



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

7 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
•금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
•일드커브: 스티프닝	
•스프레드(bp): 국5/3 2.2 (-0.3) 국10/3: 8.7 (0.7) 국10/5: 6.5 (1.0) 국30/10: -13.7 (1.3)	

KR Market

KR Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
CD91D		3.600	0.0	-1.0	2.0
통안1Y		3.373	-0.7	-0.8	-5.8
통안2Y		3.365	-3.4	-6.3	-13.7
국고3Y		3.343	-4.9	-7.7	-16.2
국고5Y		3.367	-5.0	-9.8	-18.5
국고10Y		3.432	-4.0	-10.3	-18.5
국고20Y		3.365	-3.5	-11.2	-16.5
KR Credit(%bp)		YTM	1D	1W	1M
금융채AA- 3Y		3.874	-5.0	-9.5	-17.0
회사채 AA- 3Y		3.769	-4.5	-7.5	-19.6
회사채 BBB+ 3Y		7.476	-4.9	-8.5	-27.0
KTB Futures(tick)		증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y		104.64	15	34	
LKTBF 10Y		113.18	45	128	
KR Stock(%)		Index	1D	1W	1M
KOSPI		2689.50	1.03	0.46	0.48
KOSDAQ		850.75	0.58	1.47	-1.71
FX Market(%)		Price	1D	1W	1M
원/달러		1373	-0.22	0.59	0.75
원/100엔		878.78	-0.82	1.16	-1.21

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.500	-1.25	1Y	3.395	-4	IRS-통1	12.7	-0.55
2Y	3.398	-4.00	2Y	3.205	-3.5	IRS-통2	3.2	-0.60
3Y	3.348	-4.50	3Y	3.19	-3.5	IRS-국3	0.5	0.40
5Y	3.308	-5.25	5Y	3.18	-5	IRS-국5	-5.9	-0.25
10Y	3.320	-4.50	10Y	3.02	-5	IRS-국10	-11.2	-0.50

US Bond Market

US Bond(%bp)		YTM	1D	1W	1M
UST2Y		4.734	0.3	-20.1	-10.5
UST5Y		4.305	0.4	-26.9	-17.2
UST10Y		4.292	1.1	-25.9	-17
UST30Y		4.439	0.7	-24.5	-16.2

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)		Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y		3.561	-1.1	-2.0	-6.3	-8.1	-23.3
특수채 AAA 3Y		3.502	-5.0	-7.2	-17.0	-8.1	-38.8
특수채 AAA 5Y		3.512	-4.5	-8.7	-17.7	-8.1	-37.9
은행채 AAA 1Y		3.587	-2.1	-3.9	-9.2	-8.6	-27.3
은행채 AAA 3Y		3.593	-4.9	-8.8	-13.3	-11.4	-45.2
은행채 AAA 5Y		3.665	-4.7	-10.9	-22.6	-17.3	-43.9
금융채 AA 1Y		3.712	-0.5	-2.5	-6.9	-3.5	-31.8
금융채 AA 3Y		3.753	-4.5	-9.0	-15.5	-12.3	-49.1
금융채 AA 5Y		3.979	-5.0	-10.8	-21.4	-17.0	-55.8
금융채 AA- 1Y		3.760	-1.0	-3.5	-9.1	-12.8	-38.8
금융채 AA- 3Y		3.874	-5.0	-9.5	-17.0	-22.2	-57
금융채 AA- 5Y		4.118	-5.5	-11.8	-23.8	-22.5	-62.7
금융채 A+ 1Y		4.721	-0.5	-3.0	-9.6	-11.3	-31
금융채 A+ 3Y		4.966	-5.5	-10.0	-19.8	-14.2	-37.7
금융채 A+ 5Y		5.262	-5.5	-11.3	-21.5	-9.8	-36.2
금융채 A 1Y		5.438	-0.5	-3.0	-9.1	-10.3	-29.5
금융채 A 3Y		5.751	-5.5	-10.0	-18.8	-11.5	-36.5
금융채 A 5Y		5.946	-5.5	-11.3	-21.0	-8.8	-36.3
금융채 A- 1Y		6.010	-0.5	-3.0	-9.1	-10.3	-31.5
금융채 A- 3Y		6.376	-5.5	-10.0	-18.8	-11.5	-35
금융채 A- 5Y		6.587	-5.5	-11.3	-21.0	-8.8	-35.9
회사채 AAA 1Y		3.643	-1.0	-1.8	-4.8	-7.1	-29
회사채 AAA 3Y		3.651	-4.3	-8.2	-16.7	-9.3	-43.3
회사채 AAA 5Y		3.691	-5.0	-10.7	-20.9	-12.5	-52.3
회사채 AA+ 1Y		3.658	-1.2	-2.5	-5.3	-11.0	-36.8
회사채 AA+ 3Y		3.682	-4.5	-7.8	-18.0	-16.9	-52.1
회사채 AA+ 5Y		3.800	-5.3	-11.0	-22.3	-19.5	-55.8
회사채 AA 1Y		3.689	-1.1	-2.3	-5.1	-12.0	-37.9
회사채 AA 3Y		3.722	-4.5	-7.8	-18.5	-17.1	-52.1
회사채 AA 5Y		3.869	-5.3	-11.1	-22.2	-19.0	-55.3
회사채 AA- 1Y		3.718	-1.2	-2.1	-5.6	-13.1	-39.1
회사채 AA- 3Y		3.769	-4.5	-7.5	-19.6	-18.4	-53.5
회사채 AA- 5Y		3.980	-5.4	-10.8	-21.9	-18.7	-55.2

