

PART 1 금리추이

표1. 국내 금리 추이 (단위: %, bp)

국내금리	10/23	전일 대비	전월 대비
통안 2Y	2.920	0.3	-11.7
국고 3Y	2.932	-1.0	-4.8
국고 10Y	3.127	0.0	0.7
국고 30Y	2.960	-0.5	-5.7
CD 91D	3.400	0.0	-11.0
CP 91D	3.460	0.0	-8.0
Call	3.300	0.0	-25.0

표2. 해외 금리 추이 (단위: %, bp)

국내금리	10/23	전일 대비	전월 대비
미국 2Y	4.048	0.8	12.2
미국 5Y	4.025	2.5	31.4
미국 10Y	4.227	1.6	31.9
독일 2Y	2.111	-6.6	-29.8
독일 10Y	2.306	0.1	-1.9
일본 10Y	0.981	0.0	5.5
중국 10Y	2.144	2.7	0.4

표3. 크레딧 YTM (단위: %, bp)

구분		금일 YTM (10/23)				전일 대비 (10/22)			
		1Y	3Y	5Y	10Y	1Y	3Y	5Y	10Y
특수채	AAA	3.183	3.176	3.245	3.305	-0.5	-1.0	-0.5	-0.5
은행채	산금/중금	3.173	3.099	3.199	3.605	0.0	-1.0	-0.5	0.0
	AAA	3.196	3.224	3.310	3.703	0.0	-1.0	-0.5	0.0
금융채	AA+	3.272	3.363	3.437	4.458	0.5	-0.5	-0.5	0.0
	AA0	3.298	3.430	3.645	4.644	0.5	-0.5	-0.5	0.0
	AA-	3.373	3.520	3.739	4.844	0.5	-0.5	-0.5	0.0
회사채	AAA	3.241	3.378	3.443	3.748	0.0	-1.0	-0.5	0.0
	AA+	3.245	3.425	3.502	4.030	-0.5	-2.0	-1.5	0.0
	AA0	3.254	3.458	3.565	4.369	-0.5	-2.0	-1.5	0.0
	AA-	3.287	3.510	3.666	4.735	-0.5	-2.0	-1.5	0.0

표4. 크레딧 스프레드 (단위: %, bp)

구분		금일 스프레드 (10/23)				전일 대비 (10/22)			
		1Y	3Y	5Y	10Y	1Y	3Y	5Y	10Y
특수채	AAA	0.333	0.244	0.238	0.178	-0.5	0.0	0.0	-0.5
은행채	산금/중금	0.323	0.167	0.192	0.478	0.0	0.0	0.0	0.0
	AAA	0.346	0.292	0.303	0.576	0.0	0.0	0.0	0.0
금융채	AA+	0.422	0.431	0.430	1.331	0.5	0.5	0.0	0.0
	AA0	0.448	0.498	0.638	1.517	0.5	0.5	0.0	0.0
	AA-	0.523	0.588	0.732	1.717	0.5	0.5	0.0	0.0
회사채	AAA	0.391	0.446	0.436	0.621	0.0	0.0	0.0	0.0
	AA+	0.395	0.493	0.495	0.903	-0.5	-1.0	-1.0	0.0
	AA0	0.404	0.526	0.558	1.242	-0.5	-1.0	-1.0	0.0
	AA-	0.437	0.578	0.659	1.608	-0.5	-1.0	-1.0	0.0

표5. CD/CP YTM

(단위: %, bp)

구분		금일 YTM (10/23)					전일 대비 (10/22)				
		7D	1M	3M	6M	1Y	7D	1M	3M	6M	1Y
CD	AAA	3.31	3.35	3.40	3.31	3.26	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
	AA+	3.34	3.38	3.44	3.39	3.32	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
CP	A1	3.35	3.40	3.46	3.47	3.49	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
	A2+	3.45	3.53	3.63	3.67	3.72	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
	A3+	3.53	3.67	3.82	3.87	3.95	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

PART 2 발행.만기/유통
표6. 금일 발행 내역

(단위: %, 억원)

