

# Market Daily Report



2024.10.29(화)

<b>레포</b>	장 초반부터 은행권 매수에 적극적으로 나섬에 따라 부가세 납부 관련 자금 이탈했음에도 조달금리 소폭 하락하였음. 장 중 시중은행 및 증권 저금리 매도 대기했으나 시장 유동성 충분치 않아 대부분 시작금리 수준에 매칭되었음. [공모주] 더본코리아   모집 10.28~10.29   환율 10.31   한투 3,345억, NH 1,648억
<b>채권</b>	한국 : 국채금리는 급등 마감. 미 국채금리가 전 거래일과 이날 아시아장에서 상승한 데 영향을 받음. 주말 간 이창용 한국은행 총재의 발언이 매파적으로 해석된 점도 약세 재료로 작용. 미국 : 미 국채금리는 모두 상승 마감. 국제유가는 장 내내 폭락 흐름이었지만 국제시장에 큰 영향을 주지는 못했음. 2년물, 5년물 국채 입찰은 부진한 수요를 보이며 시장 예상보다 높은 수익률로 결정. 10월 텍사스주 제조업 일반기업활동지수도 2022년 4월 이후 최고치를 기록하며 -3.0으로 전월(-9.0)보다 6포인트 상승. 이후 미 재무부의 4분기 차입 예상치가 소폭 하향되어 발표되자 국채금리는 오름폭을 축소
<b>MONEY</b>	본격 말일 주간 접어들면서 장기 구간보다, 1달 이내의 단기 구간 위주로 마켓 형성 됨. 특히 월커버의 1주~2주 구간 위주로 마켓 관심 집중 되는 중이며, 대만계 1주 4.97~4.98 레벨로 여전히 높게 유지 되는 중이며, 일부 스물 일본계로 부터는 5.05 레벨선 까지 월말 커버 시도 됨. 기간물 1달 4.95~5.00, 2달 4.95~4.99 오퍼 대기 속에, 1달 4.97~4.98, 2달 4.95~4.99 마켓 체결 리포트 되면서, 연내 내 만기 구간으로 마켓 운용은 지속 되는 중임. 장기구간의 경우 큰 변동없이 6달 4.82, 9달 4.72 레벨선에 대만계로 부터 오퍼 제시 되는 중이지만, 펀딩은 6달 4.70~4.75, 9달 4.65~4.67 레벨선에만 머물러며, 오퍼/비드간 대치 되고 있는 상황. 일부 대만계간 6달 4.79 소액 체결 리포트 됨.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환스와프포인트는 풍부한 달러 유동성과 과도하게 올랐던 환율에 대한 조정으로 초단기를 위주로 상승하는 장세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 10전 하락한 -24.50원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 10전 오른 -13.40원의 증가를 기록함. 초단기물이 오버나이트와 탐넥은 이른가를 크게 상회하는 -0.04원의 증가를 기록하며 강세를 보임. 최근 과도하게 상승한 달러-원 환율의 여파로 재정거래 물량과 네고물량 유입되면서 만기가 짧은 쪽은 상승하고, 만기가 해를 넘어가는 장기물에서는 상승세가 제한되는 추세가 지속되고 있음.
<b>IRS</b>	전일 irs는 이창용 총재의 매파적 발언과 미국 대선 및 지정학적 긴장감이 고조됨에 따라 국채선물은 약세를 보였고 이와 연동되어 상승 마감. 초반에는 국채선물 움직임을 연동되면서 5년 94.5에 거래되었고 9m*3년 비드가 올라오면서 -22/-22.5로 대치를 이루다 -22에 거래가 이뤄짐. 오전부터 대치중이던 2*10년은 비드가 꾸준히 올라오면서 par에 nd, d로 몇차례 거래되었고 6년 오퍼가 내려오면서 nd로 95.75에, 5년은 95.25/95에서 95.25에 거래가 이뤄졌고 5년 비드가 다소 많이 보였음. 장 막판에는 4*5년 nd로 par에 거래되었고 12*20년 오퍼가 -15로 내려왔으며 9개월 오퍼가 내려오면서 18에 거래되었고 전체적으로 오퍼리쉬한 분위기를 보임. 이날 양도성예금증서(cd)는 상승하여 3.41이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.10.22(화)	218.5	199.0	3.25%	3.264%	3.25%	3.40%	4.144%	3.7
2024.10.23(수)	218.9	199.9	3.25%	3.270%		3.40%	4.119%	5.3
2024.10.24(목)	219.8	198.8	3.26%	3.276%		3.40%	4.284%	4.2
2024.10.25(금)	219.3	197.1	3.28%	3.283%		3.40%	4.531%	3.0
2024.10.28(월)	219.6		3.27%	3.277%		3.41%	14.0	0.5

