



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

01 Nov. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 하락(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 플랫닝
- 스프레드(bp): 국5/3 5.5 (-1.2) 국10/3: 16.5 (-0.2)
국10/5: 11.0 (1.0) 국30/10: -17.0 (-1.8)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.430	0.0	3.0	-10.0
통안1Y	2.841	0.0	0.0	-0.4
통안2Y	2.950	0.0	7.0	10.0
국고3Y	2.930	-0.5	4.0	12.5
국고5Y	2.985	-1.5	3.2	10.0
국고10Y	3.095	-0.7	2.5	10.3
국고20Y	3.012	-1.5	1.7	10.1

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.525	0.0	6.0	11.5
회사채 AA- 3Y	3.504	-0.7	4.5	10.8
회사채 BBB+ 3Y	6.919	-0.5	2.0	8.6

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.85	1	-15	
LKTBF 10Y	116.23	6	-37	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2556.15	-1.45	-0.96	-1.43
KOSDAQ	743.06	0.66	1.15	-2.73

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1379.9	-0.18	-0.02	5.51
원/100엔	903.54	0.25	-0.72	-2.24

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	3.120	0.000	1Y	2.86	2.5	IRS-통1	27.9	0.0
2Y	3.003	-0.250	2Y	2.745	-0.5	IRS-통2	5.2	-0.2
3Y	2.973	0.250	3Y	2.725	-1.5	IRS-국3	4.3	0.7
5Y	2.963	-0.250	5Y	2.705	-1.5	IRS-국5	-2.3	1.3
10Y	2.998	-0.500	10Y	2.765	-2	IRS-국10	-9.8	0.2

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.2	-0.4	9.3	56.8
UST5Y	4.2	-0.8	12.5	65.0
UST10Y	4.3	-1.4	7.3	55.4
UST30Y	4.5	-2.8	0.0	40.3

KR Credit Market

Bond Yield(% bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.182	0.3	0.8	-1.5	-7.6	-91.8
특수채 AAA 3Y	3.182	-0.3	4.4	10.4	4.2	-137.7
특수채 AAA 5Y	3.229	-1.1	3.3	8.0	9.9	-137.7
은행채 AAA 1Y	3.231	0.5	3.1	2.6	-5.0	-91.5
은행채 AAA 3Y	3.222	-0.5	4.1	11.8	2.3	-137.6
은행채 AAA 5Y	3.294	-1.2	3.7	9.1	8.9	-143.9
금융채 AA 1Y	3.334	0.8	2.8	2.8	-8.9	-100
금융채 AA 3Y	3.429	0.0	6.0	12.3	5.5	-159.9
금융채 AA 5Y	3.610	-1.5	3.3	9.5	10.1	-159.8
금융채 AA- 1Y	3.413	0.8	2.8	1.8	-6.2	-109.9
금융채 AA- 3Y	3.525	0.0	6.0	11.5	5.7	-176
금융채 AA- 5Y	3.718	-1.5	3.3	9.0	8.6	-169.7
금융채 A+ 1Y	4.145	0.0	0.5	-1.3	-27.3	-116.6
금융채 A+ 3Y	4.438	0.0	3.7	8.4	-9.1	-161.7
금융채 A+ 5Y	4.848	-1.5	3.3	9.0	4.3	-149.3
금융채 A 1Y	4.862	0.0	0.5	-1.8	-27.8	-114.1
금융채 A 3Y	5.231	0.0	3.7	8.4	-9.1	-157.7
금융채 A 5Y	5.532	-1.5	3.3	9.0	4.3	-147.8
금융채 A- 1Y	5.434	0.0	0.5	-1.3	-27.3	-113.1
금융채 A- 3Y	5.866	0.0	4.2	8.9	-8.6	-154.2
금융채 A- 5Y	6.173	-1.5	3.3	9.0	4.3	-147
회사채 AAA 1Y	3.229	0.6	0.9	-0.2	-9.7	-102.4
회사채 AAA 3Y	3.342	-1.0	2.8	9.1	6.6	-130.4
회사채 AAA 5Y	3.401	-1.6	3.2	9.5	12.5	-140.7
회사채 AA+ 1Y	3.255	0.3	2.0	-0.1	-9.3	-107.3
회사채 AA+ 3Y	3.425	-0.7	4.5	10.9	10.7	-137.2
회사채 AA+ 5Y	3.476	-1.5	3.2	9.1	13.0	-150.4
회사채 AA 1Y	3.279	0.5	2.2	0.1	-9.0	-109.3
회사채 AA 3Y	3.456	-0.7	4.5	10.8	10.3	-138.1
회사채 AA 5Y	3.537	-1.5	3.2	8.7	12.7	-150.8
회사채 AA- 1Y	3.308	0.5	2.1	0.1	-9.0	-110
회사채 AA- 3Y	3.504	-0.7	4.5	10.8	10.8	-139.8
회사채 AA- 5Y	3.639	-1.6	3.2	8.5	12.5	-151.5

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
10월 28일	월	국고채	5y	12000	2.995
10월 28일	월	통안채	91d	8000	3.010
10월 29일	화	국고채	20y	4000	3.025

