

Market Daily Report

2024.10.21(월)



레포	건보자금 유효한 가운데 공모주 청약자금 유입되어 조달여건 매우 양호했고, 장 초반부터 잉여 분위기 형성되었음. 시중은행 저금리 매도 간헐적으로 발생했으며, 금리 공모주 청약자금 유출입 혼재하면서 은행권 매수 규모에 따라 수급 분위기 달라질 것으로 예상되며. 회사채 타이트한 흐름은 유지될 전망.
채권	한국 : 국채금리는 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 국채금리는 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.
MONEY	주말을 앞두고, 역내외 한산한 분위기 속에 오버나잇 위주로 거래되며 온쇼 4.83-4.86, 역외 4.85-4.89 수준으로 마감됨. 대만계 은행들의 월말 커버 2주물을 4.96까지 올리면서 1-2주물이 그동안 4.90-4.92 수준의 저점을 유지해 왔으나, 월말 구간에 접어들면서 차입 수요가 늘면서 레벨 상승세를 보임에 1개월물 레벨도 소폭 오름세를 보였음. 단, 중국 본토 국영은행들의 단기물 유통성 공급으로 오버나잇-1개월 중국계로 굿사이즈 오퍼가 제시 되면서 중국계 1개월물 레벨은 4.97-4.98 수준으로 전일 대비 소폭 하락세를 보였음. SOFR 금리가 장기물은 전주 대비 하락세를 보였고, 연준의 11월 FOMC 회의가 다가오면서 1년물 유럽계 네임들의 차입 금리는 소폭 하락세를 보이며, 1년물 4.50 수준에서 4.40-4.45 수준으로 하향 조정 되었으며, 중국계 및 말레이계 은행으로 최근 1년물 4.50-4.55 수준에 체결 되면서 장기물 레벨은 네임별로 다시 조정 장세를 보이고 있음.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 장기를 중심으로 하락세를 보임. 미국 여러 경제지표 발표 결과 미 연준의 금리 인하 기대가 감소함에 따라 예선 스와프 수급에도 영향을 미친 것으로 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 70전 내린 -23.60원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 30전 내린 -13.50원의 증가를 기록함. 9월 미국 소매판매 지표가 시장 예상치를 상회했고 고용 지표도 견조하게 나오며 외화자금시장에서는 장기를 중심으로 하방 압력을 받음.
IRS	전일 irs는 미국 9월 소매 판매 지수가 0.4%로 예상치인 0.3%를 상회하며 이에 영향을 받은 국채선물 움직임과 연동되어 상승 마감. 초반에는 3년이 90.25에 nd/d로 초이슬을 이루다 거래되었고 이후에 현물 움직임에 따라 90에 거래가 이뤄졌으며 3*4*5년은 비드가 올라오며 nd로 -0.25에 거래됨. 오후에는 2*3년 오퍼가 -4.25로 나왔고 이후에는 한산한 분위기를 보임. 장 막판에는 2년과 3년 오퍼가 96.5, 92로 내려왔고 4년 비드가 올라와 92에 몇 차례 거래가 이뤄짐. 마감 이후에도 4년 비드가 나오며 92에 거래되었고 5년이 91.5에 거래된 후 엔디 오퍼가 나오며 91.5 초이슬을 이루다 추가 거래되었고 2년 비드가 nd로 96.5에 올라옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.10.11(금)	218.2	188.7	3.30%	3.312%	3.25%	3.40%	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	198.6	2.25%	3.282%		3.40%	30년물	4.391%	9.4
2024.10.18(금)	221.5		3.26%	3.278%		3.39%	10Y-2Y	11.9	4.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
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									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.89	4.81	4.85	0.00	O/N	4.90	4.85	4.85	-0.01
T/N	4.91	4.83	4.87	0.00	T/N	4.90	4.85	4.86	-0.01
1W	4.95	4.85	4.91	0.01	1W	4.95	4.85	4.90	0.00
1S	5.00	4.90	4.95	0.01	1S	5.05	4.95	4.98	-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	4.75	-0.03
1YR	4.65	4.35	4.53	-0.02	1YR	4.60	4.40	4.53	0.03

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-15/-13	-14	4.48	-0.09	3.25	4.86000	1M MAR	-225	-220
T/N	-6/-4	-5	4.57	-0.26	3.25	4.85675	1W*1S	-175	-170
1W	-48/-42	-45	4.94	0.00	3.25	4.83723	1*2	-225	-215
1S	-225/-215	-220	5.20	-0.01	3.33	4.75915	1*3	-510	-500
3S	-740/-720	-730	5.53	-0.02	3.41	4.61740	1*6	-1125	-1075
6S	-1380/-1320	-1350	5.37	0.03	3.36	4.41536	1*9	-1650	-1590
1YR	-2410/-2310	-2360	5.00	0.05	3.21	4.08911	1*12	-2125	-2065

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)

