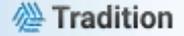


Market Daily Report

2024.10.30(수)



레포	부가세 분담에 상응하는 국고금 유입되어 금리 추가 하락했음에도 일부 시중은행 매수에 적극적이었으며, 장 초반부터 잉여세 강하였음. 장 중 저금리 매도 대기했으나 익일물 금리 낙폭 제한적이었던 반면, 월말 유동성 풍부할 것으로 기대돼 기일물 금리 하락하였음. [공모주] 더본코리아 청약 10.28~10.29 환볼 10.31 한투 7.21조, NH 4.62조
채권	한국 : 국채금리는 약보합 마감. 국회 기획재정위원회 중합감사를 주시하며 관망 분위기가 이어짐. 아시아장에서 미국 국채금리 하락에 강세폭을 키우다가 금리 낙폭이 감소하자 약해짐. 미국 : 미 국채가격은 상승 마감. 전장대비 금리 낙폭은 크지 않았으나 장중 움직임이 큰 편이었음. 장 초반 미국 9월 JOLTs 구인건수가 예상치와 전월치를 큰 폭 하회하고 특히 해고가 2023년 1월 이후 최고치로 큰 폭의 상승을 보이며 금리를 4.339%까지 강하게 끌어올림. 이후 미국 소비자신뢰지수가 개선된 양상을 보이며 상승폭을 완화했고, 7년물 440억달러 어치 입찰에서 낙찰수익률이 4.215%로 시장 예상치보다 2bp나 낮게 형성되면서 강한 수요가 나오며 금리는 하락 마감.
MONEY	온소 달러 유동성 여유로 초단기 자금 수요가 급감하면서 말일 구간임에도 수요는 제한적. (오버나잇 4.82-4.84 오퍼 대기) 대만계 은행들의 월말 커버 1주물 레벨 상승 트리거로 중국계 및 싱가포르 네임 은행들도 소폭 상승. (대만계 1주물 4.98-5.00, 중국계 및 싱가포르계 1주물 4.88-4.90) 11월 8일 새벽 FOMC 회의 결과 발표 예정을 앞두고, 1주물 (11월7일 만기 이내) 위주의 시장 비드가 증가했으나, 2주물 이상 구간은 차입 수요 크지 않아, 레벨 정체 및 1-2개월물 4.95 언더로 형성. 월말 마감 및 FOMC 회의를 앞두고, 장기물 차입 & 운용 수요가 감소하면서 초단기물 위주로 체결 비중 확대.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 장기물 중심으로 전 구간에서 강세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 50전 상승한 -24.00원에 형성됐고 6개월 만기물 역시 전장보다 50전 상승한 -12.90원의 증가를 기록함. 6개월물과 1년물 모두 전장보다 50전 상승한 증가를 기록했으나 6개월물은 전일보다 거래일수가 하루 줄었다는 점을 고려시 거래일수 보정된 증가는 1년 만기물에서 더 큰 상승폭을 기록함. 미국 금리 상승이 다소 완화되며 원화 약세 흐름에서 되돌림 성격의 반등이 나온 것으로 보이나 여전히 달러 강세를 지지하는 미국 대선 이슈가 존재해 지속적인 스와프포인트 반등으로 이어질지는 미지수로 보임.
IRS	전일 IRS는 국감에서의 이창용 총재 매파적 발언에 영향을 받아 소폭 상승 마감. 초반에는 한산한 분위기를 보이는 가운데 4*5년 par 오퍼와 1.5*2년으로 -3/-3.5로 대치를 이룸. 오후에는 2*5년이 -4/-4.25에서 nd로 -4에 거래가 이뤄졌고 4*5년 오퍼는 -0.25로 내려왔으며 10*20년 -14 오퍼로 초장기쪽 커브가 움직이게 됨. 막판에는 10년 비드가 꾸준히 올라오면서 01에 거래되었으며 마감 이후에는 3년 비드가 97.5로 올라옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.10.23(수)	218.9	199.9	3.25%	3.270%	3.25%	3.40%	2년물	4.100%	-4.4
2024.10.24(목)	219.8	198.8	3.26%	3.276%		3.40%	5년물	4.082%	-3.7
2024.10.25(금)	219.3	197.1	3.28%	3.283%		3.40%	10년물	4.256%	-2.8
2024.10.28(월)	219.6	196.8	3.27%	3.277%		3.41%	30년물	4.500%	-3.1
2024.10.29(화)	216.5		3.23%	3.263%		3.41%	10Y-2Y	15.6	1.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,617.80	5.37	26.01.29	산금채	3,000	은행채 4,400	은행채 4,800	
KOSDAQ	744.18	3.70	25.10.29	주금공MBS(사)	600	여전채 9,230	여전채 900	
달러-원	1,382.20원	-3.50원	29.06.10	국고 19-4	500	회사채 2,948	회사채 800	
국고3Y	2.936%	0.4	43.09.10	국고 23-9	-188	공사채 8,900	공사채 1,100	
국고10Y	3.118%	0.1	25.09.10	국고 20-6	-280			
국고10Y-3Y	18.2	-0.3	26.09.10	국고 24-9	-480			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.87	4.79	4.83	-0.01	O/N	4.90	4.80	4.85	0.00
T/N	4.88	4.80	4.84	-0.01	T/N	4.90	4.80	4.86	0.00
1W	5.00	4.90	4.95	0.00	1W	4.95	4.85	4.90	0.00
1S	5.00	4.90	4.95	0.00	1S	5.00	4.90	4.93	-0.03
3S	5.04	4.89	4.96	0.00	3S	5.05	4.90	4.97	0.00
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.85	4.65	4.76	-0.04
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.65	4.45	4.56	-0.04

