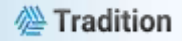


# Market Daily Report



2024.10.18(금)

<b>레포</b>	건보자금 유효한 가운데 공모주 청약자금 유입되어 조달여건 매우 양호했고, 장 초반부터 잉여 분위 형성되었음. 시중은행 및 증권사 저금리 매도 간헐적으로 발생했으며, 한은RP매각 입찰 이후 운용사 매수 추가되어 수급 무난하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국제금리는 상승 마감. 트럼프 리스크와 북한 지정학 이슈로 인한 달러-원 환율 상승, 호주 고용지표 호조 등이 영향을 미치며 최근의 강세를 일부 되돌리는 모습. 미국 : 미국 경기가 견고하다고 가리키는 지표가 잇따라 발표되며 매도 심리를 자극. 이에 미 국제금리는 모두 상승 마감. 미국 9월 소매판매는 전월비 0.4% 증가로 시장 예상치 0.3% 증가를 상회함. 지난 12일로 끝난 한 주간 신규 실업보험 청구건수도 직전주보다 1만 9천명 줄어든 계절 조정 기준 24만 1천명으로, 실업 현황도 개선된 모습. 기준금리 50bp 하락에도 소비가 가파르게 회복된 점에 비추어 연준의 금리 인하 속도가 느려질 것이라는 전망도 힘을 얻고 있음. 한편 ECB는 이날 3대 정책금리를 모두 25bp씩 인하.
<b>MONEY</b>	SOFR 오버나잇이 4.86으로 상승했고, 역외 초단기 자금이 일부 타이트해 오버나잇 4.85-4.90까지 체결 된 반면, 온쇼에서는 달러 유동성이 여유롭고 단기 FX스왑이 강세를 보이고 있어, 머니 자금 운용에 좀더 집중 되는 모습. (오버나잇 4.83-4.85 수준 유지) 역내외 1주일 4.90-4.93 2주일 4.93-4.96 1개월물 4.95-5.00 수준의 운용 인트가 여전히 높은 가운데, 월말 커버 및 FOMC 회의 시점에 매칭을 위한 단기를 수요도 시장에서 제시되며 시장에 USD 펀딩을 잘 하지 않았던 싱가포르 국내은행들도 2주-1개월물 차입하며 레벨도 4.93-4.95 수준까지 올려 국사이즈 체결 소식 전했음. CME FEDWATCH에서는 11월 금리 인하 가능성을 85% 이상으로 반영하며 FOMC 회의가 3주도 채 남지 않은 상황에서 역외에서 장기물 6개월 -1년물 오피를 좀더 공격적으로 제시 중. 연커버 구간 3개월물은 5% 전후반에 레벨이 갱신되는 정제된 분위기인 반면 장기구간은 네임별 & 센터별 호가가 다양하게 제시되며, 1년물이 4.50% 수준으로 중국계, 말레이계로 체결 소식 전했음.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환 스와프포인트는 장기를 중심으로 하락세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 20전 내린 -22.90원에 형성됐고 6개월 만기물 역시 전장보다 20전 하락한 -13.20원의 증가를 기록함. 미국 대선에서 트럼프 대통령이 우세하다는 조사 결과가 나오면서 달러-원 환율은 연장 시간대에서 1,371.40원까지 상승하며 글로벌 달러 강세가 심화됨. 환율이 상승하면서 선물환 매도 물량이 나왔고 이것이 장기물에 하방 압력으로 작용한 것으로 분석됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 미국 소매 판매 지표 대기하는 분위기 속에 국제선물 움직임과 연동되어 상승 마감. 초반에는 7년이 79/78에 대기되다 오피가 강하게 내려오면서 87에 몇 차례 거래됨. 6개월 오피가 내려왔으며 3*4*5년 오피가 내려오며 par/-0.5를 이룸. 오후에는 2년과 5년으로 호가가 형성되면서 2년이 93.5/93에서 93.5에 거래가 이뤄졌고, 5년 오피가 나오며 88에 거래됨. 이후 3년 비드가 올라오며 88.75에 거래가 이뤄졌으며, 6년쪽으로도 꾸준히 오피가 나오는 모습을 보임. 장 막판에는 6*9*12개월 -2.75 마켓 거래 소식과 함께 -2.75/-3으로 대치를 이뤘으며 1.5년 비드는 99.5, 7년 비드는 89.25로 올라옴. 마감 이후에는 3년 비드는 89.5에 나왔고 2년 비드가 94.5까지 올라왔으며 마켓에서는 95에까지 거래 소식이 들림. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.39이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	플금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.10.11(금)	218.2	188.7	3.30%	3.312%	3.25%	3.50%	2년물	3.974%	3.2
2024.10.15(화)	216.6	190.9	3.30%	3.306%		3.40%	5년물	3.901%	5.6
2024.10.16(수)	219.3	193.9	3.27%	3.291%		3.40%	10년물	4.093%	7.8
2024.10.17(목)	220.5	198.1	3.27%	3.282%		3.40%	30년물	4.391%	9.4
2024.10.18(금)	223.4					3.40%	10Y-2Y	11.9	4.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부업 최종오기수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,609.30	-1.06	27.03.03	통안채	2,000	은행채 2,300	은행채 6,600	국고채 50년 5,000억원 입찰
KOSDAQ	765.06	-0.73	31.12.10	국고 11-7	1,000	여전채 4,000	여전채 5,680	
달러-원	1,372.70원	8.20원	34.06.10	국고 24-5	739	회사채 1,800	회사채 4,695	
국고3Y	2.897%	1.7	26.03.10	국고 24-3	-500	공사채 6,271	공사채 32	
국고10Y	3.028%	2.0	28.03.10	국고 23-1	-871			
국고10Y-3Y	13.1	0.3	28.12.10	국고 18-10	-1,000			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	지표	전일대비	증가	전일대비	기간	지표	전일대비	증가	전일대비
O/N	4.89	4.81	4.85	0.00	O/N	4.90	4.85	4.86	-0.01
T/N	4.91	4.83	4.87	0.00	T/N	4.90	4.85	4.87	0.00
1W	4.95	4.85	4.90	0.00	1W	4.95	4.85	4.90	0.00
1S	4.99	4.89	4.94	0.00	1S	5.07	4.97	5.00	-0.02
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	0.00	6S	4.90	4.60	4.78	-0.02
1YR	4.68	4.38	4.55	0.00	1YR	4.60	4.40	4.50	-0.05

