

Market Daily Report



2024.07.10(수)

레포	지준 잉여 마감 우려 확대됨에 따라 은행권 운용에 적극적이었으며, 장 초반 체결금리 급락하였음. 운용금리 낮아 장 중 추가 매수 제한적이었고, 조달수요도 많지 않아 막판까지 소강상태 유지되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 장기 중심 하락 마감. 금통위를 앞두고 열린 국회 업무보고에서 금리 인하 기대감이 이어졌으며 외국인 국채선물 순매수가 이어지며 강세 분위기 견인함. 미국 : 미국 채권 금리는 혼조세 마감. 2년물 국채 금리는 0.3bp 하락하였으나 10년물 국채 금리는 1.6bp 상승함. 파월 의장은 의회 증언에서 "향후 움직임의 시기에 대한 어떠한 이야기도 하지 않을 것"이라는 발언에 금리 인하 시점에 대한 힌트를 기대했던 시장은 실망하며 2년물 제외 약세장 형성함.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 SOFR 금리 1년물이 추가로 3bp 하향 조정 되면서, 1년물 대만계 렌더 오퍼도 5.40 에서 5.38로 제시 중이며, 카운터 비드가 한국계 및 포린 네임으로 5.28-5.33 수준으로 1yr SOFR +25-30bp 반영된 수준으로 호가 제시 중. 중국계 네임의 1년물 호가는 5대 은행 기준 5.55-5.65 수준, 그외 스몰 네임은 5.65-5.70 사이로 레벨 형성 되면서 네임별 센터별 일부 차등을 보이고 있음. FX 스왑도 장기를 위주로 가격이 올라오면서, 3개월-1년물 스왑 환산 달러 금리도 머니 시장과 같이 하락세를 보였음.
FX SWAP	FX스왑포인트는 장기물을 중심으로 대체로 상승했으며, 1년 만기 스왑프는 전장보다 30전 오른 -2830전, 6개월 만기는 보험권을 유지하며 전장과 동일하게 -1440전에 증가를 형성함. 오는 9월 미국 금리인하 가능성을 반영해 미국 금리가 더 오르는 쉽지 않다는 기대감이 모이는 것으로 풀이되고 있으며, 한미 금리 격차가 조금씩 완화 되는 분위기가 조성되고 있음. 초단기는 이른가 아래에서 거래되고 밀리는 분위기였으며, 내일 벨류 기준일에 대한 자금수요가 있는 것으로 판단됨
IRS	전일 irs는 금통위를 대기하면서 이창용 총재의 국회 보고를 소화하는 분위기 속에 단기쪽은 소폭 상승, 나머지 구간에서는 하락 마감하며 혼조세를 보임. 초반에 6*9개월이 -10에 d/nd로 초이스를 이뤘고 -10에 nd로 거래되었으며, 양도성예금증서(cd)의 영향으로 단기쪽 호가가 형성되어 6,9개월 비드가 꾸준히 보였음. 막판에는 비드 레벨이 올라오는 장세로 1년이 35.25, 1.5년이 25, 2년이 17.5까지 올라옴. 마감 이후에는 3년이 11.5/11.25를 이루다 11.5에 거래가 이뤄졌고 6개월 50.5/50.25, 6*9개월 -9 비드가 나옴. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.56이 고시됨.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	단위 : 조 원	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp
							금리	전일대비	
2024.07.03(수)	214.3	203.8	3.40%	3.504%			2년물	4.628%	-0.3
2024.07.04(목)	217.9	204.1	3.43%	3.514%			5년물	4.244%	0.2
2024.07.05(금)	213.0	204.1	3.55%	3.538%	3.500%		10년물	4.298%	1.6
2024.07.08(월)	207.6	203.2	3.50%	3.498%			30년물	4.490%	2.3
2024.07.09(화)	207.3		3.45%	3.440%			10Y-2Y	-33	1.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,867.38	9.62	54.03.10	국고 24-2	1,034	여전채 1,400	은행채 4,700	통안채 1년물 6,000
KOSDAQ	860.42	1.15	26.06.10	국고 16-3	700	회사채 1,280	여전채 1,400	채정증권 63일물 10,000
달러-원	1,383.50원	0.40원	26.03.10	국고 24-3	650	공사채 1,000	회사채 650	
국고3Y	3.114%	-0.5	25.07.02	통안채	-300		공사채 600	
국고10Y	3.191%	-2.1	25.09.10	국고 20-6	-735			
국고10Y-3Y	7.7	-1.6	43.09.10	국고 23-9	-999			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.37	5.30	5.34	-0.01	O/N	5.36	5.32	5.34	0.00
TN	5.38	5.31	5.35	-0.01	TN	5.37	5.32	5.35	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.43	5.35	5.40	0.00
1S	5.52	5.42	5.47	-0.01	1S	5.55	5.45	5.51	0.00
3S	5.60	5.50	5.55	0.00	3S	5.70	5.55	5.60	-0.02
6S	5.65	5.50	5.57	-0.01	6S	5.70	5.55	5.63	-0.02
1YR	5.47	5.32	5.39	-0.03	1YR	5.70	5.55	5.60	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.58	0.00	3.50	5.32000	1M MAR	-238	-234
TN	-9/-7	-8	5.58	0.00	3.50	5.32020	1W*1S	-195	-188
1W	-56/-52	-54	5.51	0.00	3.50	5.32138	1*2	-220	-210
1S	-250/-240	-245	5.50	-0.02	3.49	5.32631	1*3	-447	-440
3S	-710/-690	-700	5.48	-0.04	3.47	5.30463	1*6	-1185	-1160
6S	-1480/-1400	-1440	5.51	-0.05	3.44	5.21446	1*9	-1890	-1860
1YR	-2860/-2800	-2830	5.47	-0.05	3.34	4.97128	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)

