

Market Daily Report



2024.08.08(목)

레포	지준일 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감함. 국고여유자금 환수에도 조달여건 양호했으며, 1일물 레포 매도 해소 원활하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 혼조세 마감. 중단기 금리는 하락, 장기 금리는 상승하며 커브 스티프닝 발생. 미국 : 미 국채금리는 2년을 제외 상승 마감. 경기 침체 우려로 급락했던 국채 금리는 시장이 안정을 되찾으며 안전자산 선호 심리가 약해진 탓에 매도세가 강하게 유지됨. 또한 10년물 국채 입찰에서 응찰률이 2.32배로 앞선 6년의 입찰 평균치 2.53배에 못미치며 수요가 약했던 점도 약세장에 영향.
MONEY	최근 연준의 역레포 잔액이 3년여만에 처음으로 3천억 달러 하회했다는 보도와 함께 최근 장기물 위주로 달러 기간물 레벨이 급락세를 보였으나, 단기물 유동성이 오히려 타이트하게 유지 되면서 오버나잇 -1개월물 이내 구간 레벨 상승세 견인 기간물 레벨도 낮게 대 놓은 비드 레벨이 오피 레벨에 맞춰 상승하고 있음. 유럽 장 오픈되면서 SOFR 금리가 미국채 금리 상승에 따라 6개월물과 1년물 금리도 상승 반영 되면서 유럽계 은행들의 장기 구간 스프레드 감안 전일비 대비 장기물 비드 레벨은 상승세를 보였음. 금일 기준, 유럽계 포린 네임 기준으로 ALL IN 가격 6개월물 5.00%, 1년물 4.70% & 중국계 6개월물 5.15%, 1년물 5.15% 수준으로 체결 되면서 장기구간 레벨은 시장에 시그널이 제시 될때마다 당분간 Daily 금리차가 발생할 것으로 예상됨.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 리스크 오프 심리가 이어지면서 예셋 우위 장세가 지속됨. 1년 만기물의 증가는 일수 조정 시 전장보다 40전 오른 -2630전을 기록하였고 6개월 만기물은 시초가와 동일한 -1530전의 증가를 기록함. 시장 전체적으로 단기부터 장기에 이르기까지 비드가 적은 상황이며 새로운 재료가 출현하기 전까지는 낮은 변동성이 계속될 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 단기물 위주로 소폭 하락 마감. 변동성을 줄 큰 재료는 없는 가운데 증시의 반등 흐름이 지속될지에 대한 불안감과, 달러-원 환율도 다시 오르는 등 불안 요인이 많이 남아있는 만큼 전체적으로 지켜보는 분위기가 형성됨. 국채 선물과 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 단기쪽으로 호가가 형성되어 6개월이 37에 몇차례 거래가 이뤄짐. 1*2년 오피가 나오면서 1.5*2년 비드와 엮여 1*1.5*2년이 -3.5에 거래되면서 커브가 바뀌었으며, 6*9개월이 -10에 거래됨. 장 막판에는 2*5년 -10.5비드와 1.5*3년 -13.75 비드가 올라오면서 커브 레벨이 움직였으며, 단기쪽으로는 1.5년이 05까지 오피가 나오면서 레벨이 놀리는 모습을 보임. 장 마감 후에는 미국채 움직임과 연동되면서 2년이 98.5에 거래됐으며, 10년이 91.75/91.5에 대치되다 91.5에 거래가 이뤄졌으며 시장에서는 91.75까지 거래 소식이 들림. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.48에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	단위 : 조 원	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp
						CD(91일)	금리	전일대비	
2024.08.01(목)	215.0	204.7	3.45%	3.512%		3.49%	2년물	3.964%	-1.5
2024.08.02(금)	221.7	209.0	3.52%	3.542%		3.48%	5년물	3.764%	3
2024.08.05(월)	222.4	208.3	3.52%	3.545%	3.500%	3.48%	10년물	3.945%	5.1
2024.08.06(화)	216.8	206.1	3.55%	3.535%		3.47%	30년물	4.248%	6.7
2024.08.07(수)	217.4		3.55%	3.487%		3.48%	10Y-2Y	-1.9	6.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,568.41	46.26	24.10.10	재정채	5,800	은행채 8,000	은행채 4,900	
KOSDAQ	748.54	15.67	25.10.02	통안채	2,100	여전채 9,900	여전채 5,700	
달러-원	1,373.60원	-4.10원	25.06.10	국고 22-4	2,000	공사채 1,800	회사채 200	
국고3Y	2.929%	-0.6	25.01.02	통안채	-1,000			
국고10Y	3.001%	0.8	25.01.18	중금채	-1,000			
국고10Y-3Y	7.2	1.4	26.02.26	산금채	-1,200			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.00	O/N	5.45	5.35	5.38	0.00
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.45	5.35	5.40	0.00
1W	5.47	5.37	5.42	0.01	1W	5.45	5.35	5.43	0.02
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.45	5.35	5.40	0.10	3S	5.45	5.30	5.40	0.00
6S	5.19	5.04	5.12	0.15	6S	5.20	5.00	5.15	0.10
1YR	5.12	4.97	5.05	0.20	1YR	5.20	4.90	5.15	0.15

