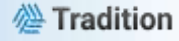


Market Daily Report

2024.10.31(목)



레포	공모주 청약자금 운용 기대감 반영되어 시작금리 하락했으며, 전일 유입된 국고여유자금 유효하여 시장 유동성 풍부하게 출발하였음. 장 중 조달여건 양호할 것으로 기대했으나 시중은행 및 증권사 조달 이어지면서 매수자금 일시에 소진되었고, 장 중 체결금리 상승하였음. [공모주] 더본코리아 청약 10.28~10.29 환율 10.31 한투 7.21조, NH 4.62조
채권	한국 : 국채금리는 혼조세 마감. 중단기 금리는 상승하고 장기 금리는 하락하는 모습. 미 대선 등 대형 이벤트를 앞두고 방향성이 크지 않은 횡보 장세가 이어짐. 수급상 월말을 앞두고 기도 하였다는 점을 염두. 미국 : 미 국채금리는 모두 상승 마감. 3분기 미국 GDP 성장률은 2.8%로 예상치(3.0%)를 하회하며 장 초반 장기물 위주로 매수세가 강하게 유입. 오후로 접어들며 GDP 성장을 부진에도 PCE가 크게 상승하고 민간 고용 또한 23만3천명 증가로 예상치(11만명)를 크게 웃돌며 금리가 상승. 미 GDP 성장을 부진에 잠시 미 대선을 앞두고 트럼프 트레이드 추가 반영은 잠시 주춤하는듯했으나 결국 추세를 꺾지 못하였음.
MONEY	온쇼, 달러 & 원화 잉여 속에 초단기 달러 오버나잇은 4.82-4.83 수준에 거래되며 오퍼 대기 속 마무리. 최금 FX 스왑 가격 상승으로 이윤가 기준, 1개월물 이내 구간은 현재 머니시장 운용금리가 높아, 머니 & FX 스왑 운용 포지션 변동에 단기물 오퍼 강세. 말일 (10/31) 싱가포르와 말레이시아 휴장이고, 역외 렌더들의 말일 자금 운용 제한에 2일 오버나잇 금리는 5.00% 고점 거래 후 4.90-5.00 사이로 형성되었으며 오후 장에도 추가 상승 시도됨. 스왑 밸류 (11/1) 스타트로 2개월물이 연말 커버 구간으로 접어들면서 일본계 마이너 네임 슷2개월물 (1월 중순 만기) 5.00-5.10 수준으로 체결 되면서 일부 은행들 연말 커버 기간물 차입 준비 돌입했으며, 내주 예정된 FOMC 회의에서 연준의 25bp 인하 가능성이 재부각되면서 11월 시작 주 1개월물 차입 레벨은 25bp 인하분 반영해 대만계 은행에서 4.72-4.75 수준으로 비드 호가 제시 중.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 단기물 강세가 지속되었고 미국 국채 금리 하락의 영향으로 장기물 상승세가 계속되었음. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 오른 -23.70원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 20전 오른 -12.70원의 증가를 기록함. 전 거래일에 이어 전반적으로 모든 구간에서 강세가 나타났으며 오는 금요일 발표될 미국 비농업부문 고용지표 발표와 다음주 미국 대선 결과에 따라 강세장이 이어질지 여부가 결정될 것으로 보임.
IRS	전일 irs는 미국 대선이 얼마 남지 않은 시점에서 관망하는 분위기를 보이는 가운데 보험 마감. 초반에는 4년이 96에 거래되었고 5년 비드가 올라오면서 96에 여러 차례 거래가 이뤄졌으며 1.5*2년이 -3.25 거래 마켓 소식과 함께 -3/-3.25에서 거래됨. 오후에는 3*5년 비드가 올라와 -0.5에 거래가 이뤄졌고 2*5년이 -3.5/-4.25를 이루다가 -3.5에 몇차례 거래되었고 오퍼가 다소 많아 보임. 막판에는 2*3년 오퍼가 내려와 -3.25에 거래되었고 1년 비드가 올라와 11.75에 거래가 이뤄졌으며 6개월 비드가 30.75로 올라옴. 마감 이후에는 양도성예금증서(cd) 영향으로 단기쪽으로 호가 형성되어 1년이 12에 거래되었고 6개월이 31/30.75에서 31에 여러 차례 nd,d로 거래가 이뤄짐. 이날 양도성예금증서(cd)는 상승하여 3.43이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	클금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.10.24(목)	219.8	198.8	3.26%	3.276%	3.25%	3.40%	2년물 4.178%	7.8	
2024.10.25(금)	219.3	197.1	3.28%	3.283%		3.40%	5년물 4.168%	8.6	
2024.10.28(월)	219.6	196.8	3.27%	3.277%		3.41%	10년물 4.301%	4.5	
2024.10.29(화)	216.5	196.4	3.23%	3.263%		3.41%	30년물 4.504%	0.4	
2024.10.30(수)	220.4		3.20%	3.265%		3.43%	10Y-2Y 12.3	-3.3	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,593.79	-24.01	26.04.28	산금채	5,000	지방채 2,912	지방채 2,339	
KOSDAQ	738.19	-5.99	27.06.10	국고 24-4	1,001	은행채 2,360	은행채 3,101	
달러-원	1,379.80원	-2.40원	25.09.10	국고 23-8	1,000	여전채 2,700	여전채 350	
국고3Y	2.937%	0.1	25.12.10	국고 15-8	-9	회사채 4,750	회사채 800	
국고10Y	3.105%	-1.3	31.06.10	국고 21-5	-21	공사채 2,836	공사채 132	
국고10Y-3Y	16.8	-1.4	52.09.10	국고 22-9	-500			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.86	4.78	4.82	-0.01	O/N	4.90	4.80	4.85	0.00
T/N	4.95	4.85	4.90	0.06	T/N	5.00	4.90	4.95	0.09
1W	5.00	4.90	4.95	0.00	1W	5.00	4.90	4.95	0.05
1S	5.00	4.90	4.95	0.00	1S	5.00	4.85	4.92	-0.01
3S	5.04	4.89	4.96	0.00	3S	5.05	4.85	4.94	-0.03
6S	4.85	4.65	4.80	0.00	6S	4.85	4.65	4.80	0.04
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.65	4.45	4.60	0.04

