

레포	공모주(제닉스) 청약 환불 및 건보자금 이탈 영향으로 레포금리 소폭 상승 출발했으나 조달여건 양호한 흐름을 이어감. 시중은행 및 증권사 저금리 수요 꾸준했으나 장 중 잉여세 강하지 않아 거래 제한적이었고, 기일물 매도 소폭 감소하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 보험권 혼조세 마감. 전반적으로 관망 분위기가 이어짐. 한때 윤대통령 발언에 장기 구간을 중심으로 강세가 가팔라지기도 했으나, 장 후반부에 미국 채권 금리 상승 영향에 장기 구간이 약세로 전환됨. 호주와 일본 통화당국자 발언은 국내에 별다른 영향을 주지 않음. 미국 : 미국 국채 가격은 상승. 중국 정부의 대규모 경기 부양책에 장중 국채 가격이 가파르게 하락했으나 미국 소비자신뢰지수가 3년래 최대 낙폭을 기록하자 고용 불안에 금리가 하락하며 강세 마감. 9월 미국 소비자신뢰지수는 98.7로 이는 상향 조정된 8월 수치 105.6과 비교해 7포인트 가까이 급락한 수치이자 2021년 8월 이후로 월간 기준 가장 큰 폭의 낙차. 시장 예상치 103.9도 5포인트 넘게 하회.
MONEY	금일 머니 시장은 분기말 막판 자금 커버에 비드 강세를 보였음. 비율 관리를 위한 한국계 은행들의 기간물 비드 러시가 이어지면서 1개월물 부터 6개월물까지 테너별로 비드 호가가 제시 되었음. SOFR 금리가 전일 대비 소폭 하락세를 보였으나, 온쇼에서 기간물 운용 가능한 시중은행들이 제한적이며 역외 오피는 분기말 프리미엄이 적용되면서 레벨은 오히려 전주 대비 상승세를 보이고 있음. 분기 커버 1주-2주물은 5.00-5.10 네임별로 형성중이며, 1-3개월물 연내 만기 떨어지는 구간도 5.00-5.10로 5% 언더로 제시된 오피는 매우 제한적인 분위기. 연말 커버 4-6개월물도 4.75-4.85 수준에 중국계간 거래가 메인으로 체결면서 非중국계로 제시된 6개월물 오피 레벨도 4.80 수준으로 전주 대비 10-20bp 상승 반영되며 제시중.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 단기 자금시장에서의 원화 잉여 흐름 영향으로 전구간에서 하락세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 20전 내린 -19.40원에 형성됐고 6개월 만기물 역시 전장보다 20전 하락한 -12.30원의 증가를 기록함. 반기 말을 앞두고 단기자금 수급 이슈가 작용해 모든 기간물에서 약세를 보였으나 특히 만기 하루짜리 초단기 구간에서 강한 하락세가 나옴, 전일 초단기물 약세가 다소 해소되는 듯 했으나 하루 만에 원화 잉여 현상이 심화되면서 다시 원화 약세 흐름이 지속되는 것으로 보임. 외환 스와프포인트 약세 장이 당분간 지속될 것으로 보이며 이로 인해 역외 스와프 매수 포지션 청산 움직임도 나올 수 있을 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 단기물은 하락했지만, 장기물은 상승하면서 커버가 스텝되면서 마감. 추석 연휴 이후 커버의 스텝 현상이 계속해서 이어지고 있으며, 역외 중심으로 기준 금리 인하의 대한 기대감이 반영되면서 리시브의 움직임이 계속해서 나타나는 모습을 보임. 전체적으로 단기쪽 리시브가 많은 분위기를 보이며, 초반에는 오피가 많은 분위기 속에서 1년이 11 레벨에 여러 차례 거래가 이뤄졌으며, 이후 1*2년 스프레드와 2년 비드가 레깅으로 엮이면서 11.25 레벨까지 거래가 이뤄짐. 오후 들어 2년쪽으로도 호가가 많이 형성되는 모습을 보였으며, 비드가 꾸준히 나오면서 89.25-89 레벨에 여러차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 국제 선물 시장의 움직임에 연동되면서 1년이 11.5, 2년이 89.5로 전체적으로 레벨이 올라왔으며, 2*5년 비드가 강하게 올라오면서 -8.25에 거래됨. 마감 이후에는 5년 비드가 81.75까지 레벨이 올라와 거래됐으며, 6*9개월 -14 비드와 6개월 비드가 엮이면서 9개월이 25.25에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.09.13(금)	218.6	188.1	3.57%	3.538%	3.500%	3.53%	2년물	3.540%	-4.9
2024.09.19(목)	219.7	190.8	3.53%	3.517%		3.53%	5년물	3.469%	-3.8
2024.09.20(금)	221.1	191.5	3.48%	3.505%		3.53%	10년물	3.730%	-2.1
2024.09.23(월)	220.2	191.0	3.46%	3.499%		3.53%	30년물	4.086%	-0.7
2024.09.24(화)	218.3		3.48%	3.509%		3.53%	10Y-2Y	19	2.8

