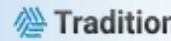


# Market Daily Report

2024.09.12(목)



<b>레포</b>	지준일 전일일 1일물 콜오버 거래가 주를 이뤘고, 공모주(아이언디바이스) 청약자금 운용되어 매도 해소 원활했음. 은행 간 콜 조정을 통해 지준 과부족 조정했으며, 소폭 잉여 마감하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 아시아 장에서 미 국채 금리가 상당 폭 하락한 영향을 받음. 국고 3년과 10년 최종호가 수익률은 지난달 5일 이후 최저치 기록. 미국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 8월 CPI 결과에 뚜렷하게 방향을 잡지 못한 채 장중 등락을 거듭. 8월 헤드라인 CPI는 전월 대비 0.2%, 전년 동기 대비 2.5% 오르며 시장 예상치에 부합. 전년 대비 상승률은 지난 2021년 2월 이후 가장 낮은 수준. 하지만 8월 근원 CPI는 전월비 0.3% 상승하며 시장 예상치 상회 및 지난 4월 이후 4년 만에 가장 큰 상승 폭 기록.
<b>MONEY</b>	금일 머니시장은 다음주 아시아장 휴장과 FOMC 회의를 앞두고, SOFR 금리 하락에 긴축 테너 비드 호가도 하락세를 반영하고 있으나, 오피 레벨 정제로 시장에서는 비드-오퍼 갭만 확대되고 있음. 차입 은행들은 다음주 FOMC 회의 전까지 초단기물 커브 위주로 대응하고 있고, 운용하는 은행들은 분기말 자금 관리를 위해 운용에 보수적인 입장 고수로 분기말 역내외 분기 커버용 유동성은 다소 타이트해질 가능성이 높아 보임. 금일도 여제와 같이 분기 커브 1개월물 편딩이 5.45-5.50 까지 이어지면서 다음주 추석 연휴 이후 분기 커버용 역내외 비드 물량이 좀더 적극적으로 제시 될 것으로 예상됨.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환 스와프포인트는 미 국채 금리 하락의 영향으로 장기물에서 강한 반등세가 나타남. 1년 만기물의 증가는 전장보다 90전 오른 -20.30원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 40전 오른 -12.80원의 증가를 기록함. 뉴욕금융시장에서는 미국 경기 침체 우려가 심화됨에 따라 미 국채 금리의 강한 하락이 나왔고 미 연준이 금리를 빠르게 내릴 수 있다는 컨센서스가 생기자 스와프포인트는 장기물 위주로 반등함. 하지만 단기물은 추석 연휴를 앞두고 원화 잉여의 영향으로 하락하는 모습을 보이면서 만기별 혼조세가 이어지고 있는 것으로 분석됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 미국 대선 토론에서 카밀라 해리스 민주당 후보가 선전했다는 평가를 받은 영향으로 증장기를 중심으로 상당폭 하락 마감함. 이날 장중 미국 대선 토론을 소화하면서 강세 분위기가 이어지면서 이에 연동되어 움직임. 이날 장 마감 후 미국의 8월 CPI(소비자물가지수)가 발표될 예정으로 이를 대기하는 모습을 보였으며, 장 초반에 2.3년 쪽으로 호가가 형성됨. 이후 1*3년 비드가 꾸준히 나오면서 -32-32.25까지 몇차례 거래가 이뤄짐. 장 중 2*3*5년 나비가 -3으로 오피가 나오면서 전체적인 커브 레벨이 움직였으며, 5년쪽으로도 꾸준히 호가가 형성되면서 76.5-75까지 여러차례 거래가 이뤄짐. 이후 6개월 40 오피와 6*12개월 오피가 엮이면서 1년이 14.5에 거래됐으며, 10*20년이 -6 거래 소식이 마켓에서 들리면서 초장기쪽 레벨이 움직이게됨. 이후 2년이 89.75까지 레벨이 내려왔으며, 3년이 30.75에 초이스를 이루다 거래됐으며, 5년 쪽으로 비드가 꾸준히 나오면서 74.75까지 거래가 이뤄짐. 장 마감 이후로도 5년 비드가 74.75에 나왔으며, 1*3년이 -34 비드가 나오는 모습을 보임.