섹터	종목명	발행일	만기일	만기	이자지급	쿠폰	발행 SP	발행액	ESG*	등급
특수채	농금채(중앙회)2024-10이2Y-C	2024-10-23	2026-10-23	2	이표	3.230	민평 +4bp	2,300		AAA
특수채	인천항만공사23	2024-10-23	2027-10-23	3	이표	3.205	민평 -3bp	2,000		AAA
특수채	광주도시공사24-4	2024-10-23	2027-10-23	3	이표	3.339	민평	1,000		AA+
은행채	하나은행47-10이5갑-23	2024-10-23	2029-10-23	5	이표	3.310	민평 +4bp	2,600		AAA
은행채	기업은행(단)2410할304A-23	2024-10-23	2025-08-23	0.83	할인	3.120	민평 -10bp	3,000		AAA
은행채	산금24신이0106-1023-1	2024-10-23	2026-04-23	1.5	이표	3.170	민평 -1bp	2,000		AAA
은행채	우리은행28-10-이표05-갑-23	2024-10-23	2029-10-23	5	이표	3.310	민평 +4bp	5,000		AAA
금융채	하나카드268-1(사)	2024-10-23	2026-03-23	1.42	이표	3.297	민평 -3bp	500	S	AA0
금융채	하나카드268-2(사)	2024-10-23	2026-04-23	1.5	이표	3.306	민평 -3bp	600	S	AA0
금융채	하나카드268-3(사)	2024-10-23	2026-10-23	2	이표	3.283	민평 -3bp	300	S	AA0
금융채	하나카드268-4(사)	2024-10-23	2027-10-22	3	이표	3.330	민평 -3bp	100	S	AA0
금융채	한국투자캐피탈115-1	2024-10-23	2027-10-21	2.99	이표	3.614	민평 -5bp	800		AA-
금융채	한국투자캐피탈115-2	2024-10-23	2027-10-22	3	이표	3.614	민평 -5bp	1,200		AA-
금융채	한국투자캐피탈115-3	2024-10-23	2026-04-23	1.5	이표	4.630	민평 -25bp	1,000		A0
회사채	롯데하이마트11-1	2024-10-23	2026-10-23	2	이표	3.784	민평	500		A+
회사채	롯데하이마트11-2	2024-10-23	2027-10-22	3	이표	3.954	민평 +4bp	800		A+
회사채	한화에너지24-1	2024-10-23	2026-10-23	2	이표	3.490	민평 -13bp	800		A+
회사채	한화에너지24-2	2024-10-23	2027-10-22	3	이표	3.732	민평 -9bp	700		A+
회사채	대한항공108-1	2024-10-23	2027-10-22	3	이표	3.703	민평 -21bp	1,000		A-
회사채	대한항공108-2	2024-10-23	2029-10-23	5	이표	4.135	민평 -24bp	500		A-
회사채	이랜드월드103	2024-10-23	2026-04-23	1.5	이표	6.567	민평 +30bp	500		BBB0

*ESG : 녹색(Green), 사회(Social), 지배구조(Governance)

주) 선매출채권, ABS, 주관채, 파생상품 제외

표7. 만기 현황 (T+7)

(단위: %, 억원)

섹터	종목명	발행일	만기일	만기	이자지급	쿠폰	발행액	ESG*	등급
특수채	한국전력1307	2022-11-04	2024-11-04	2	이표	5.98	2,700		AAA
특수채	인천국제공항공사168	2021-11-04	2024-11-04	3	이표	2.288	800		AAA
특수채	주택금융공사84(사)	2022-11-04	2024-11-04	2	이표	5.659	2,100	S	AAA
특수채	부산도시공사65(지)	2023-05-04	2024-11-04	1.5	이표	3.914	1,200	G	AA+
은행채	신한은행27-05-이-1.5-B	2023-05-04	2024-11-04	1.5	이표	3.69	4,000		AAA

