



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

20 June. 2024

| 전일 국내 채권 시장 요약 | |
|--|--|
| • 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락) | |
| • 일드커브: 스티프닝 | |
| • 스프레드(bp): 국5/3 3.0 (0.7) 국10/3: 7.5 (0.5) 국10/5: 4.5 (-0.2) 국30/10: -10.8 (1.9) | |

KR Market

| KR Bond(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
|-------------------|--|---------|------|-------|-------|
| CD91D | | 3.600 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| 통안1Y | | 3.329 | -0.5 | -4.1 | -4.1 |
| 통안2Y | | 3.230 | -4.5 | -12.0 | -19.7 |
| 국고3Y | | 3.150 | -5.7 | -14.5 | -25.7 |
| 국고5Y | | 3.180 | -5.0 | -13.5 | -26.2 |
| 국고10Y | | 3.225 | -5.2 | -14.5 | -27.2 |
| 국고20Y | | 3.195 | -4.0 | -11.7 | -25.8 |
| KR Credit(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
| 금융채AA- 3Y | | 3.674 | -5.7 | -16.3 | -29.2 |
| 회사채 AA- 3Y | | 3.620 | -4.4 | -11.9 | -22.7 |
| 회사채 BBB+ 3Y | | 7.293 | -5.5 | -14.3 | -29.0 |
| KTB Futures(tick) | | 증가 | 1D | 1W | 저평 |
| KTBF 3Y | | 105.29 | 17 | 50 | |
| LKTBF 10Y | | 114.96 | 47 | 121 | |
| KR Stock(%) | | Index | 1D | 1W | 1M |
| KOSPI | | 2797.33 | 1.21 | 2.54 | 2.01 |
| KOSDAQ | | 861.17 | 0.26 | -1.09 | 1.66 |
| FX Market(%) | | Price | 1D | 1W | 1M |
| 원/달러 | | 1381.8 | 0.05 | 0.41 | 1.91 |
| 원/100엔 | | 875.89 | 0.32 | 0.11 | 0.62 |

| IRS(%) | | 1D(bp) | CRS(%) | | 1D(bp) | Spread(bp) | | 1D(bp) |
|--------|-------|--------|--------|-------|--------|------------|-------|--------|
| 1Y | 3.395 | -4.50 | 1Y | 3.315 | -1.5 | IRS-통1 | 6.6 | -4.00 |
| 2Y | 3.250 | -5.00 | 2Y | 3.06 | -3.5 | IRS-통2 | 2.0 | -0.50 |
| 3Y | 3.168 | -5.25 | 3Y | 3.04 | -3.5 | IRS-국3 | 1.8 | 0.45 |
| 5Y | 3.108 | -6.00 | 5Y | 3.015 | -3.5 | IRS-국5 | -7.3 | -1.00 |
| 10Y | 3.110 | -6.25 | 10Y | 2.88 | -1 | IRS-국10 | -11.5 | -1.05 |

US Bond Market

| US Bond(%bp) | | YTM | 1D | 1W | 1M |
|--------------|--|-------|----|-------|-------|
| UST2Y | | 4.725 | 0 | -3.7 | -13.3 |
| UST5Y | | 4.251 | 0 | -7.3 | -22.2 |
| UST10Y | | 4.227 | 0 | -9.3 | -22.2 |
| UST30Y | | 4.357 | 0 | -12.1 | -23.1 |

