



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

28 June. 2024

| 전일 국내 채권 시장 요약 | |
|--|--|
| • 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승) | |
| • 일드커브: 스티프닝 | |
| • 스프레드(bp): 국5/3 2.3 (0.5) 국10/3: 8.3 (1.5) 국10/5: 6.0 (1.0) 국30/10: -7.5 (1.0) | |

KR Market

| KR Bond(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
|-------------------|--|---------|-------|-------|-------|
| CD91D | | 3.600 | 0.0 | 0.0 | -2.0 |
| 통안1Y | | 3.342 | -0.2 | 0.0 | -2.5 |
| 통안2Y | | 3.280 | 1.0 | 2.4 | -12.5 |
| 국고3Y | | 3.212 | 0.4 | 1.7 | -17.5 |
| 국고5Y | | 3.236 | 1.1 | 1.6 | -17.9 |
| 국고10Y | | 3.295 | 2.0 | 2.5 | -18.2 |
| 국고20Y | | 3.272 | 2.9 | 3.7 | -15.5 |
| KR Credit(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
| 금융채AA- 3Y | | 3.718 | 0.0 | 0.4 | -22.3 |
| 회사채 AA- 3Y | | 3.669 | 0.1 | 0.3 | -14.7 |
| 회사채 BBB+ 3Y | | 7.341 | 0.4 | 0.3 | -19.4 |
| KTB Futures(tick) | | 증가 | 1D | 1W | 저평 |
| KTBF 3Y | | 105.09 | -5 | -18 | |
| LKTBF 10Y | | 114.30 | -25 | -54 | |
| KR Stock(%) | | Index | 1D | 1W | 1M |
| KOSPI | | 2784.06 | -0.29 | -0.84 | 2.25 |
| KOSDAQ | | 838.65 | -0.41 | -2.20 | -1.45 |
| FX Market(%) | | Price | 1D | 1W | 1M |
| 원/달러 | | 1385.8 | -0.21 | 0.08 | 2.01 |
| 원/100엔 | | 863.05 | -0.63 | -1.29 | -0.30 |

| IRS(%) | | 1D(bp) | CRS(%) | | 1D(bp) | Spread(bp) | | 1D(bp) |
|--------|-------|--------|--------|-------|--------|------------|-------|--------|
| 1Y | 3.430 | 1.50 | 1Y | 3.315 | 0.5 | IRS-통1 | 8.8 | 1.70 |
| 2Y | 3.288 | 1.75 | 2Y | 3.095 | 2.5 | IRS-통2 | 0.8 | 0.75 |
| 3Y | 3.220 | 1.75 | 3Y | 3.07 | 2 | IRS-국3 | 0.8 | 1.35 |
| 5Y | 3.178 | 2.00 | 5Y | 3.05 | 1 | IRS-국5 | -5.9 | 0.90 |
| 10Y | 3.183 | 2.25 | 10Y | 2.97 | 0.5 | IRS-국10 | -11.3 | 0.25 |

US Bond Market

| US Bond(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
|--------------|--|-------|------|------|-------|
| UST2Y | | 4.722 | -3.6 | -2.8 | -26.5 |
| UST5Y | | 4.304 | -4.6 | 2.2 | -29.7 |
| UST10Y | | 4.291 | -4.3 | 2.5 | -26.4 |
| UST30Y | | 4.429 | -3.6 | 3 | -24 |

