

<b>레포</b>	청약(성우) 환불 및 공자기금 환수 영향으로 금리 소폭 상승했으나 은행권 매수 증가하여 조달여건 양호한 모습을 보임. 장 중 공모주 청약 관련 추가 조달수요 발생했으며, 한은RP매각 입찰 후 운용사 자금 유입되어 수급 무난하였음. [공모주] 성우   모집 10.21~10.22   환불 10.24   한투 9.8조
<b>채권</b>	한국 : 국제금리는 하락 마감. 중단기 금리보다 장기 금리가 더 하락하는 모습. 우리나라 3분기 GDP 성장률이 시장 예상치를 대폭 하회한 충격으로 강제 흐름이 이어짐. 대외금리 추이와 외국인 동향 또한 강제 압력을 더함. 특히 외국인은 3년 국제채선물을 1만계약 이상 순매수. 미국 : 미 국제채가격은 상승 마감. 미 대선 불확실성에 국제채가격이 잇달아 하락한 데 따른 저가 매수세가 유입. 장 초반에는 미 주간 실업보험 청구건수가 예상치(24만 2천)보다 낮게 (22만 7천) 발표되어 금리가 상승. 이후 유로존 국제시장의 기준 역할을 하는 독일 국제 채 수익률 하락, 가자지구 전쟁 휴전 협상에 따른 국제유가 하락으로 국제채가격은 상승하며 마무리. 미 대선에 대한 경계감은 지속되며 10년물 금리는 200일 이동평균선의 지지를 받는 양상.
<b>MONEY</b>	오전장에서 오버나잇 비드 수요가 크지 않아 여유있게 마무리 되면서 중국계 4.84-4.85, 한국계 4.82-4.83, 대만계 4.87-4.89 수준으로 체결되며 마감. 월커버 1-2주물 대만계 & 일본계 스물 네임 비드가 시장 고점을 유지하며 4.95-4.98 수준까지 체결 되었고, 중국계 네임은 중국 본토 오피 제시로 1-2주 4.88-4.94 수준에 상승세 없이 마무리. 내달 FOMC 회의를 앞두고 주요국들의 금리 인하 분위기가 속, 상대적으로 달러 금리는 상단을 유지하면서 월말 구간에 진입해 중국계 역외 센터들의 장기를 차입 수요도 등장, 중국계 중동 센터 및 유럽센터들의 레벨 상승세에 아시아 중국계 빅센터들도 레벨 상승분 반영해 6개월물 4.78-4.82 1년물 4.58-4.63까지 올려 체결 되고 있음. 한국계 은행들의 장기 차입 물량도 어느정도 해소 되면서 6개월물 4.80 1년물 4.55 수준에 마지막 taken 되며 거래는 소강상태. 최근 달러 단기 유동성이 Long으로, 머니 콜론과 FX 스왑으로 운용했던 금리가 낮아지면서, 대체처로 달러 RP 매입을 통한 자금 운용도 일부 거래 되고 있음.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환 스와프포인트는 미 국제 금리 상승 여파로 장기를 위주의 하락세를 이어갔으나 레벨 하락에 따른 부담으로 하락폭은 제한됨. 1년 만기물의 증가는 전장보다 10전 하락한 -24.80원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장과 동일한 -13.80원의 증가를 기록함. 미 국제 금리 상승과 트럼프 트레이드 영향은 계속됐으나 높아진 환율에 따른 당국의 미세 조정 개입 여부가 반영돼 전장보다 하락폭은 감소한 모습을 보임. 미 금리와 달러-원 환율의 상승세가 진정되고 있어 향후 방향성이 뚜렷하게 나오기 전까지 현재 레벨에서 횡보하는 움직임을 보일 것으로 예상됨.
<b>IRS</b>	전일 irs는 우리나라 3분기 gdp 발표로 인해 경기 침체 우려가 커짐에 따라 국제채선물이 강세를 보였고 이에 연동되어 하락 마감. 초반에는 1년과 2년 오피가 다소 강하게 내려오는 분위기를 보였으며 2년은 96/95.5에서 95.5에 거래되었고 이후 1년 오피가 내려오면서 7.5에 몇 차례 거래가 이뤄짐. 오후에는 2년 비드가 올라오며 94.5에 거래되었고 국제채선물 움직임과 연동되어 10년이 95.5에 거래가 이뤄짐. 2*10년은 01/0.5에서 비드가 올라오며 0.75에 nd로 여러 차례 거래됨. 장 막판에는 6개월 비드가 27로 올라왔고 5년 비드가 나오며 91에 거래되었으며 5*10년 4.5 마켓 거래 소식과 5*10년 비드가 4.5에 나옴. 마감 이후에는 미국채 움직임과 연동되어 6개월 비드가 27.25로 올라오며 nd로 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국제채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp	
2024.10.18(금)	221.5	199.1	3.26%	3.278%	3.25%	3.39%	2년물	4.081%	-0.1
2024.10.21(월)	216.6	198.7	3.26%	3.278%		3.39%	5년물	4.035%	-2.3
2024.10.22(화)	218.5	199.0	3.25%	3.264%		3.40%	10년물	4.214%	-3.4
2024.10.23(수)	218.9	19.9	3.25%	3.270%		3.40%	30년물	4.476%	-4.5
2024.10.24(목)	219.8		3.26%	3.276%		3.40%	10Y-2Y	13.3	-3.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,581.03	-18.59	25.07.24	중금채	2,500	은행채 17,700	은행채 5,300	
KOSDAQ	734.59	-10.60	25.10.24	수출입채	2,000	여전채 14,100	여전채 7,550	
달러-원	1,382.30원	0.70원	25.09.10	국고 23-8	1,500	회사채 12,032	회사채 8,062	
국고3Y	2.891%	-4.5	51.03.10	국고 21-2	-213	공사채 9,600	공사채 5,683	
국고10Y	3.074%	-5.4	25.03.10	국고 20-1	-299			
국고10Y-3Y	18.3	-0.9	26.09.10	국고 24-9	-497			

