

레포	공자기금 및 국고여유자금 환수 영향으로 금리 상승 출발한 가운데 장 초반부터 은행권 매수에 나섰음에도 부족세 지속되었음. 시중은행 추가 매수에 힘입어 오후에 일반채 정채 해소된 반면, 회사채 매도 막판까지 난항을 겪음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승함. 전 거래일 미국 국채 금리가 하락했지만, 이날 아시아장에서 반등하며 약세 분위기를 이끔. 외국인의 10년 국채선물 순매도 규모 확대 또한 약세장에 기여. 미국 : 미 국채 가격은 보험권에서 좁게 등락. 2~5년 구간 금리는 상승하고, 10~30년 구간 금리는 하락. 전반적으로 조용하게 거래가 진행된 가운데 지난주 나온 8월 미국 비농업 고용지표의 여파를 마저 소화하는 분위기. 10년물과 2년물 스프레드는 전일 대비 축소. 이번 주는 11일로 예정된 8월 미국 소비자물가지수가 시장에 핵심 변수로 작용할 전망.
MONEY	금일 머니 시장은 다음주 휴장과 FOMC 회의를 일주일 남기고 오버나잇과 1주물 레벨이 시장 고점을 형성하며 초단기 자금 거래에 집중 된 하루. 오버나잇은 5.40-5.42까지 자금 커버에 주력했고, 스왑-1주물 (8일물)이 기준금리 인하 반영 전으로 MAX 운용 금리로 5.45 까지 TAKEN 되는 등 레벨 고점에서 대부분 체결 되며 마무리. 한국계 은행들의 분기말 커버 및 비율 매칭용으로 2개월물 이상 구간에 시장 차입을 시도 했으나, 6개월물 5.00 (SOFR + 40bp) 가량 높은 오퍼 레벨만 대기 중이라, MM 시장 대신 CD 혹은 RP시장쪽으로 낮은 스프레드 제시 되는 곳으로 시도 중. 아시아 네임벌 비드/오퍼는 중국계 6개월물 4.95-5.15/ 한국계 4.90-5.00/ 대만계 4.90-5.00 형성중이며, 6개월물 -1년물은 SOFR 대비 높은 스프레드를 반영하고 있음.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 만기 구간별 혼조세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 오른 -21.00원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 10전 오른 -13.10원의 증가를 기록했으나 3개월물과 1개월물은 전장보다 20전 내린 증가를 기록함. 3개월물 이하에서는 단기 예셋 물량 유입과 기준일을 앞둔 원화 수요 증가로 하방 압력을 받았지만 1년 등 장기물에서는 미국 국채금리 하락으로 상승 압력을 받은 것으로 보임. 미국 8월 고용보고서에서 미국 노동시장 둔화 신호가 재차 나오에 따라 미 국채 금리가 하락했고 1년 등 장기물에 영향을 준 것으로 분석됨.
IRS	전일 IRS는 미국의 8월 신규고용이 예상을 하회했지만, 실업률도 낮아진 영향을 받아 변동 흐름을 보임. 지난 주말 발표된 미국의 8월 고용지표는 혼재된 해석을 낳는 분위기를 보임. 신규고용이 예상보다 부진했지만, 실업률은 4.2%로 전달보다 하락함. 미 국채 금리 역시 주말장에서는 하락했지만, 이날 아시아 시간대에서는 다시 반 등하는 흐름을 보이면서 이에 연동되어 IRS 도 움직이는 모습을 보임. 장 초반에는 대체로 한산한 분위기를 보였으며, 오후 들어 1.5년이 3.5/03에 대치되다 03에 거래 가 이뤄짐. 이후 1.5년과 2년쪽으로 오퍼가 보이는 분위기가였으며, 1.5*2년이 -8.25까지 오퍼가 내려오는 모습을 보임. 시장에서는 1*1.5*2년이 -4.25에 거래 소식이 들렸으며, 1.5*2년이 -8.5에 거래가 이뤄짐. 이후 1.5년 비드가 올라 오면서 2.75에 거래됐으며, 3년이 86비드가 올라왔으며 10년이 86.5오퍼가 나온. 마감 후에는 1년이 16 레벨에 거래됐으며, 미국채 움직임과 연동 되어 3년이 86.75까지 거래가 이뤄짐

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
2024.09.03(화)	213.4	198.4	3.50%	3.507%	3.500%	3.51%	2년물	3.671%	2.3
2024.09.04(수)	217.7	197.2	3.48%	3.521%		3.51%	5년물	3.489%	0.1
2024.09.05(목)	216.5	197.0	3.52%	3.546%		3.51%	10년물	3.701%	-0.9
2024.09.06(금)	218.1	194.2	3.57%	3.555%		3.51%	30년물	4.002%	-1.8
2024.09.09(월)	216.1		3.59%	3.562%		3.51%	10Y-2Y	3	-3.2

