

# Market Daily Report



2024.07.31(수)

<b>레포</b>	기 유입된 유동성 풍부하여 청아 환불에도 금리 상승폭 크지 않았으나 장 초반부터 은행권 매도에 적극적으로 나서 시장 부족 전환되었음. 장 중 매도 정체 계속됐으며, 오후에 익일물 및 기일물 체결금리 동반 상승하는 등 조달여건 악화되는 모습을 보임. [공모주] 아이빔테크놀로지   모집 7.25~7.26   환불 7.30   삼성(3.06조)
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 레벨 부담에다 아시아장에서 미국 국채 금리 반등 등이 악세 재료로 작용함. 외국인도 3년 국채선물을 매도하며 악세 압력을 가함. 미국 : 미국 국채 금리는 하락 마감. 장 초반 미 국채 시장은 FOMC 회의 결과를 기다리며 혼조 양상을 보였으나 오후 들어 매수 분위기가 형성되며 강세 마감. 이번 FOMC 에서 기준 금리를 동결하되 9월 금리 인하 가능성을 제시할 것을 기대하는 데 영향받은 것으로 보임.
<b>MONEY</b>	말일을 하루 앞두고 마켓 전반적으로 마감에 돌입 함. 스팟 벨류가 8월 스타트로 접어들었으나, 비 중국계 위주로 투데이/탐 스타트의 월커버 구간 펀딩이 지체 되면서, 마켓은 여전히 단기 차입 중심으로 형성 됨. 월 이내 스타트 1주 중국계의 경우 5.41~5.45, 비중국계 5.45 레벨 수준으로 점차 안정을 찾아가는 모습. 기간물 구간은 월마감 및 오늘부터 예정된 FOMC, BOJ 정책 회의 영향으로 대부분 제한된 운용의 단발성 거래에만 머무는 중이며, 큰 변화 없이 레벨 유지 되면서 1달 5.46~5.50, 3달 5.48~5.53 수준에 마감 됨.
<b>FX SWAP</b>	월말 이슈로 인해 물량의 영향으로 6달 1년의 가격 변동이 있었음. 초단기물도 월말로 인해 생긴 불안이 탐넥의 비드가 늘면서 해소되었음. 원화 잉여의 영향이 컸다고 보여짐. 초단기물이 워낙 몰려서 이것이 해결되야 기간물의 움직임이 좀 더 살아날 것으로 보여짐.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 대체로 상승 마감. 전체적으로 국고채 움직임에 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 별다른 특이사항이 있던 않은 분위기를 보임. 장 초반에 5년이 89까지 거래 소식이 시장에서 들렸으며, 1.5년쪽으로 호가가 꾸준히 형성되면서 거래가 이뤄짐. 1*2년이 꾸준히 비드가 나오면서 -18에 거래가 됐으며, 10*20년이 -6.5비드, 20*30년이 ND로 -26비드까지 나오면서 초장기쪽 레벨이 움직임. 장 막판에 12*20년 오퍼가 내려오면서 -8.75에 거래됐으며, 5년베이스스와 크로스 5년 호가가 레깅으로 엮이면서 5년이 92.5에 거래가 이뤄짐. 전체적으로 마지막에 비드가 올라오는 모습으로, 1.5년이 마켓에서 14 초이스 소식이 들렸으며 3년이 97까지 올라오면서 거래됐으며 장 마감 후 2*3년 오퍼가 내려오면서 -8.5에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.07.24(수)	210.1	205.4	3.48%	3.526%	3.500%	3.51%	2년물	4.369%	-3.1
2024.07.25(목)	209.6	204.6	3.55%	3.557%		3.51%	5년물	4.035%	-4.2
2024.07.26(금)	211.4	206.2	3.55%	3.541%		3.50%	10년물	4.141%	-3.5
2024.07.29(월)	217.4	207.0	3.43%	3.505%		3.50%	30년물	4.396%	-2.9
2024.07.30(화)	217.7		3.45%	3.513%		3.50%	10Y-2Y	-22.8	-0.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,738.19	-27.34	27.09.10	국고 22-8	1,000	지방채 3,157	지방채 2,283	재정증권 63일물 10,000
KOSDAQ	803.78	-4.21	26.09.10	국고 21-7	1,000	은행채 4,500	은행채 3,003	
달러-원	1,384.60원	0.90원	29.03.10	국고 24-1	1,000	여전채 1,350	여전채 3,730	
국고3Y	2.994%	1.6	27.06.10	국고 17-3	-1,089	회사채 2,606	회사채 900	
국고10Y	3.052%	0.6	28.03.10	국고 08-2	-1,170	공사채 4,434	공사채 1,088	
국고10Y-3Y	5.8	-1	28.06.10	국고 18-4	-1,233			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.01	O/N	5.40	5.35	5.37	0.01
TN	5.45	5.38	5.42	0.05	TN	5.46	5.41	5.43	0.06
1W	5.45	5.35	5.40	-0.06	1W	5.45	5.35	5.40	-0.02
1S	5.52	5.42	5.47	-0.01	1S	5.54	5.44	5.49	-0.01
3S	5.56	5.46	5.51	-0.01	3S	5.60	5.45	5.52	0.00
6S	5.53	5.38	5.45	0.00	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		
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	0.00	3.50	5.34981	1W*1S	-192	-187
1W	-60/-54	-57	5.62	-0.07	3.50	5.34867	1*2	-260	-250
1S	-270/-260	-265	5.57	-0.05	3.48	5.34371	1*3	-490	-480
3S	-770/-710	-740	5.57	-0.02	3.45	5.25211	1*6	-1250	-1230
6S	-1550/-1450	-1500	5.59	-0.02	3.43	5.08769	1*9	-1865	-1845
1YR	-2820/-2720	-2770	5.39	-0.01	3.31	4.75042	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)

