



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

21 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승)
- 일드커브: 보합
- 스프레드(bp): 국5/3 2.5 (-0.5) 국10/3: 7.5 (0.0)
국10/5: 5.0 (0.5) 국30/10: -11.0 (-0.2)

KR Market

| KR Bond(% ,bp) | YTM | 1D | 1W | 1M |
|----------------|-------|-----|------|-------|
| CD91D | 3.600 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 통안1Y | 3.342 | 1.3 | -1.8 | -2.8 |
| 통안2Y | 3.256 | 2.6 | -7.9 | -17.4 |
| 국고3Y | 3.195 | 4.5 | -8.3 | -21.7 |
| 국고5Y | 3.220 | 4.0 | -8.0 | -22.5 |
| 국고10Y | 3.270 | 4.5 | -8.2 | -22.5 |
| 국고20Y | 3.235 | 4.0 | -5.5 | -19.5 |

| KR Credit(% ,bp) | YTM | 1D | 1W | 1M |
|------------------|-------|-----|-------|-------|
| 금융채AA- 3Y | 3.714 | 4.0 | -10.0 | -25.7 |
| 회사채 AA- 3Y | 3.666 | 4.6 | -6.0 | -18.1 |
| 회사채 BBB+ 3Y | 7.338 | 4.5 | -8.1 | -24.7 |

| KTBF Futures(tick) | 증가 | 1D | 1W | 저평 |
|--------------------|--------|-----|----|----|
| KTBF 3Y | 105.16 | -13 | 23 | |
| LKTBF 10Y | 114.60 | -36 | 43 | |

| KR Stock(%) | Index | 1D | 1W | 1M |
|-------------|---------|-------|-------|------|
| KOSPI | 2807.63 | 0.37 | 1.91 | 3.06 |
| KOSDAQ | 857.51 | -0.43 | -1.59 | 1.30 |

| FX Market(%) | Price | 1D | 1W | 1M |
|--------------|--------|-------|------|------|
| 원/달러 | 1384.6 | 0.20 | 0.78 | 1.56 |
| 원/100엔 | 874.34 | -0.18 | 0.07 | 0.15 |

| IRS(%) | | 1D(bp) | CRS(%) | | 1D(bp) | Spread(bp) | 1D(bp) | |
|--------|-------|--------|--------|-------|--------|------------|--------|-------|
| 1Y | 3.408 | 1.25 | 1Y | 3.365 | 5 | IRS-통1 | 6.6 | -0.05 |
| 2Y | 3.273 | 2.25 | 2Y | 3.115 | 5.5 | IRS-통2 | 1.7 | -0.35 |
| 3Y | 3.205 | 3.75 | 3Y | 3.1 | 6 | IRS-국3 | 1.0 | -0.75 |
| 5Y | 3.148 | 4.00 | 5Y | 3.075 | 6 | IRS-국5 | -7.3 | 0.00 |
| 10Y | 3.150 | 4.00 | 10Y | 2.98 | 10 | IRS-국10 | -12.0 | -0.50 |

US Bond Market

| US Bond(% ,bp) | YTM | 1D | 1W | 1M |
|----------------|-------|-----|-----|-------|
| UST2Y | 4.75 | 2.5 | 4.5 | -8.9 |
| UST5Y | 4.282 | 3.1 | 3.1 | -15.9 |
| UST10Y | 4.266 | 3.9 | 1.7 | -15.1 |
| UST30Y | 4.399 | 4.2 | 0 | -15.2 |

