

Market Daily Report



2024.08.09(금)

레포	지준율 초반 시중은행 매도 감소하여 국고여유자금 환수 영향 크지 않았으며, 공모주 청약자금 유입되어 조달여건 양호하였음. 장 중 저금리 거래 간헐적으로 매칭됐으나 금리 낙폭 제한적이었고, 연이은 국고 환수 우려로 익일 스타트 기일을 금리 소폭 상승하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 중단기 금리 중심 하락하였음. 증시가 약세를 나타내며 위험회피 분위기가 이어지던 중 외국인인 3년 국채선물을 매수하면서 강세 압력을 가함. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 상승 마감하였음. 주간 실업보험 청구자수가 예상치를 하회하자 채권 매도세가 강화됨. 이러한 실업 지표에 시장은 금리인하 전망이 과도했다 인식하였음. 또한 30년을 입찰에서 응찰률이 앞선 6번의 응찰률에 못미치며 수요가 약했던 점도 약세장에 기여함.
MONEY	장기구간 중심으로 10~20BP 레벨 등락을 거듭하던 달러 마켓 진정세 보임. 중국계를 제외한 네임의 경우 1주 5.42~5.40, 1달 5.43~5.48 레벨 유지하며 1달 이하의 단기 구간 큰 변동없이 마감됨. 낮게는 5.30 초반에도 형성되었던 3달의 경우, 5.30~5.40 레벨에 차입 수요가 점차 증가되고 있으나, 운용선은 아직 5.40 이상 레벨로만 확인되며 마켓 체결까지는 제약됨. 그간 레벨 하락을 거듭해오던 장기 구간의 경우 어제 다시 반등세 분위기에 6달 중심으로 4.95~5.05 레벨선에 마켓 차입 증가된 모습. 오퍼는 일부 소액으로 6달 5.05~5.10 제시가 되었으나, 운용 부족세에 장기 펀딩 대기는 계속해서 이어지는 중.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 엔캐리 청산 불안 완화의 분위기 속에 소폭 반등하는 장세를 보임. 1년 만기물의 증가는 -25.70원으로 거래 일수 보정 시 시초가 보다 50전 오른 증가를 형성함. 6개월 만기물은 -15.10원으로 마찬가지로 거래일 보정 고려 시 시초가보다 10전 오른 증가를 기록함. 큰 폭의 움직임은 없었으나 역의 비드가 나오며 6개월물과 1년물 같은 장기물에서 반전이 나타남. 점차 유동성 공급이 되면서 비드가 증가하는 모습을 보이거나 아직 로컬 오퍼가 시장에 많이 나오고 있어 전반적인 반등까지는 시간이 더 걸릴 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 단기는 하락한 반면 장기는 소폭 상승 마감함. 국채 선물과 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 2년쪽으로 꾸준히 호가가 형성되면서 95.5-94까지 거래가 여러 차례 이뤄짐. 1*2*3년 나비가 -12.5까지 비드가 올라오면서 거래되면서 앞쪽 커브 레벨이 움직이는 모습을 보였으며, 1년이 계속해서 오퍼가 나오면서 14.5/14로 대치를 이루다 14에 거래가 이뤄짐. 2,3년쪽으로 오퍼가 꾸준히 나오는 분위기를 보였으며, 장 중 6개월 비드가 소폭 올라오면서 36.25에 거래된 후로도 비드가 꾸준히 나옴. 장 막판에 전체적으로 레벨이 2년 쪽으로해서 올라오는 분위기를 보였으며, 2*5년 비드가 강하게 올라오면서 -8 레벨에 거래됐고, 단기쪽으로는 9*12개월 오퍼가 -11 까지 내려오면서 레벨이 움직임. 장 마감 후에는 5*10년이 4.5/04로 대체 된 후 04에 ND로 거래됐으며, 4*5년 역시 오퍼가 내려오면서 -0.75에 거래됨. 이날 양도성 예금증서(CD)는 3.47에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.08.02(금)	221.7	209.0	3.52%	3.542%		3.48%	2년물	4.040%	7.6
2024.08.05(월)	222.4	208.3	3.52%	3.545%		3.48%	5년물	3.829%	6.5
2024.08.06(화)	216.8	206.1	3.55%	3.535%	3.500%	3.47%	10년물	3.991%	4.6
2024.08.07(수)	217.4	205.2	3.55%	3.487%		3.48%	30년물	4.280%	3.2
2024.08.08(목)	216.0		3.53%	3.531%		3.47%	10Y-2Y	-4.9	-3