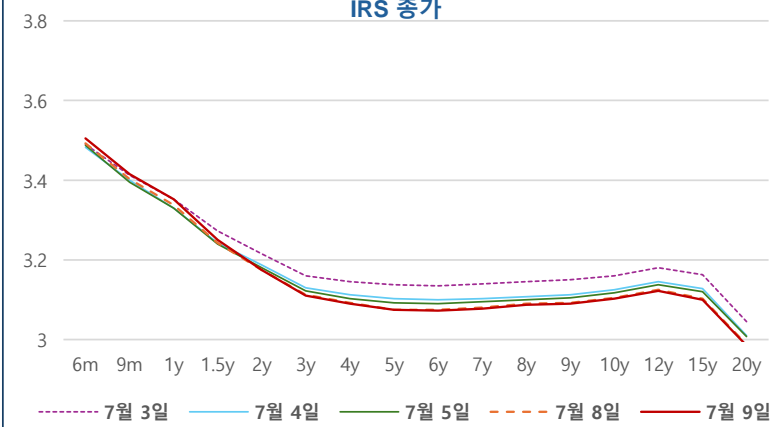
IRS 데일리 증가

7월 9일

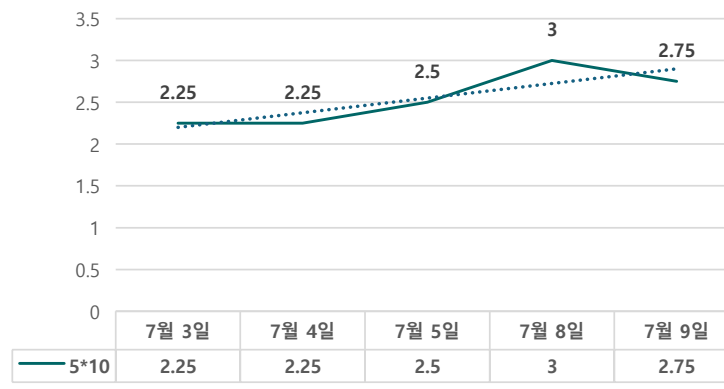
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5050	1.25
9m	3.4150	1.25
1y	3.3525	1.50
1.5y	3.2500	0.75
2y	3.1750	0.00
3y	3.1100	-0.25
4y	3.0900	-0.25
5y	3.0750	0.00
6y	3.0725	-0.25
7y	3.0775	-0.25
8y	3.0875	-0.25
9y	3.0900	-0.25
10y	3.1025	-0.25
12y	3.1225	-0.25
15y	3.1000	-0.25
20y	2.9850	-0.25

