

Market Daily Report

2024.07.08(월)



레포	공모주 청약(시프트업) 환율 및 공자기금 환수 영향으로 유동성 축소된 가운데 전일의 부족세 반영되어 조달금리 급등하였음. 장 초반부터 시은 운용에 적극적으로 나서 정체 이른시간에 해소됐으며, 오후에 추가 자금 일부 저금리 매칭되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 소폭 하락 마감. 전일 뉴욕 채권시장 휴장으로 재료가 부재한 상황에서 다음주 금통위에 대한 기대감이 커진 데 영향을 받음. 미국 : 미국 채권 금리는 하락 마감. 6월 비농업 고용이 20만 6천명 증가해 예상치를 상회하며 장 초반 국채 금리는 상승하였으나 이내 국채 금리는 하락세 전환. 시장은 비농업 고용의 증가치가 FOMC의 기준금리 인하 기초를 뒤집을 정도는 아니라고 판단.
MONEY	금일 머니 시장은 어제 뉴욕 휴장 이후, 역의 렌더들의 자금 운용 인트가 되살아 나면서 시장은 오퍼 우위의 장세 속에, 중국계 2개월물 5.57-5.58 굿사이즈 오퍼 제시되고, 1-2개월물 가격은 추가 하락세를 보였으며, 3-6개월물은 5.62-5.68 수준으로 체결됨. 지난 분기말 기간을 펀딩 수요가 컸던 만큼 7월초에는 매칭성 자금 포지션이 크지 않고, 여름 휴가철 시즌이 다가오면서 기업채 관련 대출 자산 규모도 축소 될수 있어 다음주 시장에 제시되는 호가와 물량에 따라 기간별 마켓 레벨이 형성 될 것으로 예상됨.
FX SWAP	FX시장은 자산 스왑 물량에 의한 하방 압력이 있는 편이었지만 대체적으로 미국 경제 지표를 앞두고 있어 큰 변동은 없었음, 미국 6월 고용보고서를 앞두고 있고 자산 스왑 수요에 의해 조금 밀리는 분위기였음.
IRS	전일 IRS는 중장기 위주로 하락 마감.연방준비제도(Fed,연준) 와 한국은행의 피벗에 대한 기대가 이어지면서 이에 영향을 받아 움직임. 다만 금리가 이미 상당폭 하락한 가운데 미국의 고용지표와 다음주 금통위를 앞두고 대기하자는 심리도 강화된 모습을 보임. CD(양도성 예금증서) 영향으로 초단기쪽으로 호가 많이 나왔으며, 장 초반 6개월이 48.5에 거래됐으며 오후에는 비드가 올라오면서 48.75까지 올라오는 모습을 보임. 15*20년 비드가 올라오며 따라 초장기쪽 레벨이 움직였으며, 1년, 1.5, 2년쪽으로 호가가 많이 형성되면서 2년이 17.5 거래 후 18까지 레벨이 올라옴. 장 막판에 6*9개월 오퍼가 내려오면서 초단기 레벨이 높였으며, 10년이 12에 초이스까지 이루어지면서 12.25, 12에 리버스로 동시에 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	
2024.07.01(월)	214.4	191.0	3.46%	3.510%	3.500%	3.60%	2년물	4.604%	-11.45
2024.07.02(화)	210.5	199.5	3.40%	3.483%		3.60%	5년물	4.228%	-10.3
2024.07.03(수)	214.3	203.8	3.40%	3.504%		3.58%	10년물	4.282%	-8.2
2024.07.04(목)	217.9	204.1	3.43%	3.514%		3.58%	30년물	4.486%	-4.6
2024.07.05(금)	213.0		3.55%	3.538%		3.57%	10Y-2Y	-32.15	3.25

