8	-48	
LKTBF 10Y	116.38	-7	-96	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2599.16	0.19	1.46	3.00
KOSDAQ	775.48	-0.35	1.75	9.81
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1350.2	0.04	2.34	0.48
원/100엔	909.16	-0.15	-0.89	-3.08

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	3.195	-0.250	1Y	2.87	-1	IRS-통1	32.0	-0.7
2Y	3.048	3.250	2Y	2.745	2	IRS-통2	9.2	1.5
3Y	2.998	4.000	3Y	2.77	2	IRS-국3	3.5	1.3
5Y	2.963	2.500	5Y	2.8	2.5	IRS-국5	-4.7	1.7
10Y	2.985	1.750	10Y	2.83	2	IRS-국10	-10.2	1.1

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	3.96	-6.3	25.4	36.3
UST5Y	3.89	-3.1	25.8	46.3
UST10Y	4.06	-1.1	21.6	41.9
UST30Y	4.36	1.7	18.1	39.6

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.233	0.5	4.9	0.0	-12.0	-75.6
특수채 AAA 3Y	3.227	2.6	17.1	8.7	-3.0	-111.7
특수채 AAA 5Y	3.268	0.8	16.2	10.6	0.3	-114.4
은행채 AAA 1Y	3.239	0.4	4.8	-3.0	-9.5	-83
은행채 AAA 3Y	3.255	2.4	17.1	8.2	-8.7	-120.6
은행채 AAA 5Y	3.320	0.9	16.0	9.9	-3.7	-127.2
금융채 AA 1Y	3.343	-0.3	4.2	-6.0	-16.5	-87.6
금융채 AA 3Y	3.440	1.9	15.7	1.6	-5.5	-134.3
금융채 AA 5Y	3.635	-0.2	15.8	7.0	-3.5	-137.8
금융채 AA- 1Y	3.432	-0.3	4.2	-5.8	-13.1	-97.5
금융채 AA- 3Y	3.539	1.4	15.2	0.1	-4.8	-151.6
금융채 AA- 5Y	3.745	-0.5	15.5	6.2	-5.3	-147.5
금융채 A+ 1Y	4.195	-0.3	4.2	-6.3	-30.8	-101.6
금융채 A+ 3Y	4.483	1.4	15.2	0.1	-18.6	-135.9
금융채 A+ 5Y	4.875	-0.5	15.5	6.7	-8.3	-128.1
금융채 A 1Y	4.917	-0.3	4.2	-6.3	-30.8	-98.6
금융채 A 3Y	5.276	1.4	15.2	0.1	-18.6	-131.9
금융채 A 5Y	5.559	-0.5	15.5	6.7	-8.3	-126.6
금융채 A- 1Y	5.484	-0.3	4.2	-6.3	-30.8	-98.1
금융채 A- 3Y	5.906	1.4	15.2	0.1	-18.1	-128.9
금융채 A- 5Y	6.200	-0.5	15.5	6.7	-8.3	-125.8
회사채 AAA 1Y	3.271	0.5	5.0	0.5	-17.0	-88.8
회사채 AAA 3Y	3.386	1.9	15.7	9.8	-3.7	-110.1
회사채 AAA 5Y	3.420	0.5	15.7	10.5	-1.0	-124.7
회사채 AA+ 1Y	3.294	0.8	5.2	0.0	-16.7	-94
회사채 AA+ 3Y	3.457	2.8	16.0	9.4	-0.6	-117.7
회사채 AA+ 5Y	3.499	0.6	15.5	9.7	0.0	-133.2
회사채 AA 1Y	3.316	0.8	5.1	0.1	-17.1	-96.2
회사채 AA 3Y	3.488	2.9	15.8	8.7	-1.4	-118.4
회사채 AA 5Y	3.560	0.6	15.3	9.4	-0.4	-133.4
회사채 AA- 1Y	3.346	0.9	5.2	0.2	-16.7	-96.8
회사채 AA- 3Y	3.536	2.9	15.8	8.9	-0.9	-119.9
회사채 AA- 5Y	3.663	0.6	15.2	9.2	-0.6	-134.1

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
10월 7일	월	국고채	30Y	20000	2.915
10월 7일	월	통안채	91D	8000	3.050

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
산금24신할01001010-1(사)	금융채	2025-10-10(금)	3500	3.120	3.209	AAA
산금24신이0200-1010-2	금융채	2026-10-10(토)	5300	3.160	3.167	AAA
기업은행(번)241001A-10	금융채	2025-10-10(금)	1600	3.560	3.209	AAA
기업은행(신)241001A-10	금융채	2026-04-10(금)	4500	3.200	3.210	AAA
기업은행(신)2410할1A-10	금융채	2025-10-10(금)	5200	3.120	3.209	AAA
주택금융공사174(사)	특수채	2027-04-10(토)	1200	3.174	3.233	AAA
토지주택채권502	특수채	2054-10-10(토)	1000	5.450	3.156	AAA
한국수출입금융2410다-이표-182	금융채	2025-04-10(목)	3700	3.370	3.412	AAA
한국수출입금융(번)2410라-이표	금융채	2025-10-10(금)	2100	3.560	3.235	AAA
우리은행28-10-이(번)01-갑-1	금융채	2025-10-10(금)	4000	3.590	3.235	AAA

