





# **DAOL Daily Bond Morning Brief**

주간 입찰 일정 및 결과

1 - 0 0 1					
일자	요일	<del>종목</del> 명	만기	발행금액	발행금리
1월 20일	월	국고채	10y	24,000	2.840
1월 20일	월	통안채	91d	12,000	2.810
1월 22일	수	통안채	2y	5,000	2.660
1월 22일	수	통안채	3у	3,000	2.670

### 금리방향: 상승(3Y), 상승(10Y)

■일드커브: 스티프닝

■스프레드(bp): 국5/3 11.3 (0.8) 국10/3: 24.8 (0.8) 국10/5: 13.5 (0.0) 국30/10: -13.5 (-0.5)

#### KR Market

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.030	5.0	4.0	-36.0
통안1Y	2.650	2.1	0.1	-3.4
통안2Y	2.635	1.5	-4.3	-9.9
국고3Y	2.577	0.7	-10.3	-3.2
국고5Y	2.690	1.5	-9.2	-6.7
국고10Y	2.824	1.4	-5.0	-2.1
국고20Y	2.755	2.7	1.1	-1.3
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.198	0.7	-12.6	-15.3
회사채 AA- 3Y	3.183	-0.1	-14.5	-10.3
회사채 BBB+ 3Y	6.530	-0.6	-13.8	-10.2
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.9	-4.0	19.0	
LKTBF 10Y	118.4	-15.0	86.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,547.1	1.15	2.01	4.30
KOSDAQ	732.3	0.86	2.91	7.81
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,437.6	-0.13	-1.62	-0.99
원/100엔	922.4	0.17	-0.59	-0.38

IRS	(%)	1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Sprea	Spread(bp)	
1Y	2.710	1.8	1Y	2.635	1	IRS-통1	6.0	-0.3
2Y	2.615	1.5	2Y	2.535	1	IRS-통2	-2.0	0.0
3Y	2.593	1.5	3Y	2.550	1.5	IRS-국3	1.5	0.8
5Y	2.615	1.8	5Y	2.575	1.5	IRS-국5	-7.5	0.2
10Y	2.690	1.8	10Y	2.560	1.5	IRS-국10	-13.4	0.4

### US Bond Market

US Bond(%,bp)	YIM	10	1W	1M
UST2Y	4.302	2.6	3.4	-4.2
UST5Y	4.438	4.0	-1.1	0.3
UST10Y	4.616	3.8	-3.9	2.7
UST30Y	4.828	1.7	-5.3	5.2

#### KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	2.805	2.0	-1.4	-22.1	-36.9	-75.3
특수채 AAA 3Y	2.822	1.5	-10.2	-11.7	-31.6	-81.5
특수채 AAA 5Y	2.936	1.5	-8.9	-11.7	-26.0	-69.9
은행채 AAA 1Y	2.856	1.8	0.5	-18.1	-34.4	-72.9
은행채 AAA 3Y	2.868	0.7	-10.5	-10.5	-31.3	-87.9
은행채 AAA 5Y	2.989	1.5	-9.6	-9.5	-26.8	-87.2
금융채 AA 1Y	3.023	2.0	-2.5	-22.5	-28.3	-74.4
금융채 AA 3Y	3.106	0.7	-12.6	-15.3	-26.3	-94.9
금융채 AA 5Y	3.318	1.5	-10.2	-9.7	-25.9	-89
금융채 AA- 1Y	3.096	1.5	-3.0	-23.0	-28.9	-83.2
금융채 AA- 3Y	3.198	0.7	-12.6	-15.3	-26.7	-108.2
금융채 AA- 5Y	3.426	1.5	-10.2	-9.7	-25.9	-97.9
금융채 A+ 1Y	3.794	1.5	-3.0	-20.5	-34.6	-101.5
금융채 A+ 3Y	4.090	0.7	-11.6	-12.3	-31.1	-107.5
금융채 A+ 5Y	4.546	1.5	-10.2	-9.2	-26.9	-83.2
금융채 A 1Y	4.511	1.5	-3.0	-20.5	-34.6	-99.5
금융채 A 3Y	4.883	0.7	-11.6	-12.3	-31.1	-104
금융채 A 5Y	5.230	1.5	-10.2	-9.2	-26.9	-82.2
금융채 A- 1Y	5.083	1.5	-3.0	-20.5	-34.6	-98.5
금융채 A- 3Y	5.523	0.7	-11.6	-12.3	-30.1	-100.5
금융채 A- 5Y	5.871	1.5	-10.2	-9.2	-26.9	-81.4
회사채 AAA 1Y	2.981	1.2	-2.6	-14.8	-23.9	-73.2
회사채 AAA 3Y	3.015	0.0	-13.2	-10.5	-29.9	-79.3
회사채 AAA 5Y	3.080	1.2	-10.5	-11.3	-28.9	-78.4
회사채 AA+ 1Y	3.016	0.7	-2.5	-14.9	-21.9	-76.9
회사채 AA+ 3Y	3.109	-0.1	-14.4	-10.1	-27.1	-81.8
회사채 AA+ 5Y	3.166	1.0	-11.6	-12.5	-27.8	-87.3
회사채 AA 1Y	3.045	0.7	-2.5	-14.7	-21.2	-78.2
회사채 AA 3Y	3.135	-0.2	-14.5	-10.1	-27.6	-83.4
회사채 AA 5Y	3.229	1.0	-11.5	-12.3	-27.6	-87.2
회사채 AA- 1Y	3.076	0.7	-2.5	-14.5	-21.1	-79.1
회사채 AA- 3Y	3.183	-0.1	-14.5	-10.3	-27.6	-85.1
회사채 AA- 5Y	3.333	1.0	-11.5	-12.3	-27.4	-88

전일 주요 채권 밤행	결과 (발행 -	극액 상위 10기	H 송복)

선물 무료 세권 월양 결과 (월양 음식 상위 10개 중국)										
	종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신 <del>용등</del> 급			
	KB금융조건부(상)13	회사채	9999-12-31(금)	4,050	4.000	5.185	AA-			
	현대제철140-1	회사채	2028-01-22(토)	3,800	2.954	-	AA			
	기업은행(신)2501할1A-22	금융채	2026-01-22(목)	3,200	2.730	2.797	AAA			
	신세계143-2	회사채	2028-01-21(금)	2,400	2.939	-	AA			
	한국전력1457	특수채	2027-01-22(금)	2,000	2.839	2.797	AAA			
	한국전력1458	특수채	2028-01-22(토)	2,000	2.885	2.807	AAA			
	케이씨씨글라스4-1	회사채	2028-01-21(금)	1,900	3.076	3.183	AA-			
	현대제철140-2	회사채	2030-01-22(화)	1,700	3.055	-	AA			
	롯데카드556-1	금융채	2028-01-19(수)	1,600	3.285	3.192	AA-			
	수산금융채권(은행)25-1이12-2	금융채	2026-01-22(목)	1,500	2.870	-	AAA			

구세월 연물 군매구/군매	도 연정		(십억계약,76,단)						
은행 순매수 상위 5건									
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
산금25신이0200-0122-1	27-01-22	2.73	100	2.0	통안DC025-0422-0910	25-04-22	2.83	-130	0.2
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.69	62	29.7	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.67	-80	3.1
국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.65	60	0.9	산금23신이0300-0421-1	26-04-21	2.80	-40	1.2
한국전력1457	27-01-22	2.84	50	2.0	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	2.87	-30	6.9
국고04250-2512(22-13)	25-12-10	2.65	50	0.9	통안03200-2607-02	26-07-02	2.68	-30	1.4
수량 합기	fl 및 가중 평균	사존만기			수량 한	계 및 가중 평균	· 잔존만기		

