

Market Daily Report



2024.07.09(화)

레포	지중 마감 앞두고 적수 부족 규모 축소되어 시은 조달 보다 운용에 적극적이었으며, 장 중 조달금리 하락하였음. 잉여 분위가 심화되어 은행 및 증권 저금리 매도 활발했고, 익일물 조달금리 소폭 하락하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 혼조세 마감. 전 거래일 미국 국채 금리가 급락한 데다 외국인 국채 선물을 대거 사들였으나, 레벨 부담에 강세는 제약받는 분위기였음. 미국 : 미국 채권 금리는 혼조세 마감. 통화정책에 민감한 2년물 국채 금리는 소폭 상승 마감. 장 초반 미 10년물 국채 금리는 4.32%까지 상승하였으나 이후 상승폭을 줄이며 보험권을 형성하며 4.28%로 마감. 시장을 움직일 만한 뚜렷한 재료가 없던 가운데 방향성을 탐색하는 것으로 풀이됨.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 SOFR 금리가 전테너 소폭 하락세를 보임에 따라 시장 참가자들의 1년물 호가가 전주 대비 10bp 하향 조정 된 가격으로 제시 했으며, 한국계로 1년물 5.40%오퍼, 중국계로 1년물 5.60% 오퍼 제시 후 일부 체결 소식 전했고, 유럽 시장 오픈하면서 굿네임 은행들(기준 비드 레벨도 낮았으나)의 장기구간 차입 금리 역시 4-6bp 하향 조정 된 후 호가를 내고 있음. 그 외, 중국계 1개월물 5.50-5.53 & 대만계 3개월물 5.55 서울 및 역외 오퍼로 체결 되면서 전반적으로 레벨은 테너별 하향 조정 중.
FX SWAP	FX스와프포인트는 미국의 고용지표가 노동시장 냉각을 시사함에 따라 장기를 중심으로 상승한 분위기를 보였으며, 1년 만기는 전장보다 60전 오른 -2860전, 6개월 만기는 20전 오른 -1440전을 기록함. 이번주 미국 소비자 물가지수와 한국은행 금통위가 예정됨에 따라 추가적인 상승압력은 해당 지표발표 이후 추진력을 얻을 것으로 판단됨.
IRS	전일 IRS는 중장기를 위주로 하락 흐름을 이어갔으며, 단기 구간은 최근 금리 급락에 따른 부담이 나타나는 분위기를 보임. 주말에 발표된 미국의 6월 비농업부문 고용 지표에서 실업률의 상승 등 고용시장 냉각 신호가 나옴에 따라 국내도 이에 영향을 받아 움직임. 이번 주 예정된 금융통화위원회에서의 인하 소수의견에 대한 기대도 여전한 상황. 1*3년, 2*5년 스프레드 쪽으로 호가가 많이 나왔으며, 1*3년은 -22에, 2*5년과 2년이 엮이면서 5년이 7.5레벨에 거래가 이뤄짐. CD움직임을 주시하면서 6개월 48.5, 9개월 40까지 비드가 올라왔으며, 7년쪽으로 비드가 꾸준히 올라오면서 08에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에 전체적으로 비드가 올라왔으며, 9년이 09에 거래됐고, 10년이 잠시 10에 초이스를 이루는 분위기였다가 10에 거래가 이뤄짐. 미국채 움직임에 연동되면서 2년이 17.5/17에 대치를 이룸.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
							금리	전일대비		
2024.07.02(화)	210.5	199.5	3.40%	3.483%	3.500%	3.60%	2년물	4.631%	2.75	
2024.07.03(수)	214.3	203.8	3.40%	3.504%		3.58%	5년물	4.242%	1.4	
2024.07.04(목)	217.9	204.1	3.43%	3.514%		3.58%	10년물	4.282%	0	
2024.07.05(금)	213.0	204.1	3.55%	3.538%		3.57%	30년물	4.467%	-1.9	
2024.07.08(월)	207.6		3.50%	3.498%		3.57%	10Y-2Y	-34.9	-2.75	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금류업 최종호가이익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,857.76	-4.47	29.06.10	국고 19-4	938	은행채 2,000	은행채 4,000	국고채 2년 14,000
KOSDAQ	859.27	11.78	24.10.08	통안채	900	여전채 9,800	여전채 1,790	
달러-원	1,383.10원	1.80원	26.03.10	국고 24-3	790	회사채 3,000	회사채 4,900	
국고3Y	3.119%	0.4	26.06.10	국고 16-3	-235	통안채 5,300	통안채 18,400	
국고10Y	3.212%	-1.5	25.07.02	통안채	-400	공사채 10,104	공사채 4,300	
국고10Y-3Y	9.3	-1.9	25.03.10	국고 23-3	-1,000			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간			증가	전일대비	기간			증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	0.01	O/N	5.36	5.32	5.34	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	0.01	TN	5.37	5.32	5.35	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.53	5.43	5.48	-0.01	1S	5.57	5.47	5.51	-0.01
3S	5.60	5.50	5.55	-0.01	3S	5.70	5.55	5.62	-0.03
6S	5.66	5.51	5.58	-0.02	6S	5.70	5.55	5.65	-0.02
1YR	5.50	5.35	5.42	-0.03	1YR	5.70	5.55	5.60	-0.08