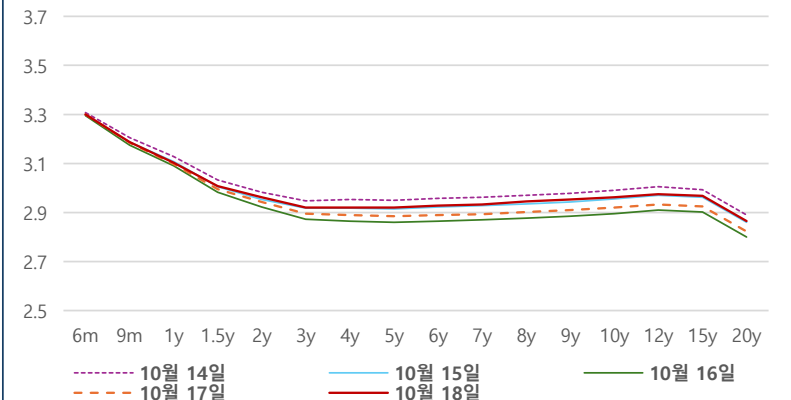
IRS 데일리 증가

10월 18일

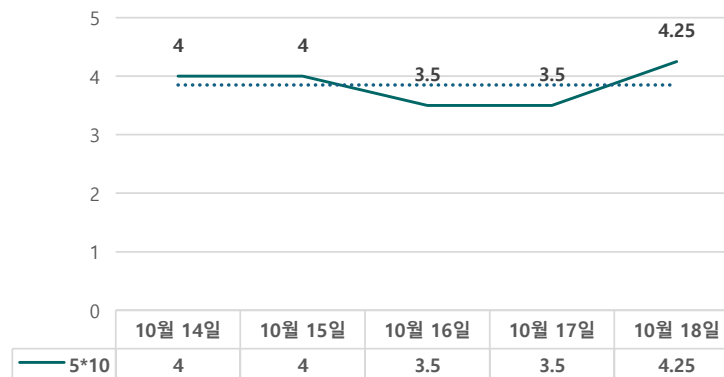
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3000	0.00
9m	3.1875	0.25
1y	3.1025	0.50
1.5y	3.0075	1.25
2y	2.9625	2.00
3y	2.9200	2.50
4y	2.9200	3.00
5y	2.9200	3.50
6y	2.9275	3.75
7y	2.9325	4.00
8y	2.9450	4.25
9y	2.9525	4.25
10y	2.9625	4.25
15y	2.9675	4.25
20y	2.8650	4.25

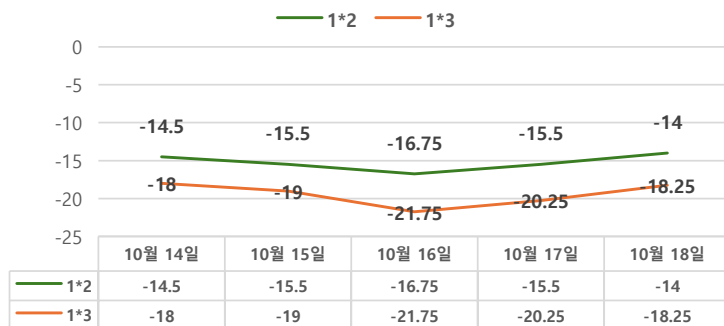
IRS 증가



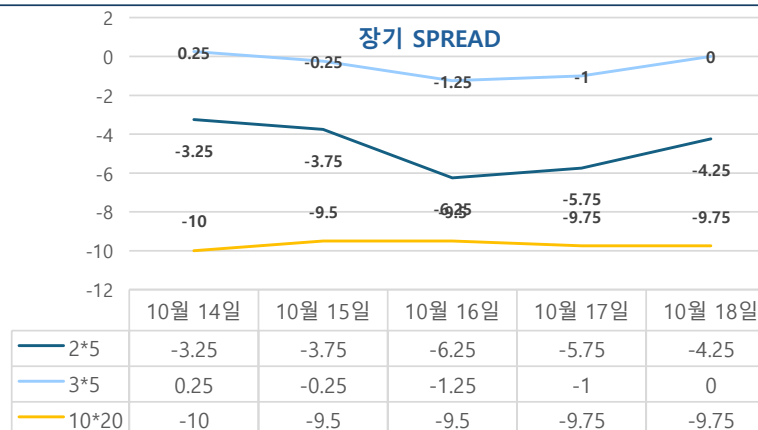
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

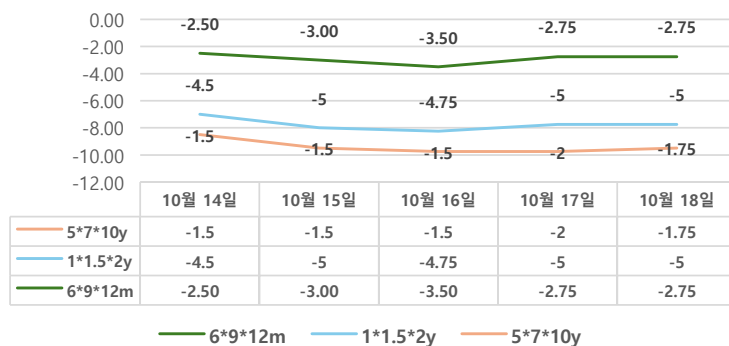
구분	증가	전일대비
1*2y	-14.00	1.50
1*3y	-18.25	2.00
2*5y	-4.25	1.50
3*5y	0.00	1.00
5*10y	4.25	0.75
10*20y	-9.75	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	0.00
1*1.5*2y	-5.00	0.00
2*5*10y	-8.50	0.75
5*7*10y	-1.75	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

