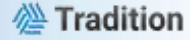


# Market Daily Report



2024.07.26(금)

<b>레포</b>	공모주 청약(피앤에스미캐닉스) 환불 영향으로 유동성 축소됐으나 조달금리 부담으로 은행권 매도 감소해 수급 무난하였음. 시중은행 및 증권사 저금리 매도 수요 꾸준했으며, 장 중 추가 자금 유입 크지 않아 오후에 일부 매도 일시적인 정체를 보임. (공모주) 피앤에스미캐닉스   모집 7.22~7.23   환불 7.25   키움(5.89조)
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 중단기물 중심으로 하락 마감. 국내 2분기 GDP가 부진한 점과 미국 국채 금리가 하락한 것에 영향을 받음. 미국 : 미국 국채 금리는 2년물 제외 하락 마감. 장 초반 PCE 가격지수가 2.6%로 전분기 대비 0.8% 하락하며 미 국채 금리는 하락하였으나 2분기 실질 GDP 성장률이 2.8%로 예상치(2.0%) 상회하고 신규 실업수당청구건수가 23.5만 명으로 예상치를 하회하며 2년물 국채 금리는 상승, 중단기물 금리 하락분을 일부 반납하며 하락 마감함.
<b>MONEY</b>	금일 달러 머니 시장은 대만의 태풍 영향으로 금융시장이 휴장하면서, 말일 중간에 겹쳐 단기물 레벨은 고점을 형성했음. 대만계 은행과 말레이시아계 은행들의 차입 물량이 증가하면서 월말 커버 1주물이 5.52 레벨까지 시장에서 거래 되었고, 3개월물은 5.63까지 TAKEN 되었음. 그러나 상대적으로 역대 유동성이 좋은 중국계 은행들은 단기물은 안정적인 레벨 유지했고, 1년물 5.33 까지 체결 되는 등 네임별 레벨 차등을 보였음.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 전일과 동일하게 구간별로 엇가린 혼조세를 보임. 1년 만기물은 전장보다 20전 오른 -2770전에 증가를 형성했으나 6개월 만기물은 전장보다 10전 내린 -1500전에 증가를 형성했고 3개월 만기물은 전장보다 15전 상승한 -740전에 증가를 형성함. 장중 예셋 스와프 물량 유입이 스와프 포인트에 영향을 줬지만 증가 시간 부근엔 수급에 의한 변동성의 영향이 컸던 것으로 보임. 당분간 예셋 스와프 물량 유입과 수급 상황이 변동성에 영향을 줄 것으로 보이며 만기별 혼조세가 지속될 것으로 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 우리나라 2분기 성장률이 시장 예상보다 큰 폭 둔화된 영향으로 하락 마감. 우리나라의 2분기 성장률이 전기대비 -0.2% 역성장을 했고, 전년동기로는 2.3%로 시장의 예상보다 둔화의 폭이 깊은 것으로 나타남. 지난밤 미국 재무부 바이백 거부로 미국 국채 금리가 장기물 위주로 상승했으나, 이날 재차 반락하는 모습을 보이면서 이에 연동되어 움직이는 모습을 보임. 장중 10*20년 비드가 -7.5까지 올라오고, 12*20년이 -10.75에서 -10 비드까지 올라오면서 초장기쪽으로 레벨이 움직였으며, 6개월이 43/42.5에 대치를 이루다 43에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 6*12개월 오퍼가 -17.25까지 올라오고, 2*5년이 -9.5 오퍼가 나오면서 레벨이 움직임.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		
2024.07.19(금)	209.6	208.1	3.57%	3.523%	3.500%	3.52%	2년물	4.439%	0.7
2024.07.22(월)	214.2	206.2	3.48%	3.510%		3.52%	5년물	4.137%	-3.8
2024.07.23(화)	207.2	204.9	3.55%	3.550%		3.52%	10년물	4.243%	-4.4
2024.07.24(수)	210.1	205.4	3.48%	3.526%		3.51%	30년물	4.485%	-5.9
2024.07.25(목)	209.6		3.55%	3.557%		3.51%	10Y-2Y	-19.6	-5.1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,710.65	-48.06	29.03.10	국고 24-1	1,002	은행채 2,700	은행채 9,100	
KOSDAQ	797.29	-16.96	27.06.10	국고 24-4	1,000	여전채 8,100	여전채 9,350	
달러-원	1,383.00원	3.10원	25.03.10	국고 23-3	1,000	회사채 1,730	회사채 9,183	
국고3Y	3.024%	-2.2	52.03.10	국고 22-2	-136	공사채 1,600	공사채 4,000	
국고10Y	3.128%	-0.3	28.12.10	국고 18-10	-601			
국고10Y-3Y	10.4	1.9	53.03.10	국고 23-2	-998			

