

Market Daily Report



2024.07.01(월)

레포	월말 MMF 환매 영향으로 운용사 및 신탁 자금 급감하여 금리 상승했으나 시은 매수 꾸준하여 조달여건 양호하였음. 회사채 정제 일찌감치 해소됐으며, 오후께 추가 자금 일부 저금리 매칭되는 등 반기말임에도 소폭 잉여세를 보임.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 미국 PCE 지표 발표를 앞두고 기대감이 커진 것에 영향을 받음. 미국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 5월 근원 PCE 가격지수가 전년 대비 2.6%로 예상치에 부합하며 국채 금리가 하락할 것이라는 예상과는 반대로 10년물 미 국채는 11bp 상승 마감. 이미 CPI 둔화를 확인한 만큼 시장에 큰 영향을 주지 못한 것으로 풀이됨. 시장은 오히려 6월 시카고 PMI 지표의 확장에 주목하며 국채 매도 심리가 강화됨.
MONEY	6월 반기월 마감으로 오전 장 오픈 하면서 7/1 홍콩 휴일로 대만계 네임 4일물 오버나잇 5.55-5.60 고점 체결 이후, 중국 본토의 오픈 공세로 월말 커브 오버나잇 중국계 네임 5.40 수준에 저점 체결 후 월말 커브 오버나잇 체결 레벨은 네임별로 차등을 보였음. 대만계 5.50-5.55, 중국계 5.40-5.45, 포린 네임 5.40-5.45 수준으로 형성 되었으며, 1개월물 이상 구간의 비드 제한으로 오픈만 테너별로 제시 되었으나, 월말 분위기 반영된 상대적으로 높은 레벨로만 제시 중이며 체결로 이어지긴 어려웠던 분위기 속 중국계 유력 센터들의 장기테너 비드만 시장에 제시 된 채 마무리. 7월 초 온소 달러 자금은 은행별 자금 상황이 다르고 월말에 수출업체 네고 물량이 많았던 터라 주 초 자금 변동성을 감안, 보수적으로 자금 운용을 시작 할 것으로 보임.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 최하단 레벨로 인지한 시장참여자들의 매수세가 유입되면서 장기를 중심으로 소폭 상승했으며, 1년 만기는 전장보다 30전 오른 -2870전, 6개월물은 20전 오른 -1470전에 증가를 형성함. 수급 자체는 양방향 비슷하게 나온 가운데, 긴쪽으로 매수심리가 강했던 것으로 보이며 반기 말 분위기와 겹쳐서 많이 밀렸던 스와프 포인트가 반등한 것으로 분석됨.
IRS	전일 IRS는 미국 대선 후보 토론회를 소화하면서 반락 마감. 이날 대선 토론에서는 조 바이든 현 대통령과 도널드 트럼프 전 대통령 간 토론회는 트럼프 전 대통령이 우위를 점했다는 평가가 나왔으며, 토론회 종료 이후 미 국채 금리가 반락하면서 국내 금리에도 영향을 줌. 장중 1년 쪽으로 41.75-42에 몇차례 거래가 이뤄졌으며, 장 막판에 단기쪽 오픈가 다소 내려오면서 1년이 41, 2년이 25.75까지 거래가 이뤄짐. 1*2년 비드가 -15가 나오면서 커브 레벨이 움직였으며, 마감 이후에는 9*12개월 -5.5 스프레드와 9개월이 엮이면서 레깅으로 1년이 41.25, 9개월이 46.75에 거래가 이뤄짐.