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	2,556.73	-11.68	25.10.02	통안채	2,300	은행채 4,600	여전채 12,175	물가채 10년 1,000억원 입찰
KOSDAQ	745.28	-3.26	25.07.02	통안채	2,000	여전채 9,650	회사채 5,090	
달러-원	1,377.20원	3.60원	25.08.08	신한은행	900	회사채 1,230	공사채 2,950	
국고3Y	2.911%	-1.8	25.10.23	산금채	-500	공사채 600		
국고10Y	2.997%	-0.4	25.01.02	통안채	-1,070			
국고10Y-3Y	8.6	1.4	53.03.10	국고 23-2	-1,840			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	-0.01	O/N	5.45	5.35	5.38	0.00
TN	5.40	5.33	5.37	-0.01	TN	5.45	5.35	5.40	0.00
1W	5.47	5.37	5.42	0.00	1W	5.45	5.35	5.43	0.00
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.52	5.42	5.48	0.00
3S	5.42	5.32	5.37	-0.03	3S	5.46	5.31	5.41	0.01
6S	5.14	4.99	5.07	-0.05	6S	5.15	5.00	5.10	-0.05
1YR	5.10	4.95	5.02	-0.03	1YR	5.15	5.00	5.10	-0.05

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	5.59	-0.01	3.50	5.33000	1M MAR	-258	-255
TN	-26/-22	-24	5.59	-0.01	3.50	5.32984	1W*1S	-205	-195
1W	-61/-55	-58	5.67	0.04	3.50	5.32887	1*2	-275	-265
1S	-270/-250	-260	5.69	0.00	3.48	5.32501	1*3	-520	-510
3S	-785/-765	-775	5.65	-0.02	3.42	5.10416	1*6	-1260	-1250
6S	-1560/-1460	-1510	5.60	-0.02	3.40	4.78476	1*9	-1830	-1810
1YR	-2620/-2520	-2570	5.22	-0.02	3.28	4.31135	1*12	-2320	-2300

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)

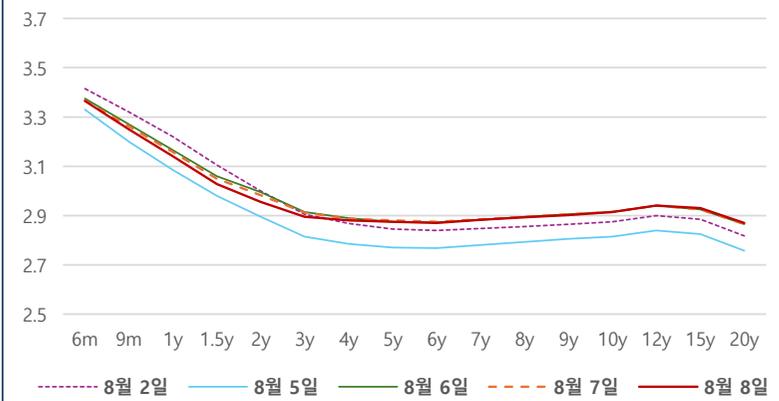
IRS 데일리 증가

8월 8일

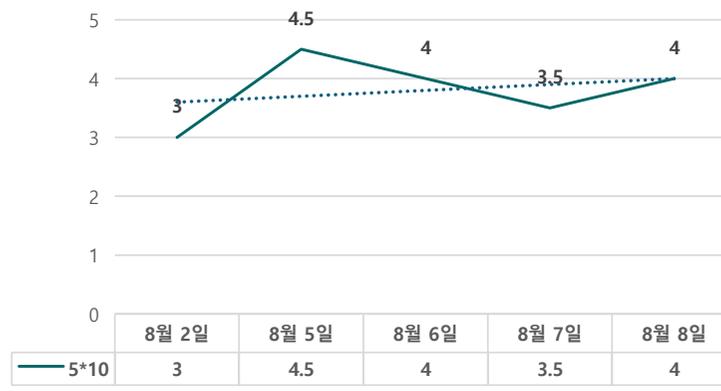
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3650	-0.25
9m	3.2500	-1.25
1y	3.1400	-1.75
1.5y	3.0275	-2.25
2y	2.9550	-2.75
3y	2.8950	-1.75
4y	2.8800	-0.75
5y	2.8750	-0.50
6y	2.8700	-0.50
7y	2.8825	-0.25
8y	2.8925	-0.25
9y	2.9025	-0.25
10y	2.9150	0.00
12y	2.9400	0.00
15y	2.9300	0.50
20y	2.8700	0.50

