





DAOL Daily Bond Morning Brief

- ·금리방향: 하락(3Y), 하락(10Y)
- 일드커브: 플래트닝
- ■스프레드(bp): 국5/3 11.7 (-1.5) 국10/3: 25.7 (-3.0) 국10/5: 14.0 (-1.5) 국30/10: -10.2 (0.8)

KR Market

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.020	-1.0	-1.0	-13.0
통안1Y	2.647	-0.7	-0.8	1.3
통안2Y	2.626	0.5	0.6	1.0
국고3Y	2.563	-0.7	0.3	9.3
국고5Y	2.682	-2.0	-1.8	4.7
국고10Y	2.822	-3.5	-3.9	5.7
국고20Y	2.773	-1.7	-2.7	3.4
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.169	-1.0	0.0	-3.7
회사채 AA- 3Y	3.159	-0.7	0.3	0.8
회사채 BBB+ 3Y	6.508	-0.8	-0.7	1.4
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	106.9	5.0	2.0	
LKTBF 10Y	118.5	31.0	47.0	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2,454.0	-2.52	-3.27	0.49
KOSDAQ	703.8	-3.36	-3.42	-0.28
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1,467.2	1.00	2.51	-0.08
원/100엔	941.3	0.18	2.09	0.66

		(%)	1D(bp)	CRS(CRS(%)		Sprea	Spread(bp)	
1	Υ	2.670	-0.5	1Y	2.660	1	IRS-통1	2.3	0.2
2	2Y	2.585	-1.8	2Y	2.555	-1	IRS-통2	-4.1	-2.3
3	BY	2.575	-2.3	3Y	2.570	-1	IRS-국3	1.2	-1.6
5	iΥ	2.593	-2.5	5Y	2.590	-1	IRS-국5	-9.0	-0.5
10	0Y	2.645	-3.5	10Y	2.575	-1	IRS-국10	-17.7	0.0

US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.251	5.2	4.7	-3.0
UST5Y	4.362	2.9	2.2	-5.2
UST10Y	4.559	1.6	2.2	-4.1
UST30Y	4.793	0.4	2.0	-1.9

KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	2.806	-0.5	-0.7	-11.2	-38.3	-78.1
특수채 AAA 3Y	2.811	-0.6	0.0	2.4	-35.9	-74.1
특수채 AAA 5Y	2.931	-1.6	-1.6	1.4	-28.6	-61.6
은행채 AAA 1Y	2.856	-0.4	-0.6	-6.0	-37.9	-75.9
은행채 AAA 3Y	2.859	-0.6	0.4	4.3	-34.9	-82.4
은행채 AAA 5Y	2.982	-2.0	-1.8	2.3	-29.9	-79
금융채 AA 1Y	3.008	-0.5	-1.0	-14.5	-33.1	-71.4
금융채 AA 3Y	3.079	-1.0	0.0	-3.5	-34.0	-87.8
금융채 AA 5Y	3.305	-2.0	-1.8	1.2	-29.0	-82
금융채 AA- 1Y	3.074	-0.5	-1.0	-15.7	-34.4	-80.9
금융채 AA- 3Y	3.169	-1.0	0.0	-3.7	-34.6	-101.8
금융채 AA- 5Y	3.413	-2.0	-1.8	1.2	-29.0	-90.9
금융채 A+ 1Y	3.769	-0.5	-1.0	-13.5	-37.6	-103.5
금융채 A+ 3Y	4.058	-1.0	0.0	-1.0	-36.7	-105.5
금융채 A+ 5Y	4.538	-2.0	-1.8	2.2	-29.5	-76.5
금융채 A 1Y	4.486	-0.5	-1.0	-13.5	-37.6	-101.5
금융채 A 3Y	4.851	-1.0	0.0	-1.0	-36.7	-102
금융채 A 5Y	5.222	-2.0	-1.8	2.2	-29.5	-75.5
금융채 A- 1Y	5.058	-0.5	-1.0	-13.5	-37.6	-100.5
금융채 A- 3Y	5.491	-1.0	0.0	-1.0	-36.2	-98.5
금융채 A- 5Y	5.863	-2.0	-1.8	2.2	-29.5	-74.7
회사채 AAA 1Y	2.966	-0.8	-1.2	-7.2	-27.3	-73.1
회사채 AAA 3Y	2.994	-0.7	0.3	0.1	-33.2	-75.8
회사채 AAA 5Y	3.067	-1.9	-1.7	0.1	-31.2	-70.8
회사채 AA+ 1Y	3.006	-0.8	-1.0	-7.3	-25.5	-78.4
회사채 AA+ 3Y	3.085	-0.7	0.3	0.9	-31.9	-79.2
회사채 AA+ 5Y	3.154	-1.8	-1.6	-0.9	-30.5	-79.4
회사채 AA 1Y	3.035	-0.8	-1.0	-7.1	-25.0	-79.7
회사채 AA 3Y	3.112	-0.6	0.4	0.9	-32.3	-80.7
회사채 AA 5Y	3.216	-1.9	-1.7	-0.7	-30.4	-79.6
회사채 AA- 1Y	3.066	-0.8	-1.0	-7.0	-24.8	-80.6
회사채 AA- 3Y	3.159	-0.7	0.3	0.8	-32.4	-82.4
회사채 AA- 5Y	3.321	-1.8	-1.6	-0.7	-30.2	-80.3

