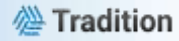


Market Daily Report

2024.10.23(수)



레포	전일 장 초반부터 은행권 매수 꾸준하여 청약자금 환불 영향 제한적이었으며, 회사채 정체도 이른 시간에 해소되어 잉여세 이어짐. 특별한 자금 감소요인 없는 가운데 공모주 청약자금의 단기 실패로 유동성 증가할 것으로 예상되며 잉여폭 늘어날 전망.
채권	한국 : 국채금리는 장기 중심으로 급등하며 마감. 트럼프 전 대통령의 당선 가능성 확대에 미 국채금리가 급등한 데 영향을 받았음. 외국인도 10년 국채선물을 대거 매도해 약세 압력을 가했음. 미국 : 미 국채금리는 30년물 제외 모두 상승 마감. 장 초반까지는 전일 급락에 따른 저가 매수세가 유입되는 양상이었다가, 중동 불안감 속에 국제유가가 급등세를 이어가자 분위기가 반전되었음. 이날 WTI는 2% 넘게 상승하며 72달러선을 회복. 트럼프 승리 가능성에 대한 경계감도 지속. 리치먼드 연방준비은행의 10월 관할지역 제조업지수는 -14로 전월비 7포인트 상승하며 시장 예상치(-19)를 상회하였으나, 시장에 큰 영향은 없었음.
MONEY	은소 단기 유동성이 여유있는 가운데, FX 스왑 단가들이 오전 대비 오후에 상승세를 보이며 (-6전->-3전) 스왑 연계 은소 머니 단가물 비드도 감소해 오버나잇 4.83-4.85 수준의 레벨 변동 없이 마감. 11월6일-7일 FOMC 회의 일정이 2주 가량 남은 시점에서 연준의 금리 동결이 시장 분위기상 우위를 보이며, 시장호가 레벨 변동성이 제한된 분위기 속 10월말 마감 커버를 위한 1-2주물 레벨도 4.90-4.95 수준으로 유지 중. 머니 시장 호가가 많지 않은 가운데, 연말 커버 구간의 비드-오퍼도 네임별 차등이 크지 않은 상황에서 레벨은 3개월물 4.97-5.03 6개월물 4.75-4.83 수준으로 형성되며 마감됨. 중국계 일부 은행들의 장기 커버 구간 엔화 비드를 제시 중이나, 엔화 약세에 환율이 150엔을 넘기자 스왑 환산 달러 금리도 낮아져 카운터 오퍼 찾기가 쉽지 않아 1년물 엔화는 오퍼 부재 속 0.50% 비드 레벨만 제시 중.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 미 대선에서 트럼프 당선 가능성이 커진 데에 따른 미 국채 금리 상승의 영향으로 장기물 중심으로 하락세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 50전 하락한 -24.10원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 10전 내린 -13.70원의 증가를 기록함. 2주 앞으로 다가온 미 대선에서 트럼프 당선 시 미 국채 공급량 부담이 커질 것으로 시장이 예측하면서 미 국채 금리가 상승했고 외화자금시장에서 스와프포인트 약세의 재료로 작용한 것으로 분석됨.
IRS	전일 IRS는 트럼프 트레이드 영향으로 국채선물은 약세를 보였고 이에 연동되어 상승 마감. 초반에는 1.5년이 2.5에 거래된 후 현물과 연동되어 02에 추가 거래되었고 5년이 95.5/95로 대체되다 95에 거래가 이뤄짐. 오후에는 1년 비드가 꾸준히 올라와 11.5에 d/nd로 초이스를 이루다 몇 차례 거래되었고 이후 비드가 또다시 올라오며 12에 거래됨. 1.5년으로도 호가 형성되며 03/2.75에서 2.75에 여러 차례 거래되었고 1.5년 비드가 2.75에 다소 많이 보였음. 장 막판에는 1.5년 오퍼가 내려오며 2.75에 초이스를 이루다 거래되었고 1.5*2년 오퍼가 내려오며 -3.5에 거래가 이뤄졌고 9개월 오퍼가 19.25로 내려옴. 마감 이후에는 5년이 95.75/95.5에서 95.5에 거래되었고 1.5*2년과 1*3년으로 비드쉬 해 보였으며 이날 양도성예금증서(cd)는 상승하여 3.40이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.10.16(수)	219.3	193.9	3.27%	3.291%	3.40%	2년물	4.035%	0.1	
2024.10.17(목)	220.5	198.6	2.25%	3.282%	3.39%	5년물	4.009%	2.1	
2024.10.18(금)	221.5	199.1	3.26%	3.278%	3.39%	10년물	4.209%	1.1	
2024.10.21(월)	216.6	198.7	3.26%	3.278%	3.39%	30년물	4.498%	-0.2	
2024.10.22(화)	218.5		3.25%	3.264%	3.40%	10Y-2Y	17.4	1	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,570.70	-34.22	25.10.22	중금채	3,000	은행채 7,600	은행채 3,600	통안채 2년물 6,000억원
KOSDAQ	738.34	-21.61	25.10.22	산금채	3,000	여전채 4,500	여전채 1,400	국고채 3조원 매입
달러-원	1,379.60원	0.80원	25.10.02	통안채	2,200	회사채 4,800	회사채 1,700	
국고3Y	2.943%	4.1	55.09.10	국고채이자	-150	공사채 2,000		
국고10Y	3.130%	7.6	41.09.10	국고 21-9	-230			
국고10Y-3Y	18.7	3.5	26.09.10	국고 24-9	-495			

