

Market Daily Report



2024.07.25(목)

레포	공모주 청약자금(피앤에스캐닉스) 유입되어 조달금리 하락한 가운데 일부 시은 조달에 적극적으로 나서 잉여자금 일시에 소진되었음. 시중은행 및 증권사 저금리 매도 대기했으며, 장 중 추가자금 유입 크지 않아 막판 수급 다소 빠듯한 모습을 보임. [공모주] 피앤에스캐닉스 모집 7.22~7.23 환불 7.25 키움(5.89조)
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 하루 만에 외국인의 국채선물 순매수가 되돌아오고 글로벌 금리도 강세 분위기를 이어간 데 영향. 미국 : 미국 국채 금리는 2년물 제외 상승 마감. 장 초반 트럼프 트레이드로 상승한 금리는 되돌리며 전 구간 국채 금리는 하락 출발. 통화정책에 민감한 2년물 금리는 연준의 금리 인하 경로에 집중하며 하락세 지속. 중장기물 금리는 미 재무부가 국채 바이백 입찰에서 매도 주문을 모두 거절했다는 소식에 장 초반 금리 하락분을 상쇄하며 상승 마감.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 태풍 3호 '개미' 상륙으로 대만 금융시장이 일시적으로 휴장을 하면서 대만계 주요 렌더들의 부채로 오버나잇 및 워크롤 레벨은 어제와 같이 상승세를 이어갔으며, 오버나잇 고점 5.42과 2주물 5.49 수준으로 체결되었음. 월말 주간으로 역외에서도 전주 대비 오피 물량이 감소되고 있고, SOFR 금리도 전일비 전테너 소폭 상승세를 보이면서 머니 호가 또한 레벨 정체 및 소폭 상승 기조로 전환되는 중. 금일 위안화 오버나잇은 중국 인민은행이 역레포 거래를 통해 기존 만기건 감안 유동성을 흡수 하면서 위안화 단기물 레벨 변동성이 확대 되고 있음. 역외 위안화 오버나잇은 6.00%대 까지 거래 되면서 위안화 유동성은 전반적으로 타이트한 기조 이어갔음.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 미국 국채 금리 하락에도 상승세는 제halt되는 모습을 보임. 만기물에 따라 에셋 스와프 물량 유입에 따른 하방 압력도 존재하는 등 일정한 추세가 나오기보다 혼조세가 지속됨. 1년 만기물은 전장과 같은 -2790전, 6개월물은 전장보다 10전 오른 -1490전에 증가를 형성했으나 3개월물은 에셋 스와프 물량 매도세로 인해 전장보다 15전 내린 -755전에 증가를 형성함. 아시아 장에서 미국 국채 금리가 전반적인 하락세였으나 기간물은 원화 잉여로 무거운 움직임을 보였고 추가 하락에는 레벨 부담이 존재해 반등의 여지도 있어 보임.
IRS	전일 IRS는 외국인의 강세 베팅이 재개된 영향으로 하락 마감. 국내외에서 특별한 재료가 많지 않은 가운데 외국인의 선물 시장 순 매수의 재개 움직임에 영향을 받는 흐름을 나타냈으며, 이에 연동되어 움직이는 모습을 보임. 시장에서 5*10년 스프레드 쪽으로 거래가 여러 차례 이뤄졌으며, 1.5년과 2년 쪽으로도 호가가 많이 형성됨. 1년쪽으로 비드가 꾸준히 나오면서 29-29.5에 거래가 이뤄졌으며, 9*12개월 스프레드가 -7.75에 여러 차례 거래됨. 장 막판에 6*12개월 오피가 -16.75까지 내려왔으며, 5*7년 이 ND로 01/0.5로 ND로 대체되다 0.5에 거래됐고, 7년 비드가 99.5-00으로 올라오면서 00에 거래됨. 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.51 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.07.18(목)	213.8	210.4	3.50%	3.523%	3.500%	3.52%	2년물	4.432%	-5.9
2024.07.19(금)	209.6	208.1	3.57%	3.523%		3.52%	5년물	4.175%	1
2024.07.22(월)	214.2	206.2	3.48%	3.510%		3.52%	10년물	4.287%	3.5
2024.07.23(화)	207.2	204.9	3.55%	3.550%		3.52%	30년물	4.544%	5.9
2024.07.24(수)	210.1		3.48%	3.526%		3.51%	10Y-2Y	-14.5	9.4

