

■금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락) ■ 일드커브: 스티프닝

DAOL Daily Bond Morning Brief

주간 입찰 일정 및 결과

1					
일자	요일	종목 명	만기	발행금액	발행금리
8월 12일	월	국고채	3у	20000	2.935
8월 12일	월	통안채	91d	5000	3.210
8월 13일	화	국고채	2y	7000	3.000

	3 1.5 (0.0) 국10/3: 6 0/5: 4.5 (0.3) 국30/		
KR Market			
KR Bond(%,bp)	MTY	1D	
CD01D	2 400	2.0	

KR Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.490	3.0	2.0	-6.0
통안1Y	3.030	-1.4	-3.7	-17.3
통안2Y	2.971	-2.6	-2.8	-17.2
국고3Y	2.915	-3.0	-2.5	-17.8
국고5Y	2.930	-2.9	-2.5	-17.4
국고10Y	2.975	-2.7	-2.2	-19.2
국고20Y	2.962	-2.8	-3.3	-17.7
KR Credit(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.491	-1.5	0.8	-9.6
회사채 AA- 3Y	3.404	-2.2	-0.5	-14.1
회사채 BBB+ 3Y	6.969	-3.0	-2.8	-23.7
KTB Futures(tick)	종가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.98	8	4	
LKTBF 10Y	117.35	26	19	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2621.50	0.12	3.94	-8.24
KOSDAQ	764.86	-1.02	4.37	-10.06
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1370.4	-0.12	-0.38	-0.67
원/100엔	924.56	-0.49	-2.93	6.93

	IRS	IRS(%) 1D(bp)		CRS	S(%)	1D(bp)	Sprea	d(bp)	1D(bp)	
Ì	1Y	3.175	-0.75	1Y	2.875	-4	IRS-통1	14.5	0.65	
	2Y	2.963	-2.00	2Y	2.735	-3.5	IRS-통2	-0.9	0.60	
	3Y	2.880	-2.75	3Y	2.69	-4	IRS-국3	-3.5	0.25	
	5Y	2.840	-3.00	5Y	2.69	-3.5	IRS-국5	-9.0	-0.10	
	10Y	2.875	-3.25	10Y	2.6	-3.5	IRS-국10	-10.0	-0.55	

US Bond Market

US Bond(%,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	3.934	-8.5	-4.5	-52
UST5Y	3.673	-7.5	-6.1	-43
UST10Y	3.845	-6	-4.9	-33.9
UST30Y	4.16	-4.2	-2.1	-23.8