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,612.43	29.16	25.08.28	중금채	5,000	은행채 1,000	은행채 800	국고채 20년 4,000억원 입찰
KOSDAQ	740.48	13.07	25.01.27	통안채	3,810	여전채 6,900	여전채 4,300	
달러-원	1,385.70원	-3.50원	27.09.10	국고 22-8	1,500	회사채 5,900	회사채 2,400	
국고3Y	2.932%	5.0	25.07.02	통안채	-200	공사채 7,319	통안채 5,000	
국고10Y	3.117%	6.3	25.09.03	통안채	-200		공사채 1,700	
국고10Y-3Y	18.5	1.3	25.09.09	통안채	-500			

Money Market Closing									
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	0.00
T/N	4.89	4.81	4.85	0.00	T/N	4.89	4.84	4.86	0.01
1W	5.00	4.90	4.95	0.01	1W	4.95	4.85	4.90	0.00
1S	5.00	4.90	4.95	0.00	1S	5.00	4.90	4.96	0.00
3S	5.04	4.89	4.96	-0.01	3S	5.05	4.90	4.97	0.00
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.95	4.65	4.80	0.00
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.70	4.45	4.60	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-2	-4	4.29	0.09	3.25	4.83000	1M MAR	-180	-174
T/N	-6/-2	-4	4.29	-0.26	3.25	4.82591	1W*1S	-155	-150
1W	-43/-39	-41	4.77	0.00	3.25	4.80137	1*2	-220	-210
1S	-200/-190	-195	5.01	-0.06	3.31	4.70730	1*3	-510	-500
3S	-720/-700	-710	5.40	-0.05	3.39	4.60464	1*6	-1130	-1110
6S	-1370/-1310	-1340	5.32	-0.01	3.36	4.43072	1*9	-1680	-1640
1YR	-2500/-2400	-2450	5.05	0.01	3.22	4.15290	1*12	-2220	-2190

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)

