

레포	전일자 1+1일률 를오버 외에 신규 매도 제한적이었으며, 시장 유동성 풍부해 수급 무난하였음. 지준일 은행권 콜 거래를 통한 지준 과부족 조정에 주력했고, 오후께 불확실성 해소되며 소폭 잉여 마감하였음.
채권	한국 : 국채금리는 상승 마감. 미 대선 개표가 진행될수록 트럼프의 승리가 유력해지면서 글로벌 금리가 일제히 오른 데 영향을 받음. 시장에선 점진적 약세장을 전망하나, '레드 스윕'(대통령-의회 모두 공화당 압승) 여부가 변수라는 의견도 상존. 미국 : 미 국채금리는 급등 마감. 30년물은 장중 4년래 최대 상승폭을 기록하기도 했으나, 오후로 접어들며 저가 매수세 유입으로 상승폭을 축소, 트럼프의 공약인 수입품 관세 부과가 인플레이션 우려를 부활시켜 금리 상승. 트럼프의 재집권으로 미국 재정적자가 심해질 것이라는 전망 역시 반영. 이날 250억달러 규모의 30년물 국채입찰에서는 2.64배의 응찰률을 보이며 강한 수요를 확인. 이번 응찰률은 2018년 1월 이후 최고치로, 저가에 장기물을 담아두겠다는 심리가 반영.
MONEY	미국 대선 개표가 시작되면서 시장은 모두 관망 모드로 달려 단기 유동성 잉여인 가운데 온쇼 오버나잇 @ 4.80-4.82 오후 대기 속 8일 FOMC 회의 결과 및 연준의 스텐스에 주목하며 포지션을 최소화 하는 중. CME FED WATCH에서 이번 FOMC 회의에서 25bp 금리 인하를 97.6%로 거의 확실시 예상함에 따라 스팟 벨류 (8일 금리 발표일) 시장 호가는 이미 선반영된 레벨로 거래 중. 투데이/탐 스타트 1-2주물 비드는 4.75-4.80 수준, 스팟 벨류 스타트 4.65-4.72 형성 중이며 1개월물은 4.75, 연말 커버 구간 2-3개월물은 4.85 오후 대기 중으로, 어제와 상반된 분위기로 연말 커버 오피 강세 속 비드 제한에 제결은 연말 커버 구간 2-3개월물은 4.77-4.83 사이로 거래 되며 주가 하락 시도 중. 대만계, 중국계 역외 센터들의 장기물 오퍼도 1년물 4.55 수준에 제시되면서 한국계, 중국계, 유럽계 네임 모두 4.50-4.55 수준으로 네임 차등없이 접점을 이루고 있음. 달러 강세에 아시아 통화가 약세를 보이며, 역외 위안화 호가도 장중 변동성을 확대하며 오버나잇 1.50~3.50 까지 급등락을 반복 했음.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 장 중에 나오는 미국 대선 관련 뉴스들에 영향 받으며 변동성이 큰 장세를 보임. 1년 만기물의 종가는 전장보다 전장보다 10전 상승한 -23.80원을 형성했으나 거래일수 2일 보정시 전일과 같은 레벨로 보합세를 보임. 6개월 만기물은 전장보다 50전 상승한 -11.90원의 종가를 기록하며 큰 상승폭을 보였고 단기물 역시 최근 이어진 상승세를 지속함. 계속된 외화자금시장에서의 달러 잉여와 트럼프 당선 가능성 증가에 따른 역외 매수세 유입으로 단기물은 강세장이 이어졌고 장기물 역시 단기물을 따라 상승함. 트럼프의 미 대통령 당선이 유력해지면서 달러 강세의 움직임이 이어질 수 있으나 직후 열릴 FOMC에서의 금리 인하 가능성과 국채 금리 변동성도 있어 즉각적인 방향성이 나오진 않을 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 미국 제 47대 대통령으로 트럼프 당선이 확실시 되면서 이에 영향을 받아 상승 마감. 초반에는 15년이 06/5.5에서 06에 거래되었고 10~20년이 nd로 -17/-20으로 나와 초장기 커브가 움직이게 됨. 오후에는 2년으로 호가가 집중되며 5.5/5에서 국채선물과 연동되며 5에 nd,d로 여러 차례 거래가 이뤄졌고 단기쪽 6개월, 9개월으로 호가가 나왔으며 6*9개월이 -9에 거래되었고 6개월은 32.5, 9개월은 23.5에 거래됨. 막판에는 10년 비드가 05로, 2*10년 비드가 0.5로 올라왔으며 단기쪽으로 호가가 꾸준히 나와 6개월이 33/32.5로 대치를 이루다 32.5에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 9개월이 23.5에 몇 차례 거래되었고 9개월 오피가 23으로 내려와 6*9개월 -9.25비드와 얹인 6개월이 32.25에 거래됨.

