

Market Daily Report



2024.11.08(금)

레포	국고여유자금 환수 및 공모주 청약 환불 영향으로 금리 소폭 상승했으나 은행권 매수세 유지되어 조달여건 양호하였음. 장 중 잉여 분위기 형성돼 시중은행 및 증권사 저금리 조달 가능했으며, 회사채 해소 원활하였음.
채권	한국 : 국채금리는 하락 마감. 중단기 금리가 장기 금리보다 더 하락하는 모습. 트럼프의 재선을 소회하면서 대선 불확실성은 해소. 전일 기준으로 시장은 11월 FOMC 발표를 대기하는 양상. 금일 새벽 연준은 기준금리를 4.50~4.75%로 25bp 금리 인하 결정. 미국 : 미 국채금리는 전날 상승분에 대한 반동으로 모두 하락 마감. FOMC가 25bp 금리 인하를 발표한 뒤 제품 파월 Fed 의장이 중도 사퇴 가능성을 일축시키며 금리 하락폭 확대. 파월의 단호한 입장에 대해 통화정책 불확실성이 완화되었다는 시장의 판단이 작용한 것으로 해석. 한 주간 신규 실업보험 청구자 수는 22만 1천명으로 소폭 증가했고 Q3 비농업 부문 노동 생산성 수정치도 강한 수준을 유지하였으나 시장은 FOMC 발표에 집중하며 금리는 하락. 한편 영국 중앙은행(BOE)은 기준금리를 25bp 인하하며 4.75%로 낮춤.
MONEY	트럼프 재집권 성공 이후, 달러 강세가 시현 중이나 온쇼 단기 유동성 잉여로 오버나잇 4.79~4.80 수준에 거래 체결, 단 역외에서는 대만계 단기 고정 비드가 유효한 가운데 오버나잇 4.87~4.89 수준에 거래. 내일 새벽 연준의 금리 25bp 인하가 가정 사실화되며, 탭넥 비드-오퍼는 머니 시장에서 4.63~4.65 사이로 형성 및 거래 시작됨. 8일 스타트 1~2주물 고정 레벨은 4.74 까지 거래 되었고, 1개월물은 4.75 오퍼 대기 속에 중국계, 대만계, 싱가포르계 모두 4.70 거래 체결 소식. 중국계 & 대만계 차입 수요가 이달 초 제한적이거나, 글로벌 강달러 시현 속 연말 다가 올수록 자금 수요 증가로 연말 커버 구간의 금리 변동은 계속 이어질 것으로 예상됨. 미국 국채 금리 상승에 sofr 금리도 1년물 상승세를 보여, 오후 장부터 유럽계 네임 은행들의 1년물 비드 레벨도 4.60 수준 근접하게 제시되고 있음.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 장 초반 전일의 강세를 이어가는 듯 했으나 장 중 단기를 중심으로 지속되던 강세를 되돌리는 조정의 흐름을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 하락한 -24.10원에 형성됐고 2개월물 보정 고리시 시초가 대비 40전의 하락폭을 보임. 6개월 만기물은 전장보다 30전 하락한 -12.20원의 증가를 기록함. 그간 강세를 이어오며 0.0(PAR) 이상으로 상승 마감하던 단기물은 그간의 상승폭을 되돌리며 오버나잇 -0.03원, 탭넥 -0.12원의 증가를 기록함. 전반적으로 외화자금시장에서는 트럼프의 대통령 당선 확정 이후 그간의 트럼프 트레이드가 이어지는 듯 했으나 불확실성이 해소됐다는 인식과 네고 몰랑 유입으로 지나친 달러강세를 제한하는 모습을 보였고 한국시간 기준 내일 새벽에 있을 미 FOMC 금리 발표와 미국 공화당의 레드스윙 여부에 따라 방향성이 나올 것으로 예상됨.
IRS	전일 irs는 미국 대선을 소회한 후 8일 예정된 fomc 미팅을 대기하는 분위기 속에 하락 마감. 초반에는 1.5년 오퍼가 나와 7.75에 nd로 거래되었고 단기쪽으로 호가가 나오기 시작하며 6*9개월이 -9에 거래가 이뤄졌고 9*12개월 비드와 9개월 비드가 엮인 1년이 15에 거래됨. 단기쪽으로 꾸준히 호가가 나오며 6개월이 31에 여러 차례 거래되었고 6개월 오퍼와 6*9개월 오퍼가 엮인 6*9개월이 -9에 nd로 거래가 이뤄짐. 막판에는 10년 오퍼는 0.5, 3년 오퍼는 96.75에 내려왔으며 9개월 비드가 강하게 올라와 22.5에 거래되었고 1년 비드가 올라와 15.75에 거래된 후 1년 오퍼가 계속해서 내려와 15에 몇 차례 거래됨. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.43이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	클금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.11.01(금)	217.5	194.2	3.20%	3.232%	3.25%	3.43%	2년물	4.204%	-6.4
2024.11.04(월)	221.9	198.1	3.15%	3.228%		3.43%	5년물	4.174%	-10.2
2024.11.05(화)	214.4	200.6	3.23%	3.192%		3.44%	10년물	4.329%	-10.7
2024.11.06(수)	214.7	201.4	3.23%	3.236%		3.44%	30년물	4.531%	-8.3
2024.11.07(목)	214.2		3.24%	3.258%		3.43%	10Y-2Y	12.5	-4.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
금투협 최종회계수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
KOSPI	2,564.63	1.12	52.03.10	국고 22-4	705	은행채 3,500	은행채 4,800	물가채 10년 1,000억원 교환 입찰
KOSDAQ	733.52	-9.79	33.06.10	국고 23-5	670	여전채 2,900	여전채 8,600	
달러-원	1,386.00원	-13.30원	26.09.10	국고 21-7	400	회사채 5,000	회사채 681	
국고3Y	2.922%	-3.8	25.03.10	국고 23-3	-200	공사채 6,000	공사채 5,900	
국고10Y	3.098%	-3.6	24.12.10	국고 22-15	-220			
국고10Y-3Y	17.6	0.2	51.03.10	국고 21-5	-250			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : %, %p									
O/N	4.83	4.75	4.79	-0.01	O/N	4.86	4.80	4.84	0.02
T/N	4.65	4.57	4.60	-0.22	T/N	4.67	4.60	4.63	-0.19
1W	4.73	4.63	4.68	-0.02	1W	4.75	4.65	4.70	-0.02
1S	4.75	4.65	4.70	0.00	1S	4.75	4.65	4.72	-0.01
3S	4.85	4.75	4.80	0.00	3S	4.85	4.75	4.80	-0.02
6S	4.73	4.58	4.65	0.02	6S	4.75	4.60	4.70	0.03
1YR	4.65	4.45	4.57	0.02	1YR	4.65	4.45	4.60	0.05

