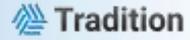


Market Daily Report



2024.07.17(수)

레포	건보자금 및 공차기금 유입 이어져 시장 유동성 풍부했으며, 조달금리 급락했음에도 매도 해소 원활하였음. 장 초반 시중은행 저금리 조달에 집중했으나 오후에 차레로 시작금리 매도로 전환하여 막판 수급 빠듯하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 중단기 금리가 장기 금리보다 더 하락하며 커브 스티프닝 발생함. 당분간 외국인 이끄는 강세장 이어질 것으로 전망됨. 미국 : 미국 국채 금리는 하락 마감. 6월 소매판매는 전월 대비 동일. 근월 소매판매는 전월 대비 0.4% 증가하며 각각 예상치를 상회. 예상보다 견고한 소비에 금리 낙폭을 줄였으나 연내 2번 이상의 금리 인하 기대감으로 인한 매수세가 우위를 보이며 강세장을 형성함. 대신 리스크보다 당장의 기준 금리 인하에 시장은 초점을 두는 모습임.
MONEY	금일 머니 시장은 여름 휴가철과 금리 인하 가능성이 맞물리면서 대출 자산 규모도 감소하고, 은행별 포지션 제한으로 시장 차입 물량 또한 감소하면서 비드가 귀한 장세 지속. 역외 시장에서 o/n -1yr 전테너 오퍼가 지속적으로 제시 되고 레벨도 점증적으로 하향 조정 되고 있으나, 차입 수요 부재로 실거래는 매우 제한적인 상황. 온쇼 시은 자금은 최근 자금 변동성 확대로 보수적 관리 속에 워크몰과 1개월물 이내 구간 운용 인트만 제시 되고 있음. 중국 인민은행이 중기유동성 MLF 규모를 점진적으로 줄일 것이라는 보도로 향후 시중의 유동성 축소 기조로 이어 갈 것이라는 예상으로 어제에 이어 금일 역외 위안화 금리는 오버나잇 5.50 까지 급등세를 보였으며, 오버나잇 -1개월물 역외 CNH 레벨 변동성이 컸던 하루.
FX SWAP	외환스와프포인트는 1년물을 제외하고 대부분 약세를 나타냈으며, 1년 만기는 전장보다 10전 오른 -2690전, 6개월물은 30전 내린 -1450전에 증가를 형성함. 전반적으로 시장에 원화 유동성이 풍부한 분위기 속에 탐백이나 1주일 이내 초단기가 무거워보였으며, 1년이 지지되고 있지만 짧은 테너로 갈수록 하방 압력이 있는 것으로 분석됨.
IRS	전일 IRS는 외국인의 금리 하락 베팅이 지속되는 가운데 하락 마감. 전체적으로 외국인의 금리 인하 베팅이 이어지면서 이에 영향을 받아 움직이는 모습을 보였으며, 단기 쪽으로 시장에서 호가가 많이 형성되는 분위기를 뒀. 6*12개월 오퍼가 내려오고, 1년과 2년쪽으로 비드가 올라오면서 1년이 26.5-27레벨에 몇차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에 6년이 00 오퍼까지 내려왔으며, 6*9개월이 -10.75/-11로 대체되다 -11에 거래됐으며, 3년 비드가 올라오면서 1.75-1.5에 거래됨. 장 마감 후에는 ND로 4년이 0.75오퍼까지 내려오는 모습을 보임. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.55에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.07.10(수)	208.6	203.3	3.45%	3.475%	3.500%	3.55%	2년물	4.421%	-3.9
2024.07.11(목)	207.6	205.5	3.48%	3.528%		3.55%	5년물	4.075%	-5.9
2024.07.12(금)	209.6	206.5	3.50%	3.528%		3.55%	10년물	4.159%	-7.2
2024.07.15(월)	207.1	205.8	3.48%	3.509%		3.54%	30년물	4.374%	-8.5
2024.07.16(화)	214.3		3.40%	3.483%		3.50%	10Y-2Y	-26.2	-3.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,866.09	5.17	54.03.10	국고 24-2	1,191	은행채 3,000	은행채 8,800	통안채 3년물 13,000
KOSDAQ	839.61	-13.27	29.03.10	국고 24-1	538	여전채 2,850	여전채 1,200	재정증권 63일물 10,000
달러-원	1,385.00원	1.80원	32.06.10	국고 22-5	19	회사채 40	회사채 1,322	
국고3Y	3.035%	-4.1	25.04.24	산금채	-600	공사채 3,600	공사채 3,300	
국고10Y	3.137%	-4	25.06.08	중금채	-600			
국고10Y-3Y	10.2	0.1	25.06.11	중금채	-1,000			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	0.01	O/N	5.35	5.30	5.33	0.00
TN	5.40	5.33	5.37	0.01	TN	5.36	5.31	5.34	0.00
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	0.00	1S	5.52	5.42	5.47	-0.01
3S	5.56	5.46	5.51	0.00	3S	5.65	5.45	5.55	-0.03
6S	5.61	5.46	5.53	-0.02	6S	5.65	5.45	5.58	-0.02
1YR	5.41	5.26	5.33	-0.02	1YR	5.55	5.40	5.50	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	5.34000	1M MAR	-236	-234
TN	-10/-8	-9	5.58	0.00	3.50	5.33983	1W*1S	-192	-187
1W	-59/-55	-57	5.62	-0.01	3.50	5.33882	1*2	-237	-233
1S	-255/-245	-250	5.60	0.07	3.48	5.33459	1*3	-460	-450
3S	-740/-700	-720	5.50	-0.01	3.46	5.28577	1*6	-1185	-1175
6S	-1480/-1420	-1450	5.47	-0.03	3.44	5.15058	1*9	-1795	-1775
1YR	-2740/-2640	-2690	5.36	-0.02	3.33	4.83577	1*12	-2410	-2390