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	2,535.93	-8.35	25.09.10	국고 20-6	2,300	국고채 64,990	국고채 258,910	국고채 2년 8,000억원 입찰
KOSDAQ	714.46	7.87	54.03.10	국고 24-2	1,620	은행채 6,300	은행채 3,100	통안채 2조원 조기환매
달러-원	1,341.00원	1.10원	34.06.10	국고 24-5	1,584	여전채 7,500	여전채 3,000	
국고3Y	2.897%	1.6	53.09.10	국고 23-7	-299	회사채 7,550	회사채 2,800	
국고10Y	3.032%	4.2	52.09.10	국고 22-9	-600	통안채 8,000	통안채 5,100	
국고10Y-3Y	13.5	2.6	33.12.10	국고 23-11	-1,252	공사채 14,920		

Money Market Closing								단위 : % , %p	
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.32	5.35	0.01	O/N	5.45	5.35	5.38	0.00
TN	5.40	5.33	5.36	0.01	TN	5.45	5.35	5.40	0.02
1W	5.48	5.38	5.43	0.01	1W	5.45	5.35	5.42	0.00
1S	5.48	5.38	5.43	0.01	1S	5.52	5.42	5.47	-0.01
3S	5.38	5.28	5.33	-0.01	3S	5.40	5.30	5.35	0.00
6S	5.08	4.88	5.00	0.00	6S	5.15	4.95	5.10	0.00
1YR	4.85	4.40	4.75	0.00	1YR	4.90	4.70	4.80	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	-7/-4	-5	4.84	-0.56	3.50	5.35000	1M MAR	-268	-262
TN	-13/-9	-11	6.45	0.79	3.50	5.34199	1W*1S	-180	-170
1W	-80/-72	-76	6.06	0.30	3.50	5.28596	1*2	-255	-245
1S	-265/-255	-260	5.84	0.16	3.50	5.10984	1*3	-470	-460
3S	-735/-715	-725	5.67	0.04	3.50	4.93864	1*6	-1050	-1040
6S	-1340/-1280	-1310	5.44	-0.04	3.44	4.59199	1*9	-1490	-1470
1YR	-2150/-2050	-2100	4.96	-0.05	3.34	4.05361	1*12	-1840	-1820

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 / 12.17~12.18D
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)

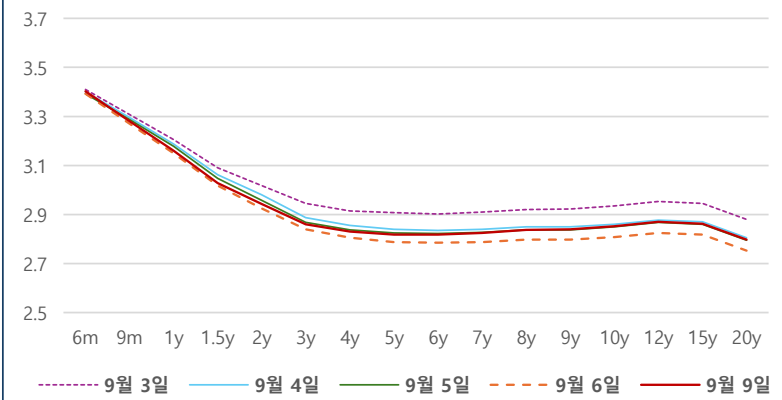
IRS 데일리 증가

9월 9일

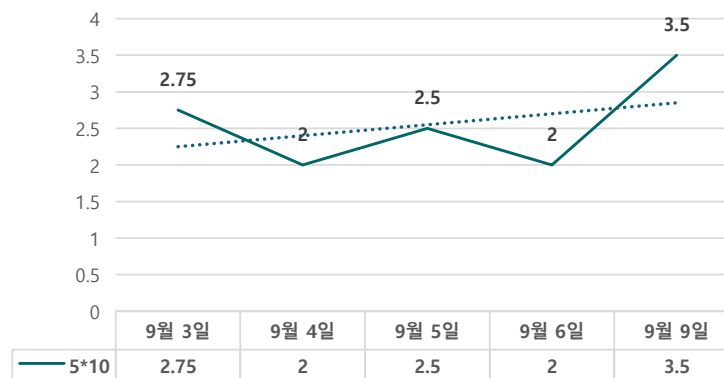
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4025	1.00
9m	3.2800	1.00
1y	3.1600	1.00
1.5y	3.0275	1.00
2y	2.9425	1.75
3y	2.8600	2.00
4y	2.8300	2.50
5y	2.8175	3.00
6y	2.8175	3.25
7y	2.8250	3.75
8y	2.8375	4.00
9y	2.8400	4.25
10y	2.8525	4.50
15y	2.8625	4.50
20y	2.7975	4.50

