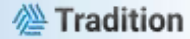


Market Daily Report



2024.08.01(목)

레포	운용사 및 은행신탁 매수 감소량 크지 않아 월말임에도 조달금리 소폭 상승에 그쳤으며, 은행권 매수 증가하여 수급 무난하였음. 일부 시중은행 저금리 매도 수요 있었으나 장 중 잉여세 강하지 않아 거래 제한적이었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 중단기 금리보다 장기 금리가 살짝 더 오르며 수익률 곡선은 가팔라짐. 미국 : 미국 국채 금리는 하락 마감. 이날 FOMC에서는 8회 연속 기준 금리 동결. 성명문에서 "양대책무에 모두 주의하고 있다."라는 문구에 시장은 고용에 중점을 두겠다는 의미로 해석. 또한 기자회견에서 파월이 "9월에 금리 인하가 테이블에 오를 수 있다."라고 발언하며 강세장에 영향.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 7월 말 기간물 포지션을 전일까지 대부분 매칭해 놓은 가운데 북 콜로징을 위해 장 시작하자마자 오버나잇 5.43-5.45 까지 역외 네임으로 일부 호가가 높아진 이후, 비드가 빠르게 정리되면서 오후 오버나잇 호가는 5.35-5.40 수준으로 말일 포지션 마감 위주의 단기 거래 O/N-1W 위주로 체결되었음. 8월 초 시작 구간의 온소 렌더 오퍼로 1-3개월물 운용이 재개 되었으나, 투데이 포지션 외엔 우선 FOMC 회의 이후 8월 자금 스케줄을 조정 할 것으로 보여, 금일 시장 호가는 매우 단조롭게 마감됨.
FX SWAP	월말 이슈로 인해 물량의 영향으로 6달 1년의 가격 변동이 있었음. 초단기물도 월말로 인해 생긴 불안이 탐백의 비드가 늘면서 해소되었음. 원화 잉여의 영향이 컸다고 보여짐. 초단기물이 워낙 몰려서 이것이 해결되야 기간물의 움직임이 좀 더 살아날 것으로 보여짐.
IRS	전일 IRS는 FOMC를 앞두고 단기물 중심으로 상승 마감. 이날 발표된 금융통화위원회(금통위) 회의 의사록에서 부동산 등을 강조하면서 금리 인하 프라이싱이 일부 되돌려진 것 같은 분위기가 형성됨. 2년 아래 구간으로 전체적으로 비디쉬한 모습을 보였으며, 장 초반 9개월 비드가 소폭 올라오면서 33.75-34까지 거래가 이뤄졌으며, 전체적으로 1*2년쪽으로 호가가 많이 형성되는 분위기로 -19/-19.25에 대치를 이룬다 -19에 여러 차례 거래됨. 5*6년이 비드가 올라오면서 -0.5에 거래됐으며, 10*12년이 2.5/2.25에 대치되다 2.25에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 1.5*2년이 -8.5에 ND로 거래가 이뤄졌으며, 1*3년 오퍼가 내려오면서 -27.75에 거래됨. 1년이 25.75까지 비드가 올라면서 26/25.75에, 2년은 7.5/07에 대치되는 모습을 보였으며, 전체적으로 비드가 많은 모습을 보임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
2024.07.25(목)	209.6	204.6	3.55%	3.557%	3.500%	3.51%	2년물	4.260%	-10.9
2024.07.26(금)	211.4	206.2	3.55%	3.541%		3.50%	5년물	3.915%	-12
2024.07.29(월)	217.4	207.0	3.43%	3.505%		3.50%	10년물	4.032%	-10.9
2024.07.30(화)	217.7	206.7	3.45%	3.513%		3.50%	30년물	4.306%	-9
2024.07.31(수)	212.9		3.50%	3.530%		3.50%	10Y-2Y	-22.8	0