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	2,758.71	-15.58	24.08.22	재정채	1,400	여전채 10,150	은행채 9,300	
KOSDAQ	814.25	2.13	27.06.10	국고 24-4	1,000	회사채 5,530	여전채 2,400	
달러-원	1,379.90원	-6.20원	26.03.10	국고 24-3	500	공사채 6,400	회사채 30	
국고3Y	3.046%	-3.8	27.09.10	국고 22-8	-2		공사채 2,625	
국고10Y	3.131%	-4	26.09.10	국고 21-7	-3			
국고10Y-3Y	8.5	-0.2	25.09.10	국고 23-8	-6			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
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	5.35	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	0.00	1W	5.48	5.38	5.45	0.04
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.52	5.42	5.49	0.01
3S	5.59	5.49	5.54	0.00	3S	5.60	5.45	5.54	0.00
6S	5.58	5.43	5.50	0.00	6S	5.60	5.45	5.52	0.00
1YR	5.33	5.18	5.25	0.00	1YR	5.50	5.30	5.43	-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	5.58	0.26	3.50	5.34000	1M MAR	-245	-243
TN	-9/-7	-8	5.58	0.00	3.50	5.34031	1W*1S	-195	-190
1W	-60/-54	-57	5.62	0.01	3.50	5.34216	1*2	-250	-240
1S	-260/-230	-245	5.56	0.00	3.49	5.34958	1*3	-500	-490
3S	-770/-740	-755	5.57	0.00	3.46	5.28460	1*6	-1235	-1215
6S	-1530/1450	-1490	5.60	0.00	3.45	5.14408	1*9	-1890	-1860
1YR	-2840/-2740	-2790	5.44	0.00	3.35	5.83735	1*12	-2490	-2460

국내외 일정	
FOMC	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
금통위	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
지준일	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)

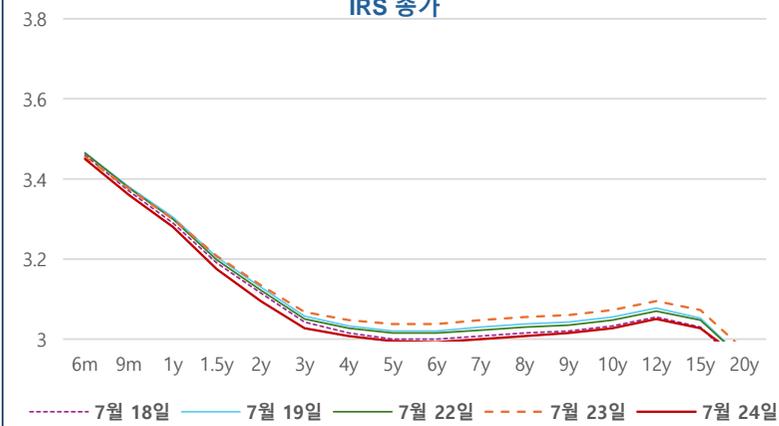
IRS 데일리 증가

7월 23일

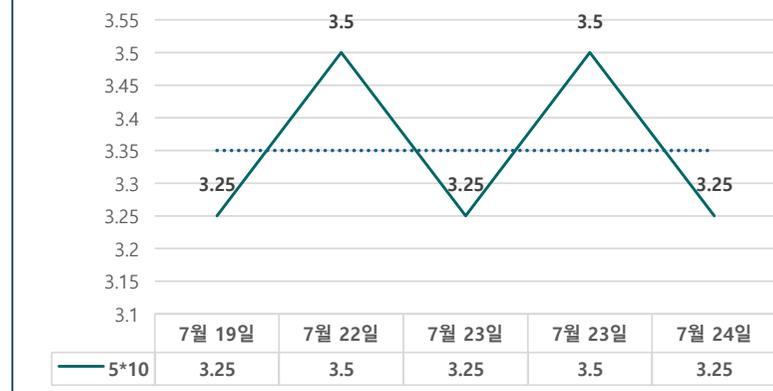
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4500	-0.50
9m	3.3600	-1.50
1y	3.2800	-2.00
1.5y	3.1750	-3.25
2y	3.0950	-4.00
3y	3.0275	-4.00
4y	3.0075	-4.00
5y	2.9950	-4.25
6y	2.9925	-4.50
7y	3.0000	-4.75
8y	3.0075	-4.75
9y	3.0150	-4.50
10y	3.0275	-4.50
12y	3.0500	-4.50
15y	3.0275	-4.50
20y	2.9450	-2.75

