



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

9 Aug. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 2.0 (0.0) 국10/3: 8.0 (0.8) 국10/5: 6.0 (0.8) 국30/10: -10.0 (0.2)	

KR Market

KR Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.470	-1.0	-2.0	-9.0
통안1Y		3.049	-2.1	-6.5	-12.7
통안2Y		2.970	-1.5	-6.8	-17.3
국고3Y		2.919	-1.2	-5.6	-20.1
국고5Y		2.939	-1.1	-4.6	-20.1
국고10Y		3.000	-0.2	-1.2	-20.0
국고20Y		2.995	0.6	-1.0	-17.9
KR Credit(%bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y		3.476	-0.2	-2.2	-13.9
회사채 AA- 3Y		3.393	-0.9	-4.3	-17.7
회사채 BBB+ 3Y		6.973	-1.2	-6.2	-26.1
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		105.98	4	7	
LKTBF 10Y		117.14	-2	-31	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2556.73	-0.45	-7.95	-10.83
KOSDAQ		745.28	-0.44	-8.39	-13.38
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1377.2	0.03	0.81	-0.32
원/100엔		942.71	1.16	2.94	9.72

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.140	-1.50	1Y	2.795	-1.5	IRS-통1	9.1	0.60
2Y	2.955	-2.50	2Y	2.7	-1	IRS-통2	-1.5	-1.00
3Y	2.895	-1.25	3Y	2.65	-1	IRS-국3	-2.4	-0.05
5Y	2.870	-0.50	5Y	2.65	-0.5	IRS-국5	-6.9	0.60
10Y	2.913	0.25	10Y	2.56	-0.5	IRS-국10	-8.7	0.45

US Bond Market

US Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		4.04	7.6	-11.2	-58.8
UST5Y		3.829	6.5	-0.7	-41.5
UST10Y		3.991	4.6	1.3	-30.7
UST30Y		4.28	3.2	0.2	-21

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.236	-1.1	-4.1	-9.2	-34.3	-55.5
특수채 AAA 3Y		3.119	-1.4	-5.7	-17.5	-48.1	-89.7
특수채 AAA 5Y		3.131	-1.2	-3.7	-16.9	-48.3	-91.3
은행채 AAA 1Y		3.273	-0.8	-2.0	-3.0	-36.8	-57
은행채 AAA 3Y		3.183	-1.1	-5.0	-18.4	-52.0	-96.9
은행채 AAA 5Y		3.205	-1.1	-3.9	-18.7	-60.4	-104.8
금융채 AA 1Y		3.398	-1.0	-3.5	-8.3	-34.2	-72.2
금융채 AA 3Y		3.367	-0.7	-3.7	-15.6	-48.6	-110.4
금융채 AA 5Y		3.512	-0.5	-3.5	-19.8	-60.1	-113.4
금융채 AA- 1Y		3.450	-1.0	-3.5	-8.6	-35.8	-86.7
금융채 AA- 3Y		3.476	-0.2	-2.2	-13.9	-50.8	-124
금융채 AA- 5Y		3.635	-0.5	-3.5	-20.3	-64.1	-121.8
금융채 A+ 1Y		4.378	-2.0	-5.0	-9.8	-38.1	-70.8
금융채 A+ 3Y		4.527	-1.2	-3.2	-17.0	-56.7	-99.8
금융채 A+ 5Y		4.803	-1.0	-4.0	-19.0	-59.7	-99.1
금융채 A 1Y		5.100	-2.0	-5.0	-9.8	-37.1	-67.3
금융채 A 3Y		5.320	-1.2	-3.2	-17.0	-55.4	-95.8
금융채 A 5Y		5.487	-1.0	-4.0	-19.0	-59.2	-97.6
금융채 A- 1Y		5.667	-2.0	-5.0	-9.8	-37.6	-68.3
금융채 A- 3Y		5.950	-1.2	-3.2	-16.5	-54.9	-93.3
금융채 A- 5Y		6.128	-1.0	-4.0	-19.0	-59.2	-96.8
회사채 AAA 1Y		3.285	-2.1	-6.3	-13.6	-36.9	-69.4
회사채 AAA 3Y		3.270	-1.2	-4.5	-17.4	-47.1	-92.7
회사채 AAA 5Y		3.279	-0.8	-3.9	-17.2	-53.9	-106.8
회사채 AA+ 1Y		3.304	-2.3	-6.7	-14.1	-37.2	-77.1
회사채 AA+ 3Y		3.314	-1.0	-4.4	-17.3	-46.9	-103.3
회사채 AA+ 5Y		3.345	-0.9	-4.4	-19.0	-59.8	-116.9
회사채 AA 1Y		3.325	-2.3	-6.6	-14.2	-37.8	-79
회사채 AA 3Y		3.351	-0.8	-4.2	-17.7	-47.2	-103.2
회사채 AA 5Y		3.409	-1.0	-4.4	-19.1	-60.2	-116.6
회사채 AA- 1Y		3.354	-2.3	-6.7	-13.9	-38.1	-80.3
회사채 AA- 3Y		3.393	-0.9	-4.3	-17.7	-48.4	-105.3
회사채 AA- 5Y		3.513	-0.9	-4.4	-19.2	-60.6	-117.2

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
8월 5일	월	국고채	30y	18000	2.805
8월 5일	월	통안채	91d	5400	3.260
8월 7일	수	통안채	2y	21000	2.980