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 일할
KOSPI	2,770.69	32.50	26.03.10	국고 24-3	1,007	여전채 500	은행채 8,000	
KOSDAQ	803.15	-0.63	25.12.10	국고 22-13	988	공사채 1,500	여전채 1,700	
달러-원	1,369.80원	-14.80원	28.12.10	국고 18-10	900			
국고3Y	3.004%	1	29.06.10	국고 19-4	-900			
국고10Y	3.064%	1.2	25.03.10	국고 23-3	-1,000			
국고10Y-3Y	6	0.2	25.06.10	국고 15-2	-2,498			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.36	5.40	0.03	O/N	5.45	5.35	5.42	0.05
TN	5.38	5.31	5.35	-0.07	TN	5.40	5.35	5.37	-0.06
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.54	5.44	5.48	-0.01
3S	5.56	5.46	5.51	0.00	3S	5.60	5.45	5.52	0.00
6S	5.51	5.36	5.43	-0.02	6S	5.55	5.35	5.45	-0.03
1YR	5.30	5.15	5.22	-0.03	1YR	5.50	5.30	5.40	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.59	0.01	3.50	5.33000	1M MAR	-241	-239
TN	-9/-7	-8	5.59	0.01	3.50	5.33039	1W*1S	-192	-187
1W	-62/-58	-60	5.74	0.12	3.50	5.33270	1*2	-260	-250
1S	-265/-255	-260	5.61	0.04	3.48	5.34233	1*3	-490	-480
3S	-790/-730	-760	5.60	0.03	3.45	5.24768	1*6	-1250	-1230
6S	-1550/-1450	-1500	5.61	0.02	3.43	5.07922	1*9	-1865	-1845
1YR	-2830/-2730	-2780	5.40	0.01	3.31	4.74481	1*12	-2470	-2430

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)

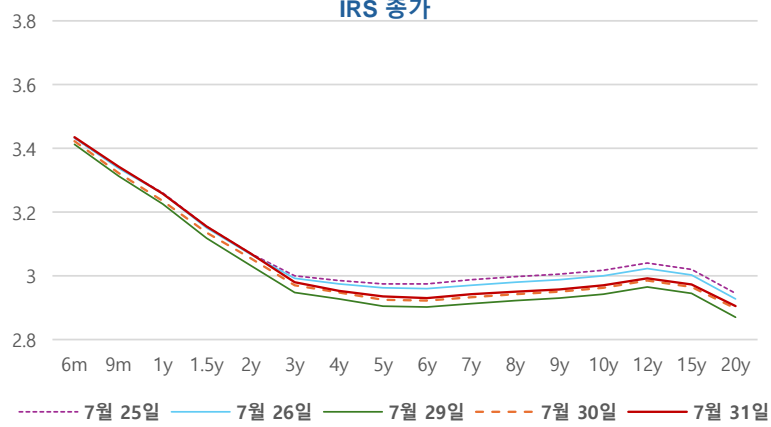
IRS 데일리 증가

7월 31일

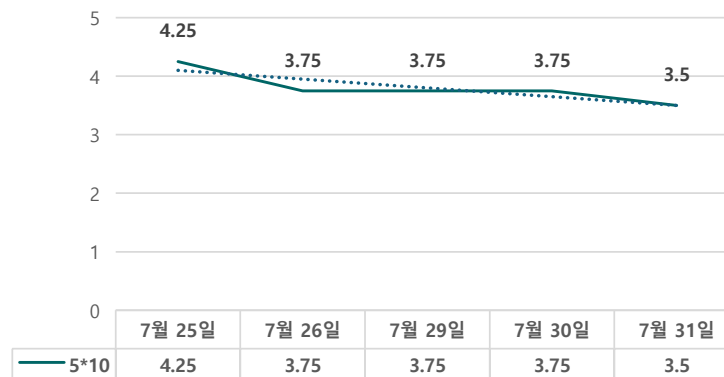
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4350	1.25
9m	3.3425	2.00
1y	3.2575	2.25
1.5y	3.1550	2.00
2y	3.0700	1.50
3y	2.9800	1.00
4y	2.9525	0.50
5y	2.9350	1.00
6y	2.9300	0.75
7y	2.9425	1.00
8y	2.9500	0.75
9y	2.9575	0.75
10y	2.9700	0.75
12y	2.9925	0.75
15y	2.9725	0.75
20y	2.9050	0.75

