



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

13 Nov. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 보험(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 플랫닝
- 스프레드(bp): 국5/3 4.0 (-1.0) 국10/3: 11.5 (-2.0)
국10/5: 7.5 (-1.0) 국30/10: -15.0 (0.0)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.440	1.0	0.0	4.0
통안1Y	2.830	0.0	-1.0	-3.3
통안2Y	2.946	0.4	0.4	1.1
국고3Y	2.900	0.0	-1.7	-4.8
국고5Y	2.940	-0.9	-3.2	-5.5
국고10Y	3.015	-2.0	-6.0	-6.2
국고20Y	2.964	-1.1	-4.0	3.6
KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.490	0.0	-2.5	-3.4
회사채 AA- 3Y	3.465	-0.3	-1.8	-5.0
회사채 BBB+ 3Y	6.862	-0.5	-4.2	-10.2
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.94	0.0	19.0	
LKTBF 10Y	116.92	12.0	114.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2482.57	-1.94	-3.66	-4.40
KOSDAQ	710.52	-2.51	-5.49	-7.84
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1403.5	0.63	1.81	4.00
원/100엔	917.07	0.69	1.28	1.07

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.145	0.250	1Y	2.885	1.5	IRS-통1	31.5	0.2
2Y	2.980	-0.250	2Y	2.725	0	IRS-통2	3.4	-0.6
3Y	2.928	-0.500	3Y	2.7	0.5	IRS-국3	2.8	-0.5
5Y	2.900	-0.750	5Y	2.68	-0.5	IRS-국5	-4.0	0.1
10Y	2.928	-1.000	10Y	2.73	-0.5	IRS-국10	-8.7	1.0

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.3	8.8	15.9	38.4
UST5Y	4.3	12.1	16.3	41.0
UST10Y	4.4	12.3	15.7	32.8
UST30Y	4.6	9.8	13.2	15.6

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.194	0.1	0.5	-2.4	-5.2	-89.9
특수채 AAA 3Y	3.150	-0.2	-2.0	-6.4	4.1	-119.9
특수채 AAA 5Y	3.185	-1.1	-3.2	-6.8	7.1	-116.8
은행채 AAA 1Y	3.238	0.1	0.3	1.7	-5.2	-90.4
은행채 AAA 3Y	3.188	0.0	-2.0	-5.2	1.4	-119.8
은행채 AAA 5Y	3.243	-0.9	-3.8	-6.3	6.7	-124.3
금융채 AA 1Y	3.340	0.0	0.1	1.7	-6.3	-100.9
금융채 AA 3Y	3.394	0.0	-2.5	-3.1	2.5	-145.1
금융채 AA 5Y	3.563	-0.7	-3.2	-5.7	7.4	-140.7
금융채 AA- 1Y	3.419	0.0	0.1	0.7	-5.1	-112.8
금융채 AA- 3Y	3.490	0.0	-2.5	-3.4	0.7	-161.5
금융채 AA- 5Y	3.671	-0.7	-3.2	-5.9	5.9	-151.6
금융채 A+ 1Y	4.135	0.0	-1.0	-4.0	-23.8	-121.1
금융채 A+ 3Y	4.397	-0.3	-2.8	-7.1	-11.2	-147.8
금융채 A+ 5Y	4.801	-0.7	-3.2	-5.9	4.1	-132.2
금융채 A 1Y	4.852	0.0	-1.0	-4.5	-24.3	-118.6
금융채 A 3Y	5.190	-0.3	-2.8	-7.1	-11.2	-143.8
금융채 A 5Y	5.485	-0.7	-3.2	-5.9	4.1	-130.7
금융채 A- 1Y	5.424	0.0	-1.0	-4.0	-23.8	-117.6
금융채 A- 3Y	5.825	-0.3	-2.8	-6.6	-10.7	-140.3
금융채 A- 5Y	6.126	-0.7	-3.2	-5.9	4.1	-129.9
회사채 AAA 1Y	3.241	0.2	0.2	-1.0	-3.2	-103.7
회사채 AAA 3Y	3.316	0.3	-1.0	-5.1	7.0	-114.5
회사채 AAA 5Y	3.349	-0.7	-3.0	-5.5	9.9	-121.1
회사채 AA+ 1Y	3.265	0.2	0.4	-1.3	-2.6	-108.6
회사채 AA+ 3Y	3.387	-0.3	-1.7	-5.0	8.1	-122.3
회사채 AA+ 5Y	3.432	-0.6	-2.7	-5.2	10.5	-130.3
회사채 AA 1Y	3.289	0.2	0.4	-1.1	-2.2	-110.4
회사채 AA 3Y	3.417	-0.3	-1.8	-5.0	7.3	-123.4
회사채 AA 5Y	3.492	-0.7	-2.8	-5.3	10.0	-130.7
회사채 AA- 1Y	3.318	0.2	0.4	-1.2	-2.3	-111.2
회사채 AA- 3Y	3.465	-0.3	-1.8	-5.0	7.6	-125.1
회사채 AA- 5Y	3.594	-0.8	-2.9	-5.3	9.9	-131.5

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
11월 11일	월	국고채	3Y	6990	2.870
11월 11일	월	국고채	3Y	5000	2.840
11월 11일	월	통안채	91d	3900	3.060