KR Credit Market

| Bond Yield(%bp) | | Yield | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|-----------------|--|-------|------|------|-------|-------|-------|
| 특수채 AAA 1Y | | 3.514 | 0.2 | -0.4 | -5.5 | -3.8 | -28.7 |
| 특수채 AAA 3Y | | 3.398 | 0.4 | 1.9 | -15.2 | -12.0 | -57.1 |
| 특수채 AAA 5Y | | 3.405 | 1.5 | 2.4 | -14.7 | -11.5 | -57 |
| 은행채 AAA 1Y | | 3.511 | 0.1 | -0.4 | -10.2 | -7.0 | -35.9 |
| 은행채 AAA 3Y | | 3.465 | 0.4 | 1.6 | -18.5 | -17.1 | -64.3 |
| 은행채 AAA 5Y | | 3.493 | 1.0 | 0.8 | -23.5 | -26.5 | -68.6 |
| 금융채 AA 1Y | | 3.636 | 0.3 | 0.1 | -9.1 | -5.4 | -42.6 |
| 금융채 AA 3Y | | 3.615 | 0.2 | 0.9 | -20.0 | -21.4 | -69.6 |
| 금융채 AA 5Y | | 3.814 | 1.2 | 0.7 | -22.8 | -29.7 | -73.8 |
| 금융채 AA- 1Y | | 3.686 | 0.3 | 0.8 | -9.9 | -12.0 | -49.7 |
| 금융채 AA- 3Y | | 3.718 | 0.0 | 0.4 | -22.3 | -30.6 | -77.1 |
| 금융채 AA- 5Y | | 3.950 | 1.2 | 0.4 | -24.1 | -35.2 | -81.8 |
| 금융채 A+ 1Y | | 4.629 | 0.0 | 0.0 | -11.2 | -12.5 | -41.2 |
| 금융채 A+ 3Y | | 4.802 | 0.2 | -0.4 | -23.6 | -27.7 | -60.8 |
| 금융채 A+ 5Y | | 5.097 | 1.2 | 0.7 | -23.3 | -24.8 | -58.7 |
| 금융채 A 1Y | | 5.351 | 0.0 | 0.0 | -10.7 | -11.5 | -38.7 |
| 금융채 A 3Y | | 5.595 | 0.2 | 0.4 | -22.8 | -24.9 | -57.3 |
| 금융채 A 5Y | | 5.781 | 1.2 | 0.7 | -23.3 | -24.3 | -58.3 |
| 금융채 A- 1Y | | 5.918 | -0.5 | -0.5 | -11.2 | -12.0 | -40.2 |
| 금융채 A- 3Y | | 6.220 | 0.2 | 0.4 | -22.8 | -24.9 | -55.8 |
| 금융채 A- 5Y | | 6.422 | 1.2 | 0.7 | -23.3 | -24.3 | -57.9 |
| 회사채 AAA 1Y | | 3.578 | -0.4 | -0.9 | -6.9 | -8.2 | -37.1 |
| 회사채 AAA 3Y | | 3.543 | 0.4 | 1.3 | -15.7 | -19.4 | -60.1 |
| 회사채 AAA 5Y | | 3.549 | 1.0 | 0.3 | -20.1 | -23.6 | -73.8 |
| 회사채 AA+ 1Y | | 3.599 | -0.5 | -0.8 | -7.3 | -8.4 | -44.4 |
| 회사채 AA+ 3Y | | 3.586 | 0.1 | 0.5 | -14.3 | -22.1 | -67.9 |
| 회사채 AA+ 5Y | | 3.638 | 0.7 | 0.2 | -22.4 | -30.9 | -79.3 |
| 회사채 AA 1Y | | 3.619 | -0.6 | -0.9 | -8.3 | -10.3 | -46.3 |
| 회사채 AA 3Y | | 3.626 | 0.0 | 0.4 | -14.3 | -22.4 | -68.1 |
| 회사채 AA 5Y | | 3.703 | 0.6 | -0.1 | -22.8 | -30.9 | -79.5 |
| 회사채 AA- 1Y | | 3.644 | -0.9 | -1.3 | -8.5 | -11.5 | -47.8 |
| 회사채 AA- 3Y | | 3.669 | 0.1 | 0.3 | -14.7 | -23.7 | -70.2 |
| 회사채 AA- 5Y | | 3.810 | 0.7 | -0.5 | -22.9 | -31.0 | -79 |

주간 입찰 일정 및 결과

| 일자 | 요일 | 종목명 | 만기 | 발행금액 | 발행금리 |
|--------|----|-----|-----|-------|-------|
| 6월 24일 | 월 | 국고채 | 5y | 23000 | 3.200 |
| 6월 24일 | 월 | 통안채 | 91d | 5900 | 3.470 |
| 6월 25일 | 화 | 국고채 | 20y | 7000 | 3.220 |