KR Credit Market

| Bond Yield(%bp) | | Yield | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|-----------------|--|-------|------|-------|-------|-------|-------|
| 특수채 AAA 1Y | | 3.513 | -0.7 | -4.0 | -6.3 | -5.4 | -27.6 |
| 특수채 AAA 3Y | | 3.334 | -5.6 | -13.0 | -24.5 | -20.6 | -65.3 |
| 특수채 AAA 5Y | | 3.342 | -4.4 | -11.3 | -24.2 | -21.6 | -65.6 |
| 은행채 AAA 1Y | | 3.511 | -1.5 | -6.4 | -11.2 | -10.1 | -35 |
| 은행채 AAA 3Y | | 3.409 | -5.7 | -14.5 | -26.9 | -24.3 | -71.5 |
| 은행채 AAA 5Y | | 3.450 | -5.0 | -15.3 | -31.9 | -38.0 | -75.5 |
| 금융채 AA 1Y | | 3.630 | -1.0 | -7.0 | -10.5 | -8.5 | -41.2 |
| 금융채 AA 3Y | | 3.566 | -5.7 | -15.5 | -26.9 | -30.3 | -76 |
| 금융채 AA 5Y | | 3.772 | -5.0 | -14.7 | -30.8 | -37.4 | -82.5 |
| 금융채 AA- 1Y | | 3.673 | -1.0 | -7.5 | -12.5 | -16.8 | -47.5 |
| 금융채 AA- 3Y | | 3.674 | -5.7 | -16.3 | -29.2 | -40.5 | -83.7 |
| 금융채 AA- 5Y | | 3.911 | -5.0 | -14.7 | -32.2 | -42.6 | -90.2 |
| 금융채 A+ 1Y | | 4.624 | -1.5 | -8.0 | -13.0 | -14.5 | -41.2 |
| 금융채 A+ 3Y | | 4.766 | -5.7 | -15.8 | -30.5 | -32.8 | -66.9 |
| 금융채 A+ 5Y | | 5.055 | -5.0 | -14.7 | -31.7 | -31.3 | -66.9 |
| 금융채 A 1Y | | 5.346 | -1.5 | -8.0 | -12.0 | -13.0 | -39.7 |
| 금융채 A 3Y | | 5.551 | -5.7 | -15.8 | -30.0 | -30.8 | -65.2 |
| 금융채 A 5Y | | 5.739 | -5.0 | -14.7 | -31.2 | -30.8 | -66.5 |
| 금융채 A- 1Y | | 5.918 | -1.5 | -8.0 | -12.0 | -13.0 | -40.7 |
| 금융채 A- 3Y | | 6.176 | -5.7 | -15.8 | -30.0 | -30.8 | -63.7 |
| 금융채 A- 5Y | | 6.380 | -5.0 | -14.7 | -31.2 | -30.8 | -66.1 |
| 회사채 AAA 1Y | | 3.573 | -0.9 | -6.1 | -8.2 | -8.5 | -36.4 |
| 회사채 AAA 3Y | | 3.488 | -4.6 | -13.8 | -22.9 | -25.7 | -68 |
| 회사채 AAA 5Y | | 3.506 | -4.6 | -12.9 | -28.0 | -30.7 | -80.7 |
| 회사채 AA+ 1Y | | 3.594 | -0.8 | -6.2 | -8.5 | -9.6 | -43.9 |
| 회사채 AA+ 3Y | | 3.535 | -4.4 | -11.9 | -22.0 | -29.7 | -75.2 |
| 회사채 AA+ 5Y | | 3.596 | -4.8 | -13.5 | -30.6 | -38.8 | -86.3 |
| 회사채 AA 1Y | | 3.615 | -0.8 | -6.3 | -9.1 | -11.6 | -45.6 |
| 회사채 AA 3Y | | 3.576 | -4.4 | -11.6 | -21.9 | -29.8 | -75.2 |
| 회사채 AA 5Y | | 3.664 | -4.8 | -13.6 | -30.5 | -38.4 | -85.4 |
| 회사채 AA- 1Y | | 3.643 | -0.9 | -6.4 | -9.3 | -12.5 | -46.8 |
| 회사채 AA- 3Y | | 3.620 | -4.4 | -11.9 | -22.7 | -31.5 | -76.8 |
| 회사채 AA- 5Y | | 3.775 | -4.8 | -13.7 | -30.2 | -38.1 | -85.1 |

주간 입찰 일정 및 결과

| 일자 | 요일 | 종목명 | 만기 | 발행금액 | 발행금리 |
|--------|----|-----|-----|-------|-------|
| 6월 17일 | 월 | 국고채 | 10y | 27000 | 3.275 |
| 6월 17일 | 월 | 통안채 | 91d | 6200 | 3.470 |
| 6월 19일 | 수 | 통안채 | 3y | 13700 | 3.250 |

