



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

30 Dec. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 하락(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 스티프닝
- 스프레드(bp): 국5/3 15.3 (-0.2) 국10/3: 25.0 (0.8)
국10/5: 9.7 (1.0) 국30/10: -6.7 (6.5)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.440	4.0	5.0	0.0
통안1Y	2.694	-1.2	1.0	-11.3
통안2Y	2.757	-3.5	3.2	-6.0
국고3Y	2.625	-4.5	1.3	-11.5
국고5Y	2.785	-4.0	2.5	0.5
국고10Y	2.885	-2.9	2.5	0.4
국고20Y	2.871	2.1	8.0	4.1
KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.366	-4.5	1.8	0.9
회사채 AA- 3Y	3.306	-4.2	2.4	-1.1
회사채 BBB+ 3Y	6.650	-4.4	1.5	-5.1
KTBF Futures(tick)	중가	1D	1W	자평
KTBF 3Y	106.6	10.0	-14.0	
LKTBF 10Y	116.8	18.0	-66.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,404.8	-1.02	0.03	-3.93
KOSDAQ	666.0	-1.43	-0.35	-3.76
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,467.5	0.18	1.11	5.05
원/100엔	931.5	-0.28	0.82	1.30

IRS(%)		1D(bp)		CRS(%)		1D(bp)		Spread(bp)		1D(bp)	
1Y	2.860	-1.8	1Y	2.775	2	IRS-통1		16.6		-0.6	
2Y	2.743	-3.2	2Y	2.680	4	IRS-통2		-1.5		0.2	
3Y	2.720	-2.5	3Y	2.680	4.5	IRS-국3		9.5		2.0	
5Y	2.735	-2.5	5Y	2.695	6	IRS-국5		-5.0		1.5	
10Y	2.785	-2.3	10Y	2.720	6	IRS-국10		-10.0		0.7	

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.332	-0.2	2.0	9.7
UST5Y	4.464	2.9	8.5	32.1
UST10Y	4.627	4.1	10.1	36.2
UST30Y	4.819	4.6	9.6	37.9

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.029	-1.2	0.3	-16.4	-17.6	-66.3
특수채 AAA 3Y	2.940	-4.9	-0.3	-7.8	-15.2	-57.7
특수채 AAA 5Y	3.065	-4.2	0.8	1.5	-8.9	-42
은행채 AAA 1Y	3.040	-1.5	0.8	-17.8	-17.4	-67.1
은행채 AAA 3Y	2.973	-4.6	-0.3	-6.5	-14.7	-65.3
은행채 AAA 5Y	3.107	-4.2	2.0	1.1	-10.2	-59.9
금융채 AA 1Y	3.268	0.0	2.0	-7.3	-4.3	-59.6
금융채 AA 3Y	3.274	-4.5	1.8	0.9	-4.7	-62.6
금융채 AA 5Y	3.443	-4.0	2.5	3.7	-7.7	-58
금융채 AA- 1Y	3.346	0.0	2.0	-6.8	-5.4	-67.9
금융채 AA- 3Y	3.366	-4.5	1.8	0.9	-5.9	-74.4
금융채 AA- 5Y	3.551	-4.0	2.5	3.7	-8.2	-67.9
금융채 A+ 1Y	4.019	0.0	1.5	-9.3	-14.4	-86.7
금융채 A+ 3Y	4.228	-4.5	1.3	-0.9	-14.1	-79.7
금융채 A+ 5Y	4.666	-4.0	2.5	2.2	-9.7	-53.7
금융채 A 1Y	4.736	0.0	1.5	-9.3	-14.9	-84.7
금융채 A 3Y	5.021	-4.5	1.3	-0.9	-14.1	-76.2
금융채 A 5Y	5.350	-4.0	2.5	2.2	-9.7	-52.7
금융채 A- 1Y	5.308	0.0	1.5	-9.3	-14.4	-83.7
금융채 A- 3Y	5.661	-4.5	1.3	-0.9	-13.1	-72.2
금융채 A- 5Y	5.991	-4.0	2.5	2.2	-9.7	-51.9
회사채 AAA 1Y	3.135	-1.6	0.8	-10.3	-10.2	-68.8
회사채 AAA 3Y	3.142	-4.6	2.1	-2.5	-12.1	-53.7
회사채 AAA 5Y	3.219	-4.0	2.3	2.6	-9.2	-49.1
회사채 AA+ 1Y	3.177	-1.4	1.6	-7.8	-8.0	-71.4
회사채 AA+ 3Y	3.231	-4.1	2.5	-1.2	-9.6	-55.2
회사채 AA+ 5Y	3.318	-4.0	2.4	3.8	-7.2	-56.7
회사채 AA 1Y	3.205	-1.4	1.6	-7.4	-7.5	-72.7
회사채 AA 3Y	3.258	-4.1	2.5	-1.2	-10.2	-56.5
회사채 AA 5Y	3.378	-4.0	2.3	3.9	-7.7	-56.9
회사채 AA- 1Y	3.234	-1.4	1.6	-7.5	-7.5	-73.8
회사채 AA- 3Y	3.306	-4.2	2.4	-1.1	-10.2	-58.3
회사채 AA- 5Y	3.483	-4.0	2.4	4.1	-7.6	-57.6

