

# Market Daily Report

2024.07.24(수)



<b>레포</b>	공모주 청약(산일전기) 환불 영향으로 시작금리 급등함에 따라 시중은행 매도 감소했으며, 조달여건 대체로 양호하였음. 일부 시은 저금리 매도 대기했으나 장 중 추가 자금 유입 많지 거래 제한적이었음. [공모주] 피앤에스미캐닉스   모집 7.22~7.23   환불 7.25   키움(5.89주)
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 대외 재료의 부재 속 글로벌 금리와 연동. 또한 외국인 투자자가 3년 국채선물을 지난달 27일 이후 처음으로 순매도한 점도 영향. 미국 : 미국 국채 금리는 30년물 제외 하락 마감. 로이터 통신의 대선 여론 조사에서 해리스 부통령이 트럼프 전 대통령을 오차범위 내에서 앞서며 '트럼프 트레이드'로 상승했던 금리는 하락. 또한 2년물 국채 입찰에서 강한 수요가 확인된 점과 기준 주택판매가 전월 대비 5.4% 감소한 점도 영향.
<b>MONEY</b>	금일 달러 머니 시장은 스왑-1주물이 월말 커버 구간으로 단기 자금 편입 수요가 대만계 위주로 일부 몰리면서, 1주 레벨은 5.45- 5.46 까지 올라섰고, 2주-1개월물 모두 소폭 상승세를 이끌었음. 우선 태풍 '개미'가 23일 밤 대만에 상륙할 것이라는 소식에 대만계 은행들의 선차입이 단기 시장 레벨을 끌어올렸고, 이에 온소 포린 서울 비드도 일부 오버나잇 5.37까지 역외 레벨에 맞춰 상승했음. 또한 월말 구간에 진입하면서 은행별 자금 수요도 늘고 월말 포지션 변동을 감안해서 머니마켓에서의 운용은 이번주 다소 소극적일 것으로 예상됨.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 뚜렷한 추세를 보이지 않고 수급에 연동되는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 20전 오른 -2790전에 형성됐고 6개월물은 전장보다 30전 내린 -1500전, 3개월물은 포함인 -740전에 증가를 형성하며 만기별로 혼조세를 보임. 단기 구간은 원화 잉여에 따른 무거운 분위기 속에 장기물은 수급에 영향 받는 모습을 보이며 대내외 금리가 아닌 수급에 따른 장세가 지속될 것으로 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 상승 마감. 특이 재료가 없는 상황에서 대체로 현물 금리에 연동되어 움직이는 분위기였으며 CD(양도성예금증서) 금리에 영향을 받아 초단기 구간이 움직이는 모습을 보임. 장 초반에 1.5년 오퍼가 다소 강하게 나오면서 20.75에 거래가 이뤄졌으며, 9개월 38/37.25에 대치를 이루다가 37.5에 거래가 이뤄지고 전체적으로 오퍼가 더 많은 분위기를 보임. 6년쪽으로 오퍼가 꾸준히 나오는 모습을 보였으며, 장 막판 2*5년 비드가 올라오면서 -9.25/-9.75로 대치됐으며, 장 마감 후에는 6*12개월이 -15.25에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
2024.07.17(수)	217.5	211.5	3.45%	3.517%	3.500%	3.54%	2년물	4.491%	-2.8
2024.07.18(목)	213.8	210.4	3.50%	3.523%		3.52%	5년물	4.165%	-0.9
2024.07.19(금)	209.6	208.1	3.57%	3.523%		3.52%	10년물	4.252%	-0.2
2024.07.22(월)	214.2	206.2	3.48%	3.510%		3.52%	30년물	4.485%	1.2
2024.07.23(화)	207.2		3.55%	3.550%		3.52%	10Y-2Y	-23.9	2.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,774.29	10.78	25.07.23	주공공MBS	1,000	은행채 3,600	지방채 152	통안채 3년물 2,000 모집발행
KOSDAQ	812.12	2.16	54.03.10	국고 24-2	909	여전채 600	은행채 2,000	통안채 2년물 4,000 모집발행
달러-원	1,386.10원	-2.10원	52.03.10	국고 22-2	201	회사채 12,150	여전채 1,300	재정증권 63일물 10,000
국고3Y	3.084%	1.3	37.09.10	국고채이자	-100		공사채 912	
국고10Y	3.171%	2.6	25.09.10	국고 20-6	-131			
국고10Y-3Y	8.7	1.3	26.03.10	국고 24-3	-598			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	0.00	O/N	5.38	5.33	5.34	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.38	5.33	5.35	0.00
1W	5.50	5.40	5.45	0.05	1W	5.43	5.35	5.41	0.01
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.59	5.49	5.54	0.01	3S	5.60	5.45	5.54	0.02
6S	5.58	5.43	5.50	0.00	6S	5.60	5.45	5.52	0.02
1YR	5.33	5.18	5.25	-0.02	1YR	5.50	5.35	5.45	0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.32	-0.25	3.50	5.34000	1M MAR	-250	-248
TN	-9/-7	-8	5.58	0.01	3.50	5.34020	1W*1S	-200	-195
1W	-60/-54	-57	5.61	-0.04	3.50	5.34143	1*2	-245	-240
1S	-265/-245	-255	5.56	-0.02	3.48	5.34675	1*3	-485	-480
3S	-750/-730	-740	5.57	0.00	3.46	5.28299	1*6	-1240	-1220
6S	-1530/1470	-1500	5.60	0.02	3.44	5.13468	1*9	-1885	-1865
1YR	-2840/-2740	-2790	5.44	-0.02	3.35	4.80026	1*12	-2495	-2475