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
재정2024-0280-0063	국채	2024-10-10(목)	10000	3.370	3.394	AAA
산금24신이0206-0808-1	금융채	2027-02-08(월)	3000	3.080	3.087	AAA
기업은행(신)2408이1.5A-08	금융채	2026-02-08(일)	3000	3.200	3.191	AAA
신한은행28-08-아-3-A	금융채	2027-08-08(일)	3000	3.190	3.194	AAA
신한은행28-08-할-1-A	금융채	2025-08-08(금)	3000	3.180	3.281	AAA
우리은행28-08-할인01-갑-08	금융채	2025-08-08(금)	2000	3.180	3.281	AAA
토지주택채권491(사)	특수채	2034-08-08(화)	1800	3.133	3.183	AAA
농림축산(중앙회)2024-8이3Y-A	특수채	2027-08-08(일)	1800	3.160	3.133	AAA
롯데카드539-2	금융채	2026-08-06(목)	1500	3.98	3.469	AA-
한국수출입금융2408다-할인-184	금융채	2025-02-08(토)	1400	3.310	3.392	AAA

주체별 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	종목	만기
기업은행(신)2408이1.5A-08	26-02-08	3.20	250	1.5	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.96	-140	1.8	국고03125-2606(23-4)	26-06-10
산금24신이0206-0808-1	27-02-08	3.08	220	2.5	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.93	-70	2.3	국고03875-2612(23-10)	26-12-10
통안03670-2507-02	25-07-02	3.05	110	0.9	국고01250-2603(21-1)	26-03-10	3.01	-58	1.6	국고01250-2603(21-1)	26-03-10
국고01875-2906(19-4)	29-06-10	2.97	100	4.8	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.95	-40	4.1	국고03500-2809(23-6)	28-09-10
한국수출입금융2408다-할인-184	25-02-08	3.36	80	0.5	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.01	-29	8.8	국고03250-3306(23-5)	33-06-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
760						-337					
보험/기금 순매수 상위 5건						보험/기금 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.12	90	0.6	통안03670-2507-02	25-07-02	3.05	-100	0.9	통안03670-2507-02	25-07-02
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.00	45	9.8	통안04020-2510-02	25-10-02	3.06	-60	1.2	통안04020-2510-02	25-10-02
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.99	40	19.1	농림축산(중앙회)2020-70이5Y-A	25-07-29	3.20	-40	1.0	농림축산(중앙회)2020-70이5Y-A	25-07-29
농림축산(중앙회)2024-8이3Y-A	27-08-08	3.16	45	3.0	국고01875-2906(19-4)	29-06-10	2.97	-40	4.8	국고01875-2906(19-4)	29-06-10
롯데카드539-2	27-08-06	4.42	34	3.0	산금카드2444	25-06-05	3.35	-20	0.8	산금카드2444	25-06-05
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
254						-260					
투신 순매수 상위 5건						투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
토지주택채권491(사)	34-08-08	3.13	180	10.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.01	-120	9.3	국고04125-3312(23-11)	33-12-10
한국수출입금융(한)2408아-이보-1	25-08-08	3.50	120	1.0	우리은행27-10-이보02-갑-10	25-10-10	3.27	-50	1.2	우리은행27-10-이보02-갑-10	25-10-10
롯데카드539-2	26-08-06	3.98	110	2.0	국고01875-2606(16-3)	26-06-10	2.98	-40	1.8	국고01875-2606(16-3)	26-06-10
농림축산(중앙회)2024-8이3Y-A	27-08-08	3.16	85	3.0	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.00	-28	9.8	국고03500-3406(24-5)	34-06-10
통안03200-2607-02	26-07-02	2.97	60	1.9	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.90	-25	29.6	국고03250-5403(24-2)	54-03-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
555						-263					
외국인 순매수 상위 5건						외국인 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
통안04020-2510-02	25-10-02	3.05	230	1.2	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.92	-184	28.6	국고03250-5303(23-2)	53-03-10
통안03670-2507-02	25-07-02	3.04	200	0.9	통안03680-2501-02	25-01-02	3.27	-107	0.4	통안03680-2501-02	25-01-02
통안03340-2601-02	26-01-02	3.05	90	1.4	산금23신이0200-1023-1	25-10-23	3.27	-50.0	1.2	산금23신이0200-1023-1	25-10-23
신한은행28-08-할-1-A	25-08-08	3.28	90	1.0	산금23신이0200-1030-3	25-10-30	3.27	-40.0	1.2	산금23신이0200-1030-3	25-10-30
국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.07	66	0.8	산금23신이0200-1115-1	25-11-15	3.26	-30.0	1.3	산금23신이0200-1115-1	25-11-15
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
676						-411					

주체별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-351	177	-546	7902	-8312
5일누적	7755	272	-1864	12373	-19023

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	205185.6	-868.2	2114.6	1862.2	34128.1
채권형*	168103.2	-297.4	1550.8	11261.5	31520
주식형*	113530.7	691.9	-4362.7	-7000.7	9663
저축성예금**	1650405.1		3522.9	-1497.1	33812.3
CD순발행**	69726.4		285	-1839	-849

*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

**는 T-4일 기준

전일 주요 회사채 거래 내역

종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	
-----	------	-----	-------	-------	--