

레포	월초 운용사 및 은행신탁 유동성 회복되어 금리 소폭 하락한 가운데 조달여건 양호한 흐름을 보임. 시중은행 적수관리를 위한 매도 증가했으며, 장 중 추가 자금 많지 않아 금리 낙폭 제한적이었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 소폭 상승. 별다른 재료가 없는 가운데 국고 30년 입찰 등 수급 요인이 영향을 미친 것으로 풀이됨. 입찰 이후 매도 헤지 물량이 물리자 약세가 가팔라짐. 미국 : '노동절'로 휴장. 유럽 각국의 국채 금리는 상승. 유럽 제조업 PMI가 45.6에서 45.8로 상황 조정된 데 따른 것으로 추정.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 근로자의 날로 뉴욕 휴장에 대체적으로 한산한 분위기 속, 3분기말 커브 1달물 오퍼가 역대외로 제시 되면서 중국계로 5.47-5.48 사이로 일부 거래되었으며, 한국계 및 포린 서울 네임으로 5.43-5.44 수준으로 체결 소식 전해졌음. 1개월물미, 3분기커브 프리미엄+중국 국경절 (10/1-10/7) 휴장 커브 구간으로 만기가 10/8 이후로 진행되면서 Long 한달물 레벨이 기간물 테너 중 시장에서 제일 높게 형성 되자 마켓 오퍼는 1개월물 위주로 역대외로 제시 되고 있음. 그러나, 차입 은행에서는 FOMC 회의 금리 인하 시점 이전으로 매칭 하려는 1-2주물 혹은 비물 매칭을 위한 장기물 6개월물 이상 구간의 차입 수요가 늘면서 레벨차와 테너 매칭이 쉽지 않는 상황. 운소 시중은행들은 대부분 9월말 이내 운용 (3주물 이내)에 집중 할 것으로 예상되나, MMDA 금리가 인하 시점까지 5.38-5.42 사이로 유지 될 경우, 위크물 시장 금리가 5.35-5.40 사이임을 감안했을때 시장으로 나오는 오퍼 물량이 상당히 감소될 가능성도 높아 보임.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 미국 시장 휴장으로 큰 변화 없는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 10전 내린 -22.60원에 형성됐고 6개월 만기물의 증가는 -13.70원으로 전장보다 10전 올랐으나 거래일수 보정 고려시 전장 증가와 동일한 수준을 기록함. 오전 채권시장에서 30년물 입찰 이후 국고채 금리 상승의 영향이 3개월 이상에서 작용했으며 내일부터 미국 제조업 지표나 고용 지표 발표에 따라 방향성이 결정될 것으로 예측됨.
IRS	전일 IRS는 미국의 7월 개인소비지출(PCE)에서 물가 지표는 예상 수준을 나타냈지만, 소비 지표가 예상보다 강하게 나오면서 국내외 금리 상승 압박을 받으며 상승 마 감. 이날 장 초반에는 전체적으로 비교적 한산한 분위기 속에서 시장에서는 1.5, 2.5년쪽으로 호가가 형성되는 모습을 보임. 오후 들어 3년 오퍼가 나오면서 95/94.75에 대치되다 95에 거래가 몇차례 이뤄졌으며, ND/D로 초이스까지 이루게 됨. 4년이 92/91.5에 대치를 이룬다 92에 거래됐으며, 2년이 비드가 2.75까지 올라오는 모습을 보임. 장 막판에는 9*15년 비드가 2.25까지 올라오면서 초장기 커브가 움직였으며, 이후 4년이 92.5까지 비드가 올라오는 모습을 보임. 마감 후에도 1년이 21/20.5에 대 치되다 21에 거래됐으며, 5년 비드가 올라오면서 92.25에 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
2024.08.27(화)	219.3	199.5	3.48%	3.509%	3.500%	3.52%	2년물	3.921%	0
2024.08.28(수)	219.3	200.3	3.48%	3.505%		3.52%	5년물	3.704%	0
2024.08.29(목)	219.8	199.7	3.43%	3.503%		3.52%	10년물	3.905%	0
2024.08.30(금)	211.5	195.4	3.53%	3.543%		3.52%	30년물	4.196%	0
2024.09.02(월)	215.1		3.50%	3.521%		3.52%	10Y-2Y	-1.6	0