KR Credit Market

| Bond Yield(% ,bp) | Yield | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|-------------------|-------|-----|-------|-------|-------|-------|
| 특수채 AAA 1Y | 3.518 | 0.5 | -2.4 | -6.0 | -4.9 | -26.6 |
| 특수채 AAA 3Y | 3.379 | 4.5 | -7.5 | -20.3 | -13.1 | -60 |
| 특수채 AAA 5Y | 3.381 | 3.9 | -6.2 | -20.6 | -14.9 | -60.2 |
| 은행채 AAA 1Y | 3.515 | 0.4 | -4.7 | -10.9 | -9.1 | -34.5 |
| 은행채 AAA 3Y | 3.449 | 4.0 | -8.8 | -23.4 | -17.8 | -66.5 |
| 은행채 AAA 5Y | 3.485 | 3.5 | -9.7 | -28.6 | -30.2 | -70.6 |
| 금융채 AA 1Y | 3.635 | 0.5 | -4.5 | -10.0 | -7.0 | -41.2 |
| 금융채 AA 3Y | 3.606 | 4.0 | -9.7 | -23.4 | -23.5 | -71 |
| 금융채 AA 5Y | 3.807 | 3.5 | -9.7 | -27.6 | -31.1 | -77.5 |
| 금융채 AA- 1Y | 3.678 | 0.5 | -5.0 | -12.0 | -15.3 | -47.5 |
| 금융채 AA- 3Y | 3.714 | 4.0 | -10.0 | -25.7 | -33.7 | -78.7 |
| 금융채 AA- 5Y | 3.946 | 3.5 | -9.7 | -29.0 | -36.3 | -85.2 |
| 금융채 A+ 1Y | 4.629 | 0.5 | -5.5 | -12.5 | -13.5 | -40.7 |
| 금융채 A+ 3Y | 4.806 | 4.0 | -10.0 | -27.0 | -26.5 | -61.9 |
| 금융채 A+ 5Y | 5.090 | 3.5 | -9.7 | -28.5 | -25.0 | -61.9 |
| 금융채 A 1Y | 5.351 | 0.5 | -5.5 | -11.5 | -12.0 | -39.2 |
| 금융채 A 3Y | 5.591 | 4.0 | -10.0 | -26.5 | -24.5 | -60.2 |
| 금융채 A 5Y | 5.774 | 3.5 | -9.7 | -28.0 | -24.5 | -61.5 |
| 금융채 A- 1Y | 5.923 | 0.5 | -5.5 | -11.5 | -12.0 | -40.2 |
| 금융채 A- 3Y | 6.216 | 4.0 | -10.0 | -26.5 | -24.5 | -58.7 |
| 금융채 A- 5Y | 6.415 | 3.5 | -9.7 | -28.0 | -24.5 | -61.1 |
| 회사채 AAA 1Y | 3.587 | 1.4 | -3.1 | -6.9 | -7.2 | -35 |
| 회사채 AAA 3Y | 3.530 | 4.2 | -8.3 | -19.2 | -19.3 | -62.8 |
| 회사채 AAA 5Y | 3.546 | 4.0 | -7.6 | -24.3 | -22.7 | -75.4 |
| 회사채 AA+ 1Y | 3.607 | 1.3 | -3.4 | -7.6 | -8.4 | -42.6 |
| 회사채 AA+ 3Y | 3.581 | 4.6 | -6.0 | -17.7 | -22.6 | -69.6 |
| 회사채 AA+ 5Y | 3.636 | 4.0 | -8.2 | -26.7 | -31.1 | -81 |
| 회사채 AA 1Y | 3.628 | 1.3 | -3.6 | -8.3 | -10.5 | -44.3 |
| 회사채 AA 3Y | 3.622 | 4.6 | -5.8 | -17.4 | -22.9 | -69.6 |
| 회사채 AA 5Y | 3.704 | 4.0 | -8.3 | -26.7 | -30.7 | -80.1 |
| 회사채 AA- 1Y | 3.657 | 1.4 | -3.6 | -8.2 | -11.2 | -45.4 |
| 회사채 AA- 3Y | 3.666 | 4.6 | -6.0 | -18.1 | -24.1 | -71.5 |
| 회사채 AA- 5Y | 3.815 | 4.0 | -8.3 | -26.4 | -30.4 | -79.8 |

주간 입찰 일정 및 결과

| 일자 | 요일 | 종목명 | 만기 | 발행금액 | 발행금리 |
|--------|----|-----|-----|-------|-------|
| 6월 17일 | 월 | 국고채 | 10y | 27000 | 3.275 |
| 6월 17일 | 월 | 통안채 | 91d | 6200 | 3.470 |
| 6월 19일 | 수 | 통안채 | 3y | 13700 | 3.250 |

