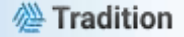


Market Daily Report

2024.10.28(월)



레포	차주 부가세 납부 관련 환매 영향으로 운용사 및 은행신탁 유동성 축소됐으며, 전일에 이어 조달금리 소폭 상승하였음. 은행권 매수세 꾸준해 일반채 해소 무난했던 반면 회사채 정채 심화되었고, 장 막판까지 담보별 조달여건 상이한 모습을 보임.
채권	한국 : 국채금리는 하락 마감. 중단기 금리보다 장기 금리가 더 하락하는 모습. 2거래일 연속 아시아장에서 미 국채금리가 하락한 데 영향을 받음. 외국인인 3년과 10년 국채선물을 대거 매수하며 강세 압력을 가함. 미국 : 미 국채금리는 모두 상승 마감. 국채금리는 오전 장중 발표된 미국의 경제지표를 기점으로 반등 시작. 9월 내구재 수주가 계절조정 기준 전달보다 0.8% 감소하며 두 달 연속 감소하였으나 시장 예상치인 1.0% 감소는 상회. 10월 미시간대 소비자심리지수는 70.5로 4월 이후 최고치를 기록. WTI도 이스라엘이 이란에 보복 공격을 가할 수 있다는 우려에 3거래일만에 상승하며 국채금리 상승 압력으로 작용
MONEY	주말을 앞두고 포지션이 크지 않은 가운데, 오버나잇 스왑 사이드로 온쇼 4.82-4.84 수준에 클리어되며 마무리. 월말 커버 1주일 단기 차입 위주의 대만계 은행들이 4.98까지 pay 하며 1주일만 급등세 연속. 기간물은 시장호가 많지 않고 usual 네임 낮은 레벨 위주로 제시되면서, 거래는 소강 상태로 마무리. 역외 중국계간 1개월물 4.95-4.96 수준으로 체결 되고 오피 남은채로 마감되며 1-2개월물 5% 비드는 현재 인도계 네임에서만 제시중. 아시아 시장에서, 역외 포린 네임으로 2개월물 4.88 레벨에 거래되며, 비선호 12월말 구간은 4.90 언더로 오피 대기 상태로 마감됨.
FX SWAP	금일 외환 스왑포인트는 미국 국채 금리 하락으로 장기를 중심으로 반등하는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 40전 오른 -24.40원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 30전 오른 -13.50원의 증가를 기록함. 달러-원 환율이 지속적으로 상승세를 보였으나 외화자금시장은 미 국채 금리 하락과 역외 매수세로 반등하는 모습을 보임. 단기물은 달러-원 환율과 연동되고 장기물은 미 금리에 연동되는 흐름이 지속될 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 변동성을 줄만한 재료가 없는 가운데 대체로 국채선물과 연동되어 혼조세 마감. 초반에는 10*20년 -13 오피로 초장기쪽 레벨이 높리게 되었고 9m*1.5년 오피가 꾸준히 내려오며 -17.25에 거래가 이뤄짐. 5*6년은 01/0.5에서 오후에 오피가 내려오며 0.75에 거래되었다 있으며 5*6년 비드가 다소 많아 보였음. 오후에도 9m*1.5년으로 오피가 나오며 -17.25에 nd로 거래가 이뤄졌고 12년 비드가 올라오며 95.25/94.5로 대치를 이루다 95.25에 거래됨. 막판에는 6개월 비드가 27로 올라왔고 28/27로 대치를 이뤘으며 4년이 90.5 거래 마켓 소식이 들리며 커브가 조정됨. 마감 이후에는 2년 비드가 나오며 95/94.5로 대치를 이뤘고 대체로 한산한 분위기를 보임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	클금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.10.21(월)	216.6	198.7	3.26%	3.278%	3.25%	3.39%	2년물	4.107%	2.6
2024.10.22(화)	218.5	199.0	3.25%	3.264%		3.40%	5년물	4.066%	3.1
2024.10.23(수)	218.9	19.9	3.25%	3.270%		3.40%	10년물	4.242%	2.8
2024.10.24(목)	219.8		3.26%	3.276%		3.40%	30년물	4.501%	2.5
2024.10.25(금)			3.28%	3.283%		3.40%	10Y-2Y	13.5	0.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,583.27	2.24	28.03.10	국고 08-2	695	은행채 4,200	은행채 2,700	국고채 5년 12,000억원 입찰
KOSDAQ	727.41	-7.18	25.12.10	국고 22-13	300	여전채 862	여전채 2,425	통안채 91일물 8,000억원 입찰
달러-원	1,389.20원	6.90원	54.03.10	국고 24-2	300	회사채 450	회사채 6,300	
국고3Y	2.882%	-0.9	54.09.10	국고 24-8	-163		공사채 5,300	
국고10Y	3.054%	-2.0	51.03.10	국고 21-2	-190			
국고10Y-3Y	17.2	-1.1	25.03.10	국고 20-1	-500			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.88	4.80	4.84	0.00	O/N	4.88	4.83	4.85	0.01
T/N	4.89	4.81	4.85	-0.01	T/N	4.88	4.83	4.85	0.00
1W	4.99	4.89	4.94	0.00	1W	4.95	4.85	4.90	-0.02
1S	5.00	4.90	4.95	-0.01	1S	5.00	4.90	4.96	-0.01
3S	5.05	4.90	4.97	-0.01	3S	5.05	4.90	4.97	-0.02
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.95	4.65	4.80	-0.02
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.70	4.45	4.60	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-13/-9	-11	4.20	-0.62	3.25	4.83000	1M MAR	-208	-200
T/N	-7/-3	-5	4.55	-0.09	3.25	4.82638	1W*1S	-168	-165
1W	-43/-39	-41	4.77	-0.08	3.25	4.80464	1*2	-215	-205
1S	-215/-205	-210	5.07	-0.07	3.30	4.71767	1*3	-510	-500
3S	-740/-720	-730	5.45	-0.06	3.39	4.61721	1*6	-1110	-1090
6S	-1380/-1320	-1350	5.33	-0.06	3.36	4.44788	1*9	-1670	-1630
1YR	-2490/-2390	-2440	5.04	-0.04	3.21	4.17793	1*12	-2190	-2160

