

Market Daily Report



2024.08.02(금)

레포	운용사 및 은행신락 유동성 회복되어 조달여건 크게 개선됐으나 일부 시은 매도에 나서 잉여 자금 일시에 소진되었음. 한은RP매각 이후 자금 검색 우려 확대됨에 따라 은행 및 증권 추가 매도 발생했으며, 장 막판까지 조달 정체 지속되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. FOMC 회의 이후 제롬 파월 연준 의장의 기자회견이 미국의 9월 기준금리 인하에 대한 확신을 주며 강세 재료로 작용함. 미국 : 미국 국채 금리는 하락 마감. 장 초반부터 전일 FOMC의 영향으로 강세장 분위기 형성. 이후 7월 ISM 제조업 PMI가 46.8로 예상치 48.8을 하회하며 국채 금리는 낙폭을 확대. 또한 신규 실업수당청구건수가 전주 대비 1만 4천명 증가한 24만 9천명을 기록해 노동시장 둔화에 대한 우려가 커지며 추가 강세 압력을 가함.
MONEY	금일 머니 시장은 FOMC 이후 9월 금리 인하를 시장 호가에 이미 선반영 했던 1년물 보다 6개월 레벨 하락세가 두드러졌음. 이번 회의를 통해서 연내 금리 인하 가능성이 2회 혹은 3회 까지 가능하다는 뷰가 늘어나면서 적극적으로 않았던 구간인 6개월물 호가가 시장에 등장하면서 연넘기는 6개월물과 1년물 오피 제시로 한국계 6s 5.25-5.30 1Yr 5.10-5.20 중국계 6s 5.30-5.35 수준의 체결 소식이 전해졌음. 엔화는 금리 인상 이후, 단기물 레벨은 여전히 0.10-0.15 수준으로 제시 중이며, 6개월물 이상 구간의 호가가 전일 대비 15-20bp 정도 상승 반영되며 제시되고 있음.
FX SWAP	월말 이슈로 인해 물량의 영향으로 6달 1년의 가격 변동이 있었음. 초단기물도 월말로 인해 생김 불안이 탐색의 비드가 늘면서 해소되었음. 원화 잉여의 영향이 컸다고 보여짐. 초단기물이 워낙 몰려서 이것이 해결되어야 기간물의 움직임이 좀 더 살아날 것으로 보여짐.
IRS	전일 IRS는 비둘기파적인 연방공개시장위원회(FOMC) 영향으로 하락 마감. 지난밤 FOMC에서 제롬 파월 연준 의장이 9월 금리 인하 가능성을 강력하게 시사하는 등 비둘기파적인 행보를 보임. 다만 한은은 이러한 대외의 변화에도 수도권 주택가격과 가계부채 문제를 계속해서 점검하겠다는 등 매파적 스탠스를 고수하는 분위기. 장 초반에는 전체적으로 단기쪽으로 비드가 많은 모습을 보였으며, 1년쪽으로 비드가 계속해서 나오면서 24에 거래가 이뤄지고, 2년쪽으로도 호가가 계속 형성되면서 02에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 10*15년이 오피가 내려오면서 0.5에 거래가 이뤄지면서 초장기쪽 레벨이 움직였으며, 5년 비드가 소폭 올라오면서 86.25에 거래가 이뤄짐. 막판에는 2*5*10년 나비 비드와 5*10년 비드가 엮이면서 2*10년이 -13에 레깅으로 거래됨. 마감 후 5년 오피가 89.25-89까지 내려오면서 89에 거래됐으며, 9개월쪽으로 호가가 대치를 이루다 34에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.49이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.07.26(금)	211.4	206.2	3.55%	3.541%	3.500%	3.50%	2년물	4.152%	-10.8
2024.07.29(월)	217.4	207.0	3.43%	3.505%		3.50%	5년물	3.836%	-7.9
2024.07.30(화)	217.7	206.7	3.45%	3.513%		3.50%	10년물	3.978%	-5.4
2024.07.31(수)	212.9	203.1	3.50%	3.530%		3.50%	30년물	4.278%	-2.8
2024.08.01(목)	215.0		3.45%	3.512%		3.49%	10Y-2Y	-17.4	5.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,777.68	6.99	29.03.10	국고 24-1	512	은행채 3,400	은행채 9,200	
KOSDAQ	813.53	10.38	52.03.10	국고 22-2	502	여전채 2,700	여전채 6,650	
달러-원	1,369.80원	0.00원	54.03.10	국고 24-2	224	회사채 3,371	회사채 3,720	
국고3Y	2.976%	-2.8	25.08.16	수출입채	-700		공사채 1,300	
국고10Y	3.010%	-5.4	24.12.10	국고 21-10	-701			
국고10Y-3Y	3.4	-2.6	25.01.19	산금채	-1,000			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	-0.05	O/N	5.38	5.33	5.36	-0.06
TN	5.39	5.32	5.36	0.01	TN	5.40	5.35	5.37	0.00
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	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.53	5.43	5.48	-0.03	3S	5.55	5.45	5.50	-0.02
6S	5.35	5.20	5.30	-0.13	6S	5.40	5.30	5.35	-0.10
1YR	5.20	5.05	5.15	-0.07	1YR	5.45	5.25	5.38	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.61	0.02	3.50	5.33000	1M MAR	-241	-239
TN	-26/-22	-24	5.61	0.02	3.50	5.33040	1W*1S	-192	-187
1W	-60/-54	-57	5.64	-0.10	3.50	5.33283	1*2	-260	-250
1S	-260/-240	-250	5.61	0.00	3.48	5.34255	1*3	-490	-480
3S	-760/-730	-745	5.61	0.01	3.45	5.24110	1*6	-1250	-1230
6S	-1520/-1420	-1470	5.59	-0.02	3.43	5.07558	1*9	-1865	-1845
1YR	-2750/2650	-2700	5.36	-0.04	3.31	4.73547	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)