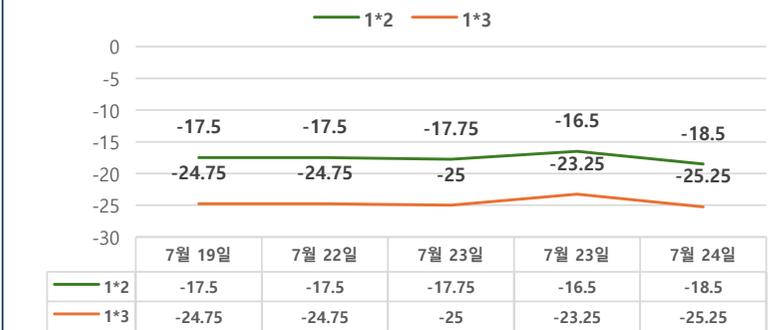
IRS 증가



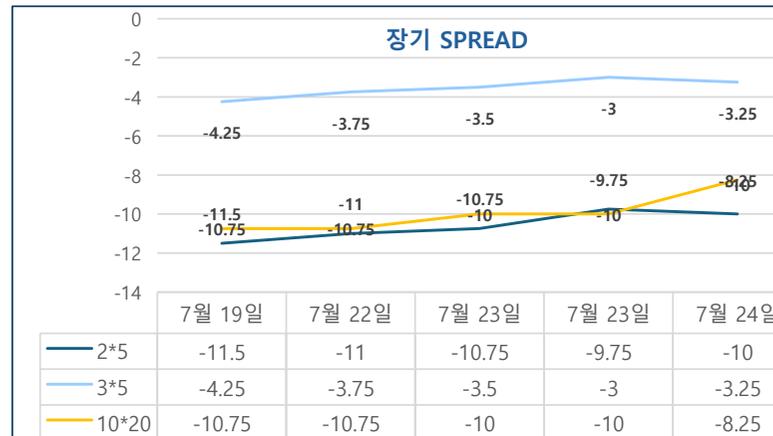
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

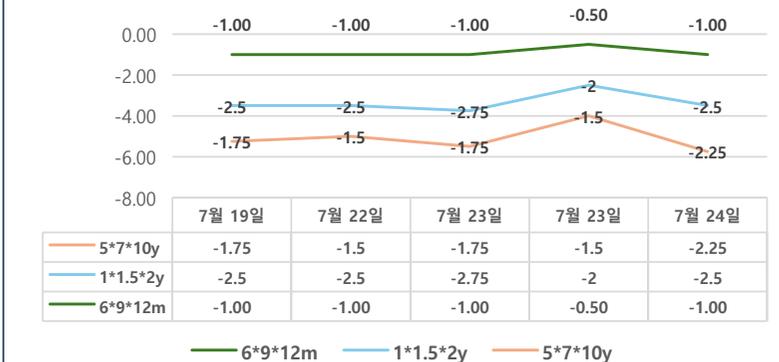


IRS 주요 커브

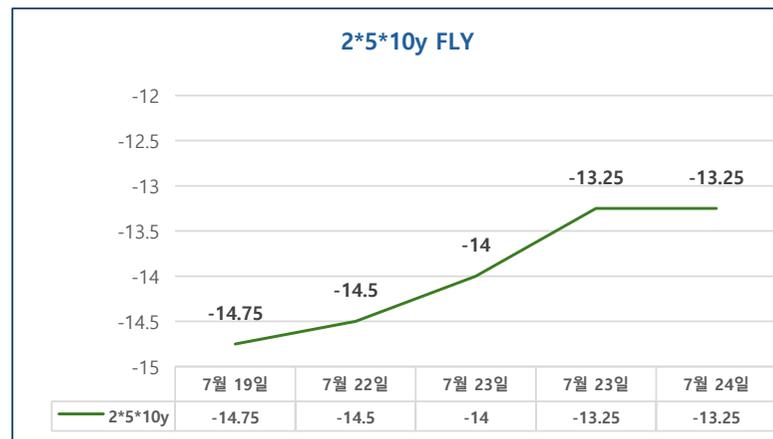
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-18.50	-2.00
1*3y	-25.25	-2.00
2*5y	-10.00	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	3.25	-0.25
10*20y	-8.25	1.75

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.00	-0.50
1*1.5*2y	-2.50	-0.50
2*5*10y	-13.25	0.00
5*7*10y	-2.25	-0.75