



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

3 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승)
- 일드커브: 스티프닝
- 스프레드(bp): 국5/3 5.0 (0.0) 국10/3: 12.8 (0.6)
국10/5: 7.8 (0.6) 국30/10: -15.0 (0.2)

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.610	1.0	1.0	4.0
통안1Y	3.391	-0.2	1.6	-5.5
통안2Y	3.453	0.6	2.3	-6.4
국고3Y	3.452	1.2	3.7	-7.3
국고5Y	3.502	1.2	6.2	-8.3
국고10Y	3.580	1.8	7.3	-7.0
국고20Y	3.505	1.5	6.5	-5.7

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y	3.994	1.0	2.3	-7.2
회사채 AA- 3Y	3.874	1.3	2.2	-11.3
회사채 BBB+ 3Y	7.588	1.2	2.0	-18.9
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평

KTBF 3Y	104.27	-3	-16	
LKTBF 10Y	111.78	-12	-61	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2636.52	0.04	-1.90	-2.06
KOSDAQ	839.98	0.96	0.07	-3.33

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1384.5	0.37	1.10	0.18
원/100엔	880.56	0.17	0.98	-0.02

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.548	0.25	1Y	3.52	2	IRS-통1	15.7	0.45
2Y	3.498	1.25	2Y	3.34	1	IRS-통2	4.5	0.65
3Y	3.468	1.50	3Y	3.33	1.5	IRS-국3	1.5	0.30
5Y	3.465	1.75	5Y	3.335	1.5	IRS-국5	-3.7	0.55
10Y	3.473	2.25	10Y	3.175	1.5	IRS-국10	-10.8	0.45

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.883	-5.2	-7.4	-8.5
UST5Y	4.512	-6.2	-2.2	-14.3
UST10Y	4.503	-4.8	3.3	-13.1
UST30Y	4.651	-3.3	7.6	-10.2

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.591	-0.1	0.8	-4.8	-8.1	-21.8
특수채 AAA 3Y	3.610	1.2	3.2	-8.1	-3.3	-26.5
특수채 AAA 5Y	3.641	1.3	6.1	-7.6	-2.6	-24.2
은행채 AAA 1Y	3.626	-0.5	0.1	-6.9	-8.9	-24.2
은행채 AAA 3Y	3.706	1.0	2.3	-8.9	-6.6	-32
은행채 AAA 5Y	3.804	1.1	3.8	-12.5	-10.6	-29
금융채 AA 1Y	3.737	-0.5	0.0	-5.1	-2.5	-31.3
금융채 AA 3Y	3.868	1.0	2.5	-5.7	-6.8	-34.9
금융채 AA 5Y	4.114	0.7	4.4	-11.2	-10.5	-41.7
금융채 AA- 1Y	3.795	-0.5	0.0	-6.6	-10.8	-37.8
금융채 AA- 3Y	3.994	1.0	2.3	-7.2	-16.7	-43
금융채 AA- 5Y	4.258	0.2	3.7	-13.1	-15.8	-48.7
금융채 A+ 1Y	4.751	-0.5	0.0	-7.6	-10.3	-30
금융채 A+ 3Y	5.091	1.0	2.0	-9.5	-7.9	-23.2
금융채 A+ 5Y	5.402	0.7	4.2	-10.8	-2.8	-21.7
금융채 A 1Y	5.468	-0.5	0.5	-7.1	-9.3	-28
금융채 A 3Y	5.876	1.0	2.5	-8.5	-5.2	-22
금융채 A 5Y	6.086	0.7	4.7	-10.3	-1.8	-21.8
금융채 A- 1Y	6.040	-0.5	0.5	-7.1	-9.3	-30
금융채 A- 3Y	6.501	1.0	2.5	-8.5	-5.2	-20.5
금융채 A- 5Y	6.727	0.7	4.7	-10.3	-1.8	-21.4
회사채 AAA 1Y	3.671	-0.2	1.0	-4.1	-7.7	-27.1
회사채 AAA 3Y	3.759	0.9	3.4	-8.3	-4.9	-31
회사채 AAA 5Y	3.831	0.9	5.5	-10.7	-5.7	-37.3
회사채 AA+ 1Y	3.694	0.0	1.0	-3.5	-11.1	-34
회사채 AA+ 3Y	3.791	1.4	3.1	-9.3	-13.0	-39.4
회사채 AA+ 5Y	3.943	1.1	5.7	-11.7	-12.5	-40.5
회사채 AA 1Y	3.724	0.0	0.8	-3.8	-12.3	-35.2
회사채 AA 3Y	3.831	1.4	2.9	-9.8	-13.2	-39.6
회사채 AA 5Y	4.012	1.1	5.6	-11.5	-12.1	-40
회사채 AA- 1Y	3.751	0.0	0.7	-4.5	-13.6	-36.7
회사채 AA- 3Y	3.874	1.3	2.2	-11.3	-14.9	-41.1
회사채 AA- 5Y	4.120	1.1	5.6	-11.5	-12.1	-40.2