KR Credit Market

Bond Yield(%, bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y	
특수채 AAA 1Y	3.243	-0.1	-0.1	-11.0	-33.5	-56.8	
특수채 AAA 3Y	3.127	-1.8	-1.8	-13.0	-49.3	-95.4	
특수채 AAA 5Y	3.139	-1.5	-0.8	-12.6	-49.5	-100.5	
은행채 AAA 1Y	3.286	0.0	1.6	-4.8	-35.8	-58.2	
은행채 AAA 3Y	3.189	-1.9	-1.2	-15.3	-53.2	-103.3	
은행채 AAA 5Y	3.203	-2.1	-1.5	-15.4	-62.3	-115	
금융채 AA 1Y	3.403	0.0	-0.5	-10.5	-34.2	-73.2	
금융채 AA 3Y	3.377	-1.5	-0.2	-11.8	-49.3	-117.4	
금융채 AA 5Y	3.512	-2.0	-1.0	-15.8	-61.6	-124.4	
금융채 AA- 1Y	3.460	0.0	0.0	-10.3	-35.3	-87.2	
금융채 AA- 3Y	3.491	-1.5	0.8	-9.6	-51.0	-131	
금융채 AA- 5Y	3.635	-2.0	-1.0	-16.3	-65.6	-132.8	
금융채 A+ 1Y	4.373	-1.0	-2.5	-13.0	-39.1	-73.3	
금융채 A+ 3Y	4.527	-3.0	-1.7	-14.2	-58.4	-107.8	
금융채 A+ 5Y	4.793	-3.0	-2.5	-16.5	-62.7	-111.1	
금융채 A 1Y	5.095	-1.0	-2.5	-13.0	-38.1	-69.8	
금융채 A 3Y	5.320	-3.0	-1.7	-14.2	-57.1	-103.8	
금융채 A 5Y	5.477	-3.0	-2.5	-16.5	-62.2	-109.6	
금융채 A- 1Y	5.662	-1.0	-2.5	-13.0	-38.6	-70.8	
금융채 A- 3Y	5.950	-3.0	-1.7	-13.7	-56.6	-101.3	
금융채 A- 5Y	6.118	-3.0	-2.5	-16.5	-62.2	-108.8	
회사채 AAA 1Y	3.281	-0.4	-2.0	-16.0	-37.2	-71.8	
회사채 AAA 3Y	3.271	-2.7	-1.2	-15.2	-48.4	-100.4	
회사채 AAA 5Y	3.277	-2.7	-1.3	-15.3	-56.6	-117.9	
회사채 AA+ 1Y	3.299	-0.4	-2.7	-16.2	-37.4	-79.4	
회사채 AA+ 3Y	3.324	-2.2	-0.7	-13.9	-47.5	-110	
회사채 AA+ 5Y	3.349	-2.0	-1.0	-15.0	-60.7	-127.5	
회사채 AA 1Y	3.320	-0.4	-2.6	-16.7	-38.1	-81.4	
회사채 AA 3Y	3.362	-2.2	-0.5	-14.0	-47.7	-109.7	
회사채 AA 5Y	3.414	-2.0	-1.0	-15.0	-61.0	-127.1	
회사채 AA- 1Y	3.349	-0.4	-2.7	-16.4	-38.3	-82.4	
회사채 AA- 3Y	3.404	-2.2	-0.5	-14.1	-48.9	-111.8	
회사채 AA- 5Y	3.517	-2.0	-1.0	-15.2	-61.5	-127.7	

전일 주	요 채권	밬행	결과	(밬행	금액	상위	10개 종목	.)
------	------	----	----	-----	----	----	--------	----

신달 구요 세면 달행 얼마 (달행 문	14 94 In	/개 중독 /				
종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
통안DC024-1112-0910	통안채	2024-11-12(화)	5000	3.210	3.291	통안
신한은행2024-1 이중상환(사)	금융채	2034-08-13(일)	3000	3.190	3.603	AAA
우리은행28-08-이표03-갑-13	금융채	2027-08-13(금)	3000	3.190	3.208	AAA
산금24신이0300-0813-1	금융채	2027-08-13(금)	2700	3.090	3.089	AAA
신한은행28-08-이-1-B(변동)	금융채	2025-08-13(수)	2500	3.550	3.286	AAA
국민은행2024-1-1(이중상환)	금융채	2029-08-13(월)	2000	3.160	3.224	AAA
주택금융공사MBS 2024-16(1-	특수채	2026-08-13(목)	1300	3.206	3.184	AAA
주택금융공사MBS 2024-16(1-	특수채	2025-08-13(수)	1192	3.266	3.270	AAA
메리츠캐피탈260-2	금융채	2027-02-12(금)	1100	4.58	4.498	A+
자산관리공사제95회3008-13(/	특수채	2027-08-13(금)	1000	3.095	3.145	AAA

즈체벽 혀문 수매스/수매도 혀화

주체별 현물 순매수/순매도 현황 (십 억 계 약, %, 년)											
은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
산금24신이0300-0813-1	27-08-13	3.09	220	3.0	국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.04	-80	1.3		
우리은행28-08-미표03-갑-13	27-08-13	3.20	120	3.0	통안03200-2607-02	26-07-02	2.98	-80	1.9		
주택금용공사MBS 2024-16(1-2)(사)	26-08-13	3.21	110	2.0	국고02875-2609(24-9)	26-09-10	2.99	-63	2.1		
국민은행2024-1-1(이중상환)	29-08-13	3.16	110	5.0	통안04020-2510-02	25-10-02	3.04	-60	1.1		
국고01500-3012(20-9)	30-12-10	3.00	100	6.3	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.96	-60	1.8		
수량 합기	내및 가중 평균	산존만기	660	3.7	수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기		1.6		
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건						
× D									TEXTOLAL		

