



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

15 Jul. 2024

전일 국내 채권 시장 요약

- 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)
- 일드커브: 스티프닝
- 스프레드(bp): 국5/3 1.3 (0.0) 국10/3: 7.5 (1.0)
국10/5: 6.2 (1.0) 국30/10: -10.7 (0.5)

KR Market

KR Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.550	0.0	-2.0	-5.0
통안1Y	3.203	-1.9	1.1	-16.7
통안2Y	3.143	-5.7	1.3	-20.7
국고3Y	3.093	-6.5	-2.2	-20.2
국고5Y	3.104	-6.6	-4.3	-21.1
국고10Y	3.167	-5.5	-4.8	-20.3
국고20Y	3.139	-5.3	-3.8	-17.3

KR Credit(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.587	-6.5	-2.8	-25.0
회사채 AA- 3Y	3.545	-6.1	-2.7	-19.4
회사채 BBB+ 3Y	7.206	-6.5	-2.4	-23.0

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	105.48	21	10	
LKTBF 10Y	115.55	56	51	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2857.00	-1.19	-0.18	4.72
KOSDAQ	850.37	-0.24	0.34	-2.33

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1379.6	0.06	-0.05	0.25
원/100엔	864.68	1.76	0.55	-1.17

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	3.320	-5.25	1Y	3.255	-4	IRS-통1	11.7	-3.35
2Y	3.150	-7.75	2Y	2.985	-4.5	IRS-통2	0.7	-2.05
3Y	3.078	-7.50	3Y	2.915	-5.5	IRS-국3	-1.5	-1.00
5Y	3.045	-6.50	5Y	2.905	-5.5	IRS-국5	-5.9	0.10
10Y	3.070	-6.00	10Y	2.82	-5.5	IRS-국10	-9.7	-0.50

US Bond Market

US Bond(% ,bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.454	-6.3	-16	-30.8
UST5Y	4.103	-4.1	-12.8	-22.1
UST10Y	4.184	-2.8	-10	-13.6
UST30Y	4.398	-2.4	-8.1	-8

KR Credit Market

Bond Yield(% ,bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.353	-1.9	0.1	-20.0	-19.7	-47.8
특수채 AAA 3Y	3.257	-6.5	-3.7	-20.7	-31.3	-75.1
특수채 AAA 5Y	3.265	-6.6	-4.1	-19.0	-33.1	-74.9
은행채 AAA 1Y	3.334	-1.1	0.0	-24.1	-24.0	-53.8
은행채 AAA 3Y	3.342	-6.3	-2.2	-21.2	-34.6	-78.2
은행채 AAA 5Y	3.357	-6.6	-4.0	-24.6	-46.7	-83.8
금융채 AA 1Y	3.508	-1.5	1.2	-19.2	-19.2	-61.4
금융채 AA 3Y	3.495	-6.5	-2.8	-22.6	-33.6	-89.8
금융채 AA 5Y	3.670	-6.5	-5.2	-24.9	-45.3	-91.5
금융채 AA- 1Y	3.563	-1.5	1.2	-18.5	-22.3	-71.2
금융채 AA- 3Y	3.587	-6.5	-2.8	-25.0	-40.4	-100.9
금융채 AA- 5Y	3.798	-6.5	-5.5	-26.0	-50.6	-97.7
금융채 A+ 1Y	4.503	-1.5	1.2	-20.1	-26.1	-57.3
금융채 A+ 3Y	4.669	-6.5	-2.8	-25.5	-43.2	-79.8
금융채 A+ 5Y	4.958	-6.5	-4.7	-24.4	-44.4	-75.8
금융채 A 1Y	5.225	-1.5	1.2	-20.1	-25.1	-55.8
금융채 A 3Y	5.462	-6.5	-2.8	-24.7	-40.4	-76.3
금융채 A 5Y	5.642	-6.5	-4.7	-24.4	-43.9	-75.4
금융채 A- 1Y	5.792	-1.5	1.2	-20.6	-25.6	-57.3
금융채 A- 3Y	6.087	-6.5	-2.8	-24.7	-40.4	-74.8
금융채 A- 5Y	6.283	-6.5	-4.7	-24.4	-43.9	-75
회사채 AAA 1Y	3.441	-1.4	0.6	-19.3	-22.9	-53.9
회사채 AAA 3Y	3.423	-5.2	-1.7	-20.3	-34.1	-75.7
회사채 AAA 5Y	3.430	-5.6	-2.7	-20.5	-40.3	-87.4
회사채 AA+ 1Y	3.461	-1.8	0.2	-19.5	-23.5	-61.7
회사채 AA+ 3Y	3.463	-6.0	-2.6	-19.1	-36.6	-84
회사채 AA+ 5Y	3.499	-6.6	-4.6	-23.2	-48.6	-95
회사채 AA 1Y	3.487	-1.7	0.6	-19.1	-24.6	-62.9
회사채 AA 3Y	3.502	-6.2	-2.7	-19.0	-37.1	-84.2
회사채 AA 5Y	3.564	-6.6	-4.7	-23.6	-48.5	-95.1
회사채 AA- 1Y	3.513	-1.7	0.6	-19.4	-25.8	-63.8
회사채 AA- 3Y	3.545	-6.1	-2.7	-19.4	-38.4	-86.2
회사채 AA- 5Y	3.669	-6.6	-4.6	-24.3	-48.8	-95.3