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.58	0.17	3.50	5.31000	1M MAR	-238	-234
TN	-9/-7	-8	5.58	0.00	3.50	5.31053	1W*1S	-195	-188
1W	-56/-52	-54	5.51	0.00	3.50	5.31370	1*2	-220	-210
1S	-260/-250	-255	5.52	0.00	3.50	5.32743	1*3	-447	-440
3S	-720/-700	-710	5.53	-0.04	3.49	5.30689	1*6	-1185	-1160
6S	-1480/-1400	-1440	5.57	-0.05	3.47	5.22647	1*9	-1890	-1860
1YR	-2900/-2820	-2860	5.53	-0.06	3.37	5.00549	1*12	-2580	-2550

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)

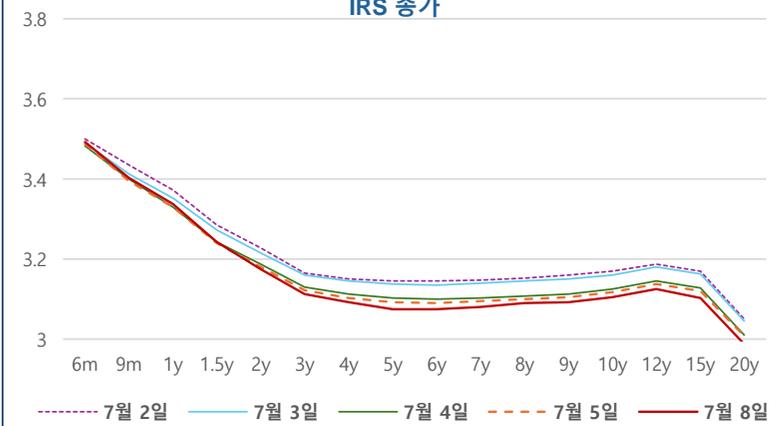
IRS 데일리 증가

7월 8일

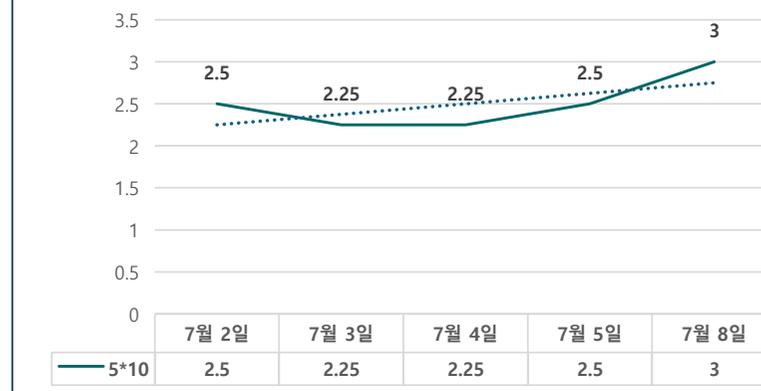
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4925	0.50
9m	3.4025	0.75
1y	3.3375	0.75
1.5y	3.2425	0.25
2y	3.1750	-0.50
3y	3.1125	-1.00
4y	3.0925	-1.00
5y	3.0750	-1.75
6y	3.0750	-1.50
7y	3.0800	-1.50
8y	3.0900	-1.00
9y	3.0925	-1.25
10y	3.1050	-1.25
12y	3.1250	-1.25
15y	3.1025	-1.75
20y	2.9875	-2.00