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종호가수익률			단위: 억 원			단위: 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,862.23	37.29	28.12.10	국고 18-10	1,087	은행채 5,500	은행채 3,600	국고채 3년 24,000
KOSDAQ	847.49	6.68	54.03.10	국고 24-2	775	여전채 1,000	여전채 4,800	통안채 91일물 5,000
달러-원	1,381.30원	0.30원	29.03.10	국고 24-1	730	회사채 1,000	회사채 1,860	
국고3Y	3.115%	-1.3	28.03.10	국고 23-1	-300	공사채 1,000	통안채 7,000	
국고10Y	3.227%	-0.7	34.06.10	국고 24-5	-892		공사채 1,000	
국고10Y-3Y	11.2	0.6	52.03.10	국고 22-2	-1,000			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.37	5.30	5.34	-0.01	O/N	5.36	5.31	5.34	-0.01
TN	5.38	5.31	5.35	0.00	TN	5.37	5.32	5.35	-0.01
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	5.52	-0.03
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.73	5.60	5.65	0.00
6S	5.68	5.53	5.60	0.00	6S	5.73	5.60	5.67	-0.01
1YR	5.52	5.37	5.45	0.00	1YR	5.73	5.60	5.68	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위: 전, %, %p						단위: 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-23/-21	-22	5.41	0.09	3.50	5.31000	1M MAR	-242	-238
TN	-9/-7	-8	5.58	0.17	3.50	5.31071	1W*1S	-184	-182
1W	-56/-52	-54	5.51	0.00	3.50	5.31499	1*2	-245	-230
1S	-245/-235	-240	5.52	0.03	3.50	5.33211	1*3	-495	-480
3S	-735/-715	-725	5.56	0.01	3.50	5.31426	1*6	-1240	-1220
6S	-1500/-1420	-1460	5.62	-0.04	3.49	5.23696	1*9	-1940	-1900
1YR	-2970/-2870	-2920	5.59	-0.05	3.39	5.02033	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)

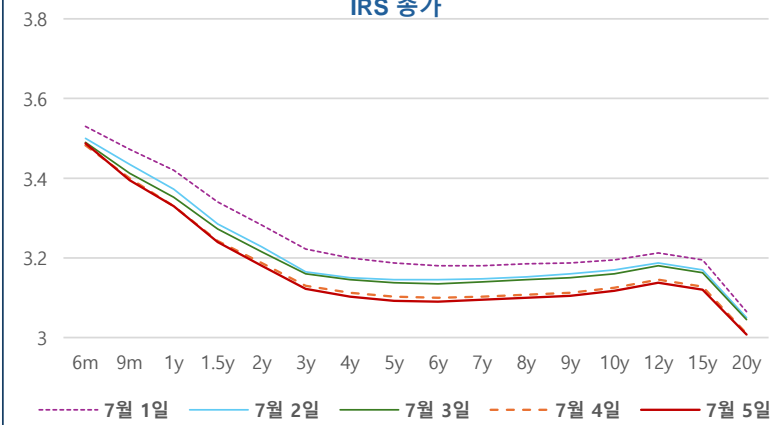
IRS 데일리 증가

7월 5일

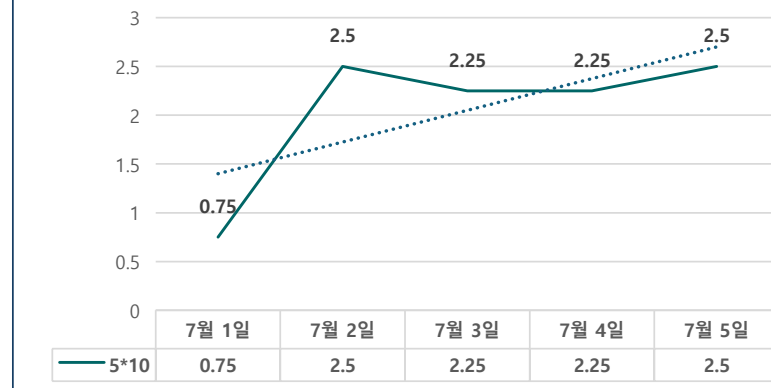
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4875	0.50
9m	3.3950	-0.50
1y	3.3300	0.00
1.5y	3.2400	-0.25
2y	3.1800	-0.75
3y	3.1225	-0.75
4y	3.1025	-1.00
5y	3.0925	-1.00
6y	3.0900	-1.00
7y	3.0950	-0.75
8y	3.1000	-0.75
9y	3.1050	-0.75
10y	3.1175	-0.75
12y	3.1375	-0.75
15y	3.1200	-0.75
20y	3.0075	-0.25

