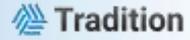


# Market Daily Report



2024.08.07(수)

<b>레포</b>	마감 불확실성 상존하여 시중은행 조달에 적극적이었으나 지준일 전 2일물 운용 제약으로 기일별 조달여건 상이하였음. 주식시장 변동성 증대됨에 따라 증권사 증거금 관련 자금 수요 증가했으며, 장 중 추가 매도 이어졌음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 미국 침체 공포가 다소 완화되며 전일 급격했던 강세를 크게 되돌림. 미국 : 미 국채금리는 상승 마감. 경기 침체 우려로 급락했던 국채 금리는 단기 고점 매도 물량이 나오며 레벨 조정. 전일 양호했던 서비스업 PMI로 시장의 공포 심리가 완화되며 안전자산 선호 심리가 약해진 것으로 풀이됨. 한편 미국 3년 만기 국채 입찰에서는 응찰률 2.55배로 앞선 6번의 입찰 평균 입찰치 2.57배를 소폭 하회하며 양호한 수요 확인.
<b>MONEY</b>	금일 달러 머니 시장은 어제 비드 급락세로 일부 패닉 장세를 보였으나, 금일 아시아장에서 기간물 체결 레벨을 바탕으로 미드가로 네임별 레벨 형성중. 대만계 3개월물 5.30, 6개월물 4.91 & 중국계 3개월물 5.40-5.43, 6개월물 5.00-5.05 수준으로 일부 체결되며 와이드한 호가 속에 체결 레인지 형성되고 있음. 다만, 오전장에서 USD/CNY DF 스왑 움직임에 중국 본토 달러 유동성이 일부 타이트 해지면서 역의 중국계 은행들의 단기 차입 물량이 처리 되지 않아 단기물 레벨 상승 압력에 오버나잇 5.40-5.43 까지 상승세를 보였고, 1주 5.45 1개월물도 5.47-5.50 수준으로 전일 대비 소폭 단기를 위주로 상승했음.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 되돌림 장세를 보이며 하방 압력이 이어짐. 1년 만기물은 전장 대비 160전 내린 -2660전에 증가를 형성했으며 6개월 만기물은 50전 내린 -1540전에 증가를 기록함. 전일의 과도한 상승에 따른 조정장의 분위기가 이어졌으며, 주식시장에서의 충격이 일부 회복세를 보였음에도 시장 전반적으로 불안한 분위기가 남아있는 것으로 보임. 단기적으로 추세의 급격한 변화는 어려울 것으로 보이며 당분간 조정장의 분위기가 이어질 것으로 예상됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 전일 움직임을 되돌리는 모습을 보이면서 상승 마감. 장기 구간을 중심으로 금리가 상승하면서 전체적인 커브가 스텝됨. 전반적으로 국채선물에 연동되어 움직이는 분위기였으며, 단기 구간쪽으로 호가가 많이 형성되는 모습을 보임. 1년쪽으로 호가가 형성되면서 17.5-16.5까지 거래가 이뤄졌으며, 장 중 4년 오퍼가 내려오면서 4*10년 스프레드와 얽여 10년이 88.5에 거래가 이뤄짐. 막판에 6개월 비드가 올라오면서 38.5/37.5에 대치를 이루다 37.5에 여러 차례 거래가 됐으며, 1.5년은 오퍼가 내려오며 따라 06에 거래가 이뤄짐. 2*5년 오퍼가 -12.25에 나와 거래됐으며, 그 이후로 비드가 -12까지 올라오는 모습을 보임. 장 마감 후에도 1*2년과 2년쪽으로 비드가 꾸준히 나오면서 2년이 99.5에 몇차례 거래가 됐으며, 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.47에 고시됨.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp	
2024.07.31(수)	212.9	203.1	3.50%	3.530%	3.50%	2년물	3.979%	5.7	
2024.08.01(목)	215.0	204.7	3.45%	3.512%	3.49%	5년물	3.734%	9.2	
2024.08.02(금)	221.7	209.0	3.52%	3.542%	3.500%	10년물	3.894%	10.4	
2024.08.05(월)	222.4	208.3	3.52%	3.545%	3.48%	30년물	4.181%	10.7	
2024.08.06(화)	216.8		3.55%	3.535%	3.47%	10Y-2Y	-8.5	4.7	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,522.15	80.60	25.01.02	통안채	1,900	회사채 300	여전채 1,300	통안채 2년물 21,000
KOSDAQ	732.87	41.59	25.07.02	통안채	1,000		회사채 2,910	재정증권 63일물 10,000
달러-원	1,377.70원	7.70원	27.03.03	통안채	1,000			
국고3Y	2.935%	12.9	54.03.10	국고 24-2	-100			
국고10Y	2.993%	11.5	26.12.10	국고 16-8	-130			
국고10Y-3Y	5.8	-1.4	24.12.05	수출입채	-1,000			

