

Market Daily Report



2024.07.16(화)

레포	건보자금 및 재정 유입 예정되어 있어 시작금리 소폭 하락 출발했으며, 조달여건 양호해 일찌감치 매도 해소되었음. 일부 시은 저금리 조달에 나섰으나 장 중 잉여세 크지 않아 거래 제한적이었고, 기일물 금리 기준금리를 소폭 상회하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 중단기 중심으로 하락 마감. 외국인인 대거 매수하며 강세였으나 장기 구간은 트럼프의 피격 소식과 국고채 10년 입찰을 소화하며 상대적으로 약한 모습. 미국 : 미국 국채 금리는 상승 마감. 파울 연준 의장이 경제클럽 컨퍼런스에 참석해 "인플레이션이 목표치인 2%에 도달할 때까지 금리 인하를 기다리지 않을 것."이라고 발언하며 9월 금리 인하 기대감은 더욱 높아졌음에도 트럼프 당선 시 인플레이 재정책에 대한 우려로 증장기물은 금리 상승폭이 더 커졌으며 2년물은 약보합세로 마감.
MONEY	금일 일본 휴장이었으나 BOJ가 전주 엔화 매수 개입과 일본의 금리 인상 가능성을 시장에서는 높게 예상하고 있어, 달러/엔 환율도 157엔대로 엔화 강세를 보였음. 반면, 중국은 국채를 매입하는 금융 기관들의 위안화 구매에도 관해 강한 비판을 제시 하였고, 6월 중국 지표가 둔화하면서 디플레이션 우려가 재부각 되었으나, 위안화 약세 우려로 중국 당국은 부양책을 적극적으로 제시 할 수 없는 상황. 금일 PBOC 가 역RP 를 통해서 유동성을 공급했으나, 역외 홍콩 시장 위안화 유동성이 타이트 해 usd/cnh 스왑이 크게 오르면서 오버나잇-1개월물까지 레벨 급등세를 보이며, 위안화 오버나잇 5.00% 까지 제시 되는 등 장중 변동성이 컸던 하루. 금일 달러 머니 시장은 전주에 이어 여전히 호가가 많지 않고, 비드-오퍼간의 레벨 갭차로 거래가 한산한 가운데, 역외 포린 은행들간 런던 시장 오픈하면서 1년물 위주로 호가가 제시 되면서 1년물 5.15-5.25 사이로 타네임 대비 거래가 좀더 활발했던 장세를 보였음.
FX SWAP	외환(FX) 스와프포인트는 도널드 트럼프 전 대통령의 피격 이슈를 소화하며 대체로 약보합세를 나타냈으며, 1년 만기는 전장보다 10전 내린 -2700전, 6개월 만기도 10전 내린 -1410전에 증가를 형성함. 이날 시장은 전반적으로 무거운 흐름을 유지했으며 달러가 전일 대비 강세로 돌아보니 현물환은 위로 오르고 FX스와프는 아래로 밀리는 장세를 보였음.
IRS	전일 IRS는 도널드 트럼프 전 미국 대통령 피격 사건의 영향을 받아 장기는 오를 반면 단기는 내리가는 모습을 보임. 주말 사이 트럼프 전 대통령이 유세 도중 총격을 받는 사건이 일어났으며, 이번 사건이 트럼프 대통령의 대선 당선 확률을 한층 더 높일 것으로 평가되면서 장기쪽으로 크게 영향을 줌. 중단기구간은연방준비제도(Fed. 연준)의 금리 인하 기대가 커짐에 따라 이에 영향을 받음. 한때 트럼프 사건의 영향으로 미국채가 큰 폭으로 움직이는 모습을 보였으며, 장 막판에 6*12개월 오퍼가 내려오면서 단기쪽 커브가 움직였으며, 2년 비드가 나오면서 14에 거래가 이뤄졌으며, 이후 오퍼가 계속 내려오면서 12.75-12.25까지 거래됨. 장 마감 후에도 2년 오퍼가 더 강하게 내려오면서 12까지 오퍼가 나오는 모습을 보였으며, 1년과 9개월 비드가 나오면서 1년은 39, 9개월은 38.5-38.25레벨에 거래가 몇차례 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	물금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
						단위 : 조 원			
						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.07.09(화)	207.3	204.3	3.45%	3.440%	3.500%	3.56%	2년물	4.460%	0.6
2024.07.10(수)	208.6	203.3	3.45%	3.475%		3.55%	5년물	4.134%	3.1
2024.07.11(목)	207.6	205.5	3.48%	3.528%		3.55%	10년물	4.231%	4.7
2024.07.12(금)	209.6	206.5	3.50%	3.528%		3.55%	30년물	4.459%	6.1
2024.07.15(월)	207.1		3.48%	3.509%		3.54%	10Y-2Y	-22.9	4.1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
금두립 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
KOSPI	2,860.92	3.92	24.10.15	통안채	1,100	은행채 2,100	은행채 7,200	국고채 30년 4,000 교환
KOSDAQ	852.88	2.51	54.03.10	국고 24-2	600	회사채 501	여전채 400	통안채 22,000 조기환매
달러-원	1,383.20원	7.40원	26.03.10	국고 24-3	600	통안채 5,700	회사채 1,300	
국고3Y	3.076%	-2.5	30.12.10	국고 20-9	-10	공사채 3,300	통안채 7,000	
국고10Y	3.177%	0	29.03.10	국고 24-1	-14		공사채 2,000	
국고10Y-3Y	10.1	2.5	25.06.10	국고 22-4	-700			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : %, %p									
O/N	5.38	5.31	5.35	0.00	O/N	5.35	5.30	5.33	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.36	5.31	5.34	0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.42	5.35	5.38	0.00
1S	5.51	5.41	5.46	-0.01	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.56	5.46	5.51	-0.02	3S	5.65	5.50	5.58	-0.02
6S	5.63	5.48	5.55	-0.02	6S	5.65	5.50	5.60	0.00
1YR	5.43	5.28	5.35	-0.03	1YR	5.55	5.40	5.50	-0.03