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종회기수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,631.68	29.67	26.06.10.	국고 23-4	2,800	은행채 12,900	은행채 800	국고채 3조원 매입
KOSDAQ	767.35	12.23	26.09.10	국고 21-7	1,000	여전채 7,570	여전채 2,700	통안채 2,3년 6,000억원 정례 모집
달러-원	1,330.40원	-4.40원	54.09.10	국고 24-8	846	회사채 411	회사채 50	
국고3Y	2.854%	-1	43.09.10	국고 23-9	-160	공사채 500	공사채 2,018	
국고10Y	3.026%	0.4	25.03.10	국고 23-3	-200			
국고10Y-3Y	17.2	1.4	51.03.10	국고 21-2	-200			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN				CHINESE					
기간	증가	전일대비	단위 : % , %p	기간	증가	전일대비	단위 : % , %p		
O/N	4.91	4.83	4.87	0.00	O/N	4.90	4.83	4.86	0.00
TN	4.93	4.85	4.89	0.00	TN	4.90	4.83	4.86	0.00
1W	5.07	4.97	5.02	0.02	1W	5.10	5.00	5.05	0.05
1S	5.17	4.97	5.07	0.02	1S	5.15	4.95	5.10	0.00
3S	5.15	4.95	5.05	0.03	3S	5.20	5.00	5.10	0.00
6S	4.80	4.50	4.70	0.05	6S	5.00	4.70	4.85	0.00
1YR	4.75	4.25	4.55	0.05	1YR	4.70	4.40	4.60	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전. % , %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-8	-9	5.93	0.28	3.50	4.83000	1M MAR	-277	-273
TN	-17/-13	-15	7.55	1.09	3.50	4.83077	1W*1S	-180	-175
1W	-112/-92	-102	6.95	0.49	3.50	4.83620	1*2	-200	-195
1S	-290/-260	-275	5.81	0.08	3.49	4.85478	1*3	-400	-390
3S	-690/-650	-670	5.51	0.06	3.49	4.66795	1*6	-930	-922
6S	-1260/-1200	-1230	5.30	0.04	3.42	4.33369	1*9	-1320	-1290
1YR	-1990/-1890	-1940	4.76	0.01	3.26	3.82350	1*12	-1650	-1600

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)

