

Market Daily Report



2024.08.30(금)

레포	적수 크게 호전되어 시은 매도 감소할 것으로 예상했으나 조달금리 급락함에 따라 조달 수요 꾸준하였음. 장 중 체결금리 등락을 반복했으며, 일시적인 조달 정체 발생하기도 했으나 외은 및 운용사 추가 자금 유입되어 무난히 마감하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 외국인 투자자들이 3년과 10년물 국채선물을 모두 순매도하며 약세 압력을 받음. 미국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 미국 2분기 GDP 잠정치가 전년도 동기 대비 3.0% 증가하며 예상치 2.8%를 상회해 연준의 9월 빅 컷 명분이 약해진 점이 주요 요인. 또한 주간 신규 실업수당청구건수도 23만 1천명으로 전주 대비 2천명 감소하며 약세 요인으로 작용.
MONEY	머니 시장에서 스왑은 9월초 시작으로 8월말 커버 구간의 급등세는 어느정도 해소되면서 탐-1주물 5.45 스왑 -1주 5.38 수준으로 형성되었음. 9월 분기말 효과도 예상되지만, FOMC 회의가 9월 중순에 예정되면서 분기말 커버 구간에 대한 금리 상승 효과 vs 금리 인하에 따른 단기물 레벨 하향 조정 기대감 사이 속에서 달러 유동성에 따라 레벨 형성 될 것으로 보임. 금일 중국계 6개월물-1년물 구간 (6달 5.12-5.15, 1년물 4.88-4.90) 체결 소식이 전해졌으며, 한국계, 대만계, 포린 네임 6달물 비드가 5.00-5.05 사이로 제시 중이나 규모는 크지 않은 가운데 스왑 체결 소식만 전해졌음.
FX SWAP	금일 외환 스왑포인트는 월말 금융권 외화 유동성 확보 문제가 해소된 결과 전 구간 상승하는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 60전 오른 -22.70원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 40전 오른 -13.90원을 기록함. 많은 거래량을 동반한 상승세가 아니었기에 전반적으로 외화 유동성 확보라는 월말 이슈가 해소된 데 따른 되돌림 수준에서의 상승이었다고 분석됨.
IRS	전일 IRS는 외국인의 국채선물 매도 흐름에 연동되면서 상승 마감. 한은의 금리 인하가 지연 될 수 있고, 내년도 물량에 대한 부담까지 작용되어 시장이 더 약해 질 수 있다는 의견이 나오는 분위기를 보임. 전반적으로 국채선물의 움직임에 연동되면서 움직였으며, 1*3년, 1*2년쪽으로 비드가 초반에 꾸준히 나오면서 1*3년이 -28.5에 거래됐으며 이후에는 1년과 2년쪽으로 호가가 형성되는 모습을 보임. 1년 오퍼가 꾸준히 나오면서 20.75에 거래됐으며, 3년 오퍼가 내려오면서 91.75에 거래됨. 이후에 다시 비드가 올라오면서 3년이 92에 여러 차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에 1년 오퍼가 다소 강하게 내려오면서 20.25까지 오퍼가 나왔으며, 마감 이후에도 3년이 91.75/91.5에 대치를 이룸.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.08.23(금)	214.5	198.7	3.50%	3.523%	3.51%	2년물	3.896%	2.1
2024.08.26(월)	215.8	198.6	3.50%	3.528%	3.51%	5년물	3.673%	0.6
2024.08.27(화)	219.3	199.5	3.48%	3.509%	3.52%	10년물	3.862%	2.5
2024.08.28(수)	219.3	200.3	3.48%	3.505%	3.52%	30년물	4.147%	2.1
2024.08.29(목)	219.8		3.43%	3.503%	3.52%	10Y-2Y	-3.4	0.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,662.28	-27.55	25.06.10	국고 22-4	3,100	은행채 3,000	은행채 2,600	
KOSDAQ	756.04	-6.46	25.03.10	국고 20-1	2,100	여전채 3,300	여전채 5,540	
달러-원	1,332.50원	-4.50원	25.03.28	산금채	1,500		회사채 2,850	
국고3Y	2.939%	2	25.09.10	국고 20-6	-60			
국고10Y	3.075%	2.1	25.09.10	국고 23-8	-200			
국고10Y-3Y	13.6	0.1	54.03.10	국고 24-2	-341			

Money Market Closing									
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	0.00
TN	5.45	5.35	5.40	0.03	TN	5.45	5.35	5.40	0.03
1W	5.43	5.38	5.42	-0.04	1W	5.42	5.32	5.38	-0.08
1S	5.52	5.42	5.47	0.00	1S	5.52	5.42	5.47	0.00
3S	5.42	5.32	5.37	0.00	3S	5.45	5.30	5.38	0.00
6S	5.15	4.95	5.07	0.02	6S	5.20	5.00	5.13	-0.02
1YR	4.95	4.55	4.87	0.04	1YR	5.05	4.80	4.90	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-8	-9	5.93	0.28	3.50	5.35000	1M MAR	-264	-262
TN	-50/-44	-47	6.67	0.20	3.50	5.34667	1W*1S	-205	-200
1W	-70/-58	-64	5.97	-0.38	3.50	5.32668	1*2	-260	-250
1S	-280/-250	-265	5.81	-0.17	3.49	5.24674	1*3	-485	-475
3S	-770/-730	-750	5.74	-0.03	3.48	5.05718	1*6	-1110	-1090
6S	-1420/-1360	-1390	5.57	-0.04	3.45	4.74058	1*9	-1585	-1565
1YR	-2320/-2220	-2270	5.13	-0.04	3.36	4.24661	1*12	-2020	-2000

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)

