

Market Daily Report

2024.11.01(금)



레포	월말 MMF 환매 및 공모주 청약자금 이탈 우려로 금리 급등했으나 장 초반부터 은행권 매수에 적극적으로 나서 일반채 해소 원활하였음. 회사채 정제 지속되어 장 중 체결금리 상승한 반면, 향후 유동성 풍부할 것으로 기대돼 기일물 조달 희망금리 하락하였음. [공모주] 더본코리아 청약 10.28~10.29 환불 10.31 한투 7.21조, NH 4.62조
채권	한국 : 국채금리가 장기 위주로 하락. 미 대선 등 대형 이벤트를 앞두고 대외 금리에 연동되다가, 장중 국제 발행 계획 기대로 초장기물이 강세를 보였음. 11월 국고채는 전월보다 1.9조 감소한 6.1조 발행. 특히 30년물 발행량이 1.3조로 전월대비 0.7조 감소한 모습 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 9월 PCE 가격지수(전년 동기 대비 +2.1%)는 시장 예상치에 부합했으나 근원 PCE 가격지수(전년 동기 대비 +2.7%)의 상승세가 가팔라지며 지난 4월 이후 처음으로 월간 상승률 0.3%를 기록. 다만 장 초반 상승폭을 키우던 국채금리는 상승폭을 반납하며 결국 하락 마감. 주간 신규 실업보험 청구건수는 21만6천명으로 지난 주보다 1만2천명 감소. 고용비용지수(ECI)는 QoQ 0.8% 상승으로 전 분기(0.9% 상승)에 비해 감소.
MONEY	금일, 싱가포르 & 말레이시아 휴장과 태풍 21호 콩레이 대만 상륙에 임시 휴장을 맞아 역외 머니시장 호가가 제한적이며, 전일 말일자 커버가 대부분 마무리되면서 한산한 장세로 마감됨. 대만계 미주, 홍콩센터들의 말일 자금은 본점 휴일로 시장 커버가 급해 오버나잇 고점 5.04%까지 터치 했고, 중국계 네임 오버나잇은 4.84-4.88 수준에 마무리. FOMC 금리 발표 예정인 (11/8) 이내 구간의 1주물은 네임에 따라 4.85-4.90 비드 호가 제시 중이며, 대만 태풍 영향에 대만계 네임 1주물은 4.98까지 제시되었음. 역외에서 중국계로 제시된 오피 레벨은 1개월물 4.88-4.90, 3개월 4.90-4.94 수준에 제시 및 일부 체결 되었음, 중국계 은행들의 차입 포지션이 크지 않아 오피 대기 시간이 길어진 상태로 마감.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 단기를 강세가 이어진 가운데 장기물에서는 대체로 보합하는 장세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장과 같은 -23.60원에 형성됐고 6개월 만기물 역시 전장과 동일한 -12.70원의 증가를 기록함. 단기물인 오버나잇과 탐넥의 강세는 원화 수요의 영향이 큰 것으로 보이며 시장 전반적으로 월말 네고물량 유입으로 원화 수요가 증가해 단기 스와프포인트의 강세가 이어지고 있는 것으로 보임. 장기물에서는 미국 고용지표 발표와 대선이라는 이벤트를 앞두고 있어 뚜렷한 방향성이 나타나지 않은 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 미국 대선을 대기하는 분위기 속에 미국 3분기 GDP는 2.8%로 예상치를 하회하며 성장 둔화에 대한 우려와 함께 소폭 하락 마감. 초반에는 2년이 3.5/3으로 대치를 이루다 오후에 오피가 내려오며 03에 거래가 이뤄짐. 오후에는 3년이 99.75/99.25였다가 국채선물 움직임이 바뀌면서 3년 비드가 올라와 99.75에 거래되었고 이후 오피가 99.5까지 내려옴. 막판에는 4년이 96.5 초이스 마켓 소식과 함께 97/96.5에서 96.5에 거래되었고 9개월 오피가 내려오며 19.5에 거래가 이뤄졌으며 10년 오피와 3년 오피가 99.75, 96.75로 내려옴. 마감 이후에는 10년이 99.75에 nd로 거래가 이뤄졌고 1년이 12 초이스까지 갔다가 거래됨.

