

Market Daily Report

2024.11.05(화)



레포	월말세입에 상응하는 국고여유자금 유입되어 잉여세 강했으며, 금리 급락했음에도 은행권 매수 꾸준하였음. 장 중 부족 마감 우려 확산되어 은행권 조달 방향으로 선회함에 따라 증권사 추가 매도분 해소 쉽지 않았음.
채권	한국 : 국채금리는 보험권 혼조세 마감. 중단기 금리는 소폭 하락하고 장기 금리는 다소 상승하는 모습. 미 대선을 앞두고 관망세가 이어짐. 장기 구간은 해리스의 선전소식에도 좀처럼 강해지지 못했음. 미국 : 미 국채금리는 트럼프의 당선 가능성이 퇴색되자 모두 하락 마감. 이날 장 초반에는 해리스가 공화당 우세 지역인 아이오와주에서 앞선다는 여론조사 결과가 나오며 10년물 금리가 4.2630%까지 하락. 이후 580억달러 규모 미 국채 3년물 입찰 금리가 4.152%로 다소 부진한 데 더해 시장 참가자들이 "대선 결과와 무관한 미국 재정 적자의 악화"에 베풀며 금리는 4.3300%까지 상승. 이러한 흐름은 다소 소강상태로 진입하여 10년물 국채금리는 4.2870%로 마감.
MONEY	금주 박빙의 미대선과 FOMC 회의를 앞두고, 초단기를 위주의 호가가 형성중. (오버나잇 오쇼 4.81-4.82, 유포스 대만계 4.86-4.88, 중국계 4.83-4.85) 연내 만기 구간 통 1개월물까지는 역외 오피로 1주 4.85 2주 4.85 1개월물 4.82-4.85 까지 제시 중이나 비드 레벨은 1개월물 4.70-4.80 수준으로 제시되며, 일부 말레이 네임에서 만기건 고점 4.88-4.89 거래 후 한산한 장세 유지. 연평기는 구간 2-3개월물은 중국계로 4.85-4.87% 타겟 오피가 제시 되었고, 카운터 비드 4.80-4.85 수준으로 레벨 형성되며 대기 상태에서 마감됨. 태풍 이후, 대만계 렌더들의 복귀로 1년물 4.60%, 홍콩 렌더로 4.55-4.56%까지 연준의 금리 인하 전 막판 장기를 오피가 시장이 제시되면서 4.56 중국계, 포린 네임으로 일부 체결 리포트되며 마감.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 달러 유동성 확대로 단기를 중심으로 상승세를 이어감. 1년 만기물의 증가는 전장보다 10전 하락한 -23.70원에 형성됐고, 6개월 만기물은 전장보다 10전 하락한 -12.50원에 증가를 기록했으나 1거래일 감소했으므로 거래일수 보정 시 보험세를 보임. 달러화는 전체적으로 미국 대선에서 해리스 부통령 측이 우세하다는 소식의 결과로 약세를 보였으며 외화자금시장에서는 몇주간 이어졌던 달러 강세로 네고 물량 유입 등 달러 유동성이 증가하며 단기를 중심으로 강세장이 계속됨.
IRS	전일 IRS는 초박빙을 이루고 있는 미국 대선을 하루 앞두고 혼조세를 보이며 소폭 상승 마감. 초반에는 5*10년과 1*1.5*2년으로 오피가 나왔으며 5년 비드가 꾸준히 오르면서 97까지 올라감. 오후에는 5년이 98 거래 마켓인 소식과 함께 5년이 98.25/97.75로 대치를 이룸. 막판에는 9개월이 20.75에 거래가 이뤄진 후 9개월 비드가 21에까지 올라왔고 3년이 98/97.5를 이루다 비드가 올라와 97.75에 거래되었고 마감 이후에는 1*1.5*2년 -5 오피가 nd로 나눔.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
							한국시간 오전 07:05 기준		단위: bp
2024.10.29(화)	216.5	196.4	3.23%	3.263%		3.41%	2년물	4.164%	-4.6
2024.10.30(수)	220.4	197.8	3.20%	3.265%		3.43%	5년물	4.149%	-7.8
2024.10.31(목)	216.6	193.7	3.26%	3.285%	3.25%	3.43%	10년물	4.287%	-9.8
2024.11.01(금)	217.5	194.2	3.20%	3.232%		3.43%	30년물	4.469%	-11.2
2024.11.04(월)	221.9		3.15%	3.228%		3.43%	10Y-2Y	12.3	-5.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
금투협 최종요구수익률			단위: 억 원			단위: 억 원		
KOSPI	2,588.97	46.61	25.02.04	통안채	3,600	여전채 3,000	은행채 2,200	
KOSDAQ	754.08	25.03	54.09.10	국고 24-8	1,420	회사채 80	여전채 1,200	
달러-원	1,374.50원	-3.80원	25.06.10	국고 15-2	998	통안채 7,100	회사채 500	
국고3Y	2.935%	-0.4	33.06.10	국고 23-5	-100	공사채 2,500	통안채 5,400	
국고10Y	3.096%	0.6	31.06.10	국고 21-5	-107			
국고10Y-3Y	16.1	1	29.12.10	국고 19-8	-275			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.85	4.77	4.81	-0.01	O/N	4.87	4.82	4.84	-0.01
T/N	4.87	4.79	4.83	-0.01	T/N	4.87	4.82	4.84	-0.01
1W	4.85	4.75	4.80	-0.07	1W	4.85	4.75	4.82	-0.04
1S	4.88	4.78	4.83	-0.05	1S	4.85	4.75	4.82	-0.05
3S	4.95	4.80	4.86	-0.04	3S	4.90	4.80	4.86	-0.04
6S	4.75	4.60	4.70	-0.05	6S	4.85	4.65	4.73	-0.02
1YR	4.65	4.45	4.56	0.01	1YR	4.65	4.45	4.56	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7/-5	-6	4.83	0.27	3.25	4.90000	1M MAR	-157	-155
T/N	-3/-1	-2	3.77	0.00	3.25	4.89197	1W*1S	-125	-115
1W	-29/-25	-27	4.26	-0.11	3.25	4.84213	1*2	-260	-250
1S	-155/-145	-150	4.62	-0.04	3.30	4.65200	1*3	-470	-455
3S	-630/-620	-625	5.20	0.00	3.40	4.55429	1*6	-1070	-1050
6S	-1280/-1220	-1250	5.22	0.00	3.37	4.41198	1*9	-1630	-1600
1YR	-2420/-2320	-2370	5.03	0.02	3.24	4.19104	1*12	-2160	-2120