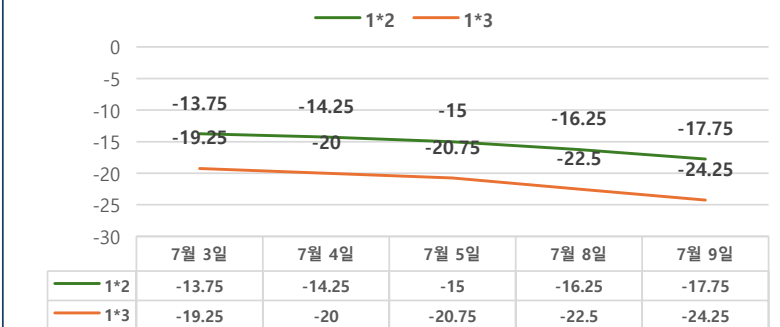
IRS 증가



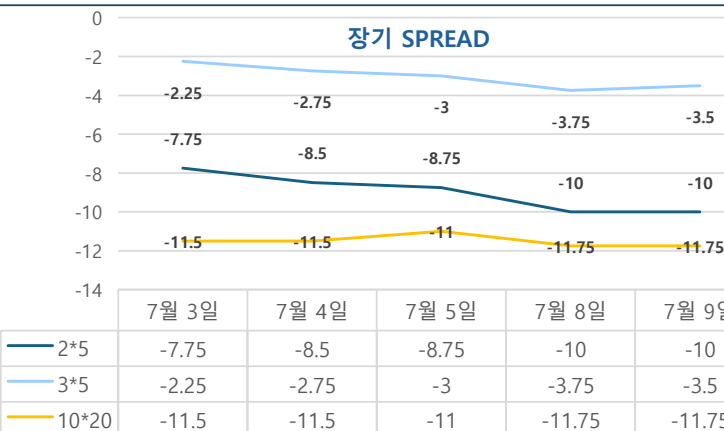
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

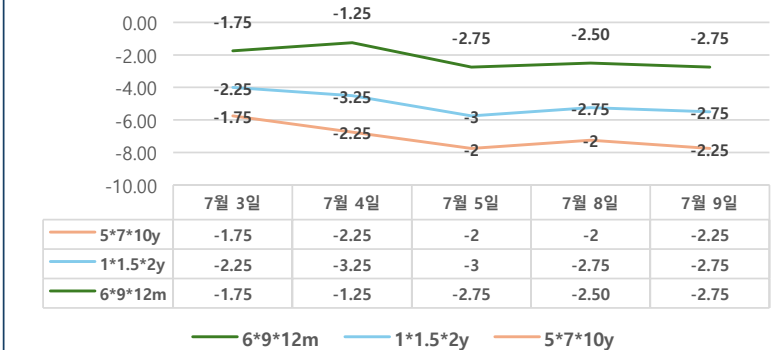


IRS 주요 커브

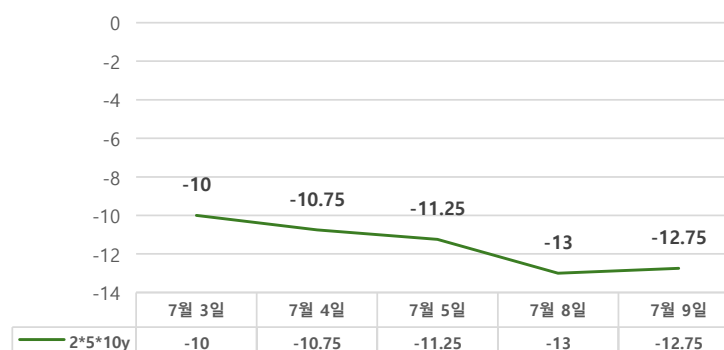
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.75	-1.50
1*3y	-24.25	-1.75
2*5y	-10.00	0.00
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	2.75	-0.25
10*20y	-11.75	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	-0.25
1*1.5*2y	-2.75	0.00
2*5*10y	-12.75	0.25
5*7*10y	-2.25	-0.25