

# Market Daily Report



2024.07.30(화)

<b>레포</b>	국고금 및 행안부 재정 유입되어 잉여세 매우 강했으며, 조달금리 하락함에 따라 은행권 매도 증가하였음. 시중은행 저금리 매도 대기했으나 장 중 추가 자금 유입 크지 않아 금리 낙폭 제한적이었음. (공모주) 아이벡테크놀로지   모집 7.25~7.26   환불 7.30   삼성(3.06조)
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 미국 디스인플레이션이 지속되면서 강세 압력을 가함. 외국인 투자자가 장기 국채선물을 대거 사들인 점도 강세 재료로 작용함. 미국 : 미국 국채 금리는 2년물 제외 하락 마감. 시장은 FOMC를 경계하는 가운데 미국 재무부가 3분기 차입 목표치를 대폭 낮추며 국채 금리에 하방 압력을 가함. 미국 재무부는 3분기 국채 발행을 통해 7,400억 달러를 차입하겠다고 발표했는데 이는 3달 전 제시된 8,470억 달러 대비 1,000억 달러 넘게 하향된 수치.
<b>MONEY</b>	본격 월말 구간으로 접어들면서 장기 구간 보다는 단기 구간 위주로 USD 마켓 관심 집중 되어 있는 양상 보이면서, 1달 이내 구간으로 5.40~5.50 레벨선에 차입 대기 되는 중임. 특히 8월초 만기 1주의 경우 대만계 중심으로 5.40 후반 대로 레벨이 보다 굳혀 가면서, 월커버의 1주~1달 구간은 5.50 전후로 레벨이 붙어 있는 양상. 이번주 예정되어 있는 FOMC 및 BOJ 정책 회의로 기간물 운용은 제약 되어 있는 분위기 속에, JPY 엔화 펀딩 수요는 1달~1년 전 구간으로 계속해서 증가하는 중이지만, 카운터 오피 부재로 체결까지는 쉽지 않은 상황.
<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 에셋 스와프 물량 유입이 스와프 포인트에 영향을 줬지만 증가 시간 부근엔 수급에 의한 변동성의 영향이 컸던 것으로 보임. 당분간 에셋 스와프 물량 유입과 수급 상황이 변동성에 영향을 줄 것으로 보이며 만기별 혼조세가 지속될 것으로 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 장기물 중심으로 하락 마감.미 국채 금리에 따라서 현물이 강세를 이어가면서 스왑시장 역시 이에 연동되어 움직임. 국고 3년 지표물이 2%대에 안착하면서 3%대를 하회한 국고 3년 금리에 적응해 나가는 분위기를 띄면서 IRS에도 영향을 줌. 시장에서 6*10년, 2*5년쪽으로 호가가 많이 형성되면서 거래가 이뤄졌으며, 2*5년이 대치를 이루다가 -12.5에서 12.75까지 거래됨. 1.5년이 12.5/12에 대치 되다 12에 거래됐으며, 장 막판에 6*12개월이 -18.75까지 내려오면서 초단기 레벨이 움직임. 장 마감 후 3년이 94.5까지 비드가 올라오고, 1.5년이 12.5/12에 ND/D로 대체되었으며, 이날 양도성예금증서(CD)는 보험에서 마감됨.

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	
2024.07.23(화)	207.2	204.9	3.55%	3.550%	3.500%	3.52%	2년물	4.400%	1.5
2024.07.24(수)	210.1	205.4	3.48%	3.526%		3.51%	5년물	4.077%	-0.1
2024.07.25(목)	209.6	204.6	3.55%	3.557%		3.51%	10년물	4.176%	-1.9
2024.07.26(금)	211.4	206.2	3.55%	3.541%		3.50%	30년물	4.425%	-2.8
2024.07.30(월)	217.4		3.43%	3.505%		3.50%	10Y-2Y	-22.4	-3.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부담 최종 호가 수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,765.53	33.63	24.10.29	통안채	1,800	은행채 5,000	은행채 6,300	
KOSDAQ	807.99	10.43	27.12.10	국고 17-7	1,001	여전채 2,450	여전채 400	
달러-원	1,383.70원	-0.10원	26.12.10	국고 23-10	1,000	회사채 582	회사채 3,800	
국고3Y	2.978%	-4.6	31.12.10	국고 11-7	-300	통안채 5,000	통안채 4,800	
국고10Y	3.046%	-6.2	28.12.10	국고 18-10	-1,388			
국고10Y-3Y	6.8	-1.6	27.03.10	국고 07-3	-1,852			

