

Market Daily Report



2024.08.28(수)

레포	적수 관리를 위한 은행권 조달 증가했으나 일부 시중은행 매수에 나서 조달여건 양호한 모습을 보임. 동안계정 감액 이후 저금리 수요만 간헐적으로 발생했으며, 월말 대비 기일물 매도 소폭 감소하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 내년 국고채 발행 규모 급증과 이창용 한국은행 총재의 매파적 발언에 영향을 받으며 커브 스티프닝 발생. 미국 : 미 국채 금리는 혼조세 마감. 장 초반 영국 정부의 증세 발표의 영향으로 미 국채 가격은 하락. 그러나 미국 8월 소비자 신뢰도 설문조사에서 '일자리가 풍부하다.'는 응답이 전월 대비 0.6% 하락한 32.8%로 21년 3월 이후 최저치를 기록하며 2년물 국채 금리는 상승분을 모두 반납하며 하락 마감.
MONEY	금일 머니 시장은 달러뿐만 아니라, 이중 통화 비드도 통화별로 다양했던 하루. 달리는 온소 오피로 1주-3주를 5.45-5.47 사이로 제시되면서 9월말 분기 넘기지 않는 구간으로 역내외 매칭 소식이 전해졌고, 이중통화는 AUD, EUR, JPY, HKD 등 2-3개월 물 위주로 9월 3분기 넘기는 자금 커버용 이중 비드가 시장에 제시되며 달러 환산 금리 레벨도 상대적으로 좋은 레벨로 제시 했으나, 월말 구간 은행별 이중통화 잔액 변동 성도 클 것으로 예상해 시장 오피는 제한적이었으며 단기를 위주의 오피만 제시되었음. (이중통화 3개월물의 경우, HKD 3s 4.10-4.15, EUR 3s 3.70-3.75, JPY 3s 0.30-0.35, AUD 3s 4.70-4.75 수준으로 네임별 레인지 형성)
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 전 구간 하락하는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 내린 -23.00원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 20전 내린 -14.10원의 증가를 기록함. 그간의 달러-원 환율 하락에 대한 조정이 나온 것이 금일 스와프포인트 하락 요인이었던 것으로 보임. 이날 오후 3시 30분까지의 정규장에서 달러-원 환율 증가는 전장보다 4.2원 상승한 1,331.00원을 기록함. 월말 외환 건전성 평가를 앞두고 시장 전체에 달러 공급이 감소한 것도 외환 스와프포인트 하락에 영향을 미친 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 대폭 늘어난 내년도 국채 발행 물량에 영향을 받아 장기를 위주로 큰 폭 상승 마감. 정부가 이날 발표한 내년 예산안에서 국고채 발행 규모가 약 201조원에 달 하면서, 예상을 넘어서는 규모에 장기를 위주로 물량 부담이 작용된 것으로 분석. 장 초반에 10*12년, 10*15년쪽으로 호가가 ND로 나오면서 초장기 커브가 움직였으며, 초 단기 6개월쪽으로 비드가 꾸준히 나오면서 42에 ND/D로 초이스를 이루다 42에 거래됨. 이후 내년 예산안 발표 소식에 국채선물 변동성이 커지면서 이에 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 2년쪽으로 계속해서 호가가 대치되면서 1.5*2년 비드와 1.5년 09 비드가 엮이면서 2년이 01에 거래됨. 이후 5년쪽으로 비드가 올라오면서 92.5에 거래가 이뤄졌으며, 1.5년은 10에 몇차례 거래됨. 장 막 판에는 1.5년이 오피가 내려오면서 8.5/08에 대치를 이루다 8.5에 거래됐으며, 10년 오피가 95까지 오피가 내려옴. 이날 양도성예금증서(cd)는 상승하여 3.52이 고시됨.