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

| 종목명 | 구분 | 만기일 | 발행금액 | 표면금리 | 민평3사 | 신용등급 |
|---------------------|-----|---------------|-------|-------|-------|------|
| 재정2024-0220-0063 | 국채 | 2024-08-29(목) | 20000 | 3.540 | 3.446 | AAA |
| 에스케이온신증자본증권 1 | 회사채 | 2054-06-27(토) | 5000 | 6.424 | - | AO |
| 산금24산이0109-0627-2 | 금융채 | 2026-03-27(금) | 2800 | 3.400 | 3.375 | AAA |
| 산금24산이0103-0627-1 | 금융채 | 2025-09-27(토) | 2700 | 3.460 | 3.437 | AAA |
| 국민은행4406이표일(03)1-27 | 금융채 | 2025-06-27(금) | 2200 | 3.500 | 3.510 | AAA |
| 중소벤처기업진흥채권863(사) | 특수채 | 2029-06-27(수) | 1700 | 3.334 | 3.390 | AAA |
| 케이비부동산신탁신증자본증권 1 | 회사채 | 2054-06-27(토) | 1700 | 7.800 | - | BBB+ |
| 기업은행(단)2406할273A-27 | 금융채 | 2025-03-27(목) | 1500 | 3.430 | 3.516 | AAA |
| 인천도시공사233 [특수채] | 특수채 | 2027-06-27(일) | 1500 | 3.48 | 3.514 | AA+ |
| GS칼텍스143-1 | 회사채 | 2027-06-27(일) | 1500 | 3.407 | 3.585 | AA+ |

주제별 현물 순매수/순매도 현황

| 은행 순매수 상위 5건 | | | | | 은행 순매도 상위 5건 | | | | | | |
|---------------------|----------|------|-----|------|--------------------------|----------|--------------------|-------|---------|------|---------|
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 산금24산이0103-0627-1 | 25-09-27 | 3.46 | 170 | 1.3 | 국고33375-2503(23-3) | 25-03-10 | 3.35 | -100 | 0.7 | | |
| 중소벤처기업진흥채권863(사) | 29-06-27 | 3.33 | 130 | 5.0 | 국민은행4406이표일10M-19 | 25-04-19 | 3.53 | -50 | 0.8 | | |
| 산금24산이0109-0627-2 | 26-03-27 | 3.40 | 100 | 1.7 | 통안03280-2504-02 | 25-04-02 | 3.37 | -30 | 0.8 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.24 | 80 | 3.0 | 국민주채1종23-01 | 28-01-31 | 3.34 | -30 | 3.6 | | |
| 국고02375-2703(22-1) | 27-03-10 | 3.25 | 70 | 2.7 | 토지주택채권70 | 26-07-08 | 3.40 | -20 | 2.0 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 550 | 2.7 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | 230 | 1.2 |
| 보통/기업 순매수 상위 5건 | | | | | 보통/기업 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 산금24산이0109-0627-2 | 26-03-27 | 3.40 | 150 | 1.7 | 신한금융조건부(상)12-1(신증-영구-5년) | 99-12-31 | 4.88 | -50 | 7,980.8 | | |
| 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.22 | 134 | 29.7 | 통안03365-2604-02 | 26-04-02 | 3.29 | -40 | 1.8 | | |
| 국고03375-2503(23-3) | 25-03-10 | 3.36 | 100 | 0.7 | 국고02625-2806(18-4) | 28-06-10 | 3.29 | -30 | 4.0 | | |
| 국고03500-3406(24-5) | 34-06-10 | 3.31 | 73 | 10.0 | 한국전력1090 | 28-11-19 | 3.45 | -30 | 4.4 | | |
| 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.34 | 52 | 9.5 | 국고03250-2903(24-1) | 29-03-10 | 3.25 | -22 | 4.7 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 509 | 10.9 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -172 | 2,322.2 |
| 특수 순매수 상위 5건 | | | | | 특수 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 기업은행(단)2406할273A-27 | 25-03-27 | 3.52 | 150 | 0.7 | 국고38875-2612(23-10) | 26-12-10 | 3.26 | -39 | 2.5 | | |
| 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.22 | 113 | 29.7 | 국고3250-2803(23-1) | 28-03-10 | 3.27 | -35 | 3.7 | | |
| 인천도시공사233 | 27-06-27 | 3.48 | 90 | 3.0 | 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.33 | -27 | 9.5 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.21 | 57 | 3.0 | 케이비국민카드372-6 | 24-12-30 | 3.61 | -20 | 0.5 | | |
| 국고03250-2903(24-1) | 29-03-10 | 3.25 | 53 | 4.7 | JB 우리캐피탈511-3 | 26-05-29 | 3.72 | -20 | 1.9 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 463 | 9.0 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -141 | 3.8 |
| 외국인 순매수 상위 5건 | | | | | 외국인 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 국고02375-2703(22-1) | 27-03-10 | 3.25 | 101 | 2.7 | 국고33375-2503(23-3) | 25-03-10 | 3.37 | -100 | 0.7 | | |
| 국고03500-3406(24-5) | 34-06-10 | 3.30 | 60 | 10.0 | 국고3250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.24 | -92 | 3.0 | | |
| 통안03430-2703-03 | 27-03-03 | 3.30 | 60 | 2.7 | 국고01875-2412(21-10) | 24-12-10 | 3.08 | -70.0 | 0.5 | | |
| 국고03250-2603(24-3) | 26-03-10 | 3.28 | 50 | 1.7 | 국고채원금01240-5203(22-2) | 52-03-10 | 3.17 | -10.0 | 27.7 | | |
| 국고03250-3306(23-5) | 33-06-10 | 3.33 | 40 | 9.0 | 국고3125-2506(22-4) | 25-06-10 | 3.34 | -2.3 | 1.0 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 311 | 4.7 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -274 | 2.4 |