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		
2024.06.24(월)	207.8	198.3	3.55%	3.554%	3.500%	2년물	4.764%	4.2	
2024.06.25(화)	207.4	195.7	3.57%	3.757%		5년물	4.383%	7.9	
2024.06.26(수)	212.8	196.5	3.55%	3.552%		10년물	4.401%	11	
2024.06.27(목)	215.3	196.5	3.55%	3.560%		30년물	4.562%	13.3	
2024.06.28(금)	216.4		3.60%	3.591%		10Y-2Y	-36.3	6.8	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부담 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,797.82	13.76	33.12.10	국고 23-11	1,583	회사채 400	은행채 2,400	국고채 30년 35,000억원
KOSDAQ	840.44	1.79	28.12.10	국고 18-10	1,493	공사채 1,700	여전채 400	통안채 91일물 5,000
달러-원	1,376.70원	-9.10원	54.03.10	국고 24-2	1,047		회사채 660	
국고3Y	3.182%	-3.8	24.12.10	국고 21-10	-1,200		공사채 2,000	
국고10Y	3.266%	-3.4	25.06.10	국고 15-2	-1,451			
국고10Y-3Y	8.4	0.4	25.06.10	국고 22-4	-1,632			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.36	5.40	0.05	O/N	5.45	5.35	5.40	0.06
TN	5.38	5.31	5.35	-0.01	TN	5.38	5.33	5.35	-0.20
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.43	5.38	5.40	-0.03
1S	5.55	5.45	5.50	0.00	1S	5.63	5.55	5.57	-0.03
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.73	5.63	5.65	0.00
6S	5.72	5.57	5.65	0.03	6S	5.73	5.63	5.67	0.00
1YR	5.60	5.45	5.52	0.02	1YR	5.73	5.63	5.68	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	-29//25	-27	5.85	0.53	3.50	5.31000	1M MAR	-240	-237
TN	-8/-6	-7	5.33	0.01	3.50	5.31107	1W*1S	-180	-175
1W	-57/-53	-55	5.56	0.01	3.50	5.31746	1*2	-240	-235
1S	-240/-230	-235	5.53	0.02	3.54	5.34304	1*3	-470	-460
3S	-740/-700	-720	5.66	0.01	3.59	5.33156	1*6	-1200	-1180
6S	-1500/-1440	-1470	5.73	0.00	3.58	5.26295	1*9	-1920	-1890
1YR	-2900/-2840	-2870	5.69	-0.01	3.51	5.05453	1*12	-2600	-2580

국내의 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)

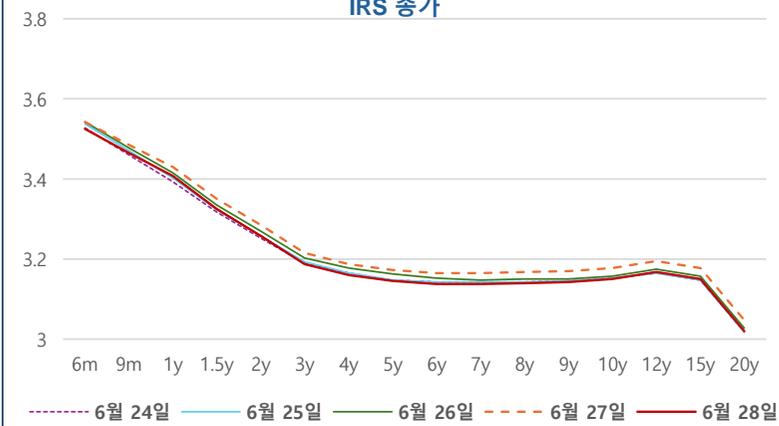
IRS 데일리 증가

6월 28일

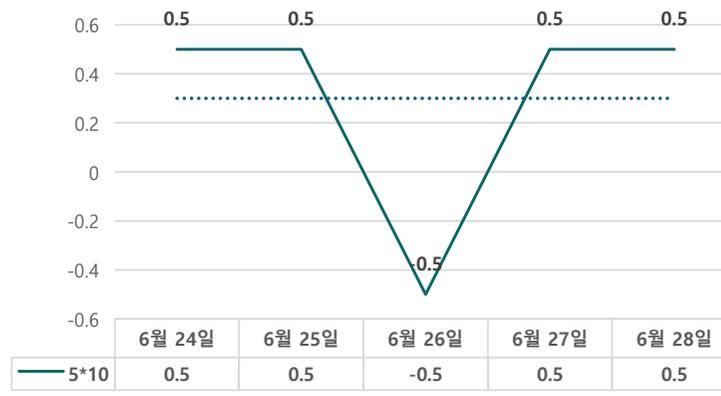
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5250	-1.75
9m	3.4650	-2.00
1y	3.4075	-2.25
1.5y	3.3250	-2.50
2y	3.2575	-2.75
3y	3.1875	-2.75
4y	3.1600	-2.75
5y	3.1450	-2.75
6y	3.1375	-2.75
7y	3.1375	-2.75
8y	3.1400	-2.75
9y	3.1425	-2.75
10y	3.1500	-2.75
12y	3.1675	-2.75
15y	3.1500	-2.75
20y	3.0200	-2.75

