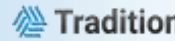


Market Daily Report



2024.07.02(화)

레포	월초 운용사 및 은행신탁 유동성 회복되어 금리 대폭 하락했으며, 은행권 매수세 꾸준하여 장 초반부터 금리 하락하였음. 증권사 익일물 및 기일물 수요 감소했고, 장 중 추가자금 지속 유입되어 시은 저금리 조달 가능했음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 전 거래일 미국 국채 금리 상승에 약세 출발하였으나 저가 매수세 유입에 약세 폭은 뉴욕 대비 크지 않았음. 미국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 6월 ISM 제조업 PMI가 48.5로 예상치 49.2를 하회하였으나 저번주 트럼프-바이든 간의 토론에서 트럼프 전 대통령이 승리한 점이 영향을 주고 있다고 해석됨. 트럼프의 당선 시, 미국의 재정적자가 더 확대될 수 있다는 우려 속에 채권 투매가 미리 이루어졌다는 분석.
MONEY	금일 홍콩 휴장을 맞아, 역외 비드가 제한적인 가운데, 중국계 및 대만계 메인 센터 비드 부재로 미주 대만계와 말레이시아 네임 위주로 일부 거래 체결 소식 전했음. 중국계 2주 5.42, 미주 대만계 1개월물 5.55 3개월물 5.63, 말레이계 1달 5.48로 체결 된 후 한산한 장세를 보였음. 온소 렌더들 1개월물 위주로 오피 재개 했으나, 제시된 오피 기대 금리와 시장 비드 호가 사이의 레벨 갭으로 체결은 일부 네임만 스몰 거래 된 후 마감됨. 온소 오버나잇은 5.32-5.35 사이로 체결 되었으며, 전월말 기업체 네고 물량이 컸고, 금주 환율 움직임에 따라 결제 자금 수요 등장에 시중은행 자금이 월초 일부 타이트하게 집계되면서 하반기 시작 운용은 소극적인 분위기.
FX SWAP	외환스와프포인트는 뉴욕장에서 미 국채 금리가 크게 뛰었지만, 외환자금시장은 대체로 견조함 유지하며 대체로 보험세를 보임. 미 국채 금리는 6월 시카고 구매관리자 지수(PMI) 호조에 상승했지만, 물가와 고용 시장은 둔화하는 흐름을 반영하며 스와프 레벨도 하방압력이 다소 약해진 것으로 판단됨.
IRS	전일 IRS는 미국 금리가 상당 폭 오른 점을 반영하여 동반 상승 마감. 지난밤 미국 일부 경제 지표가 호조를 보이고, 프랑스 총선의 극우 정당 승리 가능성과 미국 대선에서 조 바이든 현 대통령의 위기 등 여러가지의 이슈가 합쳐지면서 금리가 상당폭 상승하는 모습을 보임. 이날 밤 공급관리협회(ISM)의 6월 제조업 PMI가 대기 중이고, 국내의 6월 소비자물가지수 등 여러가지 지수 발표를 앞두고 전반적으로 불확실성이 커지는 분위기를 보임. 전반적으로 2년쪽 호가가 많이 형성되면서 29에 여러 차례 거래됐으며, 장 막판에 2*10년, 5*10년이 엮이면서 2*5년이 -9에 레깅되어 거래됨. 마지막에 6개월, 2년, 5년등 전체적으로 오피가 내려오면서 레벨이 움직였으며, 장 마감 후 6개월 비드가 나오면서 52.75에 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	단위 : bp
2024.06.25(화)	207.4	195.7	3.57%	3.757%	3.500%	3.60%	2년물	4.766%	0.2
2024.06.26(수)	212.8	196.5	3.55%	3.552%		3.60%	5년물	4.430%	4.7
2024.06.27(목)	215.3	196.5	3.55%	3.560%		3.60%	10년물	4.466%	6.5
2024.06.28(금)	216.4	187.4	3.60%	3.591%		3.60%	30년물	4.627%	6.5
2024.07.01(월)	214.4		3.46%	3.510%		3.60%	10Y-2Y	-30	6.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,804.31	6.49	54.03.10	국고 24-2	4,857	은행채 1,000	은행채 600	
KOSDAQ	847.15	6.71	27.06.10	국고 24-4	1,000	여전채 5,300	여전채 1,000	
달러-원	1,384.10원	7.40원	34.06.10	국고 24-5	538	회사채 2,350	회사채 4,340	
국고3Y	3.210%	2.8	24.12.10	국고 21-10	-500	통안채 5,400	통안채 80,700	
국고10Y	3.312%	4.6	25.03.10	국고 20-1	-524	공사채 1,900	공사채 6,900	
국고10Y-3Y	10.2	1.8	25.06.10	국고 15-2	-643			