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
2024.09.05(목)	216.5	197.0	3.52%	3.546%	3.500%	3.51%	2년물	3.644%	4.6
2024.09.06(금)	218.1	194.2	3.57%	3.555%		3.51%	5년물	3.445%	2.1
2024.09.09(월)	216.1	189.8	3.59%	3.562%		3.51%	10년물	3.654%	0.9
2024.09.10(화)	219.0	187.2	3.52%	3.420%		3.51%	30년물	3.967%	0.3
2024.09.11(수)	219.1		3.52%	3.480%		3.51%	10Y-2Y	1	-3.7

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	2,513.37	-10.06	25.09.09	통안채	4,400	은행채 21,200	은행채 2,400	-
KOSDAQ	709.42	3.22	28.09.10	국고 23-6	2,147	여전채 13,900	여전채 2,000	
달러-원	1,341.50원	-2.70원	54.09.10	국고 24-8	1,074	회사채 20,393	공사채 75	
국고3Y	2.820%	-5.7	25.06.10	국고 15-2	-400	공사채 3,600		
국고10Y	2.943%	-6.7	34.06.10	국고 24-5	-493			
국고10Y-3Y	12.3	-1	25.09.10	국고 23-8	-1,000			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN				CHINESE					
기간	지표	증가	전일대비	기간	지표	증가	전일대비		
O/N	5.41	5.33	5.37	0.00	O/N	5.44	5.35	5.38	0.00
TN	5.42	5.34	5.38	0.00	TN	5.44	5.35	5.40	0.00
1W	5.49	5.39	5.44	0.00	1W	5.46	5.36	5.43	-0.01
1S	5.50	5.40	5.45	0.02	1S	5.53	5.43	5.48	0.00
3S	5.37	5.27	5.32	0.00	3S	5.45	5.35	5.38	0.03
6S	5.08	4.88	5.00	0.00	6S	5.20	4.90	5.12	0.00
1YR	4.85	4.40	4.75	0.00	1YR	4.95	4.70	4.82	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	-11/-9	-10	6.19	0.55	3.50	5.34000	1M MAR	-255	-253
TN	-10/-8	-9	5.92	0.01	3.50	5.33284	1W*1S	-200	-190
1W	-70/-64	-67	6.08	0.01	3.50	5.28986	1*2	-220	-210
1S	-280/-260	-270	5.78	0.08	3.50	5.11077	1*3	-435	-425
3S	-730/-690	-710	5.62	-0.01	3.49	4.94886	1*6	-1020	-1000
6S	-1310/-1250	-1280	5.38	-0.06	3.43	4.57888	1*9	-1440	-1420
1YR	-2080/-1980	-2030	4.85	-0.09	3.29	3.99443	1*12	-1765	-1745

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)

