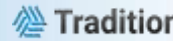


Market Daily Report



2024.08.13(화)

레포	공모주(전진건설로봇) 청약자금 유입 기대되어 금리 보합 출발했으나 예상을 상회한 은행권 조달 영향으로 시장 일시에 부족 전환되었음. 장 중 체결금리 급등했으며, 지준시간 이후에도 매도 미결 물량 대기하는 등 부족세 극심한 모습을 보임.
채권	한국 : 국고채 금리는 중단기 금리는 소폭 상승, 장기 금리는 하락 마감. 다음 주 금통위를 앞둔 점이 중단기 구간에 약세 압력으로 작용함. 미국 : 미 국채 금리는 하락 마감. 중동 지역의 군사적 긴장감 팽창으로 안전자산에 대한 수요가 증가하며 국채 가격은 상승. 주요 지표 발표가 없던 가운데 14일 미국 CPI 발표를 대기하는 흐름이었으나 미국 정부가 중동 지역에 항공 모함을 파견했다는 소식에 이스라엘-이란 전쟁이 임박했다는 우려가 커지며 국채 금리는 하락 마감.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 차입-운용 모두 선호되는 1개월물 위주로 메인 거래 유지 되었고, 2개월물은 3분기 커브 구간이나 한달 후에 있을 FOMC 회의 시점을 반영해 시장에 호기가 활발하게 제시 되지 않고 있음. 지난주 Sofr 금리 변동성 확대로 운용에 소극적이었던, 대만계 렌더들의 재운용으로 3개월물과 6개월물 위주로 3s 5.28-5.32 6s 5.05-5.10 사이로 포린 및 한국계 네임에 오퍼가 제시 되었으며, 3개월물 Sofr 금리 + 20bp, 6개월물 Sofr 금리 +30bp 가량 제시된 레벨로 체결되며, 시장가 형성 중.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 시장에 변동성을 줄 재료가 거의 없는 상황에서 기간물만 소폭 오르는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 10전 오른 -25.60원에서 형성되었고 6개월 만기물은 전장보다 10전 높아진 -15.00원의 증가를 기록함. 외화자금시장은 전반적으로 수급을 처리하며 한산한 장세를 보였고 각각 10전씩 오른 6개월물과 1년 만기물을 제외하면 대부분의 스와프포인트는 보합 수준에서 횡보함.
IRS	전일 irs는 이번주 발표되는 미국 cpi 지수를 앞두고 대기하는 분위기 속에 국채선물과 연동되어 단기쪽은 상승, 중단기쪽은 하락 마감. 초반에는 방향성을 탐색하는 듯한 분위기를 보였으나 이후에는 비디쉬한 분위기를 보임. 2*10년 -8 비드와 2년 97.25 비드로 억인 10년이 89.25에 거래되었고 1*2년이 -19.5/-20를 이루다 -20에 nd로 거래가 이뤄지며 전체적인 커브가 움직이게 됨. 막판에는 단기 중심으로 호가가 많이 보였으며 6*12개월이 d/nd로 -21에 초이스를 이뤘고 1년 오퍼가 내려오며 18.5에 거래되었으며 5*10년이 3.5/3.25로 대체됨. 마감 이후에는 6*12개월이 -21에 거래되었고 미국채 움직임과 연동되어 5*10년이 3.5/3.25를 이루다 3.5에 거래되었고 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.46이 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	단위 : bp
2024.08.06(화)	216.8	206.1	3.55%	3.535%	3.500%	3.47%	2년물	4.019%	-3.8
2024.08.07(수)	217.4	205.2	3.55%	3.487%		3.48%	5년물	3.748%	-5
2024.08.08(목)	216.0	203.3	3.53%	3.531%		3.47%	10년물	3.905%	-3.7
2024.08.09(금)	215.3	201.2	3.50%	3.531%		3.47%	30년물	4.202%	-2.5
2024.08.12(월)	216.7		3.50%	3.534%		3.46%	10Y-2Y	-11.4	0.1