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

| 종목명 | 구분 | 만기일 | 발행금액 | 표면금리 | 민평3사 | 신용등급 |
|----------------------|-----|---------------|-------|-------|-------|------|
| 재정2024-0210-0063 | 국채 | 2024-08-22(목) | 20000 | 3.550 | 3.441 | AAA |
| 통안DC024-0919-0910 | 통안채 | 2024-09-19(목) | 6200 | 3.470 | 3.443 | 통안 |
| 미래에셋증권73(후) | 회사채 | 2030-06-20(목) | 3700 | 5.100 | 3.919 | AA- |
| 2024기보제일차1-2(사) | 회사채 | 2027-06-20(일) | 1726 | 3.487 | 3.488 | AAA |
| 기업은행(단)2406월214A-20 | 금융채 | 2025-01-20(월) | 1600 | 3.440 | 3.530 | AAA |
| 국가철도공단채권409 | 특수채 | 2029-06-20(수) | 1600 | 3.309 | 3.342 | AAA |
| 우리금융캐피탈503-2 | 금융채 | 2027-06-18(금) | 1300 | 3.650 | 3.671 | AA- |
| 개인03540-3406 | 국채 | 2034-06-20(화) | 1231 | 3.540 | - | AAA |
| 토지주택채권482(사) | 특수채 | 2034-06-20(화) | 1200 | 4.25 | 3.398 | AAA |
| 자산관리공사제90회3006-20(사) | 특수채 | 2027-06-20(일) | 1000 | 3.261 | 3.334 | AAA |

주제별 현물 순매수/순매도 현황

| 은행 순매수 상위 5건 | | | | | 은행 순매도 상위 5건 | | | | | | |
|----------------------|----------|------|-----|------|-----------------------|--------------------|------|-------|------|------|------|
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 토지주택채권482(사) | 34-06-20 | 4.25 | 120 | 10.0 | 국고03500-2809(23-6) | 28-09-10 | 3.24 | -130 | 4.2 | | |
| 국가철도공단채권409 | 29-06-20 | 3.31 | 100 | 5.0 | 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.32 | -70 | 1.2 | | |
| 기업은행(단)2406월214A-20 | 25-01-20 | 3.51 | 100 | 0.6 | 국고02375-3112(21-11) | 31-12-10 | 3.30 | -55 | 7.5 | | |
| 자산관리공사제90회3006-20(사) | 27-06-20 | 3.26 | 90 | 3.0 | 통안04020-2510-02 | 25-10-02 | 3.31 | -50 | 1.3 | | |
| 국민주택1종24-06 | 29-06-30 | 3.33 | 88 | 5.0 | 기업은행(신)2306012A-15 | 25-06-15 | 3.47 | -50 | 1.0 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | 498 | 5.0 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | -355 | 3.3 |
| 보통/기금 순매수 상위 5건 | | | | | 보통/기금 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 2024기보제일차1-2(사) | 27-06-20 | 3.49 | 103 | 3.0 | 국고03875-2612(23-10) | 26-12-10 | 3.23 | -80 | 2.5 | | |
| 국고03500-3406(24-5) | 34-06-10 | 3.27 | 96 | 10.0 | 국고03625-5309(23-7) | 53-09-10 | 3.15 | -49 | 29.2 | | |
| 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.32 | 77 | 1.2 | 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.27 | -28 | 9.5 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.19 | 77 | 3.0 | 국고04250-3212(22-14) | 32-12-10 | 3.28 | -20 | 8.5 | | |
| 통안04020-2510-02 | 25-10-02 | 3.31 | 70 | 1.3 | 하나금융지주57-2 | 26-01-16 | 3.49 | -20 | 1.6 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | 422 | 4.0 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | -197 | 10.6 |
| 투신 순매수 상위 5건 | | | | | 투신 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 재정2024-0210-0063 | 24-08-22 | 3.55 | 253 | 0.2 | 국고01375-2409(19-5) | 24-09-10 | 3.14 | -50 | 0.2 | | |
| 우리금융캐피탈503-2 | 27-06-18 | 3.65 | 100 | 3.0 | 기업은행(신)2404012A-23(사) | 26-04-23 | 3.35 | -40 | 1.8 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.18 | 67 | 3.0 | 우리은행28-01-월안9M-19 | 24-10-19 | 3.58 | -30 | 0.3 | | |
| 하나캐피탈400-1 | 25-01-27 | 3.66 | 50 | 0.6 | 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.29 | -20 | 9.5 | | |
| 통안DC024-0919-0910 | 24-09-19 | 3.53 | 50 | 0.2 | 통안03670-2507-02 | 25-07-02 | 3.34 | -20 | 1.0 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | 520 | 1.1 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | -160 | 1.9 |
| 외국인 순매수 상위 5건 | | | | | 외국인 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 재정2024-0210-0063 | 24-08-22 | 3.56 | 235 | 0.2 | 통안01510-2409-03 | 24-09-03 | 3.38 | -66 | 0.2 | | |
| 국고02375-2703(22-1) | 27-03-10 | 3.21 | 105 | 2.7 | 국고03250-2803(23-1) | 28-03-10 | 3.22 | -60 | 3.7 | | |
| 국고01750-2609(21-7) | 26-09-10 | 3.23 | 100 | 2.2 | 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.33 | -50 | 1.2 | | |
| 국고01375-3006(20-4) | 30-06-10 | 3.24 | 50 | 6.0 | 국고04000-3112(11-7) | 31-12-10 | 3.28 | -19.8 | 7.5 | | |
| 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.13 | 34 | 29.7 | 국고02500-5203(22-2) | 52-03-10 | 3.30 | -14.0 | 27.7 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | 524 | 3.5 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | -210 | 4.0 |

