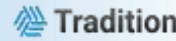


# Market Daily Report



2024.08.22(목)

<b>레포</b>	건보자금 이탈하여 조달금리 소폭 상승했음에도 시중은행 매도 계속됐으며, 잉여 자금 이력시간에 소진되었음. 장 중 은행 및 운용사 매수 자금 지속 유입되어 체결금리 소폭 하락했으나 추가 거래 규모 크지 않았음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 중단기 및 장기 구간에서 소폭 하락. 다음날 한은 금통위를 앞두고 시장의 경계 심리가 강했던 것이 요인. 또한 외국인의 적극적인 매수세도 제한되면서 강세폭을 점차 반납한 모습. 미국 : 미 국채는 30년물 제외 강세 지속. 미국의 비농업 부문 연간 고용 규모가 기존 수치보다 대폭 줄어든 것으로 집계된 데다 7월 FOMC 회의에서 9월 금리인하를 지지하는 목소리가 컸다는 소식에 매수 심리가 강화.
<b>MONEY</b>	금일 머니 시장은 중국 본토 저점 오퍼로 중국계 네임 1주 5.35 2주 5.40 까지 거래되면서 월말 구간이지만 중국계 네임들의 단기 차입 수요가 크지 않아, 시장 전반적으로 레벨 급등세는 제한적임. 다만, 중국계간 거래 외에 대만계, 포린, 한국계 은행들의 단기 레벨은 현재 중국계 보다 높게 형성 및 거래 되면서 1주 5.41-5.42, 2주 5.45-5.47까지 TAKEN 되는 등 중국계를 제외하고는 월말 커버 구간의 상승 기조는 유지되고 있음. 3개월물도 대만계 & 한국계는 5.40 이상을 터치하고 있으나, 중국계로는 역의 3달물 오퍼가 5.40에 대기 중인 상황으로 MAX 3개월물 까지는 중국계 은행 레벨이 좀더 낮은 레벨로 거래되고 있음. 이는 최근 중국의 경기침체를 예상해 신규 대출 감소로 중국계 은행들의 자산 매칭 수요가 일부 감소하고 있고, 중국의 부양 정책에 따라 중국 본점 은행들의 유동성 공급은 이어지고 있는 점을 감안해 상대적으로 규모가 큰 중국계 은행들의 레벨이 안정적인 수준 유지중.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 전일에 이어 이틀째 장기를 중심으로 강세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 70전 오른 -24.10원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 20전 오른 -14.50원의 증가를 기록함. 미국 2년 국채금리 하락과 이전에 발표된 미 고용지표가 하향 조정될 수 있다는 전망이 나오에 따라 미 연준의 금리 인하 기대를 강화했고 한미 양국 간 금리 차가 축소될 것이라는 전망이 강세 재료로 작용함. 6개월물과 1년물과 같은 장기물은 역의 재정 거래 수요에 따라 강세를 나타내고 있는 것으로 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 소폭 상승 마감. 한국은행 금융통화위원회를 앞두고 이번 금통위에서 매파적 발언이 경우 금리가 되돌림으로 상승할 수 있다는 경계심이 작용되는 분위기를 띠. 전반적으로 국채선 물 흐름에 연동되어 움직였으며, 장 초반에 2년쪽으로 오퍼가 내려오면서 0.25/00에 대치를 이루다 00에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 이후 00에 초이 스까지 이루는 모습을 보였으며, 이후 초단기 쪽으로 6*9개월 스프레드 호가가 형성되면서 -9.5에 거래됨. 1년과 1.5년쪽으로 오퍼가 꾸준히 나오면서 1년이 21.75에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 1년이 22.5/22에 대치되다 22.25에 거래됐으며, 6*9개월이 -9.25까지 거래되면서 단기쪽 레벨이 움직임. 이후 2*3년 비드가 -9까지 올라오고, 1*2년이 -19.5까지 올라오면서 커브 레벨이 움직였으며, 마감 이후에는 1.5년이 11/10.75에 대치되다 11에 거래가 이뤄짐. 이날 양도성예금증서(cd) 상승하여 3.52이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.08.14(수)	212.3	197.1	3.55%	3.561%	3.500%	2년물	3.935%	-5.3
2024.08.16(금)	214.1	199.1	3.53%	3.554%		5년물	3.659%	-3.1
2024.08.19(월)	218.3	201.1	3.53%	3.538%		10년물	3.802%	-0.7
2024.08.20(화)	216.4	200.4	3.51%	3.523%		30년물	4.079%	1.7
2024.08.21(수)	214.8		3.53%	3.536%		10Y-2Y	-13.3	4.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,701.13	4.50	24.10.24	재정채	6,700	은행채 8,300	은행채 24,400	-
KOSDAQ	779.87	-7.57	25.03.10	국고 20-1	2,000	여전채 1,530	여전채 600	
달러-원	1,334.80원	2.30원	26.12.10	국고 23-10	1,200	회사채 401	회사채 203	
국고3Y	2.940%	-0.4	43.09.10	국고 23-9	-230		공사채 1,800	
국고10Y	2.997%	-0.2	25.06.10	국고 22-4	-653			
국고10Y-3Y	5.7	0.2	25.06.10	국고 15-2	-1,700			

