

Market Daily Report



2024.07.22(월)

레포	전반적인 유동성 풍부한 가운데 공모주 산일전기 청약자금 운용될 것으로 예상되며, 시작금리에 따라 시은 조달 수요 가변적일 것으로 보임. [공모주] 산일전기 모집 7.18~7.19 환불 7.23 미래(16.35조), 삼성(0.53조)
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 장중 별다른 재료가 없던 가운데 글로벌 금리가 소폭 오른 가운데 레벨 부담에 조정 분위기가 이어짐. 미국 : 미국 국채 금리는 상승 마감. 연준이 9월 기준금리를 인하할 것이라는 기대감에 7월 들어 국채 금리가 급락한 뒤 조정을 계속 받는 모습. 17일 3월 이후 최저치까지 하락하였던 10년물 국채 금리는 이후 이틀간 8.2bp 상승, 2년물 국채 금리는 16일 4.421%로 마감 이후 3일간 9.4bp 상승함.
MONEY	월화 자금 임여가 커진 반면, 시중 은행들의 달러 자금은 타일 기초가 이어가면서 단기 스왑은 밀리고, 외화자금은 운소 오버나잇 처리 속도도 더뎠던 하루. 6월 거주자 외화예금이 반년만에 증가했다는 보도가 있었으나, 은행에서의 체감은 예수금 잔액이 전반적으로 줄어들면서 금리 인하 시준이지만 운용에는 적극적일 수 없는 상황으로 월말에 다가갈수록 자금 관리 및 비율 관리에 보수적인 입장. 한국계로 장기구간 오피 레벨이 마켓 금리 하락 분위기에 맞춰 하향 조정되고 있으나, 분기 커버 3개월물과 연말 커버 6개월물의 실차입은 한국계 리미트 제한으로 대만계나 중국계 수준까지 레벨이 맞춰져야 오피를 받을 수 있어 3개월물 5.53, 6개월물 5.49-5.50 수준의 오피 레벨만 확인.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 시장 유동성 저하 속에 대부분 만기에서 증가가 하락함. 1년 만기 스와프포인트는 전장보다 20전 내린 -2740전에서 증가가 형성되었고 6개월 만기는 전장과 동일한 -1460전 증가, 3개월 만기는 전장보다 5전 내린 -730전에서 증가가 형성됨. 큰 틀에서 무거운 흐름이 지속되고 있는 가운데 단기 상승분을 되돌리며 대부분 구간에서 보합 또는 하락세를 보임. 최근 6개월과 1년 같은 장기물에서의 유동성도 충분하지 않은 바 당분간 하락 추세는 지속될 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 국내외적으로 재료가 많지 않은 가운데 최근 금리 급락에 따른 레벨 부담이 많은 분위기를 보임. 장중 20*30년이 -24/-28 ND로 형성되고, 마켓에서 -28거래 소식이 들리면서 초장기 레벨이 움직였으며, 2*10년 스프레드가 -7.5에 거래가 이뤄짐. 막판에는 3년이 06, 10년이 6.25에서 5.5까지 오피가 내려오는 모습을 보였으며, 3*5년이 -3.75까지 비드가 올라오고 2*3년이 -7.5비드가 나오면서 레벨이 움직임. 장 마감 후에는 6*9*12개월 나비가 -1.25 비드가 나오고, 6*12개월 오피가 -12.25까지 내려옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.07.15(월)	207.1	205.8	3.48%	3.509%	3.500%	3.54%	2년물	4.515%	4.2
2024.07.16(화)	214.3	209.4	3.40%	3.483%		3.55%	5년물	4.171%	5.1
2024.07.17(수)	217.5	211.5	3.45%	3.517%		3.54%	10년물	4.241%	3.8
2024.07.18(목)	213.8	210.4	3.50%	3.523%		3.52%	30년물	4.449%	2.8
2024.07.19(금)	209.6		3.57%			3.52%	10Y-2Y	-27.4	-0.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,795.46	-28.89	54.03.10	국고 24-2	750	은행채 1,000	여전채 3,850	국고채 5년 8,000 선매출
KOSDAQ	828.72	6.24	33.06.10	국고 23-5	602	여전채 5,700	회사채 1,600	국고채 5년 11,000
달러-원	1,390.20원	6.80원	43.09.10	국고 23-9	230	회사채 3,070	공사채 2,500	통안채 91일물 5,000
국고3Y	3.074%	1.6	28.03.10	국고 23-1	-20			
국고10Y	3.156%	1.8	27.06.10	국고 17-3	-90			
국고10Y-3Y	8.2	0.2	25.07.02	통안채	-350			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	0.00	O/N	5.37	5.32	5.34	-0.01
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.36	5.31	5.35	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.42	5.35	5.39	-0.01
1S	5.52	5.42	5.47	0.01	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.58	5.48	5.53	0.03	3S	5.60	5.45	5.52	0.00
6S	5.58	5.43	5.50	0.00	6S	5.60	5.45	5.52	0.02
1YR	5.36	5.21	5.28	0.00	1YR	5.50	5.35	5.42	0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-23/-21	-22	5.41	-0.18	3.50	5.35000	1M MAR	-257	-254
TN	-9/-7	-8	5.59	-0.08	3.50	5.34984	1W*1S	-192	-188
1W	-59/-55	-57	5.63	0.04	3.50	5.34890	1*2	-240	-235
1S	-260/-240	-250	5.60	0.00	3.48	5.34513	1*3	-470	-460
3S	-750/-720	-735	5.57	0.03	3.46	5.28201	1*6	-1220	-1200
6S	-1500/1420	-1460	5.57	0.01	3.44	5.13575	1*9	-1850	-1830
1YR	-2780/2700	-2740	5.41	0.04	3.34	4.80556	1*12	-2475	-2445