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	5.35	0.00
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.38	5.33	5.36	0.01
1W	5.51	5.41	5.46	0.01	1W	5.48	5.38	5.45	0.00
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.52	5.42	5.49	0.00
3S	5.59	5.49	5.54	0.00	3S	5.60	5.45	5.54	0.00
6S	5.56	5.41	5.48	-0.02	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	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.58	0.00	3.50	5.34000	1M MAR	-241	-239
TN	-28/-24	-26	5.76	0.18	3.50	5.33970	1W*1S	-192	-187
1W	-62/-56	-59	5.70	0.08	3.50	5.33791	1*2	-260	-250
1S	-250/-240	-245	5.56	0.00	3.49	5.34926	1*3	-490	-480
3S	-770/-710	-740	5.58	0.00	3.45	5.27921	1*6	-1250	-1230
6S	-1550/1450	-1500	5.60	-0.01	3.44	5.13903	1*9	-1865	-1845
1YR	-2830/-2730	-2780	5.43	-0.01	3.34	4.81817	1*12	-2470	-2430

국내외 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)

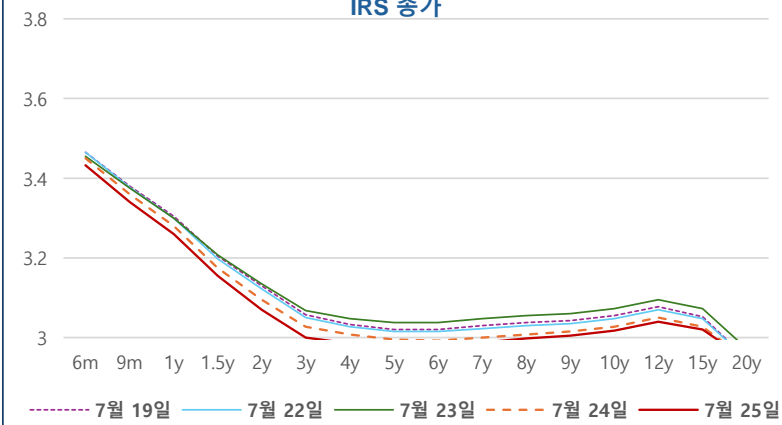
IRS 데일리 증가

7월 25일

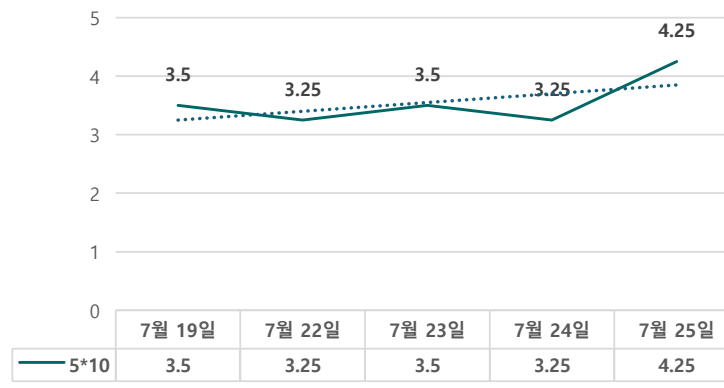
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4325	-1.75
9m	3.3400	-2.00
1y	3.2600	-2.00
1.5y	3.1550	-2.00
2y	3.0700	-2.50
3y	3.0000	-2.75
4y	2.9850	-2.25
5y	2.9750	-2.00
6y	2.9750	-1.75
7y	2.9875	-1.25
8y	2.9975	-1.00
9y	3.0050	-1.00
10y	3.0175	-1.00
12y	3.0400	-1.00
15y	3.0200	-0.75
20y	2.9450	0.00

