





# **DAOL Daily Bond Morning Brief**

주간 인챀 일정 및 결과

구난 남은 돈이 못 된다					
일자	요일	<del>종목</del> 명	만기	발행금액	발행금리
1월 13일	월	국고채	3у	25,000	2.625
1월 13일	월	통안채	91d	10,000	2.880
1월 14일	화	국고채	5y	22,000	2.725
1월 15일	수	통안채	3у	19,800	2.760

## · 금리방향: 상승(3Y), 상승(10Y)

■일드커브: 플래트닝

■스프레드(bp): 국5/3 10.2 (1.2) 국10/3: 19.5 (-0.3) 국10/5: 9.3 (-1.5) 국30/10: -17.5 (-1.7)

#### KR Market

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	2.990	-1.0	-5.0	-39.0
통안1Y	2.649	1.0	1.2	-3.5
통안2Y	2.678	2.3	7.4	1.4
국고3Y	2.680	3.3	18.0	12.9
국고5Y	2.782	4.5	13.5	13.2
국고10Y	2.874	2.9	8.9	16.2
국고20Y	2.744	1.2	2.0	10.9
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.324	1.8	10.8	4.3
회사채 AA- 3Y	3.328	3.2	15.6	11.4
회사채 BBB+ 3Y	6.668	3.0	15.4	9.5
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.5	-11.0	-48.0	
LKTBF 10Y	116.8	-46.0	-121.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,496.8	-0.02	-0.96	0.31
KOSDAQ	711.6	-0.90	-1.11	1.87
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,461.2	-0.14	0.43	1.83
원/100엔	927.9	-0.03	0.55	-0.77

IRS	(%)	1D(bp)	CRS(	%)	1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	2.765	1.5	1Y	2.680	-0.5	IRS-통1	11.6	0.5
2Y	2.703	2.5	2Y	2.625	-1	IRS-통2	2.5	0.2
3Y	2.705	2.7	3Y	2.655	-2.5	IRS-국3	2.5	-0.6
5Y	2.758	3.0	5Y	2.695	-2.5	IRS-국5	-2.5	-1.5
10Y	2.833	3.3	10Y	2.705	-2.5	IRS-국10	-4.2	0.4

### US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.268	-10.1	-1.9	1.3
UST5Y	4.449	-14.9	-1.4	18.9
UST10Y	4.650	-14.4	-4.2	24.8
UST30Y	4.870	-10.7	-6.4	26.9

#### KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	10	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	2.819	0.0	-5.4	-18.9	-38.3	-72.7
특수채 AAA 3Y	2.924	2.9	12.8	4.8	-23.4	-66.9
특수채 AAA 5Y	3.025	4.0	10.8	7.9	-17.9	-56.3
은행채 AAA 1Y	2.851	0.9	-2.1	-15.6	-35.1	-70.6
은행채 AAA 3Y	2.973	3.2	13.8	6.4	-21.5	-72.4
은행채 AAA 5Y	3.085	4.3	11.4	10.9	-17.5	-72.6
금융채 AA 1Y	3.048	0.0	-5.5	-17.5	-26.0	-71.4
금융채 AA 3Y	3.232	1.8	10.8	4.3	-14.1	-76.8
금융채 AA 5Y	3.420	4.0	11.5	11.9	-16.0	-72.3
금융채 AA- 1Y	3.126	0.0	-5.5	-17.0	-26.6	-79.7
<del>금융</del> 채 AA- 3Y	3.324	1.8	10.8	4.3	-14.7	-89.8
금융채 AA- 5Y	3.528	4.0	11.5	11.9	-16.2	-81.2
금융채 A+ 1Y	3.824	0.0	-4.0	-15.5	-33.1	-97.5
금융채 A+ 3Y	4.206	1.8	12.8	5.8	-20.9	-90.6
금융채 A+ 5Y	4.648	4.0	12.0	12.4	-17.2	-66.5
금융채 A 1Y	4.541	0.0	-4.0	-15.5	-33.6	-95.5
금융채 A 3Y	4.999	1.8	12.8	5.8	-20.9	-87.1
금융채 A 5Y	5.332	4.0	12.0	12.4	-17.2	-65.5
금융채 A- 1Y	5.113	0.0	-4.0	-15.5	-33.1	-94.5
금융채 A- 3Y	5.639	1.8	12.8	5.8	-19.9	-83.6
금융채 A- 5Y	5.973	4.0	12.0	12.4	-17.2	-64.7
회사채 AAA 1Y	3.007	0.9	-1.5	-11.0	-23.9	-69.1
회사채 AAA 3Y	3.147	2.4	13.3	9.6	-17.6	-60.3
회사채 AAA 5Y	3.185	3.9	11.2	10.4	-18.4	-62
회사채 AA+ 1Y	3.041	0.9	-1.6	-10.4	-22.1	-73.4
회사채 AA+ 3Y	3.253	3.1	15.5	11.4	-13.6	-62
회사채 AA+ 5Y	3.282	3.5	10.9	10.4	-16.0	-69.8
회사채 AA 1Y	3.070	0.9	-1.5	-10.0	-21.5	-74.6
회사채 AA 3Y	3.280	3.1	15.5	11.4	-14.0	-63.5
회사채 AA 5Y	3.344	3.4	11.0	10.6	-15.9	-70.1
회사채 AA- 1Y	3.101	0.9	-1.3	-9.9	-21.3	-75.5
회사채 AA- 3Y	3.328	3.2	15.6	11.4	-14.0	-65.3
회사채 AA- 5Y	3.448	3.4	11.0	10.7	-15.8	-70.8

TIOL TO MICH HE	3431 /UL±II 5	704 1101 44	-II 1
전일 주요 채권 발행	결과 (일엥 =	흑액 상위 표	ᄱᆇ

신일 주요 세권 일행 결과 (일행 금						
종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
메리츠증권2501-1	회사채	2028-01-14(금)	3,500	3.259	3.295	AA-
산금25신할0100-0115-1	금융채	2026-01-15(목)	3,000	2.730	2.802	AAA
기업은행(신)2501이2A-15	금융채	2027-01-15(금)	2,000	2.760	2.772	AAA
산금25신이0203-0115-2	금융채	2027-04-15(목)	1,800	2.790	2.804	AAA
현대캐피탈2040-2	금융채	2029-01-15(월)	1,600	3.137	3.137	AA+
토지주택채권510	특수채	2032-01-15(목)	1,500	3.044	3.084	AAA
부산광역시채권2025-1	지방채	2028-01-15(토)	1,062	2.857	2.909	AAA
농금채(중앙회)2025-1이3Y-B	특수채	2028-01-15(토)	900	2.910	2.895	AAA
수산금융채권(중앙회)07-01이표	특수채	2026-01-15(목)	500	2.820	2.819	AAA
키움캐피탈203-2	금융채	2026-07-15(수)	500	4.483	5.085	A-

### 즈체벽 혀문 수매스/수매도 혀화

주체별 현물 순매수/순매	(십억	(십억계약,%,년)							
은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건				
종목		수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
통안02940-2709-03	27-09-03	2.75	590	2.6	산금22신미0500-0407-3	27-04-07	2.79	-20	2.2
산금25신할0100-0115-1	26-01-15	2.80	180	1.0	산금24신할0003-1212-1	25-03-12	3.13	-20	0.2
산금25신미0203-0115-2	27-04-15	2.79	160	2.2	신한은행28-12-할-6M-A	25-06-09	3.00	-20	0.4
통안03570-2603-03	26-03-03	2.56	150	1.1	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	2.90	-20	5.9
기업은행(신)2501미2A-15	27-01-15	2.76	150	2.0	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.70	-18	29.7
수량 합기	네 및 가중 평균	· 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		
LITTATE AND LUCLETI					WELCOLD ADJUST HOLEST				

