



DAOL Daily Bond Morning Brief

DAOL 다올투자증권

4 June. 2024

전일 국내 채권 시장 요약	
• 금리방향: 3Y(하락), 10Y(하락)	
• 일드커브: 플레트닝	
• 스프레드(bp): 국5/3 3.5 (-1.5) 국10/3: 10.5 (-2.3) 국10/5: 7.0 (-0.8) 국30/10: -17.0 (-2.0)	

KR Market

KR Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
CD91D	3.610	0.0	0.0	3.0
통안1Y	3.390	-0.1	2.0	-4.1
통안2Y	3.435	-1.8	1.5	-6.7
국고3Y	3.432	-2.0	2.2	-7.3
국고5Y	3.467	-3.5	3.0	-8.5
국고10Y	3.537	-4.3	4.0	-8.0
국고20Y	3.447	-5.8	0.7	-8.3

KR Credit(%bp)	YTM	1D	1W	1M
금융채 AA- 3Y	3.969	-2.5	0.3	-7.5
회사채 AA- 3Y	3.856	-1.8	1.5	-10.9
회사채 BBB+ 3Y	7.568	-2.0	1.0	-17.8

KTBF Futures(tick)	증가	1D	1W	저평
KTBF 3Y	104.35	8	-15	
LKTBF 10Y	112.17	39	-53	

KR Stock(%)	Index	1D	1W	1M
KOSPI	2682.52	1.74	-1.49	0.22
KOSDAQ	844.72	0.56	-0.39	-2.41

FX Market(%)	Price	1D	1W	1M
원/달러	1376.1	-0.61	0.90	0.98
원/100엔	876.22	-0.49	0.82	-1.49

IRS(%)		1D(bp)	CRS(%)		1D(bp)	Spread(bp)	1D(bp)	
1Y	3.535	-1.25	1Y	3.48	-4	IRS-통1	14.5	-1.15
2Y	3.478	-2.00	2Y	3.3	-4	IRS-통2	4.3	-0.20
3Y	3.440	-2.75	3Y	3.29	-4	IRS-국3	0.8	-0.75
5Y	3.418	-4.75	5Y	3.295	-4	IRS-국5	-5.0	-1.25
10Y	3.420	-5.25	10Y	3.135	-4	IRS-국10	-11.7	-0.95

US Bond Market

US Bond(%bp)	YTM	1D	1W	1M
UST2Y	4.818	-6.5	-13.9	-0.8
UST5Y	4.413	-9.9	-12.1	-9.2
UST10Y	4.393	-11	-7.7	-12.1
UST30Y	4.541	-11	-3.4	-12.6

