



GFI BOND DAILY

2023-06-23

BOND FAX (6333-2917)

팀장 박연미(2963)

과장 윤지영(2910)

대리 조성혁(2965)

사원 허유빈(2964)

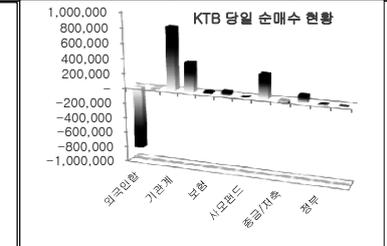
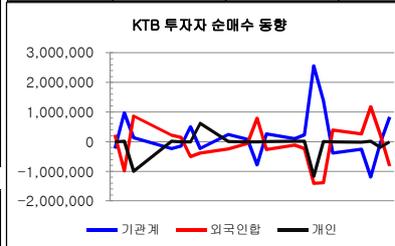
전일한국시장		
KOSPI	2,593.70	▲11.1
KOSDAQ	876.38	▲0.7
USD/KRW	1,295	▲2.9
CNY/KRW	180.36	▲0.8
구분	금리	대비(bp)
국채2Y	3.649	▲2.3
국채3Y	3.598	▲2.8
국채5Y	3.599	▲2.3
국채10Y	3.653	▲3.1
국채30Y	3.687	▲2.0
국채50Y	3.669	▲2.0
동안3Y	3.671	▲2.0
동안2Y	3.672	▲2.6
동안1Y	3.55	▲0.9
회사채AA-	4.4	▲2.2
CD(91일)	3.750	-

전일미국시장		
Dow	33946.71	-4.81
NASDAQ	13630.61	128.41
EUR/USD	1.09845	0.00707
USD/JPY	141.852	-0.142
WTI	69.39	-0.1
GOLD	1914.41	0.89
구분	금리	대비(bp)
미국2Y	4.800	▲8.6
미국3Y	4.376	▲8.5
미국5Y	4.047	▲8.7
미국10Y	3.797	▲7.2
미국20Y	4.066	▲7.3
미국30Y	3.874	▲6.4

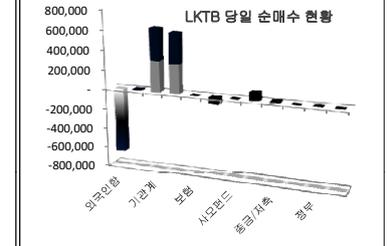
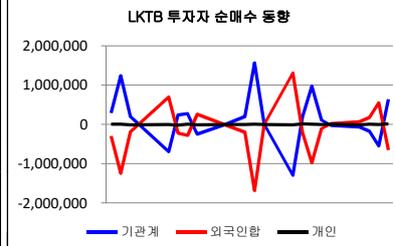
Credit Spread			
종목	대표금리	대비(bp)	스플
특수채AAA 1Y	3.793	▲0.9	28
특수채AAA 3Y	4.006	▲2.7	40.8
특수채AAA 5Y	4.007	▲2.4	40.8
특수채AAA 10Y	4.032	▲3.1	37.9
특수채AAA 30Y	4.134	▲2.0	44.7
상급채 6M	3.752	▲0.6	30.6
상급채 1Y	3.809	▲0.9	29.6
상급채 1.5Y	3.868	▲1.7	22.9
상급채 2Y	3.916	▲2.3	26.7
상급채 3Y	3.945	▲2.7	34.7
은행채AAA 6M	3.813	▲0.4	36.7
은행채AAA 1Y	3.869	▲0.9	35.6
은행채AAA 1.5Y	3.964	▲1.8	32.5
은행채AAA 2Y	4.028	▲2.3	37.9
은행채AAA 3Y	4.141	▲2.7	54.3
은행채AAA 5Y	4.213	▲2.2	61.4
카드채AA+ 1Y	4.037	▲0.9	52.4
카드채AA+ 2Y	4.189	▲3.0	54
카드채AA+ 3Y	4.243	▲2.9	64.5
카드채AA+ 5Y	4.401	▲1.9	80.2
여전채AA- 1Y	4.168	▲1.3	65.5
여전채AA- 2Y	4.389	▲2.2	74
여전채AA- 3Y	4.532	▲2.4	93.4
여전채AA- 5Y	4.819	▲1.8	122
회사채AA0 1Y	4.08	▲0.9	56.7
회사채AA0 2Y	4.277	▲2.7	62.8
회사채AA0 3Y	4.343	▲2.5	74.5
회사채AA0 5Y	4.527	▲2.2	92.8
국주1종 5Y	3.795	▲3.0	19.6
서울도철 7Y	3.958	▲2.4	28.8
지역5Y	3.891	▲3.0	29.2

