



# DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

25 Sep. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(보합), 10Y(상승)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 5.0 (1.0) 국10/3: 17.2 (0.7) 국10/5: 12.2 (-0.3) 국30/10: -11.7 (-0.2)	

## KR Market

KR Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.530	0.0	0.0	2.0
통안1Y		2.865	-0.4	-0.6	-17.0
통안2Y		2.915	-0.5	0.5	-7.7
국고3Y		2.860	0.0	4.0	-5.7
국고5Y		2.910	0.7	8.0	-4.2
국고10Y		3.032	0.7	10.5	2.7
국고20Y		2.948	0.8	12.8	-6.4
KR Credit(%bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y		3.468	-0.5	1.0	-8.0
회사채 AA- 3Y		3.439	-0.5	3.5	-0.4
회사채 BBB+ 3Y		6.890	0.0	4.0	-8.1
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		106.23	0	-13	
LKTBF 10Y		117.00	-9	-100	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2631.68	1.14	2.18	-2.59
KOSDAQ		767.35	1.62	4.66	-0.76
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1334.9	-0.07	0.41	-0.29
원/100엔		922.16	-0.82	-2.42	1.22

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.120	-1.000	1Y	2.75	-1.5	IRS-통1	25.5	-0.6
2Y	2.898	0.250	2Y	2.635	0	IRS-통2	-1.8	0.7
3Y	2.830	0.250	3Y	2.64	0	IRS-국3	-3.0	0.2
5Y	2.813	1.500	5Y	2.68	0	IRS-국5	-9.8	0.8
10Y	2.848	1.500	10Y	2.67	2.5	IRS-국10	-18.5	0.8

## US Bond Market

US Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		3.54	-4.9	-6.9	-37.7
UST5Y		3.469	-3.8	2.4	-18.1
UST10Y		3.73	-2.1	8.3	-7.1
UST30Y		4.086	-0.7	12.6	-0.7

## KR Credit Market

Bond Yield(%bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.217	-0.3	-0.1	-6.8	-29.5	-75.6
특수채 AAA 3Y		3.130	0.0	3.6	-2.6	-26.4	-113.7
특수채 AAA 5Y		3.173	0.5	7.8	0.3	-21.7	-113.9
은행채 AAA 1Y		3.235	-0.4	-0.4	-10.7	-27.5	-81.2
은행채 AAA 3Y		3.159	0.0	3.8	-4.8	-30.2	-122.7
은행채 AAA 5Y		3.229	0.5	8.0	0.1	-25.4	-126.6
금융채 AA 1Y		3.328	-1.5	-2.5	-12.5	-30.5	-87.6
금융채 AA 3Y		3.364	0.0	2.0	-7.0	-24.9	-135.4
금융채 AA 5Y		3.545	0.0	6.5	-1.2	-25.7	-137.3
금융채 AA- 1Y		3.420	-1.5	-2.5	-10.5	-26.3	-96.7
금융채 AA- 3Y		3.468	-0.5	1.0	-8.0	-25.0	-151.2
금융채 AA- 5Y		3.658	0.0	6.0	-2.2	-28.0	-146.7
금융채 A+ 1Y		4.188	-1.5	-2.5	-20.5	-44.1	-100.3
금융채 A+ 3Y		4.417	-0.5	1.5	-12.7	-38.3	-135
금융채 A+ 5Y		4.788	0.0	6.5	-2.7	-29.7	-127.3
금융채 A 1Y		4.910	-1.5	-2.5	-20.5	-44.1	-97.3
금융채 A 3Y		5.210	-0.5	1.5	-12.7	-38.3	-131
금융채 A 5Y		5.472	0.0	6.5	-2.7	-29.7	-125.8
금융채 A- 1Y		5.477	-1.5	-2.5	-20.5	-44.6	-96.8
금융채 A- 3Y		5.840	-0.5	1.5	-12.7	-37.8	-128
금융채 A- 5Y		6.113	0.0	6.5	-2.7	-29.7	-125
회사채 AAA 1Y		3.254	-0.1	0.5	-7.9	-32.8	-87.5
회사채 AAA 3Y		3.289	-0.7	3.7	0.0	-25.0	-110.8
회사채 AAA 5Y		3.329	0.2	7.5	1.6	-21.0	-124.4
회사채 AA+ 1Y		3.276	0.1	0.4	-8.1	-32.8	-93.3
회사채 AA+ 3Y		3.355	-0.5	3.5	-0.5	-23.0	-119.5
회사채 AA+ 5Y		3.402	0.4	7.4	0.8	-22.9	-133.5
회사채 AA 1Y		3.298	0.1	0.3	-7.9	-32.7	-95.5
회사채 AA 3Y		3.391	-0.5	3.4	-0.6	-23.5	-119.6
회사채 AA 5Y		3.466	0.3	7.3	0.8	-23.1	-133.4
회사채 AA- 1Y		3.327	0.1	0.3	-8.0	-32.6	-96.2
회사채 AA- 3Y		3.439	-0.5	3.5	-0.4	-22.9	-121
회사채 AA- 5Y		3.570	0.3	7.3	0.8	-23.3	-133.9