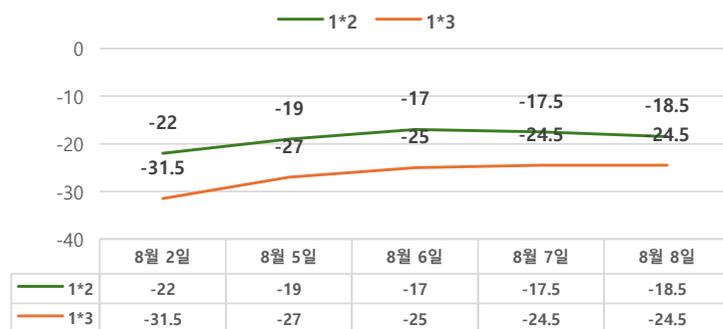
IRS 증가



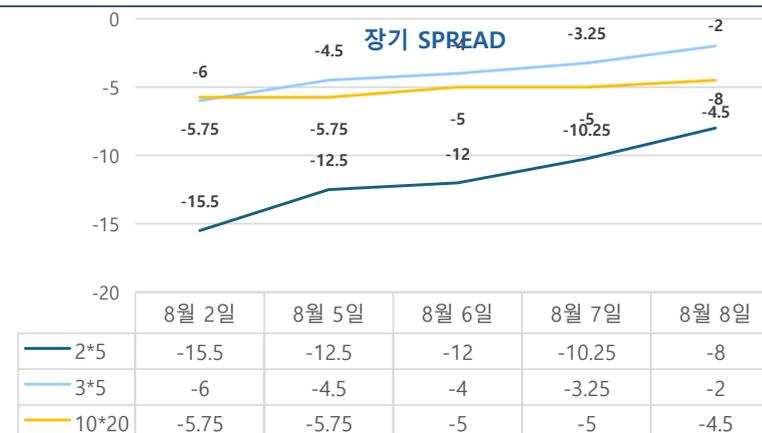
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

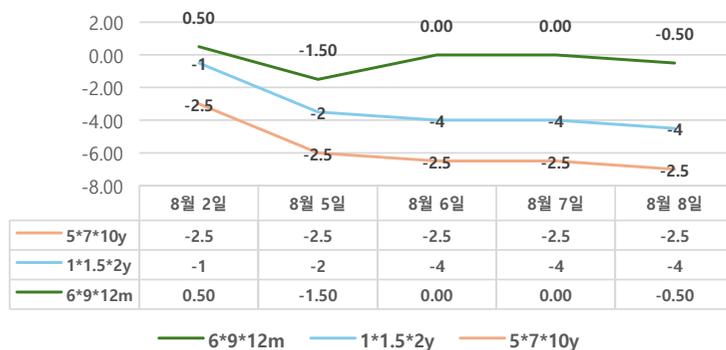


IRS 주요 커브

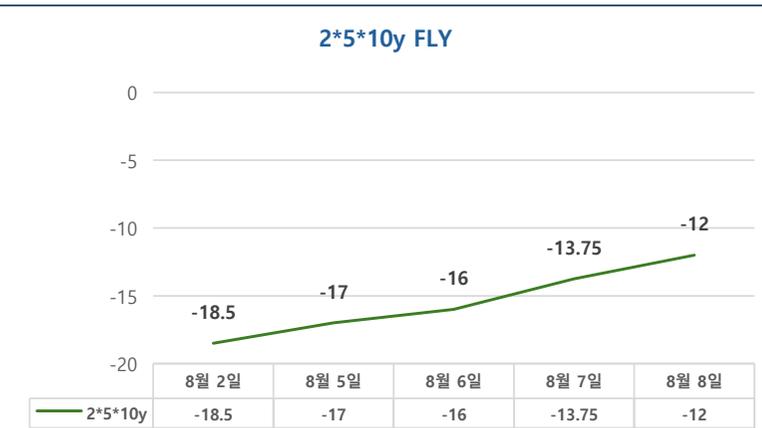
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-18.50	-1.00
1*3y	-24.50	0.00
2*5y	-8.00	2.25
3*5y	-2.00	1.25
5*10y	4.00	0.50
10*20y	-4.50	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	-0.50
1*1.5*2y	-4.00	0.00
2*5*10y	-12.00	1.75
5*7*10y	-2.50	0.00