

레포	지준 마감 이후 은행권 운용 감소할 것으로 예상됐으나 금통위 앞두고 상당 기관 매수에 나서 일반채 이른 시간에 소진되었음. 장 중 은행 및 운용사 추가 자금 유입되어 일반채 담보 저금리 매칭된 반면, 회사채 매수처 많지 않아 막판까지 정채 극심하였음.
채권	한국 : 국제금리는 상승 마감. 중단기 금리가 장기 금리보다 더 큰 폭으로 상승하는 모습. 우리나라의 국제채 세계국채지수(WGBI) 편입에 따라 강세 출발했지만 외국인의 매도세 등을 반영해 약세 전환. 미국 : 미 국제금리는 2년물 및 10년물 금리 하락, 30년물 금리 상승 마감. 9월 CPI가 전월비 0.2% 상승하며 시장 예상치 0.1%를 소폭 상회하였고 9월 근월 CPI도 전월비 3.3% 오르며 시장 예상치 3.2%를 웃돌았음. 한편 주간 신규 실업보험 청구건수는 계절조정 기준 직전주보다 3만 3천명 늘어난 25만 8천명으로 집계됨. 미국 재무부가 220억달러 규모로 진행한 30년 만기 국제채 입찰에서는 강한 수요 확인. 이날 입찰에서 30년물 국제금리는 4.389%로 결정.
MONEY	아시아 머니 시장에서 10일 대만 휴장 & 11일 홍콩 휴장 & 14일 뉴욕 휴장 (노동절)로 10월의 막판 휴장 커버를 위해서 오버나이트 1일물은 4.83-4.86, 홍콩 휴장 커버 5일물 4.85-4.90 사이로 체결되며 마감됨. 금일 대만과 내일 홍콩의 휴장으로 비드 호가가 한정적인 가운데 15일 시작으로 중국계 역외 센터 비드로 1개월물 5.04-4.98 수준으로 호가 형성되며 온쇼-올쇼간 매칭 거래 체결. 연준의 11월 금리 동결 우세론이 고개를 들면서 SOFR 금리도 10월초 대비 1개월물 제외하고 3개월-1년물 모두 상승세를 보이고 있고, 특히 1년물은 30bp 가량 상승했음. 금리 동결 우세 분위기 속, 연내 구간 만기 오피가 강세 vs 연말 커버 장기 테너 차입 수요 증가에 1-2개월물은 레벨 정채 & 6개월물과 1년물은 상승세를 보이고 있음. 한국계 6개월물 4.60-4.70 비드와 1년물 4.35-4.45 수준에 시장 태핑 중이나 장기 테너 렌더인 대만 휴장으로 장기를 체결 정채 속 단기를 (중국계 4.98-5.04, 한국계 4.95) 위주로 체결 되고 있음.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 WGBI(세계국채지수) 한국 편입 소식으로 하락세를 보임. 1년 만기물의 증가는 3거래일수 보정 고려시 전장보다 90전 하락한 -22.80원에 형성되었고 6개월 만기물은 전장보다 40전 하락한 -13.00원의 증가를 기록함. 10/9일 한글날 휴장동안 세계 국제채지수 편입 뉴스가 나오면서 하락 분위기가 나왔으나 오는 11월 열릴 예정인 한국은행 금융통화위원회(금통위)의 발표에 따라 방향성이 결정될 것으로 예상됨. 시장 전반적으로 금리 인하 폭보다 한국은행의 장기 방향성에 더 주목하는 분위기로 보임.
IRS	전일 irs는 금통위를 하루 앞두고 한국 wgbi 세계국채지수 편입에 성공하여 초반에 선물 움직임에 영향을 주는듯 하였으나 이후에는 9월 fomc 회의록 공개와 미국 9월 cpi 대기 영향으로 되돌림 장세로 바뀌어 단기쪽은 소폭 하락, 이외 구간은 상승 마감. 초반에는 단기쪽 거래 소식과 함께 단기 오피가 많이 보였으며 3년이 99에 거래되었고 이후에는 한산한 분위기를 보임. 오후에도 단기쪽으로 호가가 꾸준히 나오는 모습과 함께 5년과 10년 비드가 나왔고 5년은 95.5에 거래되었으며 10년 비드는 꾸준히 올라 98로 나옴. 막판에는 9m*1.5년이 -19에 거래되었으며 1년이 20/19.5에서 19.5에, 1.5년이 10/9.5에서 10에 거래되었으며 3년 비드가 99.75로 올라와 거래가 이뤄지면서 전체적인 커브가 움직임. 마감 이후에도 1년으로 호가 형성되었으며 19.5/19.25에서 19.25에 거래되었고 이후 1년 오피가 19에까지 내려오는 모습을 보임. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.50이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.10.02(수)	227.0	178.9	3.48%	3.510%	3.500%	3.52%	2년물	3.961%	-6.3
2024.10.04(금)	223.9	187.8	3.45%	3.494%		3.52%	5년물	3.887%	-3.1
2024.10.07(월)	221.1	191.9	3.50%	3.473%		3.51%	10년물	4.064%	-1.1
2024.10.08(화)	221.9	191.8	3.50%	3.483%		3.51%	30년물	4.360%	1.7
2024.10.10(목)	218.5		3.50%	3.517%		3.50%	10Y-2Y	10.3	5.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종외가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,599.16	4.80	25.10.10	산금채	3,000	은행채 2,300	은행채 8,500	물가채 10년 1,000억원 입찰
KOSDAQ	775.48	-2.76	26.04.10	중금채	3,000	회사채 9,390	여전채 9,520	
달러-원	1,355.20원	9.20원	26.10.02.	통안채	1,600	공사채 500	회사채 6,902	
국고3Y	2.962%	3	31.12.10	국고 21-11	-40			
국고10Y	3.088%	1.1	25.06.10	국고 15-2	-100			
국고10Y-3Y	12.6	-1.9	51.03.10	국고 21-2	-206			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN				CHINESE					
기간	증가	전일대비	기간	증가	전일대비	기간	전일대비		
O/N	4.90	4.82	4.86	0.00	O/N	4.88	4.83	4.86	0.00
TN	4.91	4.83	4.87	0.00	TN	4.90	4.85	4.88	0.02
1W	4.95	4.85	4.90	0.00	1W	4.92	4.85	4.90	0.00
1S	4.99	4.89	4.94	0.00	1S	5.05	4.95	5.00	0.00
3S	5.05	4.90	4.97	0.00	3S	5.05	4.90	5.00	0.00
6S	4.83	4.68	4.75	0.03	6S	4.95	4.65	4.80	0.06
1YR	4.67	4.37	4.55	0.02	1YR	4.70	4.40	4.60	0.10

