

# Market Daily Report



2024.08.29(목)

<b>레포</b>	적수 양전환됐음에도 시중은행 조달 꾸준했으며, 장 중 유동성 풍부해 체결금리 하락하였음. 월말 전 자금 흐름 양호하여 기일물 금리 하락세를 보였고, 막판까지 매수 대기하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 내년 국채 발행 계획이 급증한 여파가 이날도 약세 심리를 이끌었으나, 외국인 투자자의 매수세 등을 참고하며 오후 들어 강세 전환. 미국 : 미 국채 금리는 2년물 제외 상승 마감. 시장을 움직일 만한 재료가 부재했던 가운데 미 국채 시장은 최근 박스권 장세를 형성하고 있는 모습. 9월 기준 금리 인하는 이미 채권 가격에 반영되어 있는 상황에서 새로운 지표 발표를 기다리는 분위기.
<b>MONEY</b>	역외 머니마켓에서도 월말 마감을 앞두고, 중국 본토 오피 물량 감소로 중국계 및 대만계 은행들의 오버나잇-월말 커버 1주 레벨이 강세를 보이자, 1주 이내 단기 매칭 거래 위주로 체결되었음. (1주 5.45-5.47 형성) 한국계 역외 점포들의 비율 관리용 기간물 비드가 4개월물-1년물까지 시장에 제시 되었으나, 제한적인 장기테너 렌더로 6개월물 5.05 수준의 오피가 시장에 대기 중이나 리밋 제한에 초이스 상태로 마감됨. 온쇼 렌더들은 대부분 비율 관리 차원에서 30일물 이내 운용에만 집중되다 보니, 한국계 은행들은 대부분 장기구간 편당은 역외 렌더 타겟으로 워킹중이나, 실제결은 다소 제한적인 상황. (4개월물 5.25 6개월물 5.05 1년물 4.70 비드 호가 제시중)
<b>FX SWAP</b>	금일 외환 스와프포인트는 전일부터 이어진 원화 약세와 금융기관의 월말 외환 건전성 평가로 인한 수급 영향으로 대체로 하락함. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 내린 -23.30원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장과 동일한 -14.30원의 증가를 기록함. 오후 3시 30분까지의 정규장에서 달러-원 환율 증가는 전장보다 8.0원 상승한 1,339.0원을 기록했으며 월말 외환 유동성 평가기간이 겹치며 시장에 풀리는 달러 자체가 적었던 것으로 보임. 결제일 기준으로 금일이 월말 평가의 마지막 날이었으므로 29일부터는 수급이 정상화 가능성이 클 것으로 예상됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 전일 급등분을 일부 되돌리면서 하락 마감. 내년 국고채 발행 규모로 인한 변동성이 다소 커진 분위기였으며, 당분간은 민감도 큰 상황이 이어질 것이라는 분석. 장 초반에 2*3년 오피가 꾸준히 내려오면서 -7.5에 거래가 이뤄졌으며, 1.5년으로 호가가 형성되면서 7.75-8에 몇차례 거래가 이뤄짐. 이날 11월 금통위와 픽싱이 겹치면서 단기쪽으로 호가가 많이 형성되면서 6개월, 9개월쪽으로 호가가 꾸준히 나오는 모습을 보임. 이후 2*5년 -10 비드와 2년 비드가 엮이면서 레깅으로 5년이 88.75-5까지 거래가 이어졌으며, 이후에도 2*5년이 -10에 몇차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 2년 오피가 꾸준히 내려오면서 98에 거래됐으며, 4년이 88.5에 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
2024.08.22(목)	214.8	198.5	3.53%	3.536%	3.500%	3.51%	2년물	3.875%	-2.8
2024.08.23(금)	214.5	198.7	3.50%	3.523%		3.51%	5년물	3.667%	1.6
2024.08.26(월)	215.8	198.6	3.50%	3.528%		3.51%	10년물	3.837%	1.3
2024.08.27(화)	219.3	199.5	3.48%	3.509%		3.52%	30년물	4.126%	1.1
2024.08.28(수)	219.3		3.48%	3.505%		3.52%	10Y-2Y	-3.8	4.1

