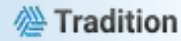


# Market Daily Report

2024.09.23(월)



<b>레포</b>	건보자금 유효한 가운데 적수 관리를 위한 은행권 매수 참여 이어져 장 중 잉여세 심화되었음. 시중은행 조달 규모 감소하여 익일을 체결금리 하락한 반면, 분기말 대비 기일물 금리 소폭 상승하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 보험권에서 혼조세를 보이며 마감. 중단기 금리는 소폭 내렸지만 장기 금리는 다소 오른 모습. 외국인인 10년 국채선물을 대거 매도해 장기 구간에 약세 압력을 가했고, 단기 구간 선호는 지속됨. 주말을 앞두고 시장 활력이 떨어진 분위기. 미국 : 미 국채금리는 장기구간 변동 폭이 상대적으로 큰 상태로 상승 마감. 장중 연준 월러 이사의 비둘기 발언에 단기 구간 금리는 하락하기도 했지만 보험권으로 마감. 월러 이사는 CNBC 인터뷰에서 "인플레이션은 내가 생각한 것보다도 훨씬 빨리 둔화했다"며 "이것으로 인해 50bp 인하가 올바른 움직임이라고 생각하는 쪽으로 움직이게 됐다"고 밝힘.
<b>MONEY</b>	금일 머니시장은 분기말 모드로 스왑-1주물이 분기커버 구간으로 5.00-5.05% 타겟 오퍼가 역외에서 제시되었고, 10/1-10/7까지 중국 국경절 휴장으로 중국계 네임 2주를 -1개월물 비드가 5.00-5.15 사이로 제시되면서 체결됨. SOFR금리가 어제 대비 소폭 하락세를 보였으나, 아시아 마켓은 분기말 구간 운용 제한에 온소 렌더 보다는 역외 렌더로 의존도가 높아지면서 역외 오퍼 레벨에 맞춰 중국계-대만계-한국계 네임별로 10-20bp 레벨갭을 두고 3개월물 기준으로 중국계 5.05-5.15 대만계 4.95-5.05 한국계 4.95-5.05 수준으로 레벨 형성중.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환스왑 포인트는 원화 자금 잉여 속에 단기물 위주로 급락세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장과 같은 -19.30원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 20전 내린 -12.10원의 증가를 기록함. 단기물인 3개월과 1개월 만기물은 각각 전장보다 30전 내린 증가를 기록하면서 약세를 나타냈고 초단기물이 약세를 보임에 따라 단기물 매수 역시 원활히 이루어지지 않음. 미국이 기준금리를 50bp 인하한 빅컷을 단행함에 따라 단기 스왑 포인트는 상승하는게 맞으나 수급의 영향이 강해 오히려 단기물이 하락하는 모습을 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 단기물은 하락한 반면 장기물은 상승하면서 혼조세를 보임. 연방준비제도(Fed,연준)의 매파적 빅컷 이후 장기 금리 위주의 반등의 흐름이 이어지는 분위기를 보임. 이날 일본은행(BOJ)은 금리를 예상대로 동결하면서 시장에 미치는 영향은 제한되는 모습을 보임. 장 초반에는 1년이 14.75에 거래됐으며, 2*3년 이 -8.75에 거래 이뤄짐. 1*1.5*2년 나비가 -6 오퍼가 나오면서 커브가 움직였으며, 3*10년쪽으로 호가가 형성되면서 0.25에 ND/D로 초이스를 이루다 거래 후, 0.5까지 레벨이 올라옴. 1년 쪽으로 호가가 많은 모습을 보였으며, 6개월 비드와 6*12개월 비드가 엮이면서 1년이 13.5 레벨에 거래가 이뤄짐. 장 막판에도 꾸준히 1*3년 쪽으로 호가가 형성되면서 -33.5에 여러 차례 거래됐으며, 2년이 88까지 오퍼가 내려오고 10년 비드가 계속해서 올라오면서 80.5에 거래됨. 이후 1년과 3년 쪽으로 오퍼가 다소 강하게 나오면서 1년이 13까지 거래됐으며, 이후 13.25까지 레벨이 올라와 거래가 이뤄짐. 또한 3년 오퍼가 꾸준히 내려오면서 80까지 거래가 이뤄졌으며 이후 80.25까지 올라옴. 장 마감 후에는 1.5년과 2년쪽으로 비드가 나왔으며 1.5년이 97에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
단위 : 조 원						단위 : bp		
2024.09.11(수)	219.1	187.8	3.52%	3.480%	3.51%	2년물	3.597%	1.1
2024.09.12(목)	219.0	188.5	3.57%	3.578%	3.51%	5년물	3.501%	1.7
2024.09.13(금)	218.6	188.1	3.57%	3.538%	3.500%	10년물	3.743%	2.6
2024.09.19(목)	219.7	190.8	3.53%	3.517%	3.53%	30년물	4.086%	3.5
2024.09.20(금)	221.1		3.48%	3.505%	3.53%	10Y-2Y	14.6	1.5

