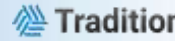


Market Daily Report



2024.08.12(월)

레포	주초 별다른 유동성 개선요인 없어 금리 보합 출발했고, 마지막 한은RP매각 증액에 따른 마감 불확실성 확대되자 시은 운용보다 조달에 집중하였음. 기준 마감 앞두고 2일을 매수자금 많지 않아 기일별 수급 불균형 상당했지만 예상보다 기준 상황 양호해 기준일 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감하였음. 공모주(유라클) 청약자금 유입되어 시작금리 일시적인 하락세를 보였으나 주 중 국고여유자금 환수 계속됨에 따라 주 후반부 자금 흐름 타이트하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 중단기 구간 위주 상승 마감. 미국 금융시장과 연동하며 주 초반 극심했던 강세 이후의 조정 국면이 지속되는 모습. 미국 : 미 국채 금리는 2년물 제외 하락 마감. 중요 지표 발표가 없던 가운데 최근 사흘 간의 국채 금리 반등이 과도했다는 시장 인식 속 저가 매수세가 강하게 유입되며 중장기를 위주로 금리 하락폭이 커짐. 주 내 10년물, 30년물 국채 입찰에서 약해진 수요가 확인되었으나 시장은 오히려 저가 매수의 기회로 여기는 모습.
MONEY	장기 구간 중심으로 레벨 소폭 상승세. 1달 이하의 단기구간 큰변화 없이 5.40~5.50 레인지에서 큰 움직임 없이 이번주 마무리. 5.00 미만 레벨 선에 그간 차입 대기가 이어졌던 장기 구간의 경우, 대만계 렌더로 부터 6달 5.15 오피 제시 됨. 6달 5.00~5.10 레벨에 비중국계 중심으로 마켓 차입 시도가 되었으며, 이후 5.12~5.11까지 운용 제시 되면서 대치 되었음. 반면 1년 구간으로도 5.10 오피 제시 되었으나 아직 1년 Term SOFR와의 스프레드가 80bp 내외 선 수준에 머물면서, 실 체결없이 오피 레벨 확인만 됨.
FX SWAP	외환 스와프 포인트는 주말을 앞두고 소강하는 분위기를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장과 동일한 -25.70원을 형성했고, 6개월 만기물 역시 전장과 동일한 -15.10원의 증가를 기록함. FX 스와프 시장은 대체로 제한된 흐름을 보였고 지표의 방향성에 확신이 없는 분위기 속에 시장 참여자들은 전반적으로 관망세를 유지할 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 미국의 지난해 실업보험청구자 수가 시장 예상보다 적게 나오면서 경기 침체에 대한 우려가 완화되면서 미국채가 상승함에 따라 이에 연동되어 움직임. 전체적으로 특별한 재료는 없는 가운데, 단기쪽으로 9*12개월쪽으로 비드가 올라오면서 -10.75에 거래가 이뤄졌으며 1년 관련해서 호가가 많이 형성되는 모습을 보임. 1년이 15.5에 거래 후 꾸준히 호가가 대치되는 분위기를 보임. 전반적으로 국채 선물 움직임에 연동되어 움직였으며, 1.5*2년 스프레드와 2년 96.5 오피가 엮이면서 1.5년이 4.5 레벨에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 초단기 6개월은 꾸준히 비드가 보이는 모습을 보였으며, 5*7*10년 나비가 -2까지 올라왔으며, 5년이 88.5, 3년이 91까지 올라오면서 레벨이 움직임. 장 마감 후에는 1.5년이 5.5 오피까지 나오면서 거래됐으며, 3년이 91, 2*3년이 -6.5에 거래가 이뤄짐. 이후 5년이 88.5/88, 5*10년이 04/3.5에 대치를 이루다가 ND로 04에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		
2024.08.05(월)	222.4	208.3	3.52%	3.545%	3.500%	3.48%	2년물	4.057%	1.7
2024.08.06(화)	216.8	206.1	3.55%	3.535%		3.47%	5년물	3.798%	-3.1
2024.08.07(수)	217.4	205.2	3.55%	3.487%		3.48%	10년물	3.942%	-4.9
2024.08.08(목)	216.0	203.3	3.53%	3.531%		3.47%	30년물	4.227%	-5.3
2024.08.09(금)	215.3		3.50%	3.531%		3.47%	10Y-2Y	-11.5	-6.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,588.43	31.70	25.07.02	통안채	1,000	공사채 1,700	회사채 171	국고채 3년물 20,000
KOSDAQ	764.43	19.15	26.01.02	통안채	900	은행채 3,800		
달러-원	1,364.40원	-12.80원	24.12.10	국고 21-10	865			
국고3Y	2.941%	3	54.03.10	국고 24-2	-1,897			
국고10Y	3.012%	1.5	43.09.10	국고 23-9	-2,150			
국고10Y-3Y	7.1	-1.5	53.09.10	국고 23-7	-2,700			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	0.00	O/N	5.42	5.32	5.37	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.43	5.33	5.38	-0.02
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	0.00	3S	5.46	5.31	5.41	0.00
6S	5.17	5.02	5.10	0.03	6S	5.10	4.95	5.15	0.05
1YR	5.15	5.00	5.07	0.05	1YR	5.15	5.00	5.10	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-26/-22	-24	5.61	0.02	3.50	5.33000	1M MAR	-292	-288
TN	-10/-6	-8	5.61	0.02	3.50	5.32989	1W*1S	-197	-193
1W	-61/-55	-58	5.69	0.02	3.50	5.32925	1*2	-256	-250
1S	-270/-250	-260	5.71	0.02	3.48	5.32666	1*3	-510	-500
3S	-775/-755	-765	5.65	0.00	3.43	5.10283	1*6	-1245	-1225
6S	-1560/-1460	-1510	5.62	0.02	3.40	4.78487	1*9	-1805	-1785
1YR	-2620/-2520	-2570	5.23	0.01	3.28	4.32457	1*12	-2310	-2270

