

Market Daily Report

2024.08.19(월)



레포	조달금리 하락과 함께 시중은행 조달 증가하여 매수 자금 일시에 소진됐으며, 장 중 저금리 거래 제한적이었음. 오후에 일부 매도 정체를 겪었으나 운용사 및 신탁 추가 자금 유입되어 큰 어려움 없이 마무리 되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 미국 7월 소매판매 호조를 반영함. 미국 : 미 국채 금리는 하락 마감. 전날 미국 소비자지표 호조에 국채가격 급락으로 대응했던 채권시장은 이날 반발 매수세의 유입 속에 레벨을 추가로 조정함. 미국 경기에 대한 소비자들의 자신감을 반영하는 소비자심리지수는 67.8로 소폭 개선됨. 또한 향후 경기에 대한 전망을 나타내는 소비자지대지수는 72.1을 기록함.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 대만의 화롄지역 지진 (시장에는 큰 영향은 없었음)과 일본의 태풍 영향권 우려로 대만과 일본지역의 호가가 제한적이며, 주말을 앞두고 북클로징을 일찍 마무리 하려는 움직임으로 대체적으로 한산한 장세를 보였음. 서울 렌더의 오퍼로 2주-1개월물은 5.47-5.49 사이로 역의 시장에 제시되었고, 연준의 빅컷 가능성이 낮아짐에 따라 장기 렌더 입장에서 좀더 여유가 생겨 공격적인 오퍼대신 DAILY 레벨 변동에 좀더 집중하는 모습. 반면, 8월말 마감 전 자산 포지션 커버를 위한 6개월물 차입이 우위를 보이며, 중국계 동경 센터의 비드가 5.20 이상으로 PAY 되면서 5.22 까지 거래 소식 전해져 그동안의 장기 구간 레벨 하락세에 제동을 거는 모습. 1년물 호가는 SOFR 금리 대비 스프레드가 급격히 벌어지면서 아시아 마켓 DEPO 시장에서 체결은 매우 제한적임.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 미국 소매판매 호조 및 고용 지표 발표로 미 경기침체 우려가 약해지면서 1년 만기물이 최근 상승분을 일부 되돌리면서 하락함. 1년 만기물의 증가는 전장보다 40전 내린 -25.20원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 10전 내린 -14.90원의 증가를 기록함. 미국 소매 판매가 시장 예상치보다 양호하게 나오에 따라 미 국채금리가 큰 폭으로 상승한 영향을 받아 미국 9월 금리 인하 가능성이 선반영된 장기물 중심으로 하락세를 보임. 시장 전체적으로 수급이 많진 않았고 미 국채 금리 움직임에 따라 스와프포인트가 영향 받을 것으로 예상됨..
IRS	전일 IRS는 2-3년 중단기 위주로 상승 마감. 미국 소매 판매 호조로 글로벌 채권 시장이 약세를 보이면서 IRS 역시 이에 연동되어 움직였으며, 전일 미국 장의 영향을 받아 2-3년 구간으로 비드가 강하게 나오는 모습을 보임. 장 초반에 5년 쪽으로 비드가 올라오면서 86에 거래가 이뤄졌으며, 이후 전반적으로 고요한 분위기를 띠. 장 막판에 3년쪽으로 호가가 꾸준히 형성되면서 90에 여러 차례 거래 됐으며, 1년이 20.75/20.25에 대치를 이루다 오퍼가 소폭 내려오면서 20.5-20.25에 거래가 이뤄짐. 이후 2*3년 비드가 -9.25까지 올라오면서 커브 레벨이 움직이는 모습을 보임. 마감 이후에도 3년쪽으로 오퍼가 꾸준히 나오면서 90에 초이스가 되면서 몇차례 90에 거래가 이뤄졌으며, 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.51에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.08.09(금)	215.3	201.2	3.50%	3.531%	3.500%	3.47%	2년물	4.052%	-4.5
2024.08.12(월)	216.7	199.3	3.50%	3.534%		3.46%	5년물	3.759%	-3.2
2024.08.13(화)	210.9	197.5	3.57%	3.579%		3.49%	10년물	3.884%	-3.1
2024.08.14(수)	212.3	197.1	3.55%	3.561%		3.49%	30년물	4.142%	-3
2024.08.16(금)	214.1		3.53%	3.554%		3.51%	10Y-2Y	-16.8	1.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부형 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,697.23	52.73	25.07.09	통안채	2,000	회사채 351	은행채 4,500	국고채 10년 20,000억원 입찰
KOSDAQ	786.33	9.50	26.12.10	국고 16-8	800		여전채 1,800	통안채 91일물 5,000억원 입찰
달러-원	1,351.30원	-6.70원	72.09.10	국고 22-12	600		회사채 518	
국고3Y	2.928%	4	25.10.18	산금채	-500			
국고10Y	2.973%	2.8	26.09.10	국고 21-7	-710			
국고10Y-3Y	4.5	-1.2	25.03.10	국고 23-3	-1,000			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.32	5.36	-0.01	O/N	5.38	5.33	5.35	0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.38	5.33	5.36	0.01
1W	5.46	5.36	5.41	0.00	1W	5.43	5.38	5.41	0.01
1S	5.50	5.40	5.45	0.00	1S	5.52	5.42	5.48	0.02
3S	5.40	5.30	5.35	0.02	3S	5.45	5.35	5.40	0.00
6S	5.15	4.95	5.08	0.00	6S	5.25	5.05	5.15	0.00
1YR	5.10	4.70	4.98	0.00	1YR	5.20	4.80	5.10	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, % , %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-25/-21	-23	5.54	0.05	3.50	5.33000	1M MAR	-262	-258
TN	-10/-6	-8	5.62	0.00	3.50	5.33037	1W*1S	-193	-187
1W	-60/-54	-57	5.66	0.00	3.50	5.33261	1*2	-260	-250
1S	-265/-245	-255	5.68	0.00	3.48	5.34157	1*3	-500	-490
3S	-775/-735	-755	5.65	-0.03	3.44	5.10155	1*6	-1220	-1200
6S	-1550/-1450	-1500	5.63	0.03	3.41	4.78062	1*9	-1740	-1720
1YR	-2570/-2470	-2520	5.22	0.03	3.31	4.28661	1*12	-2240	-2200