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) / <b>4.10(수)</b> / 5.8(수) / 6.5(수) / 7.10(수) / 8.7(수) / 9.11(수) / <b>10.9(수)</b> / 11.6(수) / 12.11(수)

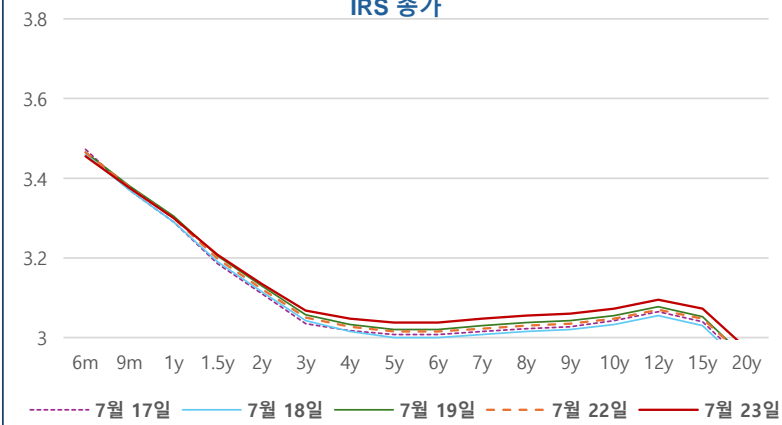
IRS 데일리 증가

7월 23일

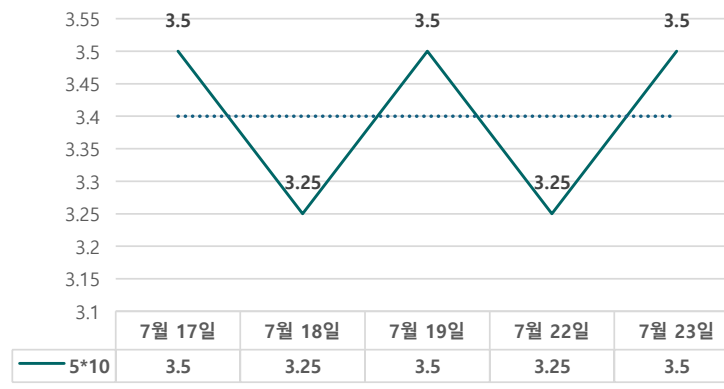
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4550	-1.00
9m	3.3750	-0.25
1y	3.3000	0.00
1.5y	3.2075	1.00
2y	3.1350	1.25
3y	3.0675	1.75
4y	3.0475	2.00
5y	3.0375	2.25
6y	3.0375	2.25
7y	3.0475	2.50
8y	3.0550	2.50
9y	3.0600	2.50
10y	3.0725	2.50
12y	3.0950	2.50
15y	3.0725	2.50
20y	2.9725	2.50

