



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

31 Dec. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 하락(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 스티프닝
- 스프레드(bp): 국5/3 16.8 (1.5) 국10/3: 27.3 (2.3)
국10/5: 10.5 (0.8) 국30/10: -7.3 (-0.6)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.440	0.0	5.0	15.0
통안1Y	2.694	0.0	1.0	0.2
통안2Y	2.752	-0.5	1.8	6.7
국고3Y	2.595	-3.0	-1.4	-1.6
국고5Y	2.765	-2.0	0.8	11.3
국고10Y	2.871	-1.4	2.6	11.1
국고20Y	2.875	0.4	10.7	16.7
KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.336	-3.0	-1.5	9.4
회사채 AA- 3Y	3.279	-2.7	-0.7	7.7
회사채 BBB+ 3Y	6.622	-2.8	-1.0	5.1
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	자평
KTBF 3Y	106.7	2.0	3.0	
LKTBF 10Y	116.9	13.0	-12.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,399.5	-0.22	-1.74	-2.30
KOSDAQ	678.2	1.83	-0.15	0.00
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,472.5	0.34	1.41	5.58
원/100엔	932.5	0.11	0.72	0.31

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	2.863	0.2	1Y	2.740	-3.5	IRS-통1	16.9	0.2
2Y	2.728	-1.5	2Y	2.615	-6.5	IRS-통2	-2.4	-1.0
3Y	2.705	-1.5	3Y	2.620	-6	IRS-국3	11.0	1.5
5Y	2.720	-1.5	5Y	2.660	-3.5	IRS-국5	-4.5	0.5
10Y	2.780	-0.5	10Y	2.670	-5	IRS-국10	-9.1	0.9

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.256	-7.6	-8.8	9.1
UST5Y	4.373	-9.1	-6.2	31.4
UST10Y	4.546	-8.1	-4.3	36.8
UST30Y	4.759	-6.0	-1.7	39.1

KR Credit Market

Bond Yield(% bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.029	0.0	0.3	1.1	-16.8	-66.3
특수채 AAA 3Y	2.910	-3.0	-2.9	2.7	-16.8	-60.7
특수채 AAA 5Y	3.047	-1.8	-0.6	11.7	-10.2	-43.8
은행채 AAA 1Y	3.036	-0.4	-0.1	-0.2	-16.9	-67.5
은행채 AAA 3Y	2.943	-3.0	-3.0	3.9	-16.1	-68.3
은행채 AAA 5Y	3.089	-1.8	0.5	12.3	-11.4	-61.7
금융채 AA 1Y	3.263	-0.5	1.5	5.7	-4.3	-60.1
금융채 AA 3Y	3.244	-3.0	-1.5	9.4	-6.2	-65.6
금융채 AA 5Y	3.423	-2.0	0.8	13.5	-9.2	-60
금융채 AA- 1Y	3.341	-0.5	1.5	6.2	-5.4	-68.4
금융채 AA- 3Y	3.336	-3.0	-1.5	9.4	-7.4	-77.4
금융채 AA- 5Y	3.531	-2.0	0.8	13.5	-9.7	-69.9
금융채 A+ 1Y	4.014	-0.5	1.5	4.7	-14.4	-87.2
금융채 A+ 3Y	4.198	-3.0	-1.5	8.6	-15.6	-82.7
금융채 A+ 5Y	4.646	-2.0	0.8	13.0	-11.2	-55.7
금융채 A 1Y	4.731	-0.5	1.5	4.7	-14.9	-85.2
금융채 A 3Y	4.991	-3.0	-1.5	8.6	-15.6	-79.2
금융채 A 5Y	5.330	-2.0	0.8	13.0	-11.2	-54.7
금융채 A- 1Y	5.303	-0.5	1.5	4.7	-14.4	-84.2
금융채 A- 3Y	5.631	-3.0	-1.5	8.6	-14.6	-75.2
금융채 A- 5Y	5.971	-2.0	0.8	13.0	-11.2	-53.9
회사채 AAA 1Y	3.133	-0.2	0.4	0.9	-9.8	-69
회사채 AAA 3Y	3.117	-2.5	-0.3	7.0	-13.4	-56.2
회사채 AAA 5Y	3.199	-2.0	0.6	13.0	-10.7	-51.1
회사채 AA+ 1Y	3.174	-0.3	0.9	2.9	-8.2	-71.7
회사채 AA+ 3Y	3.205	-2.6	-0.5	7.9	-11.1	-57.8
회사채 AA+ 5Y	3.298	-2.0	0.7	13.8	-8.7	-58.7
회사채 AA 1Y	3.201	-0.4	0.9	3.2	-7.7	-73.1
회사채 AA 3Y	3.231	-2.7	-0.5	7.7	-11.7	-59.2
회사채 AA 5Y	3.358	-2.0	0.6	13.9	-9.2	-58.9
회사채 AA- 1Y	3.231	-0.3	1.0	3.2	-7.6	-74.1
회사채 AA- 3Y	3.279	-2.7	-0.7	7.7	-11.7	-61
회사채 AA- 5Y	3.463	-2.0	0.7	14.1	-9.1	-59.6