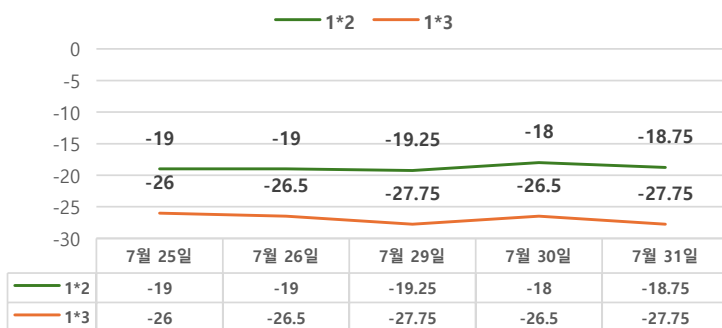
IRS 증가



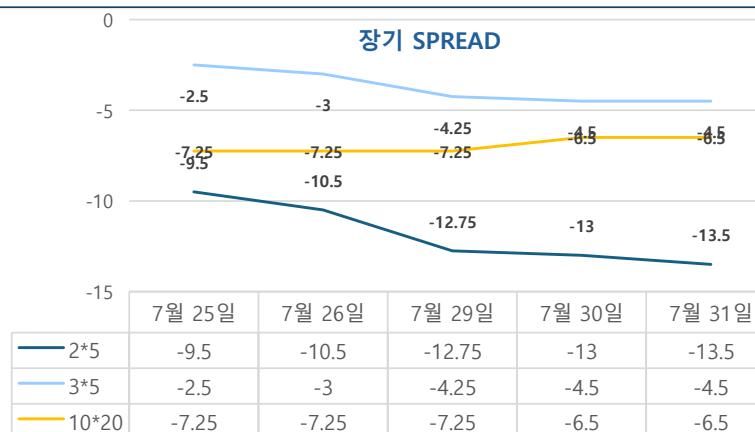
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

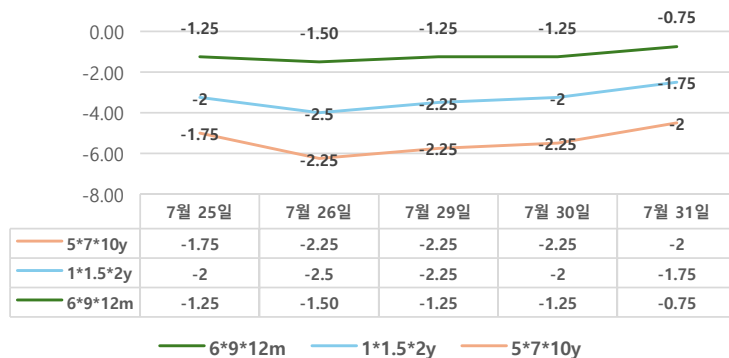


IRS 주요 커브

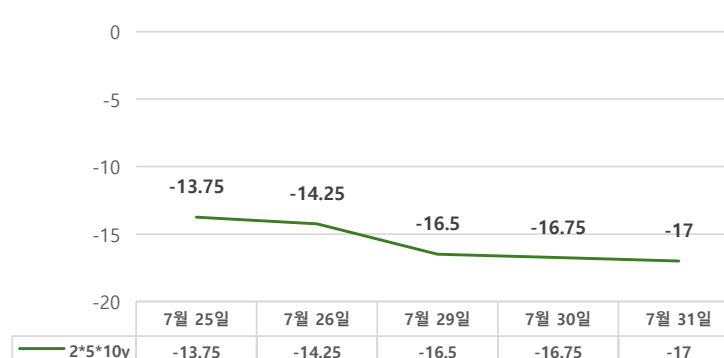
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-18.75	-0.75
1*3y	-27.75	-1.25
2*5y	-13.50	-0.50
3*5y	-4.00	0.00
5*10y	3.50	-0.25
10*20y	-6.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.75	0.50
1*1.5*2y	-1.75	0.25
2*5*10y	-17.00	-0.25
5*7*10y	-2.00	0.25