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-4	-5	4.55	0.26	3.25	4.83000	1M MAR	-182	-180
T/N	-5/-3	-4	4.29	0.00	3.25	4.82540	1W*1S	-150	-140
1W	-41/-35	-38	4.66	-0.11	3.25	4.79777	1*2	-220	-210
1S	-180/-170	-175	4.89	-0.12	3.31	4.69649	1*3	-495	-485
3S	-685/-665	-675	5.33	-0.08	3.40	4.58917	1*6	-1095	-1075
6S	-1320/-1260	-1290	5.26	-0.06	3.36	4.41270	1*9	-1670	-1650
1YR	-2450/-2350	-2400	5.01	-0.04	3.22	4.14467	1*12	-2175	-2155

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)

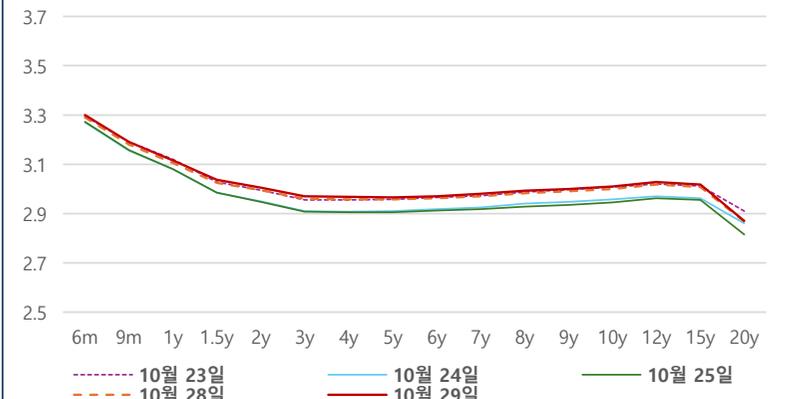
IRS 데일리 증가

10월 29일

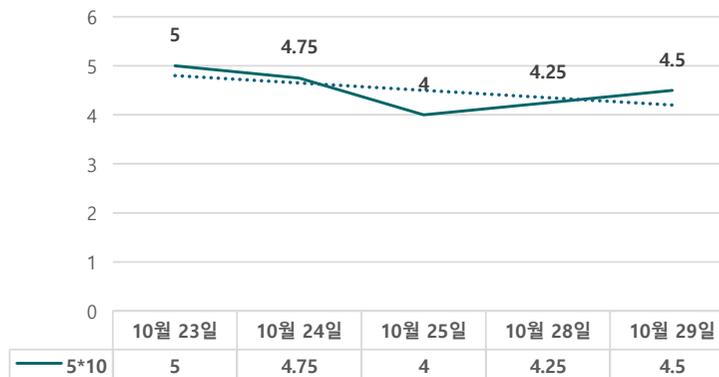
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3000	1.00
9m	3.1900	1.00