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

| 종목명 | 구분 | 만기일 | 발행금액 | 표면금리 | 민평3사 | 신용등급 |
|---------------------|-----|---------------|------|-------|-------|------|
| 우리금융조건부(상)17(신중) | 회사채 | - | 4000 | 4.270 | 5.779 | AA- |
| 국민은행4406할인일10M-19 | 금융채 | 2025-04-19(토) | 3500 | 3.440 | 3.545 | AAA |
| 기업은행(단)2406할304A-19 | 금융채 | 2025-04-19(토) | 2500 | 3.400 | 3.513 | AAA |
| 농림채(중앙회)2024-603Y-B | 특수채 | 2027-06-19(토) | 2500 | 3.370 | 3.390 | AAA |
| 중소벤처기업진흥채권861(사) | 특수채 | 2027-06-18(금) | 1200 | 3.315 | 3.390 | AAA |
| 현대캐피탈2019-2 | 금융채 | 2026-06-19(금) | 1100 | 3.575 | 3.583 | AA+ |
| 현대캐피탈522 | 금융채 | 2026-12-18(금) | 1000 | 3.645 | 3.702 | AA- |
| 중소벤처기업진흥채권862(사) | 특수채 | 2029-06-19(화) | 800 | 3.328 | 3.386 | AAA |
| 현대캐피탈2019-4 | 금융채 | 2026-12-18(금) | 500 | 3.56 | 3.571 | AA+ |
| 케이비국민카드407-2 | 금융채 | 2027-01-19(화) | 400 | 3.561 | 3.571 | AA+ |

주체별 현물 순매수/순매도 현황

| 은행 순매수 상위 5건 | | | | | 은행 순매도 상위 5건 | | | | | | |
|---------------------|----------|------|-------|------|-----------------------|----------|--------------------|-------|------|------|------|
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 채정2024-0210-0063 | 24-08-22 | 3.55 | 297 | 0.2 | 국고03875-2612(23-10) | 26-12-10 | 3.19 | -111 | 2.5 | | |
| 통안DC024-0919-0910 | 24-09-19 | 3.53 | 110 | 0.3 | 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.16 | -81 | 29.7 | | |
| 기업은행(단)2406할304A-19 | 25-04-19 | 3.50 | 100 | 0.8 | 통안04020-2510-02 | 25-10-02 | 3.29 | -50 | 1.3 | | |
| 중소벤처기업진흥채권861(사) | 27-06-18 | 3.32 | 90 | 3.0 | 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.32 | -50 | 1.2 | | |
| 농림채(중앙회)2024-603Y-B | 27-06-19 | 3.37 | 80 | 3.0 | 농림금융채(은행)2024-0503Y-B | 27-05-03 | 3.41 | -50 | 2.9 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 677 | 1.0 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -342 | 8.6 |
| 보험/기금 순매수 상위 5건 | | | | | 보험/기금 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 농림채(중앙회)2024-603Y-B | 27-06-19 | 3.37 | 110 | 3.0 | 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.27 | -125 | 9.5 | | |
| 국고03500-3406(24-5) | 34-06-10 | 3.24 | 95 | 100 | 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.12 | -86 | 29.7 | | |
| 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.33 | 50 | 1.2 | 국고03250-3306(23-5) | 33-06-10 | 3.28 | -70 | 9.0 | | |
| 현대캐피탈2019-2 | 26-06-19 | 3.58 | 40 | 2.0 | 국고03875-4309(23-9) | 43-09-10 | 3.21 | -37 | 19.2 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.18 | 31 | 3.0 | 국고04250-3212(22-14) | 32-12-10 | 3.29 | -30 | 8.5 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 326 | 4.6 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -348 | 15.3 |
| 투신 순매수 상위 5건 | | | | | 투신 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 채정2024-0210-0063 | 24-08-22 | 3.55 | 1,059 | 0.2 | 국고03875-2612(23-10) | 26-12-10 | 3.20 | -155 | 2.5 | | |
| 국고03250-2706(24-4) | 27-06-10 | 3.18 | 99 | 3.0 | 국고04125-3312(23-11) | 33-12-10 | 3.28 | -114 | 9.5 | | |
| 통안03430-2703-03 | 27-03-03 | 3.26 | 83 | 2.7 | 현대캐피탈477-1 | 24-10-29 | 3.67 | -50 | 0.4 | | |
| 산림24신할0008-0429-2 | 24-12-29 | 3.56 | 80 | 0.5 | 하나캐피탈400-2 | 25-02-28 | 3.65 | -50 | 0.7 | | |
| 기업은행(단)2406할304A-19 | 25-04-19 | 3.50 | 80 | 0.8 | 통안03365-2604-02 | 26-04-02 | 3.24 | -40 | 1.8 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 1,401 | 0.6 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -408 | 3.9 |
| 외국인 순매수 상위 5건 | | | | | 외국인 순매도 상위 5건 | | | | | | |
| 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | 종목 | 만기 | 수익률 | 수량 | 잔존만기 | | |
| 채정2024-0210-0063 | 24-08-22 | 3.56 | 235 | 0.2 | 통안01510-2409-03 | 24-09-03 | 3.38 | -66 | 0.2 | | |
| 국고02375-2703(22-1) | 27-03-10 | 3.21 | 105 | 2.7 | 국고03250-2803(23-1) | 28-03-10 | 3.22 | -60 | 3.7 | | |
| 국고01750-2609(21-7) | 26-09-10 | 3.23 | 100 | 2.2 | 국고03625-2509(23-8) | 25-09-10 | 3.33 | -50 | 1.2 | | |
| 국고01375-3006(20-4) | 30-06-10 | 3.24 | 50 | 6.0 | 국고04000-3112(11-7) | 31-12-10 | 3.28 | -19.8 | 7.5 | | |
| 국고03250-5403(24-2) | 54-03-10 | 3.13 | 34 | 29.7 | 국고02500-5203(22-2) | 52-03-10 | 3.30 | -14.0 | 27.7 | | |
| 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | | | 524 | 3.5 | 수량 합계 및 가중 평균 잔존만기 | | | -210 | 4.0 |

주체별 선물 순매수

| 구분 | 은행 | 보험 | 자산운용 | 외국인 | 증권/선물 |
|------|--------|------|-------|-------|--------|
| 당일 | -8545 | -299 | -1173 | 18936 | -7855 |
| 5일누적 | -20542 | -77 | -5805 | 91276 | -49438 |

Fund Flow

| 구분 | 잔액 | 1D | 1W | 1M | YTD |
|---------|-----------|--------|--------|---------|---------|
| MMF* | 204049.8 | 1102.5 | 2717.9 | -4555.8 | 32992.3 |
| 채권형* | 153995.2 | 384.2 | 1375.2 | 1187 | 17412 |
| 주식형* | 114876.8 | 148.5 | 271.9 | 1540.3 | 11009.1 |
| 저축성예금** | 1632015.9 | 0 | -955.9 | 4791.2 | 15423.1 |
| CD순발행** | 72407.6 | 0 | -401.1 | 1774.3 | 1832.2 |

*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 |
|------------------|------|------------|-------|-------|-----|
| 우리금융조건부(상)17(신중) | AA- | 2099-12-31 | - | 4.26 | 142 |
| 한국수력원자력58-1 | AAA | 2025-06-15 | 3.52 | 3.49 | 100 |
| 한화시스템5-1 | AA- | 2026-06-04 | 3.604 | 3.57 | 100 |
| 풍산107 | A+ | 2025-04-25 | 3.902 | 3.76 | 90 |
| LG에너지솔루션2-2(녹) | AA0 | 2026-06-29 | 3.489 | 3.47 | 60 |
| 신한금융지주143-1 | AAA | 2024-09-06 | 3.524 | 3.45 | 50 |
| 에스케이이엔에스19-1 | AA0 | 2026-07-11 | 3.644 | 3.59 | 50 |
| 한국수력원자력69-1 | AAA | 2025-12-20 | 3.503 | 3.46 | 50 |
| 한국중부발전31-3 | AAA | 2025-04-29 | 3.535 | 3.55 | 50 |
| 롯데지주13-1 | AA- | 2025-02-25 | 3.817 | 3.75 | 50 |
| LG화학54-2(지) | AA+ | 2026-02-19 | 3.482 | 3.46 | 40 |
| 신한금융지주166-1 | AAA | 2027-05-23 | 3.449 | 3.41 | 40 |
| SK302-1 | AA+ | 2025-02-22 | 3.564 | 3.56 | 40 |
| LG유플러스117-1 | AA0 | 2027-06-12 | 3.498 | 3.49 | 40 |
| KT187-3 | AAA | 2024-09-02 | 3.472 | 3.62 | 40 |
| 현대백화점28 | AA+ | 2025-05-27 | 3.491 | 3.54 | 40 |
| 하오준케이제오차5-2 | 없음 | 2028-04-21 | - | 5.42 | 40 |
| 통영에코파워2 | A+ | 2025-07-28 | 4.699 | 4.6 | 39 |