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
한국전력1402	특수채	2026-07-12(일)	3000	3.300	3.319	AAA
산금24산이0200-0712-1	금융채	2026-07-12(일)	2400	3.250	3.284	AAA
한국전력1403	특수채	2027-07-12(월)	2000	3.295	3.322	AAA
롯데카드536-1	금융채	2026-10-12(월)	1200	3.640	3.612	AA-
농협금융채권(은행)2024-0701	금융채	2025-07-12(토)	1100	3.310	3.345	AAA
롯데카드536-2	금융채	2027-07-12(월)	900	4.571	4.741	A+
롯데카드536-3	금융채	2027-07-12(월)	700	3.663	-	A
롯데카드536-2	금융채	2027-01-12(화)	500	3.651	3.628	AA-
JB 우리카페빌515-2	금융채	2026-07-10(금)	400	3.55	3.596	AA-
JB 우리카페빌515-1	금융채	2026-03-12(목)	300	3.580	3.579	AA-

주제별 현물 순매수/순매도 현황

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
통안03200-2607-02	26-07-02	3.16	210	2.0	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.16	-170	1.9		
산금24산이0200-0712-1	26-07-12	3.25	170	2.0	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.13	-110	4.7		
산금23산이0200-0802-2	25-08-02	3.33	100	1.1	통안03365-2604-02	26-04-02	3.19	-100	1.7		
국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.29	100	0.2	국고02375-2712(17-7)	27-12-10	3.16	-40	3.4		
한국전력1403	27-07-12	3.30	80	3.0	국고02375-2703(22-1)	27-03-10	3.16	-30	2.7		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					660	1.7	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-450	2.7
보험/기금 순매수 상위 5건					보험/기금 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
한국전력1402	26-07-12	3.30	170	2.0	통안03950-2509-03	25-09-03	3.13	-130	1.1		
한국전력1403	27-07-12	3.30	90	3.0	국고03000-2409(14-5)	24-09-10	3.26	-100	0.2		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.09	85	29.7	국고03250-5303(23-2)	53-03-10	3.09	-31	28.7		
국고03500-7209(22-12)	72-09-10	3.04	77	48.2	에스케이하이닉스221-2	25-02-14	3.35	-30	0.6		
롯데카드536-3	27-07-12	3.66	40	3.0	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.14	-30	1.2		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					462	15.1	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-321	3.4
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03125-2506(22-4)	25-06-10	3.21	100	0.9	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.15	-63	2.4		
한국전력1402	26-07-12	3.30	70	2.0	국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.13	-61	4.7		
롯데카드536-1	26-10-12	3.64	60	2.2	국고03625-5309(23-7)	53-09-10	3.08	-40	29.2		
통안03365-2604-02	26-04-02	3.19	50	1.7	국고03250-5306(23-5)	53-06-10	3.22	-33	8.9		
한국수출입은행240501-월안-276	25-02-16	3.41	40	0.6	하나은행47-070112-08	25-07-08	3.33	-30	1.0		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					320	1.5	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-227	8.5
외국인 순매수 상위 5건					외국인 순매도 상위 5건						
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기		
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.08	77	29.7	국고01250-2603(21-1)	26-03-10	3.21	-266	1.7		
국고03500-7209(22-12)	72-09-10	3.04	60	48.2	통안03280-2504-02	25-04-02	3.26	-220	0.7		
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.14	16	2.4	기업은행(신)231001.15A-20	25-04-20	3.44	-150.0	0.8		
국고03625-2509(23-8)	25-09-10	3.19	8	1.2	기업은행(신)230701.2A-19	25-07-19	3.38	-100.0	1.0		
국고03250-2903(24-1)	29-03-10	3.13	2	4.7	산금23산이0200-0802-2	25-08-02	3.37	-100.0	1.1		
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					162	32.2	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			-836	1.1

주제별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	1631	522	-2540	6392	-4953
5일누적	-12190	612	-5893	41438	-19801

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	205469.5	2146.1	1385	2528.4	34412
채권형*	156964.5	122.8	1079.4	3625.9	20381.3
주식형*	121087.2	555.8	2249	6380.2	17219.5
저축성예금**	1652611.5	709.3	4548.8	21857	36018.7
CD순발행**	71326.2	-239.2	-283.1	-1248.4	750.8

*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
에스케이하이닉스221-2	AAO	2025-02-14	3.418	3.37	151
한국남부발전75-1	AAA	2027-07-02	3.378	3.39	70
포스코퓨처엠 15-2	AA-	2024-10-07	3.416	3.33	60
메리츠증권2301-2	AA-	2026-01-16	3.75	3.65	50
S-Oil55-1	AAO	2024-11-04	3.42	3.36	50
한국남동발전60-1	AAA	2026-06-25	3.351	3.35	50
한국서부발전63-1	AAA	2027-06-17	3.378	3.37	50
LG유플러스111-1	AAO	2025-06-30	3.418	3.43	50
LG유플러스113-1	AAO	2025-01-13	3.427	3.47	40
한국서부발전60-2	AAA	2029-01-16	3.382	3.38	40
니드원제구자1-1		2025-06-26	-	0.01	39
현대차증권1-1	AA-	2025-03-10	3.867	3.77	30
한국남동발전60-2	AAA	2027-06-25	3.378	3.34	30
한국수력원자력58-1	AAA	2025-06-15	3.396	3.3	30
키움증권9-2	AA-	2027-04-23	3.678	3.66	30
기업금융2024제1차1-1(사)	AAA	2027-07-13	-	3.57	25
한국수력원자력32-3	AAA	2032-04-26	3.475	3.48	20
대한항공102-1	A-	2025-04-24	3.89	3.83	16