

레포	전일의 부족세 반영되어 조달금리 급등했으며, 은행권 매도 감소했음에도 공모주(전진건설로봇) 청약환불 영향으로 장 초반 수급 빠듯하였음. 오전 한은RP매입(6.5조원, 7일물) 이후 정세 점차 해소되었고, 오후에 익일물 및 기일물 체결금리 하락하며 시장 안정을 되찾았음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 중동 지정학적 위험에 안전자산 선호가 확대된 영향이 이어짐. 외국인의 3년과 10년 국채선물 매수 또한 강세에 압력을 가함. 미국 : 미 국채 금리는 하락 마감. 미국 7월 PPI가 전월 대비 0.1% 상승폭을 기록해 예상치 0.2%를 하회하며 둔화 흐름을 이어가자 기준 금리 인하 기대감이 상승하며 국채 금리는 하락 마감함. 특히 서비스 지수가 전월 대비 0.2% 하락해 작년 12월 이후 처음으로 하락하며 강세장에 영향을 줌.
MONEY	미국과 중동간의 군사적 긴장감으로 뉴욕 유가가 4% 넘게 급등했으나, 어제 오늘 시장은 지난주 과도한 변동성을 진정시키며 급주에 발표될 미국의 PPI와 CPI 결과에 주목하며 레인지 장세를 보였음. 금일 달러 머니 시장은 대만계와 말레이계 네임으로 2개월물 5.45 까지 체결 되면서, 1개월물-2개월물 레벨은 5.45-5.47 플랫한 레벨 유지 중이며, 3개월물은 5.45 & 6개월물 5.15 레벨로 중국계 네임으로 역외 오픈 대기 중이나, 3개월물은 인도계를 제외하고는 굿네임 카운터 비드 5.40 이상 레벨을 찾기는 쉽지 않아, 실제결로 이어지지 못하고 있음.
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 장기 금리 위주로 하락 마감. 전체적으로 거래가 한산한 모습을 보인 가운데 1년 이하 단기 구간에서는 양도성예금증서(CD) 금리의 영향을 받아 비드가 다 소 많은 모습을 보임. 단기쪽으로 6개월, 1년쪽으로 비드가 많이 나오는 분위기였으며, 5년 이상 구간에서는 국채선물과 연동되어 움직임. 1년 오픈가 잠시 내려오면서 17.5에 거래가 이뤄졌으며 2년쪽으로도 꾸준히 비드가 많은 모습을 보임. 장 막판에는 5*7년 0.75오픈가 나오고, 6개월*2년으로 -42.5 오픈까지 내려오면서 거래가 이뤄짐. 1*1.5*2 년 나비 비드가 올라옴에 따라서 -3.5에 거래가 이뤄졌으며 1.5년쪽으로도 계속해서 비드가 나오는 분위기를 보임. 이날 양도성 예금증서(CD)는 상승하여 3.49에 고시 됨.

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	
2024.08.07(수)	217.4	205.2	3.55%	3.487%	3.500%	3.48%	2년물	3.934%	-8.5
2024.08.08(목)	216.0	203.3	3.53%	3.531%		3.47%	5년물	3.673%	-7.5
2024.08.09(금)	215.3	201.2	3.50%	3.531%		3.47%	10년물	3.845%	-6
2024.08.12(월)	216.7	199.3	3.50%	3.534%		3.46%	30년물	4.160%	-4.2
2024.08.13(화)	210.9		3.57%	3.579%		3.49%	10Y-2Y	-8.9	2.5

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금후업 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,621.50	3.20	26.12.10	국고 23-10	2,000	은행채 8,000	은행채 6,000	통안채 1년물 6,000억원 입찰
KOSDAQ	764.86	-7.86	34.06.10	국고 24-5	1,310	여전채 3,100	여전채 100	재정증권 28일물 1.00조원 입찰
달러-원	1,366.50원	-3.10원	25.12.10	국고 22-13	1,000	회사채 107	회사채 50	
국고3Y	2.918%	-2.8	51.03.10	국고 21-2	-100	공사채 1,500		
국고10Y	2.974%	-2.6	25.06.10	국고 15-2	-210			
국고10Y-3Y	5.6	0.2	24.09.10	국고 19-5	-800			