은행채	국민은행4305이표일(03)1.5-4	2023-05-04	2024-11-04	1.5	이표	3.69	2,500		AAA
은행채	산금21신이0300-1104-1	2021-11-04	2024-11-04	3	이표	2.2	1,000		AAA
은행채	한국수출입금융2111라-이표-3	2021-11-04	2024-11-04	3	이표	2.2	1,600		AAA
은행채	우리은행27-05-이표1.5-갑-04	2023-05-04	2024-11-04	1.5	이표	3.69	3,600		AAA
금융채	현대캐피탈1952-2	2022-11-04	2024-11-04	2	이표	5.952	1,000		AA+
금융채	신한카드2085-2	2020-08-04	2024-11-04	4.25	이표	1.485	200		AA+
금융채	키움캐피탈141	2023-05-04	2024-11-04	1.5	이표	6.142	200		A-
회사채	한국남동발전55-1	2022-11-04	2024-11-04	2	이표	6.063	700		AAA
회사채	S-Oil55-1	2019-11-04	2024-11-04	5	이표	1.904	1,600		AA0
회사채	한진95-2	2021-11-04	2024-11-04	3	이표	3.974	200		BBB+

*ESG : 녹색(Green), 사회(Social), 지배구조(Governance)

주) 선매출채권, ABS, 주관채, 파생상품 제외

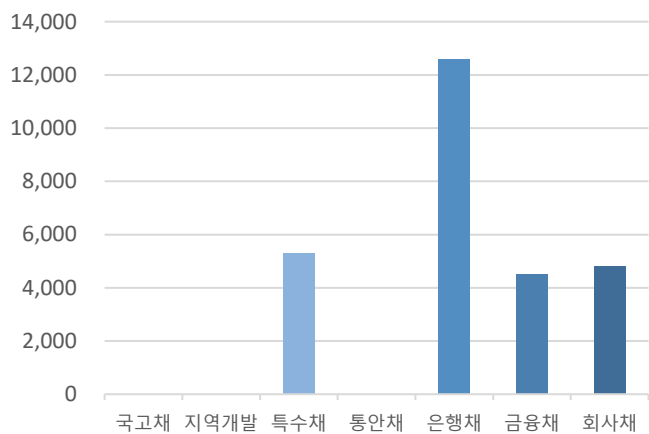
표8. 섹터별 당일 유통 랭킹 TOP 3

(단위: 억원)

섹터	종목코드	종목명	거래량
국고채	KR103502GE63	국고03500-3406(국고24-5)	28,655
국고채	KR103501GE64	국고03250-2706(국고24-4)	25,012
국고채	KR103501GD65	국고03125-2606(국고23-4)	22,900
지역개발	KR2044022EA3	경기지역개발24-10	34
지역개발	KR2001024EA0	서울도시철도24-10	30
지역개발	KR2006024E93	부산도시철도24-09	17
특수채	KR355901GEA7	인천항만공사23	5,900
특수채	KR352401GEA1	광주도시공사24-4	3,100
특수채	KR350109GCC2	한국전력1329	2,200
통안채	KR310101GEA8	통안02800-2610-02	20,300
통안채	KR310101GE77	통안03200-2607-02	11,600
통안채	KR310102GE92	통안02940-2709-03	9,200
은행채	KR6000036EA6	우리은행28-10-이표05-갑-23	16,800
은행채	KR6004944EA7	하나은행47-10이5갑-23	6,500
은행채	KR310511AEA1	기업은행(단)2410할304A-23	3,000
금융채	KR6214344EA6	한국투자캐피탈115-2	2,700
금융채	KR6174141E44	우리카드239-1	2,500
금융채	KR6021965C42	케이비캐피탈490-1	1,400
회사채	KR6003451D24	KB증권41-1	2,100
회사채	KR6063321A52	한국수력원자력57-1	1,700
회사채	KR6207941EA8	삼성바이오로직스8-1	1,200