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종요가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,681.00	6.69	24.12.03	통안채	4,700	회사채 10,351	은행채 1,500	-
KOSDAQ	769.21	1.55	26.06.10	국고 23-4	1,500	통안채 8,000	여전채 2,900	
달러-원	1,338.50원	1.00원	26.03.10	국고 24-3	1,010	공사채 9,600	회사채 5,250	
국고3Y	2.989%	3.6	25.03.10	국고 20-1	-5		통안채 54,400	
국고10Y	3.121%	3.3	52.03.10	국고 22-2	-199		공사채 2,300	
국고10Y-3Y	13.2	-0.3	43.09.10	국고 23-9	-500			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.32	5.35	-0.06	O/N	5.35	5.30	5.33	-0.12
TN	5.40	5.32	5.36	0.00	TN	5.36	5.31	3.34	-2.03
1W	5.44	5.34	5.39	-0.04	1W	5.42	5.32	5.38	-0.05
1S	5.52	5.42	5.47	-0.02	1S	5.50	5.40	5.48	0.00
3S	5.43	5.33	5.38	0.01	3S	5.40	5.30	5.37	-0.01
6S	5.15	4.95	5.07	0.00	6S	5.20	5.00	5.10	-0.05
1YR	4.99	4.59	4.85	0.00	1YR	5.00	4.80	4.90	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	-	-	-	-	3.50	5.33000	1M MAR	-250	-245
TN	-9/-7	-8	5.66	-	3.50	5.32551	1W*1S	-200	-195
1W	-62/-56	-59	5.77	-0.21	3.50	5.29858	1*2	-250	-240
1S	-255/-245	-250	5.75	-0.15	3.49	5.19535	1*3	-475	-465
3S	-750/-720	-735	5.70	-0.04	3.49	5.01662	1*6	-1090	-1070
6S	-1400/-1340	-1370	5.55	-0.03	3.46	4.70877	1*9	-1570	-1550
1YR	-2300/-2220	-2260	5.14	0.01	3.38	4.21768	1*12	-1970	-1950

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)

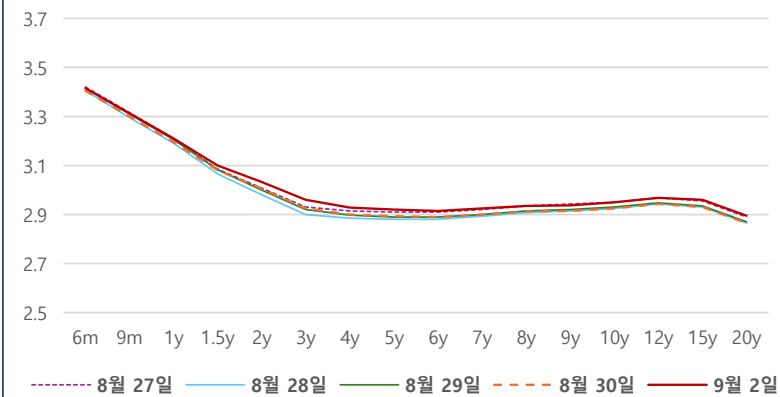
IRS 데일리 증가

9월 2일

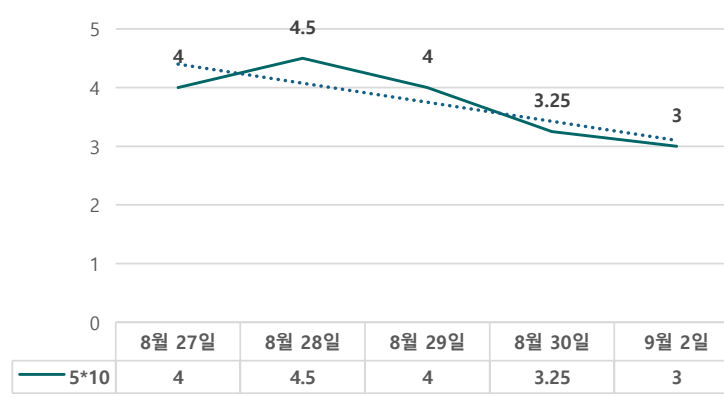
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4150	1.00
9m	3.3125	1.25
1y	3.2100	1.50
1.5y	3.1000	2.00
2y	3.0325	2.75
3y	2.9600	3.50
4y	2.9275	2.75
5y	2.9200	2.75
6y	2.9150	2.50
7y	2.9250	2.50
8y	2.9350	2.25
9y	2.9375	2.25
10y	2.9500	2.50
12y	2.9675	2.50
15y	2.9600	3.00
20y	2.8950	3.00

