



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

17 Jul. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)
- 일드커브: 플랫닝
- 스프레드(bp): 국5/3 2.5 (0.0) 국10/3: 10.2 (-0.1)
국10/5: 7.7 (-0.1) 국30/10: -10.7 (0.1)

KR Market

KR Bond(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.550	1.0	-1.0	-5.0
통안1Y		3.186	-1.2	1.0	-16.0
통안2Y		3.087	-3.8	-5.6	-22.2
국고3Y		3.035	-3.7	-8.5	-20.7
국고5Y		3.060	-3.7	-8.0	-20.2
국고10Y		3.137	-3.8	-6.3	-16.3
국고20Y		3.103	-4.2	-7.1	-16.4
KR Credit(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y		3.525	-3.7	-9.0	-24.9
회사채 AA- 3Y		3.488	-3.4	-8.2	-21.0
회사채 BBB+ 3Y		7.143	-4.0	-9.1	-24.0
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		105.63	10	22	
LKTBF 10Y		115.91	40	63	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2866.09	0.18	-0.04	3.90
KOSDAQ		839.61	-1.56	-2.42	-2.62
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1384.9	0.15	0.24	0.41
원/100엔		873.93	-0.20	1.71	-0.39

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.273	-2.75	1Y	3.205	-4	IRS-통1	8.7	-1.55
2Y	3.088	-4.50	2Y	2.93	-4	IRS-통2	0.0	-0.70
3Y	3.018	-4.50	3Y	2.875	-4	IRS-국3	-1.8	-0.80
5Y	3.000	-4.00	5Y	2.87	-4	IRS-국5	-6.0	-0.30
10Y	3.043	-3.75	10Y	2.78	-4.5	IRS-국10	-9.5	0.05

US Bond Market

US Bond(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		4.421	-3.9	-20.7	-29.4
UST5Y		4.075	-5.9	-16.9	-16.9
UST10Y		4.159	-7.2	-13.9	-6.7
UST30Y		4.374	-8.5	-11.6	2.2

KR Credit Market

Bond Yield(% ,bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.338	-0.8	1.0	-19.2	-23.5	-48.1
특수채 AAA 3Y		3.195	-4.1	-9.9	-22.1	-43.4	-81.7
특수채 AAA 5Y		3.221	-3.6	-7.9	-18.7	-44.3	-80.3
은행채 AAA 1Y		3.313	-1.9	1.0	-23.4	-28.0	-55.1
은행채 AAA 3Y		3.285	-3.6	-8.2	-21.6	-45.0	-84.2
은행채 AAA 5Y		3.312	-3.7	-8.0	-22.5	-57.8	-89.2
금융채 AA 1Y		3.473	-3.0	-0.8	-18.7	-23.2	-65.9
금융채 AA 3Y		3.433	-3.7	-9.0	-23.0	-45.3	-96.5
금융채 AA 5Y		3.625	-3.7	-8.5	-23.4	-56.8	-96.5
금융채 AA- 1Y		3.528	-3.0	-0.8	-18.0	-24.8	-75.7
금융채 AA- 3Y		3.525	-3.7	-9.0	-24.9	-51.4	-107.6
금융채 AA- 5Y		3.753	-3.7	-8.5	-24.5	-61.1	-103.2
금융채 A+ 1Y		4.478	-2.5	0.2	-18.6	-28.6	-60.8
금융채 A+ 3Y		4.604	-3.7	-9.3	-26.2	-54.5	-86.8
금융채 A+ 5Y		4.913	-3.7	-8.0	-22.9	-55.4	-81.3
금융채 A 1Y		5.200	-2.5	0.2	-18.6	-27.6	-59.3
금융채 A 3Y		5.397	-3.7	-9.3	-25.4	-51.7	-83.3
금융채 A 5Y		5.597	-3.7	-8.0	-22.9	-54.9	-80.9
금융채 A- 1Y		5.767	-2.5	0.2	-19.1	-28.1	-60.8
금융채 A- 3Y		6.027	-3.7	-8.8	-24.9	-51.2	-81.3
금융채 A- 5Y		6.238	-3.7	-8.0	-22.9	-54.9	-80.5
회사채 AAA 1Y		3.424	-1.2	0.3	-17.1	-25.4	-55.6
회사채 AAA 3Y		3.371	-3.1	-7.3	-20.4	-44.3	-80.6
회사채 AAA 5Y		3.386	-3.7	-6.5	-20.2	-51.5	-92.8
회사채 AA+ 1Y		3.443	-1.3	-0.2	-18.1	-25.9	-63.3
회사채 AA+ 3Y		3.409	-3.3	-7.8	-20.6	-46.9	-89.2
회사채 AA+ 5Y		3.455	-3.7	-8.0	-22.8	-59.2	-100.4
회사채 AA 1Y		3.467	-1.3	0.0	-17.8	-27.1	-64.9
회사채 AA 3Y		3.446	-3.4	-8.2	-20.8	-47.4	-89.7
회사채 AA 5Y		3.520	-3.7	-8.0	-23.2	-59.1	-100.5
회사채 AA- 1Y		3.493	-1.3	0.0	-18.1	-28.2	-65.8
회사채 AA- 3Y		3.488	-3.4	-8.2	-21.0	-48.8	-91.7
회사채 AA- 5Y		3.625	-3.7	-8.0	-23.9	-59.4	-100.7

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
7월 15일	월	국고채	10y	24000	3.185
7월 15일	월	통안채	91d	5700	3.250