Money Market Closing							
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE	
O/N	4.88	4.80	4.84	-0.01	O/N	4.90	4.83
T/N	4.90	4.82	4.86	-0.01	T/N	4.90	4.83
1W	4.99	4.89	4.94	0.00	1W	4.98	4.88
1S	5.01	4.91	4.96	0.00	1S	5.02	4.92
3S	5.06	4.91	4.98	-0.01	3S	5.05	4.90
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.95	4.65
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.70	4.45

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7/-5	-6	4.82	0.27	3.25	4.83000	1M MAR	-216	-212
T/N	-17/-15	-16	4.64	0.09	3.25	4.82134	1W*1S	-175	-168
1W	-45/-41	-43	4.85	0.00	3.25	4.80979	1*2	-220	-210
1S	-230/-220	-225	5.14	0.01	3.30	4.73759	1*3	-520	-515
3S	-765/-745	-755	5.51	-0.03	3.40	4.62587	1*6	-1145	-1125
6S	-1410/-1350	-1380	5.39	0.01	3.36	4.45486	1*9	-1720	-1690
1YR	-2530/-2430	-2480	5.08	0.03	3.21	4.16561	1*12	-2240	-2200

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)

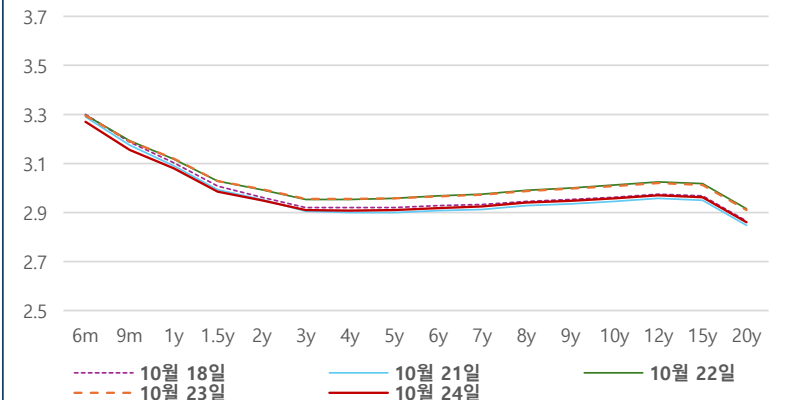
IRS 데일리 증가

10월 24일

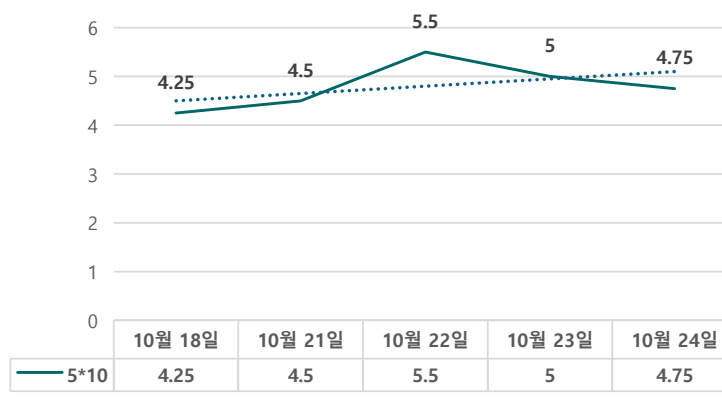
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2700	-2.50
9m	3.1550	-3.50
1y	3.0800	-4.00
1.5y	2.9850	-4.25
2y	2.9500	-4.50
3y	2.9100	-4.50
4y	2.9075	-4.75
5y	2.9100	-4.75
6y	2.9175	-4.75
7y	2.9250	-4.75
8y	2.9400	-4.75
9y	2.9475	-5.00
10y	2.9575	-5.00
15y	2.9625	-5.00
20y	2.8600	-5.00

