

Market Daily Report

2024.08.23(금)



레포	당일지준 양전환하여 은행권 매도 소폭 감소했으며, 시장 유동성 풍부해 조달여건 양호한 모습을 보임. 장 중 매수 수요 꾸준했으나 시중은행 및 증권사 매도 희망금리 낮아 추가 거래 제한적이었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락. 금통위는 다소 매파적으로 해석됐으나 외국인 투자자가 국채선물을 대거 사들여 강세 압력을 가한 데 영향을 받은 모습. 미국 : 미 국채 가격은 큰 폭으로 하락. 최근 금리인하 기대감으로 가파르게 상승했던 만큼 책سن출 회의를 앞두고 빠르게 반발 매도가 나온 것으로 풀이. 한 주간 신규 실업보험 청구자수는 계절 조정 기준 23만 2천명으로 집계. 이는 직전주보다 4천명 증가한 수치.
MONEY	금일 금통위에서는 시장의 예상대로 기준금리 3.50%로 13회 연속 동결했고 이는 부동산 가격 급등세에 대한 부담과 연준의 9월 FOMC 회의 이후로 인하 시점을 잡고 있는 것으로 시장은 해석하고 있음. 미국의 비농업 연간고용 예비 수치가 시장 예상보다 대폭 하향 조정 (81만8천명 감소) 소식에 9월 연준의 빅컷 가능성이 재부각되고 있으나, 25bp 인하에 초점이 맞춰져 있는 상황. 금일 머니 시장은 월말 커버 구간 1주-2주물이 대세를 이루며, 다음달 FOMC 회의와 아시아 마켓 휴장이 겹쳐있어 FOMC 회의 전인 구간 2주를 선호해 뚜렷해 지고 있음. 기간물은 중국계간 3개월물 5.35-5.38 1년물 4.91-4.95 대치속 일부 체결 소식 전해졌고, 중국계를 제외하고는 장기구간 차입-운용 호가도 드물고 제한적인 상황 유지됨.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 부채 스와프 물량이 집중된 1년 만기물을 중심으로 전반적인 강세를 이어감. 1년 만기물의 증가는 전장보다 50전 오른 -23.60원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 10전 오른 -14.40원의 증가를 기록함. 외화자금 시장은 전반적으로 대부분 만기에서 강세를 이어갔으며 특히 1년 만기물은 3거래일 연속 큰 상승폭을 보여줌. 1년 만기물은 부채 스와프 물량의 유입으로 크게 상승했으나 6개월 만기물은 에셋스와프의 영향으로 상승 폭이 제한되는 모습을 보임. 상승장이 미국 금리 인하가 주요 요인이자기 보다 수급 영향을 더 크게 받는 것으로 보임.
IRS	전일 irs는 8월 금융통화위원회를 소화하면서 하락 마감. 전체적으로 장중 금통위를 소화하면서 금리가 크게 움직인 이후로는 다소 고요한 분위기를 보임. 장 초반 3년 쪽으로 호가가 형성되면서 88.5-90.5에 여러차례 거래됐으며 1*3년이 대치를 이루다 -29.5에 몇차례 거래되는 모습을 보임. 책سن출 미팅이 아직 남아있고, 금통위에서 크게 이슈가 없었던 만큼 전체적으로 거래가 활발한 분위기는 아니었으나 초단기쪽으로 호가가 형성되면서 6*9개월이 -9.5/-10에 대치되다 -10에 거래됨. 장 마감 이후 9*12개월 오퍼가 -10.75까지 내려오면서 커버가 움직였으며, 미국채 움직임에 연동되면서 1년이 19.75, 3년이 90.75에 거래되었고 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.51이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.08.16(금)	214.1	199.1	3.53%	3.554%	3.500%	3.51%	2년물	4.008%	7.3
2024.08.19(월)	218.3	201.1	3.53%	3.538%		3.51%	5년물	3.720%	6.1
2024.08.20(화)	216.4	200.4	3.51%	3.523%		3.51%	10년물	3.854%	5.2
2024.08.21(수)	214.8	200.0	3.53%	3.536%		3.52%	30년물	4.128%	4.9
2024.08.22(목)	212.5		3.53%	3.538%		3.51%	10Y-2Y	-15.4	-2.1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,707.67	6.54	25.06.10	국고 22-4	1,100	은행채 5,000	은행채 3,200	-
KOSDAQ	773.47	-6.40	25.08.21	산금채	800	여전채 10,700	여전채 9,200	
달러-원	1,343.50원	8.70원	54.03.10	국고 24-2	506	회사채 221	회사채 4,910	
국고3Y	2.907%	-3.3	25.09.10	국고 20-6	-1,000	공사채 5,000	공사채 3,877	
국고10Y	2.980%	-1.7	25.03.10	국고 23-3	-1,000			
국고10Y-3Y	7.3	1.6	25.06.10	국고 15-2	-1,000			