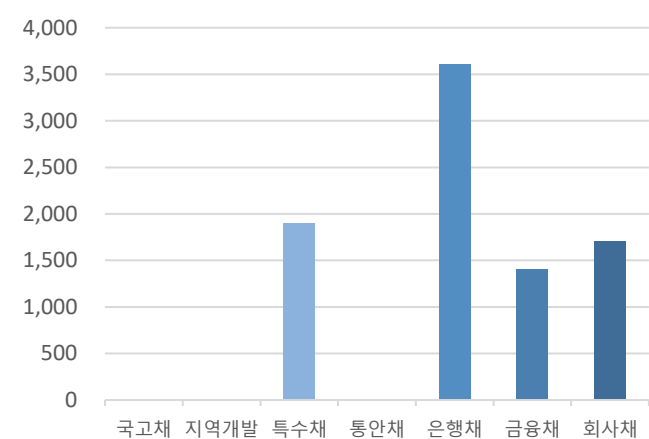
주) 옵션, FRN, 파생상품 제외

그림1. 크레딧 섹터별 당일 발행액 (단위: 억원)



자료: KIS자산평가

그림2. 크레딧 섹터별 당일 만기액 (단위: 억원)



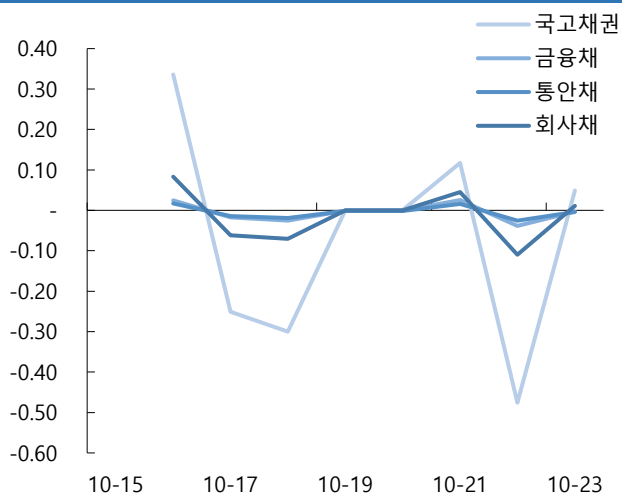
자료: KIS자산평가

PART 3 주요채권지수

표9. 주요채권지수

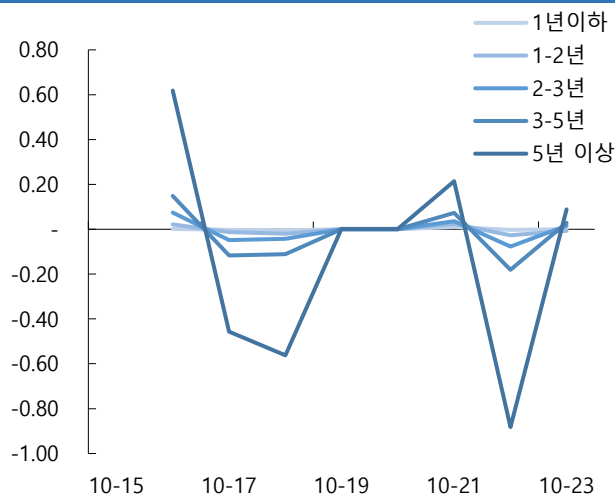
구분	한경- KIS-Reuters				KOB130	KOB120
	종합	국공채	금융채	회사채		
당일지수	273.8036	281.1340	250.5888	295.8674	229.7850	246.2139
전일대비	0.0939	0.1340	0.0177	0.0538	0.0177	0.0337
평균듀레이션	5.7289	7.9611	1.4469	2.4957	0.9634	1.8150

그림3. 일일변동추이(채권종류)