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	2,618.30	29.87	24.11.12	통안채	4,100	은행채 11,500	여전채 5,400	국고채 2년 7,000
KOSDAQ	772.72	8.29	26.03.10	국고 24-3	1,512	여전채 8,200	회사채 2,330	
달러-원	1,369.60원	5.20원	25.06.10	국고 22-4	1,200	회사채 740	통안채 3,200	
국고3Y	2.946%	0.5	25.03.10	국고 20-1	-300	통안채 5,000	공사채 2,300	
국고10Y	3.000%	-1.2	26.06.10	국고 16-3	-500	공사채 7,724		
국고10Y-3Y	5.4	-1.7	26.06.10	국고 23-4	-600			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	0.00	O/N	5.38	5.33	5.36	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.47	5.37	5.42	0.00	1W	5.43	5.38	5.41	-0.02
1S	5.50	5.40	5.45	-0.02	1S	5.52	5.42	5.49	0.01
3S	5.38	5.28	5.33	-0.04	3S	5.45	5.35	5.41	0.00
6S	5.15	4.95	5.09	-0.01	6S	5.25	5.05	5.15	0.00
1YR	5.10	4.70	5.00	-0.07	1YR	5.15	4.95	5.05	-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	-9/-7	-8	5.60	-0.01	3.50	5.34000	1M MAR	-275	-271
TN	-9/-7	-8	5.60	-0.01	3.50	5.33985	1W*1S	-239	-235
1W	-63/-53	-58	5.68	-0.01	3.50	5.33874	1*2	-222	-212
1S	-320/-280	-300	5.68	-0.02	3.48	5.33352	1*3	-463	-455
3S	-800/-730	-765	5.64	-0.01	3.43	5.11269	1*6	-1200	-1180
6S	-1560/-1460	-1510	5.62	-0.01	3.40	4.80597	1*9	-1750	-1730
1YR	-2620/-2520	-2570	5.23	-0.01	3.28	4.35628	1*12	-2260	-2220

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)

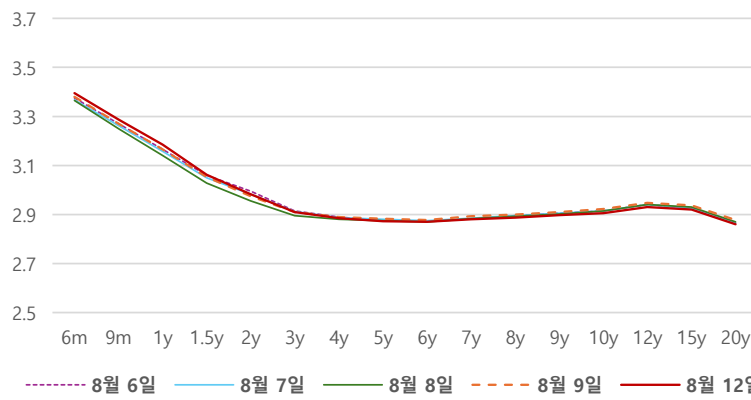
IRS 데일리 증가

8월 12일

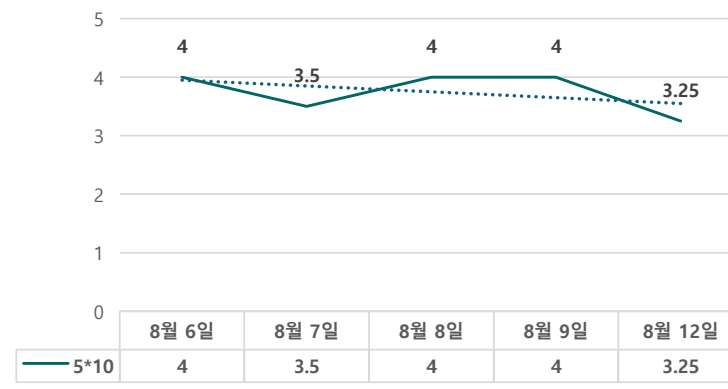
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3950	1.50
9m	3.2875	1.75
1y	3.1850	2.00
1.5y	3.0625	1.00
2y	2.9825	0.75
3y	2.9100	0.00
4y	2.8850	-0.50
5y	2.8725	-1.00
6y	2.8700	-0.75
7y	2.8800	-1.25
8y	2.8875	-1.25
9y	2.8975	-1.25
10y	2.9050	-1.75
12y	2.9300	-1.75
15y	2.9200	-1.75
20y	2.8600	-1.75

