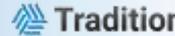


# Market Daily Report

2024.07.23(화)



<b>레포</b>	공모주 청약자금 유입되어 금리 급락했으나 당일기준 잉여세 지속됨에 따라 은행권 저금리 조달에 편중되었음. 체결금리 낮았던 탓에 장 중 추가자금 유입 제한적이었으며, 막판 일부 조달 정체를 보임. [공모주] 산일전기   모집 7.18~7.19   환불 7.23   미래(16.35조), 삼성(0.53조)
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 조 바이든 미국 대통령의 대선후보 사퇴 이슈를 소화하는 가운데 장 초반 약세를 보였으나 오후 들어 약세 폭을 축소하다 강세 마감함. 미국 : 미국 국채 금리는 상승 마감. 장 초반 바이든 대통령의 대선 후보 사퇴 이후 추가 정보를 기다리며 보합권에 머물렀으나 장 후반 이후 금리는 상승. 펠로시 전 하원 의장마저 해리스 부통령을 지지하며 해리스 부통령이 후보직을 승계할 것으로 시장은 판단하며 트럼프 전 대통령의 승기를 확신한 점이 금리에 상승 압력.
<b>MONEY</b>	금일 달러 머니 시장은 월말 주간에 접어들면서 대체적으로 호가가 단조로웠고, 금일은 대만계 은행들의 월말 커버 1-2주물 5.40-5.45 그리고 2-3개월물 5.50-5.53 사이로 체결 소식 전했음. 한국계 네임은 1년물 5.20 (366일물) 소액 체결로 1년물 오피 레벨 확인에 초점을 두었으며, 우선 SOFR 장기구간 1년물 금리가 전월대비 25bp 가량 하향 조정 되면서 금리 인하분이 호가에 어느정도 선반영 되며, 1년물 SOFR 4.80에서 40bp 스프레드 감안 된 1년물 5.20% 레벨에 체결.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 애셋 스와프 물량 소화 속에 무거운 움직임을 지속함. 1년 만기물의 증가는 전장보다 70전 내린 -2810전에서 형성됐으며 6개월과 3개월 만기물은 전장보다 10전 하락한 증가를 형성함. 이처럼 외환자금시장은 전 구간 약세를 나타냈으며 특히 오후 장에서 애셋스와프 물량이 유입되면서 하방 압력을 받음. 전반적 호가 측면에서 매도 우위 시장세를 보였으며 스와프 시장은 무거운 분위기가 지속됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 소폭 하락 마감. 조 바이든 미국 대통령이 대선 후보에서 사퇴하면서 미국의 대선 구도 변화에 관심이 집중된 상황으로 미국채 금리가 점차 하락하면서 이에 영향을 받아 움직이는 모습을 보임. 바이든 사퇴 이후 미 금리의 방향이 아직 불확실해 보이며, 레벨 부담이 큰 상황이니만큼 추가적인 강세는 제한 될 수 있다는 전망. 전체적으로 고요한 분위기를 보였으며, 장 초반에 5년 비드가 소폭 올라오면서 5.5까지 나왔으며 시장에 거래 소식이 들림. 2*10년쪽으로 호가가 형성되면서 -78-7.5에 대치를 이루다가 -7.5에 ND로 거래가 됨. 장 막판에 6*12개월이 -16.25/-17에 대치를 이루었으며 3*5년이 -3.5 비드가 나오면서 레벨이 움직임. 초장기쪽으로 계속해서 레벨이 나오면서 10*20년이 -10까지 비드가 올라왔으며, 10*15년 오피가 막판에 par에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.07.16(화)	214.3	209.4	3.40%	3.483%	3.500%	3.55%	2년물	4.519%	0.4
2024.07.17(수)	217.5	211.5	3.45%	3.517%		3.54%	5년물	4.174%	0.3
2024.07.18(목)	213.8	210.4	3.50%	3.523%		3.52%	10년물	4.254%	1.3
2024.07.19(금)	209.6	208.1	3.57%	3.523%		3.52%	30년물	4.473%	2.4
2024.07.22(월)	214.2		3.48%	3.510%		3.52%	10Y-2Y	-26.5	0.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부담 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,763.51	-31.95	54.03.10	국고 24-2	800	여전채 1,000	은행채 4,000	국고채 20년 5,000
KOSDAQ	809.96	-18.76	27.09.10	국고 22-8	695	회사채 1,500	여전채 1,500	
달러-원	1,388.20원	-2.00원	31.06.10	국고 21-5	595	통안채 3,900	회사채 2,300	
국고3Y	3.071%	-0.3	25.09.07	수출입채	-200	공사채 10,065	통안채 7,000	
국고10Y	3.145%	-1.1	25.09.12	수출입채	-200		공사채 1,500	
국고10Y-3Y	7.4	-0.8	25.09.11	산금채	-400			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : %, %p									
O/N	5.39	5.32	5.36	0.01	O/N	5.38	5.33	5.35	0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.01	TN	5.37	5.32	5.35	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.43	5.35	5.40	0.01
1S	5.53	5.43	5.48	0.01	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.58	5.48	5.53	0.00	3S	5.60	5.45	5.52	0.00
6S	5.58	5.43	5.50	0.00	6S	5.60	5.45	5.50	-0.02
1YR	5.35	5.20	5.27	-0.01	1YR	5.50	5.35	5.40	-0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, % %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.57	0.16	3.50	5.34000	1M MAR	-254	-249
TN	-9/-7	-8	5.57	-0.02	3.50	5.34020	1W*1S	-210	-200
1W	-60/-56	-58	5.65	0.02	3.50	5.34143	1*2	-240	-225
1S	-270/-260	-265	5.58	-0.02	3.48	5.34675	1*3	-475	-460
3S	-750/-730	-740	5.57	0.00	3.46	5.28299	1*6	-1220	-1200
6S	-1520/1420	-1470	5.57	0.01	3.44	5.13468	1*9	-1870	-1850
1YR	-2850/-2770	-2810	5.46	0.05	3.35	4.80026	1*12	-2520	-2480

