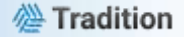


Market Daily Report

2024.11.06(수)



레포	지준 마감 불확실성 확대되어 은행권 운용보다 조달에 집중했으며, 1+1일물 및 2일물 거래 혼재해 조달금리 크게 상승하였음. 시중은행 매도 계속된 가운데 일반채와 회사채 모두 장 중 일시적인 정체를 보였고, 기일물 조달금리 소폭 상승하였음.
채권	한국 : 국채금리는 하락 마감. 전일 뉴욕 채권시장이 해리스의 선전 소식에 강세를 보인 데 영향을 받은. 국내 인플레이션 둔화도 강세 재료로 작용. 다만 아시아장에서 미 국채금리가 반등하며 강세를 일부 제약. 미국 : 미 국채금리는 2년물, 5년물 국채금리는 상승한 반면 10년물, 30년물 금리는 하락 마감. ISM 서비스업 PMI가 시장 예상치를 상회하고 4개월 연속으로 '50'을 넘어 경기 확장을 가리키자 금리는 상승. 이후 10년물 입찰 결과 발표 직후 10년물 금리는 4.3680%까지 상승했으나 이내 하락함. 낙찰 금리가 4.347%로 양호하게 나오고 해리스의 당선 가능성이 부각되며 4.2730%로 마감.
MONEY	역내외 단기 유통성 잉여로, 오버나이트는 온쇼 4.80-4.81 수준에 거래되며 오퍼 대기속 마무리 되었고, 역외에서도 레벨 상승세 없이 순조롭게 마감. FOMC 금리 발표가 SPOT+1일로 다가오면서, 역내외 시장 호가는 1개월물 이내 구간의 하락세가 뚜렷하게 진행되며, 1주물 4.73-4.77 2주물 4.68-4.73 1개월물 4.65-4.75 사이로 비드-오퍼 형성되었으며, 중국계 타겟 1개월물이 4.75에 오퍼 대기하며 추가 하락의 여지를 남겨 두고 있음. 연말 커버 구간 2-3개월물은 4.80-4.85 사이로 체결되며 연말 커버 프리미엄이 적용된 점 감안 레벨 급락세를 제한적임. 장기물 오퍼 1년물 4.50-4.55 사이로 역외에서 제시 중이며, 장기물 비드 제한으로 체결 소식은 중국계 일부 네임에 국한적으로 거래 되는 상황.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 지급준비율(11/6)과 미국 대선을 앞두고 수급 처리 위주의 제한된 장세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장과 동일한 -21.20원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 10전 상승한 -12.40원의 증가를 기록했으나 거래일수 보정시 보합을 기록함. 장기물에서는 보합세가 유지됐으나 단기물은 지급준비율을 앞두고 증가한 원화 수요로 상승세를 보임. 초단기물인 오버나이트는 +0.02원까지 상승했고 탐넥 역시 0.00원의 증가를 기록하며 전장대비 강한 상승세가 나옴. 전반적으로 미국 대선이라는 빅 이벤트를 앞두고 시장은 관망세를 보였으며 내일 장 중에 발표될 출구조사와 개표 상황에 따라 변동성이 커지고 시장 방향성이 나올 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 우리나라 10월 CPI가 예상치를 하회하며 1.3%를 기록했고 미국 대선 결과를 대기하는 분위기 속에 하락 마감. 초반에는 10*20년 -16 오퍼로 인해 초장기쪽 커브가 움직이게 되었으며 1.5*2년 비드가 나와 -4.25에 거래가 이뤄졌고 1*2년은 -12.75에 거래됨. 오후에는 3년이 96-96.25에 몇차례 거래되었으며 5년 오퍼가 95.5로 내려와 2*5년 비드와 1.5*2년 비드가 엮인 1.5년이 4.25에 거래됨. 막판에는 5년이 95.5/95에서 95.5에 nd로 거래가 이뤄졌고 10년 오퍼가 내려와 98.75에 사이즈 조이스를 이뤘다가 거래됨. 마감 이후에는 1.5년 비드와 2년 오퍼가 엮인 1.5*2년이 -4.5에 거래되었고 3*5년 비드와 3년 비드가 엮인 5년이 95.25에 거래가 이뤄짐. 또한 2년 오퍼가 내려와 99.5에 거래되었고 이날 양도성예금증서(cd)는 상승하여 3.44이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.10.30(수)	220.4	197.8	3.20%	3.265%		3.43%	2년물	4.185%	2.1
2024.10.31(목)	216.6	193.7	3.26%	3.285%		3.43%	5년물	4.151%	0.2
2024.11.01(금)	217.5	194.2	3.20%	3.232%	3.25%	3.43%	10년물	4.273%	-1.4
2024.11.04(월)	221.9	198.1	3.15%	3.228%		3.43%	30년물	4.437%	-3.2
2024.11.05(화)	214.4		3.23%	3.192%		3.44%	10Y-2Y	8.8	-3.5

