

레포	운용사 및 은행신탁 유동성 풍부하여 조달금리 하락했으며, 은행별 포지션 상이해 양방향 움직임 혼재했음. 장 초반 조달여건 양호한 듯 했으나 시중은행 및 증권사 매도 추가됨에 따라 장 중 체결금리 소폭 상승하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 미국의 경기침체 공포가 다시금 부각된 상황에 국내 장도 연동되며, 외국인의 동향에 주로 영향을 받은 모습. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 하락 마감. 10년물 금리는 미국 노동부의 7월 구인,이직 보고서가 나오자 3.80%선을 내준 후 꾸준히 낙폭을 확대. 2년물 금리는 장중 기준 지난달 5일 이후 최저치 기록. 7월 JOLTS에 따르면 계절조정 기준 구인 건수는 767만3천건으로, 이는 전달비 23만7천건 줄어든 수치이자 2021년 1월 이후 최저치.
MONEY	금일 머니 시장은 FX 스왑 단기를 레벨이 상승함에 따라, 온쇼 포린 오버나잇 물량이 크지 않아 오전에 5.32-5.35 수준으로 매칭 되었으나 반면 역외 은행들은 초단기 오버나잇 커버 물량의 증가로 체결이 지연되면서 5.37-5.41 수준으로 거래 되었음. 역외 오퍼로 1개월물 5.36-5.37 3개월물 5.36-5.38 6개월물 5.02-5.03 수준으로 한국계 및 포린 네임으로 호가 제시 되었고, 중국계 네임은 센터별 레벨갭을 확대하며 6개월물 5.05-5.15 체결 소식을 전했음. 이는 비율 매칭 건으로 4개월물 이상 구간의 비드가 제시되면서 1-3개월물 비드가 오히려 제한적인 상황.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 미국 공급관리협회에서 발표한 구매관리자지수(PMI)가 예상치보다 저조하고, 미국 국채 금리 하락으로 인해 상승하는 모습을 보임. 1년 만기 물의 증가는 -22.40원으로 거래일수 보정을 고려시 전장보다 40전 상승했고 6개월 만기물 역시 전장보다 10전 오른 -13.60원의 증가를 기록함. 전반적으로 비드 우위의 장세가 형성됐으며 PMI 지표로 인한 미 달러 금리 하락과 역외 비드 매수세가 영향을 미친 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 미국의 경제 침체 우려 재부상으로 큰 폭 하락 마감함. 미국 8월 공급관리협회(ISM) 제조업 구매관리자지수(PMI)가 시장 예상보다 둔화하면서 경기 침체 우려가 급부상했으며, 이에 영향을 받아 국내외 주요 추가지수도 8월 초 나타났던 것과 유사한 폭락세를 나타냄. 이에 연방준비제도(Fed.연준)의 빅컷(50bp) 금리 인하 기대가 다시 자국을 받는 분위기를 보임. 장 초반 2년 비드가 올라오면서 98.25에 여러 차례 거래가 이뤄졌으며, 3년이 90.5에 거래됨. 2년쪽으로 비드가 꾸준히 나오면서 99.25까지 거래가 이뤄짐. 1*3년 비드가 올라오면서 ND/D로 초이스를 이루다 -28에 거래됐으며, 이후로도 비드가 계속해서 나오는 모습을 보임. 1년 비드와 1*3년 -28.5 비드가 엮여 3년이 90.25에 거래되었으며, 1*1.5*2년 -4.25비드와 2년 98비드가 엮이면서 1.5년이 6.25에 한차례 거래됨에 따라 전반적인 커브가 움직임. 장 막판에는 국채선물과 연동되면서 전반적으로 오퍼가 강하게 나오는 분위기였으며, 10년이 86까지 오퍼가 내려오고, 3년 오퍼가 88.75까지 내려오는 모습을 보임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준			
단위 : 조 원						단위 : bp			
2024.08.29(목)	219.8	199.7	3.43%	3.503%	3.500%	3.52%	2년물	3.758%	-10.9
2024.08.30(금)	211.5	195.4	3.53%	3.543%		3.52%	5년물	3.551%	-8.9
2024.09.02(월)	215.1	195.8	3.50%	3.521%		3.52%	10년물	3.757%	-7.6
2024.09.03(화)	213.4	198.4	3.50%	3.507%		3.51%	30년물	4.060%	-6.6
2024.09.04(수)	217.7		3.48%	3.521%		3.51%	10Y-2Y	-0.1	3.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금후렴 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,580.80	-83.83	52.03.10	국고 22-2	2,850	은행채 12,400	은행채 12,400	-
KOSDAQ	731.75	-28.62	25.06.10	국고 22-4	1,600	여전채 10,900	여전채 3,200	
달러-원	1,336.00원	-9.40원	43.09.10	국고 23-9	800	회사채 3,260	회사채 700	
국고3Y	2.931%	-5	72.09.10	국고 22-12	-50	공사채 4,500	공사채 2,274	
국고10Y	3.052%	-6.8	39.09.10	국고 19-6	-70			
국고10Y-3Y	12.1	-1.8	53.03.10	국고 23-2	-150			