국내의 일정	
<b>FOMC</b>	1.30~1.31 / 3.19~3.20 / 4.30~5.1 / 6.11~6.12 / 7.30~7.31 / 9.17~9.18 / 11.6~11.7 / 12.17~12.18
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	1.10(수) / 2.7(수) / 3.6(수) / 4.10(수) / 5.8(수) / 6.5(수) / 7.10(수) / 8.7(수) / 9.11(수) / 10.9(수) / 11.6(수) / 12.11(수)

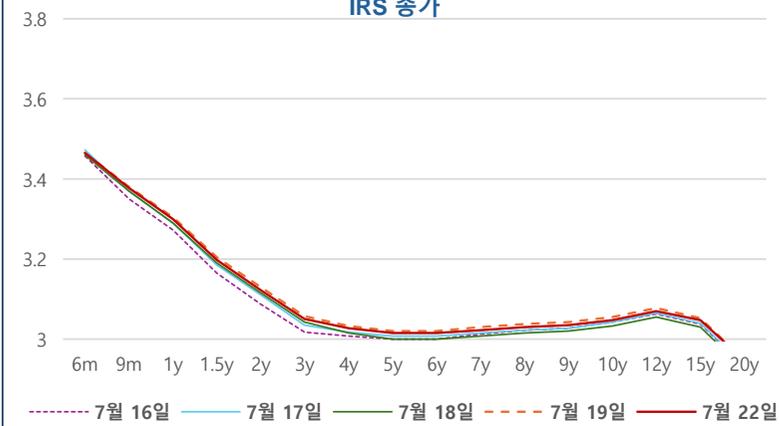
IRS 데일리 증가

7월 22일

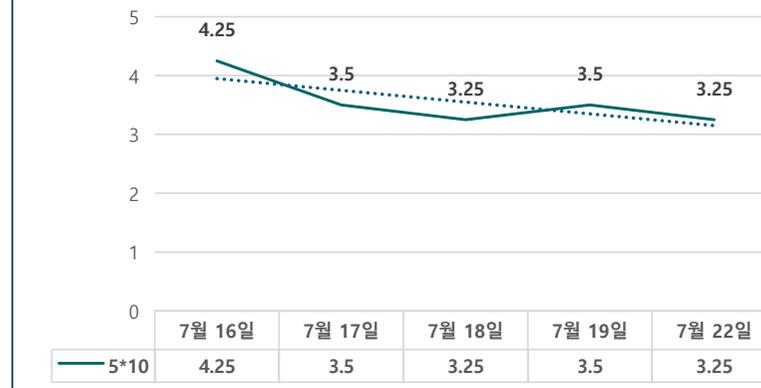
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4650	0.00
9m	3.3775	-0.25
1y	3.3000	-0.50
1.5y	3.1975	-0.75
2y	3.1225	-0.75
3y	3.0500	-0.75
4y	3.0275	-0.50
5y	3.0150	-0.50
6y	3.0150	-0.50
7y	3.0225	-0.75
8y	3.0300	-0.75
9y	3.0350	-0.75
10y	3.0475	-0.75
12y	3.0700	-0.75
15y	3.0475	-0.50
20y	2.9475	0.00

