



# DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

21 May. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 3.5 (0.0) 국10/3: 9.0 (1.0) 국10/5: 5.5 (1.0) 국30/10: -13.7 (-0.2)	

## KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.600	0.0	1.0	5.0
통안1Y	3.370	1.6	-1.2	-4.8
통안2Y	3.427	2.7	-3.7	-6.8
국고3Y	3.407	3.2	-4.5	-7.0
국고5Y	3.442	3.2	-5.3	-10.8
국고10Y	3.497	4.2	-5.8	-9.3
국고20Y	3.453	5.6	-3.7	-3.7

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.966	3.2	-3.5	-7.0
회사채 AA- 3Y	3.847	2.9	-4.6	-12.3
회사채 BBB+ 3Y	7.583	2.0	-7.5	-19.5

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	104.43	-11	12	
LKTBF 10Y	112.51	-45	44	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2742.14	0.64	0.55	5.80
KOSDAQ	847.08	-0.93	-0.86	0.61

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1355.9	0.07	-0.90	-1.90
원/100엔	870.45	0.20	-0.82	-2.77

IRS(%)		1D(bp)		CRS(%)		1D(bp)		Spread(bp)		1D(bp)	
1Y	3.573	1.00		1Y	3.49	2		IRS-통1	20.3	-0.60	
2Y	3.475	2.50		2Y	3.29	1.5		IRS-통2	4.8	-0.20	
3Y	3.410	3.50		3Y	3.28	2		IRS-국3	0.3	0.30	
5Y	3.368	4.00		5Y	3.24	1		IRS-국5	-7.5	0.80	
10Y	3.370	4.25		10Y	3.095	0.5		IRS-국10	-12.7	0.05	

## US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.858	2.3	-1.6	-13.9
UST5Y	4.473	2.2	-4	-20.4
UST10Y	4.449	2.4	-4.2	-17.6
UST30Y	4.588	2.6	-4.5	-12.5

## KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.576	1.7	-0.6	-2.1	-5.7	-14.8
특수채 AAA 3Y	3.579	3.1	-4.1	-4.9	-7.6	-14
특수채 AAA 5Y	3.584	3.2	-5.2	-9.1	-10.2	-15.3
은행채 AAA 1Y	3.623	1.1	-2.1	-0.4	-5.6	-15.1
은행채 AAA 3Y	3.678	3.0	-4.3	-6.9	-11.3	-19.3
은행채 AAA 5Y	3.769	3.0	-5.9	-13.6	-17.4	-19.9
금융채 AA 1Y	3.735	1.5	-1.0	0.5	0.3	-23.5
금융채 AA 3Y	3.835	3.2	-3.5	-5.3	-15.4	-25.6
금융채 AA 5Y	4.080	3.2	-5.3	-12.1	-18.4	-34.6
금융채 AA- 1Y	3.798	1.0	-1.5	-0.3	-9.0	-32
금융채 AA- 3Y	3.966	3.2	-3.5	-7.0	-25.3	-35.2
금융채 AA- 5Y	4.233	2.2	-6.3	-13.1	-22.8	-41.7
금융채 A+ 1Y	4.754	1.5	-1.0	-3.5	-9.5	-22.2
금융채 A+ 3Y	5.071	3.2	-4.0	-7.5	-14.9	-13.4
금융채 A+ 5Y	5.372	3.2	-4.8	-10.3	-10.3	-14.2
금융채 A 1Y	5.466	1.5	-1.0	-3.5	-8.0	-19.2
금융채 A 3Y	5.851	3.2	-4.0	-6.5	-12.7	-11.7
금융채 A 5Y	6.051	3.2	-4.8	-10.3	-9.8	-14.8
금융채 A- 1Y	6.038	1.5	-1.0	-3.5	-8.0	-22.7
금융채 A- 3Y	6.476	3.2	-4.0	-6.5	-12.2	-10.2
금융채 A- 5Y	6.692	3.2	-4.8	-10.3	-9.8	-14.4
회사채 AAA 1Y	3.655	1.5	-0.1	-3.6	-8.2	-20.2
회사채 AAA 3Y	3.717	3.2	-4.0	-10.1	-13.7	-20.9
회사채 AAA 5Y	3.786	3.0	-5.2	-12.7	-15.2	-30.6
회사채 AA+ 1Y	3.679	1.8	0.3	-2.8	-13.5	-26.9
회사채 AA+ 3Y	3.755	3.0	-4.4	-11.6	-21.5	-28.4
회사채 AA+ 5Y	3.902	3.1	-5.4	-14.1	-21.6	-33.1
회사채 AA 1Y	3.706	1.7	0.3	-3.7	-14.9	-28.4
회사채 AA 3Y	3.795	3.0	-4.4	-11.9	-21.7	-28.4
회사채 AA 5Y	3.969	3.0	-5.5	-13.8	-21.4	-32.7
회사채 AA- 1Y	3.736	1.7	0.1	-4.4	-15.9	-29.5
회사채 AA- 3Y	3.847	2.9	-4.6	-12.3	-22.9	-29.7
회사채 AA- 5Y	4.077	3.0	-5.5	-13.8	-21.7	-33

## 주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
5월 20일	월	국고채	5y	23000	3.420

## 전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
기업은행(단)2405월276A-20	금융채	2025-02-20(목)	2700	3.500	3.590	AAA
산금24신할0100-0520-1	금융채	2025-05-20(화)	900	3.460	3.575	AAA
기업은행(신)2405월1A-20	금융채	2025-05-20(화)	600	3.460	3.575	AAA
현대바이오9CB	회사채	2027-05-20(목)	180	2.000	-	-
해피몬테이차1-3	회사채	2025-05-20(화)	150	4.100	-	-
디비캐피탈122	금융채	2025-11-20(목)	50	5.600	7.283	BBB+
디비엔이비블류업3	회사채	2024-08-08(목)	50	8.000	-	-

## 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
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.42	90	2.1	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.44	-104	0.8
통안03365-2604-02	26-04-02	3.43	90	1.9	국고02875-2406(22-7)	24-06-10	3.66	-72	0.1
통안DC024-0820-0910	24-08-20	3.45	90	0.3	국고03625-2509(23-8)	25-09-10	3.44	-70	1.3
국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.44	60	1.6	기업은행(신)2306월1A-01	24-06-01	3.56	-50	0.0
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.35	56	29.8	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.44	-45	0.8
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
386 5.5					341 0.6				
보험/기업 순매수 상위 5건					보험/기업 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03625-2509(23-8)	25-09-10	3.44	140	1.3	한국전력1012	29-12-19	3.80	-30	5.6
국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.44	134	0.8	도로공사563	27-12-18	3.54	-20	3.6
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.36	96	29.8	알씨아미파이낸셜109-1	24-08-09	3.86	-20	0.2
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.50	83	9.6	중소벤처기업진흥공단831(사)	28-10-05	3.53	-10	4.4
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.44	61	4.8	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	3.50	-10	7.6
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
514 8.3					-90 -0.4				
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.41	240	2.6	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	3.34	-41	0.6
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.44	86	4.8	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.43	-40	4.3
국고02875-2406(22-7)	24-06-10	3.66	72	0.1	국고03625-2509(23-8)	25-09-10	3.44	-40	1.3
기업은행(신)2306월1A-01	24-06-01	3.56	50	0.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.50	-37	9.6
국고02375-2703(22-1)	27-03-10	3.43	40	2.8	국민은행4404월일일8M-30	24-12-30	3.62	-30	0.6
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
488 2.3					-188 0.3				
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.35	105	26.8	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.44	-50	0.8
국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.51	20	29.3	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.45	-50	0.8
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.44	10	29.8	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.45	-45	1.3
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.39	3	1.8	국고01375-3006(20-4)	30-06-10	3.49	-33	27.8
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.47	1	2.8	국고02375-2703(22-1)	27-03-10	3.43	-22	5.6
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
45 23.0					-135 -3.0				

## 주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-6267	235	1141	-41	4651
5일누적	-16751	1659	3100	-13371	19867

## Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	208129.1	1675.6	2008.7	-1492.9	37071.6
채권형*	152155.3	369.4	923	4901.3	15572.1
주식형*	112864.3	-339.3	333.1	4021.2	8996.6
저축성예금**	1629693.2	5223.3	5914.8	-869.3	13100.4
CD순발행**	70431.8	-149.1	-675.2	-513.9	-143.6

\*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

\*\*는 T-4일 기준

## 전일 주요 회사채 거래 내역

(십억원)

종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
이마트22-1	AA-	2024-08-11	3.685	3.67	211.991
루미너스논현제일차1-1		2024-12-27	-	5.72	150.0
POSCO311-1	AA+	2024-09-13	3.528	3.6	100.086
현대제철138-2	AAO	2027-01-22	3.665	3.7	80
뉴비타제삼차4-1		2030-07-26	-	3.58	80
아스본제일차3-1		2030-07-26	-	3.41	60
한화솔루션279-1(녹)	AA-	2025-01-24	3.791	3.78	50
포스코퓨처엠18-2(녹)	AA-	2027-04-14	3.671	3.67	40
SK305-1	AA+	2024-12-06	3.626	3.65	40
엔씨소프트3-2	AAO	2026-07-06	3.704	3.78	40
GS파워12-2(녹)	AAO	2028-10-19	3.703	3.72	40
SK에너지50-2	AAO	2026-03-06	3.722	3.73	40
에이치디비이에이제일차3		2025-12-01	-	4.8	40
한국중부발전70-1	AAA	2024-07-14	3.569	3.75	35
한국투자증권22	AAO	2025-02-28	3.873	3.8	30
롯데유통66-1	AAO	2025-02-17	3.647	3.67	30
더퍼스트사이닝제일차3-1		2028-12-20	-	5.51	30
대신증권24-2	AA-	2027-04-29	4.083	4.06	27