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
O/N	-4/-2	-3	4.02	1.29	3.25	4.82000	1M MAR	-121	-117
T/N	-14/-10	-12	4.02	0.77	3.25	4.81375	1W*1S	-100	-95
1W	-30/-24	-27	4.25	0.00	3.25	4.77626	1*2	-245	-235
1S	-135/-125	-130	4.42	-0.22	3.30	4.63256	1*3	-445	-435
3S	-595/-575	-585	5.07	-0.06	3.41	4.52226	1*6	-1070	-1050
6S	-1250/-1190	-1220	5.18	-0.02	3.39	4.39641	1*9	-1670	-1650
1YR	-2460/-2360	-2410	5.04	0.04	3.25	4.19947	1*12	-2250	-2230

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)

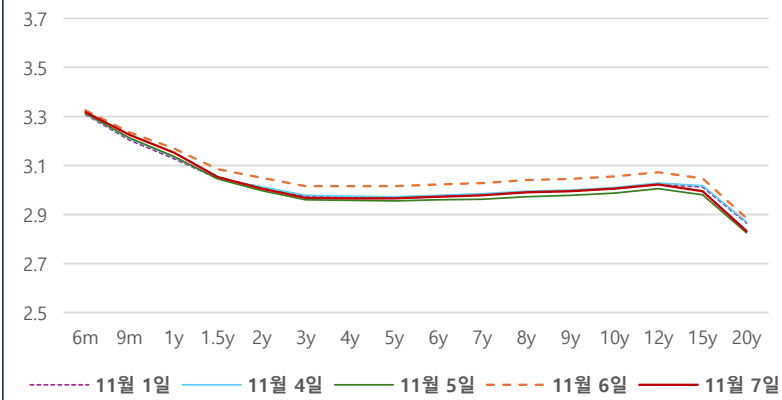
IRS 데일리 증가

11월 7일

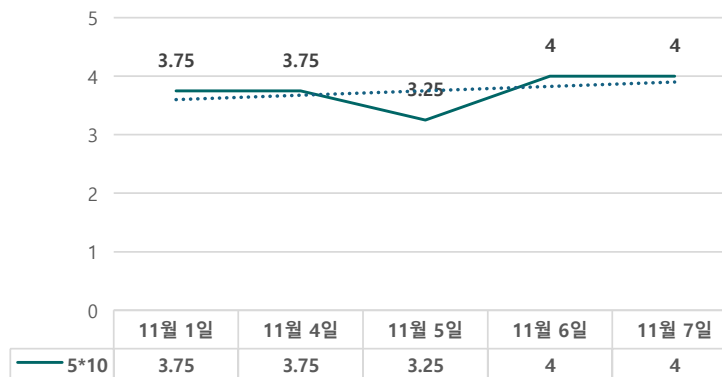
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3175	-0.75
9m	3.2250	-1.00
1y	3.1525	-1.75