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목 명	만기	발행금액	발행금리
2월 3일	월	국고채	2y	10,000	2.635
2월 3일	월	통안채	91d	3,800	2.850

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 송목)								
종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급		
산금25신할0100-0203-1	금융채	2026-02-03(화)	4,300	2.760	2.822	AAA		
에이텀1CB	회사채	2028-02-03(목)	15	-	-	-		
더웨일제십삼차1	회사채	2026-02-06(금)	6	3.900	-	-		
				ĺ				
				ĺ				

주체별 현물 순매수/순매도 현황 은행 순매수 상위 5건 종목 민

(십억계약,%,년)

근행 군매구 성취 5건					근행 군대도 성취 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
산금25신할0100-0203-1	26-02-03	2.83	160	1.0	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.70	-90	3.6	
통안03340-2601-02	26-01-02	2.65	140	0.9	국고01500-3012(20-9)	30-12-10	2.81	-45	5.9	
통안DC025-0506-0910	25-05-06	2.87	120	0.3	기업은행(신)2302미3A-14	26-02-14	2.84	-40	1.0	
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.81	50	18.6	국고02625-2703(25-1)	27-03-10	2.63	-35	2.1	
기업은행(신)2502할1A-03	26-02-03	2.83	40	1.0	통안02800-2610-02	26-10-02	2.67	-30	1.7	
수량 합기	예 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기			
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고03000-3412(24-13)	34-12-10	2.83	63	9.9	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.87	-182	9.4	
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.73	54	29.6	통안03340-2601-02	26-01-02	2.65	-160	0.9	
국고02875-2712(24-12)	27-12-10	2.58	15	2.8	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	2.65	-100	8.0	
도로공사917	29-11-28	2.93	10	4.8	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.61	-55	1.8	
국고02375-3112(21-11)	31-12-10	2.85	10	6.9	산금23신이0300-0104-2	26-01-04	2.84	-50	0.9	
	ᅨ 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기			
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
한국수출입금융(변)2502가-이표-1	26-02-03	3.06	80	1.0	현대캐피탈2036-2	27-11-25	3.85	-30	2.8	
국고03000-3412(24-13)	34-12-10	2.83	51	9.9	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.86	-26	9.4	
기업은행(신)2312이1.25A-04	25-03-04	3.03	50	0.1	국고02625-2806(18-4)	28-06-10	2.69	-20	3.4	
산금25신할0100-0203-1	26-02-03	2.83	50	1.0	신한은행29-01-이-1-A	26-01-16	2.86	-20	1.0	
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.72	49	29.6	국고05500-2803(08-2)	28-03-10	2.70	-10	3.1	

외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.66	240	1.6	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	2.87	-50	6.9
통안03340-2601-02	26-01-02	2.62	220	0.9	국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.76	-10	27.1
통안DC025-0506-0910	25-05-06	2.87	110	0.3	국고01500-5003(20-2)	50-03-10	2.69	-9	25.1
국고05500-2803(08-2)	28-03-10	2.69	50	3.1	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	2.51	-7	0.6
국고02750-5409(24-8)	54-09-10	2.71	42	29.6	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.76	-6	28.1
수량 합기	예 및 가중 평균	· 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		12.3

주체별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산 운용	외국인	증권/선물
당일	-3,345	-509	-1,992	21,069	-14,849
5일누적	4,751	984	-1,996	35,534	-36,168

(십억원) Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	186,899		-8,666	19,939	15,841
채권형*	177,779		-86	8,632	41,196
주식형*	131,139		-596	5,366	27,272
저축성예금**	1,702,739	-4	2,797	-20,260	86,147
CD순발행**	60,880	180	-567	696	-9,696

^{*}는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

저이 ㅈㅇ 히나바 거래 내여

전일 주요 회사채 거래 내역					(십억원)
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
현대제철140-2	AA0	2030-01-22	3.074	3.090	120
LG화학58-2	AA+	2030-01-24	3.141	3.160	120
LG유플러스111-1	AA0	2025-06-30	3.101	3.120	60
KT201-1	AAA	2027-12-02	2.869	2.890	60
S-0il60-1	AA0	2029-01-26	3.043	3.030	60
롯데케미칼57-2(지)	AAA	2026-04-28	2.980	3.000	60
메리츠증권2411-3	AA-	2026-11-27	3.167	3.080	60
니드원제팔차4	-	2029-06-11	-	3.870	60
에이치엘만도14-1	AA-	2026-04-27	3.027	3.030	50
한화생명보험7(후)	AA0	2034-12-12	4.416	4.430	49
한화손해보험16(후)	AA-	2035-01-31	4.790	4.610	43
LG에너지솔루션2-3(녹)	AA0	2028-06-29	3.020	3.160	40
지에스에너지6-3	AA0	2025-03-11	3.080	3.150	40
호텔신라71-2	AA-	2025-04-24	3.234	3.160	40
롯데쇼핑66-3	AA-	2025-06-23	3.323	3.330	40
한화에어로스페이스126-1	AA-	2025-04-18	3.195	3.160	40
현대차증권5-2	AA-	2027-02-26	3.462	3.310	30
호텔롯데69-2	AA-	2026-01-27	3.346	3.340	30

^{**}는 T-4일 기준