## 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
통안DC024-1224-0910	통안채	2024-12-24(화)	8000	3.030	3.179	통안
우리은행28-09-이표02-갑-24	금융채	2026-09-24(목)	6000	3.180	3.179	AAA
한화생명보험신증자본증권 6	회사채	2054-09-24(목)	6000	4.800	5.463	AA-
산금24신할01000924-1(사)	금융채	2025-09-24(수)	3000	3.110	3.217	AAA
하나은행47-09이4갑-24	금융채	2028-09-24(일)	2200	3.190	-	AAA
하나츠금융지주18-1	회사채	2025-09-24(수)	1990	3.517	-	AA
중소벤처기업진흥공단871(사)	특수채	2027-03-24(수)	1800	3.097	3.152	AAA
한국철도공사256	특수채	2027-09-24(금)	1800	3.124	3.130	AAA
예비기업특별계정채권2024-4(사)	특수채	2026-09-24(목)	1700	3.13	3.102	AAA
광주은행2024-09이(번)1갑-24	금융채	2025-09-24(수)	1500	3.630	3.301	AA+

## 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		
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.92	250	1.7	통안04000-2609-03	26-09-03	2.93	-80	1.9		
중소벤처기업진흥채권871(사)	27-03-24	3.10	180	2.5	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.93	-70	3.5		
예비기업특별계정채권2024-4(사)	26-09-24	3.13	150	2.0	국고03250-2603(24-3)	26-03-10	2.94	-33	1.5		
국고01750-2609(21-7)	26-09-10	2.89	150	2.0	국고03125-2709(22-8)	27-09-10	2.91	-30	3.0		
산금24(할01000924-1)	25-09-24	3.20	150	1.0	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.04	-20	8.2		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				880	1.8	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-233	3.0
보통/금융 순매수 상위 5건					보통/금융 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
우리은행28-09-이표02-갑-24	26-09-24	3.18	250	2.0	국고04750-3012(10-7)	30-12-10	3.04	-90	6.2		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.92	58	30.0	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.01	-76	6.2		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.05	49	9.2	국고채원금03350-2912(09-5)	29-12-10	3.03	-80	5.2		
국민은행4307계보일(03)1.5-20	25-01-20	3.51	40	0.3	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.00	-30	19.0		
국고03250-2603(24-3)	26-03-10	2.94	30	1.5	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.96	-30	4.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				427	6.4	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-306	7.0
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
광주은행2024-09이(번)1갑-24	25-09-24	3.63	100	1.0	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.85	-69	2.7		
신한은행28-09-이-1.3-A	26-01-24	3.22	70	1.3	국고01750-2609(21-7)	26-09-10	2.89	-68	2.0		
신한은행28-02-이-8M-A	24-10-02	3.59	40	0.0	통안04120-2410-02	24-10-02	2.76	-50	0.0		
기업은행(번)231001A-18	24-10-18	3.54	40	0.1	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.88	-38	2.2		
우리금융캐피탈511-2	27-03-24	3.41	40	2.5	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.92	-30	1.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				290	1.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-255	1.8
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.92	280	1.7	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	2.99	-20	0.5		
국고01750-2609(21-7)	26-09-10	2.88	100	2.0	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.00	-16	19.0		
국고05500-2912(09-5)	29-12-10	2.99	80	5.2	국고01875-5103(21-2)	51-03-10	2.67	-20.0	26.5		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.93	78	29.5	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	2.91	-0.5	0.2		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.90	85	30.0	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.85	-0.4	1.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				623	9.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				-57	14.8

## 주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	3220	760	-1322	5468	-7208
5일누적	9780	1254	-1722	14557	-22704

## Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	191017.6	#N/A	#N/A	#N/A	19960.1
채권형*	172309	#N/A	#N/A	#N/A	35725.8
주식형*	117479.7	#N/A	#N/A	#N/A	13612
저축성예금**	1671315.2	-13636	-12505.6	9284.2	54722.4
CD순발행**	61317.2	-218.3	-806.3	-4599.1	-9258.2

\*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
한화생명보험신증자본증권 6	AA-	2054-09-24	-	4.79	224
롯데케미칼58-1	AAO	2025-02-28	3.647	3.7	120
현대건설303-1	AA-	2025-02-17	3.556	3.56	61
한화솔루션290-1	AA-	2026-01-16	3.445	3.45	60
DGB금융지주19	AAA	2027-03-30	3.38	3.34	60
미르원제이차1	-	2027-07-09	-	2.73	56
신한금융지주140-2	AAA	2026-04-22	3.161	3.18	50
SBS13-2	AAO	2025-09-01	3.322	3.37	50
신한투자증권2403-2	AAO	2027-03-18	3.408	3.37	50
삼성증권17-1	AA+	2024-10-22	3.576	3.53	50
대신증권21-1	AA-	2024-10-07	3.684	3.76	50
현대제철139-2	AAO	2029-09-12	3.301	3.29	40
롯데케미칼55-3	AAO	2029-04-27	3.771	3.81	40
한국투자금융지주36-1	AA-	2025-09-19	3.482	3.46	40
KB금융지주31-3	AAA	2028-02-28	3.312	3.26	40
SK에너지46-4(녹)	AAO	2029-09-26	3.474	3.42	40
GS파워7-2	AAO	2029-05-10	3.279	3.32	40
LG유플러스104-3	AAO	2029-01-28	3.28	3.27	40