1.5y	3.0525	-3.25
2y	3.0050	-4.50
3y	2.9675	-4.75
4y	2.9650	-5.00
5y	2.9650	-5.00
6y	2.9725	-5.00
7y	2.9775	-5.00
8y	2.9900	-5.00
9y	2.9950	-5.00
10y	3.0050	-5.00
12y	3.0225	-5.00
15y	2.9950	-5.25
20y	2.8325	-5.25

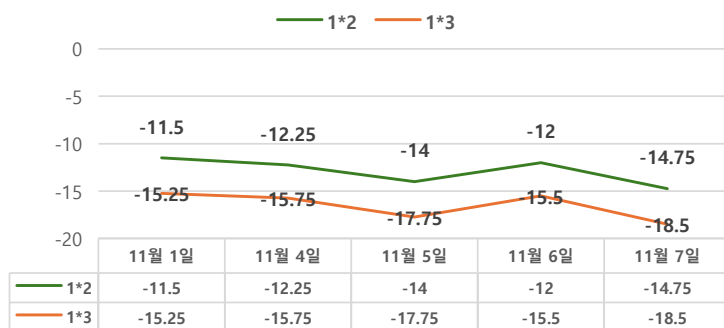
IRS 증가



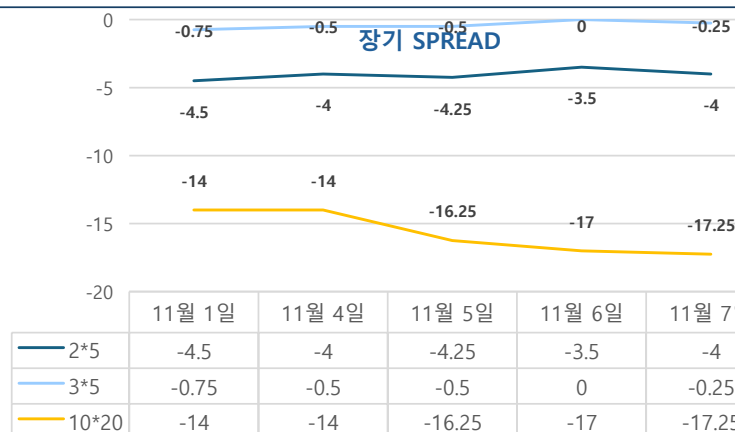
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

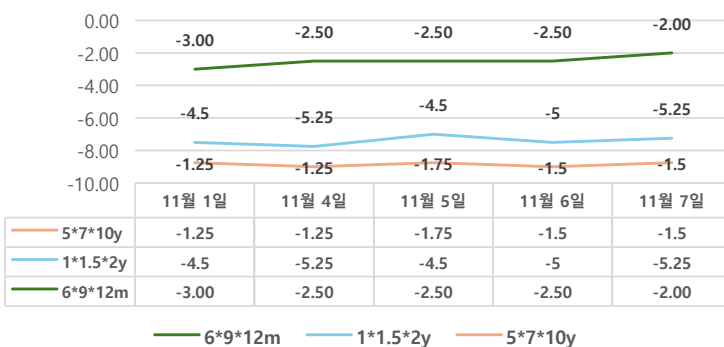


IRS 주요 커브

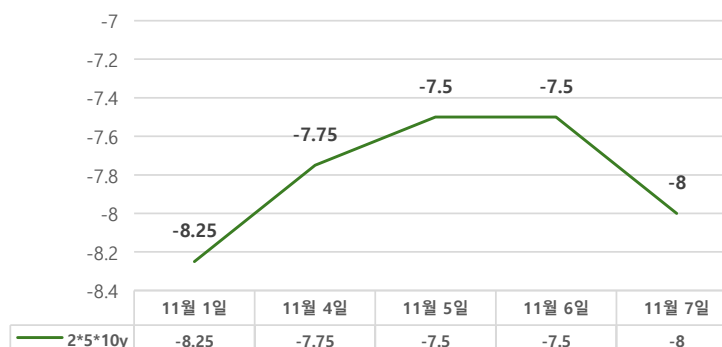
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.75	-2.75
1*3y	-18.50	-3.00
2*5y	-4.00	-0.50
3*5y	-0.25	-0.25
5*10y	4.00	0.00
10*20y	-17.25	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.00	0.50
1*1.5*2y	-5.25	-0.25
2*5*10y	-8.00	-0.50
5*7*10y	-1.50	0.00