KR Credit Market

Bond Yield(%bp)	Yield	1D	1W	1M	3M	1Y
특수채 AAA 1Y	3.587	-0.4	1.2	-3.7	-7.6	-19.4
특수채 AAA 3Y	3.590	-2.0	2.4	-8.2	-2.8	-23.8
특수채 AAA 5Y	3.606	-3.5	3.3	-8.3	-2.1	-22
은행채 AAA 1Y	3.620	-0.6	0.1	-5.9	-7.6	-22.1
은행채 AAA 3Y	3.683	-2.3	0.9	-9.3	-5.9	-29.9
은행채 AAA 5Y	3.764	-4.0	1.5	-12.7	-10.4	-27.5
금융채 AA 1Y	3.732	-0.5	0.0	-4.9	-2.5	-28.3
금융채 AA 3Y	3.843	-2.5	0.5	-6.5	-6.6	-33.8
금융채 AA 5Y	4.079	-3.5	1.2	-11.4	-10.0	-39.7
금융채 AA- 1Y	3.790	-0.5	0.0	-6.1	-10.8	-34.3
금융채 AA- 3Y	3.969	-2.5	0.3	-7.5	-16.0	-41.2
금융채 AA- 5Y	4.223	-3.5	0.5	-13.3	-15.3	-46.7
금융채 A+ 1Y	4.746	-0.5	0.0	-7.1	-10.3	-26.5
금융채 A+ 3Y	5.066	-2.5	0.0	-9.8	-7.7	-21.4
금융채 A+ 5Y	5.367	-3.5	1.0	-11.0	-2.3	-19.7
금융채 A 1Y	5.463	-0.5	0.5	-6.6	-9.3	-25
금융채 A 3Y	5.851	-2.5	0.5	-8.8	-5.0	-20.2
금융채 A 5Y	6.051	-3.5	1.5	-10.5	-1.3	-19.8
금융채 A- 1Y	6.035	-0.5	0.5	-6.6	-9.3	-27
금융채 A- 3Y	6.476	-2.5	0.5	-8.8	-5.0	-18.7
금융채 A- 5Y	6.692	-3.5	1.5	-10.5	-1.3	-19.4
회사채 AAA 1Y	3.669	-0.2	1.6	-2.2	-5.8	-24.4
회사채 AAA 3Y	3.735	-2.4	1.3	-8.3	-4.1	-28.7
회사채 AAA 5Y	3.793	-3.8	2.0	-10.7	-5.2	-35.6
회사채 AA+ 1Y	3.691	-0.3	1.2	-2.0	-9.4	-31.5
회사채 AA+ 3Y	3.769	-2.2	1.7	-9.3	-11.7	-37.1
회사채 AA+ 5Y	3.905	-3.8	2.2	-11.8	-12.0	-38.8
회사채 AA 1Y	3.720	-0.4	0.9	-2.0	-10.6	-32.8
회사채 AA 3Y	3.809	-2.2	1.5	-9.8	-11.9	-37.2
회사채 AA 5Y	3.974	-3.8	2.1	-11.7	-11.5	-38.3
회사채 AA- 1Y	3.747	-0.4	0.8	-2.7	-11.9	-34.2
회사채 AA- 3Y	3.856	-1.8	1.5	-10.9	-13.2	-38.5
회사채 AA- 5Y	4.085	-3.5	2.4	-11.4	-11.2	-38.2

주간 입찰 일정 및 결과

일자	요일	종목명	만기	발행금액	발행금리
6월 3일	월	국고채	30y	38000	3.380

전일 주요 채권 발행 결과 (발행 금액 상위 10개 종목)

종목명	구분	만기일	발행금액	표면금리	민평3사	신용등급
현대해상4(후)	회사채	2034-06-03(토)	5000	4.480	4.540	AAO
연합자산관리36-1	회사채	2027-06-03(목)	3500	3.817	-	AAO
한국수출입은행2406가-할인-1	금융채	2025-06-03(화)	2700	3.460	3.626	AAA
미래에셋증권72	회사채	2027-06-03(목)	2100	3.857	-	AAO
기업은행(신)2406할1A-03	금융채	2025-06-03(화)	1700	3.460	3.593	AAA
연합자산관리36-2	회사채	2029-06-01(금)	1500	3.920	-	AAO
GS건설144-1	회사채	2025-12-03(수)	500	5.638	-	AO
GS건설144-2	회사채	2026-06-03(수)	500	5.712	-	AO
한국남부발전74-1	회사채	2027-06-03(목)	500	3.60	3.759	AAA
한국남부발전74-2(녹)	회사채	2029-06-01(금)	500	3.682	3.830	AAA