Money Market Closing								
단위 : %, %p								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		전일대비
O/N	5.37	5.30	5.34	-0.06	O/N	5.35	5.30	-0.07
TN	5.39	5.32	5.36	0.01	TN	5.37	5.32	-0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.43	5.38	0.01
1S	5.54	5.44	5.49	-0.01	1S	5.60	5.50	0.00
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.70	5.60	0.00
6S	5.72	5.57	5.65	0.00	6S	5.73	5.63	0.00
1YR	5.58	5.43	5.50	-0.02	1YR	5.73	5.63	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	-8/-6	-7	5.32	-0.53	3.50	5.31000	1M MAR	-234	-225
TN	-9/-7	-8	5.58	0.25	3.50	5.31082	1W*1S	-195	-185
1W	-56/-52	-54	5.52	-0.04	3.50	5.31576	1*2	-222	-215
1S	-260/-240	-250	5.53	-0.01	3.54	5.33717	1*3	-470	-450
3S	-740/-700	-720	5.63	-0.03	3.59	5.32460	1*6	-1210	-1180
6S	-1500/-1420	-1460	5.70	-0.03	3.58	5.25471	1*9	-1910	-1890
1YR	-2900/-2820	-2860	5.66	-0.03	3.50	5.04004	1*12	-2590	-2550

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)

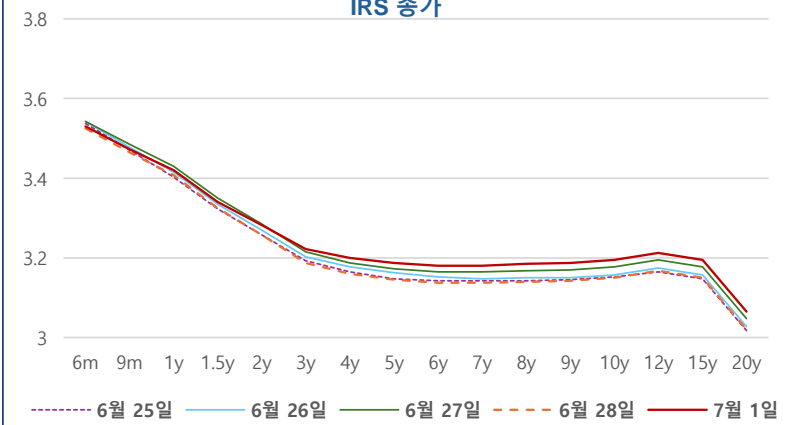
IRS 데일리 증가

7월 1일

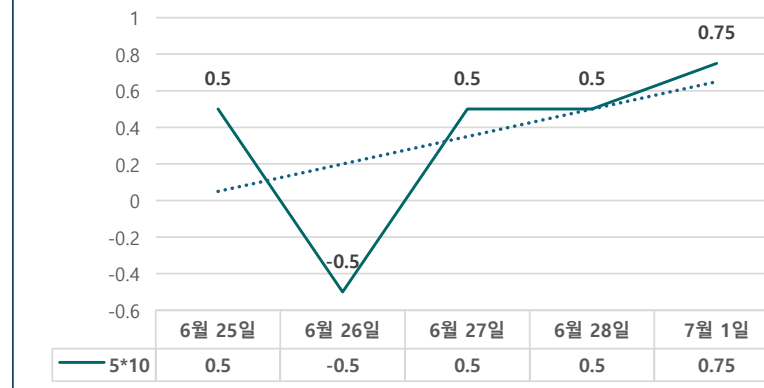
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5300	0.50
9m	3.4725	0.75
1y	3.4200	1.25
1.5y	3.3400	1.50
2y	3.2825	2.50
3y	3.2225	3.50
4y	3.2000	4.00
5y	3.1875	4.25
6y	3.1800	4.25
7y	3.1800	4.25
8y	3.1850	4.50
9y	3.1875	4.50
10y	3.1950	4.50
12y	3.2125	4.50
15y	3.1950	4.50
20y	3.0650	4.50