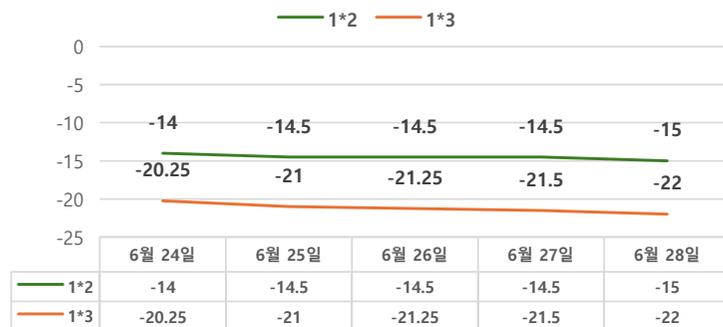
IRS 증가



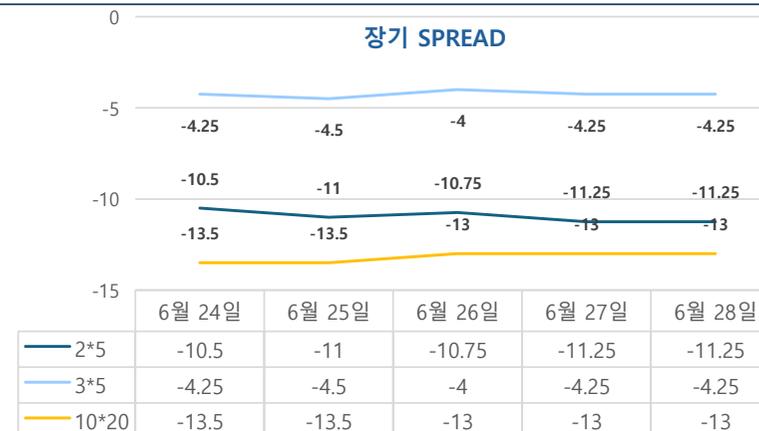
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

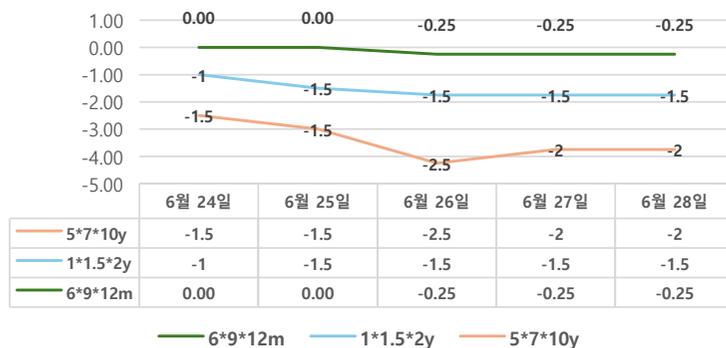


IRS 주요 커브

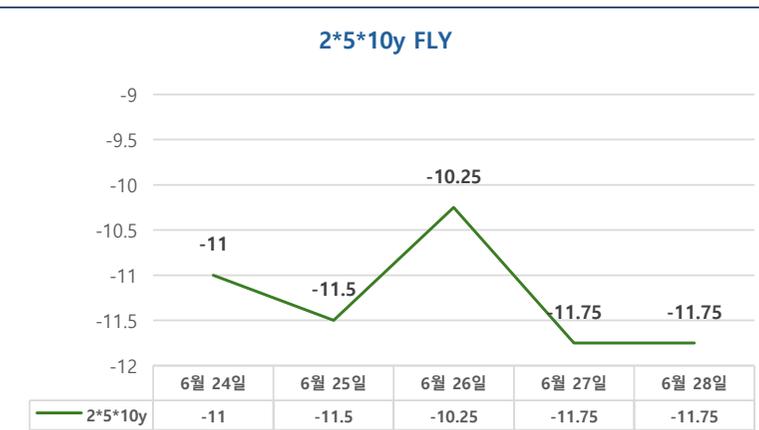
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-15.00	-0.50
1*3y	-22.00	-0.50
2*5y	-11.25	0.00
3*5y	-4.00	0.00
5*10y	0.50	0.00
10*20y	-13.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-1.50	0.00
2*5*10y	-11.75	0.00
5*7*10y	-2.00	0.00