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,576.88	-12.09	34.06.10	국고 24-5	916	여전채 1,500	여전채 1,500	통안채 2년물 22,000억원 입찰
KOSDAQ	751.81	-2.27	27.12.10	국고 17-7	400	회사채 460	회사채 250	
달러-원	1,379.30원	4.80원	26.12.10	국고 16-8	271		공사채 4,100	
국고3Y	2.918%	-1.7	25.09.10	국고 23-8	-270			
국고10Y	3.073%	-2.3	41.09.10	국고 21-9	-301			
국고10Y-3Y	15.5	-0.6	29.12.10	국고 19-8	-950			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.85	4.77	4.81	0.00	O/N	4.85	4.80	4.82	-0.02
T/N	4.86	4.78	4.82	-0.01	T/N	4.85	4.80	4.83	-0.01
1W	4.80	4.70	4.75	-0.05	1W	4.80	4.70	4.77	-0.05
1S	4.77	4.67	4.70	-0.13	1S	4.80	4.70	4.75	-0.07
3S	4.90	4.75	4.85	-0.01	3S	4.87	4.77	4.83	-0.03
6S	4.70	4.55	4.65	-0.05	6S	4.80	4.60	4.70	-0.03
1YR	4.60	4.45	4.54	-0.02	1YR	4.60	4.40	4.53	-0.03

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	0/+4	2	2.73	-2.10	3.25	4.86000	1M MAR	-137	-133
T/N	-2/+2	0	3.25	-0.52	3.25	4.85314	1W*1S	-130	-120
1W	-30/-24	-27	4.26	0.00	3.25	4.81197	1*2	-230	-220
1S	-165/-155	-160	4.61	-0.01	3.30	4.64045	1*3	-435	-430
3S	-635/-615	-625	5.20	0.00	3.40	4.53164	1*6	-1040	-1020
6S	-1270/-1210	-1240	5.21	-0.01	3.38	4.38167	1*9	-1630	-1600
1YR	-2420/-2320	-2370	5.02	-0.01	3.24	4.14268	1*12	-2150	-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)

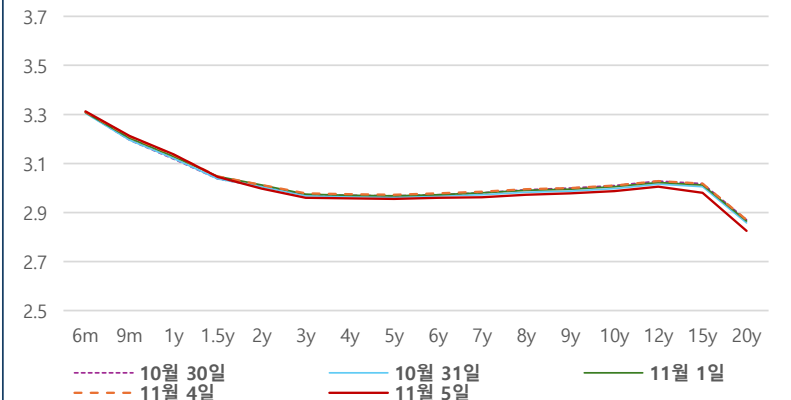
IRS 데일리 증가

11월 5일

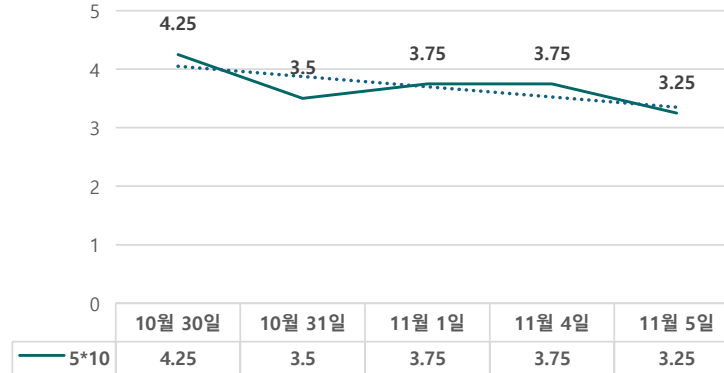
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3125	0.25
9m	3.2125	0.25
1y	3.1375	0.25
1.5y	3.0450	-0.25
2y	2.9975	-1.50
3y	2.9600	-1.75
4y	2.9575	-1.75
5y	2.9550	-1.75
6y	2.9600	-1.75
7y	2.9625	-2.25
8y	2.9725	-2.25
9y	2.9775	-2.25
10y	2.9875	-2.25
12y	3.0050	-2.25
15y	2.9800	-3.75
20y	2.8250	-4.50