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	5.37	5.32	5.35	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.38	5.33	5.36	-0.02
1W	5.46	5.36	5.41	-0.01	1W	5.43	5.38	5.41	0.00
1S	5.50	5.40	5.45	0.00	1S	5.52	5.42	5.47	-0.02
3S	5.38	5.28	5.33	0.00	3S	5.45	5.35	5.40	-0.01
6S	5.15	4.95	5.08	-0.01	6S	5.20	5.00	5.15	0.00
1YR	5.10	4.70	4.98	-0.02	1YR	5.20	4.80	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	-8/-6	-7	5.34	-0.26	3.50	5.34000	1M MAR	-250	-245
TN	-20/-14	-17	5.73	0.13	3.50	5.33993	1W*1S	-222	-218
1W	-63/-53	-58	5.68	0.00	3.50	5.33954	1*2	-225	-220
1S	-300/-270	-285	5.70	0.01	3.48	5.33777	1*3	-490	-480
3S	-800/-750	-775	5.63	-0.02	3.43	5.11602	1*6	-1220	-1210
6S	-1570/-1470	-1520	5.60	-0.01	3.40	4.80431	1*9	-1740	-1720
1YR	-2610/-2510	-2560	5.23	0.00	3.30	4.34795	1*12	-2240	-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)

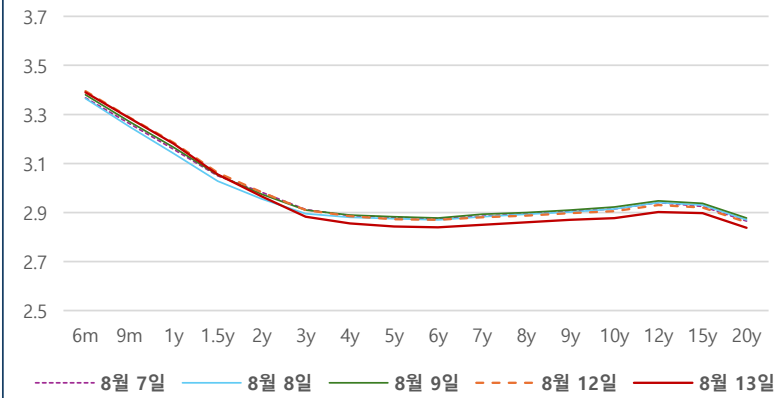
IRS 데일리 증가

8월 13일

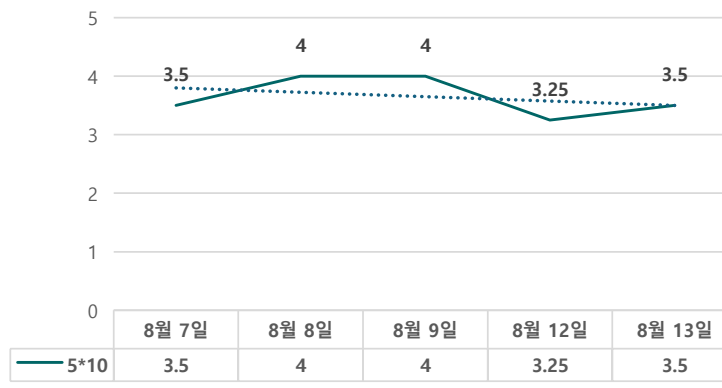
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3900	-0.50
9m	3.2850	-0.25
1y	3.1800	-0.50
1.5y	3.0550	-0.75
2y	2.9650	-1.75
3y	2.8825	-2.75
4y	2.8550	-3.00
5y	2.8425	-3.00
6y	2.8400	-3.00
7y	2.8500	-3.00
8y	2.8600	-2.75
9y	2.8700	-2.75
10y	2.8775	-2.75
12y	2.9025	-2.75
15y	2.8975	-2.25
20y	2.8375	-2.25