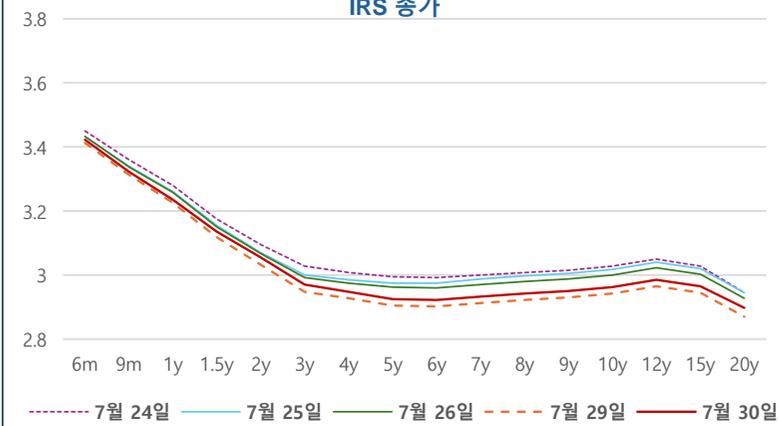
IRS 데일리 증가

7월 30일

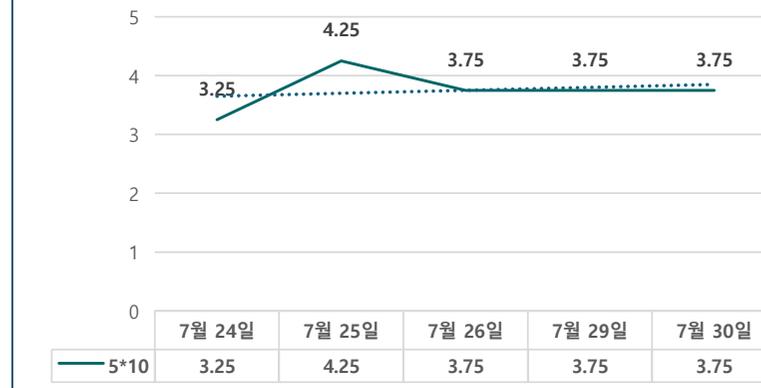
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4225	1.00
9m	3.3225	1.00
1y	3.2350	1.00
1.5y	3.1350	1.75
2y	3.0550	2.25
3y	2.9700	2.25
4y	2.9475	2.00
5y	2.9250	2.00
6y	2.9225	2.00
7y	2.9325	2.00
8y	2.9425	2.00
9y	2.9500	2.00
10y	2.9625	2.00
15y	2.9650	2.00
20y	2.8975	2.75