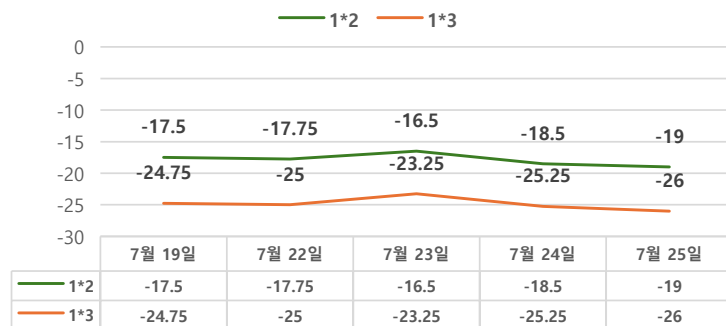
IRS 증가



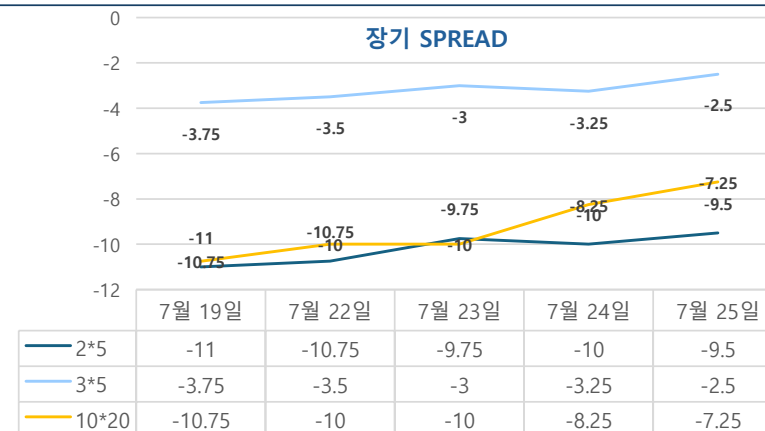
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

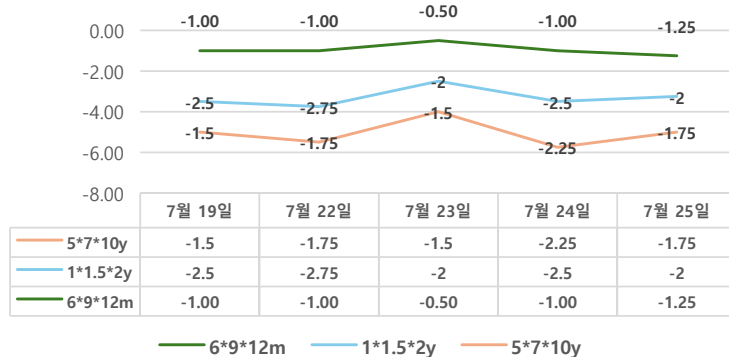


IRS 주요 커브

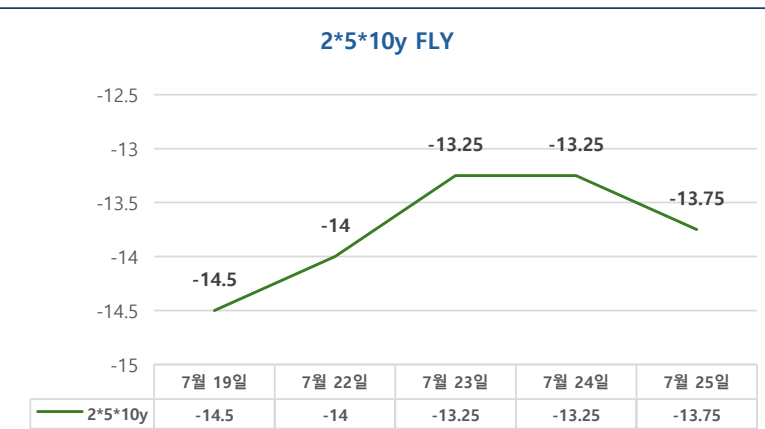
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-19.00	-0.50
1*3y	-26.00	-0.75
2*5y	-9.50	0.50
3*5y	-4.00	0.75
5*10y	4.25	1.00
10*20y	-7.25	1.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.25	-0.25
1*1.5*2y	-2.00	0.50
2*5*10y	-13.75	-0.50
5*7*10y	-1.75	0.50