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
금투협 최종로가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
KOSPI	2,593.37	12.57	54.09.10	국고 24-8	1,331	은행채 10,500	은행채 600	국고채 10년 16,000억원 입찰
KOSDAQ	748.33	8.82	25.09.10	국고 20-6	1,290	여전채 400	여전채 2,000	통안채 91일물 8,000억원 입찰
달러-원	1,333.00원	3.80원	26.06.10	국고 16-3	701	회사채 323	회사채 100	
국고3Y	2.838%	-0.5	33.06.10	국고 23-5	-208	공사채 8,000	공사채 887	
국고10Y	2.989%	1	25.06.10	국고 22-4	-500			
국고10Y-3Y	15.1	1.5	54.03.10	국고 24-2	-1,193			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : %, %p									
O/N	4.90	4.80	4.85	0.00	O/N	4.92	4.82	4.86	-0.01
TN	4.91	4.81	4.86	0.00	TN	4.95	4.85	4.88	0.00
1W	4.98	4.88	4.93	0.00	1W	5.05	4.85	5.00	0.08
1S	5.15	4.95	5.05	0.05	1S	5.15	4.95	5.10	0.00
3S	5.15	4.90	5.00	0.02	3S	5.20	5.00	5.15	0.05
6S	4.75	4.50	4.60	-0.05	6S	5.00	4.70	4.90	0.05
1YR	4.60	4.20	4.50	0.05	1YR	4.70	4.40	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	-34/-30	-32	6.39	0.18	3.50	5.33000	1M MAR	-260	-258
TN	-18/-14	-16	7.84	1.98	3.50	5.31633	1W*1S	-180	-170
1W	-95/-89	-92	6.62	0.91	3.50	5.23431	1*2	-230	-220
1S	-265/-255	-260	5.85	0.27	3.49	4.91991	1*3	-415	-405
3S	-690/-660	-675	5.52	0.09	3.49	4.75327	1*6	-940	-920
6S	-1240/-1180	-1210	5.28	0.03	3.42	4.39343	1*9	-1340	-1320
1YR	-1980/-1880	-1930	4.76	-0.03	3.26	3.85402	1*12	-1655	-1630