국내의 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 / 12.17~12.18D
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)

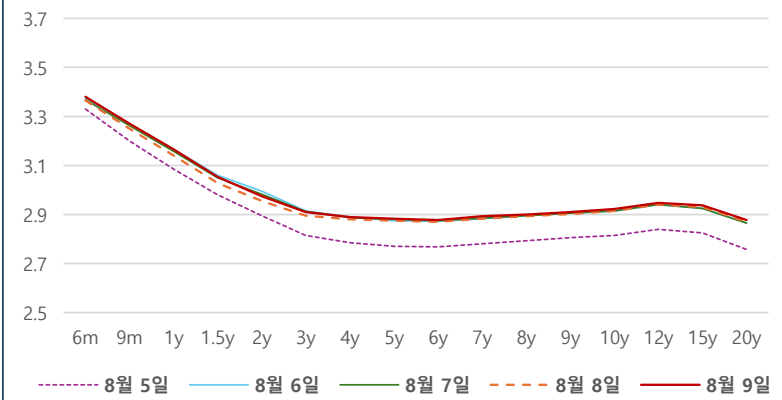
IRS 데일리 증가

8월 9일

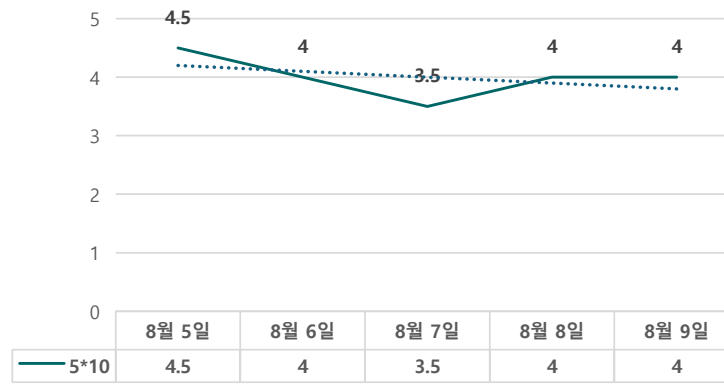
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3800	1.50
9m	3.2700	2.00
1y	3.1650	2.50
1.5y	3.0525	2.50
2y	2.9750	2.00
3y	2.9100	1.50
4y	2.8900	1.00
5y	2.8825	0.75
6y	2.8775	0.75
7y	2.8925	1.00
8y	2.9000	0.75
9y	2.9100	0.75
10y	2.9225	0.75
12y	2.9475	0.75
15y	2.9375	0.75
20y	2.8775	0.75