보험/기금 순매수 상위 5건				보험/기금 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률:	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.03	105	8.9	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.00	-52	9.4
현대캐피탈2040-2	29-01-15	3.14	80	4.0	경기지역개발21-03	26-03-31	2.70	-28	1.2
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.73	60	1.9	국고채원금03520-2803(08-2)	28-03-10	2.81	-30	3.2
수산금융채권(은행)24-12이18-18	26-06-18	2.85	50	1.4	경기주택도시공사22-12-52	25-06-05	2.97	-20	0.4
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.66	30	2.9	한국수자원공사276	34-04-17	3.04	-10	9.3
수량 합계	∥ 및 가중 평균	잔존만기	325	4.7	수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		5.1
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				

투신 순배수 상위 5건				투신 순배노 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
산금25신할0100-0115-1	26-01-15	2.80	100	1.0	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.71	-38	2.4
메리츠증권2501-1	28-01-14	3.26	95	3.0	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.81	-20	4.2
산금25신이0200-0109-2	27-01-09	2.75	50	2.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.70	-20	1.4
POSCO314-2	28-01-14	3.10	33	3.0	국고02375-2703(22-1)	27-03-10	2.73	-20	2.1
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.67	33	2.9	국민은행4410할인일1-21	25-10-21	2.89	-20	0.8
수량 합기	네 및 가중 평균	· 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		
이그이 스매스 사이 되					이그이 스매트 사이 되게				

외국인 순매수 상위 5건	의국인 순매도 상위 5건								
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.02	60	8.9	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	2.72	-60	0.1
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.68	59	29.7	통안03570-2603-03	26-03-03	2.56	-30	1.1
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.70	50	1.4	국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.65	-30	2.9
국고01375-3006(20-4)	30-06-10	2.84	32	5.4	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.56	-29	0.7
국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.70	30	1.7	국고01875-5103(21-2)	51-03-10	2.71	-19	26.2
수량 합기	계 및 가중 평균	- 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		3.9

주체별 선물	를 순매수				(계약수)
구분	은행	보험	자산 <del>운용</del>	외국인	증권/선물
당일	726	2	-176	-2,507	499
5일누적	4,599	1,999	4,028	-6,797	-8,390

#### (십억원) Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	201,036	2,047	-352	10,786	29,979
채권형*	175,556	723	2,693	-3,356	38,973
주식형*	127,876	56	139	3,427	24,008
저축성예금**	1,705,674	-5,521	-8,011	-12,948	89,081
CD순발행**	61,306	-856	321	-395	-9,270

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

평균수익률	거리	배량

전일 주요 회사채 거래 내역						
종목명	신 <del>용등</del> 급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량	
메리츠증권2501-1	AA-	2028-01-14	-	3.260	620	
POSCO314-2	AA+	2028-01-14	3.069	3.100	100	
LG전자77-3	AA0	2025-02-02	3.146	3.410	85	
미래에셋증권57-1	AA0	2025-01-24	3.259	3.130	80	
신한금융지주133-2	AAA	2025-04-10	3.109	3.220	70	
SK매직13-1	A+	2026-03-04	3.264	3.260	60	
에스케이하이닉스221-2	AA0	2025-02-14	3.151	3.400	50	
코리아에너지터미널1	AA-	2025-02-21	3.398	3.350	50	
한국중부발전42-2	AAA	2028-03-27	3.045	3.040	50	
뉴테라제칠차1-1	-	2025-04-11	-	3.600	40	
농협금융지주47	AAA	2026-11-20	2.955	2.950	40	
이마트23-1	AA-	2025-04-27	3.311	3.380	40	
현대제철139-2	AA0	2029-09-12	3.160	3.100	40	
에이치디현대오일뱅크5(신종)	-	2054-10-15	-	5.030	40	
메리츠증권2311-2	AA-	2025-11-21	3.292	3.140	30	
이마트25-2	AA-	2028-07-05	3.371	3.400	30	
에스케이인천석유화학24-1	A+	2025-02-06	3.324	3.740	30	
한국투자금융지주36-2	AA-	2026-09-18	3.256	3.130	30	

<sup>\*\*</sup>는 T-4일 기준