보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
신한은행2024-1 이중상환(사)	34-08-13	3.19	160	10.0	국고01875-2606(16-3)	26-06-10	2.98	-100	1.8
아이엠캐피탈120-2	27-08-13	3.79	70	3.0	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.00	-60	8.8
국민은행2024-1-2(이중상환)	34-08-13	3.19	60	10.0	통안03670-2507-02	25-07-02	3.03	-60	0.9
통안03200-2607-02	26-07-02	2.97	50	1.9	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.99	-40	9.3
한국장학재단24-14(사)	44-08-13	3.09	30	20.0	통안04020-2510-02	25-10-02	3.03	-40	1.1
수량 합	계 및 가중 평균	· 잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	· 잔존만기		3.9
트시 수매수 산위 5거					트시 수매도 산위 5거				

투신 순배수 상위 5건					투신 순내노 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.93	68	2.8	기업은행(신)2306이1.5A-08(사)	24-12-08	3.47	-30	0.3
신한은행28-08-이-1-B(변동)	25-08-13	3.55	50	1.0	산금23신미0106-0609-1	24-12-09	3.47	-30	0.3
메리츠캐피탈260-1	26-02-13	4.53	50	1.5	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	2.99	-23	8.8
메리츠캐피탈260-2	27-02-12	4.58	40	2.5	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	2.94	-22	4.6
국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.04	38	1.3	산금23신미0106-0901-1	25-03-01	3.41	-20	0.5
수량 합	계 및 가중 평균	잔존만기			수량 합	계 및 가중 평균	· 잔존만기		

귀속은 프네트 OTI 2년					귀속은 프레포 용제 2년				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.94	200	2.3	국고01375-2409(19-5)	24-09-10	3.01	-80	0.1
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.98	131	9.8	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.08	-21	0.8
국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.03	100	1.3	국고03125-5209(22-9)	52-09-10	3.30	-10.0	28.1
국고03250-2603(24-3)	26-03-10	3.02	100	1.6	국고01875-5103(21-2)	51-03-10	2.89	-10.0	26.6
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.88	60	29.6	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	2.81	-7.0	29.1
수량 합기	네 및 가중 평균	산존만기	591	6.5	수량 합	계 및 가중 평균	· 잔존만기	-128	6.0

주체별 선물 순매수

주체별 선물	로 순매수				(계약수)
구분	안하	보험	자산 운용	외국인	증권/선물
당일	2604	-382	-288	2968	-3524
5일누적	-1102	11	-1466	13838	-11945

Fund Flow (십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	201174.7	-2140.1	-7803.7	-5300.2	30117.2
채권형*	168776.2	494.3	1097.7	11289	32193
주식형*	114444.9	1739.4	-1923.9	-5588.7	10577.2
저축성예금**	1656315	1295.9	4849.8	5935	39722.2
CD순발행**	69908.4	-424.8	-180.8	-972.5	-667

^{*}는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

전일 주요 회사채 거래 내역						
종목 명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량	
엔에이치투자65-1	AA+	2024-10-25	3.482	3.55	100	
신한투자증권2401-2	AA0	2027-01-22	3.4	3.4	90	
미래에셋증권71	AA0	2027-04-05	3.451	3.45	60	
오토피아제칠십차유1-28	AAA	2024-10-18	3.568	3.4	60	
한국투자증권22	AA0	2025-02-28	3.559	3.53	50	
SK네트웍스183-2	AA-	2026-04-19	3.477	3.49	50	
SK304-1	AA+	2024-09-13	3.394	3.57	40	
현대케피코12-1	A+	2026-03-20	3.58	3.55	40	
하오준케이제오차5-1		2028-04-21	-	5.52	40	
JB 금융 지주20-1	AA+	2025-08-13	-	3.34	40	
JB금융지주20-2	AA+	2026-08-13	-	3.4	40	
신세계141-2	AA0	2029-01-18	3.308	3.3	40	
신한투자증권2402-2	AA0	2027-02-19	3.405	3.41	40	
호텔신라70-3	AA-	2026-04-23	3.391	3.42	40	
신세계센트럴시티9-1	AA-	2026-07-17	3.272	3.33	30	
JB 금융 지주11-2	AA+	2025-05-23	3.536	3.49	30	
SK네트웍스185-3	AA-	2028-04-17	3.551	3.56	20	
다올투자증권554-1	A-	1930-08-13	-	8	20	

^{**}는 T-4일 기준