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.01	O/N	5.45	5.35	5.38
TN	5.41	5.34	5.38	0.01	TN	5.45	5.35	5.40
1W	5.46	5.36	5.41	0.01	1W	5.45	5.35	5.41
1S	5.52	5.42	5.47	0.01	1S	5.50	5.40	5.48
3S	5.35	5.25	5.30	-0.10	3S	5.45	5.30	5.40
6S	5.04	4.89	4.97	-0.03	6S	5.20	4.90	5.05
1YR	4.92	4.77	4.85	-0.05	1YR	5.20	4.80	5.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-5	-7	5.33	-0.28	3.50	5.35000	1M MAR	-260	-253
TN	-10/-6	-8	5.59	-0.02	3.50	5.34929	1W*1S	-205	-195
1W	-70/-62	-66	5.66	-0.08	3.50	5.34506	1*2	-245	-240
1S	-275/-255	-265	5.66	0.01	3.48	5.32740	1*3	-515	-505
3S	-780/-750	-765	5.63	-0.02	3.43	5.13241	1*6	-1305	-1295
6S	-1560/-1500	-1530	5.62	0.02	3.40	4.78566	1*9	-1870	-1850
1YR	-2700/-2600	-2650	5.26	0.07	3.26	4.29257	1*12	-2400	-2370

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

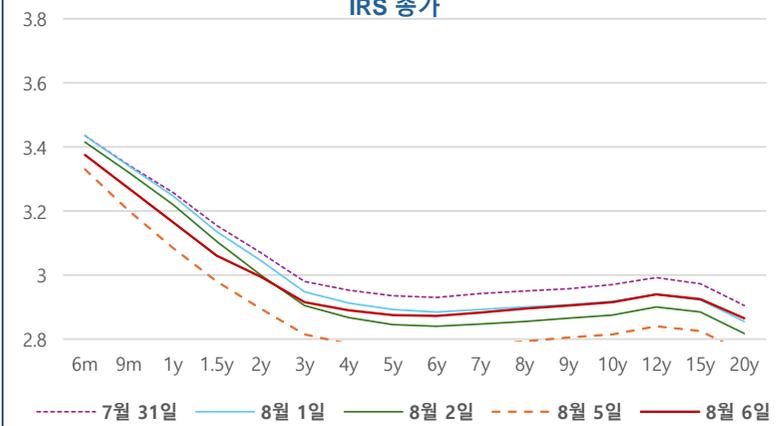
IRS 데일리 증가

8월 6일

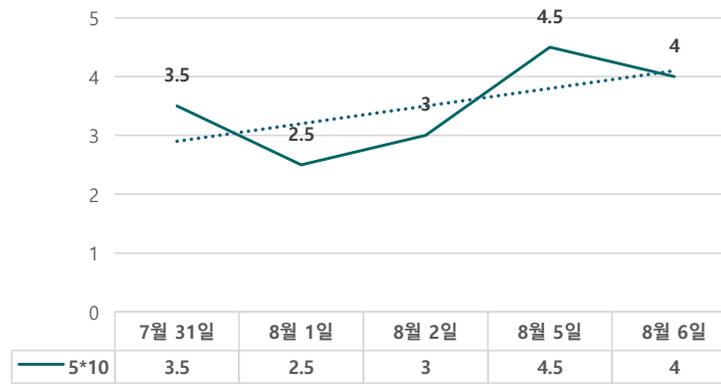
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3750	4.50
9m	3.2700	7.00
1y	3.1650	8.00
1.5y	3.0600	8.00
2y	2.9950	10.00
3y	2.9150	10.00
4y	2.8900	10.50
5y	2.8750	10.50
6y	2.8725	10.50
7y	2.8825	10.25
8y	2.8950	10.25
9y	2.9050	10.00
10y	2.9150	10.00
12y	2.9400	10.00
15y	2.9250	10.00
20y	2.8650	10.75

