

Market Daily Report

2024.07.18(목)



레포	전일의 빠듯했던 장세 반영되어 조달금리 상승했음에도 은행권 매도 꾸준하여 잉여자금 일시에 소진되었음. 시중은행 및 증권사 추가 매도 이어졌으나 장 중 자금 유입 크지 않아 거래 정체되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 혼조 마감. 초장기 구간은 금리가 하락하였으나 3년 등 중단기 구간을 중심으로 금리는 소폭 상승함. 외국인 투자자는 대규모 국채선물 순매수를 이어감. 미국 : 미국 국채 금리는 10년물 제외 상승 마감. 채권시장을 움직일 만한 특별한 재료는 없던 가운데 전일 국채 금리가 대폭 하락한 이후 숨고르기에 들어가는 모습. 또한 미국 6월 산업생산과 6월 주택착공건수가 각각 예상치를 상회한 점도 경기 둔화에 대한 우려를 줄이며 국채 금리 상승에 영향을 준 것으로 풀이됨.
MONEY	금일 머니 시장은 어제에 이어 중국계 홍콩 센터 BIG 렌더의 1년물 오퍼가 시장에 등장하면서 유럽계 네임 은행들의 비드가 탄력을 받았음. 유럽계 네임별로 1년물 5.10-5.20 사이로 일부 체결 소식 전해졌고, NEXT 대만계 오퍼로 한국계에 1년물 5.25 오퍼가 제시 되면서 SOFR 금리 감안 45bp 반영된 금리로 유럽계 네임과 10bp 가량 레벨갭을 두고 있음. 금리 인하 시점에 장기 편당에 부담스러운 면이 있어 일부 네임을 제외하면 거래는 제한적인 상황.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 대규모 에셋스와프 물량 출회로 전 구간 하락하면서 마감했으며, 1년 만기는 전장보다 30전 하락한 -2730전, 6개월물은 10전 내린 -1460전에 증가를 형성함. 15시 30분 이후에도 시중은행 오퍼가 출현하는 등 에셋스와프 네고물량이 다 처리되지 않은 것으로 판단되며, 내일도 이와같은 수급상 에셋 우위로 인해 스와프레벨은 하락압력이 지속될 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 국채선물 변동성이 크진 않았지만, 장 막판에 밀리면서 이에 연동되어 움직이는 모습을 보임. 초단기 쪽으로 호가가 형성되면서 6*9개월스프레드로 얹여 6개월이 46.75, 9개월이 36.25에 거래됐으며, 장 막바지에는 전체적으로 비드가 소폭 올라오는 분위기를 띠며, 장 막판에 9개월이 37에 초이스 됐다 거래됐으며, 2년 비드가 올라오면서 11에 몇차례 거래가 이뤄짐. 3년이 04/3.5에서 3.75에 거래됐으며, 3*5년 비드가 다소 강하게 올라오면서 -2.75에 거래됨에 따라 커브레벨이 움직임. 미국채와 연동되면서 장 마감 후 5년이 0.5/0.25에 대치되다 0.5에 초이스를 이룬 후 거래됐으며, 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.54이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.07.11(목)	207.6	205.5	3.48%	3.528%	3.500%	3.55%	2년물	4.440%	1.9
2024.07.12(금)	209.6	206.5	3.50%	3.528%		3.55%	5년물	4.079%	0.4
2024.07.15(월)	207.1	205.8	3.48%	3.509%		3.54%	10년물	4.159%	0
2024.07.16(화)	214.3	209.4	3.40%	3.483%		3.55%	30년물	4.376%	0.2
2024.07.17(수)	217.5		3.45%	3.517%		3.54%	10Y-2Y	-28.1	-1.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부담 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,843.29	-22.80	25.06.10	국고 15-2	600	은행채 6,500	은행채 6,800	
KOSDAQ	829.41	-10.20	34.06.10	국고 24-5	574	여전채 3,550	여전채 1,250	
달러-원	1,381.30원	-3.70원	29.03.10	국고 24-1	519	회사채 2,000	회사채 500	
국고3Y	3.050%	1.5	25.09.03	통안채	-200	공사채 4,800	공사채 1,600	
국고10Y	3.139%	0.2	25.09.10	국고 23-8	-260			
국고10Y-3Y	8.9	-1.3	25.10.24	산금채	-400			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : %, %p									
O/N	5.38	5.31	5.35	-0.01	O/N	5.35	5.30	5.33	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	-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	5.39	0.01
1S	5.51	5.41	5.46	0.00	1S	5.52	5.42	5.46	-0.01
3S	5.55	5.45	5.50	-0.01	3S	5.65	5.45	5.55	0.00
6S	5.59	5.44	5.51	-0.02	6S	5.65	5.45	5.58	0.00
1YR	5.38	5.23	5.30	-0.03	1YR	5.50	5.35	5.45	-0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
O/N	-8/-6	-7	5.33	-0.25	3.50	5.34000	1M MAR	-238	-236
TN	-9/-7	-8	5.59	0.01	3.50	5.33981	1W*1S	-190	-184
1W	-59/-55	-57	5.63	0.01	3.50	5.33864	1*2	-242	-232
1S	-250/-240	-245	5.55	-0.05	3.48	5.33399	1*3	-482	-472
3S	-750/-710	-730	5.52	0.02	3.46	5.27924	1*6	-1215	-1190
6S	-1500/1420	-1460	5.55	0.08	3.44	5.12855	1*9	-1855	-1805
1YR	-2800/2700	-2750	5.40	0.04	3.33	4.80059	1*12	-2470	-2420

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)