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	3.620	-	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

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
채정2024-0190-0063	24-08-09	3.57	400	0.2	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	3.38	-100	4.3
통안03365-2604-02	26-04-02	3.37	220	1.8	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.37	-70	2.0
통안03430-2703-03	27-03-03	3.39	70	2.7	산금23신미0300-0803-1	26-08-03	3.48	-60	2.2
부산항만공사44-1	27-06-04	3.56	50	3.0	기업은행(신)2306미2A-20	25-06-20	3.54	-50	1.0
국고02000-3106(21-5)	31-06-10	3.42	50	7.0	산금23신미0300-0502-2	26-05-02	3.47	-50	1.9
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					790	1.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.30	115	29.8	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.43	-132	9.5
국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.36	46	0.8	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	3.32	-105	29.3
신한캐피탈483-2	30-07-26	4.34	25	6.1	통안03670-2507-02	25-07-02	3.38	-60	1.1
롯데캐피탈462-1	27-06-03	4.95	25	3.0	국고01875-2412(21-10)	24-12-10	3.30	-40	0.5
롯데캐피탈462-2	27-06-04	4.95	22	3.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.35	-35	2.5
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					233	16.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.34	107	3.0	채정2024-0140-0063	24-07-04	3.59	-140	0.1
채정2024-0190-0063	24-08-09	3.57	106	0.2	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.44	-129	9.5
수산금융채권(경제)53-0601표12-05호	25-06-05	3.62	70	1.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.35	-121	2.5
롯데카드534-2	26-12-03	4.03	70	2.5	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.37	-80	2.0
국고03125-5209(22-9)	52-09-10	3.31	62	28.3	한국수출입은행2404A-할인-91	24-07-01	3.55	-50	0.1
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					415	5.6	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
채정2024-0190-0063	24-08-09	3.58	451	0.2	국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.45	-170	0.3
국고03250-2603(24-3)	26-03-10	3.38	105	1.8	국고03125-2709(22-8)	27-09-10	3.38	-25	3.3
국고02000-3106(21-5)	31-06-10	3.42	90	7.0	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.38	-20	0.8
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.43	61	9.5	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	3.38	-200	3.8
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.30	60	29.8	국고01500-2612(16-8)	26-12-10	3.39	-200	2.5
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					766	4.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기		

주제별 선물 순매수

(계약수)					
구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-2730	-221	64	13113	-10056
5일누적	-4511	-2311	-2292	17889	-8524

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	206038.3	1070.4	-3378.2	-4518.9	34980.8
채권형*	153721.3	202.6	424.4	2817.5	17138.1
주식형*	113185.2	51.5	-357.5	954.9	9317.5
저축성예금**	1639457.8	0	3977	14824	22865
CD순발행**	72857.2	0	3416.6	2018.2	2281.8

*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
한온시스템14-2	AA-	2028-04-25	4.389	4.19	110
신한금융지주146-1	AAA	2025-03-23	3.586	3.61	100
현대건설308-2	AA-	2027-01-29	3.924	3.88	100
뉴스타이문1제일차유1	AA+	2025-02-27	3.911	3.92	80
아스본제일차3-1		2030-07-26	-	4.17	75
더퍼스트사이닝제일차3-1		2028-12-20	-	4.98	70
한국수력원자력43-2	AAA	2024-12-18	3.575	3.59	60
한온시스템10-2	AA-	2024-06-27	3.862	3.87	50
농협금융지주34-2	AAA	2025-01-13	3.601	3.61	50
한화시스템5-2	AA-	2027-06-04	3.76	3.74	50
한국중부발전66-2	AAA	2027-01-24	3.614	3.6	40
신한금융지주159-1	AAA	2026-08-28	3.595	3.57	40
신한금융지주148-2	AAA	2027-05-21	3.606	3.58	40
뉴비타제삼차3-1		2030-07-26	-	4.35	40
신한금융지주150-1	AAA	2025-08-11	3.595	3.6	30
한국서부발전30-2	AAA	2026-01-28	3.595	3.6	30