



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

5 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 플랫닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 2.5 (-1.0) 국10/3: 8.0 (-2.5) 국10/5: 5.5 (-1.5) 국30/10: -15.0 (2.0)	

KR Market

KR Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.600	-1.0	-2.0	2.0
통안1Y		3.380	-1.0	1.3	-5.1
통안2Y		3.399	-3.6	-0.6	-10.3
국고3Y		3.392	-4.0	0.5	-11.3
국고5Y		3.417	-5.0	0.2	-13.5
국고10Y		3.472	-6.5	-0.5	-14.5
국고20Y		3.400	-4.7	-2.7	-13.0
KR Credit(%bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y		3.924	-4.5	-1.7	-12.0
회사채 AA- 3Y		3.814	-4.2	-0.2	-15.1
회사채 BBB+ 3Y		7.525	-4.3	-1.0	-22.1
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		104.49	14	10	
LKTBF 10Y		112.73	56	54	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2662.10	-0.76	-2.23	-0.54
KOSDAQ		845.84	0.13	-0.61	-2.28
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1376	-0.01	1.29	0.97
원/100엔		886.08	1.13	2.36	-0.38

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.513	-2.25	1Y	3.435	-4.5	IRS-통1	13.3	-1.25
2Y	3.438	-4.00	2Y	3.24	-6	IRS-통2	3.9	-0.40
3Y	3.393	-4.75	3Y	3.225	-6.5	IRS-국3	0.1	-0.75
5Y	3.360	-5.75	5Y	3.23	-6.5	IRS-국5	-5.7	-0.75
10Y	3.365	-5.50	10Y	3.07	-6.5	IRS-국10	-10.7	1.00

US Bond Market

US Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		4.781	-3.7	-20.6	-4.5
UST5Y		4.352	-6.1	-24.9	-15.3
UST10Y		4.333	-6	-22.2	-18.1
UST30Y		4.476	-6.5	-19.3	-19.1

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.572	-1.5	0.3	-5.2	-7.2	-22.2
특수채 AAA 3Y		3.552	-3.8	0.2	-12.0	-3.8	-33.8
특수채 AAA 5Y		3.557	-4.9	0.5	-13.2	-3.7	-33.4
은행채 AAA 1Y		3.608	-1.2	-0.5	-7.1	-6.9	-25.2
은행채 AAA 3Y		3.642	-4.1	-0.8	-13.4	-6.8	-40.3
은행채 AAA 5Y		3.712	-5.2	-1.6	-17.9	-12.1	-39.2
금융채 AA 1Y		3.717	-1.5	-1.0	-6.4	-2.5	-31.3
금융채 AA 3Y		3.798	-4.5	-1.7	-11.0	-8.3	-44.6
금융채 AA 5Y		4.029	-5.0	-1.3	-16.4	-11.5	-50.8
금융채 AA- 1Y		3.770	-2.0	-1.5	-8.1	-11.3	-37.8
금융채 AA- 3Y		3.924	-4.5	-1.7	-12.0	-17.7	-52
금융채 AA- 5Y		4.173	-5.0	-1.8	-18.3	-16.8	-57.2
금융채 A+ 1Y		4.726	-2.0	-1.5	-9.1	-10.8	-30.5
금융채 A+ 3Y		5.021	-4.5	-1.7	-14.3	-9.0	-32.2
금융채 A+ 5Y		5.317	-5.0	-1.3	-16.0	-3.8	-30.7
금융채 A 1Y		5.443	-2.0	-1.5	-8.6	-9.8	-29
금융채 A 3Y		5.806	-4.5	-1.7	-13.3	-6.3	-31
금융채 A 5Y		6.001	-5.0	-1.3	-15.5	-2.8	-30.8
금융채 A- 1Y		6.015	-2.0	-1.5	-8.6	-9.8	-31
금융채 A- 3Y		6.431	-4.5	-1.7	-13.3	-6.3	-29.5
금융채 A- 5Y		6.642	-5.0	-1.3	-15.5	-2.8	-30.4
회사채 AAA 1Y		3.653	-1.6	0.6	-3.8	-6.0	-28
회사채 AAA 3Y		3.694	-4.1	-0.6	-12.4	-5.3	-39
회사채 AAA 5Y		3.741	-5.2	-0.9	-15.9	-7.0	-47.3
회사채 AA+ 1Y		3.670	-2.1	-0.2	-4.1	-10.1	-35.6
회사채 AA+ 3Y		3.727	-4.2	-0.2	-13.5	-12.7	-47.6
회사채 AA+ 5Y		3.853	-5.2	-0.9	-17.0	-13.7	-50.5
회사채 AA 1Y		3.700	-2.0	-0.2	-4.0	-11.3	-36.8
회사채 AA 3Y		3.767	-4.2	-0.2	-14.0	-12.9	-47.6
회사채 AA 5Y		3.922	-5.2	-0.9	-16.9	-13.2	-50
회사채 AA- 1Y		3.730	-1.7	0.1	-4.4	-12.3	-37.9
회사채 AA- 3Y		3.814	-4.2	-0.2	-15.1	-14.2	-49
회사채 AA- 5Y		4.034	-5.1	-0.5	-16.5	-12.8	-49.8

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
6월 3일	월	국고채	30y	38000	3.380
6월 3일	월	통안채	91d	5400	3.450

