

레포	국고금 및 공모주(와이제이링크) 청약자금 유입됐음에도 매수 증분치 않아 부족세 지속됐으며, 장 중 거래금리 상승하였음. 은행권 운용에 힘입어 일반채 정채 오후에 해소됐으나 회사채 난항은 장 막판까지 계속되었음. [공모주] 와이제이링크 모집 10.10~10.11 환율 10.15 KB 5.13조
채권	한국 : 국채금리는 혼조세 마감. 보험권에서 중단기 구간은 강세, 장기 구간은 약세를 보이는 모습. 전반적으로 외국인인 국채선물을 사들이며 강세 압력을 가했으나 장기 구간은 지난 주말 미 국채 장기 금리가 오른 여파에 약세를 보임. 미국 : 미 국채 시장, '콜럼버스의 날' 맞아 휴장. 영국과 독일 등 주요국 장기 국채 수익률은 상승
MONEY	금일 뉴욕 (콜럼버스의날), 일본 (체류의 날)로 휴장을 맞이해, 오버나이트 부채 속 KEB 하나 국내이체로 대기성 오퍼에 4.80-4.83 수준으로 거래되며 마무리. 중국계로 1개월물 오퍼가 역내외에서 5.00-5.05 사이로 제시되며 5.02-5.03 수준에 체결되었고, 통2개월물 (End Dec) 오퍼도 4.95-4.96에 제시되며 체결되었음. 연말 커브 구간 3개월물 (5.00-5.03)과 6개월물 (4.78-4.85) 오퍼가 온쇼에서 역외 중국계, 대만계 그리고 말레이계 쪽으로 제시되면서 연내 한차례 인하 가능성에 연금기는 구간 운용 수요도 일부 제시되고 있음. 한국계 1년물은 최근 4.50-4.53 수준으로 형성되면서 시은 해외 지점들의 366일 이상 구간으로 LCR 비율 매칭 비드가 시장에 제시되면서 스물로 체결되고 있는 분위기.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 만기별 혼조세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장파와 같은 -22.70원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 10전 내린 -13.10원의 증가를 기록함. 미국 금융 시장 휴장으로 특별한 재료가 없어 구간별로 수급이 가격 형성에 큰 영향을 미침. 미국 9월 PPI 지표 발표가 시장 예상치보다 하회했음에도 이스라엘-이란 등 지정학적 리스크로 인해 달러 강세장은 이어졌고 위안화 약세에 맞물려 원화 역시 약세를 기록함. 이날 코스피는 상승 마감했으나 수급상 결제 수요가 더 큰 것으로 보이며 미국 대선과 11월 FOMC 등 불확실성이 남아있어 원화 반등이 쉽게 나오지 못할 것으로 예상됨.
IRS	금일 IRS는 대체로 하락 마감. 초단기 구간인 6개월 구간은 오퍼와 비드가 전반적으로 비슷하게 나왔으며, 2-3년 구간이 현물보다 좀 더 오퍼리쉬한 분위기를 보임. 초반에는 다소 한산한 분위기를 띄웠으며, 오후에는 2년과 3년으로 호가 형성되면서 2년이 99에 거래됨. 이후 2년 오퍼와 3년 비드가 엮인 2*3년이 -3.5에 거래가 이뤄졌으며 2*3년 오퍼가 다소 많은 모습을 보임. 장 막판에는 10*30년 오퍼가 -37에까지 내려오며 초장기쪽 레벨이 움직이게 되었고 6개월 오퍼가 내려오면서 30.75에 거래된 후 ND/D로 초이스를 이루는 동시에 D로 31까지 거래가 이뤄짐. 이후로도 계속해서 6개월이 30.75에 ND/D로 초이스를 이루다, 31/30.75에 대치되면서 31에 막판에 거래됐으며, 2년 오퍼가 내려오면서 98에 거래됨. 5년쪽으로 비드가 나오면서 95에 초이스를 이루다 5년 비드와 2년 오퍼가 엮이면서 2*5년이 -3.5에 거래가 한차례 더 이뤄졌으며, 이후 5년이 94.75/94.5에 대치됐으며 시장에서 94.5 거래 소식이 들림.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
						단위: 조 원	한국시간 오전 07:05 기준	단위: bp
2024.10.07(월)	221.1	191.9	3.50%	3.473%	3.50%	3.51%	2년물 3.960%	0
2024.10.08(화)	221.9	191.8	3.50%	3.483%		3.51%	5년물 3.904%	0
2024.10.10(목)	218.5	188.7	3.50%	3.517%		3.50%	10년물 4.102%	0
2024.10.11(금)	218.2	188.7	3.30%	3.312%	3.25%	3.40%	30년물 4.413%	0
2024.10.15(화)	216.6		3.30%	3.306%		3.40%	10Y-2Y 14.2	0