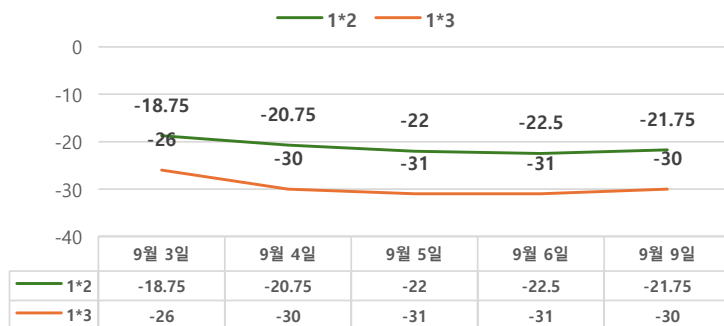
IRS 증가



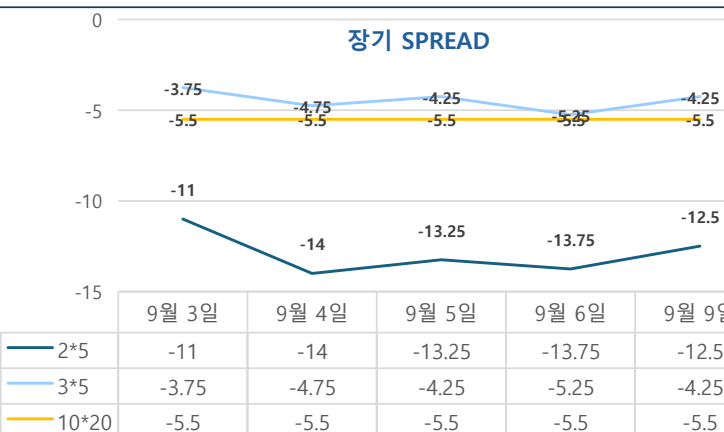
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

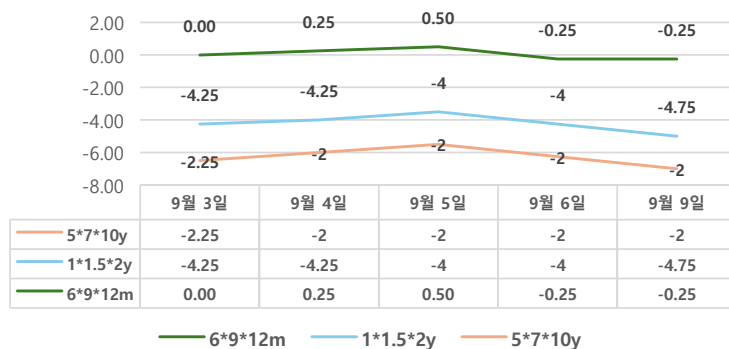


IRS 주요 커브

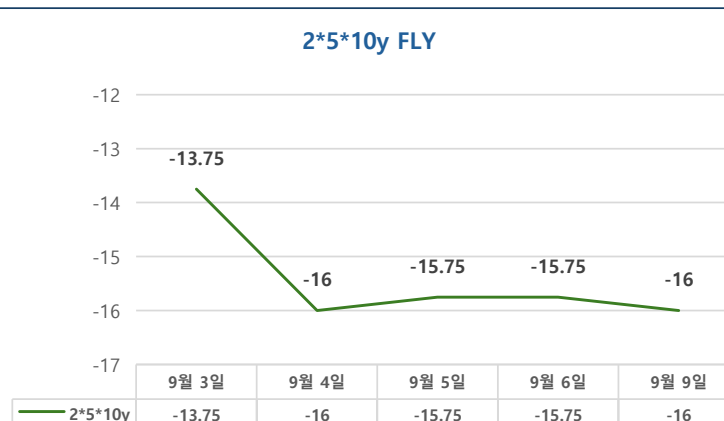
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-21.75	0.75
1*3y	-30.00	1.00
2*5y	-12.50	1.25
3*5y	-4.25	1.00
5*10y	3.50	1.50
10*20y	-5.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-4.75	-0.75
2*5*10y	-16.00	-0.25
5*7*10y	-2.00	0.00