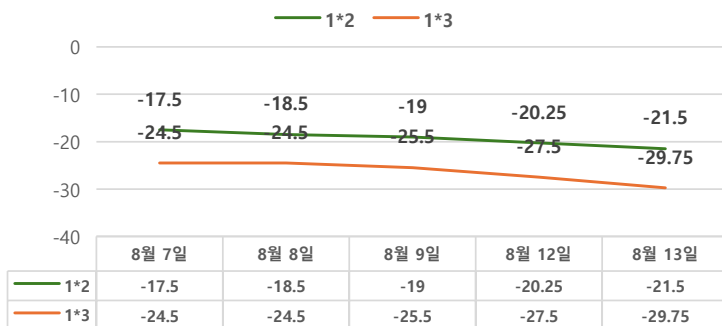
IRS 증가



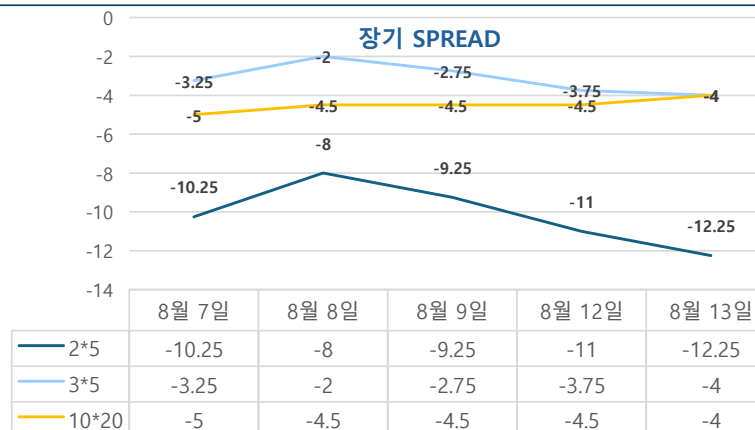
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

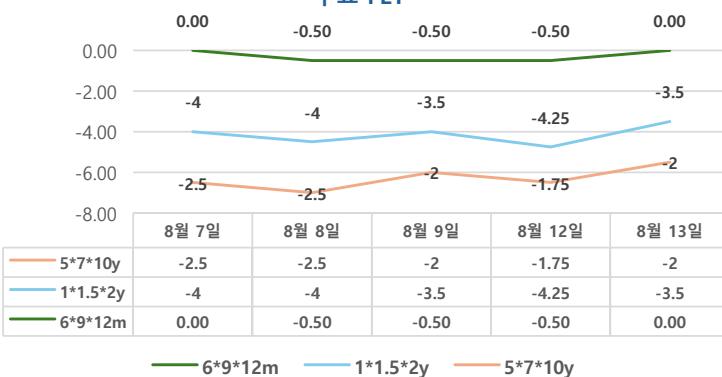


IRS 주요 커브

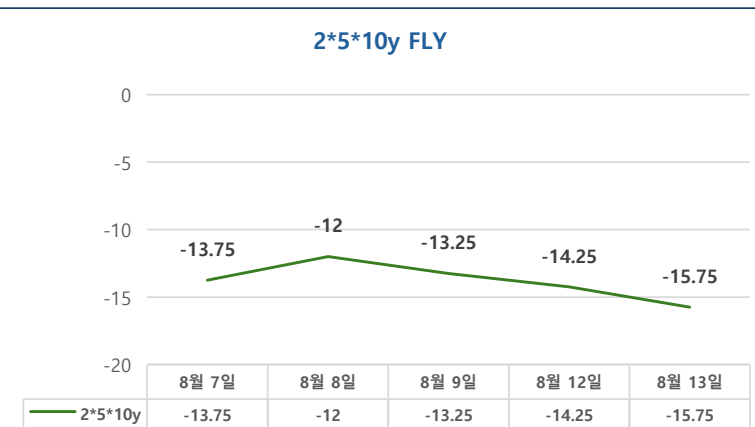
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-21.50	-1.25
1*3y	-29.75	-2.25
2*5y	-12.25	-1.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	3.50	0.25
10*20y	-4.00	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.50
1*1.5*2y	-3.50	0.75
2*5*10y	-15.75	-1.50
5*7*10y	-2.00	-0.25