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
2024.08.21(수)	214.8	200.0	3.53%	3.536%	3.500%	3.52%	2년물	3.903%	-3.5
2024.08.22(목)	214.8	198.5	3.53%	3.536%		3.51%	5년물	3.651%	-1.7
2024.08.23(금)	214.5	198.7	3.50%	3.523%		3.51%	10년물	3.824%	0.7
2024.08.26(월)	215.8	198.6	3.50%	3.528%		3.51%	30년물	4.115%	0.8
2024.08.27(화)	219.3		3.48%	3.509%		3.52%	10Y-2Y	-7.9	4.2

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	2,689.25	-8.76	54.03.10	국고 24-2	1,705	은행채 5,800	은행채 7,700	통안채 2년물 6,000 모집발행
KOSDAQ	764.95	-1.84	26.03.10	국고 21-1	1,595	여전채 7,700	여전채 3,150	재정증권 63일물 10,000
달러-원	1,331.00원	1.20원	26.03.10	국고 24-3	1,313	회사채 2,548	회사채 500	
국고3Y	2.940%	5	31.06.10	국고 21-5	-93	공사채 1,200	공사채 5,756	
국고10Y	3.073%	9.9	33.12.10	국고 13-8	-139			
국고10Y-3Y	13.3	4.9	30.12.10	국고 10-7	-192			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.32	5.36	0.00	O/N	5.35	5.28	5.33	0.01
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.35	5.28	5.33	0.00
1W	5.50	5.40	5.45	0.00	1W	5.48	5.38	5.45	0.02
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.50	5.40	5.47	0.00
3S	5.42	5.32	5.37	-0.01	3S	5.45	5.30	5.38	0.03
6S	5.09	4.89	5.02	-0.01	6S	5.25	5.00	5.13	0.03
1YR	4.97	4.57	4.85	-0.03	1YR	5.10	4.80	4.93	-0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, % %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.66	-0.01	3.50	5.33000	1M MAR	-262	-260
TN	-10/-8	-9	5.93	0.26	3.50	5.32755	1W*1S	-210	-200
1W	-68/-62	-65	6.01	0.18	3.50	5.31286	1*2	-245	-235
1S	-280/-270	-275	5.81	0.14	3.48	5.25163	1*3	-490	-480
3S	-780/-750	-765	5.75	0.04	3.47	5.06109	1*6	-1120	-1100
6S	-1440/-1380	-1410	5.59	0.03	3.45	4.74793	1*9	-1570	-1550
1YR	-2350/-2250	-2300	5.14	0.01	3.35	4.26103	1*12	-2010	-1990

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)

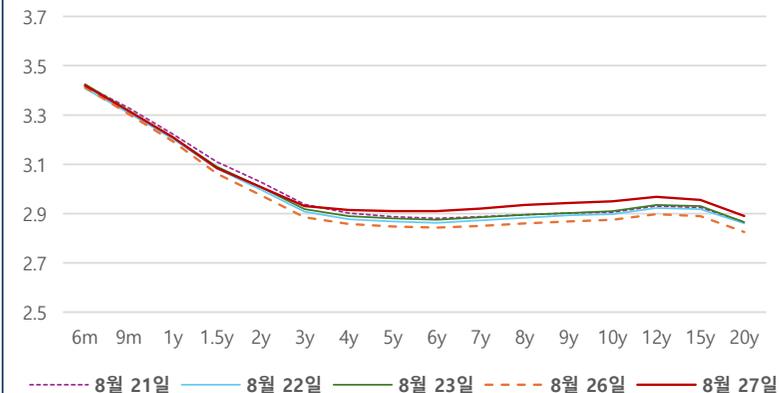
IRS 데일리 증가

8월 27일

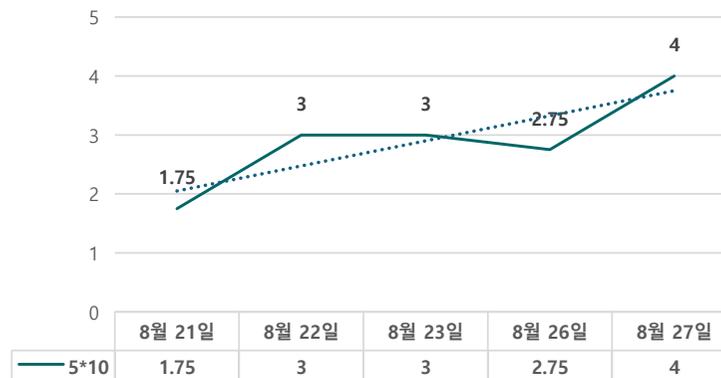
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4200	0.75
9m	3.3150	1.25
1y	3.2100	1.75
1.5y	3.0850	2.25
2y	3.0075	3.25
3y	2.9300	4.50
4y	2.9150	5.75
5y	2.9100	6.25
6y	2.9100	6.75
7y	2.9200	7.00
8y	2.9350	7.50
9y	2.9425	7.50
10y	2.9500	7.50
12y	2.9675	7.00
15y	2.9550	6.50
20y	2.8900	6.50