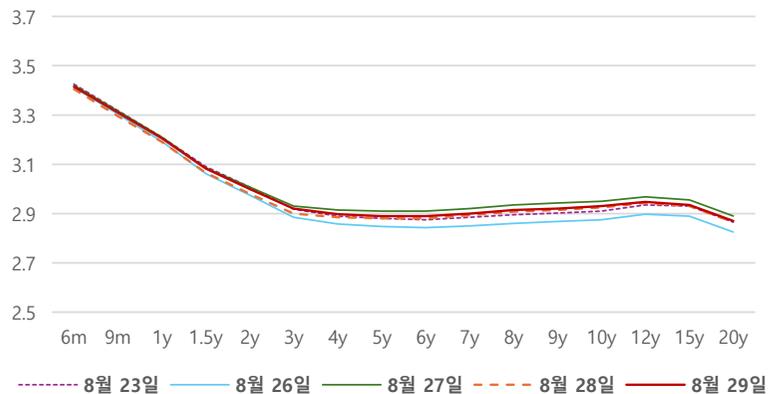
IRS 데일리 증가

8월 29일

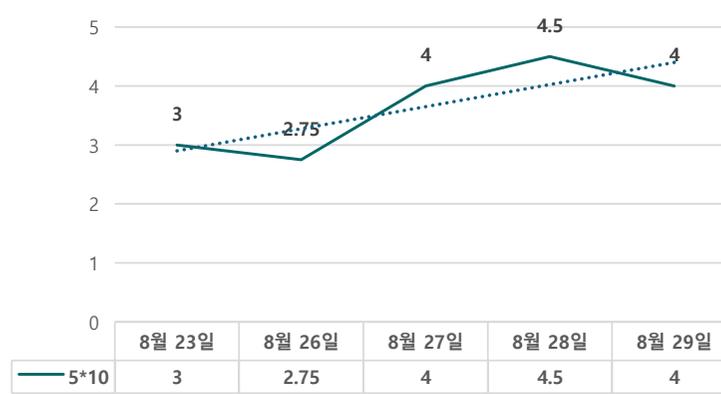
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4150	1.00
9m	3.3100	1.50
1y	3.2050	1.50
1.5y	3.0825	1.75
2y	3.0000	2.00
3y	2.9200	2.00
4y	2.8975	1.25
5y	2.8900	1.00
6y	2.8900	1.00
7y	2.9000	0.75
8y	2.9150	0.75
9y	2.9200	0.50
10y	2.9300	0.50
12y	2.9475	0.50
15y	2.9350	0.50
20y	2.8700	0.50

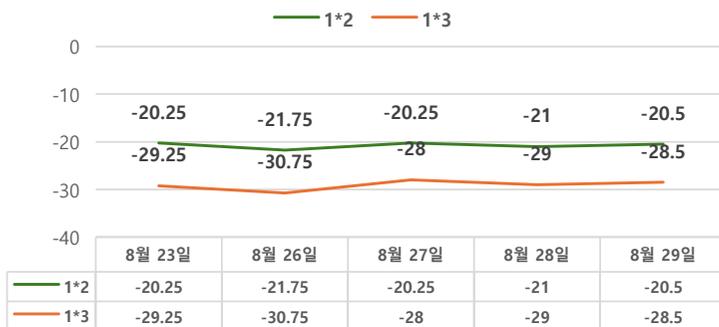
IRS 증가



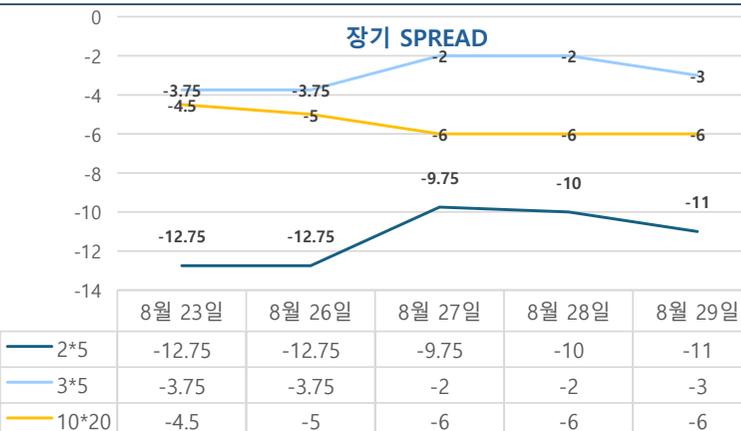
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

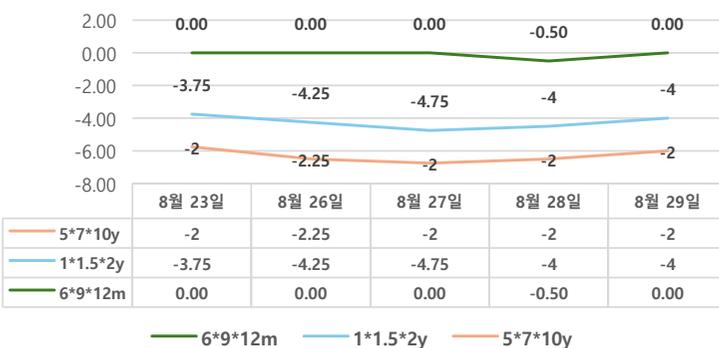


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-20.50	0.50
1*3y	-28.50	0.50
2*5y	-11.00	-1.00
3*5y	-3.00	-1.00
5*10y	4.00	-0.50
10*20y	-6.00	0.00

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.50
1*1.5*2y	-4.00	0.00
2*5*10y	-15.00	-0.50
5*7*10y	-2.00	0.00

2*5*10y FLY