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 16일

단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4575	-0.75
9m	3.3500	-1.75
1y	3.2725	-2.50
1.5y	3.1650	-3.75
2y	3.0875	-4.25
3y	3.0175	-4.25
4y	3.0075	-4.00
5y	3.0000	-4.00
6y	3.0000	-4.00
7y	3.0125	-3.75
8y	3.0225	-3.50
9y	3.0275	-3.50
10y	3.0425	-3.50
12y	3.0625	-3.50
15y	3.0375	-3.50
20y	2.9325	-3.50

IRS 주요 커브

SPREAD

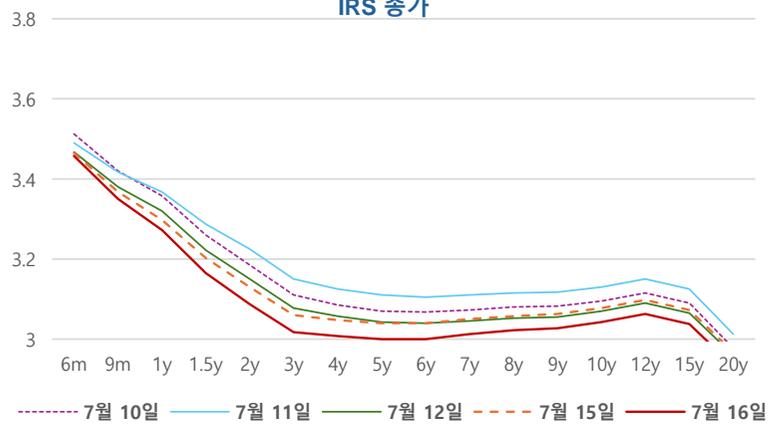
구분	증가	전일대비
1*2y	-18.50	-1.75
1*3y	-25.50	-1.75
2*5y	-8.75	0.25
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	4.25	0.50
10*20y	-11.00	0.00