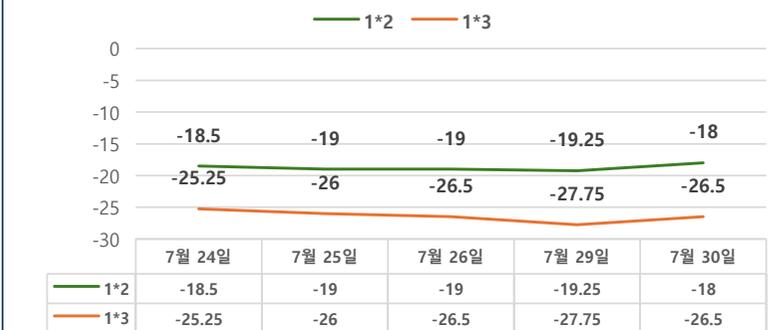
IRS 증가



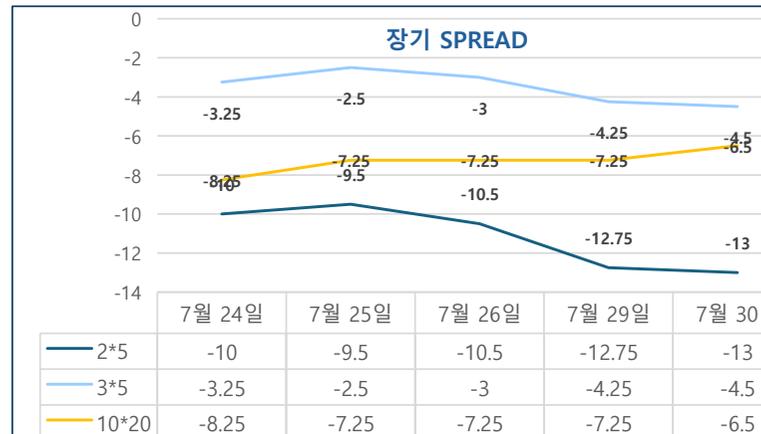
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

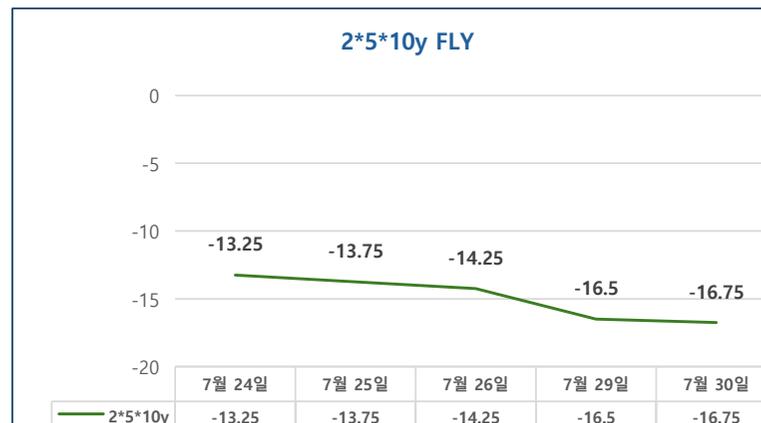
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-18.00	1.25
1*3y	-26.50	1.25
2*5y	-13.00	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	3.75	0.00
10*20y	-6.50	0.75

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.25	0.00
1*1.5*2y	-2.00	0.25
2*5*10y	-16.75	-0.25
5*7*10y	-2.25	0.00