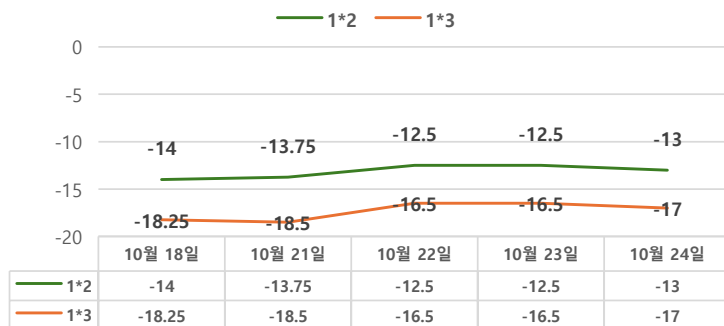
IRS 증가



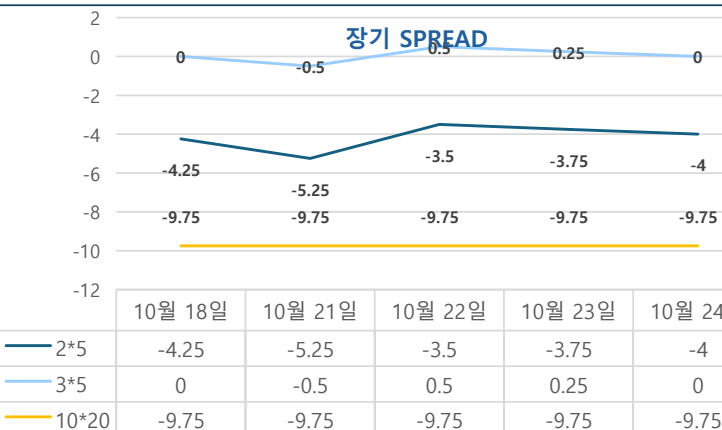
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

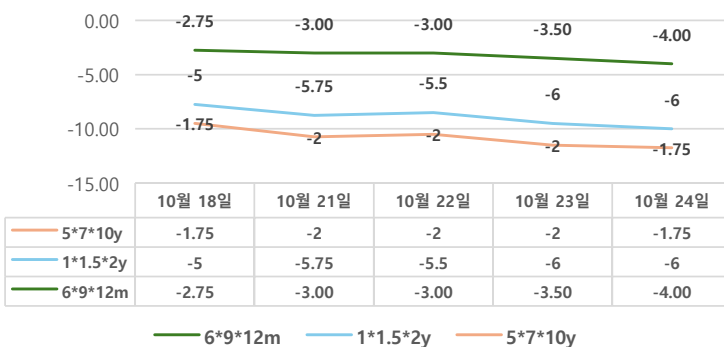


IRS 주요 커브

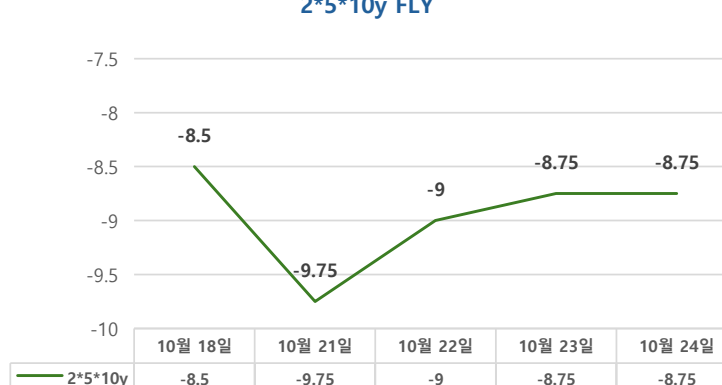
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.00	-0.50
1*3y	-17.00	-0.50
2*5y	-4.00	-0.25
3*5y	0.00	-0.25
5*10y	4.75	-0.25
10*20y	-9.75	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-4.00	-0.50
1*1.5*2y	-6.00	0.00
2*5*10y	-8.75	0.00
5*7*10y	-1.75	0.25