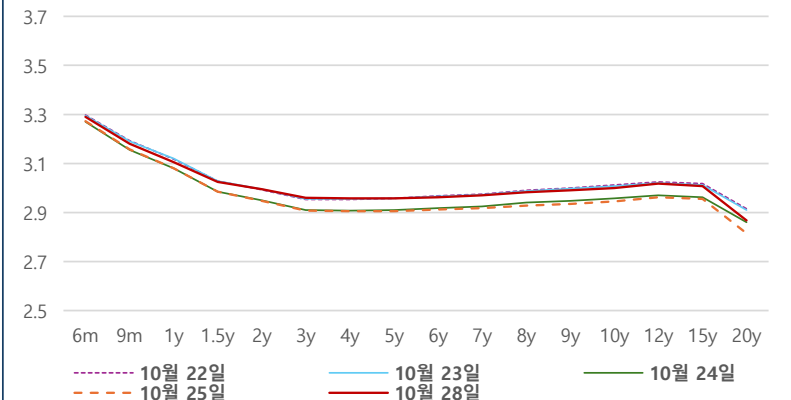
IRS 데일리 증가

10월 28일

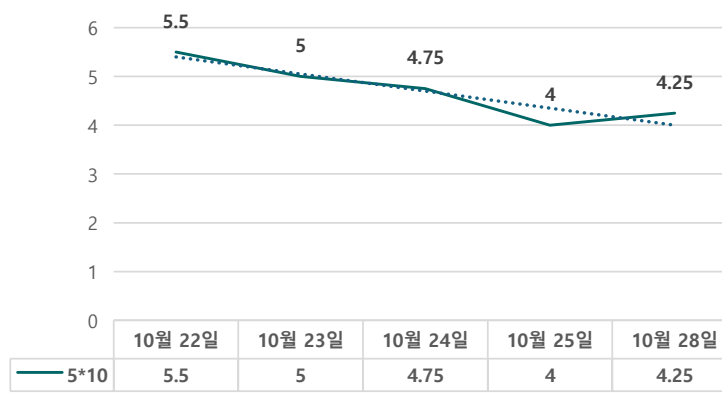
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2900	1.75
9m	3.1800	2.25
1y	3.1050	2.50
1.5y	3.0250	4.00
2y	2.9950	4.75
3y	2.9600	5.25
4y	2.9575	5.25
5y	2.9575	5.25
6y	2.9625	5.00
7y	2.9700	5.25
8y	2.9825	5.50
9y	2.9900	5.50
10y	3.0000	5.50
12y	3.0175	5.50
15y	3.0075	5.25
20y	2.8675	5.25

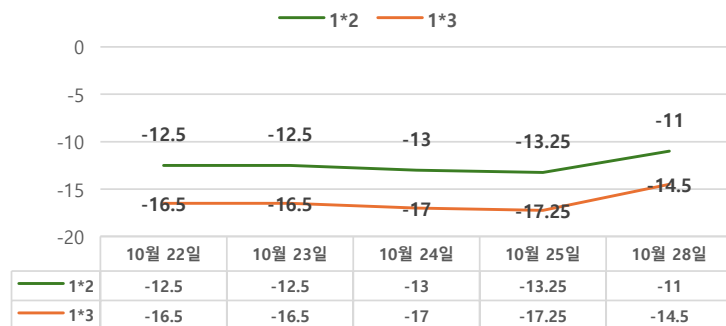
IRS 증가



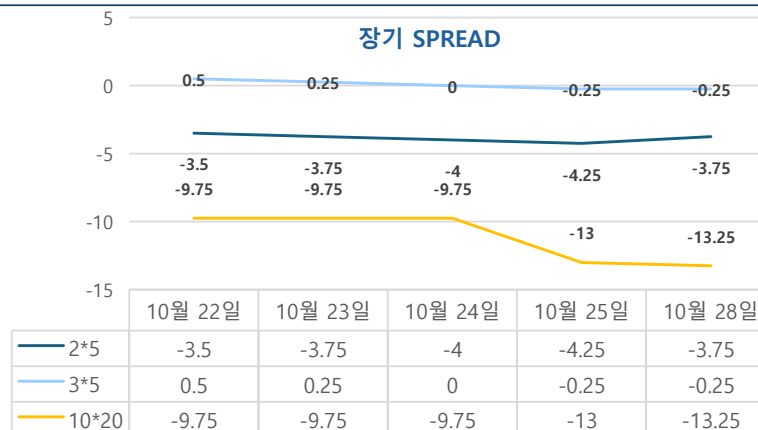
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

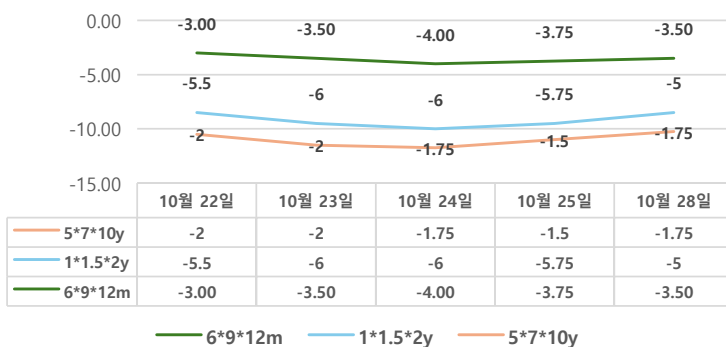
구분	증가	전일대비
1*2y	-11.00	2.25
1*3y	-14.50	2.75
2*5y	-3.75	0.50
3*5y	-0.25	0.00
5*10y	4.25	0.25
10*20y	-13.25	-0.25

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.50	0.25
1*1.5*2y	-5.00	0.75
2*5*10y	-8.00	0.25
5*7*10y	-1.75	-0.25

주요 FLY



2\*5\*10y FLY