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
					단위: 억 원			단위: 억 원
KOSPI	2,623.29	26.38	26.04.14	중금채	4,000	은행채 1,500	은행채 2,900	국고채 2년 7,000억원 입찰
KOSDAQ	770.26	-0.72	25.01.14	통안채	3,100	통안채 8,000	여전채 900	통안채 18,000억원 조기환매
달러-원	1,358.60원	7.30원	25.10.14	중금채	2,500	공사채 11,100	회사채 3,026	
국고3Y	2.938%	-0.9	29.06.10	국고 19-4	-500		통안채 5,700	
국고10Y	3.087%	0.2	28.06.10	국고 18-4	-505		공사채 2,900	
국고10Y-3Y	14.9	1.1	25.09.10	국고 23-8	-600			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.85	4.80	4.82	-0.03	O/N	4.85	4.80	4.82	-0.02
T/N	4.91	4.83	4.87	0.00	T/N	4.87	4.82	4.85	-0.01
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	5.02	0.02
3S	5.05	4.90	4.97	0.00	3S	5.05	4.90	5.02	0.02
6S	4.83	4.68	4.75	0.00	6S	4.90	4.60	4.80	0.00
1YR	4.68	4.38	4.53	0.03	1YR	4.75	4.45	4.65	0.05

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
						단위: 전, %, %p			단위: 전
T/N	-7/-5	-6	4.84	0.01	3.25	4.82000	1M MAR	-231	-226
S/N	-8/-6	-7	5.11	-0.26	3.25	4.81890	1W*1S	-190	-180
1W	-50/-48	-49	5.11	-0.33	3.25	4.81230	1*2	-205	-195
1S	-245/-235	-240	5.30	-0.21	3.36	4.78592	1*3	-490	-485
3S	-750/-730	-740	5.62	-0.01	3.45	4.64730	1*6	-1060	-1040
6S	-1340/-1280	-1310	5.36	-0.02	3.40	4.44358	1*9	-1565	-1535
1YR	-2320/-2220	-2270	4.97	-0.03	3.24	4.13974	1*12	-2020	-2000

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)