주간 입찰 일정 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
국민주택1종24-05	국채	2029-05-31(목)	13750	1.300	3.615	AAA
신한투자증권3(후)	회사채	2031-05-30(금)	3000	5.100	4.407	AA-
신보2024제10차유동화1-2(사)	회사채	2027-05-31(월)	2133	3.749	3.750	AAA
신한은행28-05-아-9M-B	금융채	2025-02-28(금)	2000	3.630	3.636	AAA
신보2024제12차유동화1-1(사)	회사채	2026-05-31(일)	1717	3.704	3.706	AAA
신세계프라퍼티9-1	회사채	2025-11-28(금)	1300	4.380	4.384	A+
푸른현대생명보험27(후)	회사채	2034-05-31(수)	1200	7.000	5.780	A+
한화에너지23-2(녹)	회사채	2027-05-28(금)	1100	4.130	4.350	A+
한화에너지23-1	회사채	2026-05-29(금)	900	3.98	4.121	A+
경기지역개발24-05	지방채	2029-05-31(목)	888	2.500	3.678	AAA

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	수량	잔존만기
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.45	140	2.0	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.39	-100	1.3		
통안03365-2604-02	26-04-02	3.44	125	1.8	농림축산검역(은행)2024-04033Y-E	27-04-23	3.63	-40	2.9		
국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.50	80	4.3	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.38	-39	0.8		
국민주택1종24-05	29-05-31	3.62	86	5.0	주택금융공사47	24-07-08	3.59	-30	0.1		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.58	64	9.5	기업은행(단)2310월274A-12	24-07-12	3.53	-30	0.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
495						239					
보통/기금 순매수 상위 5건						보통/기금 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	수량	잔존만기
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.43	163	29.8	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.39	-100	1.3		
신보2024제10차유동화1-2(사)	27-05-31	3.75	133	3.0	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	3.37	-60	0.5		
신보2024제12차유동화1-1(사)	26-05-31	3.70	112	2.0	농림축산검역(은행)2024-04033Y-E	27-04-23	3.63	-40	2.9		
하나은행47-05제20금-31(고금)	44-05-31	4.53	50	20.0	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.38	-39	0.8		
신보2024제11차유동화1-1(사)	26-05-31	3.70	47	2.0	주택금융공사47	24-07-08	3.59	-30	0.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
505						-269					
투신 순매수 상위 5건						투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	수량	잔존만기
통안DC024-0827-0910	24-08-27	3.54	100	0.2	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.45	-20	2.0		
아이비케이캐피탈303-2	26-03-31	3.76	50	1.8	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.50	-20	4.3		
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.58	45	9.5	키움증권10-2	27-05-28	3.89	-20	3.0		
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.43	40	3.0	도로공사823	24-10-27	3.64	-10	0.4		
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.45	38	2.5	자산관리공사제66회2012-09(사)	24-12-09	3.62	-10	0.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
273						-80					
외국인 순매수 상위 5건						외국인 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	수량	잔존만기
국고05500-2803(08-2)	28-03-10	3.50	125	3.8	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.39	-60	1.3		
국고03250-2603(24-3)	26-03-10	3.45	57	1.8	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.39	-36	0.8		
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.49	46	4.8	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.37	-21	0.8		
국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.45	40	2.0	국고01375-2409(19-5)	24-09-10	3.39	-200	0.3		
국고02375-2812(18-10)	28-12-10	3.51	33	4.5	국고01500-4009(20-7)	40-09-10	3.45	-13.7	16.3		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
301						-151					

주제별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	3511	-235	-2411	2619	-1985
5일누적	-3452	-654	-3410	-23339	31302

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	208880.5	-2217.5	1851.1	11743.3	37823
채권형*	153035.9	-184.3	-148.8	3330.6	16452.7
주식형*	112598.1	-677.4	-925.7	1365.1	8730.4
저축성예금**	1630821.3	404.4	457.5	9507.2	14228.5
CD순발행**	73031.7	478.4	818.4	2499.8	2456.3

*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
신보2024제10차유동화1-2(사)	AAA	2027-05-31	-	3.75	273
신보2024제12차유동화1-1(사)	AAA	2026-05-31	-	3.7	222
푸른현대생명보험27(후)	A0	2034-05-31	-	6.9	89
한온시스템10-2	AA-	2024-06-27	3.878	3.74	80
신보2024제11차유동화1-1(사)	AAA	2026-05-31	-	3.7	77
한국서부발전59-1	AAA	2024-07-19	3.581	3.72	60
한국서부발전61-1	AAA	2025-01-24	3.626	3.63	60
SK311-1	AA+	2027-05-28	3.696	3.71	50
키움증권10-2	AA-	2027-05-28	3.916	3.89	40
신한금융지주158	AAA	2026-06-19	3.639	3.62	30
SK284-2	AA+	2025-06-08	3.66	3.67	30
엘지헬로비전13-2	AA-	2027-01-25	3.7	3.7	30
한국남동발전40	AAA	2024-06-26	3.572	3.72	30
연합자산관리27-2	AA0	2024-06-10	3.638	3.75	30
뉴비타제삼차4-1		2030-07-26	-	3.61	30
신보2024제10차유동화1-1(녹)	AAA	2027-05-31	-	3.75	23
리드트리제일차2		2027-05-31	-	4.95	20