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
국민주택1종24-10	국채	2029-10-31(수)	13636	1.300	3.195	AAA
서울도시철도24-10	지방채	2031-10-31(금)	548	2.500	3.422	AAA
강원지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	175	2.500	3.249	-
대전지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	53	2.500	3.249	AA+
인천지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	95	2.500	3.249	AA+
광주지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	67	2.500	3.249	AA+
부산지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	34	2.500	3.249	AA+
부산도시철도24-10	지방채	2029-10-31(수)	56	2.500	3.249	AA+
대구지역개발24-10	지방채	2029-10-31(수)	29	2.500	3.249	AA+
대구도시철도24-10	지방채	2029-10-31(수)	22	2.500	3.249	AA+

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		
통안02800-2610-02	26-10-02	2.98	230	1.9	통안04020-2510-02	25-10-02	2.84	-70	0.9		
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.05	170	4.4	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.13	-50	6.1		
국고03000-2909(24-7)	29-09-10	3.01	110	4.9	한국수력원자력59-1	25-11-23	3.21	-30	1.1		
기업은행(단)2410월273A-31	25-07-31	3.27	110	0.7	중소벤처기업진흥채권719(사)	26-03-11	3.20	-30	1.4		
국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.86	99	0.9	산금23신이0300-1017-1	26-10-17	3.19	-20	2.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				719	2.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-200	2.4
보통/기업 순매수 상위 5건					보통/기업 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.12	93	9.6	국고03625-2509(23-8)	25-09-10	2.87	-50	0.9		
도로공사910	34-10-31	3.22	60	10.0	통안03670-2507-02	25-07-02	2.85	-20	0.7		
통안03200-2607-02	26-07-02	3.03	50	1.7	국고01500-4009(20-7)	40-09-10	3.09	-20	15.9		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.14	40	9.1	국고01500-5003(20-2)	50-03-10	2.93	-20	25.4		
국고02875-4409(24-10)	44-09-10	3.04	30	19.9	국고03500-7209(22-12)	72-09-10	2.88	-10	47.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				273	9.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-120	11.3
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
기업은행(단)2410월1A-31	25-10-31	3.40	140	1.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.99	-30	1.6		
국민은행4410월(03)2-31	26-10-31	3.22	90	2.0	통안03200-2607-02	26-07-02	3.01	-30	1.7		
기업은행(단)2410월2A-31	26-10-31	3.17	80	2.0	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.94	-22	2.6		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.11	51	9.6	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.96	-20	29.4		
기업은행(단)2410월273A-31	25-07-31	3.27	40	0.7	호텔롯데75-2	27-05-07	3.76	-20	2.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				401	2.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-122	6.5
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.11	88	9.6	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	2.99	-72	0.6		
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.04	88	4.4	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.13	-59	6.1		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.96	72	29.4	국고02000-3106(21-5)	31-06-10	3.13	-30.0	6.6		
국고03750-3312(13-8)	33-12-10	3.14	66	9.1	국고01875-2906(19-4)	29-06-10	3.09	-14.7	4.6		
국고03375-3206(22-5)	32-06-10	3.13	63	7.6	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.12	-10.1	9.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				377	11.7	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-186	4.4

주체별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	2925	6	1439	-2160	-2191
5일누적	11123	207	-484	6380	-16756

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	197774.8	1376.7	-2173.1	21617.6	26717.3
채권형*	175741.7	209.6	3095.1	5437.7	39158.5
주식형*	121208.2	-201.2	-147.8	2208.3	17340.5
저축성예금**	1694030.3	-663.9	443.3	11018.1	77437.5
CD순발행**	61144.1	-95.5	364.1	-1269.4	-9431.3

*는 T-2일 기준, **는 설정액 및 ETF 제외 기준

**는 T-4일 기준

전일 주요 회사채 거래 내역

(십억원)

종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
한국수력원자력59-1	AAA	2025-11-23	3.165	3.21	150
호텔롯데75-2	AA-	2027-05-07	3.728	3.76	150
한국남부발전76-1	AAA	2027-10-01	3.242	3.31	60
신세계138-1	AAO	2025-01-27	3.388	3.55	60
KT194-2	AAA	2026-01-27	3.15	3.03	50
하나금융지주49-1	AAA	2025-10-28	3.179	3.13	43
신한금융지주167-2	AAA	2029-07-22	3.3	3.32	40
에스케이이엔에스14-3	AAO	2027-01-30	3.439	3.46	40
신한금융지주165-1	AAA	2027-04-29	3.237	3.26	40
캐슈넛로드1-1	-	2028-06-20	-	3.97	40
실버라인제일차2	-	2028-06-27	-	3.55	40
엔에이치투자61-2	AA+	2025-09-28	3.316	3.34	30
현대비앤지스틸205	AO	2025-02-28	3.604	3.69	30
KB금융지주49-2	AAA	2026-10-31	-	3.3	30
연합자산관리37-1	AAO	2027-10-29	3.402	3.4	30
DGB금융지주19	AAA	2027-03-30	3.421	3.42	30
신한금융지주156-2	AAA	2028-04-21	3.269	3.3	30
SKC145-1	A+	2026-10-29	3.996	3.98	22