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)

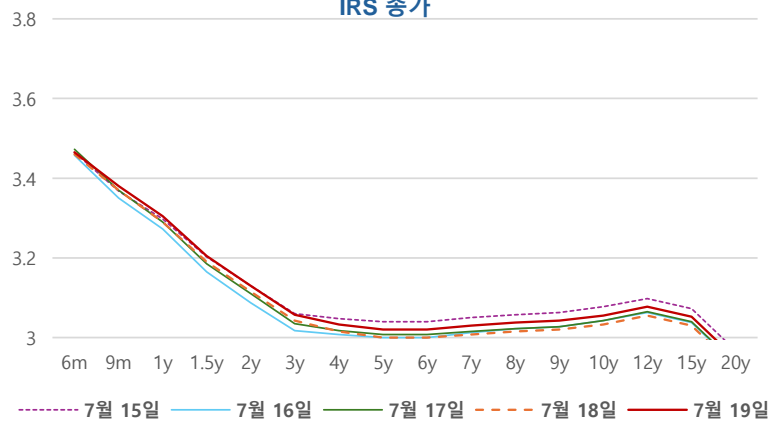
IRS 데일리 증가

7월 19일

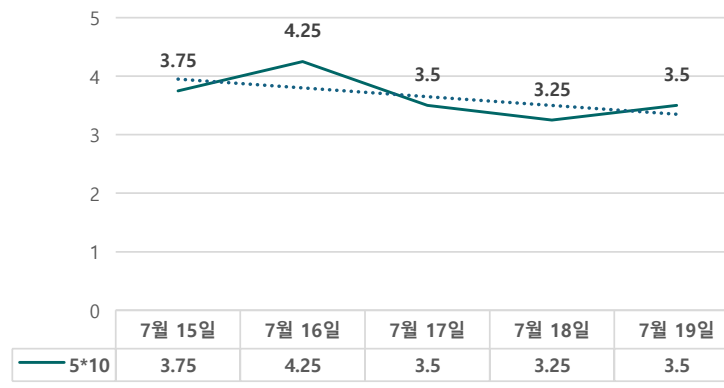
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4650	0.50
9m	3.3800	1.00
1y	3.3050	1.50
1.5y	3.2050	1.50
2y	3.1300	1.50
3y	3.0575	1.50
4y	3.0325	1.75
5y	3.0200	2.00
6y	3.0200	2.00
7y	3.0300	2.25
8y	3.0375	2.25
9y	3.0425	2.25
10y	3.0550	2.25
12y	3.0775	2.25
15y	3.0525	2.25
20y	2.9475	2.25