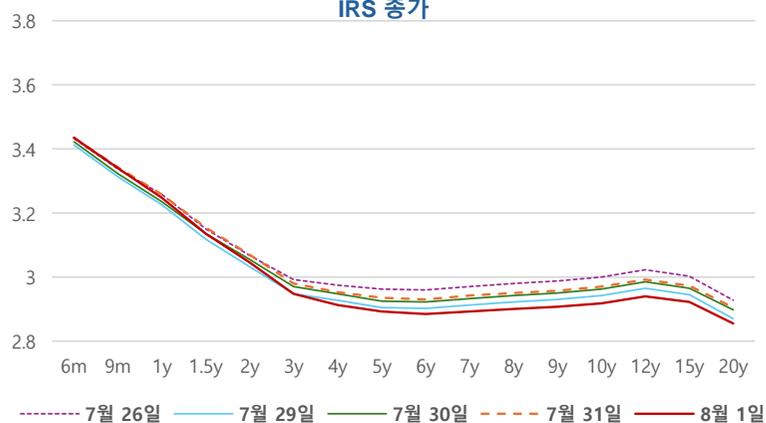
IRS 데일리 증가

8월 1일

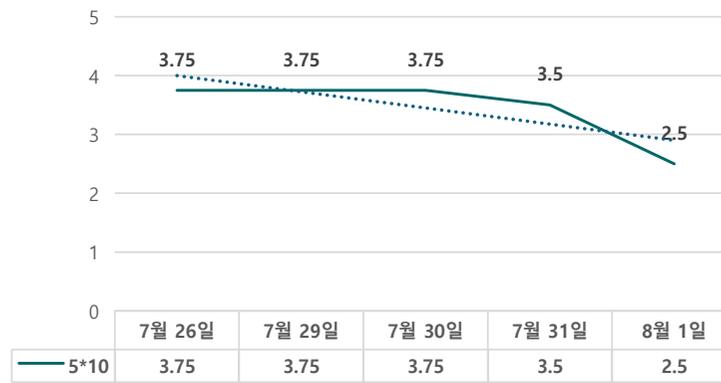
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4350	0.00
9m	3.3400	-0.25
1y	3.2475	-1.00
1.5y	3.1350	-2.00
2y	3.0450	-2.50
3y	2.9475	-3.25
4y	2.9125	-4.00
5y	2.8925	-4.25
6y	2.8850	-4.50
7y	2.8925	-5.00
8y	2.9000	-5.00
9y	2.9075	-5.00
10y	2.9175	-5.25
12y	2.9400	-5.25
15y	2.9225	-5.00
20y	2.8550	-5.00

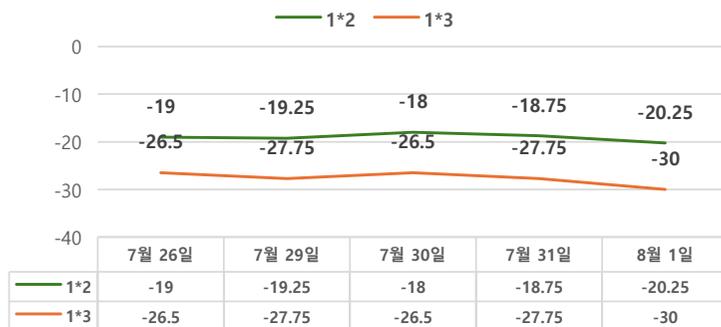
IRS 증가



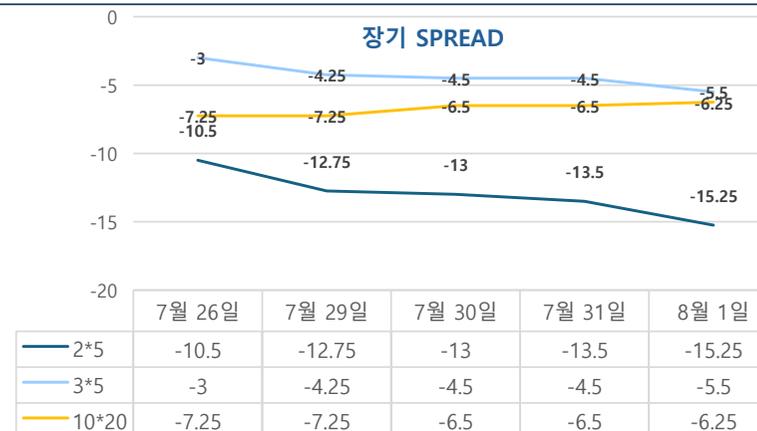
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-20.25	-1.50
1*3y	-30.00	-2.25
2*5y	-15.25	-1.75
3*5y	-4.00	-1.00
5*10y	2.50	-1.00
10*20y	-6.25	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.50
1*1.5*2y	-2.25	-0.50
2*5*10y	-17.75	-0.75
5*7*10y	-2.50	-0.50