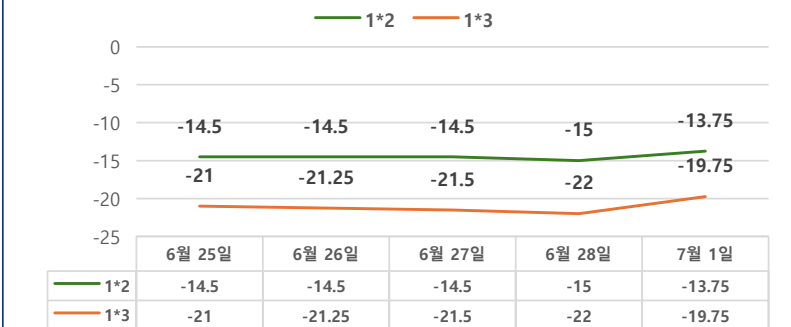
IRS 증가



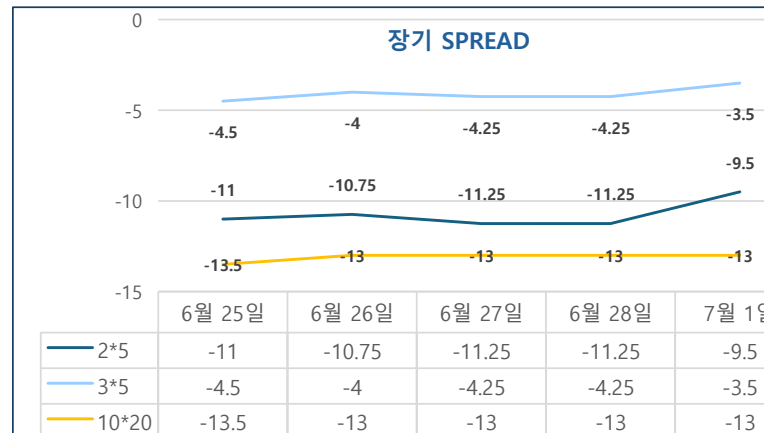
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

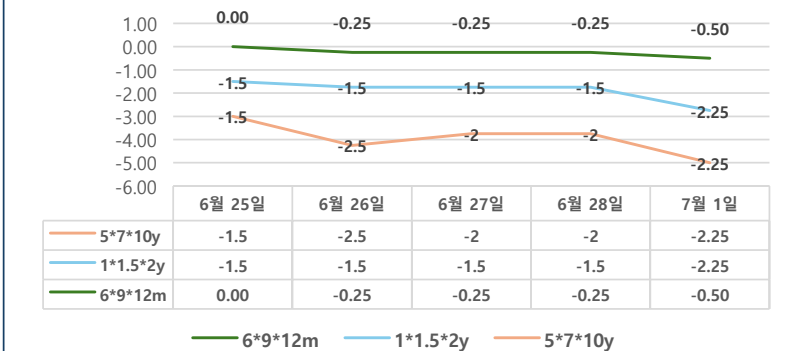


IRS 주요 커브

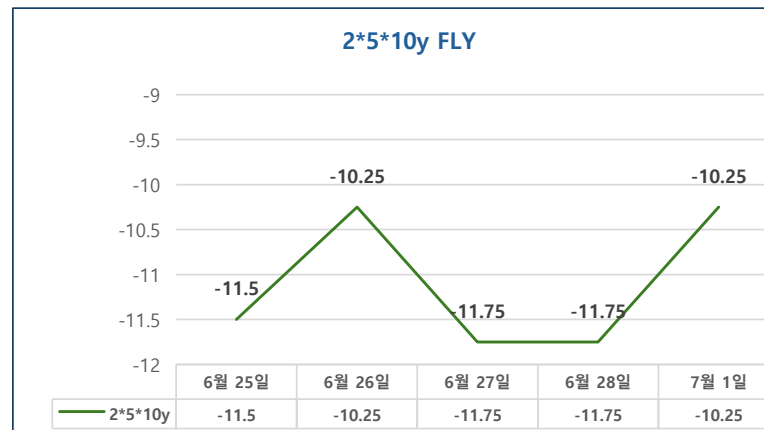
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.75	1.25
1*3y	-19.75	2.25
2*5y	-9.50	1.75
3*5y	-4.00	0.75
5*10y	0.75	0.25
10*20y	-13.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	-0.25
1*1.5*2y	-2.25	-0.75
2*5*10y	-10.25	1.50
5*7*10y	-2.25	-0.25