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	0.00
1W	5.47	5.37	5.41	0.00	1W	5.42	5.37	5.40	0.00
1S	5.52	5.42	5.47	-0.01	1S	5.52	5.42	5.46	-0.01
3S	5.47	5.37	5.42	0.00	3S	5.45	5.30	5.38	0.00
6S	5.17	4.97	5.10	0.00	6S	5.25	5.05	5.20	0.02
1YR	5.10	4.70	4.98	-0.05	1YR	5.15	4.90	4.95	-0.05

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.39	-0.26	3.50	5.32000	1M MAR	-255	-253
TN	-25/-23	-24	5.66	-0.26	3.50	5.31963	1W*1S	-192	-188
1W	-70/-64	-67	5.76	-0.01	3.50	5.31742	1*2	-270	-260
1S	-265/-255	-260	5.75	0.01	3.48	5.30858	1*3	-500	-490
3S	-780/-750	-765	5.73	0.01	3.46	5.10176	1*6	-1195	-1175
6S	-1470/-1410	-1440	5.61	0.01	3.44	4.81009	1*9	-1670	-1650
1YR	-2410/-2310	-2360	5.16	-0.04	3.33	4.33885	1*12	-2100	-2080

국내의 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)

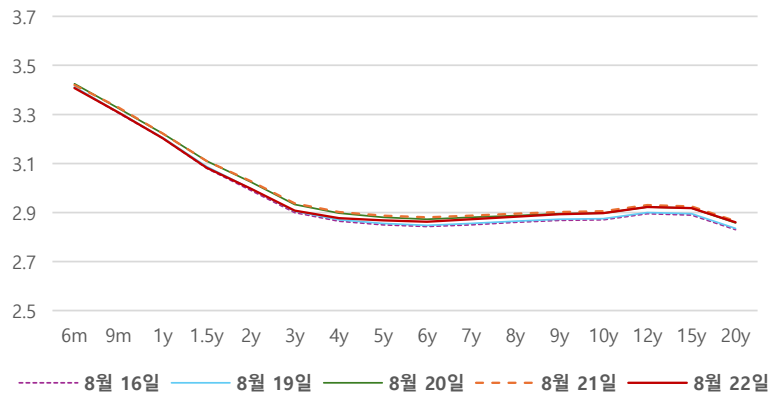
IRS 데일리 증가

8월 22일

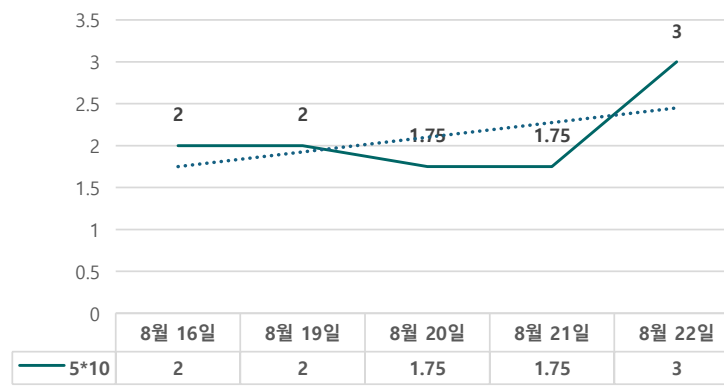
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4075	-1.25
9m	3.3075	-2.00
1y	3.2025	-2.00
1.5y	3.0825	-2.75
2y	2.9975	-3.00
3y	2.9075	-3.00
4y	2.8775	-2.50
5y	2.8675	-2.00
6y	2.8625	-1.75
7y	2.8725	-1.50
8y	2.8825	-1.25
9y	2.8925	-1.00
10y	2.8975	-0.75
15y	2.9175	-0.75
20y	2.8600	-0.50