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
현대해상6(후)	회사채	2034-12-30(토)	9,000	4.550	-	AA0
하나에이아이씨제일차13	회사채	2025-12-30(화)	1,200	4.300	-	-
엔에이치농협캐피탈240-4	금융채	2027-06-30(수)	1,100	3.385	3.406	AA-
래피드호그제이십칠차5	회사채	2026-05-29(금)	1,056	3.700	-	-
엔에이치농협캐피탈240-5	금융채	2027-09-30(목)	800	3.371	3.387	AA-
엔에이치농협캐피탈240-7	금융채	2027-12-30(목)	700	3.358	3.369	AA-
엔에이치농협캐피탈240-2	금융채	2027-03-30(화)	600	3.352	3.371	AA-
엔에이치농협캐피탈240-6	금융채	2027-12-29(수)	500	3.358	3.369	AA-
글로벌리미제일차1	회사채	2025-03-30(일)	400	4.670	-	-
엔에이치농협캐피탈240-1	금융채	2027-02-26(금)	400	3.341	3.359	AA-

주제별 현물 손매수/손매도 현황

(십억계약, %, 년)

은행 손매수 상위 5건					은행 손매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.07	100	9.4	산골24신할01000924-1(사)	25-09-24	3.15	-30	0.7
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.84	71	4.2	통안DC025-0127-0910	25-01-27	3.06	-20	0.1
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.71	54	2.4	메리츠증권2309-1	25-09-19	3.52	-10	0.7
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.93	36	18.7	통안02800-2610-02	26-10-02	2.75	-10	1.8
국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.81	40	3.2	대구도시개발공사2023-04	25-06-08	3.51	-10	0.4
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					301	7.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
보험/기금 손매수 상위 5건					보험/기금 손매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
현대해상6(후)	34-12-30	4.55	910	10.0	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.07	-52	9.4
글로벌리미제일차1	25-03-30	4.67	40	0.2	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.89	-14	29.2
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.10	29	9.0	한국전력1369	25-03-10	3.28	-10	0.2
산골24신할010200-0423-2	26-04-23	2.93	20	1.3	SK지오센트릭18-2(녹)	26-04-27	3.24	-10	1.3
비씨카드174	25-11-10	3.29	20	0.9	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.00	-10	6.9
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					1,019	9.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
투자 손매수 상위 5건					투자 손매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
엔에이치농협캐피탈240-4	27-06-30	3.39	100	2.5	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.94	-60	18.7
현대해상6(후)	34-12-30	4.55	90	10.0	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.79	-21	3.2
엔에이치농협캐피탈240-5	27-09-30	3.37	80	2.8	한국전력1150	25-03-07	3.35	-20	0.2
엔에이치농협캐피탈240-11	26-04-11	2.93	50	1.3	국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.60	-13	2.9
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.76	43	1.9	신세계141-1	27-01-18	3.13	-10	2.1
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					363	4.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
외국인 손매수 상위 5건					외국인 손매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.07	167	9.4	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	2.80	-115	0.4
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.58	136	2.9	국고03125-2709(22-8)	27-09-10	2.77	-65	2.7
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.09	120	9.0	국고01375-2912(19-8)	29-12-10	2.90	-62	4.9
국고03000-3412(24-13)	34-12-10	2.86	96	10.0	통안03280-2504-02	25-04-02	2.92	-50	0.3
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.83	90	29.7	국고04250-2512(22-13)	25-12-10	2.70	-45	0.9
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					609	11.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		

주제별 선물 손매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	2,099	790	1,582	-4,419	-471
5일누적	-2,174	1,398	1,528	-10,475	9,675

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	170,448	-4,266	-12,910	-28,247	-609
채권형*	169,026	-4,770	-6,038	-8,648	32,443
주식형*	126,074	199	3,236	5,177	22,206
저축성예금**	1,723,000	8,257	8,193	14,519	106,407
CD순발행**	60,183	266	-768	542	-10,392

*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
현대해상6(후)	AA0	2034-12-30	-	4.55	1140
래피드호그제이십칠차5	-	2026-05-29	-	3.7	211
글로벌리미제일차1	-	2025-03-30	-	4.67	120
SK에너지50-1	AA0	2025-03-07	3.432	3.41	50
SK에너지47-2	AA0	2025-04-24	3.439	3.42	50
현대제철137-1	AA0	2025-01-17	3.378	3.55	50
CJ대한통운100-2	AA-	2026-02-13	3.104	3.11	50
메리츠증권2309-1	AA-	2025-09-19	3.477	3.51	40
KT&G4-2	AAA	2027-10-08	3.088	3.14	40
더현대제일차3-1	-	2026-08-21	-	3.73	40
코스모스그린1	A+	2026-04-30	-	4.8	35
신세계141-1	AA0	2027-01-18	3.119	3.13	30
SK지오센트릭18-2(녹)	AA-	2026-04-27	3.251	3.24	30
굿메이트제사자1	-	2027-02-24	-	1.75	25
한국투자증권22	AA0	2025-02-28	3.574	4.11	20
SK렌터카58-2	AO	2027-11-08	3.783	4.11	15
엔캠14CB	BB+	2029-11-29	12.271	0	12
우리금융증권보(상)18(신중)	AA-	2099-12-31	3.956	3.99	8