단기자금시장

전일 미국 국채 금리

한국시간 오전 07:05 기준

단위 : bp

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2024.10.31(목)	216.6	193.7	3.26%	3.285%		3.43%	2년물	4.268%
2024.11.01(금)	217.5	194.2	3.20%	3.232%		3.43%	5년물	4.276%
2024.11.04(월)	221.9	198.1	3.15%	3.228%	3.25%	3.43%	10년물	4.436%
2024.11.05(화)	214.4	200.6	3.23%	3.192%		3.44%	30년물	4.614%
2024.11.06(수)	214.7		3.23%	3.236%		3.44%	10Y-2Y	16.8
								8

국내 금융시장 동향

전일 외국인 순매수 순매도

오늘의 채권

단위 : 억 원

항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	단위 : 억 원	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
							채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,563.51	-13.37	54.09.10	국고 24-8	650	은행채 6,000	은행채 1,400		
KOSDAQ	743.31	-8.50	52.03.10	국고 22-2	400	여전채 1,800	여전채 100		
달러-원	1,399.30원	20.00원	29.12.10	국고 19-8	230	회사채 204	회사채 600		
국고3Y	2.960%	4.2	27.03.10	국고 22-1	-42	공사채 1,600			
국고10Y	3.134%	6.1	25.09.03	통안채	-200				
국고10Y-3Y	17.4	1.9	25.09.10	국고 23-8	-2,860				

Money Market Closing

단위 : %, %p

기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	4.84	4.76	4.80	-0.01	O/N	4.85	4.80	4.82	0.00
T/N	4.86	4.78	4.82	0.00	T/N	4.85	4.80	4.82	-0.01
1W	4.75	4.65	4.70	-0.05	1W	4.75	4.65	4.72	-0.05
1S	4.77	4.67	4.70	0.00	1S	4.75	4.65	4.73	-0.02
3S	4.85	4.75	4.80	-0.05	3S	4.85	4.75	4.82	-0.01
6S	4.70	4.55	4.63	-0.02	6S	4.75	4.60	4.67	-0.03
1YR	4.60	4.45	4.55	0.01	1YR	4.60	4.45	4.55	0.02

FX SWAP CLOSING

단위 : 전, %, %p

기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-2/+2	0	2.73	0.00	3.25	4.82000	1M MAR	-110	-100
T/N	-3/+1	-1	3.25	0.00	3.25	4.81387	1W*1S	-95	-85
1W	-25/-19	-22	4.25	-0.01	3.25	4.77711	1*2	-245	-235
1S	-125/-115	-120	4.64	0.03	3.30	4.63008	1*3	-475	-445
3S	-595/-575	-585	5.13	-0.07	3.40	4.52266	1*6	-1100	-1080
6S	-1220/-1160	-1190	5.20	-0.01	3.39	4.38030	1*9	-1670	-1650
1YR	-2430/-2330	-2380	5.00	-0.02	3.25	4.15115	1*12	-2220	-2200

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)