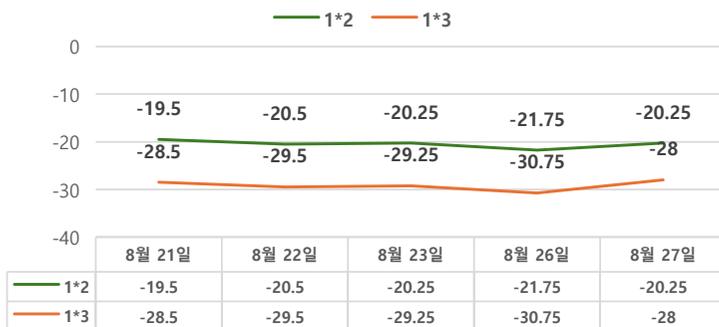
IRS 증가



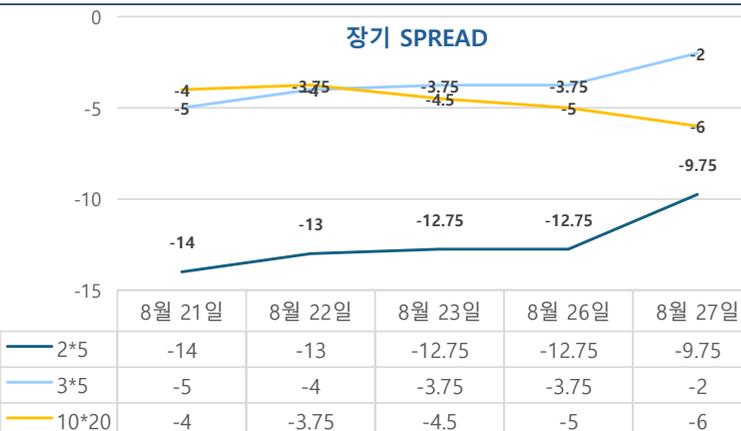
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

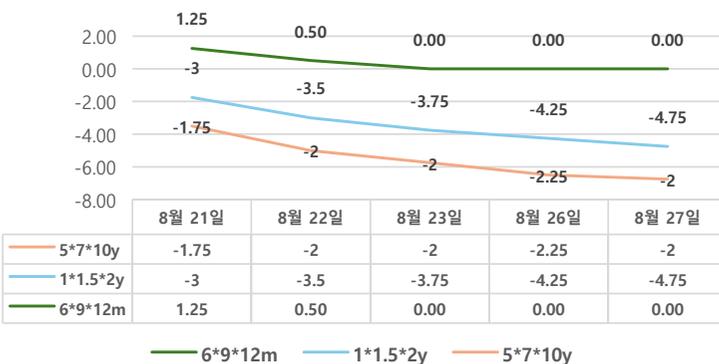


IRS 주요 커브

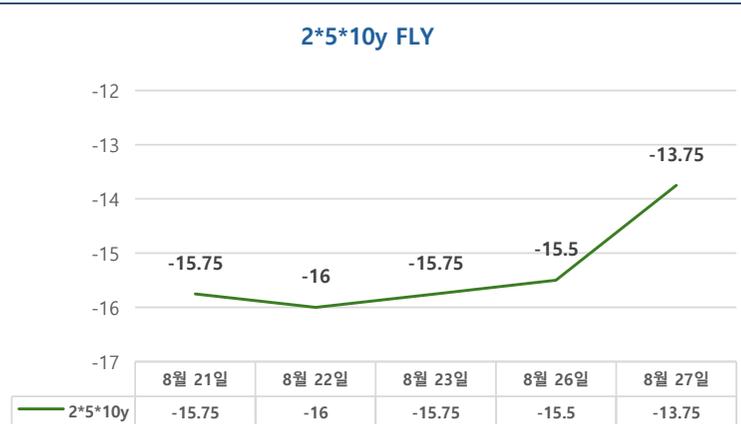
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-20.25	1.50
1*3y	-28.00	2.75
2*5y	-9.75	3.00
3*5y	-2.00	1.75
5*10y	4.00	1.25
10*20y	-6.00	-1.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.00
1*1.5*2y	-4.75	-0.50
2*5*10y	-13.75	1.75
5*7*10y	-2.00	0.25