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-
글로벌미아제일차1	회사채	2025-03-30(일)	400	4.670	-	-
엔에이치농협캐피탈240-1	금융채	2027-02-26(금)	400	3.341	3.359	AA-

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억억, %, 년)

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국민주택1종24-12	29-12-31	3.00	36	5.0	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.70	-40	0.9		
국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.09	30	8.0	통안02800-2610-02	26-10-02	2.79	-30	1.8		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.06	30	9.5	통안0C025-0101-0910	25-01-01	3.65	-30	0.0		
국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.84	30	3.7	국고03625-2509(23-8)	25-09-10	2.71	-20	0.7		
국민주택1종24-01	29-01-31	2.96	30	4.1	국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.62	-11	2.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					156	6.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-131	1.0
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.09	117	9.5	국고01500-5003(20-2)	50-03-10	2.87	-67	25.2		
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.68	119	2.9	국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.84	-30	27.2		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.83	90	29.7	국고01875-4109(21-9)	41-09-10	2.98	-20	16.7		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.08	30	9.0	국고02010-4212(12-5)	42-12-10	2.95	-20	18.0		
통안02800-2610-02	26-10-02	2.79	27	1.8	국고03000-2909(24-7)	29-09-10	2.83	-11	4.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					383	11.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-148	22.0
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
산금24이010106-1227-1	26-06-27	2.95	295	1.5	통안02800-2610-02	26-10-02	2.78	-97	1.8		
교보생명보험신종자본증권 6	54-11-12	4.59	60	29.9	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.84	-20	3.2		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.06	55	9.5	우리금융캐피탈496-1	25-06-30	3.52	-20	0.5		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.81	51	29.7	기업은행(당)2402할335A-20	25-01-20	3.32	-20	0.1		
신한은행28-02-아-11M-A	25-01-05	3.50	50	0.0	KT201-1	27-12-02	3.05	-20	2.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					511	8.4	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-177	1.7
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고05500-2912(09-5)	29-12-10	2.92	245	5.0	국고04250-2512(22-13)	25-12-10	2.72	-201	0.9		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.08	140	9.0	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.71	-1	0.9		
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.80	30	29.7	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	3.05	-1	7.0		
국고03000-3412(24-13)	34-12-10	2.88	20	10.0	국고01375-3006(20-4)	30-06-10	3.00	-1	5.4		
국고03750-3312(13-8)	33-12-10	3.10	10	9.0	국고01125-3909(19-6)	39-09-10	2.96	-1	14.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					445	8.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-204	1.0

주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-1,749	139	1,261	-4,356	5,655
5일누적	-8,680	976	890	-8,786	16,341

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	174,714	-2,412	-14,671	-21,344	3,656
채권형*	173,796	-724	-1,858	-3,619	37,213
주식형*	125,875	839	2,246	4,855	22,007
저축성예금**	1,714,742		1,156	10,113	98,150
CD순발행**	59,917		-601	1,025	-10,658

*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
교보생명보험신종자본증권 6	AA0	2054-11-12	4.526	4.58	69
KT201-1	AAA	2027-12-02	3.068	3.05	60
한화생명보험7(후)	AA0	2034-12-12	4.546	4.43	47
미래에셋증권66-1	AA0	2025-06-20	3.446	3.44	30
HD현대11-2	A0	2026-02-23	3.341	3.35	30
한국중부발전30-2	AAA	2025-03-23	3.321	3.37	20
하이오션커미트제일차3	-	2031-06-10	-	3.42	20
KT195-3	AAA	2031-06-10	3.169	3.25	20
한국투자증권22	AA0	2025-02-28	3.576	4.12	20
한국남동발전61-1(연)	AAA	2027-07-30	3.111	3.09	20
한국남동발전50-2(녹)	AAA	2031-07-26	3.247	3.28	20
하나금융조건부(상)15	AA-	2099-12-31	3.976	3.99	14
농협금융 조건부(상)7	AA-	2099-12-31	3.932	3.94	14
우전지엔에프1	-	2025-12-27	-	6.5	10
동아쏘시오홀딩스106-2	AO	2026-03-06	3.492	3.4	10
에스케이하이닉스224-2	AA0	2028-02-14	3.186	3.2	9
아이비케이연금보험4(후)	-	2033-03-30	-	5.82	8
한화생명보험신종자본증권 6	AA-	2054-09-24	4.714	4.64	8