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	2,689.83	0.58	24.10.31	재정채	7,830	은행채 2,000	은행채 15,200	
KOSDAQ	762.5	-2.45	26.03.10	국고 21-1	1,980	여전채 10,800	여전채 1,760	
달러-원	1,337.00원	6.00원	26.02.28	중금채	1,000	회사채 5,726	회사채 4,800	
국고3Y	2.919%	-2.1	33.06.10	국고 23-5	-647	공사채 2,900	공사채 617	
국고10Y	3.054%	-1.9	52.09.10	국고 22-9	-700			
국고10Y-3Y	13.5	0.2	24.09.10	국고 19-5	-730			

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	5.40	5.33	5.36	0.03
TN	5.40	5.33	5.37	0.00	TN	5.40	5.33	5.37	0.04
1W	5.50	5.40	5.46	0.01	1W	5.50	5.40	5.46	0.01
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	0.00	3S	5.45	5.30	5.38	0.00
6S	5.12	4.92	5.05	0.03	6S	5.25	5.00	5.15	0.02
1YR	4.95	4.55	4.83	-0.02	1YR	5.10	4.80	4.90	-0.03

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	5.65	-0.01	3.50	5.34000	1M MAR	-264	-260
TN	-12/-10	-11	6.47	0.54	3.50	5.33717	1W*1S	-210	-205
1W	-77/-71	-74	6.35	0.34	3.50	5.32016	1*2	-255	-245
1S	-290/-280	-285	5.97	0.16	3.48	5.25213	1*3	-490	-475
3S	-780/-750	-765	5.77	0.02	3.47	5.06197	1*6	-1130	-1110
6S	-1450/-1390	-1420	5.61	0.02	3.45	4.74244	1*9	-1600	-1580
1YR	-2380/-2280	-2330	5.17	0.03	3.35	4.23762	1*12	-2030	-2000

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)

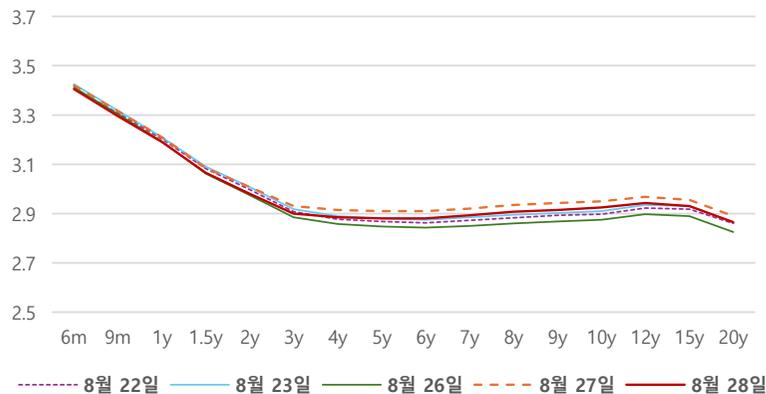
IRS 데일리 증가

8월 28일

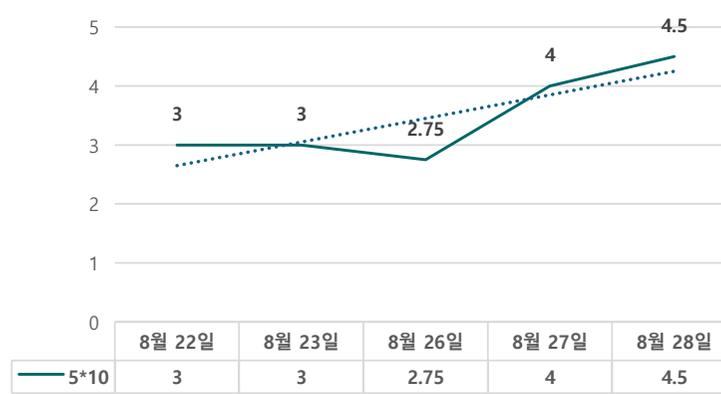
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4050	-1.50
9m	3.2950	-2.00
1y	3.1900	-2.00
1.5y	3.0650	-2.00
2y	2.9800	-2.75
3y	2.9000	-3.00
4y	2.8850	-3.00
5y	2.8800	-3.00
6y	2.8800	-3.00
7y	2.8925	-2.75
8y	2.9075	-2.75
9y	2.9150	-2.75
10y	2.9250	-2.50
15y	2.9300	-2.50
20y	2.8650	-2.50