전일 외국인 채권동향			
구분	잔고	순매수	비중
전체	2,337,359	2,899	8.5
국고	1,901,423	2,099	19.23
동안	205,270	0	16.62
기타			
현재가	111.13	F 202209	
콜1D	3.576	2023-06-20	D-3
CD91일	3.75	금통위일정	
CP91일	3.97	2023-07-13	D-20

KTB	25010	수익률			헤지수량		선물	
		3년	10년	이른가	지평(bp)	이른가	지평(bp)	
KTB	22-4	3.665	64.6	21.1				
KTB	22-13	3.63	81.7	26.6	103,901	3.9		
KTB	23-1	3.599	147.7	48.2				
LKTB	22-5	3.685	258.8	84.5	110,987	1.3		
LKTB	22-14	3.675	282.1	92.1				
KTB		기관계	외국인합	개인	현재가	거래량	미결제약정	
2023-06-22	832,715	-828,665	-3,952	103.94	88,046	363,631		
2023-06-21	-43,761	233,189	-188,699	104.02	138,893	360,762		



외국인합	개인	외국인합	개인	현재가	거래량	미결제약정
2023-06-22	637,691	-650,249	11,781	111.00	40,762	163,366
2023-06-21	-549,022	551,500	-139	111.26	53,985	163,353



종목	대차	상환	대차잔량	증감
3Y Basket	22-4	100	-	624
	22-8	300	290	4,180
	22-13	400	190	3,853
10Y Basket	22-5	-	-	15,946
	22-14	500	500	3,805
	국고2Y	22-15	700	8,053
국고5Y	22-8	-	-	4,057
국고10Y	22-14	-	-	3,021

금일 발행 (상위5종목)					
발행회사	일자	만기	표면금리	발행금액	
하나은행46-06이2갑-22	2023-06-22	2025-06-22	3.960	2,000	
중소벤처기업진흥채권819(사)	2023-06-22	2028-06-22	0.000	1,800	
미래에셋증권66-1	2023-06-22	2025-06-20	4.329	1,500	
도로공사850	2023-06-22	2026-06-22	0.000	1,300	
한국수자원공사268	2023-06-22	2025-06-22	0.000	1,000	

전일 발행 (상위5종목)					
종목	만기	표면금리	신용등급	이자주기	
한국전력1393(녹)	2026-06-23	1900-01-00	AAA	3 개월	
LG유플러스114-2	2028-06-23	1900-01-04	AAA	3 개월	
한국전력1392(녹)	2025-06-23	1900-01-00	AA	3 개월	
토지주택채권438	2043-06-23	1900-01-03	AAA	6 개월	
토지주택채권439	2025-06-23	1900-01-03	AAA	3 개월	

금일 주요 경제지표					
시간	국가	지표	예상	이전	
9:30	일본	5월 CPI 상승률	4.10%	3.50%	
16:30	독일	6월 제조업 PMI	50.7	50.6	
22:45	미국	6월 합성 PMI		54.3	

국고 Spread				금일 채권 만기			
(bp)	스플	전일	대비	채권 만기			
3Y-2Y	-7.40	-7.60	0.2	은행채 12,600억, 여전채 7,900억			
5Y-3Y	0.10	0.60	-0.5	회사채 1,952억, 공사채 4,400억			
10Y-5Y	5.40	4.60	0.8	채권 발행			
10Y-3Y	5.50	5.20	0.3	은행채 4,000억, 여전채 7,900억			
20Y-10Y	4.20	5.60	-1.4	회사채 4,410억, 공사채 7,700억			
30Y-10Y	3.40	4.50	-1.1	채권 입찰			
30Y-20Y	-0.80	-1.10	0.3	총액 2년물 10,000억원, 1년물 1,000억원 모집발행			
50Y-30Y	-1.80	-1.80					

국내 시장
 국고금리는 영국 통화정책회의 결과를 앞두고 상승 마감하였습니다.
 영국 물가 빅스텝 우려가 커진 영향과 외국인인 국채선물을 대거 매도하면서 약세 압력이 가해진 것으로 분석됩니다.