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)

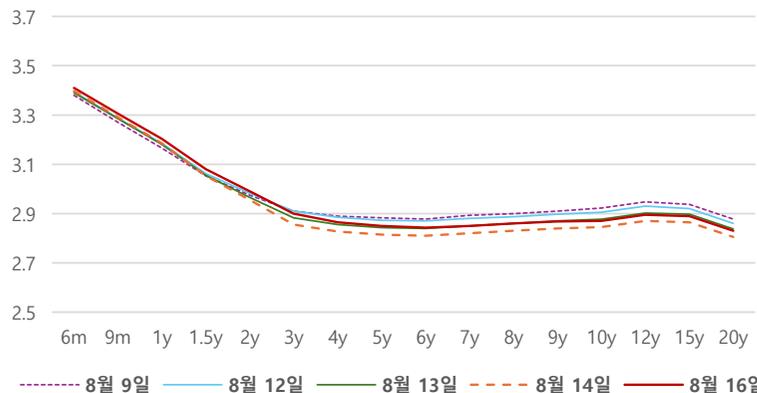
IRS 데일리 증가

8월 16일

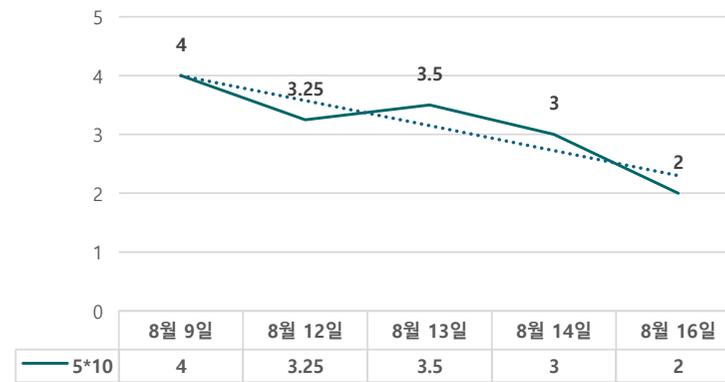
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4100	1.25
9m	3.3050	1.50
1y	3.2025	1.75
1.5y	3.0800	2.75
2y	2.9900	3.50
3y	2.9000	4.50
4y	2.8650	3.75
5y	2.8500	3.50
6y	2.8425	3.25
7y	2.8500	3.00
8y	2.8600	3.00
9y	2.8675	2.75
10y	2.8700	2.50
12y	2.8950	2.50
15y	2.8900	2.50
20y	2.8300	2.50