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
						단위 : 전, % p			
						단위 : 전			
O/N	-9/-7	-8	5.58	0.07	3.50	5.34000	1M MAR	-243	-241
TN	-9/-7	-8	5.58	-0.01	3.50	5.33963	1W*1S	-198	-194
1W	-59/-55	-57	5.63	0.07	3.50	5.33741	1*2	-235	-225
1S	-250/-270	-260	5.54	0.02	3.48	5.32780	1*3	-440	-430
3S	-720/-700	-710	5.50	0.00	3.47	5.28611	1*6	-1140	-1130
6S	-1450/-1390	-1420	5.51	0.02	3.44	5.16480	1*9	-1790	-1780
1YR	-2750/-2650	-2700	5.37	0.00	3.34	4.86554	1*12	-2390	-2380

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 / 12.17~12.18D
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 15일

단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4650	-0.25
9m	3.3675	-1.25
1y	3.2975	-2.25
1.5y	3.2025	-2.00
2y	3.1300	-2.00
3y	3.0600	-1.75
4y	3.0475	-1.00
5y	3.0400	-0.25
6y	3.0400	0.00
7y	3.0500	0.50
8y	3.0575	0.50
9y	3.0625	0.75
10y	3.0775	0.75
12y	3.0975	0.75
15y	3.0725	0.75
20y	2.9675	0.75

IRS 주요 커브

SPREAD

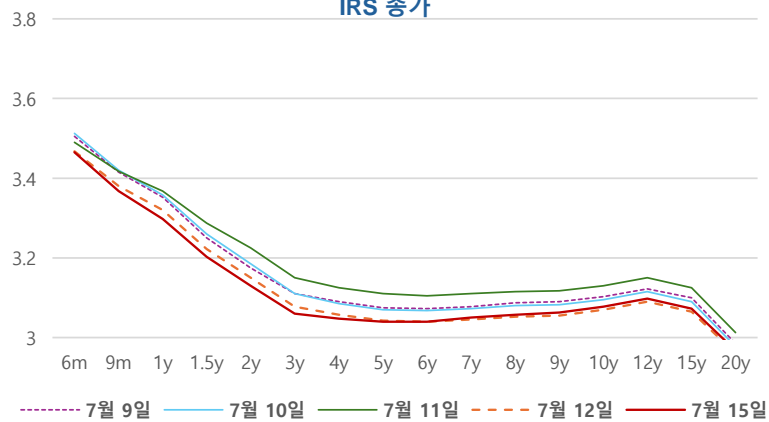
구분	증가	전일대비
1*2y	-16.75	0.25
1*3y	-23.75	0.50
2*5y	-9.00	1.75
3*5y	-4.00	1.50
5*10y	3.75	1.00
10*20y	-11.00	0.00