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
통안DC024-1015-0910	통안채	2024-10-15(화)	5700	3.250	3.367	통안
산금24신이0200-0716-1	금융채	2026-07-16(목)	3500	3.200	3.216	AAA
한국수출입금융2407사-할인-184	금융채	2025-01-16(목)	3000	3.330	3.435	AAA
국민은행4407기표일(03)1.5-1	금융채	2026-01-16(금)	2100	3.260	3.244	AAA
주택금융공사160(사)	특수채	2027-07-16(금)	1800	3.159	3.236	AAA
자산관리공사제93회3007-16(사)	특수채	2027-07-16(금)	1500	3.160	3.236	AAA
에이치디현대캐피탈7	회사채	2028-08-16(수)	500	4.900	5.030	AO
에이치엘비39CB	회사채	2027-07-16(금)	330	1.000	-	-
디비아레나제세팔차4	회사채	2025-08-14(목)	162	5.78	-	-
디비아레나제세구차4	회사채	2025-08-14(목)	70	5.790	-	-

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	
산금24신이0200-0716-1	26-07-16	3.20	330	2.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.06	-90	2.4	
주택금융공사160(사)	27-07-16	3.16	150	3.0	통안03200-2607-02	26-07-02	3.08	-90	2.0	
자산관리공사제93회3007-16(사)	27-07-16	3.16	100	3.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.09	-80	1.9	
한국수출입금융2407사-할인-184	25-01-16	3.38	100	0.5	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.17	-50	9.9	
국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.31	50	0.2	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.15	-50	9.9	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					730	2.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
							360			4.2
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국민은행4407기표일(03)1.5-16	26-01-16	3.26	150	1.5	국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.29	-130	0.2	
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.14	122	9.9	국고01875-2906(19-4)	29-06-10	3.10	-60	4.9	
한국수출입금융2407사-할인-184	25-01-16	3.38	50	0.5	국고02375-3112(21-11)	31-12-10	3.16	-52	7.4	
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.17	25	9.4	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.12	-41	19.2	
산금23신이0200-0424-1	25-04-24	3.37	20	0.8	주택금융공사MBS2019-19(14-4)(사)	24-10-15	3.25	-40	0.2	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					367	4.7	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
							323			4.6
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.14	57	9.9	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.16	-217	9.4	
한국수출입금융2407사-할인-182	24-08-08	3.40	50	0.1	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.04	-32	2.9	
기업은행(신)2308할1A-11	24-08-11	3.40	40	0.1	재정2024-0210-0063	24-08-22	3.46	-30	0.1	
한국수출입금융2407사-할인-184	25-01-16	3.38	40	0.5	메리츠캐피탈227-4	26-02-20	4.30	-20	1.6	
현대캐피탈1972	26-02-20	3.88	30	1.6	우리카드222-2	25-12-26	3.41	-10	1.4	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					217	2.9	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
							309			7.1
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	3.03	119	29.7	기업은행(신)2406할1A-11	25-06-11	3.40	-100	0.9	
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.06	54	4.7	산금23신이0200-0424-1	25-04-24	3.38	-60	0.8	
국고03375-3206(22-5)	32-06-10	3.15	2	7.9	기업은행(신)2306기2A-08	25-06-08	3.40	-600	0.9	
국고02625-2806(18-4)	28-06-10	3.08	2	3.9	산금23신이0200-0504-3	25-05-04	3.39	-500	0.8	
국고01875-2906(19-4)	29-06-10	3.10	2	4.9	기업은행(신)2307기2A-11(사)	25-07-11	3.38	-300	1.0	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					178	21.4	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
							300			0.0

주제별 선물 순매수

(계약수)

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-989	4	-1228	4000	-2577
5일누적	649	390	-7197	41275	-32157

Fund Flow

(십억원)

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	205791.1	-683.8	2579.7	2843.8	34733.6
채권형*	157834.2	347.0	1585.2	4223.2	21251
주식형*	120324.7	291.1	92.4	5596.4	16457
저축성예금**	1649713.3	-6534.9	1554.4	17697.4	33120.5
CD순발행**	70673	-605	-1227.1	-1734.6	97.6

*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
하이오션케미트제일차3		2031-06-10	-	4	90
농협금융지주35-2	AAA	2025-04-25	3.42	3.41	60
인지니어드제일차6-1		2028-07-06	-	4.16	60
신한증권2201-2	AA0	2025-01-13	3.478	3.48	50
호텔롯데73-1	AA-	2026-01-29	3.739	3.66	50
한국수력원자력29-3	AAA	2031-12-08	3.399	3.33	40
GS파워11-3	AA0	2028-02-13	3.335	3.3	40
에스케이온4-2(녹)	A+	2026-10-30	4.179	4.21	40
에이치디비에이제일차2		2025-12-01	-	4.4	34
더스카이제일차2-3		2025-02-06	-	5.9	32
에이치디현대오일뱅크126-2	AA-	2026-02-28	3.404	3.35	30
씨제이제일제당27-1	AA0	2024-09-13	3.361	3.31	30
현대백화점31-1	AA+	2026-02-27	3.312	3.3	20
스카이오션제일차2-2		2028-03-16	-	4.99	20
하오준케이제오차5-1		2028-04-21	-	5.55	20
더블트리제일차1-1		2025-07-18	-	4.25	20
현대건설303-2	AA-	2027-02-17	3.621	3.58	20
LG에너지솔루션2-3(녹)	AA0	2028-06-29	3.367	3.47	18