



# DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

22 Aug. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 스티프닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 2.2 (0.7) 국10/3: 5.7 (0.2) 국10/5: 3.5 (-0.5) 국30/10: -9.2 (0.8)	

## KR Market

KR Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.520	1.0	3.0	0.0
통안1Y	3.011	-1.1	-0.9	-21.6
통안2Y	3.004	0.1	5.1	-11.1
국고3Y	2.940	-0.3	5.3	-12.9
국고5Y	2.961	0.1	6.3	-12.4
국고10Y	2.997	-0.3	5.7	-14.6
국고20Y	2.997	0.2	6.7	-9.8

KR Credit(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.561	-0.2	7.8	1.3
회사채 AA- 3Y	3.458	-0.4	6.9	-6.4
회사채 BBB+ 3Y	6.994	-0.3	5.3	-17.5

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.87	0	-20	
LKTBF 10Y	117.13	0	-56	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2701.13	0.17	2.14	-2.26
KOSDAQ	779.87	-0.96	0.39	-3.71

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1336.6	0.26	-1.76	-3.72
원/100엔	913.18	0.33	-0.97	3.24

IRS(%)		1D(bp)		CRS(%)		1D(bp)		Spread(bp)		1D(bp)	
1Y	3.223	0.00		1Y	2.93	2		IRS-통1	21.2	1.10	
2Y	3.030	0.50		2Y	2.8	2.5		IRS-통2	2.6	0.40	
3Y	2.940	1.00		3Y	2.755	2.5		IRS-국3	0.0	1.30	
5Y	2.890	1.00		5Y	2.75	2.5		IRS-국5	-7.1	0.90	
10Y	2.908	1.00		10Y	2.66	2.5		IRS-국10	-8.9	1.30	

## US Bond Market

US Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	3.935	-5.3	-2.7	-58.4
UST5Y	3.659	-3.1	-2.2	-51.5
UST10Y	3.802	-0.7	-3.6	-45.2
UST30Y	4.079	1.7	-4.8	-39.4

## KR Credit Market

Bond Yield(% ,bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.259	-0.7	1.3	-9.8	-31.7	-56.4
특수채 AAA 3Y	3.171	-0.5	6.2	-5.5	-39.3	-95.8
특수채 AAA 5Y	3.176	0.1	6.2	-7.0	-38.6	-102
은행채 AAA 1Y	3.325	0.0	3.5	-1.4	-29.4	-56.9
은행채 AAA 3Y	3.227	-0.2	5.3	-9.2	-44.2	-103.2
은행채 AAA 5Y	3.236	0.0	6.0	-10.0	-51.0	-117.6
금융채 AA 1Y	3.433	-0.5	3.0	-6.5	-29.9	-69.2
금융채 AA 3Y	3.447	-0.2	7.8	-0.9	-38.1	-115.1
금융채 AA 5Y	3.562	0.0	7.3	-8.0	-49.3	-125.6
금융채 AA- 1Y	3.505	0.0	3.5	-4.5	-29.0	-79.7
금융채 AA- 3Y	3.561	-0.2	7.8	1.3	-39.5	-128.7
금융채 AA- 5Y	3.685	0.0	7.3	-8.5	-52.1	-134
금융채 A+ 1Y	4.378	-0.5	0.5	-13.5	-37.3	-71.8
금융채 A+ 3Y	4.567	-0.2	5.8	-7.2	-49.4	-108.5
금융채 A+ 5Y	4.823	0.0	6.3	-11.5	-52.2	-114.3
금융채 A 1Y	5.100	-0.5	0.5	-13.5	-36.3	-68.8
금융채 A 3Y	5.360	-0.2	5.8	-7.2	-48.1	-104.5
금융채 A 5Y	5.507	0.0	6.3	-11.5	-51.7	-112.8
금융채 A- 1Y	5.667	-0.5	0.5	-13.5	-36.8	-69.8
금융채 A- 3Y	5.990	-0.2	5.8	-7.2	-47.6	-102
금융채 A- 5Y	6.148	0.0	6.3	-11.5	-51.7	-112
회사채 AAA 1Y	3.310	0.0	3.7	-14.7	-34.5	-69.4
회사채 AAA 3Y	3.310	-0.5	6.4	-9.4	-39.8	-100
회사채 AAA 5Y	3.322	-0.2	7.2	-9.0	-43.2	-118.8
회사채 AA+ 1Y	3.327	-0.3	3.6	-15.4	-35.1	-76.8
회사채 AA+ 3Y	3.375	-0.4	6.9	-6.9	-36.9	-109
회사채 AA+ 5Y	3.403	0.0	7.6	-7.2	-46.3	-127.4
회사채 AA 1Y	3.347	-0.4	3.6	-15.6	-36.2	-79.2
회사채 AA 3Y	3.412	-0.4	6.8	-6.8	-37.4	-108.8
회사채 AA 5Y	3.467	0.0	7.5	-7.3	-46.9	-127.1
회사채 AA- 1Y	3.377	-0.3	3.6	-15.4	-36.1	-79.8
회사채 AA- 3Y	3.458	-0.4	6.9	-6.4	-37.8	-110.4
회사채 AA- 5Y	3.571	0.0	7.6	-7.4	-47.3	-127.7