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
통안DC025-0211-0910	통안채	2025-02-11(화)	3900	3.060	3.046	통안
산금24신할0100-1112-1	금융채	2025-11-12(수)	2700	3.100	3.202	AAA
산금24신이0200-1112-2	금융채	2026-11-12(목)	3100	3.150	3.157	AAA
기업은행(신)2411012A-12	금융채	2026-11-12(목)	1900	3.150	3.157	AAA
기업은행(신)2411013A-12	금융채	2027-11-12(금)	1500	3.060	3.069	AAA
한국전력1437	특수채	2026-11-12(금)	3000	3.230	3.200	AAA
한국전력1438	특수채	2027-11-12(금)	2000	3.205	3.152	AAA
한국전력1439	특수채	2029-11-12(월)	2000	3.262	3.196	AAA
국가철도공단채권420(녹)	특수채	2026-11-12(목)	500	3.190	3.200	AAA
주택금융공사182(사)	특수채	2027-11-12(금)	1600	3.091	3.152	AAA

주제별 현물 순매수/순매도 현황

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
산금24신010200-1112-2	26-11-12	3.15	220	2.0	국민은행4406이표일(03)1-07	25-06-07	3.37	-100	0.6		
산금24신할0100-1112-1	25-11-12	3.19	210	1.0	국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.92	-70	1.8		
기업은행(신)2411012A-12	26-11-12	3.15	150	2.0	통안03570-2603-03	26-03-03	2.93	-50	1.3		
기업은행(신)2411013A-12	27-11-12	3.06	120	3.0	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.07	-50	7.1		
한국전력1439	29-11-12	3.26	100	5.0	통안03365-2604-02	26-04-02	2.97	-40	1.4		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					800	2.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-310	2.1
보험/금융 순매수 상위 5건					보험/금융 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
한국전력1437	26-11-12	3.23	110	2.0	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.88	-60	29.3		
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.96	50	18.8	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.02	-60	9.6		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.87	55	29.8	LX인터내셔널122-1	25-01-27	3.62	-30	0.2		
통안03365-2604-02	26-04-02	2.97	50	1.4	국고02375-2712(17-7)	27-12-10	2.95	-30	3.1		
통안03200-2607-02	26-07-02	2.97	41	1.6	신한카드2119-3	25-09-29	3.39	-20	0.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					306	9.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-200	12.3
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
하나카드269-2	26-11-12	3.34	95	2.0	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.89	-77	2.6		
국민은행4406이표일(03)1-07	25-06-07	3.37	80	0.6	통안03570-2603-03	26-03-03	2.93	-50	1.3		
한국전력1437	26-11-12	3.23	70	2.0	국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.89	-53	27.3		
국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.06	60	6.1	국고02500-3406(24-5)	34-06-10	3.01	-33	9.6		
한국전력1438	27-11-12	3.21	50	3.0	국민은행4306이표일(03)15-16	24-12-16	3.31	-30	0.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					355	2.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-243	8.4
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고02375-2703(22-1)	27-03-10	2.94	104	2.3	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.86	-56	0.8		
통안DC025-0211-0910	25-02-11	3.08	80	0.2	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.07	-50	7.1		
국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.06	54	6.1	국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.94	-46.0	1.8		
국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.90	20	28.3	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	3.18	-2.9	0.1		
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.96	16	18.8	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	2.91	-1.3	0.3		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					274	5.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-156	3.1

주제별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-4205	-914	-694	3845	683
5일누적	-6025	579	-632	1068	3167

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	196347.9	-1961.7	-1748	7652.6	25290.4
채권형*	176949.7	-372.9	309.5	5326.1	40366.5
주식형*	120715.9	-537.7	479.5	-484.8	16848.2
저축성예금**	1708347.6	1947.8	8152.8	24832.5	91754.8
CD순발행**	60580	275.7	-412.8	-1692	-9995.4

*는 T-2일 기준, **는 설정액 및 ETF 제외 기준

**는 T-4일 기준

전일 주요 회사채 거래 내역

종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
교보생명보험신증자본증권 6	AA	2054-11-12	-	4.59	214
롯데손해보험17(후)	A-	2034-11-12	-	6.04	149
LX인터내셔널122-1	AA-	2025-01-27	3.526	3.62	120
LG화학52-4	AA+	2029-03-13	3.279	3.29	120
연합자산관리37-1	AA0	2027-10-29	3.402	3.39	110
롯데하이마트11-1	A+	2026-10-23	3.786	3.78	80
대신에프앤아이40-1	A0	2026-01-23	3.991	3.97	80
롯데쇼핑66-3	AA-	2025-06-23	3.537	3.57	70
LG화학54-2(지)	AA+	2026-02-19	3.177	3.2	60
농협금융 조건부(상)6	AA-	2099-12-31	4.16	4.21	60
나래에너지서비스1-1	AA0	2024-12-09	3.555	3.4	60
하이트레디전세빌1	-	2024-12-20	3.583	4.17	50
롯데쇼핑83-3	AA-	2029-08-29	3.681	3.67	40
코웨이5-1	AA-	2025-01-27	3.51	3.58	40
SK에너지47-2	AA0	2025-04-24	3.464	3.53	40
롯데렌탈57-2(녹)	A+	2025-04-14	3.439	3.41	40
롯데렌탈58-1	A+	2025-01-27	3.428	3.37	40
롯데렌탈60-2	A+	2027-02-02	3.58	3.57	40