



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

16 Aug. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 플랫닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 1.3 (-0.2) 국10/3: 5.5 (-0.5) 국10/5: 4.2 (-0.3) 국30/10: -11.2 (-0.9)	

KR Market

KR Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.490	0.0	1.0	-5.0
통안1Y		3.020	-1.0	-5.0	-17.8
통안2Y		2.953	-1.8	-3.2	-17.2
국고3Y		2.887	-2.8	-4.4	-18.5
국고5Y		2.898	-3.2	-5.2	-19.9
국고10Y		2.940	-3.5	-6.2	-23.5
국고20Y		2.930	-3.2	-5.9	-21.5
KR Credit(%bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y		3.483	-0.8	0.5	-7.9
회사채 AA- 3Y		3.389	-1.5	-1.3	-13.3
회사채 BBB+ 3Y		6.941	-2.8	-4.4	-24.2
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		106.07	9	9	
LKTBF 10Y		117.69	34	55	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2644.50	0.88	2.96	-7.56
KOSDAQ		776.83	1.56	3.78	-8.92
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1360.6	-0.72	-1.18	-1.61
원/100엔		922.12	-0.26	-1.05	5.31

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.183	0.75	1Y	2.875	0	IRS-통1	16.3	1.75
2Y	2.943	-2.00	2Y	2.735	0	IRS-통2	-1.1	-0.20
3Y	2.853	-2.75	3Y	2.69	0	IRS-국3	-3.5	0.05
5Y	2.815	-2.50	5Y	2.69	0	IRS-국5	-8.3	0.70
10Y	2.845	-3.00	10Y	2.6	0	IRS-국10	-9.5	0.50

US Bond Market

US Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		4.105	14.3	6.5	-31.6
UST5Y		3.808	12.7	-2.1	-26.7
UST10Y		3.939	10.1	-5.2	-22
UST30Y		4.206	7.9	-7.4	-16.8

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.246	0.3	-0.1	-10.0	-30.8	-56.5
특수채 AAA 3Y		3.109	-1.8	-2.4	-12.7	-44.1	-97.2
특수채 AAA 5Y		3.114	-2.5	-2.9	-14.3	-44.3	-103
은행채 AAA 1Y		3.290	0.4	0.9	-4.2	-32.8	-57.8
은행채 AAA 3Y		3.174	-1.5	-2.0	-14.7	-47.6	-104.8
은행채 AAA 5Y		3.176	-2.7	-4.0	-17.3	-57.0	-117.7
금융채 AA 1Y		3.403	0.0	-0.5	-10.0	-31.7	-73.2
금융채 AA 3Y		3.369	-0.8	-0.5	-10.1	-43.1	-118.2
금융채 AA 5Y		3.489	-2.3	-2.8	-17.3	-56.4	-126.7
금융채 AA- 1Y		3.470	1.0	1.0	-8.8	-31.8	-86.2
금융채 AA- 3Y		3.483	-0.8	0.5	-7.9	-44.8	-131.8
금융채 AA- 5Y		3.612	-2.3	-2.8	-17.8	-60.4	-135.1
금융채 A+ 1Y		4.373	0.0	-2.5	-13.0	-36.6	-73.3
금융채 A+ 3Y		4.509	-1.8	-3.0	-13.2	-53.2	-109.6
금융채 A+ 5Y		4.760	-3.3	-5.3	-19.0	-58.5	-114.4
금융채 A 1Y		5.095	0.0	-2.5	-13.0	-35.6	-69.8
금융채 A 3Y		5.302	-1.8	-3.0	-13.2	-51.9	-105.6
금융채 A 5Y		5.444	-3.3	-5.3	-19.0	-58.0	-112.9
금융채 A- 1Y		5.662	0.0	-2.5	-13.0	-36.1	-70.8
금융채 A- 3Y		5.932	-1.8	-3.0	-13.2	-51.4	-103.1
금융채 A- 5Y		6.085	-3.3	-5.3	-19.0	-58.0	-112.1
회사채 AAA 1Y		3.273	-0.8	-3.3	-16.3	-36.5	-72.6
회사채 AAA 3Y		3.246	-2.5	-3.6	-15.6	-44.1	-102.9
회사채 AAA 5Y		3.250	-2.7	-3.7	-17.3	-51.3	-120.6
회사채 AA+ 1Y		3.291	-0.8	-3.6	-16.5	-36.9	-80.2
회사채 AA+ 3Y		3.306	-1.8	-3.6	-13.6	-42.5	-111.8
회사채 AA+ 5Y		3.327	-2.2	-2.7	-16.5	-54.9	-129.7
회사채 AA 1Y		3.311	-0.9	-3.7	-16.9	-37.6	-82.3
회사채 AA 3Y		3.344	-1.8	-1.5	-13.6	-42.7	-111.5
회사채 AA 5Y		3.392	-2.2	-2.7	-16.5	-55.2	-129.3
회사채 AA- 1Y		3.341	-0.8	-3.6	-16.5	-37.8	-83.2
회사채 AA- 3Y		3.389	-1.5	-1.3	-13.3	-43.6	-113.3
회사채 AA- 5Y		3.495	-2.2	-2.7	-16.7	-55.7	-129.9