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-1/+1	0	3.25	-1.30	3.25	4.82000	1M MAR	-157	-148
T/N	-2/0	-1	3.51	-0.78	3.25	4.81565	1W*1S	-135	-125
1W	-35/-31	-33	4.48	-0.18	3.25	4.78955	1*2	-265	-255
1S	-170/-160	-165	4.71	-0.18	3.31	4.68516	1*3	-490	-480
3S	-670/-650	-660	5.25	-0.08	3.39	4.58537	1*6	-1080	-1060
6S	-1300/-1240	-1270	5.23	-0.04	3.36	4.42681	1*9	-1630	-1610
1YR	-2420/-2320	-2370	4.99	-0.03	3.22	4.18548	1*12	-2140	-2120

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)

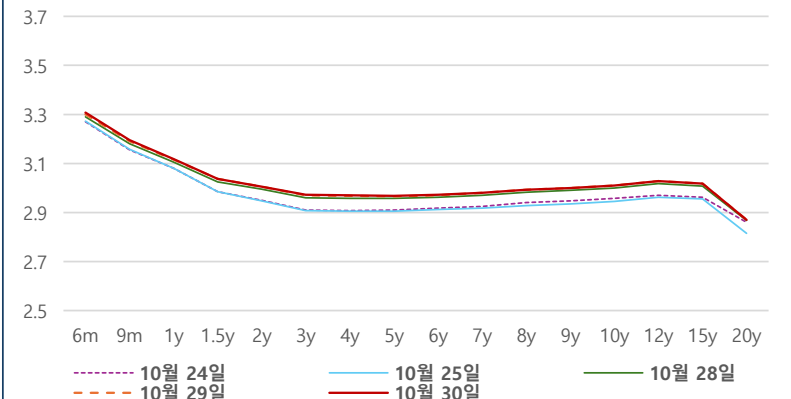
IRS 데일리 증가

10월 30일

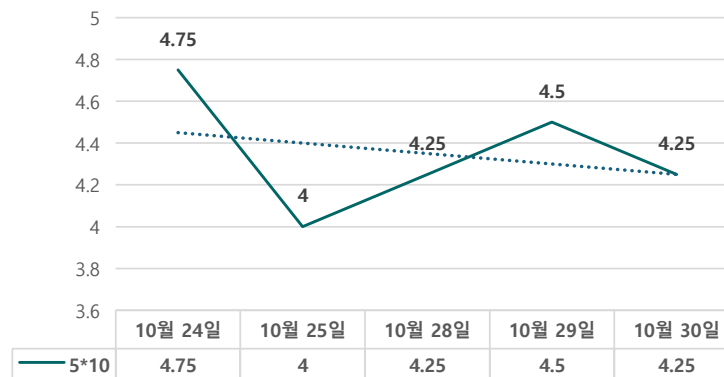
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3075	0.75
9m	3.1950	0.50