IRS 주요 커브

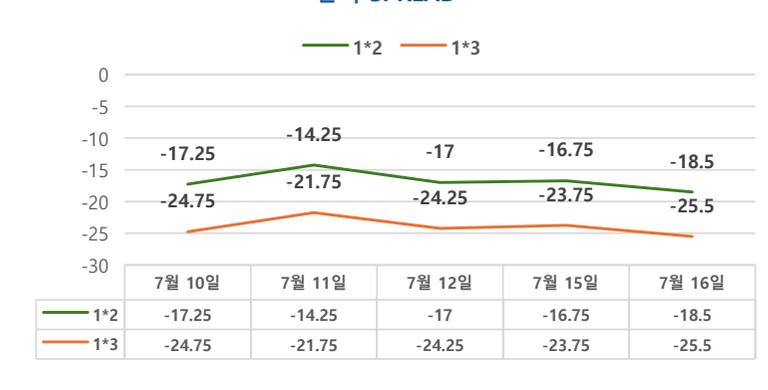
FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.00	-0.25
1*1.5*2y	-3.00	-0.75
2*5*10y	-13.00	-0.25
5*7*10y	-1.75	0.00

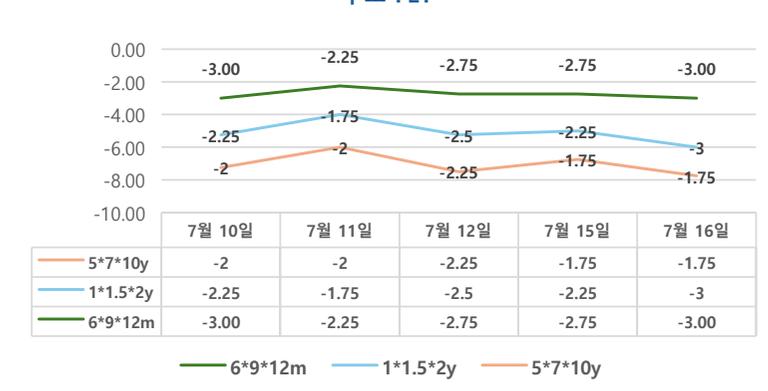
IRS 증가



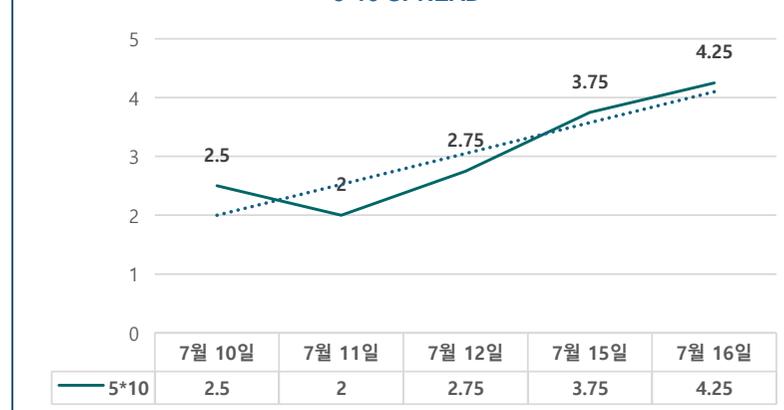
단기 SPREAD



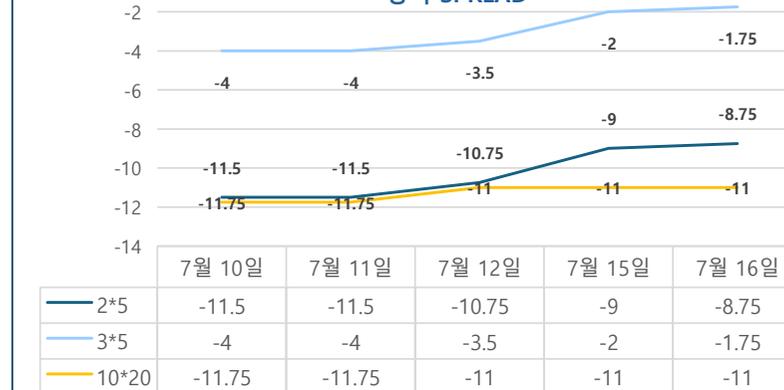
주요 FLY



5*10 SPREAD



장기 SPREAD



2*5*10y FLY

