

Market Daily Report



2024.08.06(화)

레포	별다른 유동성 증가요인 없어 금리 보합 출발했으며, 시은 조달에 적극적으로 나서 매수 일시에 소진되었음. 장 중 은행 및 증권 조달 계속됐으나 추가 자금 유입 크지 않아 장 막판까지 매도 정체되었음.
채권	한국 : 국고채 금리가 급락하며 최종호가 수익률 기준 연저점을 또 다시 경신하였음. 미국 고용 지표 발표 후 경기 침체 우려가 반영 된 것으로 보임. 미국 : 미 국채금리는 2년, 5년물은 상승했고, 10년, 30년물은 하락하며 혼조 마감하였음. 7월 ISM 서비스업 PMI지표가 호조를 보이며 경기침체 공포에 따른 폭발적인 매수세가 다소 진정되었음. 서비스업 PMI는 51.4로 전월비 상승하며 경기 확장과 위축의 기준선 '50'을 회복하였음.
MONEY	달러 머니 시장 오전장에서는 아시아계 네임으로 1년물 4.90 오퍼가 제시 되었으며 유럽 시장이 오픈 되면서 SOFR 금리 6개월물 4.65-4.75 & 1년물 4.15-4.25 수준으로 형성되자, 유럽계 포린 네임들 1년물 SOFR 금리 20-30bp 가량 스프레드 감안한 1년물 4.35-4.55 사이로 비드 호가 제시 되면서 전주 대비 큰폭의 하락세를 보이며 장기물 테너는 네임별 레벨 차등 확대로 기간별 마켓 형성 레벨이 가능하기 어려운 상태로 비드-오퍼간 갭만 확대되는 양상. 연화는 강세가 지속되면서 엔캐리 트레이드 청산 물량 여파로 달러/엔 환율과 달러/엔 스왑 변동성 확대로 달러 환산 금리도 장중 움직임이 컸음.
FX SWAP	외환 스와프 포인트는 1년 만기물을 제외한 대부분의 구간에서 하방 압력을 받음. 1년 만기물은 전장보다 120 전 오른 -2500원에서 증가를 형성했으나 6개월 만기물은 전장보다 30전 내린 -1470원, 3개월 만기물은 전장보다 15전 내린 -760원에서 증가를 기록함. 미국 고용 지표 부진과 달러 금리 하락 영향으로 1년 만기 스와프포인트를 비롯해 전반적으로 상승 시작했으나 한국 증시 급락에 따른 리스크오프가 나타나 하락 압력이 크게 작용한 것으로 보임. 중동 리스크와 같은 변수에 따라 앞으로의 흐름이 결정될 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 미국 경기침체 우려가 급부상함에 따라 급락 마감. 미국의 7월 고용지표가 시장 예상치보다 훨씬 부진하게 나오며 따라 경기 침체에 대한 우려가 급부상하는 분위기가 형성됐으며, 여기에 중동 지역의 전쟁 우려도 위험회피 심리를 키우면서 국내외 금리에 하락 압력을 가함. 미국 지표가 급격하게 움직인 만큼 IRS도 이에 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 장 초반 9개월, 1년쪽으로 호가가 많이 형성되면서 9개월이 26.5-27에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 전체적으로 국채선물과 연동되어 움직였으며, 장 막판에 1년쪽으로 오퍼가 7.5까지 내려오면서 전체적인 레벨이 내려가는 모습을 보임. 9개월 오퍼도 내려오며 따라 20까지 거래가 이뤄졌으며, 이후 5*10년 비드가 04까지 올라오면서 거래가 이뤄짐. 5년쪽으로 호가가 형성되는 상황에서 7년 비드가 78까지 올라오고, 5*7년 스프레드와 엮이면서 5년이 77에 거래가 이뤄짐. 2년이 비드가 올라오면서 89에 거래가 이뤄졌으며, 장 마감 이후에도 2년이 89.5/89.25에 대치를 이루다 89.5에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.07.30(화)	217.7	206.7	3.45%	3.513%	3.50%	2년물	3.922%	3.8
2024.07.31(수)	212.9	203.1	3.50%	3.530%	3.50%	5년물	3.642%	2.2
2024.08.01(목)	215.0	204.7	3.45%	3.512%	3.500%	10년물	3.790%	-0.4
2024.08.02(금)	221.7	209.0	3.52%	3.542%	3.48%	30년물	4.074%	-3.5
2024.08.05(월)	222.4		3.52%	3.545%	3.48%	10Y-2Y	-13.2	-4.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,441.55	-234.64	27-09-10	국고 22-8	1,779	은행채 1,000	여전채 4,700	
KOSDAQ	691.28	-88.05	24-11-05	통안채	1,600	여전채 7,100	회사채 2,100	
달러-원	1,370.00원	14.00원	54-03-10	국고 24-2	1,310	회사채 2,400	통안채 5,000	
국고3Y	2.806%	-13.3	25-01-08	수출입채	-600	통안채 5,400	공사채 2,300	
국고10Y	2.878%	-9.8	25-09-05	산금채	-750	공사채 600		
국고10Y-3Y	7.2	3.5	25-01-02	통안채	-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	5.40	5.35	5.37	0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.51	5.41	5.46	-0.01	1S	5.50	5.40	5.47	-0.01
3S	5.45	5.35	5.40	-0.07	3S	5.50	5.30	5.45	-0.02
6S	5.07	4.92	5.00	-0.25	6S	5.20	4.90	5.10	-0.20
1YR	4.97	4.82	4.90	-0.20	1YR	5.20	4.80	5.05	-0.25