Money Market Closing									
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	0.00
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.36	5.31	5.34	-0.01
1W	5.47	5.37	5.41	0.00	1W	5.43	5.35	5.40	0.00
1S	5.53	5.43	5.48	0.01	1S	5.52	5.42	5.47	0.00
3S	5.47	5.37	5.42	-0.01	3S	5.45	5.35	5.38	0.00
6S	5.17	4.97	5.10	-0.02	6S	5.25	5.05	5.18	0.03
1YR	5.15	4.75	5.03	-0.02	1YR	5.15	4.90	5.00	-0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.65	-0.01	3.50	5.32000	1M MAR	-257	-255
TN	-10/-8	-9	5.92	0.25	3.50	5.31972	1W*1S	-205	-195
1W	-62/-56	-59	5.77	-0.05	3.50	5.31807	1*2	-250	-240
1S	-265/-255	-260	5.74	-0.03	3.48	5.31145	1*3	-515	-505
3S	-800/-760	-780	5.72	-0.03	3.46	5.12108	1*6	-1180	-1170
6S	-1480/-1420	-1450	5.60	-0.03	3.43	4.82768	1*9	-1690	-1670
1YR	-2460/-2360	-2410	5.20	-0.08	3.34	4.37834	1*12	-2140	-2120

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)