1y	3.1175	0.25
1.5y	3.0375	0.00
2y	3.0050	0.00
3y	2.9725	0.25
4y	2.9700	0.25
5y	2.9675	0.25
6y	2.9725	0.25
7y	2.9800	0.00
8y	2.9925	0.00
9y	3.0000	0.00
10y	3.0100	0.00
12y	3.0275	0.00
15y	3.0175	0.00
20y	2.8700	0.00

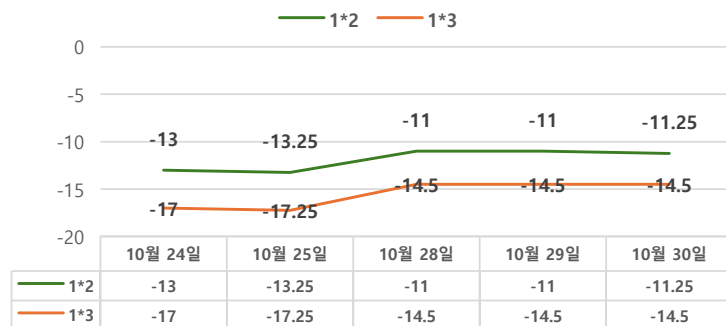
IRS 증가



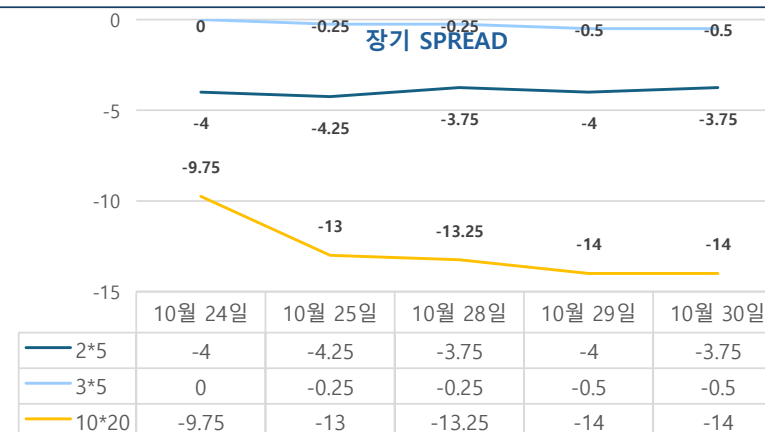
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

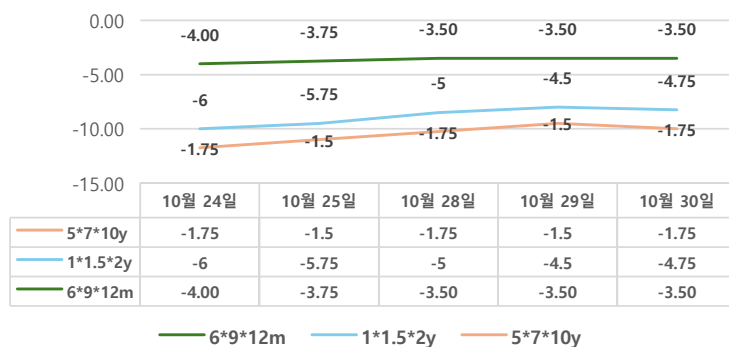
구분	증가	전일대비
1*2y	-11.25	-0.25
1*3y	-14.50	0.00
2*5y	-3.75	0.25
3*5y	-0.50	0.00
5*10y	4.25	-0.25
10*20y	-14.00	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.50	0.00
1*1.5*2y	-4.75	-0.25
2*5*10y	-8.00	0.50
5*7*10y	-1.75	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