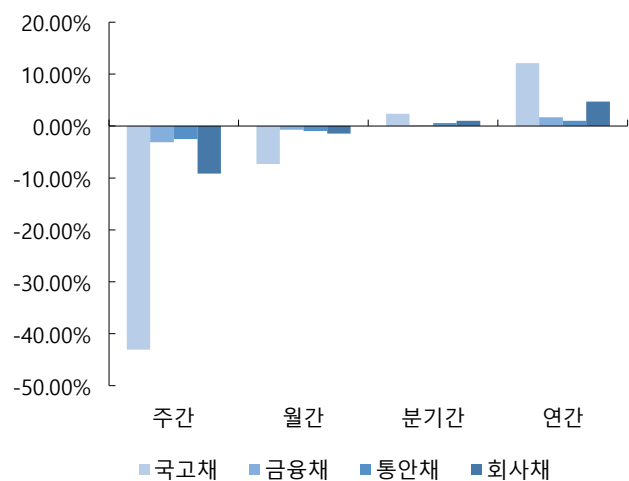
자료: KIS자산평가

그림4. 일일변동추이(잔존만기)



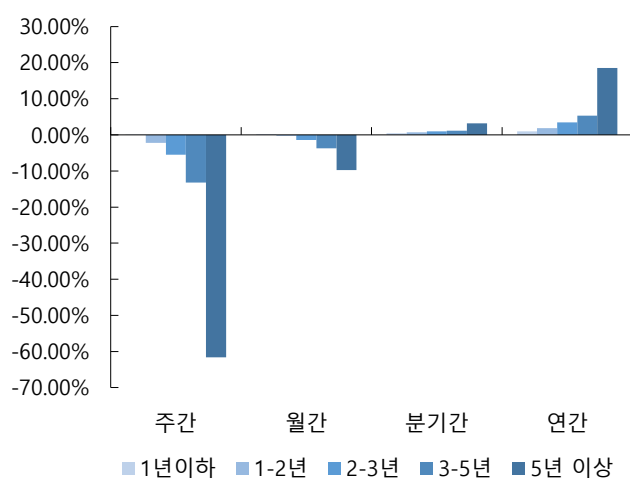
자료: KIS자산평가

그림5. 기간별수익률(채권종류)



자료: KIS자산평가

그림6. 기간별수익률(잔존만기)



자료: KIS자산평가

PART 4 APPENDIX

표10-1. 신용등급 변경 기업

기업명	변경전	변경후	변경
다올투자증권	A0	A-	하향

자료: 신용평가사(한국신용평가, NICE신용평가, 한국기업평가)

