



# DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

23 Aug. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 3.0 (0.8) 국10/3: 7.7 (2.0) 국10/5: 4.7 (1.2) 국30/10: -7.5 (1.7)	

## KR Market

KR Bond(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.510	-1.0	2.0	-1.0
통안1Y		3.015	0.4	-0.5	-21.2
통안2Y		2.978	-2.6	2.5	-15.4
국고3Y		2.905	-3.5	1.8	-18.2
국고5Y		2.935	-2.6	3.7	-17.7
국고10Y		2.982	-1.5	4.2	-19.0
국고20Y		2.995	-0.2	6.5	-12.2
KR Credit(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y		3.531	-3.0	4.8	-3.4
회사채 AA- 3Y		3.424	-3.4	3.5	-11.4
회사채 BBB+ 3Y		6.959	-3.5	1.8	-22.5
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		105.98	11	3	
LKTBF 10Y		117.25	12	-10	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2707.67	0.24	2.39	-2.40
KOSDAQ		773.47	-0.82	-0.43	-4.76
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1334.7	-0.14	-1.90	-3.72
원/100엔		918.7	0.60	-0.37	3.32

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.203	-2.00	1Y	2.88	-5	IRS-통1	18.8	-2.40
2Y	3.000	-3.00	2Y	2.765	-3.5	IRS-통2	2.2	-0.40
3Y	2.910	-3.00	3Y	2.72	-3.5	IRS-국3	0.5	0.50
5Y	2.870	-2.00	5Y	2.715	-3.5	IRS-국5	-6.5	0.60
10Y	2.898	-1.00	10Y	2.625	-3.5	IRS-국10	-8.5	0.50

## US Bond Market

US Bond(% ,bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		3.976	4.1	-12.1	-51.5
UST5Y		3.692	3.3	-9.9	-47.3
UST10Y		3.829	2.7	-8.6	-42.3
UST30Y		4.101	2.2	-7.1	-38.4

## KR Credit Market

Bond Yield(% ,bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.262	0.3	1.6	-9.5	-32.1	-54.9
특수채 AAA 3Y		3.141	-3.0	3.2	-10.1	-43.7	-95.8
특수채 AAA 5Y		3.151	-2.5	3.7	-12.2	-42.9	-100.3
은행채 AAA 1Y		3.324	-0.1	3.4	-2.2	-30.1	-56.3
은행채 AAA 3Y		3.193	-3.4	1.9	-14.2	-49.0	-103.8
은행채 AAA 5Y		3.210	-2.6	3.4	-15.3	-55.6	-115.8
금융채 AA 1Y		3.433	0.0	3.0	-6.7	-30.4	-67.7
금융채 AA 3Y		3.417	-3.0	4.8	-5.9	-42.6	-115.4
금융채 AA 5Y		3.537	-2.5	4.8	-13.2	-53.3	-123.6
금융채 AA- 1Y		3.505	0.0	3.5	-4.7	-29.0	-78.5
금융채 AA- 3Y		3.531	-3.0	4.8	-3.4	-44.0	-129.5
금융채 AA- 5Y		3.660	-2.5	4.8	-13.7	-56.1	-132
금융채 A+ 1Y		4.383	0.5	1.0	-12.7	-36.8	-70.1
금융채 A+ 3Y		4.537	-3.0	2.8	-11.9	-53.4	-109.3
금융채 A+ 5Y		4.798	-2.5	3.8	-16.7	-56.2	-112.3
금융채 A 1Y		5.105	0.5	1.0	-12.7	-35.8	-67.1
금융채 A 3Y		5.330	-3.0	2.8	-11.9	-52.1	-105.3
금융채 A 5Y		5.482	-2.5	3.8	-16.7	-55.7	-110.8
금융채 A- 1Y		5.672	0.5	1.0	-12.7	-36.3	-68.1
금융채 A- 3Y		5.960	-3.0	2.8	-11.9	-51.6	-102.8
금융채 A- 5Y		6.123	-2.5	3.8	-16.7	-55.7	-110
회사채 AAA 1Y		3.313	0.3	4.0	-14.5	-34.8	-67.9
회사채 AAA 3Y		3.276	-3.4	3.0	-14.1	-44.9	-100.6
회사채 AAA 5Y		3.296	-2.6	4.6	-14.5	-48.0	-117
회사채 AA+ 1Y		3.333	0.6	4.2	-14.8	-35.1	-75
회사채 AA+ 3Y		3.341	-3.4	3.5	-11.9	-41.9	-109.6
회사채 AA+ 5Y		3.377	-2.6	5.0	-12.5	-50.9	-125.7
회사채 AA 1Y		3.354	0.7	4.3	-14.9	-36.2	-77.3
회사채 AA 3Y		3.379	-3.3	3.5	-11.6	-42.3	-109.3
회사채 AA 5Y		3.441	-2.6	4.9	-12.6	-51.5	-125.4
회사채 AA- 1Y		3.383	0.6	4.2	-14.7	-36.1	-78
회사채 AA- 3Y		3.424	-3.4	3.5	-11.4	-42.8	-111
회사채 AA- 5Y		3.545	-2.6	5.0	-12.6	-51.9	-125.9

## 주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
8월 19일	월	국고채	10y	20000	2.980
8월 19일	월	통안채	91d	5000	3.140
8월 21일	수	통안채	3y	11000	2.980
8월 22일	목	통안채	3y	11000	2.980