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-6	-8	5.61	0.09	3.50	5.35000	1M MAR	-256	-253
TN	-10/-6	-8	5.61	0.00	3.50	5.35006	1W*1S	-210	-200
1W	-64/-54	-59	5.73	0.12	3.50	5.35043	1*2	-230	-220
1S	-280/-260	-270	5.65	0.08	3.48	5.35204	1*3	-510	-500
3S	-780/-740	-760	5.65	0.04	3.44	5.22773	1*6	-1210	-1180
6S	-1500/-1440	-1470	5.60	0.05	3.43	5.00763	1*9	-1700	-1680
1YR	-2550/-2450	-2500	5.20	-0.10	3.29	4.59608	1*12	-2220	-2160

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)

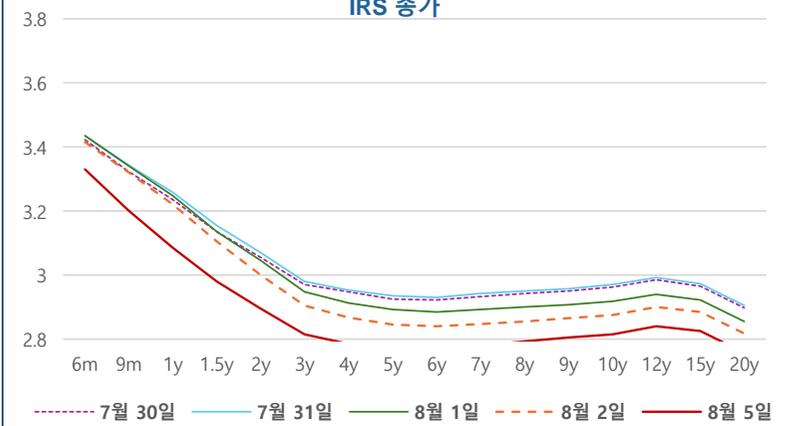
IRS 데일리 증가

8월 5일

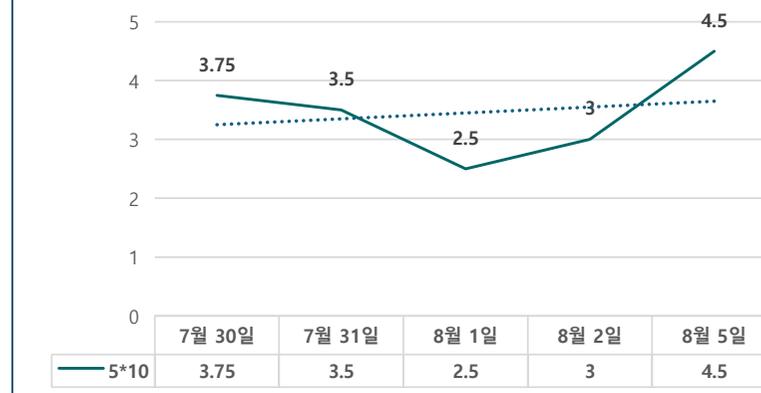
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3300	-8.50
9m	3.2000	-12.00
1y	3.0850	-13.50
1.5y	2.9800	-12.50
2y	2.8950	-10.50
3y	2.8150	-9.00
4y	2.7850	-8.25
5y	2.7700	-7.50
6y	2.7675	-7.25
7y	2.7800	-6.75
8y	2.7925	-6.25
9y	2.8050	-6.00
10y	2.8150	-6.00
15y	2.8250	-6.00
20y	2.7575	-6.00

