

<b>레포</b>	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.
<b>채권</b>	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.
<b>MONEY</b>	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.
<b>FX SWAP</b>	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.
<b>IRS</b>	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	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

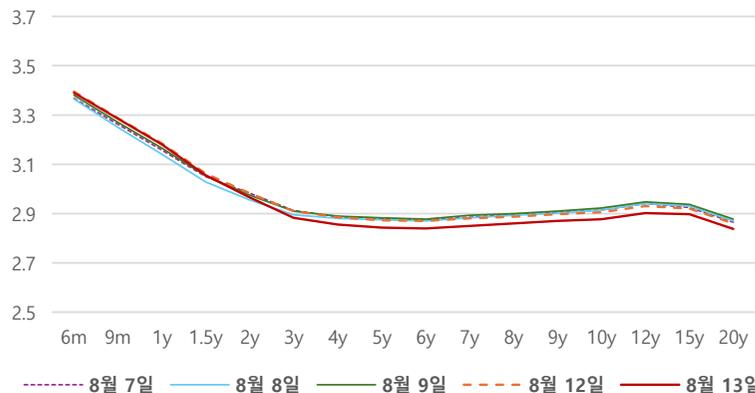
IRS 데일리 증가

8월 13일

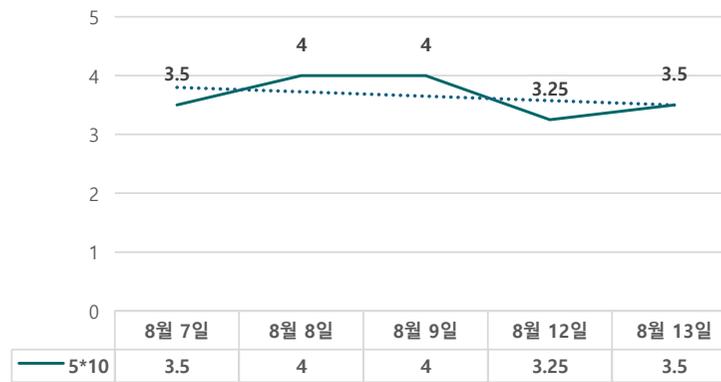
단위 : %, bp

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

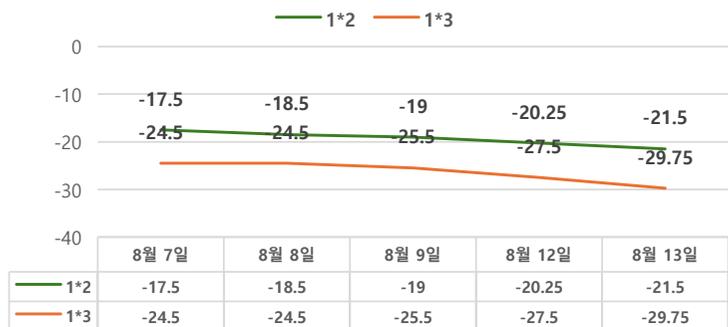
IRS 증가



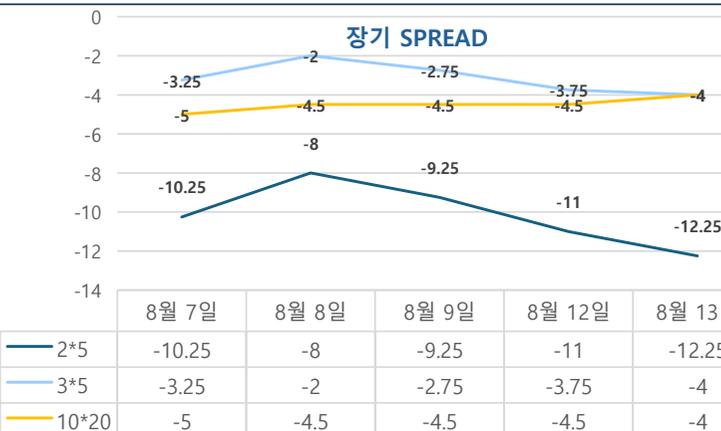
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

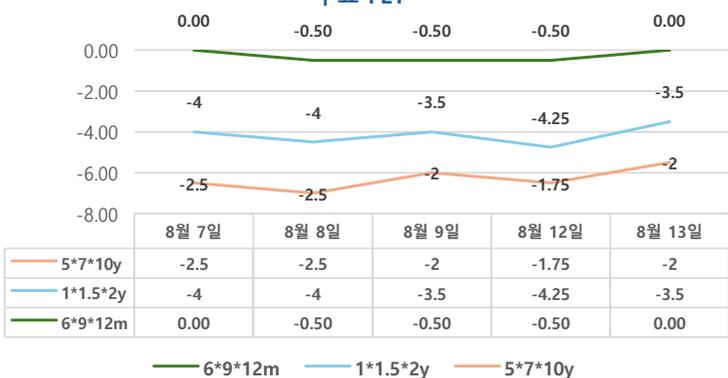


IRS 주요 커브

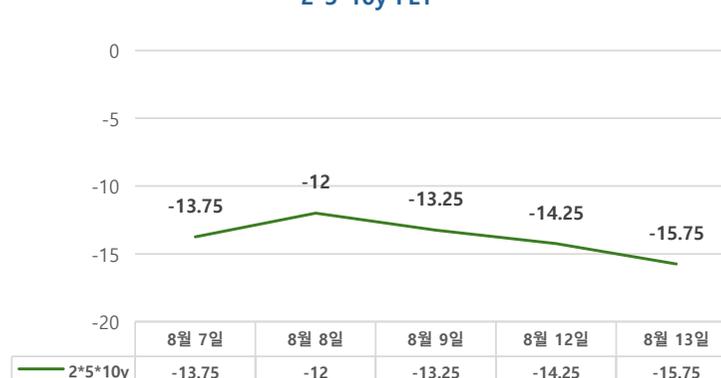
SPREAD

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