국내의 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)

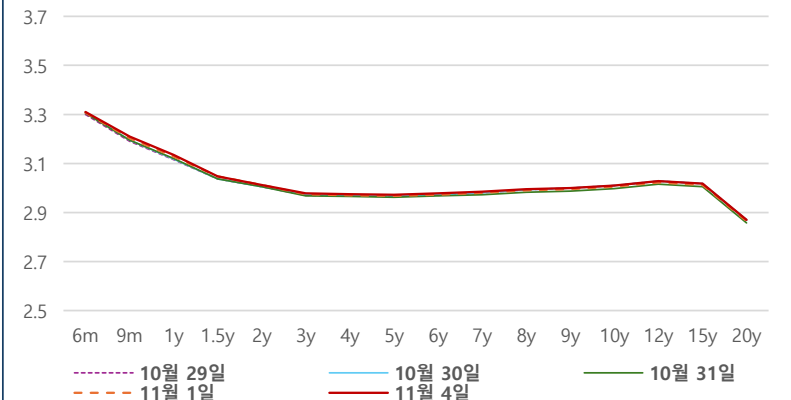
IRS 데일리 증가

11월 4일

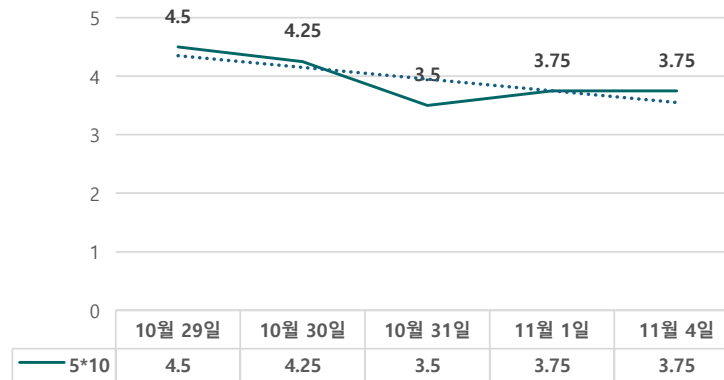
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3100	0.25
9m	3.2100	0.75
1y	3.1350	0.75
1.5y	3.0475	0.00
2y	3.0125	0.00
3y	2.9775	0.25
4y	2.9750	0.50
5y	2.9725	0.50
6y	2.9775	0.50
7y	2.9850	0.50
8y	2.9950	0.50
9y	3.0000	0.50
10y	3.0100	0.50
12y	3.0275	0.50
15y	3.0175	0.50
20y	2.8700	0.50