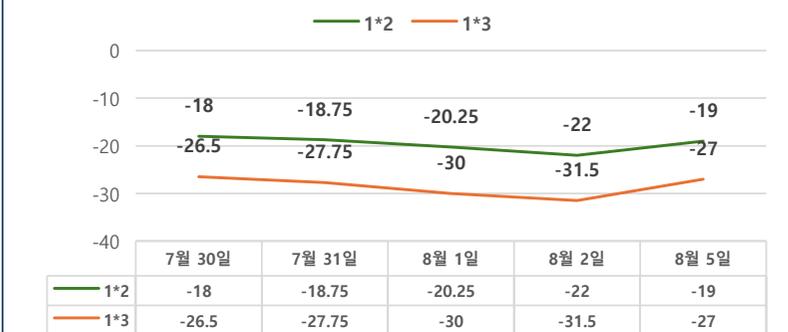
IRS 증가



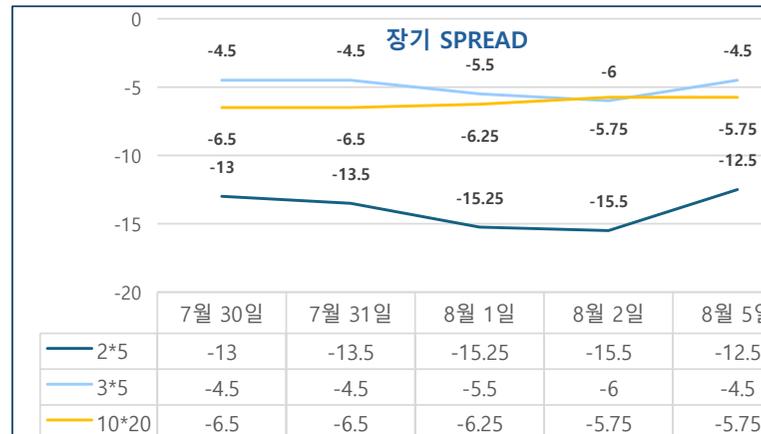
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

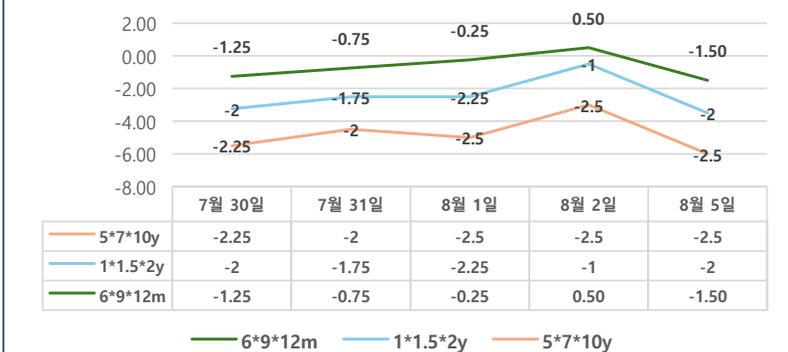


IRS 주요 커브

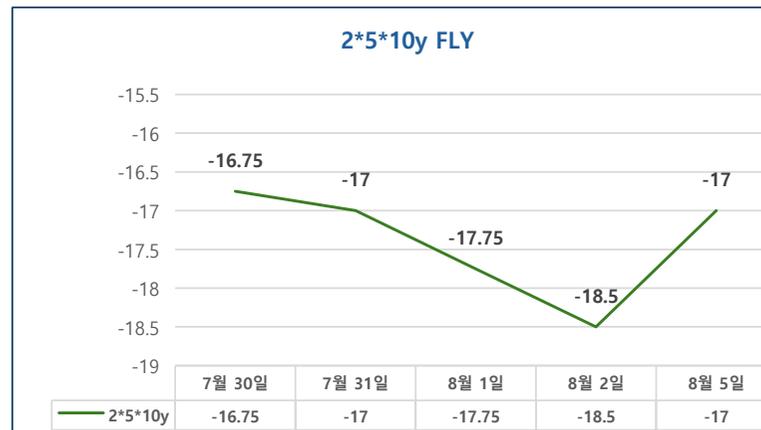
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-19.00	3.00
1*3y	-27.00	4.50
2*5y	-12.50	3.00
3*5y	-4.00	1.50
5*10y	4.50	1.50
10*20y	-5.75	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.50	-2.00
1*1.5*2y	-2.00	-1.00
2*5*10y	-17.00	1.50
5*7*10y	-2.50	0.00