Money Market Closing							
KOREAN/FOREIGN				CHINESE			
기간	증가	전일대비	단위 : %	기간	증가	전일대비	단위 : %
O/N	5.40	5.32	5.35	O/N	5.40	5.33	5.37
TN	5.40	5.33	5.36	TN	5.42	5.35	5.38
1W	5.45	5.35	5.40	1W	5.43	5.33	5.41
1S	5.50	5.40	5.45	1S	5.50	5.40	5.47
3S	5.42	5.32	5.37	3S	5.40	5.30	5.37
6S	5.12	4.92	5.04	6S	5.20	5.00	5.10
1YR	4.94	4.54	4.80	1YR	4.90	4.70	4.80

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.38	-0.27	3.50	5.32000	1M MAR	-242	-240
TN	-8/-6	-7	5.38	-0.27	3.50	5.31529	1W*1S	-200	-190
1W	-60/-52	-56	5.65	-0.08	3.50	5.28702	1*2	-245	-235
1S	-260/-240	-250	5.66	-0.06	3.49	5.17395	1*3	-465	-455
3S	-750/-700	-725	5.67	-0.03	3.50	5.01153	1*6	-1070	-1050
6S	-1400/-1320	-1360	5.53	-0.02	3.46	4.70818	1*9	-1540	-1520
1YR	-2300/-2200	-2240	5.10	-0.05	3.37	4.22519	1*12	-1920	-1900

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)

