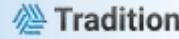


Market Daily Report



2024.08.21(수)

레포	건보자금 유효한 가운데 공자기금 추가 유입되어 조달금리 하락했으며, 한은RP매입 만기 영향으로 시중은행 조달 꾸준하였음. 오전 중 은행권 조달 대부분 마무리 되어 추가 매도 많지 않았고, 장 중 잉여세 크지 않아 저금리 거래 제한적이었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 한은 금통위와 미국 잭슨홀 회의 등 이번 주 예정된 대형 이벤트를 앞두고 뚜렷한 방향성 없이 대외 금리와 연동한 장세가 지속되는 모습. 미국 : 미 국채 금리는 전구간 하락하며 강세 지속. 이달 초 시장을 뒤흔들었던 경기침체 우려가 어느 정도 해소되면서 9월 '빅컷'에 대한 기대감도 많이 약화됨. 다음 날 공개되는 미국 연간 비농업 고용 수정치에 대한 불안감이 국채가격에 선반영됐다는 시각도 존재.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 외국인 국내 주식 매수 및 환율 하락으로 온소 달러 자금은 일부 역외에서 유입 되는 영향도 있고, 환율 하락 기조에 맞서 기존 대고객 예금 물량 해지 및 매도 가능성 그리고 월말 자금 수요 영향으로 시중은행별 DAILY 자금 변동성도 있을 것으로 예상됨. 8월말 구간 접어들면서 월말 커버를 위한 펀딩으로 역외 시장은 단기를 위주의 상승세를 이끌고 있어 2주물은 5.46-5.48까지 일본계 및 대만계로 체결 소식 전해지면서 1개월물 -3개월물 차입 레벨도 동반 상승중. SOFR 금리 대비 1개월물 15-17bp 3개월물 30bp 가량 스프레드 감안된 All in 금리로 거래 되고 있음.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 미국 연준 금리 인하 기대감과 위험 선호 심리가 강세 재료가 되어 장기를 위주로 상승함. 1년 만기물의 증가는 전장보다 60전 오른 -24.80원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 20전 오른 -14.70원의 증가를 기록함. 외환자금시장은 월 초의 경기침체 우려에 따른 약세를 되돌리려는 움직임으로 장기를 중심의 강세가 이어짐. 달러-원 환율은 전날 급락한 기세가 이어져 장 초반 1,325원까지 하락했다가 최종 1,333원에 안착했고 코스피 역시 상승 마감함. 경기 침체 공포에 이어진 약세 움직임을 되돌리려는 장세가 이어질 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 특별한 요인 없이 국채선물 흐름과 연동되면서 8월 금융통화위원회를 대기하는 분위기를 보임. 전반적으로 고요한 모습을 보였으며, 6개월쪽으로 비드가 올라 오면서 장 초반 42에 거래됐으며 1년이 22에 거래가 이뤄짐. 이후 1*3년 비드가 계속해서 올라오면서 -29.5/-30에 대치를 이루다 -29.5에 거래되면서 커브 레벨이 움직였으며, 이후 시장에서 -30까지 거래 소식이 들림. 오후들어 2년과 5년쪽으로 호가가 나오는 모습을 보였으며, 2년이 2.5에 거래됐고 5년 오피와 2년 비드가 엮이면서 2*5년 이 -14.5/-14.75에 대체되다 -14.5에 거래가 됨. 장 막판에는 1년이 22.5/22.25에 대체되다 22.25에 거래가 됐으며, 3년 오피가 내려오면서 93.25에 거래가 이뤄짐. 장 마감된 이후에도 1년쪽으로 호가가 계속 형성되면서 22.25에 nd로 거래됨.