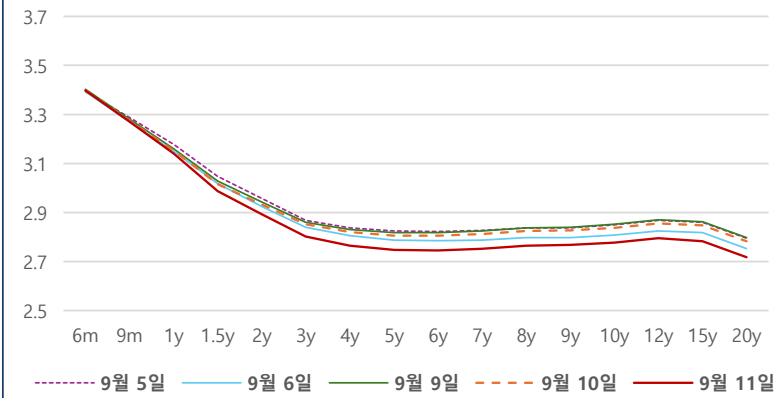
IRS 데일리 증가

9월 11일

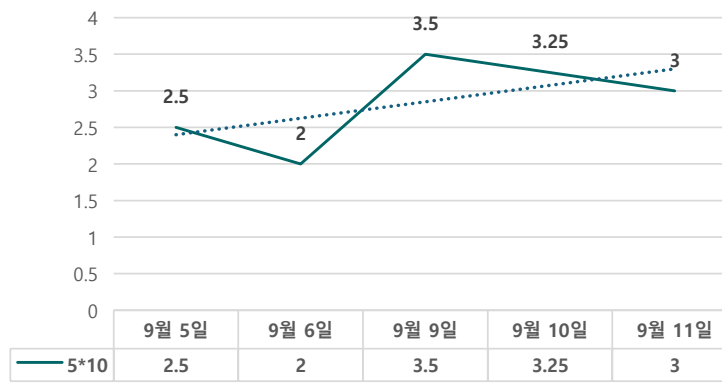
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3975	0.00
9m	3.2700	-0.50
1y	3.1400	-1.25
1.5y	2.9875	-2.75
2y	2.8925	-4.00
3y	2.8025	-5.00
4y	2.7650	-5.50
5y	2.7475	-5.75
6y	2.7450	-6.00
7y	2.7525	-6.00
8y	2.7650	-6.00
9y	2.7675	-6.00
10y	2.7775	-6.00
12y	2.7950	-6.00
15y	2.7825	-6.50
20y	2.7175	-6.50

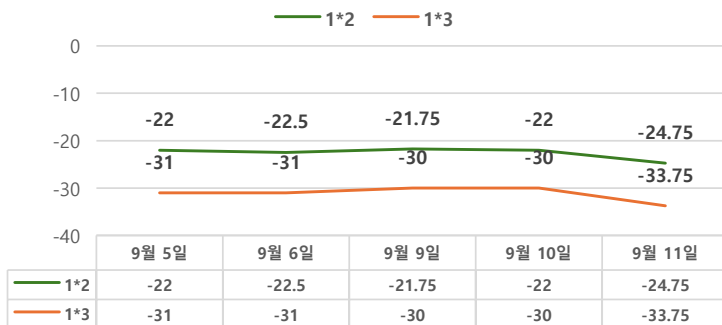
IRS 증가



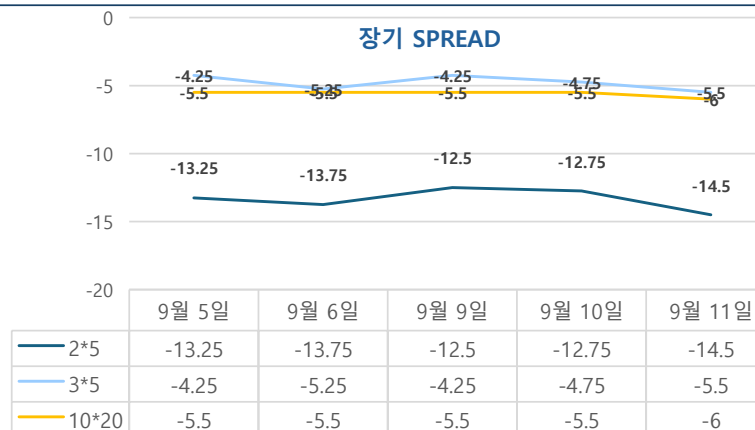
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

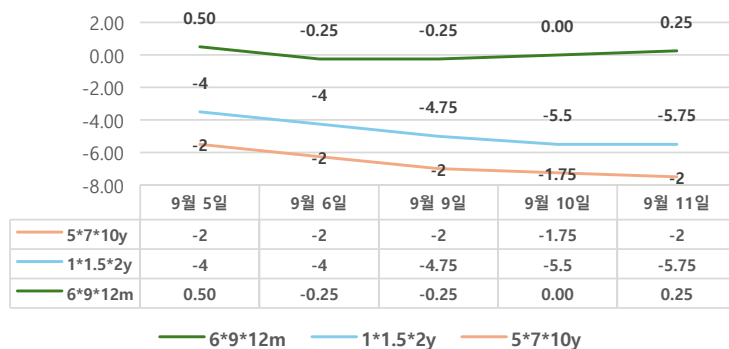


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-24.75	-2.75
1*3y	-33.75	-3.75
2*5y	-14.50	-1.75
3*5y	-5.50	-0.75
5*10y	3.00	-0.25
10*20y	-6.00	-0.50

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.25
1*1.5*2y	-5.75	-0.25
2*5*10y	-17.50	-1.50
5*7*10y	-2.00	-0.25

2\*5\*10y FLY

