



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

13 Dec. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 상승(3Y), 상승(10Y)
- 일드커브: 스티프닝
- 스프레드(bp): 국5/3 8.3 (0.3) 국10/3: 15.3 (0.1)
국10/5: 7.0 (-0.2) 국30/10: -17.0 (-2.3)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.310	-2.0	3.0	-13.0
통안1Y	2.689	-0.4	-1.3	-14.1
통안2Y	2.670	0.1	-0.2	-27.6
국고3Y	2.547	1.2	-5.3	-35.3
국고5Y	2.630	1.5	1.5	-31.0
국고10Y	2.700	1.3	-3.5	-31.5
국고20Y	2.598	-1.2	-5.6	-36.6
KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.270	2.0	4.1	-22.0
회사채 AA- 3Y	3.211	1.2	1.6	-25.4
회사채 BBB+ 3Y	6.570	1.2	1.2	-29.2
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.7	-6.0	-4.0	
LKTBF 10Y	119.1	-22.0	-47.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,482.1	1.62	1.65	-0.02
KOSDAQ	683.4	1.10	1.85	-3.82
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,431.9	-0.02	1.19	2.02
원/100엔	937.9	-0.61	-0.80	2.27

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	2.805	-0.2	1Y	2.595	0.5	IRS-통1	11.6	0.2
2Y	2.618	0.8	2Y	2.440	1	IRS-통2	-5.2	0.7
3Y	2.565	1.0	3Y	2.410	2	IRS-국3	1.8	-0.2
5Y	2.565	1.2	5Y	2.375	2.5	IRS-국5	-6.5	-0.2
10Y	2.615	1.5	10Y	2.400	2.5	IRS-국10	-8.5	0.2

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.195	3.8	4.7	-14.9
UST5Y	4.184	4.8	10.7	-13.0
UST10Y	4.329	5.4	14.9	-10.1
UST30Y	4.547	6.3	21.1	-2.2

KR Credit Market

Bond Yield(% bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.003	-0.3	-0.5	-19.1	-21.5	-86.6
특수채 AAA 3Y	2.868	1.1	0.1	-28.2	-22.6	-95.4
특수채 AAA 5Y	2.925	2.3	3.2	-26.0	-17.0	-89.2
은행채 AAA 1Y	2.996	-0.1	-0.1	-24.2	-24.3	-89.7
은행채 AAA 3Y	2.901	1.4	0.8	-28.7	-22.0	-103.7
은행채 AAA 5Y	2.953	1.6	2.4	-29.0	-19.6	-109.4
금융채 AA 1Y	3.218	0.5	1.2	-12.2	-13.5	-79.6
금융채 AA 3Y	3.178	2.0	4.1	-21.6	-16.6	-100.9
금융채 AA 5Y	3.276	1.5	2.5	-28.7	-20.4	-108.7
금융채 AA- 1Y	3.291	0.5	1.2	-12.8	-15.4	-87.9
금융채 AA- 3Y	3.270	2.0	4.1	-22.0	-18.8	-113.2
금융채 AA- 5Y	3.384	1.5	2.5	-28.7	-21.4	-118.1
금융채 A+ 1Y	3.979	0.5	0.7	-15.6	-23.4	-105.2
금융채 A+ 3Y	4.145	2.0	4.1	-25.2	-25.7	-116.7
금융채 A+ 5Y	4.504	1.5	2.5	-29.7	-21.9	-103.4
금융채 A 1Y	4.696	0.5	0.7	-15.6	-23.9	-103.2
금융채 A 3Y	4.938	2.0	4.1	-25.2	-25.7	-113.2
금융채 A 5Y	5.188	1.5	2.5	-29.7	-21.9	-102.4
금융채 A- 1Y	5.268	0.5	0.7	-15.6	-23.4	-102.2
금융채 A- 3Y	5.578	2.0	4.1	-24.7	-24.7	-109.2
금융채 A- 5Y	5.829	1.5	2.5	-29.7	-21.9	-101.6
회사채 AAA 1Y	3.121	-0.3	-1.2	-12.0	-12.8	-85.5
회사채 AAA 3Y	3.045	1.3	1.1	-27.1	-20.7	-92.5
회사채 AAA 5Y	3.059	1.5	2.4	-29.0	-19.5	-99.1
회사채 AA+ 1Y	3.146	0.0	-0.6	-11.9	-12.6	-89.1
회사채 AA+ 3Y	3.136	1.2	1.6	-25.1	-18.4	-93.9
회사채 AA+ 5Y	3.156	1.3	2.5	-27.6	-17.2	-106.5
회사채 AA 1Y	3.172	0.0	-0.4	-11.7	-12.3	-90.5
회사채 AA 3Y	3.163	1.2	1.6	-25.4	-19.4	-95.3
회사채 AA 5Y	3.215	1.3	2.4	-27.7	-17.8	-106.9
회사채 AA- 1Y	3.201	0.0	-0.4	-11.7	-12.3	-91.4
회사채 AA- 3Y	3.211	1.2	1.6	-25.4	-19.3	-97
회사채 AA- 5Y	3.318	1.4	2.5	-27.6	-17.9	-107.7

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
12월 9일	월	국고채	3Y	2,000	2.530
12월 9일	월	통안채	91d	5,000	2.960
12월 10일	화	국고채	2Y	1,000	2.595
12월 11일	수	통안채	1Y	4,000	2.710