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-4	-5	4.57	-0.27	3.25	4.86000	1M MAR	-209	-207
T/N	-20/-16	-18	4.83	0.26	3.25	4.85745	1W*1S	-175	-165
1W	-48/-42	-45	4.94	-0.01	3.25	4.84214	1*2	-210	-206
1S	-230/-210	-220	5.21	-0.01	3.34	4.78089	1*3	-525	-515
3S	-745/-725	-735	5.55	0.00	3.42	4.63235	1*6	-1080	-1060
6S	-1350/-1290	-1320	5.33	0.01	3.37	4.43182	1*9	-1580	-1550
1YR	-2340/-2240	-2290	4.95	0.00	3.22	4.11010	1*12	-2070	-2020

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)

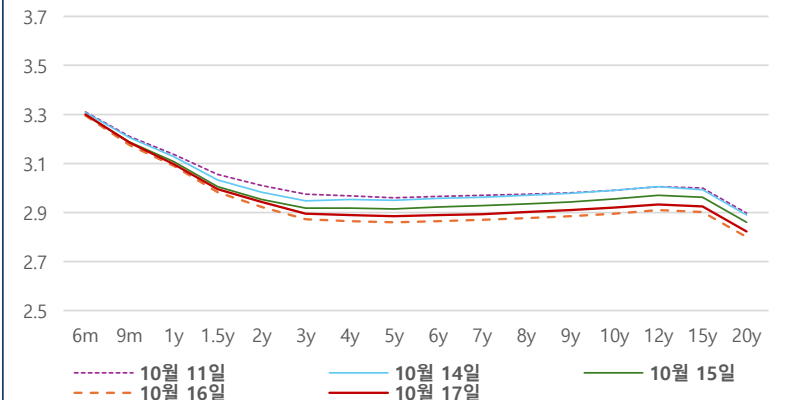
IRS 데일리 증가

10월 17일

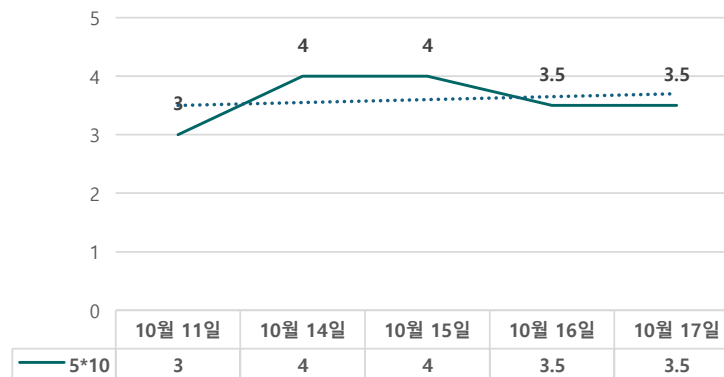
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3000	0.50
9m	3.1850	1.00
1y	3.0975	0.75
1.5y	2.9950	1.25
2y	2.9425	2.00
3y	2.8950	2.25
4y	2.8900	2.50
5y	2.8850	2.50
6y	2.8900	2.50
7y	2.8925	2.25
8y	2.9025	2.50
9y	2.9100	2.50
10y	2.9200	2.50
12y	2.9325	2.25
15y	2.9250	2.25
20y	2.8225	2.25