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
2024.08.13(화)	210.9	197.5	3.57%	3.579%	3.500%	3.49%	2년물	3.988%	-8.2
2024.08.14(수)	212.3	197.1	3.55%	3.561%		3.49%	5년물	3.690%	-6.9
2024.08.16(금)	214.1	199.1	3.53%	3.554%		3.51%	10년물	3.809%	-6.4
2024.08.19(월)	218.3	201.1	3.53%	3.538%		3.51%	30년물	4.062%	-6.2
2024.08.20(화)	216.4		3.51%	3.523%		3.51%	10Y-2Y	-17.9	1.8

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	2,696.63	22.27	26.12.10	국고 16-8	1,600	회사채 1,150	은행채 3,900	통안채 3년물 11,000억원 입찰
KOSDAQ	787.44	9.97	26.03.10	국고 24-3	1,000	공사채 3,600	여전채 900	재정증권 63일물 1.00조원 입찰
달러-원	1,332.50원	-2.30원	25.06.10	국고 22-4	1,000		회사채 70	
국고3Y	2.944%	1.7	28.03.10	국고 23-1	-25			
국고10Y	2.999%	1.4	53.03.10	국고 23-2	-95			
국고10Y-3Y	5.5	-0.3	25.03.10	국고 23-3	-100			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.32	5.36	0.00	O/N	5.36	5.31	5.34	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.38	5.33	5.35	-0.01
1W	5.47	5.37	5.41	-0.01	1W	5.43	5.38	5.40	-0.01
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.52	5.42	5.47	-0.01
3S	5.48	5.38	5.43	0.03	3S	5.45	5.35	5.38	-0.02
6S	5.19	4.99	5.12	0.02	6S	5.25	5.05	5.15	-0.03
1YR	5.17	4.77	5.05	0.02	1YR	5.20	4.90	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	5.66	0.00	3.50	5.32000	1M MAR	-266	-264
TN	-9/-7	-8	5.67	0.01	3.50	5.31969	1W*1S	-212	-208
1W	-63/-57	-60	5.82	0.04	3.50	5.31785	1*2	-245	-235
1S	-275/-265	-270	5.77	0.03	3.48	5.31017	1*3	-495	-485
3S	-780/-750	-765	5.75	0.03	3.46	5.12612	1*6	-1200	-1190
6S	-1500/-1440	-1470	5.63	-0.03	3.43	4.84132	1*9	-1730	-1710
1YR	-2530/-2430	-2480	5.28	0.05	3.34	4.39539	1*12	-2200	-2180

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)

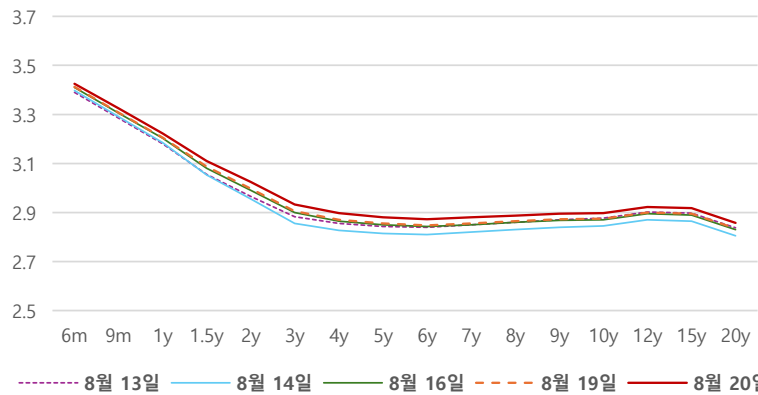
IRS 데일리 증가

8월 20일

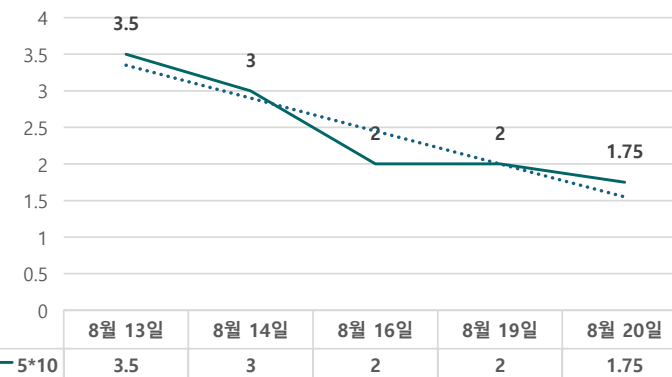
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4250	1.25
9m	3.3250	1.75
1y	3.2225	1.75
1.5y	3.1100	2.25
2y	3.0250	2.75
3y	2.9325	2.75
4y	2.8975	2.75
5y	2.8800	2.50
6y	2.8725	2.50
7y	2.8800	2.50
8y	2.8875	2.25
9y	2.8950	2.25
10y	2.8975	2.25
12y	2.9225	2.25
15y	2.9175	2.25
20y	2.8575	2.25