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	5.39	5.34	5.36	0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.40	5.35	5.37	0.01
1W	5.51	5.41	5.46	0.00	1W	5.47	5.37	5.42	-0.01
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.55	5.45	5.50	0.02
3S	5.57	5.47	5.52	0.00	3S	5.60	5.45	5.52	0.00
6S	5.53	5.38	5.45	-0.01	6S	5.55	5.35	5.48	0.00
1YR	5.33	5.18	5.25	0.00	1YR	5.50	5.30	5.42	0.00

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	0.00	3.50	5.35000	1M MAR	-241	-239
TN	-10/-6	-8	5.58	-0.26	3.50	5.34989	1W*1S	-192	-187
1W	-62/-56	-59	5.69	-0.04	3.50	5.34923	1*2	-260	-250
1S	-250/-240	-245	5.63	0.03	3.49	5.34670	1*3	-490	-480
3S	-780/-720	-750	5.60	0.00	3.45	5.25537	1*6	-1250	-1230
6S	-1550/-1450	-1500	5.61	0.00	3.43	5.09145	1*9	-1865	-1845
1YR	-2820/-2720	-2770	5.40	-0.03	3.32	4.75290	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) / <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)

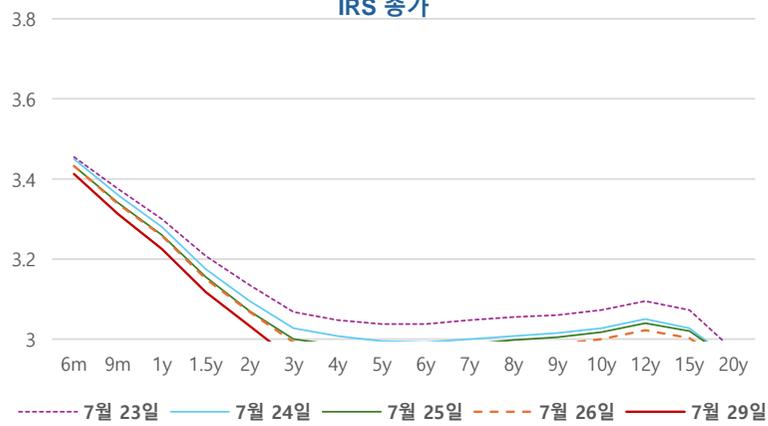
IRS 데일리 증가

7월 29일

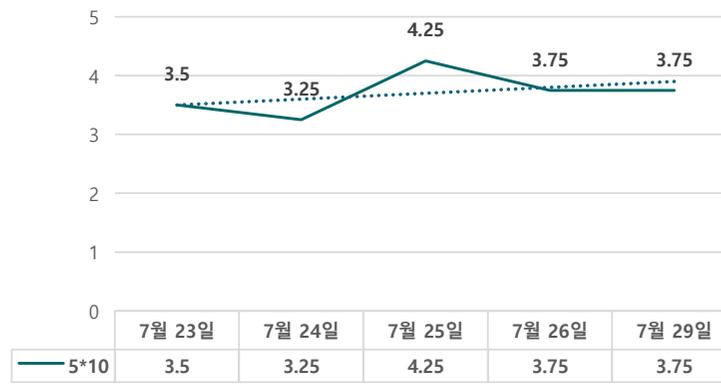
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4125	-2.00
9m	3.3125	-2.50
1y	3.2250	-3.25
1.5y	3.1175	-3.25
2y	3.0325	-3.50
3y	2.9475	-4.50
4y	2.9275	-4.75
5y	2.9050	-5.75
6y	2.9025	-5.75
7y	2.9125	-5.75
8y	2.9225	-5.75
9y	2.9300	-5.75
10y	2.9425	-5.75
12y	2.9650	-5.75
15y	2.9450	-5.75
20y	2.8700	-5.75

