



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

30 Sep. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 상승(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 플랫닝
- 스프레드(bp): 국5/3 6.8 (0.1) 국10/3: 17.5 (-1.5)
국10/5: 10.7 (-1.6) 국30/10: -11.2 (-0.7)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.530	0.0	0.0	1.0
통안1Y	2.853	0.3	-1.4	-17.8
통안2Y	2.878	1.3	-2.2	-11.2
국고3Y	2.820	1.0	-1.7	-9.5
국고5Y	2.890	1.2	2.0	-8.2
국고10Y	2.997	-0.3	0.5	-5.3
국고20Y	2.913	-1.2	0.1	-14.3

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.425	1.0	-3.5	-14.1
회사채 AA- 3Y	3.408	1.3	-1.4	-5.7
회사채 BBB+ 3Y	6.849	0.8	-1.8	-12.0

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.30	-7	-2	
LKTBF 10Y	117.21	-11	-14	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2649.78	-0.82	2.18	-1.49
KOSDAQ	774.49	-0.60	3.50	1.57

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1318.6	-0.65	-0.79	-1.52
원/100엔	915.58	0.53	-1.22	-1.05

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.080	1.500	1Y	2.75	2.5	IRS-통1	22.7	1.2
2Y	2.860	0.750	2Y	2.575	-1	IRS-통2	-1.8	-0.6
3Y	2.798	0.500	3Y	2.59	-2	IRS-국3	-2.3	-0.5
5Y	2.788	-0.250	5Y	2.625	-1	IRS-국5	-10.3	-1.5
10Y	2.828	0.000	10Y	2.665	1	IRS-국10	-17.0	0.3

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	3.561	-7	-3.6	-31.4
UST5Y	3.505	-6.4	0.4	-16.2
UST10Y	3.752	-4.7	0.9	-8.5
UST30Y	4.105	-2.9	1.9	-2.1

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.205	0.3	-1.6	-9.0	-29.0	-76.9
특수채 AAA 3Y	3.092	1.1	-1.6	-6.9	-27.1	-117.1
특수채 AAA 5Y	3.154	1.3	1.9	-3.8	-20.6	-115.4
은행채 AAA 1Y	3.214	0.1	-2.4	-13.9	-27.7	-83.8
은행채 AAA 3Y	3.120	1.1	-1.7	-8.9	-31.0	-126.2
은행채 AAA 5Y	3.209	1.2	1.9	-4.0	-24.1	-128.2
금융채 AA 1Y	3.311	-0.3	-3.7	-15.7	-30.5	-88.3
금융채 AA 3Y	3.321	1.0	-2.5	-13.1	-26.1	-138.5
금융채 AA 5Y	3.520	0.5	0.5	-7.2	-25.2	-139.3
금융채 AA- 1Y	3.400	-0.3	-4.0	-14.0	-27.1	-97.7
금융채 AA- 3Y	3.425	1.0	-3.5	-14.1	-25.5	-155.3
금융채 AA- 5Y	3.633	0.5	0.0	-8.2	-27.0	-148.7
금융채 A+ 1Y	4.163	-0.5	-4.5	-22.0	-45.1	-101.8
금융채 A+ 3Y	4.369	0.5	-3.5	-15.8	-39.8	-139.6
금융채 A+ 5Y	4.763	1.0	0.5	-7.2	-29.2	-129.3
금융채 A 1Y	4.885	-0.5	-4.5	-22.0	-45.1	-98.8
금융채 A 3Y	5.162	0.5	-3.5	-15.8	-39.8	-135.6
금융채 A 5Y	5.447	1.0	0.5	-7.2	-29.2	-127.8
금융채 A- 1Y	5.452	-0.5	-4.5	-22.0	-45.1	-98.3
금융채 A- 3Y	5.792	0.5	-3.5	-15.8	-39.3	-132.6
금융채 A- 5Y	6.088	1.0	0.5	-7.2	-29.2	-127
회사채 AAA 1Y	3.237	0.3	-1.6	-10.1	-32.3	-89.8
회사채 AAA 3Y	3.263	1.6	-0.8	-4.0	-24.3	-113.2
회사채 AAA 5Y	3.311	1.0	1.9	-2.5	-19.5	-125.7
회사채 AA+ 1Y	3.257	0.5	-1.8	-10.8	-32.3	-95.9
회사채 AA+ 3Y	3.327	1.5	-1.2	-5.4	-22.5	-122.3
회사채 AA+ 5Y	3.390	1.2	2.2	-3.2	-20.7	-134.2
회사채 AA 1Y	3.280	0.5	-1.7	-10.6	-32.1	-97.9
회사채 AA 3Y	3.360	1.3	-1.4	-5.9	-23.3	-122.7
회사채 AA 5Y	3.455	1.2	2.2	-3.1	-20.7	-134
회사채 AA- 1Y	3.309	0.5	-1.7	-10.6	-31.7	-98.7
회사채 AA- 3Y	3.408	1.3	-1.4	-5.7	-22.7	-124.2
회사채 AA- 5Y	3.559	1.2	2.2	-3.2	-20.9	-134.5