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
수산금융채권(경제)53-0601표1	특수채	2025-06-05(목)	2000	-	-	AAA
부산항만공사44-1	특수채	2027-06-04(금)	1200	3.555	3.552	AAA
롯데카드534-1	금융채	2026-09-04(금)	1200	4.003	3.850	AA-
롯데카드534-2	금융채	2026-12-03(목)	1200	4.033	3.879	AA-
롯데카드534-4	금융채	2027-06-04(금)	1000	4.073	3.926	AA-
부산항만공사44-2	특수채	2029-06-05(화)	900	3.553	3.557	AAA
롯데캐피탈462-1	금융채	2027-06-03(목)	400	4.953	5.020	A+
롯데캐피탈462-2	금융채	2027-06-04(금)	400	4.953	5.021	A+
롯데캐피탈462-3	금융채	2029-06-05(화)	200	5.05	5.337	A+
롯데카드534-3	금융채	2026-12-04(금)	200	4.033	3.879	AA-

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억 계약 %, 년)											
은행 순매수 상위 5건						은행 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	잔존만기
주채금융공사154(사)	26-06-04	3.54	160	2.0	통안03365-2604-02	26-04-02	3.40	-120	1.8		
주채금융공사MBS 2024-11(1-4)(사)	29-06-04	3.59	130	5.0	산금23신미0300-0502-2	26-05-02	3.51	-70	1.9		
한국철도공사252	29-06-04	3.58	100	5.0	통안03430-2703-03	27-03-03	3.42	-70	2.7		
주채금융공사MBS 2024-11(1-5)(사)	31-06-04	3.71	100	7.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.47	-58	9.5		
광주광역시지정채2024-01	27-06-04	3.55	70	3.0	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.42	-50	4.3		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
보통/기업 순매수 상위 5건						보통/기업 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	잔존만기
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.38	130	29.8	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.38	-100	0.8		
주채금융공사MBS 2024-11(1-3)(사)	27-06-04	3.56	80	3.0	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.37	-100	1.0		
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.40	72	19.3	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	3.33	-70	28.8		
주채금융공사MBS 2024-11(1-6)(사)	34-06-04	3.75	70	10.0	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	3.32	-60	0.5		
주채금융공사154(사)	26-06-04	3.54	60	2.0	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.48	-52	9.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
투신 순매수 상위 5건						투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	잔존만기
통안03365-2604-02	26-04-02	3.40	90	1.8	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.39	-139	2.5		
광주광역시지정채2024-01	27-06-04	3.57	84	3.0	산금23신미0106-0609-1	24-12-09	3.59	-50	0.5		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.32	72	29.8	한국수출입은행24059-발안-276	25-02-16	3.58	-50	0.7		
한국서부발전62-1	26-06-04	3.53	70	2.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.40	-43	2.0		
하나캐피탈429-1	26-06-04	3.80	70	2.0	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.47	-34	9.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
외국인 순매수 상위 5건						외국인 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	만기	수익률	수량	잔존만기	종류	잔존만기
주채금융공사MBS 2024-11(1-1)(사)	25-06-04	3.52	100	1.0	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	3.41	-30	3.8		
주채금융공사MBS 2024-11(1-2)(사)	26-06-04	3.55	80	2.0	국고01875-2606(16-3)	26-06-10	3.40	-30	2.0		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.45	68	10.0	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	3.32	-20	29.3		
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.37	52	3.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.40	-20.0	2.0		
국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.42	24	4.3	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	3.37	-20.0	1.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					

주제별 선물 순매수

(계약수)					
구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-4059	-444	-565	3285	1833
5일누적	145	-2058	-2798	-7300	11704

Fund Flow

(십억원)					
구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	204967.9	1493.7	-1142	-2072.1	33910.4
채권형*	153518.7	294.0	386.4	3132.6	16935.5
주식형*	113133.7	497.9	-557.2	2482.5	9266
저축성예금**	1639457.8	6563.7	13353.8	15100.6	22865
CD순발행**	72857.2	-82.5	629.5	1748.9	2281.8

*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
한화솔루션285-1	AA-	2024-10-25	3.767	3.77	87
한국서부발전62-1	AAA	2026-06-04	-	3.53	80
JB금융지주11-2	AA+	2025-05-23	3.949	3.77	50
한국서부발전62-2(녹)	AAA	2034-06-02	-	3.8	40
에이치디현대케미칼5-1	A0	2025-03-10	3.994	3.96	40
한화에너지23-1	A+	2026-05-29	3.989	3.95	30
연합자산관리36-1	AA0	2027-06-03	3.808	3.82	30
현대건설308-2	AA-	2027-01-29	3.961	3.9	30
현대제철122-3	AA0	2024-09-19	3.617	3.63	30
한화에너지로스패이스123-2	AA-	2024-10-02	3.73	3.68	20
롯데지주13-1	AA-	2025-02-25	3.899	3.88	20
LS129-2	A+	2027-02-26	4.04	3.94	20
미래에셋증권64-2	AA0	2026-02-13	3.817	3.82	20
신한투자증권2301-1	AA0	2024-07-09	3.601	3.67	20
미래에셋자산운용5-2	AA0	2024-09-27	3.752	3.68	20
여천NCC72-2	A0	2025-03-03	4.277	4.51	20
신한금융지주147-1	AAA	2025-06-20	3.609	3.6	20
에스케이이엔에스18-1	AA0	2026-03-03	3.771	3.77	20