주체별 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		
산금24이0200-1010-2	26-10-10	3.16	470	2.0	국고3250-2903(24-1)	29-03-10	3.06	-225	4.4		
통안02890-2509-01	25-09-09	2.90	220	0.9	통안03570-2603-03	26-03-03	2.95	-40	1.4		
기업은행(신)2410할1A-10	25-10-10	3.21	150	1.0	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	2.93	-40	0.2		
한국수출입금융2410다-이표-182	25-04-10	3.37	120	0.5	국고01375-2912(19-8)	29-12-10	3.09	-35	5.2		
주택금융공사174(사)	27-04-10	3.17	110	2.5	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.09	-30	9.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				1,070	1.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-370	4.1
보험/기업 순매수 상위 5건					보험/기업 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.92	157	29.9	국고3750-3312(13-8)	33-12-10	3.10	-57	9.2		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.10	50	9.2	주택금융공사2019-25(1-4)(사)	24-12-06	3.22	-50	0.2		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.09	37	9.7	통안03365-2604-02	26-04-02	3.02	-20	1.5		
국고재원금01220-5409(24-8)	54-09-10	2.87	80	29.9	국고01500-5003(20-2)	50-03-10	2.88	-20	25.4		
국고채이자01610-3803	38-03-10	3.10	50	13.4	산금(정금)14이01500-0109-2	29-01-09	3.18	-10	4.3		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				374	22.9	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-157	7.3
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
우리은행28-10-이(번)01-갑-10	25-10-10	3.60	270	1.0	롯데카드508	25-06-13	3.54	-20	0.7		
한국수출입금융(번)2410라-이표-1	25-10-10	3.56	180	1.0	국고03500-7209(22-12)	72-09-10	2.82	-10	48.0		
기업은행(번)241001A-10	25-10-10	3.56	130	1.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.01	-11	1.7		
우리은행28-01-할인9M-갑-19	24-10-19	3.52	80	0.0	국고03250-2603(24-3)	26-03-10	3.01	-11	1.4		
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.96	59	2.7	인천국제공항공사190	25-10-17	3.27	-10	1.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				719	1.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-62	8.7
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
기업은행(신)241001A-10(사)	26-04-10	3.20	300	1.5	국고01875-5103(21-2)	51-03-10	2.86	-21	26.4		
산금24신할01001010-1(사)	25-10-10	3.21	300	1.0	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	2.95	-10	0.7		
통안02800-2610-02	26-10-02	2.95	160	2.0	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.11	-4.0	7.2		
국고03250-4209(22-11)	42-09-10	3.00	130	17.9	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.08	-1.2	6.2		
국고01875-2906(19-4)	29-06-10	2.98	70	4.7	국고01875-2606(16-3)	26-06-10	3.03	-0.7	1.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				960	3.9	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-37	16.6

주체별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	4750	-37	-1729	-12892	9761
5일누적	11120	-442	6796	-75799	53416

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	191818.7	-60.4	15661.5	-2417	20761.2
채권형*	171623	494.2	1319	-35	35039.8
주식형*	120598.1	-552.8	1598.2	6276	16730.4
저축성예금**	1683012.2	-866.1	4230.1	18864.3	66419.4
CD순발행**	62413.5	268.5	559.8	-1961.5	-8161.9

*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
지메스에너지17-1	AAO	2027-10-04	3.262	3.33	120
롯데쇼핑99-1	AA-	2026-04-16	3.503	3.5	80
우리금융증권부(상)18(신중)	AA-	2099-12-31	-	4	59
하나증권5-3	AAO	2025-09-01	3.488	3.45	50
롯데건설148-1	A+	2026-01-26	5.278	5.37	40
GS건설144-1	AO	2025-12-03	4.757	4.84	40
하이오션커미트체일차3	-	2031-06-10	-	4.18	40
뉴테라제팔차1-1	-	2025-04-18	-	4.03	40
신한투자증권2402-1	AAO	2026-02-19	3.348	3.35	40
신한금융지주167-2	AAA	2029-07-22	3.316	3.31	40
케이씨씨76-1	AA-	2026-01-15	3.443	3.44	30
한국투자금융지주29-2	AA-	2025-09-22	3.499	3.45	30
한국서부발전23-2	AAA	2024-10-23	3.464	3.62	30
메리츠증권2304-1	AA-	2026-04-14	3.578	3.51	30
엘에스일렉트릭187-1	AA-	2027-10-04	3.259	3.32	30
에이치디현대오일뱅크130-3	AA-	2031-10-04	3.471	3.46	20
미래에셋증권64-1	AAO	2025-02-14	3.511	3.55	20
JB금융지주22	AA+	2025-10-08	3.334	3.41	20