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

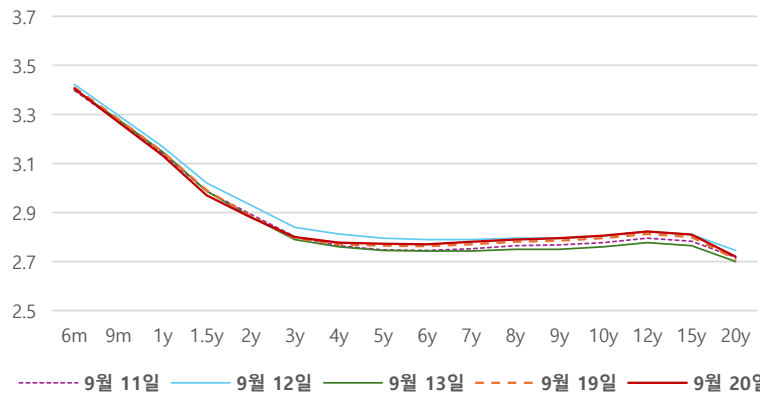
IRS 데일리 증가

9월 20일

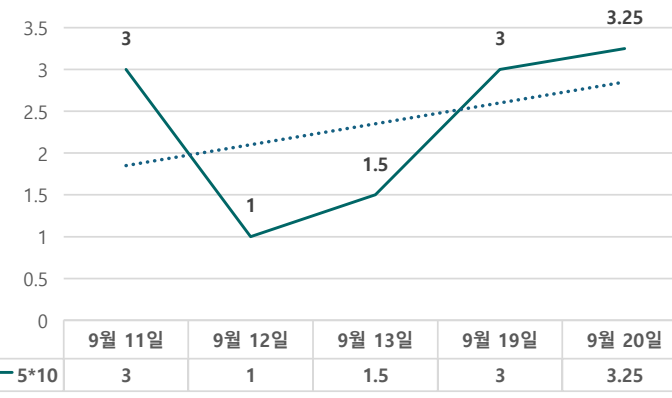
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4050	-0.50
9m	3.2675	-1.25
1y	3.1325	-1.50
1.5y	2.9700	-2.00
2y	2.8800	-0.50
3y	2.8000	0.50
4y	2.7775	0.75
5y	2.7725	0.75
6y	2.7700	0.75
7y	2.7800	1.00
8y	2.7900	1.00
9y	2.7950	1.00
10y	2.8050	1.00
12y	2.8225	1.00
15y	2.8100	1.00
20y	2.7200	1.00

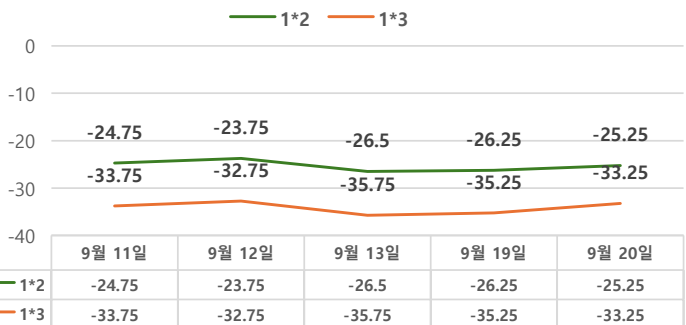
IRS 증가



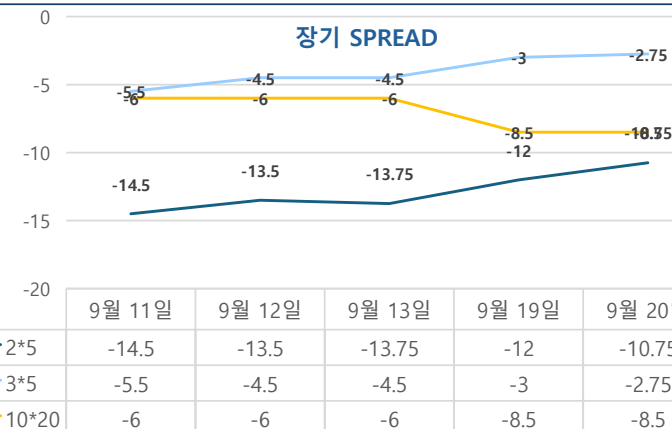
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

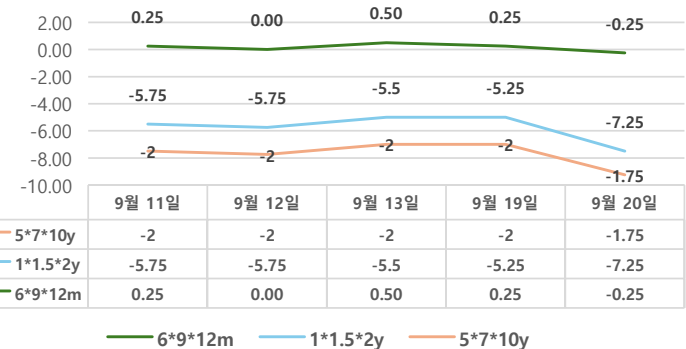


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-25.25	1.00
1*3y	-33.25	2.00
2*5y	-10.75	1.25
3*5y	-2.75	0.25
5*10y	3.25	0.25
10*20y	-8.50	0.00

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	-0.50
1*1.5*2y	-7.25	-2.00
2*5*10y	-14.00	1.00
5*7*10y	-1.75	0.25

2\*5\*10y FLY