그림7-1. 신용등급 변경 발행사 KIS TERM

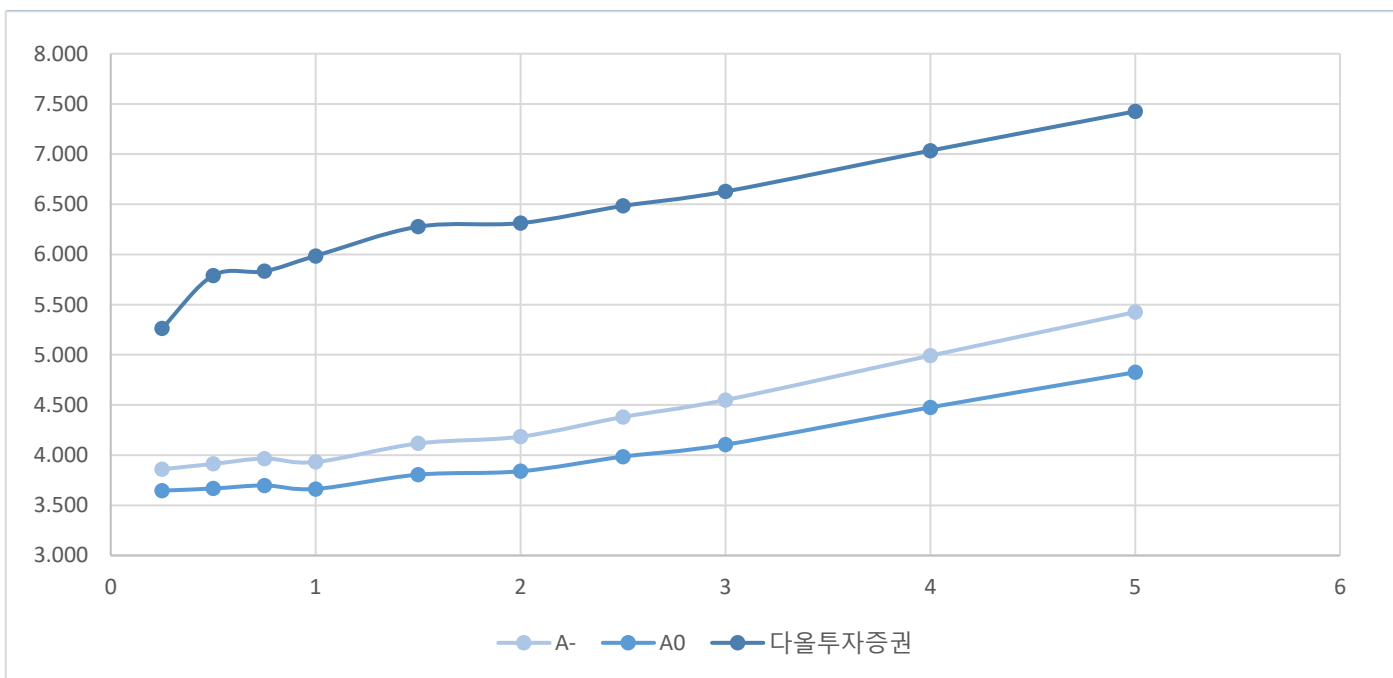


표11-1. 신용등급 변경 발행사 KIS TERM

(단위: %, 년)

구분	0.25	0.5	0.75	1	1.5	2	2.5	3	4	5
A-	3.860	3.912	3.966	3.931	4.116	4.184	4.380	4.549	4.991	5.425
A0	3.646	3.667	3.698	3.663	3.805	3.839	3.985	4.104	4.476	4.825
다올투자증권	5.263	5.790	5.832	5.985	6.276	6.312	6.483	6.627	7.034	7.425

표12. 기준물 단가 변화표 (매매일 : 2024/10/23)

종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이
국고23-6	2.990	10,228		10,230		국고23-10	2.920	10,340		10,342		국고24-1	2.997	10,142		10,145		국고24-4	2.892	10,211		10,213	
	2.995	10,226	2	10,229	1		2.925	10,338	2	10,341	1		3.002	10,140	2	10,143	2		2.897	10,209	2	10,212	1
	3.000	10,224	2	10,227	2		2.930	10,337	1	10,340	1		3.007	10,138	2	10,141	2		2.902	10,208	1	10,211	1
	3.005	10,222	2	10,225	2		2.935	10,336	1	10,339	1		3.012	10,136	2	10,139	2		2.907	10,207	1	10,209	2
	3.010	10,221	1	10,223	2		2.940	10,335	1	10,338	1		3.017	10,134	2	10,137	2		2.912	10,206	1	10,208	1
	3.015	10,219	2	10,221	2		2.945	10,334	1	10,337	1		3.022	10,132	2	10,135	2		2.917	10,204	2	10,207	1
	3.020	10,217	2	10,219	2		2.950	10,333	1	10,336	1		3.027	10,130	2	10,133	2		2.922	10,203	1	10,205	2
	3.025	10,215	2	10,218	1		2.955	10,332	1	10,335	1		3.032	10,128	2	10,131	2		2.927	10,202	1	10,204	1
○ KIS 민평	3.030	10,213	2	10,216	2	○ KIS 민평	2.960	10,331	1	10,334	1	○ KIS 민평	3.037	10,126	2	10,129	2	○ KIS 민평	2.932	10,201	1	10,203	1
	3.035	10,211	2	10,214	2		2.965	10,330	1	10,333	1		3.042	10,124	2	10,127	2		2.937	10,199	2	10,202	1
	3.040	10,210	1	10,212	2		2.970	10,329	1	10,332	1		3.047	10,122	2	10,125	2		2.942	10,198	1	10,200	2
	3.045	10,208	2	10,210	2		2.975	10,328	1	10,331	1		3.052	10,120	2	10,123	2		2.947	10,197	1	10,199	1
	3.050	10,206	2	10,208	2		2.980	10,327	1	10,330	1		3.057	10,118	2	10,120	3		2.952	10,195	2	10,198	1
	3.055	10,204	2	10,207	1		2.985	10,326	1	10,329	1		3.062	10,116	2	10,118	2		2.957	10,194	1	10,197	1
	3.060	10,202	2	10,205	2		2.990	10,325	1	10,328	1		3.067	10,114	2	10,116	2		2.962	10,193	1	10,195	2
	3.065	10,200	2	10,203	2		2.995	10,324	1	10,327	1		3.072	10,112	2	10,114	2		2.967	10,192	1	10,194	1
	3.070	10,199	1	10,201	2		3.000	10,323	1	10,325	2		3.077	10,110	2	10,112	2		2.972	10,190	2	10,193	1

종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이	종목명	금리	10/25	차이	10/28	차이
국고24-7	2.967	10,051		10,054		국고23-11	3.102	10,961		10,964		국고24-5	3.087	10,472		10,474		통당	2.945	10,061		10,064	
	2.972	10,049	2	10,051	3		3.107	10,957	4	10,960	4		3.092	10,467	5	10,470	4		2.950	10,060	1	10,063	1
	2.977	10,047	2	10,049	2		3.112	10,953	4	10,956	4		3.097	10,463	4	10,466	4		2.955	10,060	0	10,062	1
	2.982	10,044	3	10,047	2		3.117	10,949	4	10,951	5		3.102	10,459	4	10,462	4		2.960	10,059	1	10,061	1
	2.987	10,042	2	10,045	2		3.122	10,945	4	10,947	4		3.107	10,455	4	10,457	5		2.965	10,058	1	10,060	1
	2.992	10,040	2	10,042	3		3.127	10,940	5	10,943	4		3.112	10,451	4	10,453	4		2.970	10,057	1	10,060	0
	2.997	10,038	2	10,040	2		3.132	10,936	4	10,939	4		3.117	10,446	5	10,449	4		2.975	10,056	1	10,059	1
	3.002	10,035	3	10,038	2		3.137	10,932	4	10,935	4		3.122	10,442	4	10,445	4		2.980	10,055	1	10,058	1
○ KIS 민평	3.007	10,033	2	10,036	2	○ KIS 민평	3.142	10,928	4	10,931	4	○ KIS 민평	3.127	10,438	4	10,441	4	○ KIS 민평	2.985	10,055	0	10,057	1
	3.012	10,031	2	10,033	3		3.147	10,924	4	10,927	4		3.132	10,434	4	10,436	5		2.990	10,054	1	10,056	1
	3.017	10,029	2	10,031	2		3.152	10,920	4	10,923	4		3.137	10,430	4	10,432	4		2.995	10,053	1	10,055	1
	3.022	10,026	3	10,029	2		3.157	10,916	4	10,918	5		3.142	10,425	5	10,428	4		3.000	10,052	1	10,055	0
	3.027	10,024	2	10,027	2		3.162	10,912	4	10,914	4		3.147	10,421	4	10,424	4		3.005	10,051	1	10,054	1
	3.032	10,022	2	10,024	3		3.167	10,907	5	10,910	4		3.152	10,417	4	10,420	4		3.010	10,051	0	10,053	1
	3.037	10,020	2	10,022	2		3.172	10,903	4	10,906	4		3.157	10,413	4	10,416	4		3.015	10,050	1	10,052	1
	3.042	10,017	3	10,020	2		3.177	10,899	4	10,902	4		3.162	10,409	4	10,411	5		3.020	10,049	1	10,051	1
	3.047	10,015	2	10,018	2		3.182	10,895	4	10,898	4		3.167	10,404	5	10,407	4		3.025	10,048	1	10,051	0

표13. KIS자산평가 최종호가집계표 (매매일 : 2024/10/23)

잔존만기			통안증권						국고채						예보채						
년	월	일	휴일	종목명	잔액(조)	만기일	전일	당일	등락	종목명	잔액(조)	만기일	전일	당일	등락	종목명	잔액(조)	만기일	전일	당일	등락
0	0	1								재정2024-0300-0063	0	24-10-24	3.245	3.245	0.000						
0	0	6		(할)통안DC024-1029-0910	0.5	24-10-29	3.270	3.270	0.000												
0	0	6		통안DC024-1029-0910	0.5	24-10-29	3.270	3.270	0.000												
0	0	8								재정2024-0310-0063	0	24-10-31	3.245	3.245	0.000						
0	0	13		(할)통안DC024-1105-0910	0.54	24-11-05	3.200	3.200	0.000												
0	0	13		통안DC024-1105-0910	0.54	24-11-05	3.200	3.200	0.000												
0	0	17	토-1	통안03730-2411-01	0.78	24-11-09	3.130	3.130	0.000												
0	0	20		통안DC024-1112-0910	0.5	24-11-12	3.140	3.140	0.000												
0	0	20		(할)통안DC024-1112-0910	0.5	24-11-12	3.140	3.140	0.000												
0	0	27		(할)통안DC024-1119-0910	0.5	24-11-19	3.100	3.100	0.000												
0	0	27		통안DC024-1119-0910	0.5	24-11-19	3.100	3.100	0.000												
0	1	3		통안DC024-1126-0910	0.5	24-11-26	3.030	3.030	0.000												
0	1	3		(할)통안DC024-1126-0910	0.5	24-11-26	3.030	3.030	0.000												
0	1	10		(할)통안DC024-1203-0910	0.8	24-12-03	3.035	3.035	0.000												
0	1	10		통안DC024-1203-0910	0.8	24-12-03	3.035	3.035	0.000												
0	1	17		(할)통안DC024-1210-0910	0.8	24-12-10	3.130	3.130	0.000	국고04250-2412(국고22-15)	3.64	24-12-10	3.050	3.050	0.000						
0	1	17		(할)통안DC024-1210-0910	0.8	24-12-10	3.130	3.130	0.000	국고01875-2412(국고21-10)	14.04	24-12-10	2.875	2.875	0.000						
0	1	17		통안DC024-1210-0910	0.8	24-12-10	3.130	3.130	0.000	국고04250-2412(국고22-15)	3.64	24-12-10	3.050	3.050	0.000						
0	1	17		통안DC024-1210-0910	0.8	24-12-10	3.130	3.130	0.000	국고01875-2412(국고21-10)	14.04	24-12-10	2.875	2.875	0.000						
0	2	1		통안DC024-1224-0910	0.8	24-12-24	3.045	3.045	0.000												
0	2	1		(할)통안DC024-1224-0910	0.8	24-12-24	3.045	3.045	0.000												
0	2	9	신정+1	통안DC025-0101-0910	0.8	25-01-01	3.035	3.035	0.000												
0	2	9	신정+1	(할)통안DC025-0101-0910	0.8	25-01-01	3.035	3.035	0.000												
0	2	10		통안03680-2501-02	7.75	25-01-02	3.067	3.067	0.000												
0	2	14		(할)통안DC025-0106-0910	0.8	25-01-06	3.045	3.045	0.000												
0	2	14		통안DC025-0106-0910	0.8	25-01-06	3.045	3.045	0.000												
0	2	17		통안03320-2501-01	1.19	25-01-09	3.077	3.077	0.000												
0	2	22		통안DC025-0114-0910	0.8	25-01-14	3.000	3.000	0.000												
0	2	22		(할)통안DC025-0114-0910	0.8	25-01-14	3.000	3.000	0.000												
0	2	29		(할)통안DC025-0121-0910	0.8	25-01-21	2.940	2.940	0.000												
0	2	29		통안DC025-0121-0910	0.8	25-01-21	2.940	2.940	0.000												
				3M			3.067	3.067	0.000	3M			3.050	3.050	0.000	3M			3.338	3.333	-0.005
0	4	8	삼일절(대체휴일)+1	통안02320-2503-03	4.19	25-03-03	3.000	3.000	0.000												
0	4	14	일+1	통안03410-2503-01	0.69	25-03-09	3.025	3.025	0.000												

