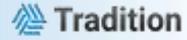


Market Daily Report



2024.07.04(목)

레포	시는 조달에 적극적으로 나서 매수자금 이른 시간에 소진됐으며, 추가 매도분 대기하는 등 빠른 분위기 조성됨. 오후에 공모주 청약자금 유입되어 정채 해소됐으나 시작금리 낮았던 탓에 저금리 거래 극히 제한적이었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 소폭 하락 마감. 금리 레벨이 연저점 수준으로 낮아졌지만 시장의 매수 심리는 여전히. 다음 주 금통위 회의 전까지 매수 심리 우위 장세 지속 전망. 미국 : 미 국채 금리는 하락 마감. 독립기념일을 하루 앞두고 조기 마감한 가운데 미국 고용 시장과 서비스업 업황이 냉각되며 강세장 형성. 신규 실업보험청구자수는 238K로 전주대비 4K 증가하였으며 ISM 서비스업 PMI는 48.8로 예상치 52.6을 밑돌며 경기 둔화 국면 진입 우려가 커지며 강세장 형성.
MONEY	달러 머니 시장은 1개월물 이내 구간의 운용 인트와 스프레드 거래 유인에 따른 3-6개월물 오퍼가 시장에 등장하면서 한국계 및 중국계 네임으로 매칭되었음. 시장에서 1개월물 차입 수요가 크지 않아, 일부 중국계 1개월물 5.55 3개월물 5.65 & 한국계는 3개월물 5.55 6개월물 5.60 수준의 레벨 형성 중. 위안화는 6월 서비스업 체감 경기 둔화와 엔저 약세 영향으로 지속 약세를 보이면서 PBOC는 역레포 통해 유동성을 공급했으나 만기 도래전 감안 실제 유동성은 흡수 하면서 역외 위안화 금리는 장중 초단기 금리가 5% 가까이 육박하는 등 유동성이 타이트한 분위기가 형성 되었고 USD/CNH 스왑 포인트 상승으로 스왑 환산 금리도 급등하며 전일 대비 1개월 금리는 35bp 가량 상승해 3.50% 수준으로 JUMP UP 하며 마감됨.
FX SWAP	간밤에 미 국채 금리 하락 동시에 리스트 선호가 살아날 가능성이 보였지만 국고채 금리가 내리지면서 FX스왑 시장 영향력이 크지 않았음. 탭밸류는 미국 금융시장의 휴장으로 인해 탭액 거래가 없었기에 하루물음의 영향도 크지 않았음. 전반적으로 FX시장의 확연한 움직임은 제한적이었음.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 장중 국민은행의 3개월 CD가 3.578%정도로 낮게 거래되면서, CD 움직임을 고려하여 단기쪽으로 오퍼가 많이 나오는 모습을 보임. 6,9개월쪽으로 호가가 많이 형성됐으며 9개월이 41에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 단기쪽으로 비드 레벨이 올라오면서 6개월이 49까지 올라왔으며, 1.5년이 27.25에 거래가 이뤄짐. 5년은 13.75/13.5에 대치를 이루다 ND로 13.5에 거래됨. 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.58에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp
						금리	전일대비	
2024.06.26(수)	212.8	196.5	3.55%	3.552%	3.500%	2년물	4.718%	-3.6
2024.06.27(목)	215.3	196.5	3.55%	3.560%		5년물	4.331%	-6.9
2024.06.28(금)	216.4	187.4	3.60%	3.591%		10년물	4.364%	-7.3
2024.07.01(월)	214.4	191.0	3.46%	3.510%		30년물	4.532%	-7.6
2024.07.02(화)	210.5		3.40%	3.483%		10Y-2Y	-35.4	-3.7

