



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

26 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 3Y(상승), 10Y(상승)
- 일드커브: 보합
- 스프레드(bp): 국5/3 1.2 (-0.8) 국10/3: 7.0 (0.0)
국10/5: 5.8 (0.8) 국30/10: -9.0 (0.2)

KR Market

KR Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.600	0.0	0.0	0.0
통안1Y	3.345	0.0	1.1	-3.0
통안2Y	3.260	0.5	-1.5	-17.0
국고3Y	3.200	0.8	-0.7	-21.5
국고5Y	3.212	0.0	-1.8	-22.8
국고10Y	3.270	0.8	-0.7	-23.7
국고20Y	3.242	0.2	0.7	-19.8
KR Credit(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.708	0.5	-2.3	-26.3
회사채 AA- 3Y	3.665	0.8	0.1	-18.7
회사채 BBB+ 3Y	7.332	0.0	-1.6	-23.6
KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.16	-2	-13	
LKTBF 10Y	114.58	-7	-38	
KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2774.39	0.35	0.38	3.23
KOSDAQ	841.99	0.06	-1.97	0.31
FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1387.5	-0.11	0.46	1.31
원/100엔	870.12	0.09	-0.34	-0.22

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)		1D(bp)
1Y	3.400	0.25	1Y	3.305	-2	IRS-통1	5.5	0.25
2Y	3.258	0.25	2Y	3.065	-2.5	IRS-통2	-0.2	-0.25
3Y	3.190	0.00	3Y	3.045	-4	IRS-국3	-1.0	-0.80
5Y	3.148	-0.25	5Y	3.035	-5	IRS-국5	-6.5	-0.25
10Y	3.153	-0.50	10Y	2.975	-6.5	IRS-국10	-11.8	-1.30

US Bond Market

US Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.755	2.1	3	-20.2
UST5Y	4.283	2.1	3.2	-25.1
UST10Y	4.252	1.5	2.5	-21.8
UST30Y	4.38	1.3	2.3	-19.5

KR Credit Market

Bond Yield(% ,bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.517	0.0	-0.3	-6.6	-5.2	-26.9
특수채 AAA 3Y	3.385	0.7	-0.5	-19.3	-11.3	-59.2
특수채 AAA 5Y	3.379	0.3	-0.7	-20.1	-12.4	-60.3
은행채 AAA 1Y	3.512	-0.3	-1.4	-11.3	-9.1	-35.3
은행채 AAA 3Y	3.453	0.7	-1.3	-23.0	-15.5	-66.2
은행채 AAA 5Y	3.471	-0.3	-2.9	-29.5	-26.9	-71.8
금융채 AA 1Y	3.635	0.0	-0.5	-10.2	-6.5	-41.7
금융채 AA 3Y	3.603	0.5	-2.0	-24.0	-21.1	-71.8
금융채 AA 5Y	3.794	0.0	-0.8	-27.6	-29.9	-77.3
금융채 AA- 1Y	3.683	0.0	0.0	-11.2	-13.3	-49
금융채 AA- 3Y	3.708	0.5	-2.3	-26.3	-30.1	-78.6
금융채 AA- 5Y	3.930	0.0	-3.1	-29.1	-35.4	-85.3
금융채 A+ 1Y	4.629	0.0	-1.0	-12.2	-13.5	-40.7
금융채 A+ 3Y	4.790	0.5	-3.3	-28.1	-26.9	-63
금융채 A+ 5Y	5.077	0.0	-2.8	-28.3	-24.5	-61.7
금융채 A 1Y	5.351	0.0	-1.0	-11.2	-12.5	-39.2
금융채 A 3Y	5.583	0.5	-2.5	-26.8	-24.1	-60.5
금융채 A 5Y	5.761	0.0	-2.8	-27.8	-24.0	-62.3
금융채 A- 1Y	5.923	0.0	-1.0	-11.2	-12.5	-40.2
금융채 A- 3Y	6.208	0.5	-2.5	-26.8	-24.1	-59
금융채 A- 5Y	6.402	0.0	-2.8	-27.8	-24.0	-61.9
회사채 AAA 1Y	3.583	-0.4	0.1	-7.8	-8.4	-35.8
회사채 AAA 3Y	3.531	0.6	-0.3	-19.4	-17.8	-62.3
회사채 AAA 5Y	3.528	-0.3	-2.4	-24.8	-22.6	-76.9
회사채 AA+ 1Y	3.609	-0.1	0.7	-7.5	-8.2	-42.8
회사채 AA+ 3Y	3.580	0.8	0.1	-18.0	-20.8	-69.3
회사채 AA+ 5Y	3.620	-0.1	-2.4	-26.6	-30.6	-82.1
회사채 AA 1Y	3.630	-0.1	0.7	-8.6	-10.2	-44.5
회사채 AA 3Y	3.621	0.8	0.1	-18.1	-21.1	-69.4
회사채 AA 5Y	3.687	-0.2	-2.5	-26.9	-30.4	-82.1
회사채 AA- 1Y	3.658	-0.2	0.6	-8.6	-11.1	-45.7
회사채 AA- 3Y	3.665	0.8	0.1	-18.7	-22.3	-71.3
회사채 AA- 5Y	3.799	-0.1	-2.4	-26.5	-30.0	-81.1

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
6월 24일	월	국고채	5y	23000	3.200
6월 24일	월	통안채	91d	5900	3.470
6월 25일	화	국고채	20y	7000	3.220