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	4.83	4.85	0.00
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	4.91	0.00	1W	4.95	4.85	4.90	0.00
1S	5.01	4.91	4.96	0.00	1S	5.05	4.95	4.99	0.00
3S	5.06	4.91	4.99	-0.01	3S	5.05	4.90	5.00	-0.01
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.95	4.65	4.82	0.00
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.65	4.40	4.55	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-4/-2	-3	4.03	-1.05	3.25	4.84000	1M MAR	-213	-211
T/N	-6/-4	-5	4.56	0.00	3.25	4.83702	1W*1S	-183	-177
1W	-46/-40	-43	4.85	-0.08	3.25	4.81913	1*2	-210	-200
1S	-235/-225	-230	5.19	0.05	3.31	4.74461	1*3	-510	-505
3S	-755/-735	-745	5.55	0.01	3.40	4.62626	1*6	-1130	-1120
6S	-1400/-1340	-1370	5.37	-0.01	3.35	4.43756	1*9	-1680	-1650
1YR	-2460/-2360	-2410	5.01	0.02	3.20	4.12025	1*12	-2150	-2140

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)

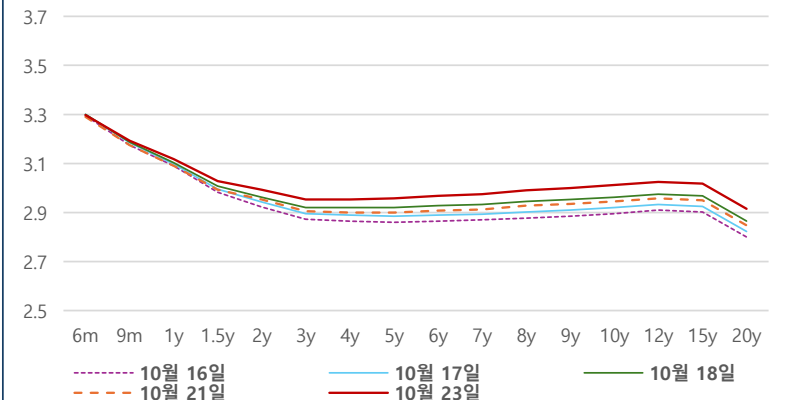
IRS 데일리 증가

10월 21일

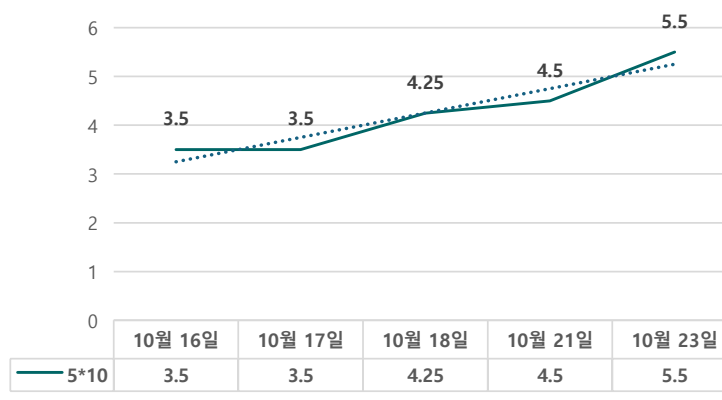
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2975	0.75
9m	3.1925	1.75
1y	3.1175	2.75
1.5y	3.0275	3.50
2y	2.9925	4.00
3y	2.9525	4.75
4y	2.9525	5.25
5y	2.9575	5.75
6y	2.9675	6.00
7y	2.9750	6.25
8y	2.9900	6.25
9y	3.0000	6.50
10y	3.0125	6.75
12y	3.0250	6.75
15y	3.0175	6.75
20y	2.9150	6.75

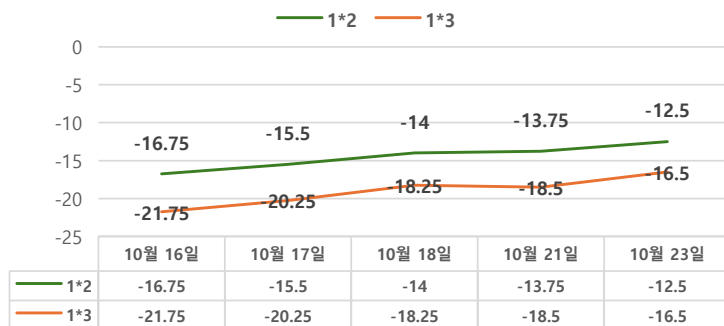
IRS 증가



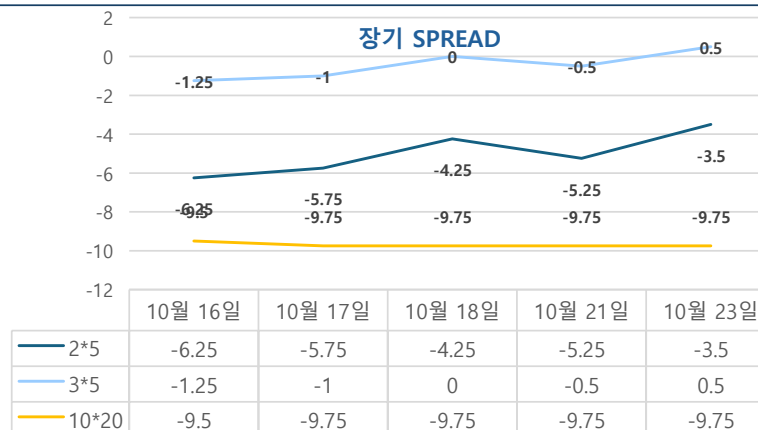
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

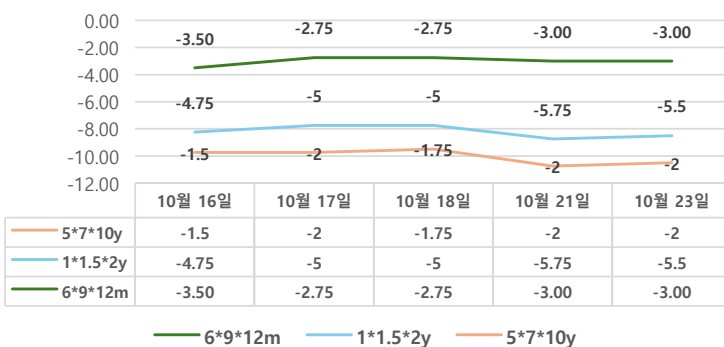
구분	증가	전일대비
1*2y	-12.50	1.25
1*3y	-16.50	2.00
2*5y	-3.50	1.75
3*5y	0.50	1.00
5*10y	5.50	1.00
10*20y	-9.75	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.00	0.00
1*1.5*2y	-5.50	0.25
2*5*10y	-9.00	0.75
5*7*10y	-2.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY