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
8월 12일	월	국고채	3y	20000	2.935
8월 12일	월	통안채	91d	5000	3.210
8월 13일	화	국고채	2y	7000	3.000

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
한화솔루션신증자본증권 1	회사채	2054-08-14(금)	7000	5.950	-	A+
산금24신이0206-0814-2	금융채	2027-02-14(일)	4000	3.120	3.096	AAA
우리은행28-08-이표03-갑-14	금융채	2027-08-14(토)	3500	3.210	3.189	AAA
신한은행28-08-이-3-B	금융채	2027-08-14(토)	3500	3.210	-	AAA
기업은행(신)2408이2A-14(사)	금융채	2026-08-14(금)	2600	3.170	3.141	AAA
현대카드906-6	금융채	2029-08-14(화)	1400	3.491	3.316	AA+
산금24신이0300-0814-3	금융채	2027-08-14(토)	1300	3.090	3.070	AAA
한국가스공사500	특수채	2029-08-14(화)	1200	3.195	3.139	AAA
수산금융채권(은행)24-8이12-1	금융채	2025-08-14(목)	1100	3.34	3.286	AAA
기업은행(단)2408할304A-14(사)	금융채	2025-06-14(토)	1100	3.210	3.288	AAA

주체별 현물 순매수/순매도 현황

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
채정2024-0290-0028	24-09-13	3.35	292	0.1	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.03	-130	0.8
산금24이0206-0814-2	27-02-14	3.12	290	2.5	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.93	-90	1.8
통안03230-2507-01	25-07-09	3.01	270	0.9	국고03625-2509(23-6)	25-09-10	3.04	-67	1.1
국고01500-2612(16-8)	26-12-10	2.94	160	2.3	국고03250-2809(23-8)	28-09-10	2.92	-60	4.1
기업은행(신)2408이2A-14(사)	26-08-14	3.17	150	2.0	통안03365-2604-02	26-04-02	2.99	-50	1.6
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
1.162					1.4				
보통/기업 순매수 상위 5건					보통/기업 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
현대카드906-6	29-08-14	3.50	68	5.0	국고01500-2612(16-8)	26-12-10	2.94	-130	2.3
기업은행(신)2408이2A-14(사)	26-08-14	3.17	50	2.0	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.85	-63	29.6
국고03250-5303(23-2)	53-03-10	2.87	36	28.6	국고03250-5003(20-2)	50-03-10	2.96	-50	8.8
통안03365-2604-02	26-04-02	2.99	30	1.6	국고01500-3306(23-5)	50-03-10	2.81	-53	25.6
국고02500-5203(22-2)	52-03-10	3.16	24	27.6	농협금융채권(은행)2020-08이5Y-B	25-08-18	3.25	-40	1.0
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
208					10.5				
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
부산은행2024-08이(변)1A-14	25-08-14	3.57	80	1.0	국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.89	-66	2.8
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.94	42	9.8	산금23번이0100-0920-1M	24-09-20	3.52	-30	0.1
현대카드906-6	29-08-14	3.49	42	5.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.91	-23	2.3
한국수출입은행(은행)2309가-이B-1	24-09-01	3.55	40	0.0	기업은행(신)2309이2A-01	25-09-01	3.27	-20	1.0
신한은행28-08-이-1B(변동)	25-08-13	3.55	40	1.0	통안03430-2505-01	25-05-09	3.10	-20	0.7
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
244					3.1				
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
채정2024-0290-0028	24-09-13	3.35	533	0.1	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.07	-132	0.8
통안03230-2507-01	25-07-09	3.00	370	0.9	국고031375-2409(19-5)	24-09-10	3.01	-80	0.1
국고01500-2612(16-8)	26-12-10	2.94	210	2.3	국고04000-3112(11-7)	31-12-10	2.98	-62.0	7.3
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.84	151	29.6	산금23신이0200-0911-1	25-09-11	3.30	-60.0	1.1
통안03670-2507-02	25-07-02	3.03	100	0.9	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.07	-60.0	0.8
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					수량 합계 및 가중 평균 잔존만기				
1.364					4.0				

주체별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-3844	-256	152	-3095	6011
5일누적	-7906	-427	912	9261	-4721

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	199310.3	-1864.4	-9026.8	-6480.8	28252.8
채권형*	168767.8	-8.4	307.3	10933.6	32184.6
주식형*	115236.4	791.5	2895.8	-5088.3	11368.7
저축성예금**	1657992.3	1776.4	8073.2	8279.4	41399.5
CD순발행**	69564.2	-487.9	-592.3	-1108.8	-1011.2