수량 합	계 및 가중 평균	' 잔손만기		6.9	수량 합	계 및 가중 평균	・잔손만기		1.9
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
통안DC025-0422-0910	25-04-22	2.83	140	0.2	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.65	-30	0.9
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.69	41	29.7	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.89	-20	8.9
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.87	39	9.4	국고05750-2603(06-1)	26-03-10	2.63	-20	1.1
통안03200-2607-02	26-07-02	2.68	30	1.4	한국전력843	28-05-13	2.90	-20	3.3
에스케이인천석유화학26-2	28-01-21	3.77	30	3.0	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.72	-15	4.1
수량 합	계 및 가중 평균	· 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		3.4

투신 순매수 상위 5건	투신 순매수 상위 5건 투신 순매도 상위 5건										
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03250-4209(22-11)	42-09-10	2.75	100	17.6	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.87	-205	9.4		
한국전력1457	27-01-22	2.84	90	2.0	토지주택채권505	29-11-08	2.88	-30	4.8		
롯데카드556-2	28-01-20	3.29	60	3.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.66	-30	1.4		
기업은행(신)25010 1.5A-22	26-07-22	2.76	60	1.5	하나카드254-1	25-07-24	3.10	-20	0.5		
롯데카드556-1	28-01-19	3.29	53	3.0	산금25신할0100-0102-1	26-01-02	2.83	-20	0.9		
수량 합기	계 및 가중 평균	7 잔존만기			수량 한	ː계 및 가중 평균	자존만기		7.0		

외국인 순매수 상위 5건	외국인 순매도 상위 5건									
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.68	111	29.7	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	2.88	-97	6.9	
국고01375-2912(19-8)	29-12-10	2.76	36	4.9	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	2.89	-39	7.9	
국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.62	32	0.9	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.60	-30	2.4	
국고02375-3112(21-11)	31-12-10	2.86	30	6.9	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.53	-24	0.6	
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.58	30	2.9	국고03125-2709(22-8)	27-09-10	2.67	-22	2.6	
수량 힙	계 및 가중 평균	잔존만기	239		수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기			

주체별 선물	주체별 선물 순매수													
구분	은행	보험	자산 <del>운용</del>	외국인	증권/선물									
당일	2,460	20	-60	3,756	-4,954									
5일누적	-6,049	-3,072	-10,347	27,726	-3,695									

#### (십억원) Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	202,719	-2,000	1,683	19,361	31,662
채권형*	177,192	277	1,636	2,128	40,609
주식형*	130,094	-112	2,219	7,256	26,227
저축성예금**	1,703,274	3,331	-2,400	-10,895	86,681
CD순발행**	61,181	-265	-124	-110	-9,394

(시어워)

40

2.940

신세계143-1

신세계143-2

## 저익 즈이 히사채 거래 내역

_ 신일 주요 외사제 기대 내역					
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
LG유플러스118-2	AA0	2030-01-20	2.984	3.020	150
현대제철140-1	AA	2028-01-22	-	2.960	130
에스케이하이닉스225-1	AA0	2027-04-08	2.929	2.950	120
신한금융지주153-1	AAA	2026-01-31	2.869	2.910	100
하나금융지주64	AAA	2026-11-25	2.885	2.910	80
에스케이인천석유화학26-2	A+	2028-01-21	-	3.770	74
엘에스일렉트릭186-1	AA-	2025-10-24	3.050	3.050	60
엘에스일렉트릭186-2	AA-	2026-10-23	2.931	2.930	60
SK텔레콤83-1	AAA	2025-08-08	3.081	3.090	60
포스코퓨처엠19-2(녹)	AA-	2028-02-23	3.094	3.190	60
KT&G4-2	AAA	2027-10-08	2.927	2.940	60
우리금융지주11-2	AAA	2026-06-02	2.880	2.900	50
삼성증권19-2	AA+	2026-03-06	3.042	3.020	50
미래에셋증권74-1	AA0	2027-01-20	2.972	2.980	50
에스케이인천석유화학26-1	A+	2027-01-22	-	3.370	40
미래에셋증권64-2	AA0	2026-02-13	3.063	3.030	40

2027-01-22

2028-01-21

AA

<sup>\*</sup>는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

<sup>\*\*</sup>는 T-4일 기준