주제별 현물 순매수/순매도 현황

은행 순매수 상위 5건					은행 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
통안10C024-0903-0910	24-09-03	3.48	350	0.3	국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.38	-278	29.8	
채정2024-0110-0063	24-06-13	3.51	200	0.0	한국전력1378	26-04-04	3.64	-50	1.8	
하나은행46-0601(15)할-09	24-12-09	3.62	130	0.5	국고01125-2406(21-4)	24-06-10	2.58	-50	0.0	
국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.38	110	0.8	한국전력1147	25-03-04	3.63	-40	0.8	
통안03365-2604-02	26-04-02	3.44	55	1.8	한국전력1143	25-02-25	3.63	-30	0.7	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					845	0.4	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
					947	0.4	-448			18.0
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	3.38	781	29.8	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.39	-170	0.8	
미래에셋증권72	27-06-03	3.86	50	3.0	국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.55	-61	9.5	
국고03500-3406(24-5)	34-06-10	3.51	40	10.0	국고04250-2512(22-13)	25-12-10	3.41	-60	1.5	
국고재원금01240-5203(22-2)	52-03-10	3.36	60	27.8	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.37	-60	1.0	
국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.44	16	2.5	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.36	-50	1.3	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					947	26.9	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
					401	2.3	-1			2.3
투신 순매수 상위 5건					투신 순매도 상위 5건					
종목	만기	수익률	수량	잔존만기	종목	만기	수익률	수량	잔존만기	
국고03250-5403(24-2)	54-03-10	3.38	145	29.8	채정2024-0110-0063	24-06-13	3.50	-200	0.0	
한국수출입은행2406가-할인-1	25-06-03	3.58	140	1.0	채정2024-0130-0063	24-06-27	3.50	-150	0.1	
국고03250-2706(24-4)	27-06-10	3.42	64	3.0	국고03875-2612(23-10)	26-12-10	3.44	-133	2.5	
미래에셋증권72	27-06-03	3.86	50	3.0	하나은행46-0601(15)할-09	24-12-09	3.62	-110	0.5	
한국전력1378	26-04-04	3.64	30	1.8	국고03125-2606(23-4)	26-06-10	3.44	-31	2.0	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					429	11.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
					424	11.3	-624			20.0
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	3.38	222	29.8	국고03375-2503(23-3)	25-03-10	3.39	-100	0.8	
국고04125-3312(23-11)	33-12-10	3.54	91	9.5	국고01125-2509(20-6)	25-09-10	3.37	-45	1.3	
국고03125-2709(22-8)	27-09-10	3.45	50	3.3	국고02250-2506(15-2)	25-06-10	3.39	-20	1.0	
국고04750-3012(10-7)	30-12-10	3.52	33	6.5	국고02250-2512(15-8)	25-12-10	3.37	-20.0	1.5	
국고04250-3212(22-14)	32-12-10	3.56	23	8.5	국고01500-2503(20-1)	25-03-10	3.37	-110	0.8	
수량 합계 및 가중 평균 잔존만기					418	19.3	수량 합계 및 가중 평균 잔존만기			
					418	19.3	-195			1.0

주제별 선물 순매수

구분	은행	보험	자산운용	외국인	증권/선물
당일	3170	-1160	1018	6547	-10504
5일누적	3203	-1772	-2716	-12801	13814

Fund Flow

구분	잔액	1D	1W	1M	YTD
MMF*	203474.2	-5406.3	-3361	3187.8	32416.7
채권형*	153224.7	188.8	-25.6	3171.2	16641.5
주식형*	112635.8	37.7	-393.9	2032.7	8768.1
저축성예금**	1632894.1	2072.8	8103	8536.9	16301.3
CD순발행**	72939.7	-92	692.6	1831.4	2364.3

*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
미래에셋증권72	AA	2027-06-03	-	3.86	270
네오파워제사차6-1		2025-03-12	-	4.35	180
연합자산관리34-2	AAO	2026-10-27	3.829	3.79	90
농협금융지주30-2	AAA	2026-01-22	3.662	3.64	60
LG에너지솔루션3-2(녹)	AAO	2027-02-16	3.687	3.69	60
아스본제일차3-1		2030-07-26	-	3.63	60
포스코인터32-3	AA-	2028-08-29	3.925	3.94	60
한국남부발전74-2(녹)	AAA	2029-06-01	-	3.68	50
HD현대12-1	AO	2025-05-30	3.993	3.95	40
한국남부발전74-1	AAA	2027-06-03	-	3.6	40
대신증권21-1	AA-	2024-10-07	3.883	3.74	40
미래에셋증권61	AAO	2024-06-07	3.632	3.61	40
하나에프앤아이182-2	AO	2024-09-06	3.921	3.8	40
GS건설144-2	A	2026-06-03	-	5.7	39
GS건설144-1	A	2025-12-03	-	5.59	33
SK브로드밴드53-1	AAO	2025-02-28	3.646	3.65	30
연합자산관리36-1	AA	2027-06-03	-	3.82	30
현대해상4(후)	AA+	1934-06-03	-	4.42	26