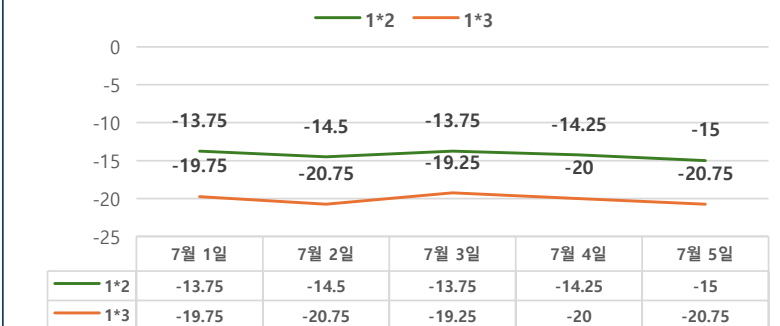
IRS 증가



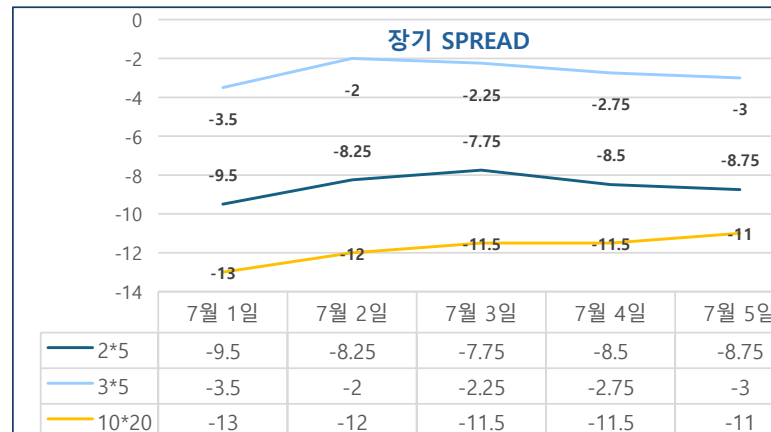
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

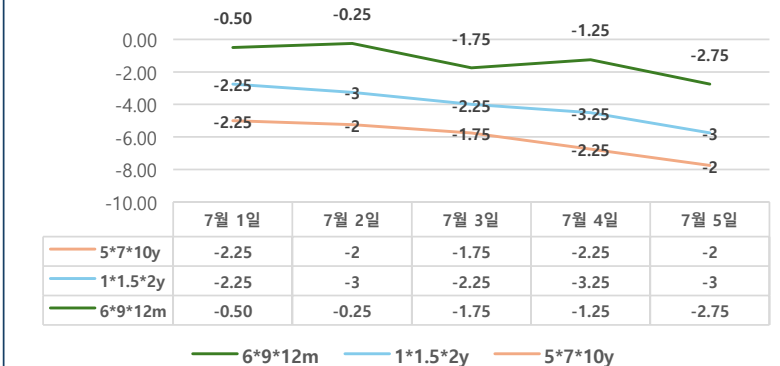


IRS 주요 커브

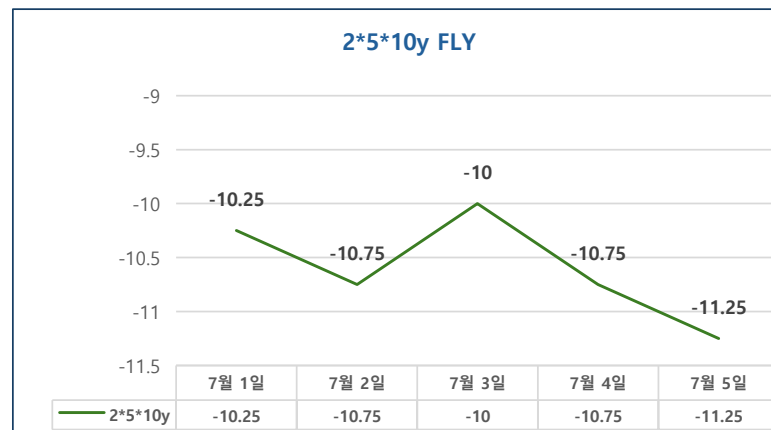
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-15.00	-0.75
1*3y	-20.75	-0.75
2*5y	-8.75	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	2.50	0.25
10*20y	-11.00	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	-1.50
1*1.5*2y	-3.00	0.25
2*5*10y	-11.25	-0.50
5*7*10y	-2.00	0.25