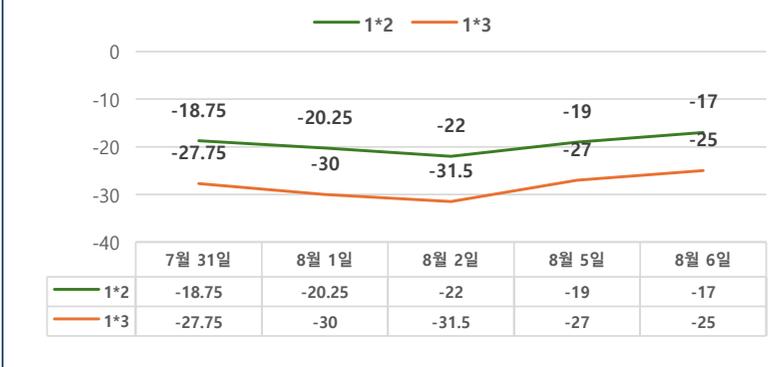
IRS 증가



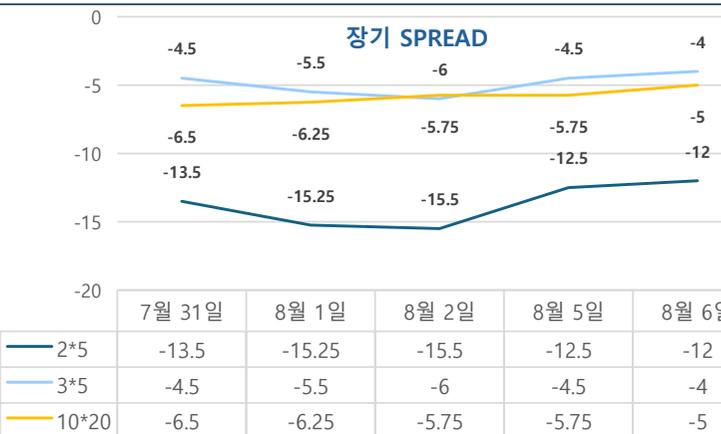
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

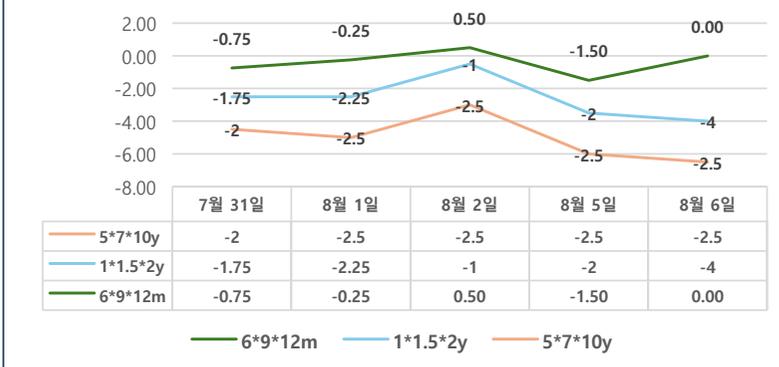


IRS 주요 커브

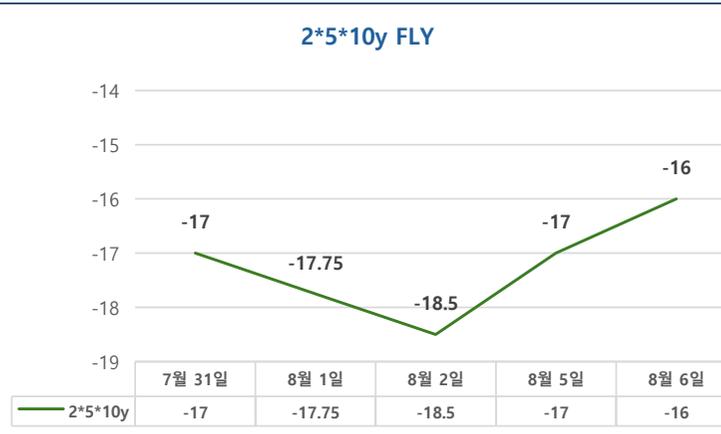
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.00	2.00
1*3y	-25.00	2.00
2*5y	-12.00	0.50
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	4.00	-0.50
10*20y	-5.00	0.75

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	1.50
1*1.5*2y	-4.00	-2.00
2*5*10y	-16.00	1.00
5*7*10y	-2.50	0.00