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
2024.10.25(금)	219.3	197.1	3.28%	3.283%	3.25%	3.40%	2년물	4.174%	-0.4
2024.10.28(월)	219.6	196.8	3.27%	3.277%		3.41%	5년물	4.160%	-0.8
2024.10.29(화)	216.5	196.4	3.23%	3.263%		3.41%	10년물	4.287%	-1.4
2024.10.30(수)	220.4	197.8	3.20%	3.265%		3.43%	30년물	4.476%	-2.8
2024.10.31(목)	216.6		3.26%	3.285%		3.43%	10Y-2Y	11.3	-1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종요가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,556.15	-37.64	29.03.10	국고 24-1	881	여전채 1,600	은행채 7,800	
KOSDAQ	743.06	4.87	34.06.10	국고 24-5	876	회사채 2,000	여전채 2,000	
달러-원	1,377.00원	-2.80원	54.03.10	국고 24-2	720	공사채 1,900	회사채 2,300	
국고3Y	2.936%	-0.1	31.06.10	국고 21-5	-300		공사채 4,400	
국고10Y	3.100%	-0.5	30.12.10	국고 20-9	-588			
국고10Y-3Y	16.4	-0.4	25.06.10	국고 15-2	-724			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
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	-0.06	T/N	4.90	4.80	4.84	-0.11
1W	4.93	4.83	4.88	-0.07	1W	4.90	4.80	4.86	-0.09
1S	4.95	4.85	4.90	-0.05	1S	5.00	4.85	4.90	-0.02
3S	5.00	4.85	4.93	-0.03	3S	5.00	4.85	4.93	-0.01
6S	4.83	4.63	4.78	-0.02	6S	4.85	4.65	4.80	0.00
1YR	4.65	4.35	4.55	0.00	1YR	4.65	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	-4/+2	-2	3.77	0.52	3.25	4.82000	1M MAR	-152	-150
T/N	-10/-4	-7	3.86	0.35	3.25	4.81506	1W*1S	-121	-115
1W	-37/-33	-35	4.40	-0.08	3.25	4.78540	1*2	-265	-255
1S	-165/-155	-160	4.71	0.01	3.31	4.67171	1*3	-465	-455
3S	-650/-630	-640	5.24	0.00	3.40	4.57106	1*6	-1090	-1070
6S	-1300/-1240	-1270	5.22	-0.01	3.37	4.41800	1*9	-1670	-1630
1YR	-2400/-2320	-2360	5.00	0.02	3.23	4.17434	1*12	-2170	-2130

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)