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
한화생명보험7(후)	회사채	2034-12-12(화)	8,000	4.450	-	AA
산금24신이0200-1212-3	금융채	2026-12-12(토)	6,200	2.860	2.856	AAA
기업은행(단)2412할182A-12	금융채	2025-06-12(목)	3,300	3.200	3.240	AAA
산금24신할0100-1212-2	금융채	2025-12-12(금)	2,900	2.880	2.957	AAA
뉴스테이허브제3호1	회사채	2027-12-12(일)	2,700	3.125	-	AAA
신한은행28-12-이-5-A	금융채	2029-12-12(수)	2,400	2.910	2.937	AAA
산금24신할0003-1212-1	금융채	2025-03-12(수)	2,100	3.210	3.250	AAA
한국철도공사261	특수채	2026-12-12(토)	2,100	2.959	2.923	AAA
신한은행28-12-이-1-B	금융채	2025-12-12(금)	1,700	3.000	2.997	AAA
신한은행28-12-이-2.5-A	금융채	2027-06-12(토)	1,400	2.930	2.927	AAA

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억계약, %, 년)

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
산금24이0200-1212-3	26-12-12	2.86	310	2.0	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	2.81	-110	8.0		
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.66	205	2.0	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	2.78	-70	7.0		
기업은행(단)2412할182A-12	25-06-12	3.25	170	0.5	통안03200-2607-02	26-07-02	2.70	-60	1.6		
국고02375-2703(22-1)	27-03-10	2.67	107	2.2	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.66	-50	18.8		
국고01375-3006(20-4)	30-06-10	2.77	110	5.5	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.63	-55	0.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					902	2.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-345	7.1
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고04250-3212(22-14)	32-12-10	2.82	110	8.0	국고01375-3006(20-4)	30-06-10	2.77	-132	5.5		
한국철도공사261	26-12-12	2.96	120	2.0	국고01500-2612(16-8)	26-12-10	2.68	-37	2.0		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.79	38	9.5	국고01500-3609(16-6)	36-09-10	2.79	-40	11.8		
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.55	31	3.0	국고01375-2912(19-8)	29-12-10	2.74	-22	5.0		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.82	28	9.0	산금24신이0200-1207-1	25-12-07	3.29	-20	1.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					327	5.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-251	5.6
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
부산은행2024-12이11M-12	25-11-12	3.04	100	0.9	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.70	-46	4.2		
산금24이0200-1212-3	26-12-12	2.86	90	2.0	케이비캐피탈528-1	25-07-04	3.45	-30	0.6		
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.62	71	2.5	신한캐피탈493-1	25-07-11	3.44	-30	0.6		
기업은행(단)2311이2A-06	25-11-06	3.02	60	0.9	우리금융캐피탈495-2	25-07-11	3.46	-30	0.6		
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.55	55	3.0	신한카드2186-1	24-12-30	3.58	-30	0.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					376	1.8	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-166	1.5
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
산금24신할0100-1212-2	25-12-12	2.96	230	1.0	국고03375-3206(22-5)	32-06-10	2.81	-64	7.5		
산금24이0200-1212-3	26-12-12	2.86	200	2.0	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.67	-50	18.8		
국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.54	100	27.3	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	2.78	-30	7.0		
국고01125-3909(19-6)	39-09-10	2.77	67	14.8	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.56	-20	28.3		
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.65	53	2.0	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	2.82	0	8.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					649	6.8	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-165	13.3

주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-1,251	-619	-1,604	-2,002	4,653
5일누적	-12,174	1,005	67	-7,618	14,142

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	190,697	-2,857	-11,444	-7,613	19,639
채권형*	178,755	61	367	1,432	42,171
주식형*	123,130	1,005	1,096	1,876	19,262
저축성예금**	1,713,414	-5,955	7,951	7,014	96,821
CD순발행**	62,083	-87	1,320	1,779	-8,492

*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
신한금융지주146-1	AAA	2025-03-23	3.244	3.38	121
한화생명보험7(후)	AA	2034-12-12	-	4.44	102
엔에이치투자69-1	AA+	2026-02-06	3.157	3.17	70
BNK금융 조건부(상)10	AA-	2099-12-31	5.168	5.17	60
LG전자98-3	AAO	2031-05-04	3.096	3.1	60
에이치디현대오일뱅크122-4	AA-	2030-02-26	3.104	3.11	60
하이메타버스제십오차1-1	-	2025-03-11	-	1.67	52
하나증권3(후)	AA-	2025-04-28	3.981	3.97	50
한화토탈에너지스24-3	AA-	2026-10-16	3.203	3.27	50
울산지피에스1-1(녹)	AA-	2025-02-25	3.594	3.73	50
에스파워1-2	AA+	2025-02-12	3.368	3.51	40
SK브로드밴드56-3	AAO	2031-12-04	3.134	3.13	40
한화에너지로스페이스125-2	AA-	2026-04-28	3.176	3.19	40
현대제철128-3	AAO	2027-01-22	3.048	3.09	40
POSCO312-1	AA+	2025-07-07	3.2	3.28	40
웨이브블루1	-	2029-06-20	-	4	40
위즈튜디오비제일차6	-	2025-06-12	-	7.5	34
한국투자증권25-2	AAO	2026-10-16	3.299	3.28	30