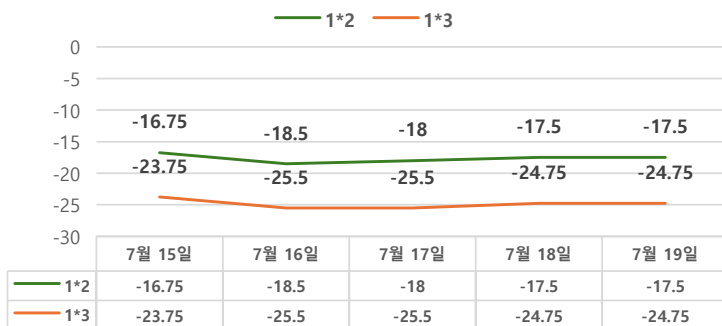
IRS 증가



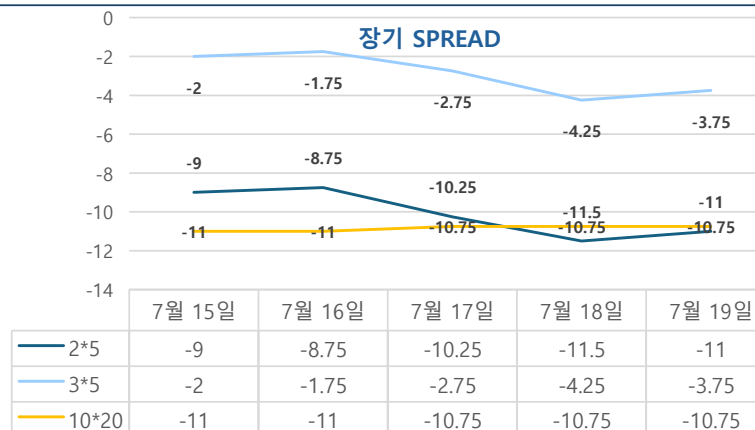
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

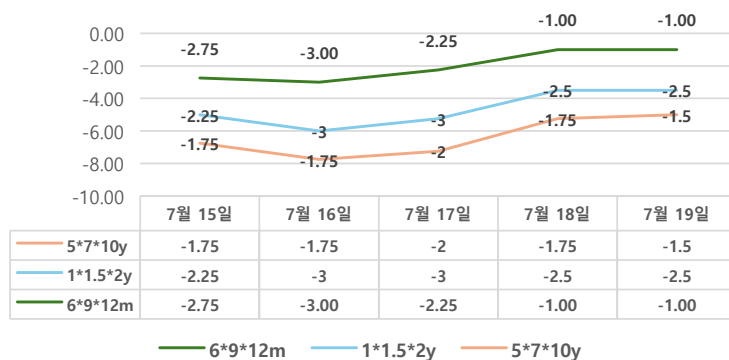


IRS 주요 커브

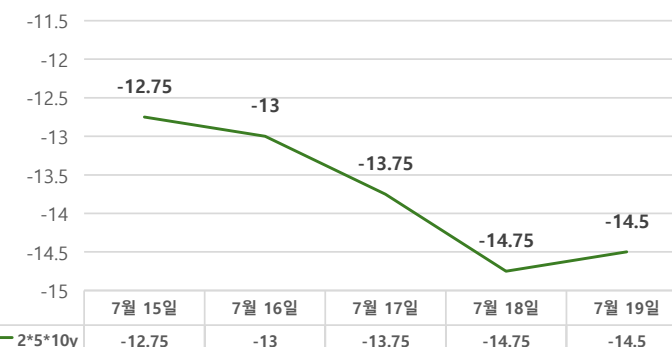
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.50	0.00
1*3y	-24.75	0.00
2*5y	-11.00	0.50
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	3.50	0.25
10*20y	-10.75	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.00	0.00
1*1.5*2y	-2.50	0.00
2*5*10y	-14.50	0.25
5*7*10y	-1.50	0.25