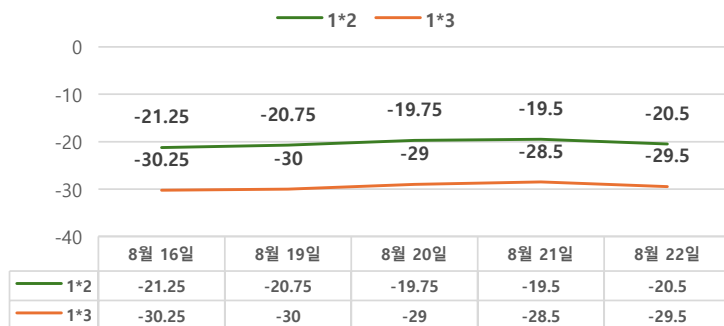
IRS 증가



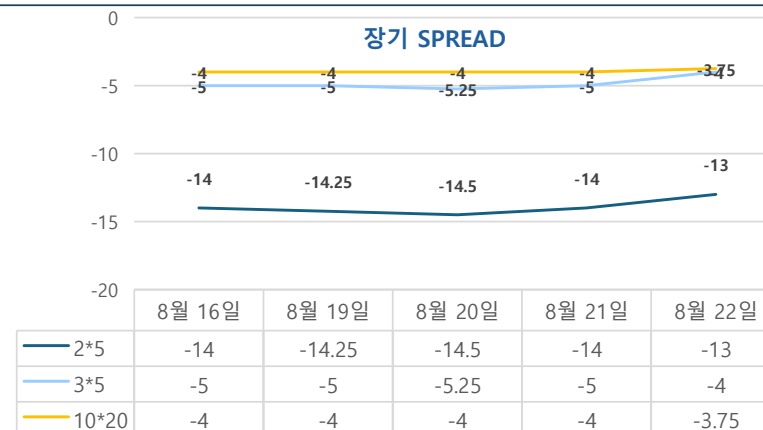
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

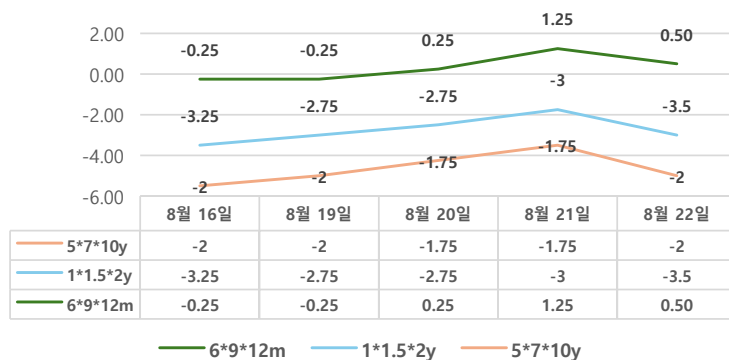


IRS 주요 커브

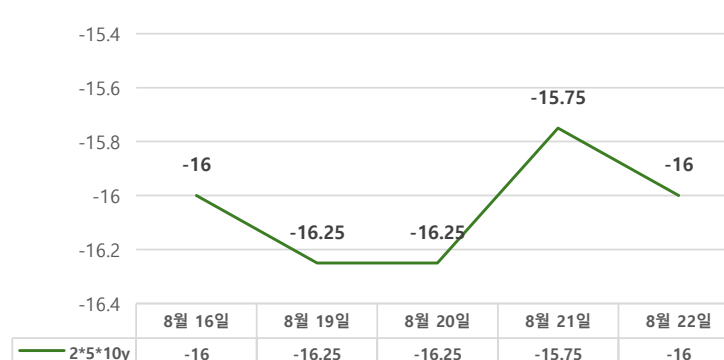
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-20.50	-1.00
1*3y	-29.50	-1.00
2*5y	-13.00	1.00
3*5y	-4.00	1.00
5*10y	3.00	1.25
10*20y	-3.75	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.50	-0.75
1*1.5*2y	-3.50	-0.50
2*5*10y	-16.00	-0.25
5*7*10y	-2.00	-0.25