IRS 주요 커브

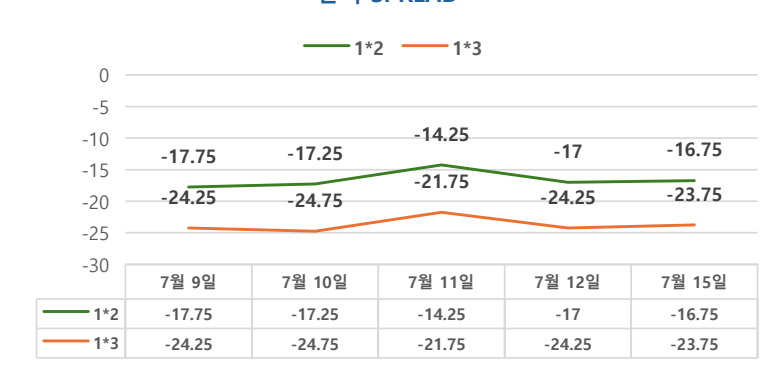
FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	0.00
1*1.5*2y	-2.25	0.25
2*5*10y	-12.75	0.75
5*7*10y	-1.75	0.50

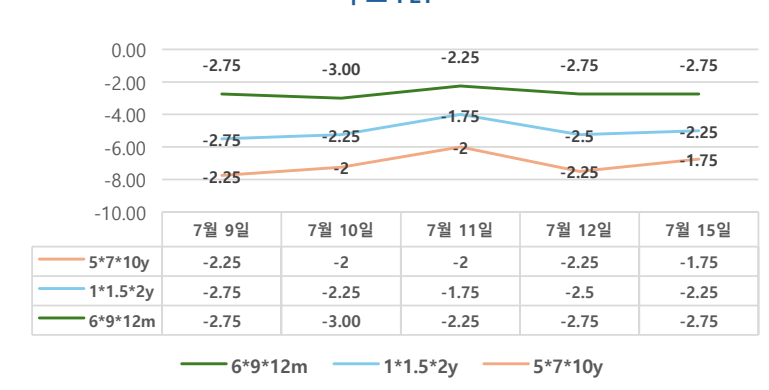
IRS 증가



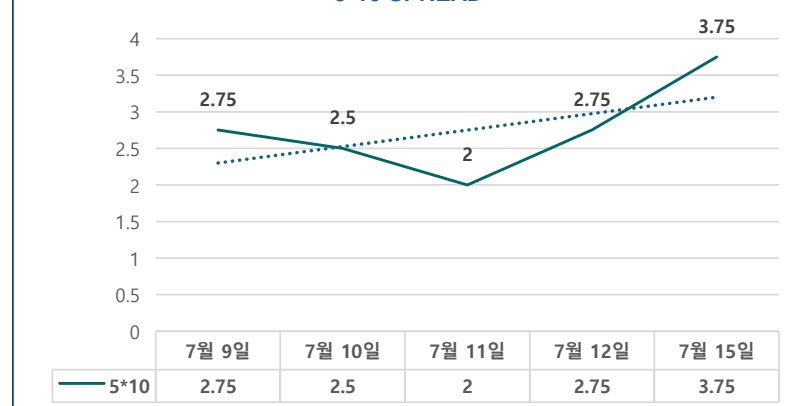
단기 SPREAD



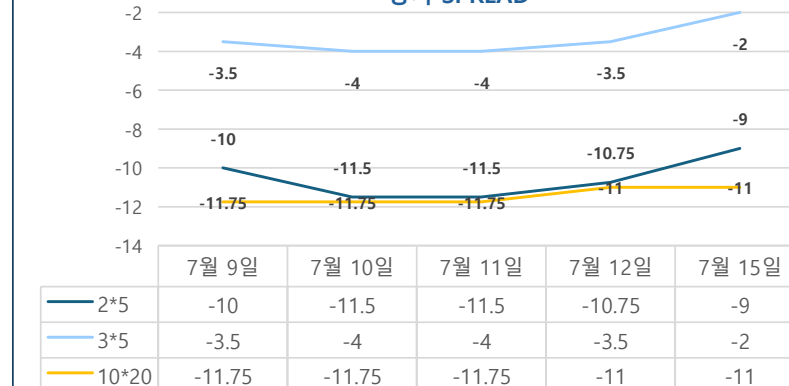
주요 FLY



5*10 SPREAD



장기 SPREAD



2*5*10y FLY