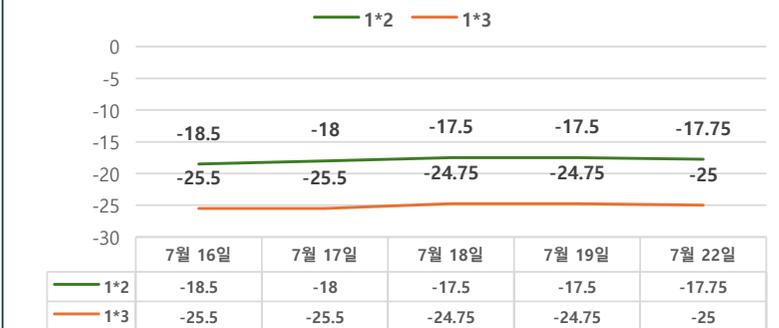
IRS 증가



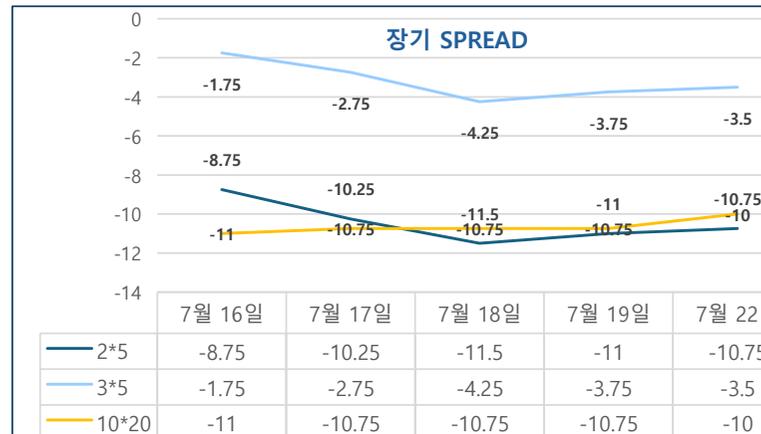
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

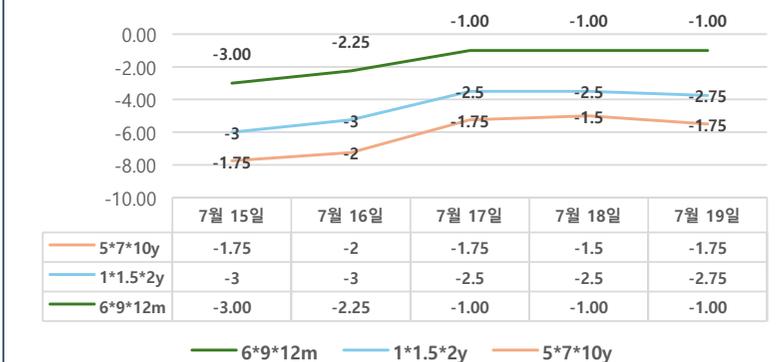


IRS 주요 커브

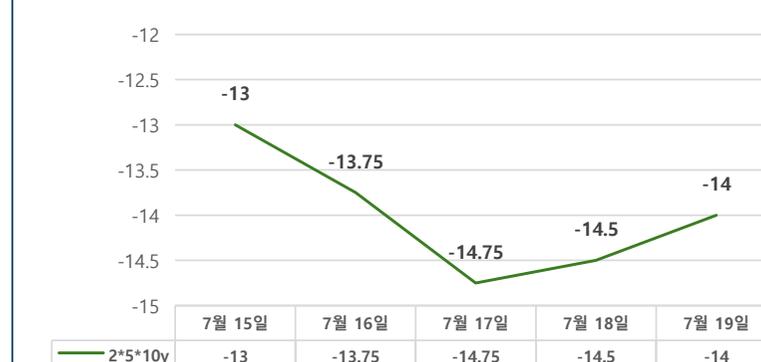
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.75	-0.25
1*3y	-25.00	-0.25
2*5y	-10.75	0.25
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	3.25	-0.25
10*20y	-10.00	0.75

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.00	0.00
1*1.5*2y	-2.75	-0.25
2*5*10y	-14.00	0.50
5*7*10y	-1.75	-0.25