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)

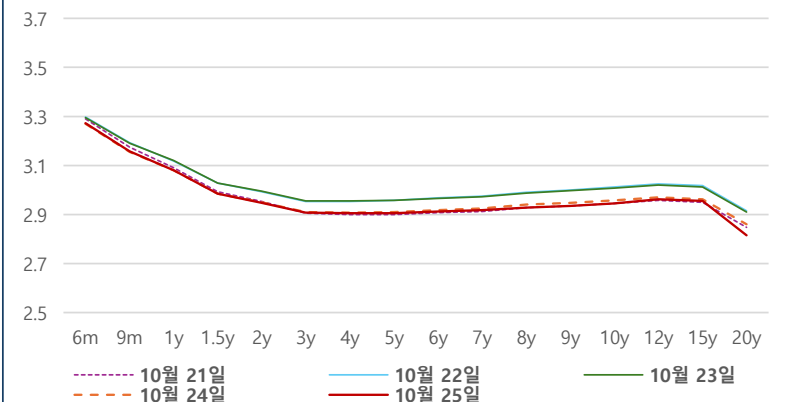
IRS 데일리 증가

10월 25일

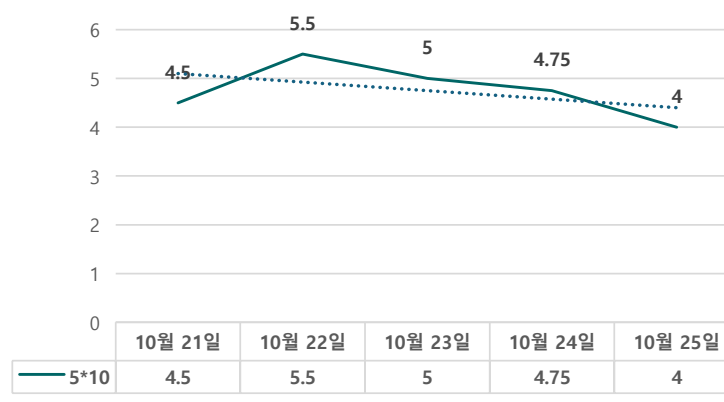
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2725	0.25
9m	3.1575	0.25
1y	3.0800	0.00
1.5y	2.9850	0.00
2y	2.9475	-0.25
3y	2.9075	-0.25
4y	2.9050	-0.25
5y	2.9050	-0.50
6y	2.9125	-0.50
7y	2.9175	-0.75
8y	2.9275	-1.25
9y	2.9350	-1.25
10y	2.9450	-1.25
12y	2.9625	-0.75
15y	2.9550	-0.75
20y	2.8150	-4.50