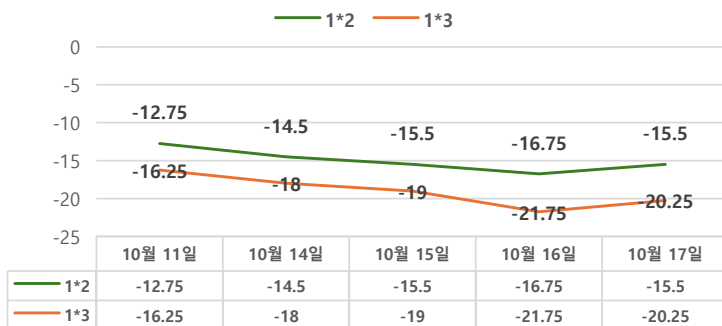
IRS 증가



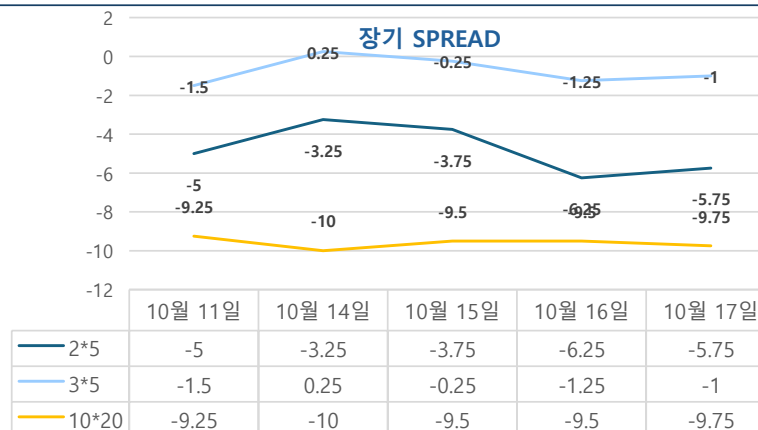
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

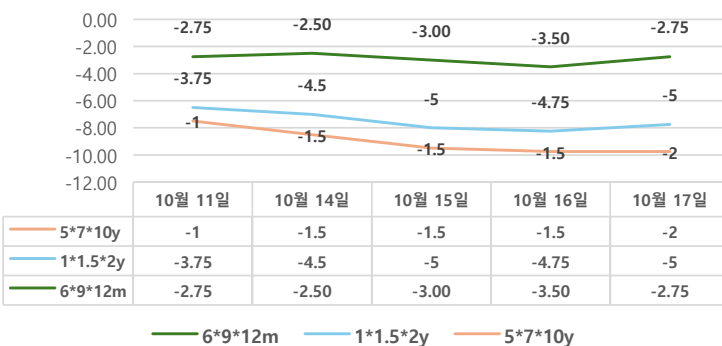


IRS 주요 커브

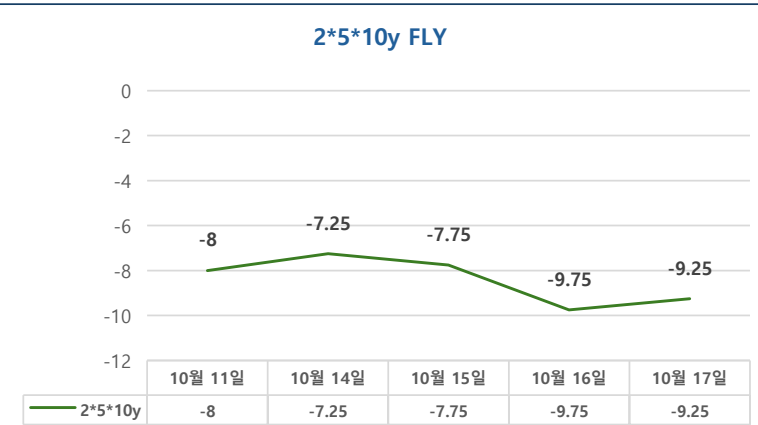
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-15.50	1.25
1*3y	-20.25	1.50
2*5y	-5.75	0.50
3*5y	-1.00	0.25
5*10y	3.50	0.00
10*20y	-9.75	-0.25

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	0.75
1*1.5*2y	-5.00	-0.25
2*5*10y	-9.25	0.50
5*7*10y	-2.00	-0.50