주제별 선물 순매수

| 구분 | 은행 | 보험 | 자산운용 | 외국인 | 증권/선물 |
|------|--------|-----|-------|-------|--------|
| 당일 | 2408 | 437 | -400 | -207 | -3364 |
| 5일누적 | -17445 | 915 | -2862 | 74324 | -45781 |

Fund Flow

| 구분 | 잔액 | 1D | 1W | 1M | YTD |
|---------|-----------|--------|--------|---------|---------|
| MMF* | 204030.4 | -19.4 | 2808.7 | -3986.7 | 32972.9 |
| 채권형* | 154442 | 446.8 | 1757.5 | 1491.6 | 17858.8 |
| 주식형* | 116074.3 | 1197.5 | 1544.6 | 2780.6 | 12206.6 |
| 저축성예금** | 1640664.8 | 8648.9 | 9910.3 | 15096.6 | 24072 |
| CD순발행** | 70567.6 | -1840 | -2007 | -78.9 | -7.8 |

*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

**는 T-4일 기준

전일 주요 회사채 거래 내역

| 종목명 | 신용등급 | 만기일 | 민평수익률 | 평균수익률 | 거래량 |
|-----------------|------|------------|-------|-------|-----|
| 2024기보제일차1-2(사) | AAA | 2027-06-20 | - | 3.49 | 378 |
| 삼양홀딩스93-1 | AA- | 2025-11-28 | 3.566 | 3.57 | 150 |
| 2024기보제일차1-1(녹) | AAA | 2027-06-20 | - | 3.49 | 117 |
| 메리츠증권2304-1 | AA- | 2026-04-14 | 3.833 | 3.76 | 60 |
| 메리츠증권2311-3 | AA- | 2026-11-23 | 3.837 | 3.76 | 60 |
| 한국투자증권21-1 | AAO | 2024-10-15 | 3.768 | 3.7 | 50 |
| BNK금융지주27 | AAA | 2024-07-26 | 3.611 | 3.63 | 50 |
| LG화학56-2 | AA+ | 2026-01-27 | 3.453 | 3.46 | 40 |
| 에이치디현대오일뱅크129-1 | AA- | 2027-01-24 | 3.503 | 3.5 | 40 |
| 에스케이하이닉스225-1 | AAO | 2027-04-08 | 3.451 | 3.49 | 40 |
| POSCO312-1 | AA+ | 2025-07-07 | 3.475 | 3.52 | 40 |
| 하나금융지주57-2 | AAA | 2026-01-16 | 3.512 | 3.49 | 40 |
| 한국투자금융지주36-2 | AA- | 2026-09-18 | 3.789 | 3.72 | 40 |
| 디에이치블록2 | - | 2028-11-03 | - | 4.09 | 40 |
| KT186-3 | AAA | 2024-06-26 | 3.462 | 3.61 | 20 |
| 더퍼스트하이테크팔차3-1 | - | 2028-12-20 | - | 4.37 | 20 |
| 베스트제삼차유1-3 | AAA | 2025-10-20 | - | 4.02 | 20 |
| 베스트제삼차유1-5 | AAA | 2026-02-20 | - | 4.01 | 20 |