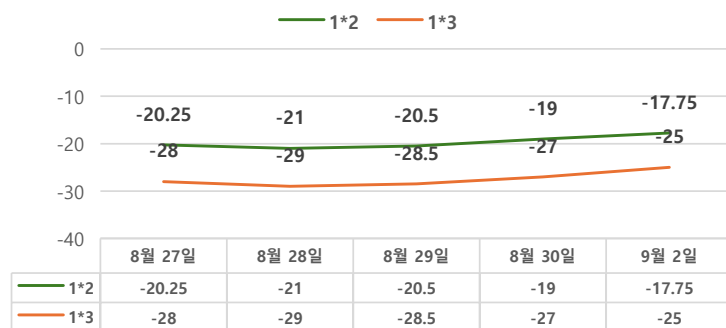
IRS 증가



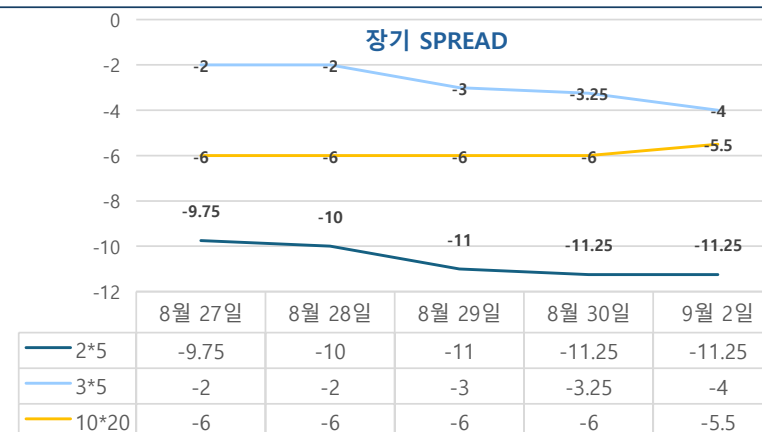
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

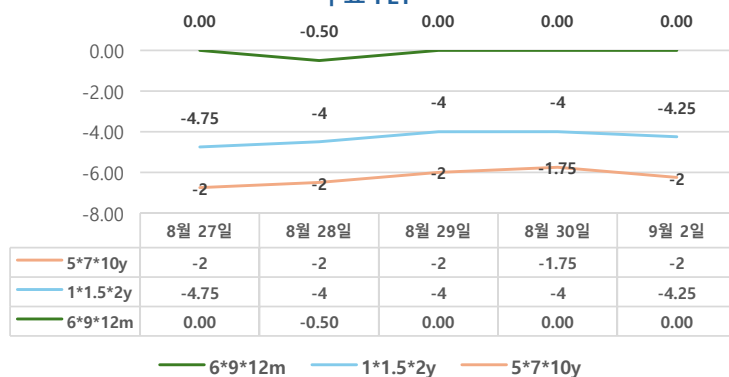


IRS 주요 커브

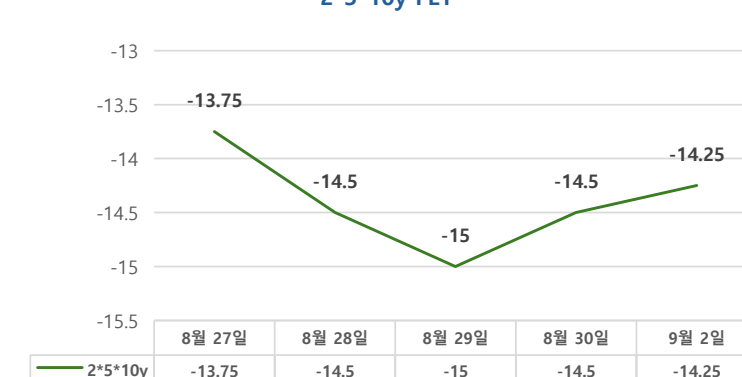
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-17.75	1.25
1*3y	-25.00	2.00
2*5y	-11.25	0.00
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	3.00	-0.25
10*20y	-5.50	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.00
1*1.5*2y	-4.25	-0.25
2*5*10y	-14.25	0.25
5*7*10y	-2.00	-0.25