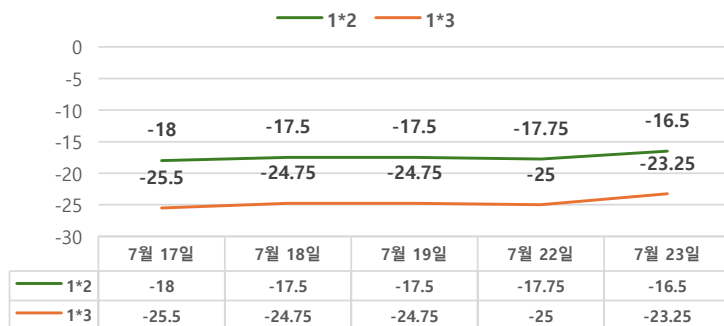
IRS 증가



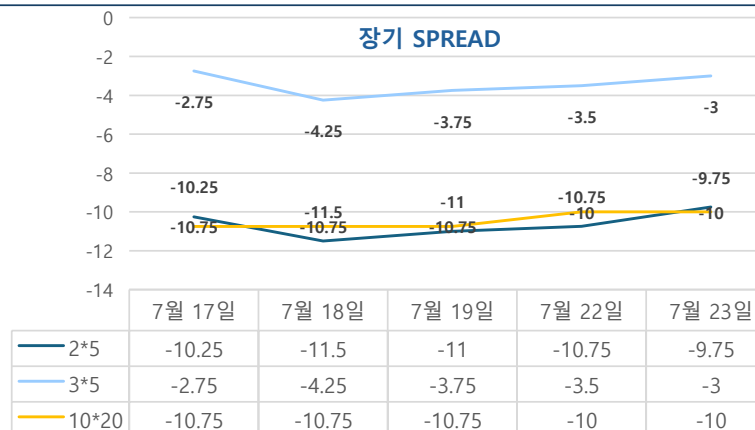
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

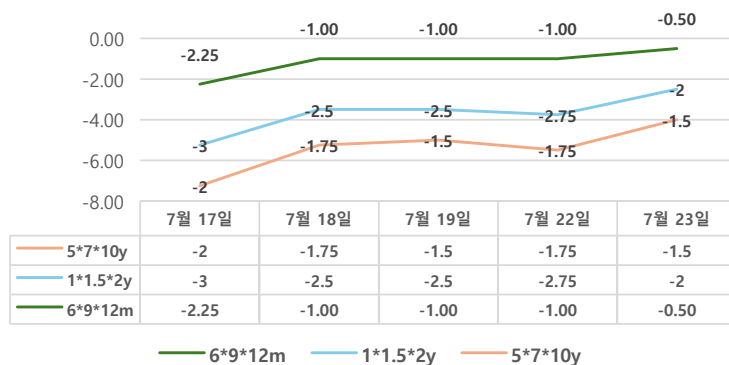


IRS 주요 커브

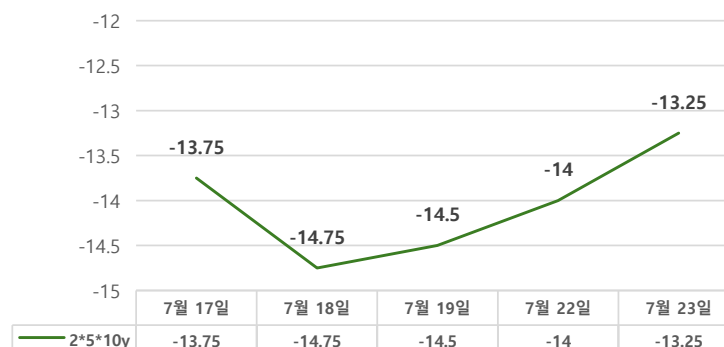
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-16.50	1.25
1*3y	-23.25	1.75
2*5y	-9.75	1.00
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	3.50	0.25
10*20y	-10.00	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	0.50
1*1.5*2y	-2.00	0.75
2*5*10y	-13.25	0.75
5*7*10y	-1.50	0.25