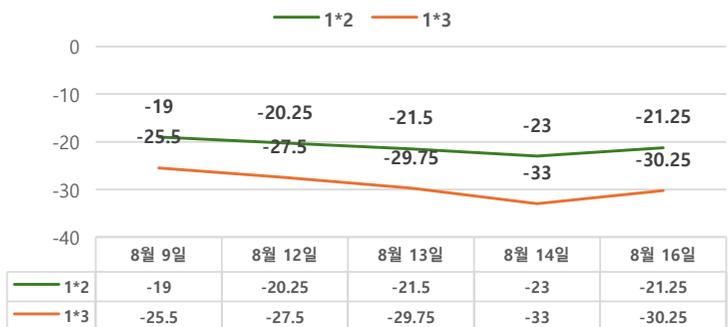
IRS 증가



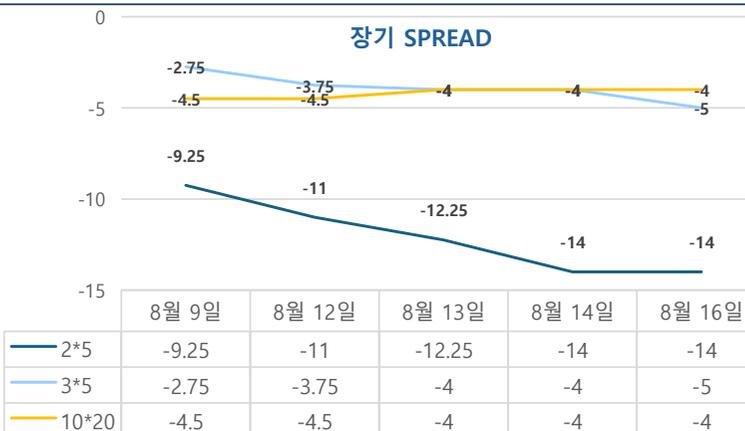
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

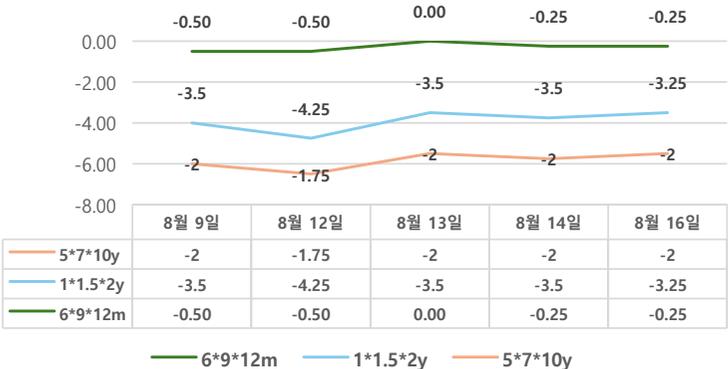


IRS 주요 커브

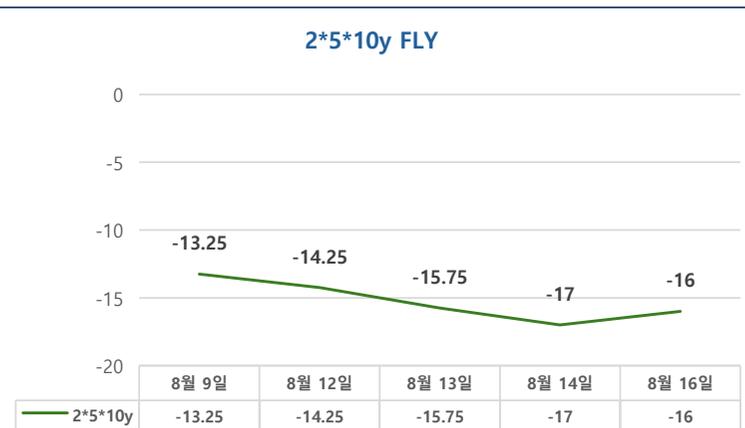
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-21.25	1.75
1*3y	-30.25	2.75
2*5y	-14.00	0.00
3*5y	-5.00	-1.00
5*10y	2.00	-1.00
10*20y	-4.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-3.25	0.25
2*5*10y	-16.00	1.00
5*7*10y	-2.00	0.00