1y	3.1150	1.00
1.5y	3.0375	1.25
2y	3.0050	1.00
3y	2.9700	1.00
4y	2.9675	1.00
5y	2.9650	0.75
6y	2.9700	0.75
7y	2.9800	1.00
8y	2.9925	1.00
9y	3.0000	1.00
10y	3.0100	1.00
12y	3.0275	1.00
15y	3.0175	1.00
20y	2.8700	0.25

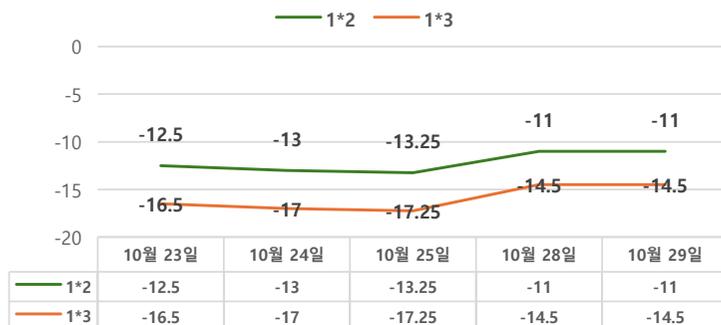
IRS 증가



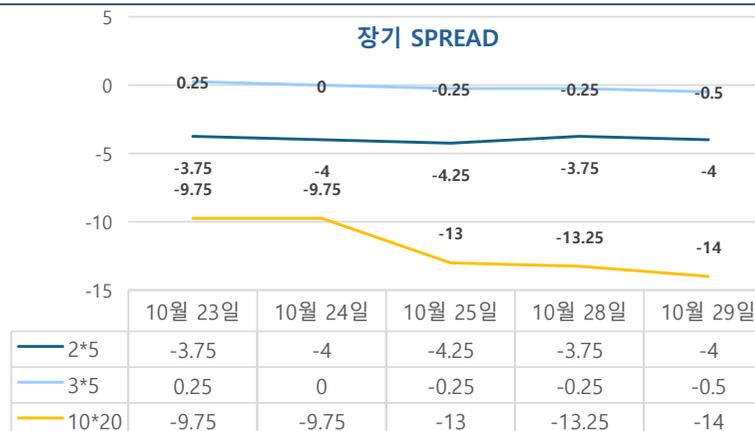
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

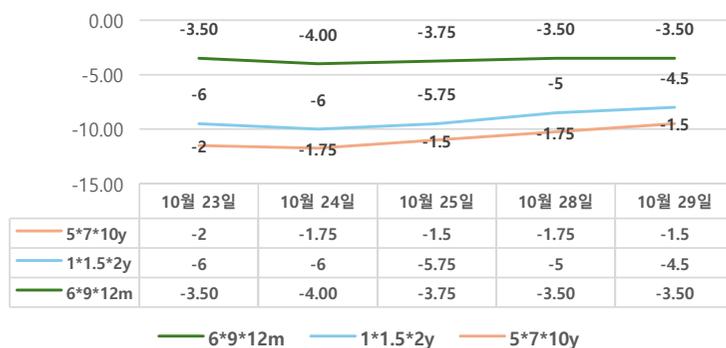
구분	증가	전일대비
1*2y	-11.00	0.00
1*3y	-14.50	0.00
2*5y	-4.00	-0.25
3*5y	-0.50	-0.25
5*10y	4.50	0.25
10*20y	-14.00	-0.75

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.50	0.00
1*1.5*2y	-4.50	0.50
2*5*10y	-8.50	-0.50
5*7*10y	-1.50	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