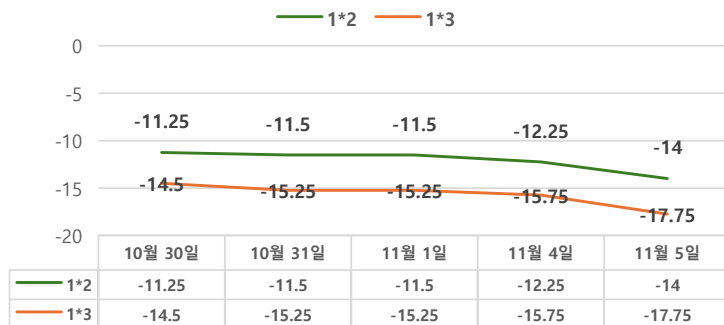
IRS 증가



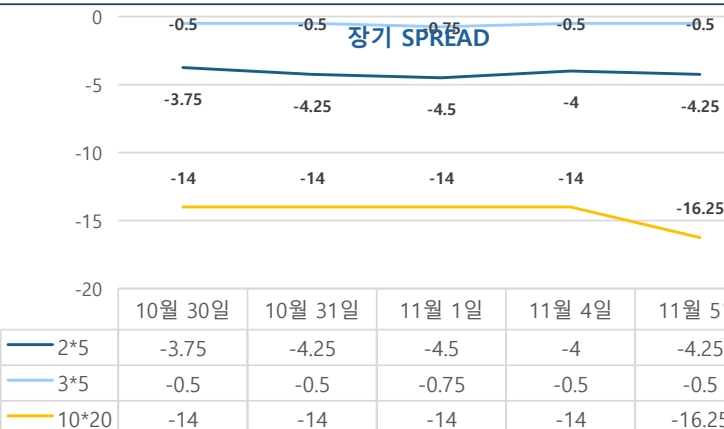
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

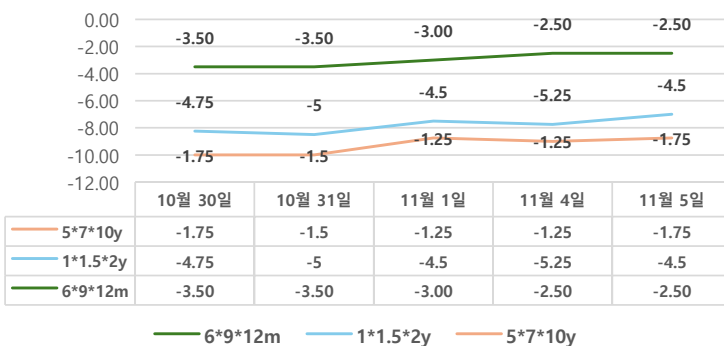


IRS 주요 커브

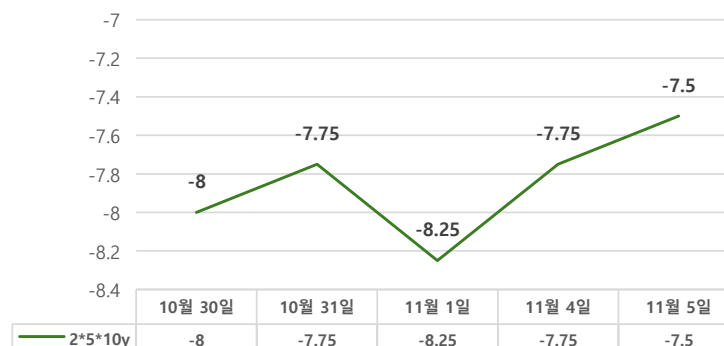
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.00	-1.75
1*3y	-17.75	-2.00
2*5y	-4.25	-0.25
3*5y	-0.50	0.00
5*10y	3.25	-0.50
10*20y	-16.25	-2.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.50	0.00
1*1.5*2y	-4.50	0.75
2*5*10y	-7.50	0.25
5*7*10y	-1.75	-0.50