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
기업은행(단)2409월334A-27	금융채	2025-08-27(수)	3000	3.090	3.212	AAA
민원은행4409이표일(03)2-27	금융채	2026-09-27(일)	3000	3.130	3.122	AAA
하나은행47-09이5갑-27	금융채	2029-09-27(목)	2200	3.200	3.197	AAA
서울특별시채권2024-1	지방채	2027-09-27(월)	1880	3.110	3.017	AAA
신보2024제17자유동화1-1(사)	회사채	2027-09-27(월)	1832	3.246	3.247	AAA
자산관리공사제100회5009-27	특수채	2029-09-27(목)	1600	3.081	3.141	AAA
농업금융채권(은행)2024-09이2	금융채	2026-09-27(일)	1500	3.140	3.122	AAA
주택금융공사MBS 2024-19(1)	특수채	2026-09-27(일)	1200	3.149	3.146	AAA
신보2024제19자유동화1-1(사)	회사채	2026-09-27(일)	1078	3.222	3.222	AAA
주택금융공사MBS 2024-19(1)	특수채	2025-09-27(토)	1030	3.186	3.223	AAA

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억 계약 %, 년)

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
자산관리공사제100회5009-27(사)	29-09-27	3.08	160	5.0	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.89	-242	30.0		
토지주택채권501	28-09-27	3.09	100	4.0	통안04020-2510-02	25-10-02	2.87	-60	1.0		
통안03200-2607-02	26-07-02	2.88	80	1.8	국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.84	-50	1.9		
국고은행4409이표일(03)2-27	26-09-27	3.13	70	2.0	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.02	-50	7.2		
서울특별시채권2024-1	27-09-27	3.11	70	3.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.87	-40	2.2		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					480	3.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			442	17.8
보험/기업 순매수 상위 5건					보험/기업 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
신보2024제17자유동화1-1(사)	27-09-27	3.25	123	3.0	국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.89	-242	30.0		
신보2024제19자유동화1-1(사)	26-09-27	3.22	78	2.0	통안04020-2510-02	25-10-02	2.87	-60	1.0		
서울특별시채권2024-1	27-09-27	3.11	68	3.0	국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.84	-50	1.9		
국고채권금1570-4109(21-9)	41-09-10	2.98	100	17.0	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.02	-50	7.2		
신보2024제18자유동화1-1(농)	27-09-27	3.25	59	3.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.87	-40	2.2		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					428	6.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			442	17.8
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
충주발전기업인통채권872(번)(사)	25-09-26	3.57	60	1.0	통안03200-2607-02	26-07-02	2.88	-50	1.8		
메리츠캐피탈263-3	27-03-26	4.36	40	2.5	채권2024-0270-0063	24-10-03	3.29	-50	0.0		
농업금융채권(은행)2024-09이2Y-1	26-09-27	3.14	40	2.0	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.09	-86	29.5		
엔디제이차1	25-12-15	3.70	40	1.2	신한은행27-05-01-1.5-B	24-11-04	3.53	-30	0.1		
통안04020-2510-02	25-10-02	2.86	30	1.0	한국수출입은행240601-말안-273	25-03-18	3.41	-30	0.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					210	1.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			203	6.7
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
기업은행(단)2409월334A-27	25-08-27	3.18	240	0.9	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.80	-393	0.9		
주택금융공사MBS 2024-19(1-1)(사)	25-09-27	3.19	100	1.0	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.09	-86	29.5		
국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.83	70	1.9	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	3.28	-20.0	29.0		
국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.04	60	8.2	국고03625-2806(18-4)	28-06-10	3.93	-21.0	3.7		
국고04000-3112(11-7)	31-12-10	3.03	61	7.2	국고03625-2509(23-8)	25-09-10	2.82	-17.3	0.9		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					531	2.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			537	6.7