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, % , %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-6	-8	5.60	0.27	3.50	5.32000	1M MAR	-255	-248
TN	-10/-6	-8	5.60	0.01	3.50	5.31902	1W*1S	-200	-190
1W	-62/-52	-57	5.63	-0.02	3.50	5.31312	1*2	-260	-250
1S	-270/-250	-260	5.69	0.03	3.48	5.28952	1*3	-550	-530
3S	-815/-795	-805	5.68	0.04	3.42	5.05651	1*6	-1270	-1250
6S	-1560/-1500	-1530	5.63	0.01	3.40	4.65546	1*9	-1820	-1800
1YR	-2680/-2580	-2630	5.25	-0.02	3.27	4.14598	1*12	-2355	-2325

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)

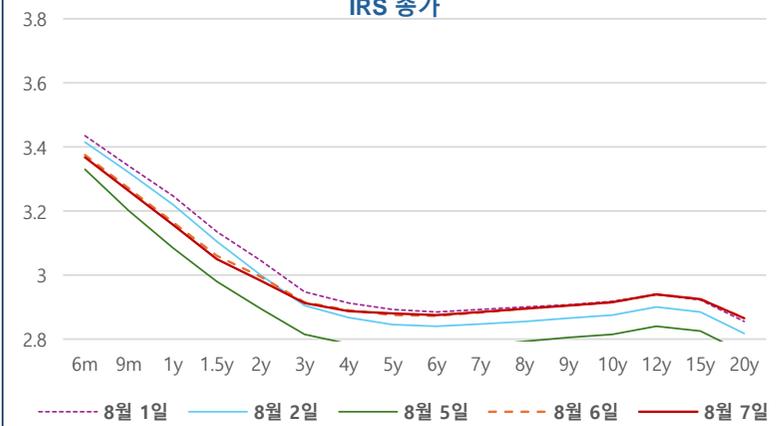
IRS 데일리 증가

8월 7일

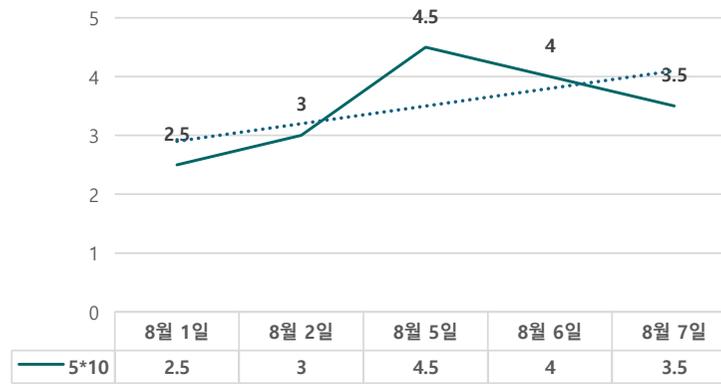
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3675	-0.75
9m	3.2625	-0.75
1y	3.1575	-0.75
1.5y	3.0500	-1.00
2y	2.9825	-1.25
3y	2.9125	-0.25
4y	2.8875	-0.25
5y	2.8800	0.50
6y	2.8750	0.25
7y	2.8850	0.25
8y	2.8950	0.00
9y	2.9050	0.00
10y	2.9150	0.00
12y	2.9400	0.00
15y	2.9250	0.00
20y	2.8650	0.00