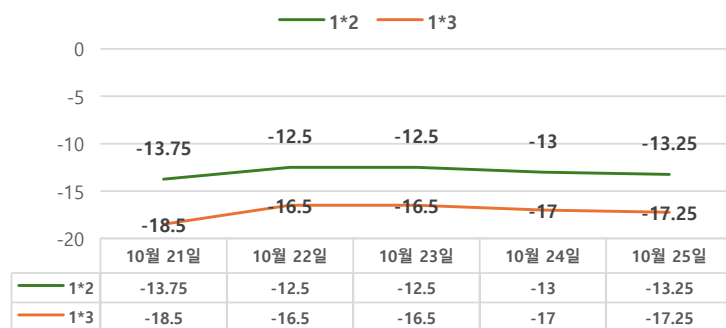
IRS 증가



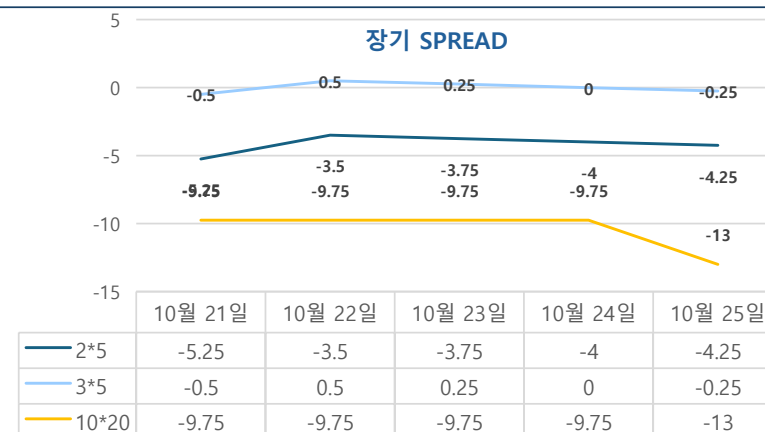
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

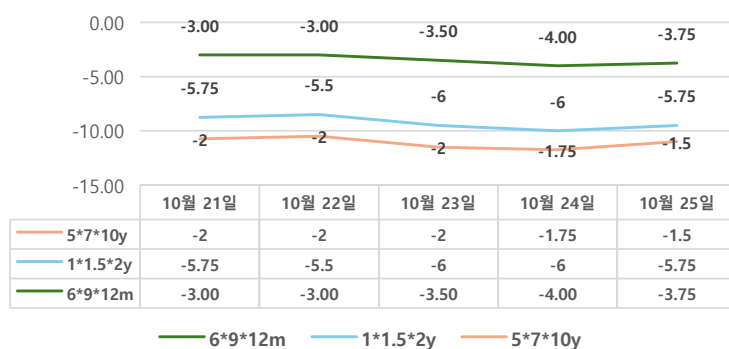


IRS 주요 커브

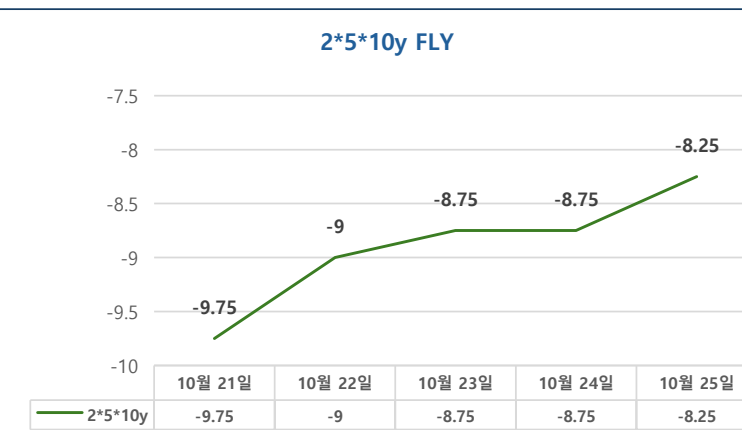
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.25	-0.25
1*3y	-17.25	-0.25
2*5y	-4.25	-0.25
3*5y	-0.25	-0.25
5*10y	4.00	-0.75
10*20y	-13.00	-3.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.75	0.25
1*1.5*2y	-5.75	0.25
2*5*10y	-8.25	0.50
5*7*10y	-1.50	0.25