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
						단위 : 전, %, %p			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-4	-5	4.83	-0.27	3.50	4.84000	1M MAR	-230	-222
TN	-27/-25	-26	5.23	0.13	3.50	4.83945	1W*1S	-180	-170
1W	-53/-49	-51	5.45	0.00	3.50	4.83616	1*2	-222	-218
1S	-245/235	-240	5.56	0.10	3.49	4.82299	1*3	-490	-480
3S	-745/-725	-735	5.64	0.06	3.48	4.65828	1*6	-1030	-1010
6S	-1330/1270	-1300	5.38	0.06	3.42	4.44581	1*9	-1540	-1510
1YR	-2330/2230	-2280	5.00	0.07	3.25	4.12794	1*12	-2000	-1970

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)

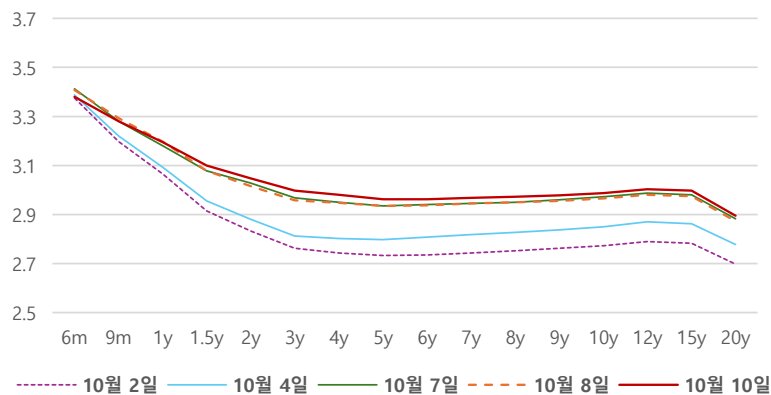
IRS 데일리 증가

10월 10일

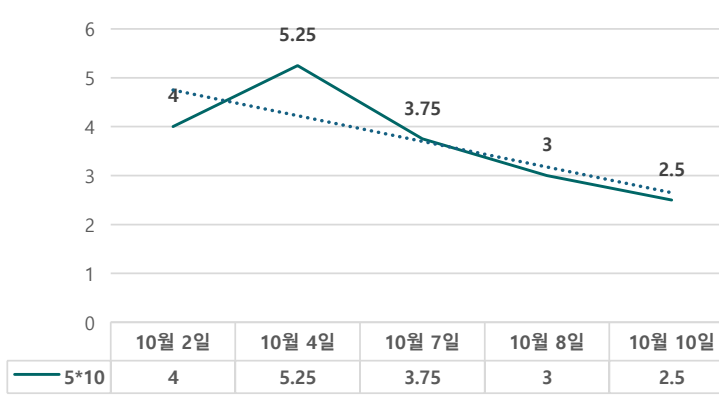
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3800	-2.75
9m	3.2800	-1.25
1y	3.1950	-0.25
1.5y	3.1000	2.25
2y	3.0475	3.25
3y	2.9975	4.00
4y	2.9800	3.25
5y	2.9625	2.75
6y	2.9625	2.50
7y	2.9675	2.25
8y	2.9725	2.25
9y	2.9775	2.25
10y	2.9875	2.25
12y	3.0025	2.25
15y	2.9975	2.25
20y	2.8950	2.25