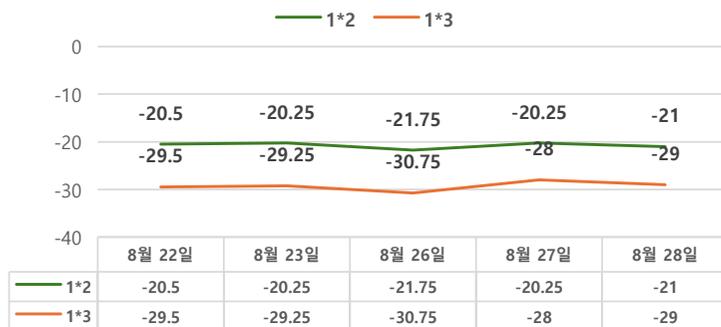
IRS 증가



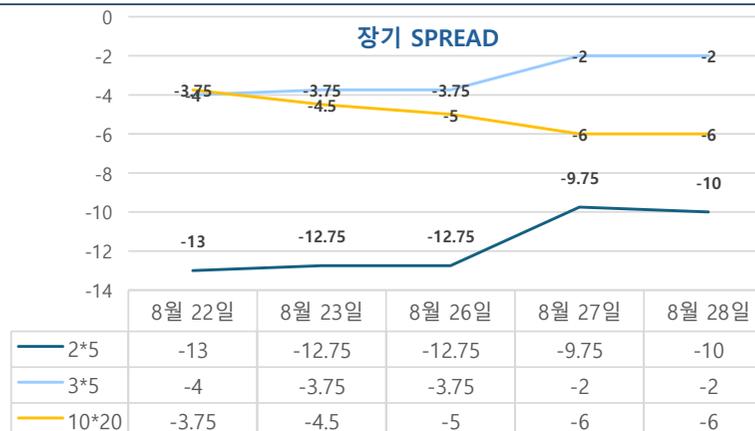
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

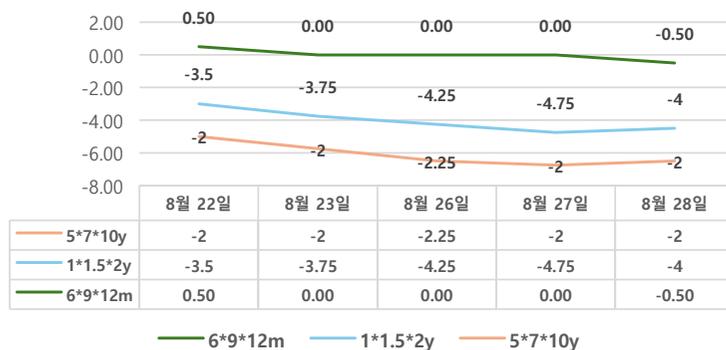


IRS 주요 커브

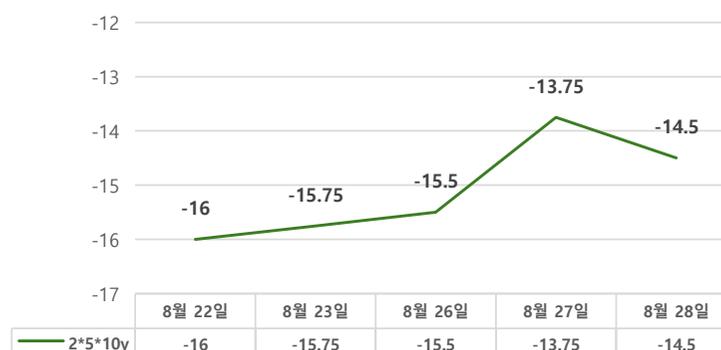
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-21.00	-0.75
1*3y	-29.00	-1.00
2*5y	-10.00	-0.25
3*5y	-2.00	0.00
5*10y	4.50	0.50
10*20y	-6.00	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	-0.50
1*1.5*2y	-4.00	0.75
2*5*10y	-14.50	-0.75
5*7*10y	-2.00	0.00