## 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

## 전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
산금24신할0100-0821-1	금융채	2025-08-21(목)	4500	3.200	3.298	AAA
한국수출입금융2408차-이표-2	금융채	2026-08-21(금)	2000	3.200	-	AAA
기업은행(신)2408이2A-21(사)	금융채	2026-08-21(금)	1600	3.200	3.206	AAA
산금24신이0300-0821-2	금융채	2027-08-21(토)	1400	3.100	3.112	AAA
기업은행(신)2408할1A-21(사)	금융채	2025-08-21(목)	1000	3.200	3.298	AAA
자산관리공사제96회3008-21(사)	특수채	2027-08-21(목)	1000	3.126	3.176	AAA
토지주택채권492	특수채	2049-08-21(토)	1000	3.650	3.196	AAA
한국수출입금융(변)2408차-이표	금융채	2025-08-21(목)	1000	3.550	3.325	AAA
도로공사895	특수채	2054-08-21(금)	900	3.04	3.196	AAA
도로공사894	특수채	2029-08-21(화)	700	3.144	3.175	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	종목	만기
채정2024-0300-0063	24-10-24	3.22	460	0.2	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.05	-170	0.8	국고02250-2506(15-2)	25-06-10
통안03430-2703-03	27-03-03	2.99	290	2.5	국고01375-2409(19-5)	24-09-10	3.03	-90	0.1	국고01375-2409(19-5)	24-09-10
국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.05	150	0.8	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	2.98	-80	1.8	국고03125-2606(23-4)	26-06-10
통안03365-2604-02	26-04-02	3.04	120	1.6	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.07	-70	0.6	국고01500-2503(20-1)	25-03-10
기업은행(신)2408이2A-21(사)	26-08-21	3.20	120	2.0	국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.05	-60	1.3	국고04250-2512(22-13)	25-12-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
1.140						1.470					
보통/금융 순매수 상위 5건						보통/금융 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
토지주택채권492	49-08-21	3.65	100	25.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.01	-66	9.3	국고04125-3312(23-11)	33-12-10
도로공사895	54-08-21	3.04	90	30.0	상장카드2445	25-06-09	3.39	-40	0.8	상장카드2445	25-06-09
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.89	32	29.6	국고03250-3306(23-5)	33-06-10	2.99	-35	8.8	국고03250-3306(23-5)	33-06-10
통안03280-2504-02	25-04-02	3.09	30	0.6	국고채미자03460-2806	28-06-10	3.03	-40	3.8	국고채미자03460-2806	28-06-10
국고채미자01600-3903	39-03-10	3.01	40	14.6	국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.99	-32	9.8	국고03500-3406(24-5)	34-06-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
292						-212					
투신 순매수 상위 5건						투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
국고03250-4209(22-11)	42-09-10	3.00	103	18.1	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	2.90	-102	29.6	국고03250-5403(24-2)	54-03-10
한국수출입금융(변)2408차-이표-1	25-08-21	3.55	100	1.0	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.05	-60	0.8	국고03125-2506(22-4)	25-06-10
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	2.99	51	9.8	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	2.99	-48	9.3	국고04125-3312(23-11)	33-12-10
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	2.94	51	2.8	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.95	-30	2.3	국고03875-2612(23-10)	26-12-10
도로공사894	29-08-21	3.14	50	5.0	국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.50	-30	0.1	국고03000-2409(14-5)	24-09-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
355						-270					
외국인 순매수 상위 5건						외국인 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기
채정2024-0300-0063	24-10-24	3.22	670	0.2	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.05	-170	0.8	국고02250-2506(15-2)	25-06-10
국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.06	200	0.6	국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.05	-65	0.8	국고03125-2506(22-4)	25-06-10
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	2.94	120	2.3	국고03875-4309(23-9)	43-09-10	3.00	-23.0	19.1	국고03875-4309(23-9)	43-09-10
한국수출입금융2408차-이표-2	26-08-21	3.20	110	2.0	국고03500-2809(23-6)	28-09-10	2.96	-100	4.1	국고03500-2809(23-6)	28-09-10
통안03670-2507-02	25-07-02	3.00	100	0.9	국고03250-2803(23-1)	28-03-10	2.95	-5.1	3.6	국고03250-2803(23-1)	28-03-10
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기						수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					
1.200						-273					

## 주제별 선물 순매수

(계약수)					
구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	2128	607	-848	1953	-2702
5일누적	-2715	1944	2460	-10796	9452

## Fund Flow

(십억원)					
구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	200357.5	-758.2	2852.5	-4558.8	29300
채권형*	169950.4	165.4	946.8	4387.5	33367.2
주식형*	118251.4	967.2	2804.7	-967.7	14383.7
저축성예금**	1658256.8	2822.5	1941.8	7715	41664
CD순발행**	66564	-219.8	-3344.4	-1511.8	-4011.4

\*는 T-2일 기준, 펀드는 설정액 및 ETF 제외 기준

\*\*는 T-4일 기준

## 전일 주요 회사채 거래 내역

(십억원)
-------