장초반 간밤 파월 연준 의장의 발언의 영향을 이어받아 전 거래일 대비 하락 출발하였습니다. 그러나 이보다 앞서 영국의 2년 국채 금리가 물가 지표 발표 이후 급등하면서 채권 시장에 대한 긴장감이 돌기 시작했습니다.

국채 선물시장에도 이같은 영향을 받았습니다.
 국채선물은 강세로 출발하였으나, 외국인이 국채 선물을 대거 매도하면서 약세 전환하여 장을 마쳤습니다.

국제 시장
 미국채 금리는 모든 구간에서 일제히 상승했습니다. 영란 은행의 금리인상 기초 속에 파월 의장의 연내 두번 금리인상 발언이 영향을 준 것으로 분석됩니다.

나스닥이 43억 달러 규모의 회사채 발행에 나선 것도 미국채 금리 상승을 거들었습니다.

미국채금리는 유럽 거래에서부터 오름폭을 꾸준히 확대했습니다. 뉴욕 장 초반 미국 주안 실업수당 신청건수가 발표된 뒤 잠시 하락 반전하는 장면이 있었지만 흐름이 오래 가지는 않았습다.

연방기금금리 선물시장과 오버나이트인덱스 옵션 시장은 내달 금리인상폭을 전일보다 약간 높아진 18bp 수준으로 가격에 반영하고 있습니다.

투자자별 매매동향(채권현물) 단위:억				
	외국인	은행	보험/기금	정부
국채	2099	284	3130	-205
동안채	0	2400	500	400
금융채	0	1944	354	600

외인 순매수 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고01250-2603(21-1)	2026-03-10	3.580	0	
국고01500-3012(20-9)	2031-06-10	3.637	0	
국고01500-3012(20-9)	2030-12-10	3.665	319	
국고01375-3006(20-4)	2030-06-10	3.674	400	
한국수자원공사268	2025-06-22	3.966	800	

외인 매도 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고01250-2603(21-1)	2026-03-10	3.589	1,926	
국고02000-3106(21-5)	2031-06-10	3.640	1,873	
국고01500-5003(20-2)	2050-03-10	3.555	1,362	
국고01125-3909(19-6)	2039-09-10	3.664	1,332	
국고01500-2503(20-1)	2025-03-10	3.643	1,063	

은행 매도 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고03280-2504-02	2025-04-02	3.670	1,700	
도로공사850	2026-06-22	3.956	800	
국고01875-2412(21-10)	2024-12-10	3.618	400	
국고03125-2506(22-4)	2025-06-10	3.657	600	
국고03125-2709(22-8)	2027-09-10	3.610	600	

은행 매도 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고02250-2512(15-8)	2025-12-10	3.684	1,000	
국고01750-2609(21-7)	2026-09-10	3.615	800	
동안03280-2504-02	2025-04-02	3.666	700	
기업은행(신)2212015A-08	2027-12-08	3.951	500	
국고02250-2506(15-2)	2025-06-10	3.673	500	

보험/기금 순매수 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고03250-5303(23-2)	2053-03-10	3.690	1,507	
국고03375-3206(22-5)	2032-06-10	3.682	1,210	
한국공사451	2025-06-22	4.026	1,000	
미래에셋증권66-1	2025-06-20	4.329	900	
동안03680-2501-02	2025-01-02	3.684	500	

보험/기금 순매도 상위 5종목				
국고	만기	수익률	수량	
국고01875-2412(21-10)	2024-12-10	3.635	300	
국고03250-5303(23-2)	2053-03-10	3.684	223	
국고04250-3212(22-14)	2032-12-10	3.675	220	
국고03250-4209(22-11)	2042-09-10	3.69	200	
국고03750-3312(13-8)	2033-12-10	3.7	200	