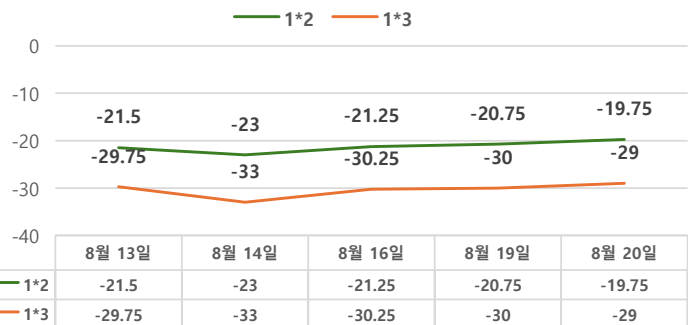
IRS 증가



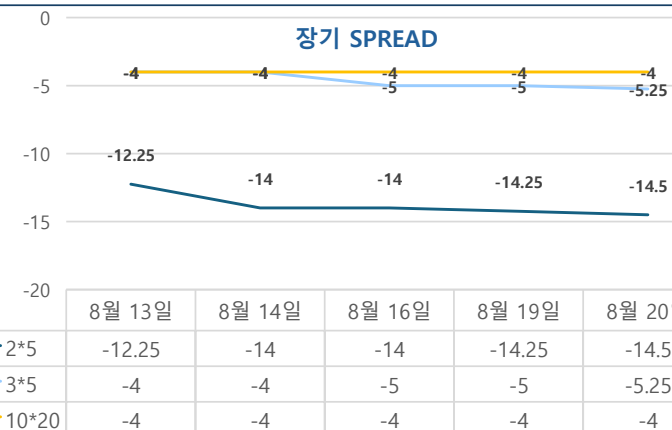
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

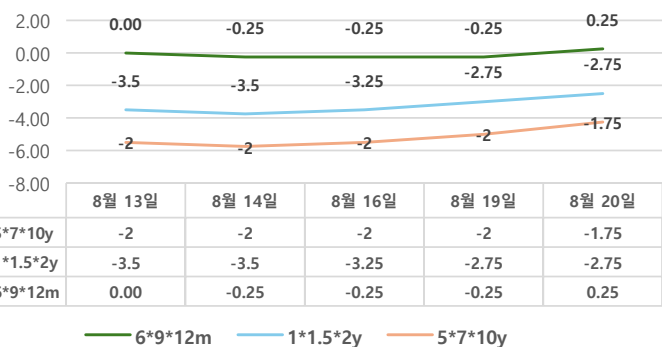


IRS 주요 커브

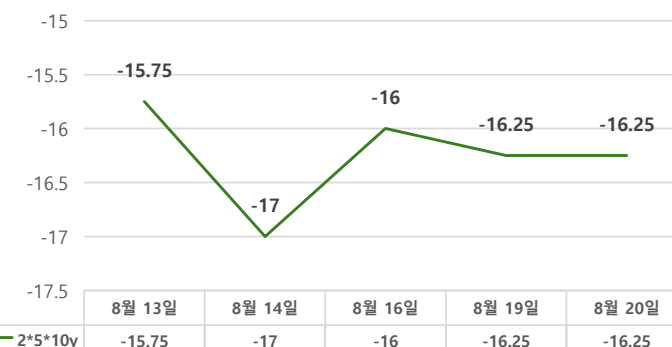
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-19.75	1.00
1*3y	-29.00	1.00
2*5y	-14.50	-0.25
3*5y	-5.25	-0.25
5*10y	1.75	-0.25
10*20y	-4.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.50
1*1.5*2y	-2.75	0.00
2*5*10y	-16.25	0.00
5*7*10y	-1.75	0.25