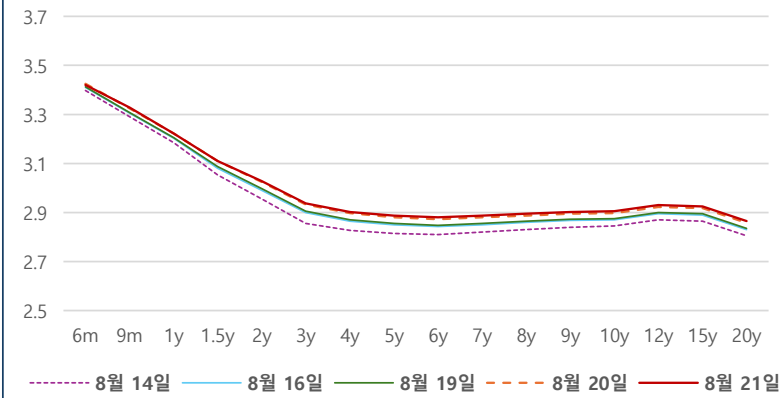
IRS 데일리 증가

8월 21일

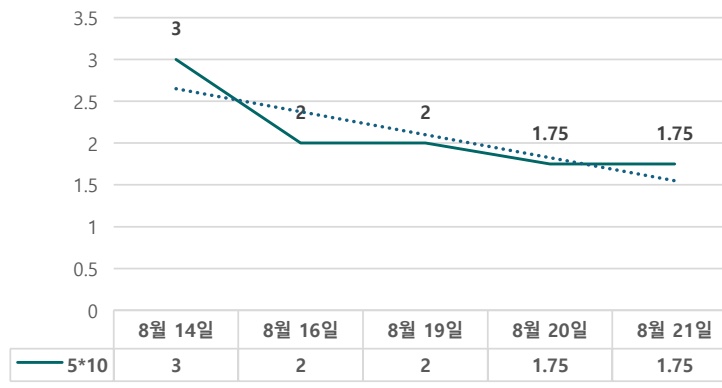
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4200	-0.50
9m	3.3275	0.25
1y	3.2225	0.00
1.5y	3.1100	0.00
2y	3.0275	0.25
3y	2.9375	0.50
4y	2.9025	0.50
5y	2.8875	0.75
6y	2.8800	0.75
7y	2.8875	0.75
8y	2.8950	0.75
9y	2.9025	0.75
10y	2.9050	0.75
12y	2.9300	0.75
15y	2.9250	0.75
20y	2.8650	0.75

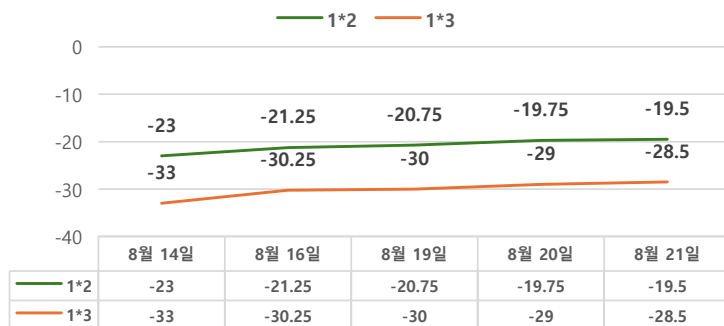
IRS 증가



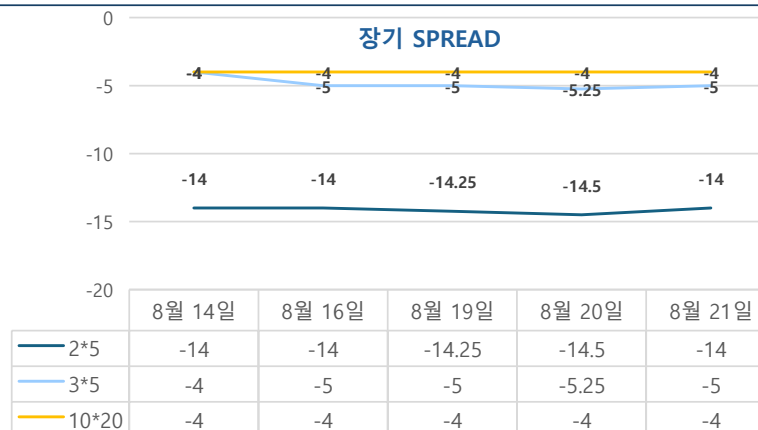
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

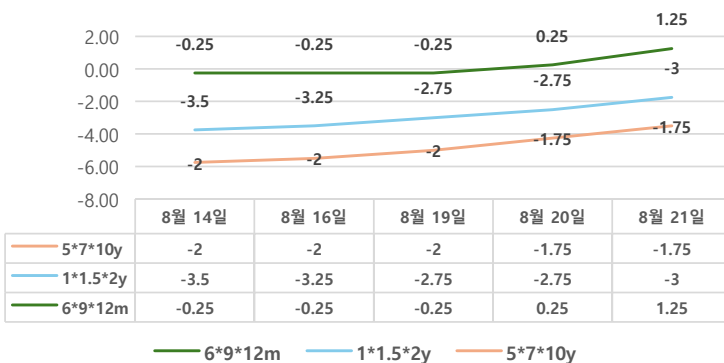
구분	증가	전일대비
1*2y	-19.50	0.25
1*3y	-28.50	0.50
2*5y	-14.00	0.50
3*5y	-5.00	0.25
5*10y	1.75	0.00
10*20y	-4.00	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	1.25	1.00
1*1.5*2y	-3.00	-0.25
2*5*10y	-15.75	0.50
5*7*10y	-1.75	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY