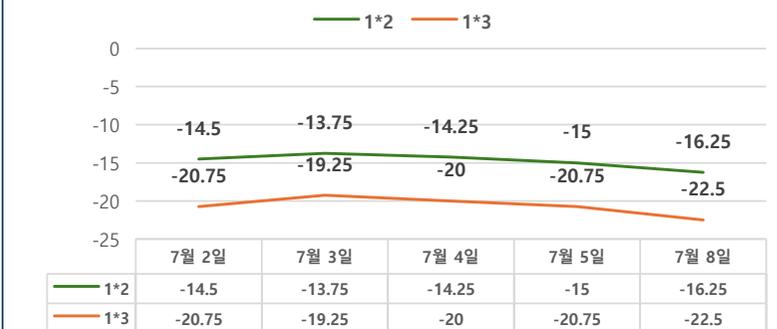
IRS 증가



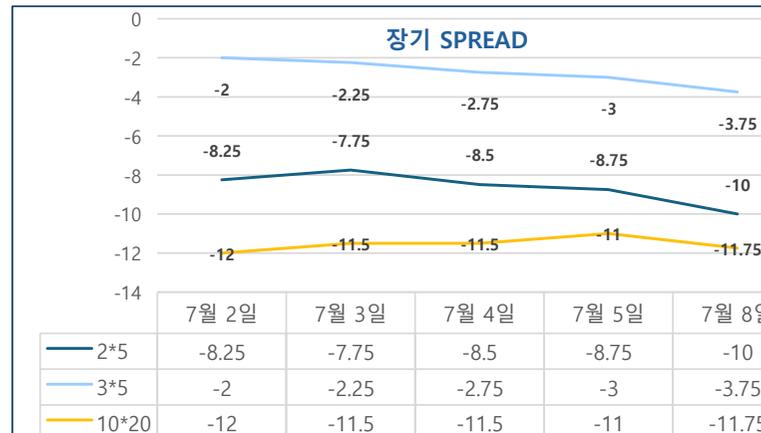
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

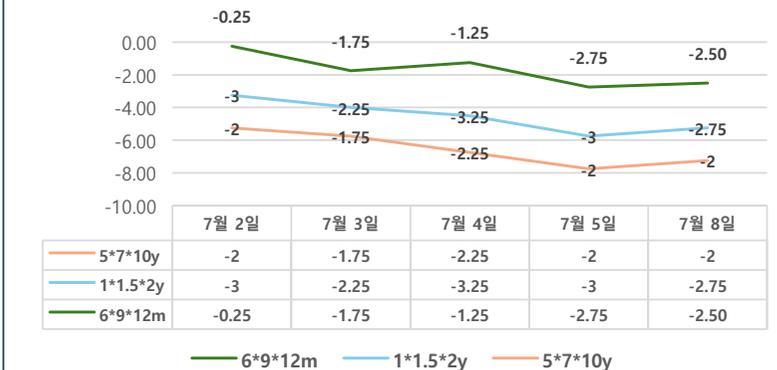
구분	증가	전일대비
1*2y	-16.25	-1.25
1*3y	-22.50	-1.75
2*5y	-10.00	-1.25
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	3.00	0.50
10*20y	-11.75	-0.75

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.50	0.25
1*1.5*2y	-2.75	0.25
2*5*10y	-13.00	-1.75
5*7*10y	-2.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY