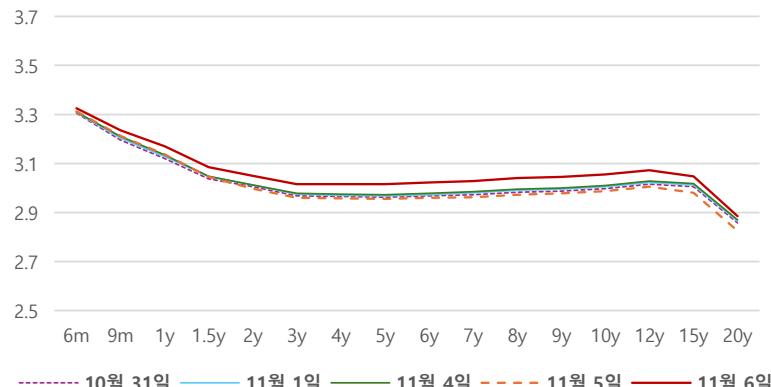
IRS 데일리 종가

11월 6일

단위 : % bp

구분	종가	전일대비
6m	3.3250	1.25
9m	3.2350	2.25
1y	3.1700	3.25
1.5y	3.0850	4.00
2y	3.0500	5.25
3y	3.0150	5.50
4y	3.0150	5.75
5y	3.0150	6.00
6y	3.0225	6.25
7y	3.0275	6.50
8y	3.0400	6.75
9y	3.0450	6.75
10y	3.0550	6.75
12y	3.0725	6.75
15y	3.0475	6.75
20y	2.8850	6.00

IRS 종가



IRS 주요 커브

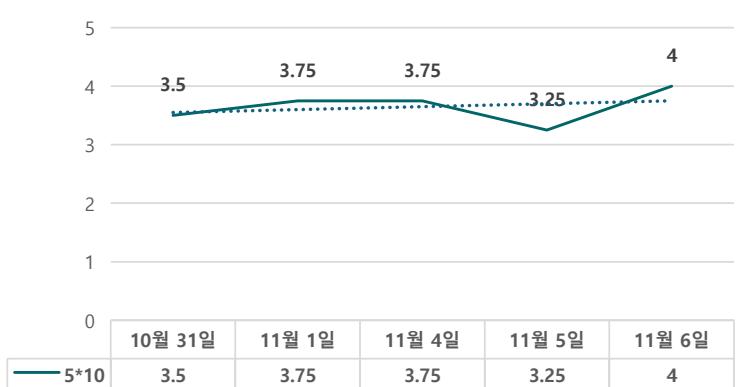
SPREAD

구분	종가	전일대비
1*2y	-12.00	2.00
1*3y	-15.50	2.25
2*5y	-3.50	0.75
3*5y	0.00	0.50
5*10y	4.00	0.75
10*20y	-17.00	-0.75

단기 SPREAD



5*10 SPREAD

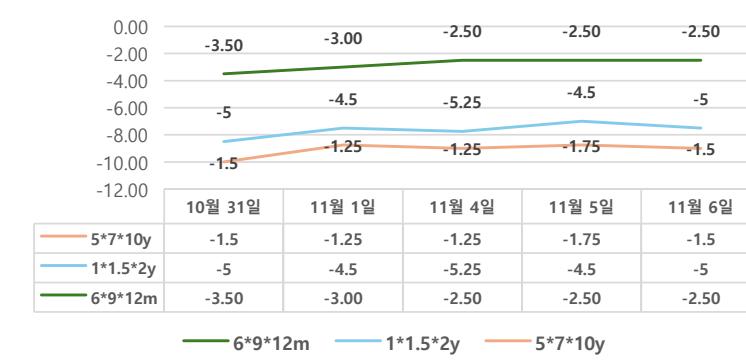


IRS 주요 커브

FLY

구분	종가	전일대비
6m*9m*1y	-2.50	0.00
1*1.5*2y	-5.00	-0.50
2*5*10y	-7.50	0.00
5*7*10y	-1.50	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