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,794.01	13.15	29.03.10	국고 24-1	705	은행채 5,000	은행채 11,800	
KOSDAQ	836.1	6.19	26.12.10	국고 16-8	500	여전채 4,000	여전채 600	
달러-원	1,385.80원	-1.10원	26.03.10	국고 24-3	500	회사채 4,067	회사채 1,300	
국고3Y	3.160%	-0.9	28.03.10	국고 23-1	-150	공사채 9,500	공사채 2,300	
국고10Y	3.274%	-1.5	31.12.10	국고 11-7	-300			
국고10Y-3Y	11.4	-0.6	25.03.10	국고 23-3	-500			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.37	5.30	5.34	0.00	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.38	5.31	5.35	-0.01	TN	5.38	5.33	5.36	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.54	5.44	5.49	0.00	1S	5.60	5.50	5.55	-0.03
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.73	5.63	5.65	-0.02
6S	5.68	5.53	5.60	-0.03	6S	5.73	5.63	5.68	0.00
1YR	5.52	5.37	5.45	-0.02	1YR	5.73	5.63	5.70	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-16/-12	-14	5.32	-0.25	3.50	5.31000	1M MAR	-242	-238
TN	-	-	-	-	3.50	5.31071	1W*1S	-184	-182
1W	-57/-53	-55	5.53	-0.04	3.50	5.31495	1*2	-245	-230
1S	-245/-235	-240	5.53	-0.05	3.52	5.33192	1*3	-495	-480
3S	-740/-720	-730	5.59	-0.04	3.55	5.31817	1*6	-1240	-1220
6S	-1520/-1460	-1490	5.69	-0.03	3.54	5.25274	1*9	-1940	-1900
1YR	-2980/-2900	-2940	5.66	-0.02	3.46	5.05029	1*12	-2660	-2620

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)

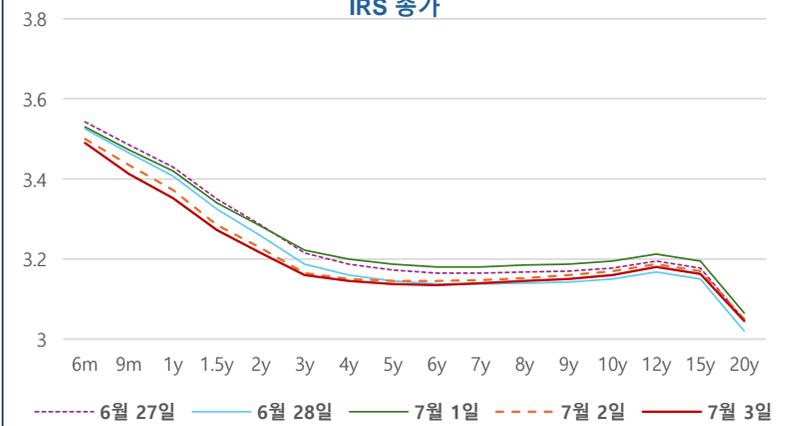
IRS 데일리 증가

7월 3일

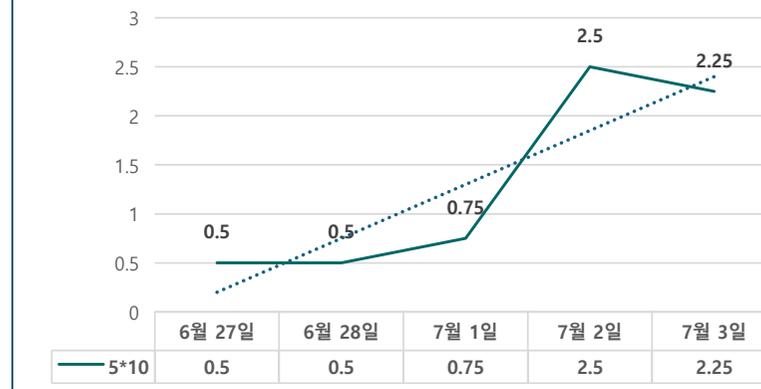
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4900	-1.00
9m	3.4125	-2.25
1y	3.3525	-2.00
1.5y	3.2725	-1.25
2y	3.2150	-1.25
3y	3.1600	-0.50
4y	3.1450	-0.50
5y	3.1375	-0.75
6y	3.1350	-1.00
7y	3.1400	-0.75
8y	3.1450	-0.75
9y	3.1500	-1.00
10y	3.1600	-1.00
12y	3.1800	-0.75
15y	3.1625	-0.75
20y	3.0450	-0.50