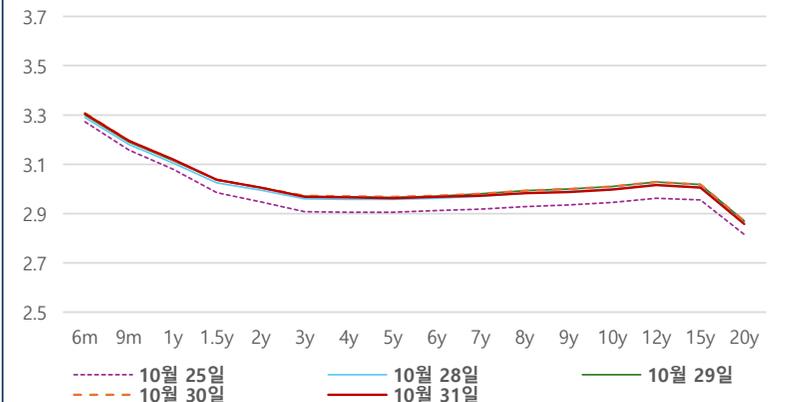
IRS 데일리 증가

10월 31일

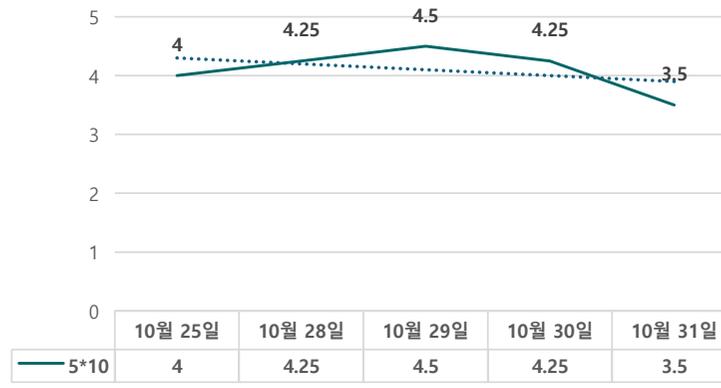
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3050	-0.25
9m	3.1950	0.00
1y	3.1200	0.25
1.5y	3.0375	0.00
2y	3.0050	0.00
3y	2.9675	-0.50
4y	2.9650	-0.50
5y	2.9625	-0.50
6y	2.9675	-0.50
7y	2.9725	-0.75
8y	2.9825	-1.00
9y	2.9875	-1.25
10y	2.9975	-1.25
12y	3.0150	-1.25
15y	3.0050	-1.25
20y	2.8575	-1.25

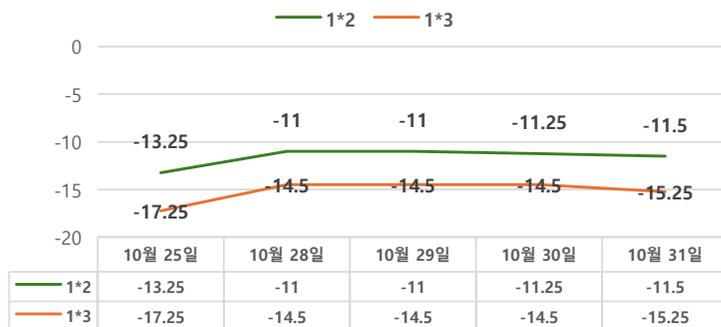
IRS 증가



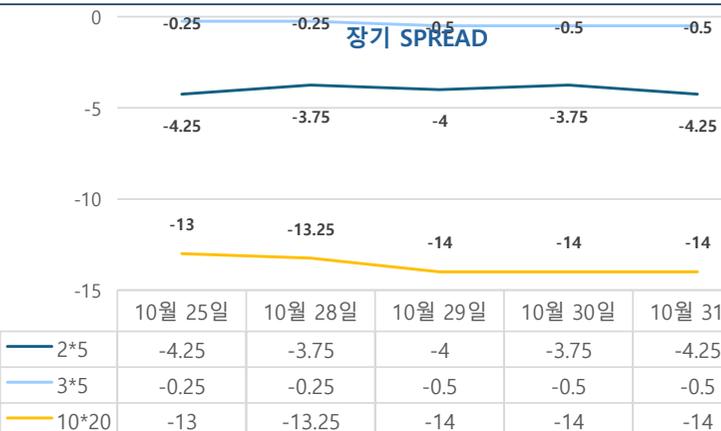
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

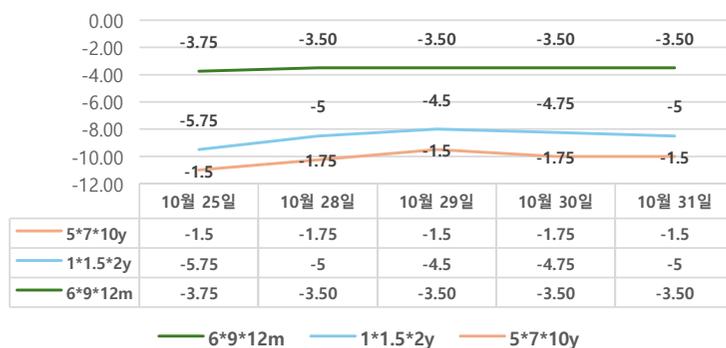
구분	증가	전일대비
1*2y	-11.50	-0.25
1*3y	-15.25	-0.75
2*5y	-4.25	-0.50
3*5y	-0.50	0.00
5*10y	3.50	-0.75
10*20y	-14.00	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.50	0.00
1*1.5*2y	-5.00	-0.25
2*5*10y	-7.75	0.25
5*7*10y	-1.50	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