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
통안DC024-0924-0910	통안채	2024-09-24(화)	5900	3.470	3.450	통안
산금24신이0103-0625-1	금융채	2025-09-25(목)	5000	3.430	3.435	AAA
한국전력1398	특수채	2026-06-25(목)	3000	3.410	3.388	AAA
농협금융채권(은행)2024-0615	금융채	2029-06-25(월)	2400	3.430	3.474	AAA
대한항공107-2	회사채	2027-06-25(금)	2320	3.989	4.818	A-
기업은행(단)2406할304A-25	금융채	2025-04-25(금)	2000	3.400	3.507	AAA
한국전력1399	특수채	2027-06-25(금)	2000	3.400	3.378	AAA
기업은행(단)2406할273A-25	금융채	2025-03-25(화)	1500	3.420	3.518	AAA
자산관리공사제92회5006-25(특수채	2029-06-25(월)	1500	3.33	3.376	AAA
주택금융공사MBS2024-13(1-3)	특수채	2026-06-25(목)	1500	3.328	3.418	AAA

주제별 현물 순매수/순매도 현황

(십억 계약 %, 년)									
은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
산금24신이0103-0625-1	25-09-25	3.43	320	1.3	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.18	-71	29.7
자산관리공사제92회5006-25(사)	29-06-25	3.33	120	5.0	통안03365-2604-02	26-04-02	3.26	-60	1.8
기업은행(단)2406할304A-25	25-04-25	3.50	120	0.8	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.28	-54	9.0
주택금융공사MBS2024-13(1-5)(사)	31-06-25	3.49	90	7.0	국고02375-2812(18-10)	28-12-10	3.25	-50	4.5
주택금융공사MBS2024-13(1-3)(사)	27-06-25	3.32	90	3.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.22	-40	2.5
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	740	2.7			수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	275	11.0		
보통/금융 순매수 상위 5건					보통/금융 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
한국전력1398	26-06-25	3.41	170	2.0	국고02500-5203(22-2)	52-03-10	3.21	-50	27.7
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.25	136	19.2	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	3.18	-23	29.2
주택금융공사MBS2024-13(1-2)(사)	26-06-25	3.33	100	2.0	농협금융채25-2	25-06-26	3.50	-20	1.0
주택금융공사MBS2024-13(1-4)(사)	29-06-25	3.34	90	5.0	부산교통공사2020-08	25-06-25	3.55	-20	1.0
한국전력1399	27-06-25	3.40	90	3.0	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.20	-16	4.7
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	586	6.6			수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	129	16.9		
특수 순매수 상위 5건					특수 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
농협금융채권(은행)2024-0615Y-E	29-06-25	3.43	90	5.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.28	-169	9.5
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.26	69	10.0	통안04020-2510-02	25-10-02	3.29	-40	1.3
우리카드242-2	26-06-25	3.54	70	2.0	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.29	-30	8.5
기업은행(단)2406할273A-25	25-03-25	3.51	60	0.7	재정2024-0150-0063	24-07-11	3.57	-30	0.0
재정2024-0140-0063	24-07-04	3.57	50	0.0	국고01375-3006(20-4)	30-06-10	3.26	-31	7.0
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	339	3.9			수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	300	6.0		
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건				
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.18	200	29.7	국고02625-2806(18-4)	28-06-10	3.23	-100	4.5
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.17	88	27.7	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	3.28	-65	4.0
국고02500-5203(22-2)	52-03-10	3.19	90	9.0	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	3.22	-60.0	3.0
국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.23	30	8.5	국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.29	-24.6	1.2
국고01500-2612(16-8)	26-12-10	3.25	20	7.5	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.28	-10.0	0.2
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	163	20.4			수량 합계 및 가중 평균 잔존만기	394	3.4		

주제별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	-2489	-175	-571	7855	-4162
5일누적	-8201	-83	-3648	44893	-31410

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	198338.4	-192.8	-4608.9	-7771.5	27280.9
채권형*	154500.4	261.5	889.4	1368.1	17917.2
주식형*	116116.9	-300.5	1388.6	2426	12249.2
저축성예금**	1645195.1	4530.3	13179.2	18951.3	28602.3
CD순발행**	70961.6	394	-1446	-1251.7	386.2

*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
삼척블루파워10	A+	2027-06-25	-	6.53	130
우리카드242-2	AA	2026-06-25	-	3.54	100
울산지피에스1-2(녹)	AA-	2027-02-25	3.934	3.86	90
메리츠증권2306-1	AA-	2025-06-09	3.869	3.87	80
신보2022제21자유동화1-1(사)	AAA	2024-10-29	3.67	3.69	70
우리카드242-3	AA	2027-06-25	-	3.53	70
우리금융증권부(상)17(신중)	AA-		4.274	4.27	69
캐슈넛골드1-1		2028-06-20	-	3.88	60
대한항공107-2	A-	2027-06-25	-	3.95	55
대한항공107-3	A-	2029-06-25	-	4.12	52
현대캐피탈10	A+	2025-02-24	3.826	3.75	50
롯데렌탈53-2	A+	2025-10-21	3.833	3.78	50
한국남동발전60-2	AAA	2027-06-25	-	3.4	50
한국남동발전60-3	AAA	2029-06-25	-	3.38	50
에스케이스파셜티8-1	A+	2026-02-20	3.663	3.75	50
송도지오제육자1		2025-06-20	-	7.5	45
GS칼텍스142-1	AA+	2025-03-02	3.538	3.54	40
S-Oil60-2	AAO	1931-01-26	3.635	3.58	40