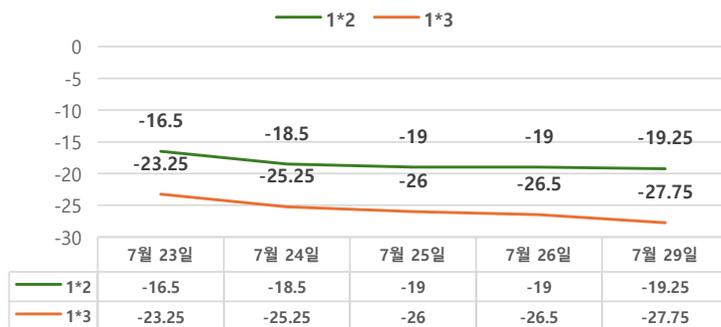
IRS 증가



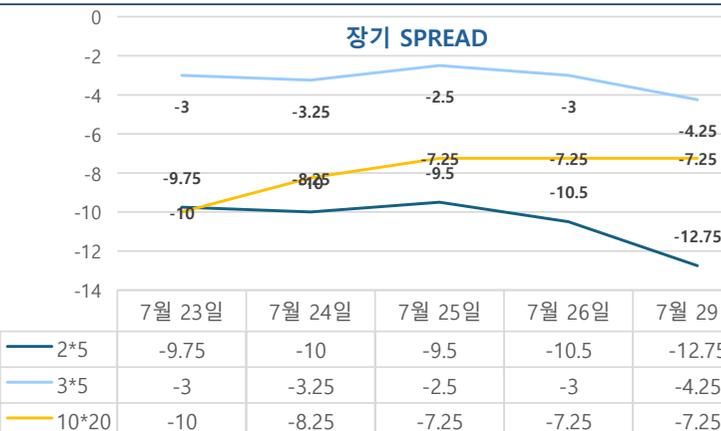
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

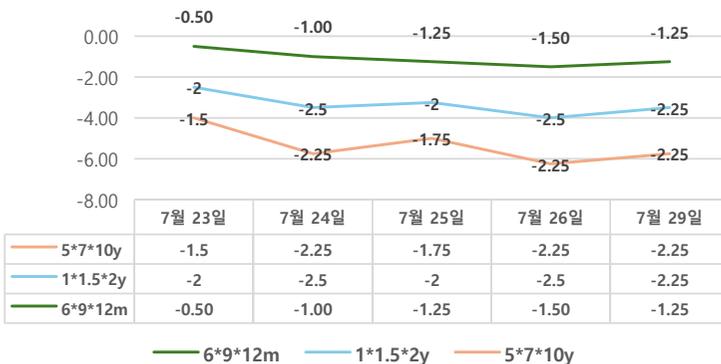


IRS 주요 커브

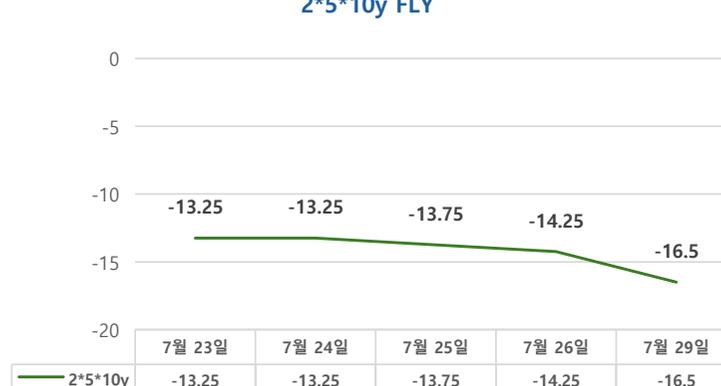
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-19.25	-0.25
1*3y	-27.75	-1.25
2*5y	-12.75	-2.25
3*5y	-4.00	-1.25
5*10y	3.75	0.00
10*20y	-7.25	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.25	0.25
1*1.5*2y	-2.25	0.25
2*5*10y	-16.50	-2.25
5*7*10y	-2.25	0.00