## 전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
재정2024-0300-0063	국채	2024-10-24(목)	10000	3.220	3.379	AAA
기업은행(신)2408월1A-22(사)	금융채	2025-08-22(금)	5600	3.200	3.298	AAA
국민은행4408이표월(03)1.5-2	금융채	2026-02-22(일)	4400	3.300	-	AAA
우리은행28-08-이표02-갑-22	금융채	2026-08-22(토)	2700	3.260	3.252	AAA
신한은행28-08-이-2-A	금융채	2026-08-22(토)	1200	3.260	3.252	AAA
우리카드248-1	금융채	2026-08-21(금)	500	3.471	-	AA
BNK캐피탈359-1	금융채	2025-08-22(금)	300	3.579	3.513	AA-
우리카드248-3	금융채	2027-08-20(금)	300	3.424	-	AA
파크물제이차1	회사채	2027-05-22(토)	300	11.00	-	-
동두천드림파워21	회사채	2025-08-21(목)	203	3.620	-	-

## 주제별 현물 순매수/순매도 현황

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.05	170	0.8	산금21신이0400-0119-3	25-01-19	3.37	-60	0.4		
국민은행4408이표월(03)1.5-22	26-02-22	3.30	100	1.5	국고01375-2409(19-5)	24-09-10	2.16	-56	0.1		
우리은행28-08-이표02-갑-22	26-08-22	3.27	100	2.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.92	-50	2.3		
기업은행(신)2408월1A-22(사)	25-08-22	3.30	100	1.0	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.05	-50	0.8		
통안03365-2604-02	26-04-02	3.01	20	1.6	통안03430-2703-03	27-03-03	2.99	-40	2.5		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					490	1.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-256	1.1
보통/기업 순매수 상위 5건					보통/기업 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.91	80	29.6	한국수출입은행230624-이표-2	25-06-26	3.30	-60	0.8		
국민은행4306이표월(03)1.5-16	24-12-16	3.49	20	0.3	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	2.92	-40	29.1		
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	2.99	17	19.1	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.99	-36	9.3		
국고02500-5203(22-2)	52-03-10	2.28	20	27.6	기업은행(신)2306012A-20	25-06-20	3.31	-30	0.8		
국고03250-5303(22-2)	53-03-10	2.93	11	28.6	주식증권공매MB52019-23(1-4)(사)	24-11-19	3.37	-30	0.2		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					148	24.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-196	8.1
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
기업은행(신)2309011A-20	24-09-20	3.53	100	0.1	부산은행2024-02011A-21	25-02-21	3.47	-30	0.5		
국민은행4408이표월(03)1.5-22	26-02-22	3.30	100	1.5	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.90	-25	29.6		
우리은행28-08-이표02-갑-22	26-08-22	3.26	40	2.0	기업은행(신)2309012A-01	25-09-01	3.28	-20	1.0		
신한은행28-08-이-2-A	26-08-22	3.26	40	2.0	국민은행4306이표월(03)1.5-16	24-12-16	3.47	-20	0.3		
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.98	33	9.8	신한은행28-06-이-1A(변동)	25-06-28	3.42	-20	0.8		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					313	2.0	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-115	7.0
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.03	110	0.8	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.11	-100	0.5		
산금24신일0100-0821-1	25-08-21	3.30	80	1.0	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.06	-100	0.8		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.89	51	29.6	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.04	-100.0	1.1		
통안04000-2609-03	26-09-03	2.97	30	2.0	국고01750-2609(21-7)	26-09-10	2.96	-100.0	2.1		
기업은행(신)2309012A-15	25-09-15	3.30	30	1.1	국고01375-2409(19-5)	24-09-10	2.80	-80.3	0.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					301	5.8	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-480	0.9

## 주제별 선물 순매수

구분		은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일		-4027	238	-754	11524	-5601
5일누적		-2898	2438	1554	3823	-2160

## Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	199952.8	-404.7	2858.7	-5461.8	28895.3
채권형*	170119.1	168.7	845.2	4598.2	33535.9
주식형*	118139.3	-112.1	1681.4	-802.9	14271.6
저축성예금**	1654399.4	-2955.2	7133.6	-2049.8	37806.6
CD순발행**	66399	-218	-949.3	-3050.2	-4176.4

\*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

\*\*는 T-4일 기준

## 전일 주요 회사채 거래 내역

(십억 원)					
종목명	신용등급	만기일	민평수익률	평균수익률	거래량
현대자동차318-2(녹)	AA+	2026-02-09	3.321	3.31	70
현대트랜시스40-3	AA-	2026-06-26	3.382	3.4	50
하나증권8	AA0	2025-07-04	3.513	3.56	50
CJ대한통운98-2	AA-	2026-02-04	3.272	3.25	45
더퍼스트사이닝제팔차4		2028-12-20	-	4.2	40
파크물제이차1		2027-05-22	-	11	30
씨제이제일제당31-2	AA0	2029-01-22	3.278	3.25	20
에이치엘비디앤아이[한리]145	BBB+	2025-08-22	-	8	15
교보생명보험5(후)	AA+	2034-08-06	4.297	4.26	12
포스코퓨처엠21-2(녹)	AA-	2028-09-26	3.371	3.39	10
쌍용씨앤이316-1(녹)	A0	2024-09-13	3.838	3.7	8
헤비제일차1-1		2027-04-07	-	4.6	8
대한조선5		2025-08-14	-	7.2	7
SK텔레콤65-3	AAA	2024-10-28	3.376	3.55	6