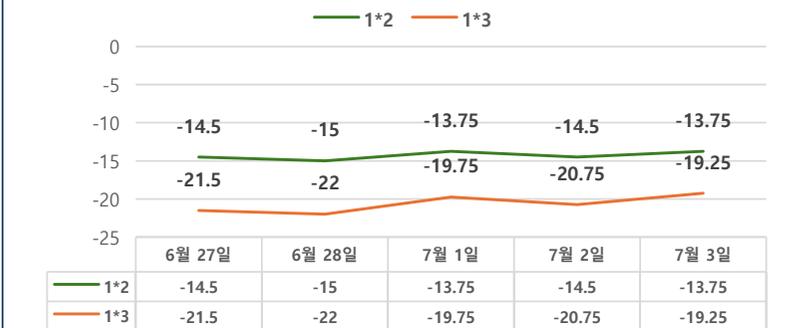
IRS 증가



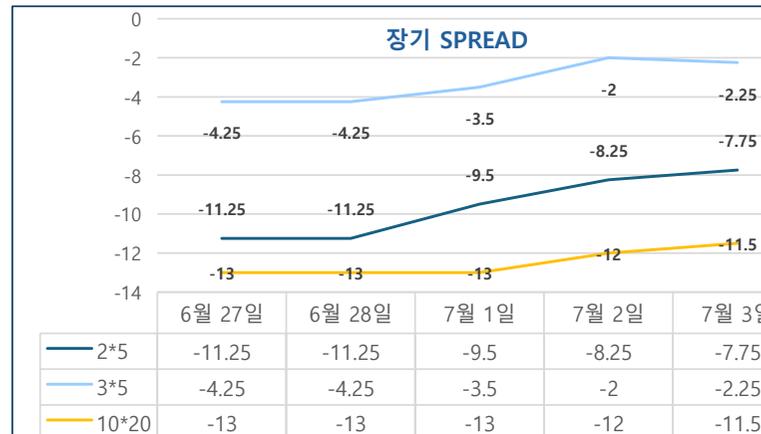
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

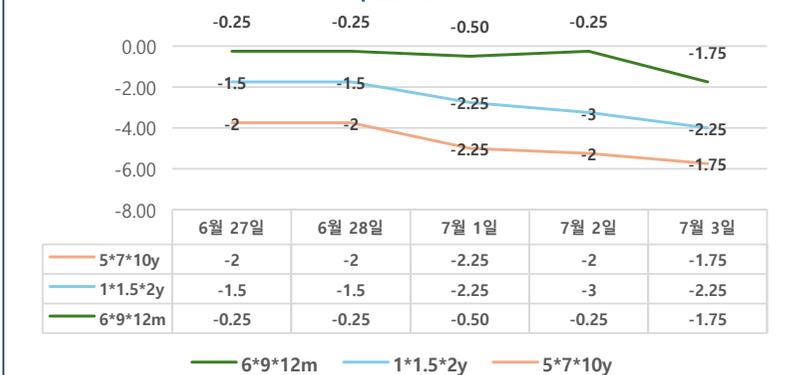


IRS 주요 커브

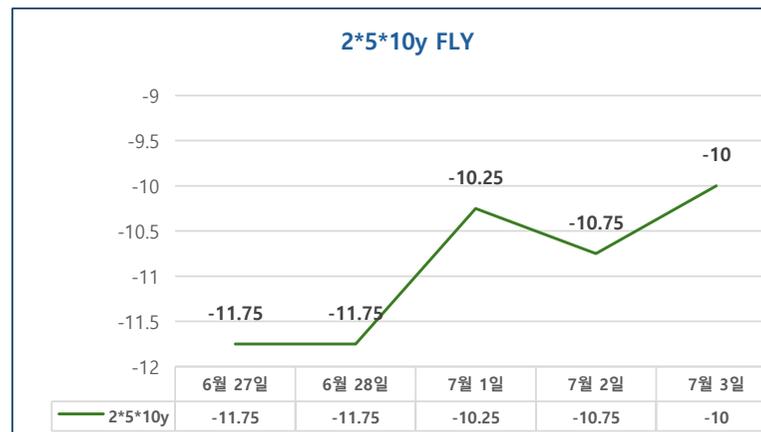
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.75	0.75
1*3y	-19.25	1.50
2*5y	-7.75	0.50
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	2.25	-0.25
10*20y	-11.50	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.75	-1.50
1*1.5*2y	-2.25	0.75
2*5*10y	-10.00	0.75
5*7*10y	-1.75	0.25