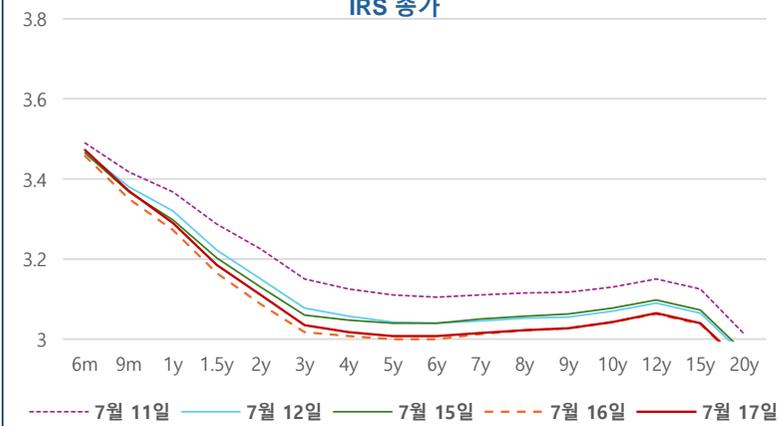
IRS 데일리 증가

7월 17일

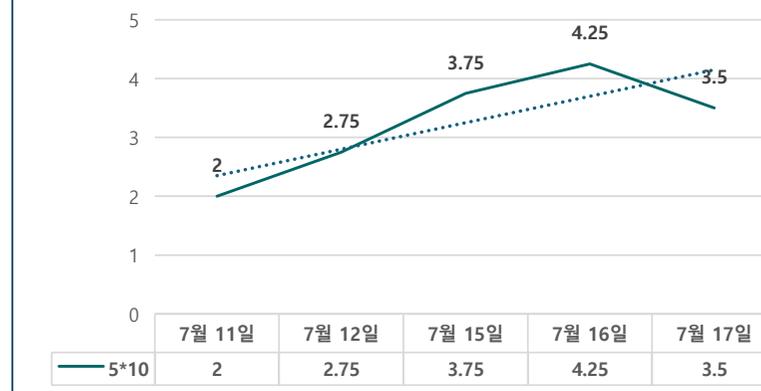
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4725	1.50
9m	3.3700	2.00
1y	3.2900	1.75
1.5y	3.1850	2.00
2y	3.1100	2.25
3y	3.0350	1.75
4y	3.0175	1.00
5y	3.0075	0.75
6y	3.0075	0.75
7y	3.0150	0.25
8y	3.0225	0.00
9y	3.0275	0.00
10y	3.0425	0.00
12y	3.0650	0.25
15y	3.0400	0.25
20y	2.9350	0.25

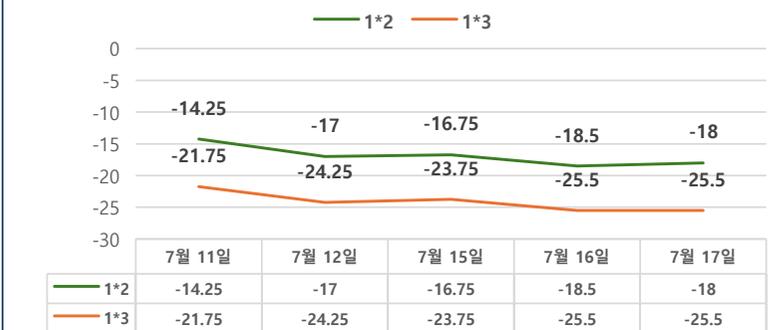
IRS 증가



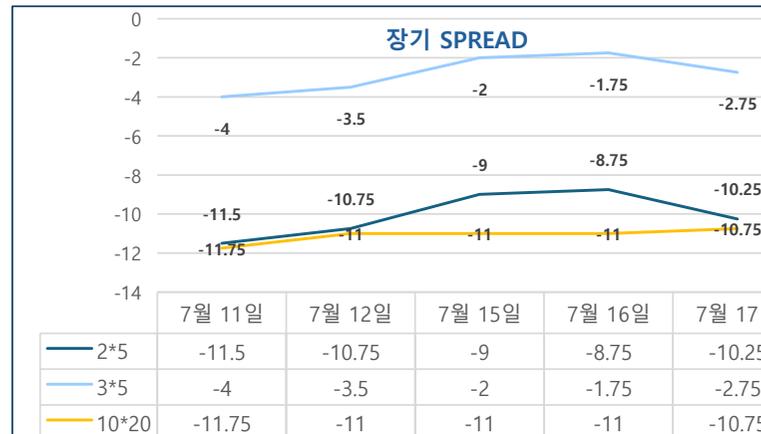
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

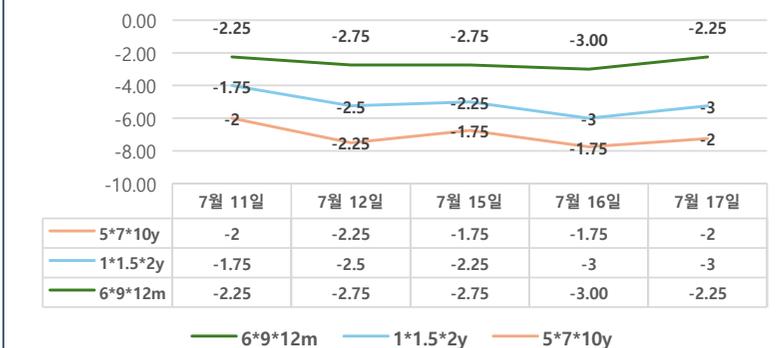
구분	증가	전일대비
1*2y	-18.00	0.50
1*3y	-25.50	0.00
2*5y	-10.25	-1.50
3*5y	-4.00	-1.00
5*10y	3.50	-0.75
10*20y	-10.75	0.25

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.25	0.75
1*1.5*2y	-3.00	0.00
2*5*10y	-13.75	-0.75
5*7*10y	-2.00	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