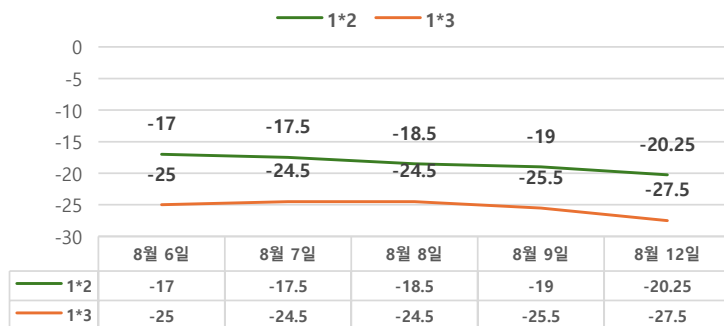
IRS 증가



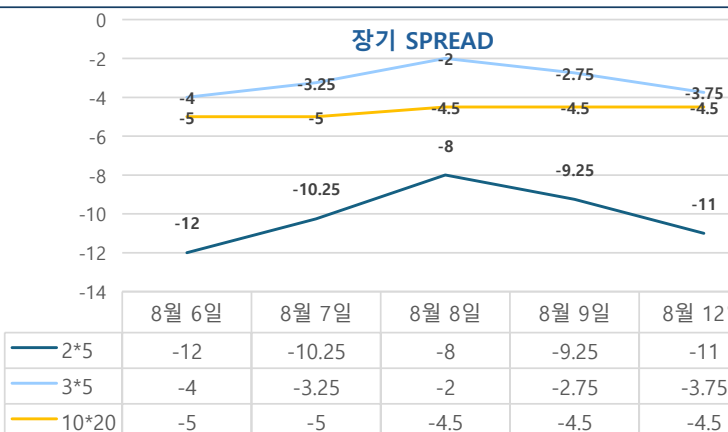
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

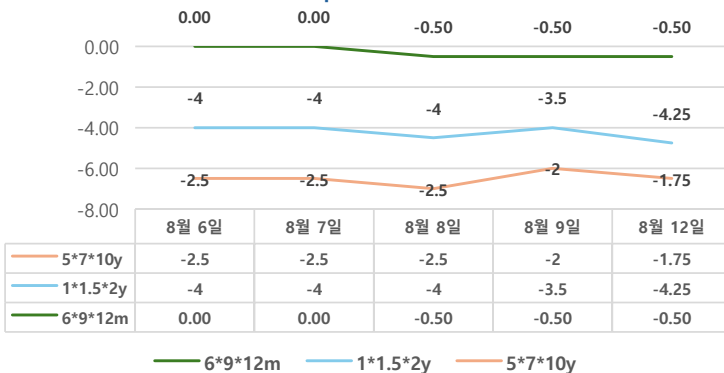


IRS 주요 커브

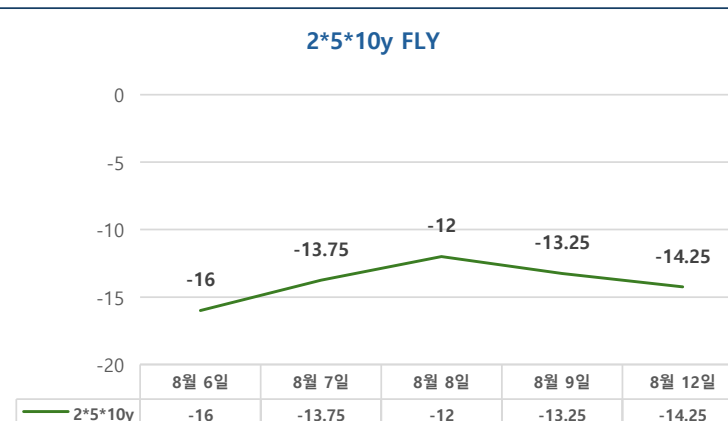
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-20.25	-1.25
1*3y	-27.50	-2.00
2*5y	-11.00	-1.75
3*5y	-3.75	-1.00
5*10y	3.25	-0.75
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	-4.25	-0.75
2*5*10y	-14.25	-1.00
5*7*10y	-1.75	0.25