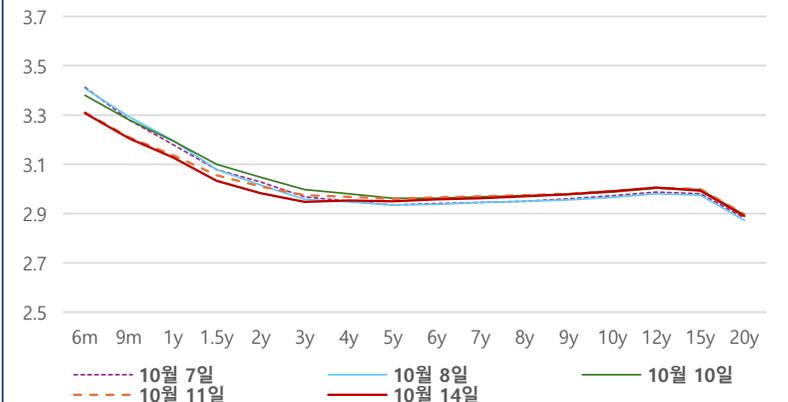
IRS 데일리 증가

10월 14일

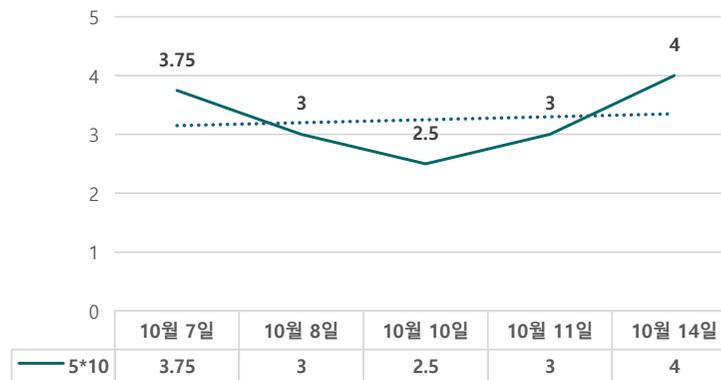
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3075	-0.25
9m	3.2050	-0.50
1y	3.1275	-1.00
1.5y	3.0325	-2.25
2y	2.9825	-2.75
3y	2.9475	-2.75
4y	2.9525	-1.50
5y	2.9500	-1.00
6y	2.9575	-0.75
7y	2.9625	-0.75
8y	2.9700	-0.50
9y	2.9775	-0.25
10y	2.9900	0.00
12y	3.0050	0.00
15y	2.9925	-0.75
20y	2.8900	-0.75

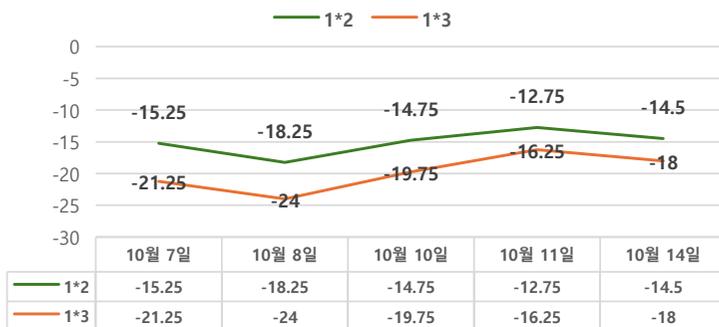
IRS 증가



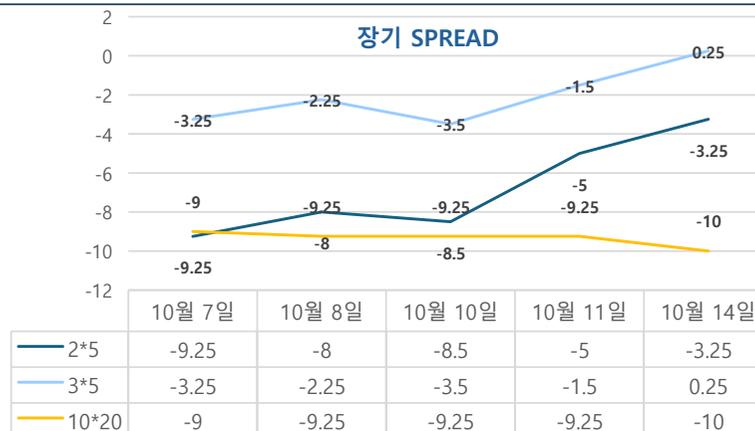
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.50	-1.75
1*3y	-18.00	-1.75
2*5y	-3.25	1.75
3*5y	0.25	1.75
5*10y	4.00	1.00
10*20y	-10.00	-0.75

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.50	0.25
1*1.5*2y	-4.50	-0.75
2*5*10y	-7.25	0.75
5*7*10y	-1.50	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY