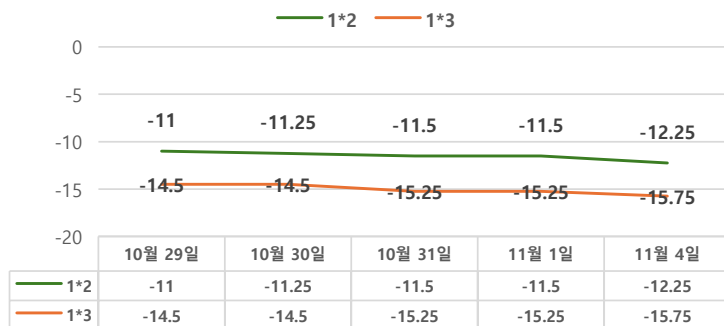
IRS 증가



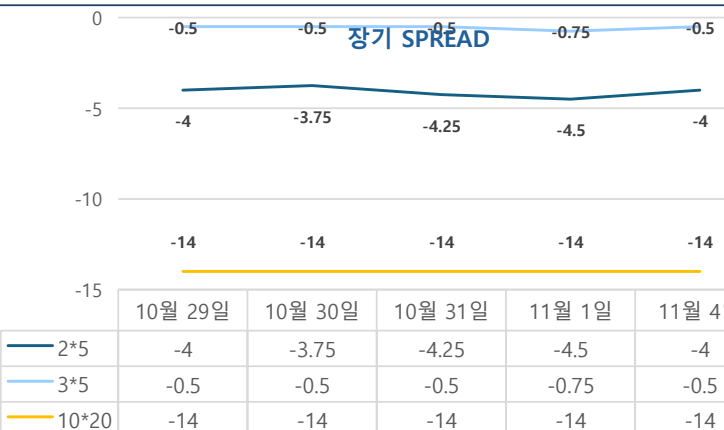
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

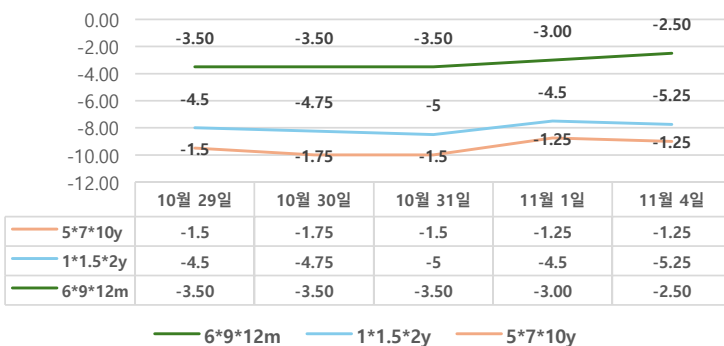


IRS 주요 커브

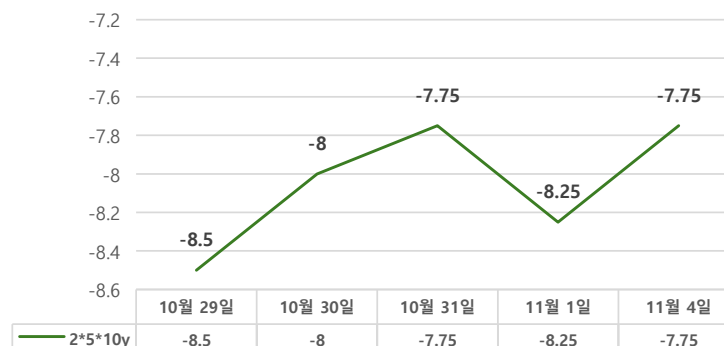
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-12.25	-0.75
1*3y	-15.75	-0.50
2*5y	-4.00	0.50
3*5y	-0.50	0.25
5*10y	3.75	0.00
10*20y	-14.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.50	0.50
1*1.5*2y	-5.25	-0.75
2*5*10y	-7.75	0.50
5*7*10y	-1.25	0.00