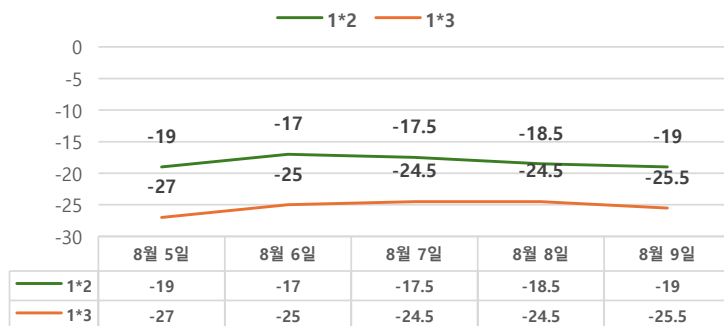
IRS 증가



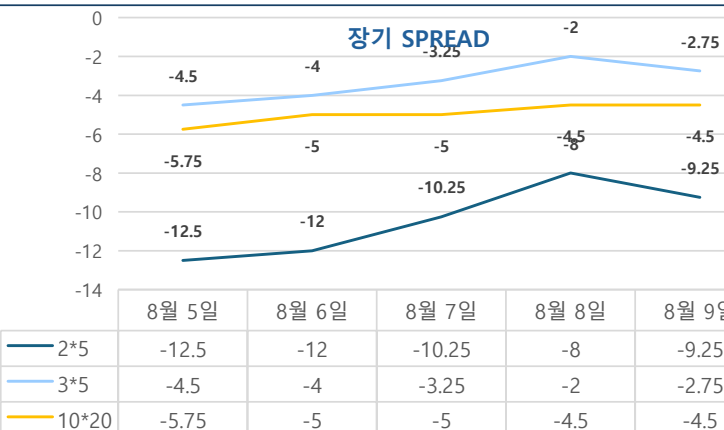
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

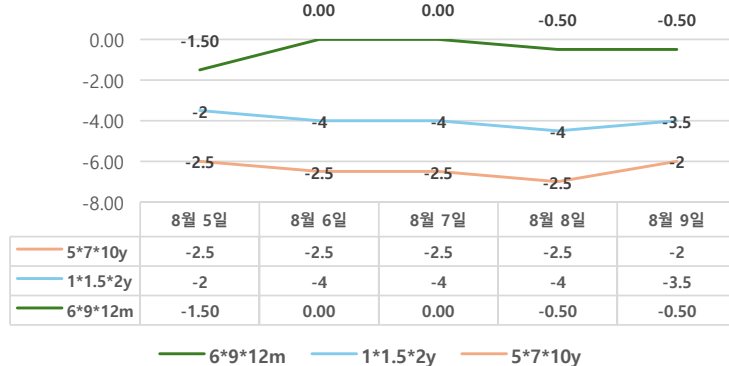


IRS 주요 커브

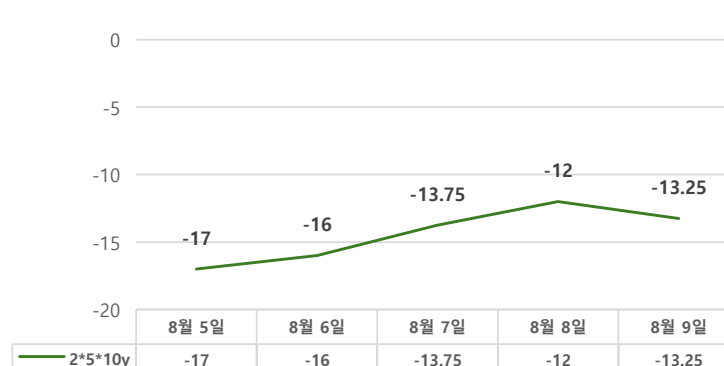
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-19.00	-0.50
1*3y	-25.50	-1.00
2*5y	-9.25	-1.25
3*5y	-2.75	-0.75
5*10y	4.00	0.00
10*20y	-4.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	0.00
1*1.5*2y	-3.50	0.50
2*5*10y	-13.25	-1.25
5*7*10y	-2.00	0.50