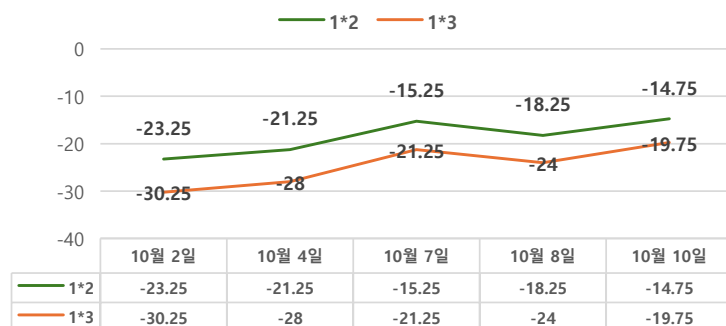
IRS 증가



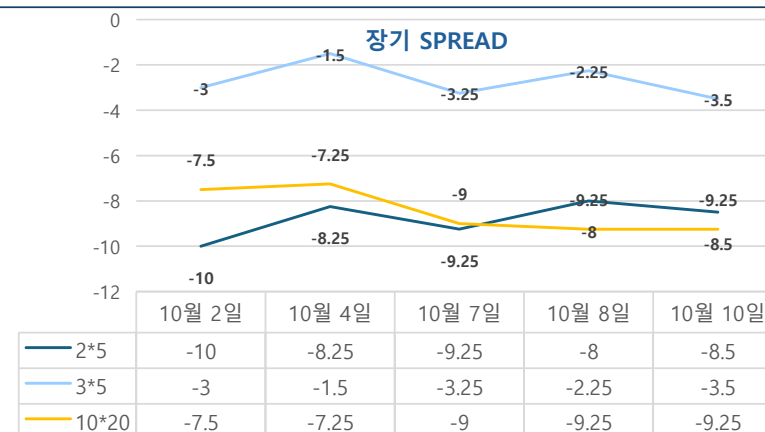
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

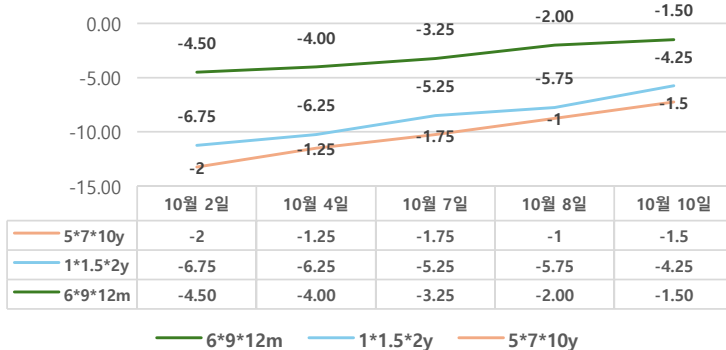


IRS 주요 커브

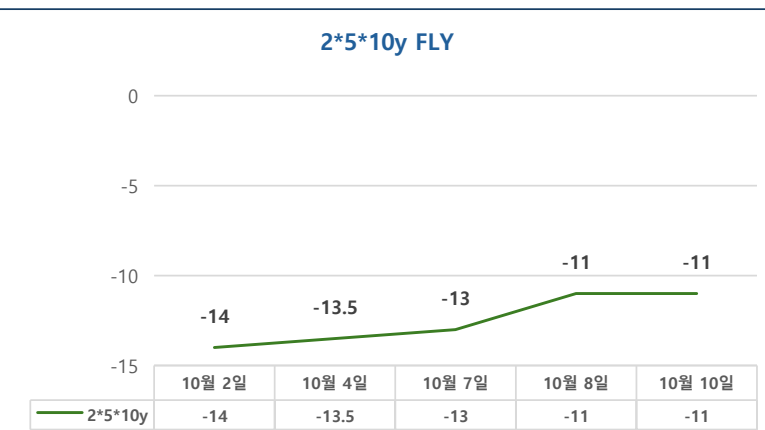
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.75	3.50
1*3y	-19.75	4.25
2*5y	-8.50	-0.50
3*5y	-3.50	-1.25
5*10y	2.50	-0.50
10*20y	-9.25	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.50	0.50
1*1.5*2y	-4.25	1.50
2*5*10y	-11.00	0.00
5*7*10y	-1.50	-0.50