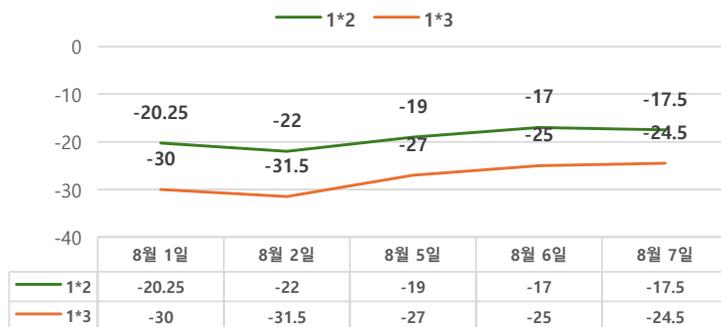
IRS 증가



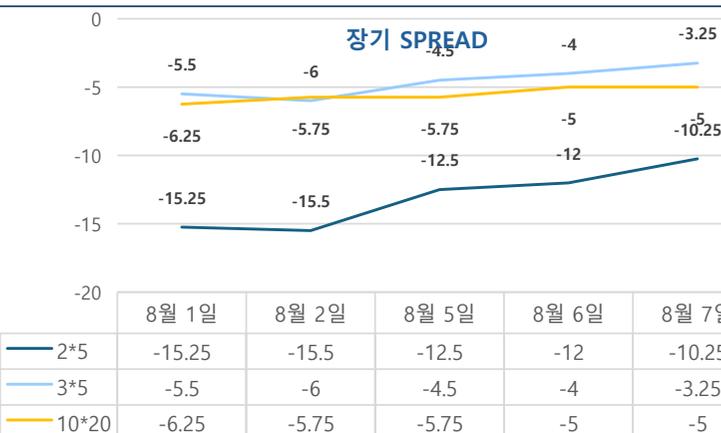
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

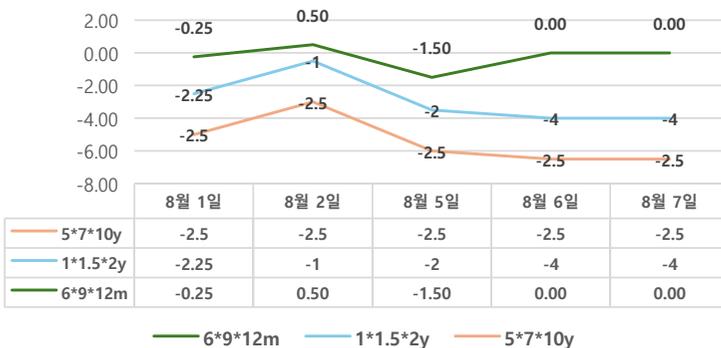


IRS 주요 커브

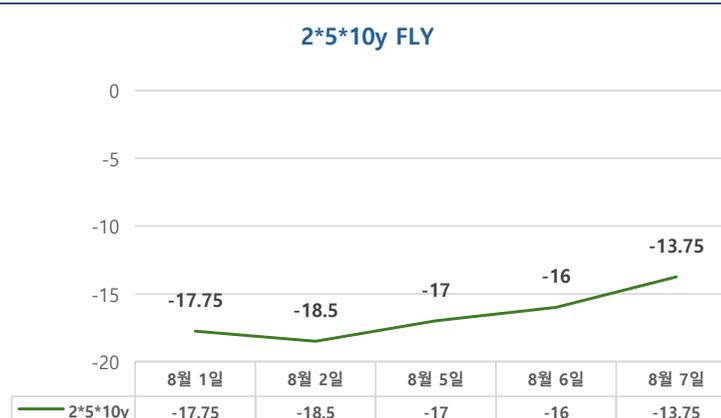
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.50	-0.50
1*3y	-24.50	0.50
2*5y	-10.25	1.75
3*5y	-4.00	0.75
5*10y	3.50	-0.50
10*20y	-5.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.00
1*1.5*2y	-4.00	0.00
2*5*10y	-13.75	2.25
5*7*10y	-2.50	0.00