주제별 선물 순매수

| (계약수) | | | | | |
|-------|------|-----|-------|-------|--------|
| 구분 | 은행 | 보험 | 자산운용 | 외국인 | 증권/선물 |
| 당일 | 4502 | 106 | -283 | -2587 | -2092 |
| 5일누적 | -74 | 197 | -2358 | 25233 | -21239 |

Fund Flow

| (십억원) | | | | | |
|---------|-----------|---------|---------|----------|---------|
| 구분 | 잔액 | 1D | 1W | 1M | YTD |
| MMF* | 196457.6 | 738.6 | -7572.8 | -14640.4 | 25400.1 |
| 채권형* | 154201.8 | -269.2 | -240.2 | 981.6 | 17618.6 |
| 주식형* | 116965.4 | 749.5 | 891.1 | 3689.9 | 13097.7 |
| 저축성예금** | 1643946.6 | -1684.4 | 3281.8 | 8465.8 | 27353.8 |
| CD순발행** | 70587.9 | -152.6 | 20.3 | 1147.3 | 12.5 |

*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 |
|---------------------|------|------------|-------|-------|-----|
| 신한금융조건부(상)12-1(신증-영 | AA- | | 4.69 | 4.88 | 147 |
| 한화에어로스페이스128-2 | AA- | 2027-06-25 | 3.581 | 3.6 | 110 |
| 롯데지주13-2 | AA- | 2027-02-25 | 3.949 | 3.91 | 60 |
| 롯데지주14-2 | AA- | 2025-07-28 | 3.843 | 3.78 | 50 |
| 엠에스경산제일차1 | | 2024-09-27 | - | 5.99 | 45 |
| LG유플러스110-1 | AAO | 2025-01-26 | 3.547 | 3.56 | 40 |
| 에이치디현대오일뱅크129-2 | AA- | 2029-01-24 | 3.584 | 3.55 | 40 |
| 한독41 | | 2026-06-27 | - | 4.25 | 35 |
| GS21-1 | AAO | 2024-10-29 | 3.63 | 3.66 | 30 |
| 포스코인터30-1 | AA- | 2025-01-27 | 3.608 | 3.58 | 30 |
| 한국서부발전62-2(녹) | AAA | 2034-06-02 | 3.615 | 3.62 | 30 |
| 하나증권4-3 | AAO | 2025-01-30 | 3.764 | 3.67 | 30 |
| 한국투자증권26-2 | AAO | 2027-02-26 | 3.852 | 3.83 | 30 |
| 한화에어로스페이스128-1(녹) | AA- | 2026-06-26 | 3.564 | 3.58 | 30 |
| 롯데지주13-1 | AA- | 2025-02-25 | 3.812 | 3.75 | 30 |
| GS칼텍스143-1 | AA+ | 2027-06-27 | - | 3.41 | 30 |
| 신한투자증권2401-2 | AAO | 2027-01-22 | 3.667 | 3.68 | 30 |
| LSELECTRIC184-1 | AA- | 2025-01-26 | 3.571 | 3.59 | 30 |