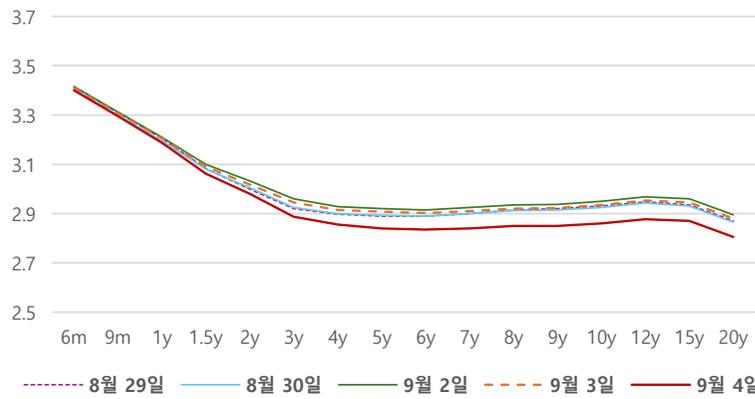
IRS 데일리 증가

9월 4일

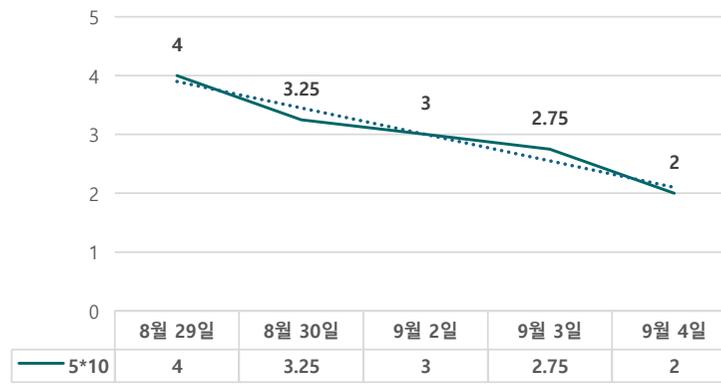
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4000	-1.00
9m	3.2950	-1.25
1y	3.1875	-1.75
1.5y	3.0625	-2.75
2y	2.9800	-3.75
3y	2.8875	-5.75
4y	2.8550	-6.00
5y	2.8400	-6.75
6y	2.8350	-6.75
7y	2.8400	-7.00
8y	2.8500	-7.00
9y	2.8500	-7.25
10y	2.8600	-7.50
12y	2.8775	-7.50
15y	2.8700	-7.50
20y	2.8050	-7.50

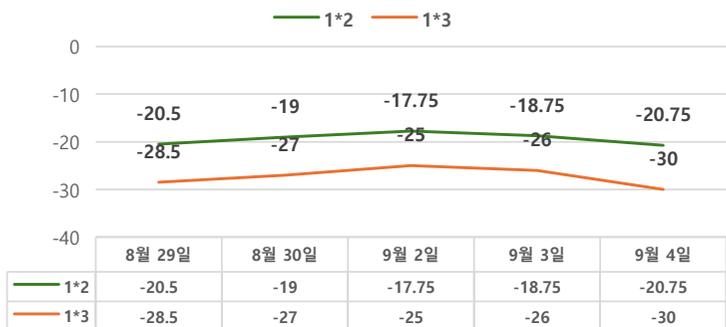
IRS 증가



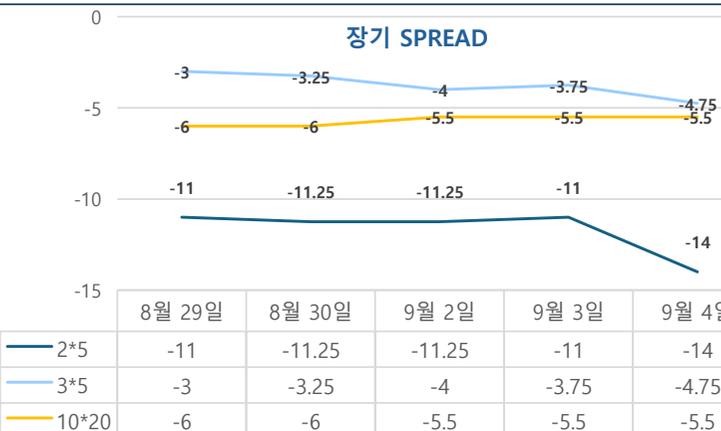
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

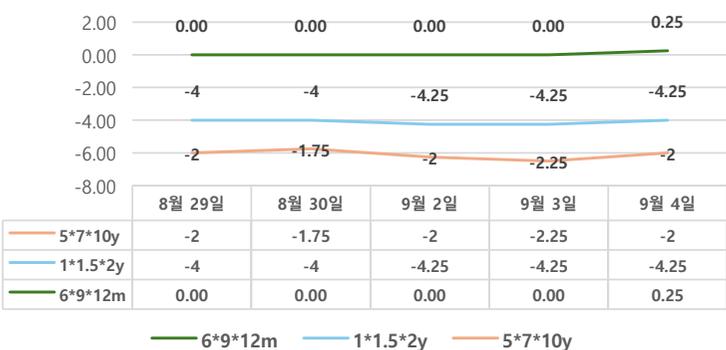
구분	증가	전일대비
1*2y	-20.75	-2.00
1*3y	-30.00	-4.00
2*5y	-14.00	-3.00
3*5y	-4.75	-1.00
5*10y	2.00	-0.75
10*20y	-5.50	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.25
1*1.5*2y	-4.25	0.00
2*5*10y	-16.00	-2.25
5*7*10y	-2.00	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