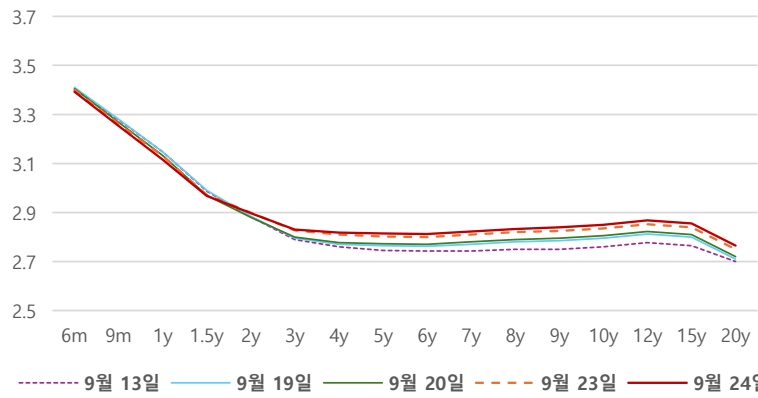
IRS 데일리 증가

9월 24일

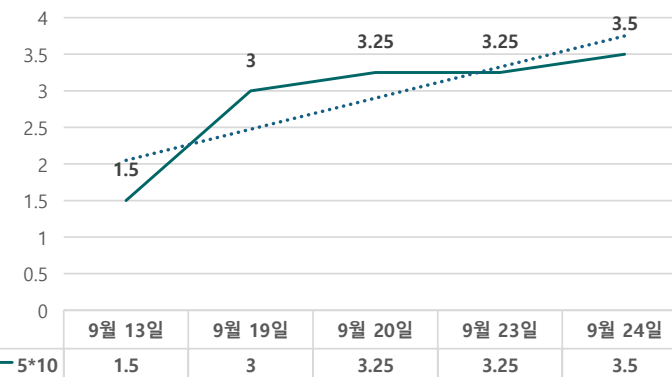
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3925	-0.75
9m	3.2525	-1.00
1y	3.1150	-1.50
1.5y	2.9675	-0.50
2y	2.8975	-0.25
3y	2.8300	0.25
4y	2.8175	0.75
5y	2.8150	1.25
6y	2.8125	1.25
7y	2.8225	1.25
8y	2.8325	1.25
9y	2.8400	1.50
10y	2.8500	1.50
15y	2.8550	1.50
20y	2.7650	1.50

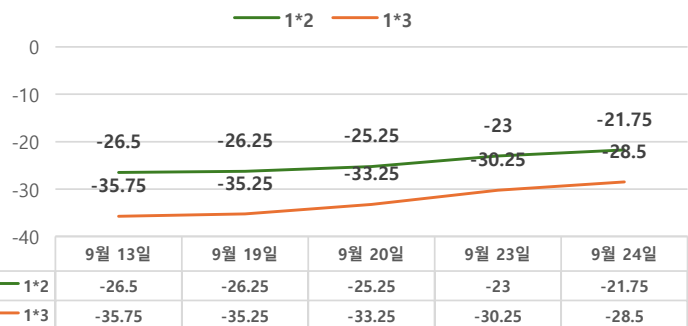
IRS 증가



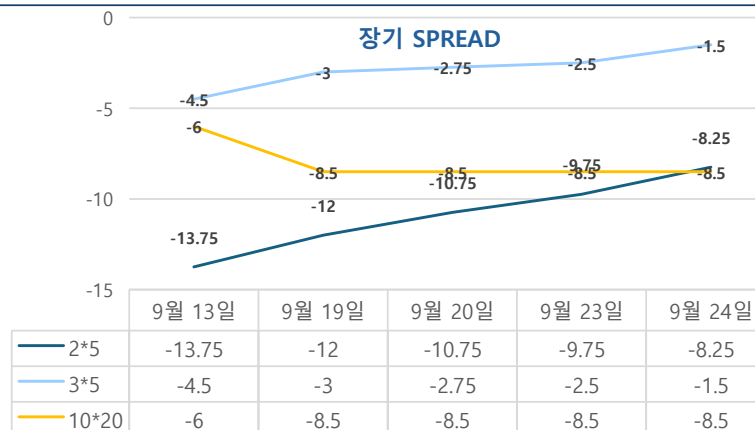
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

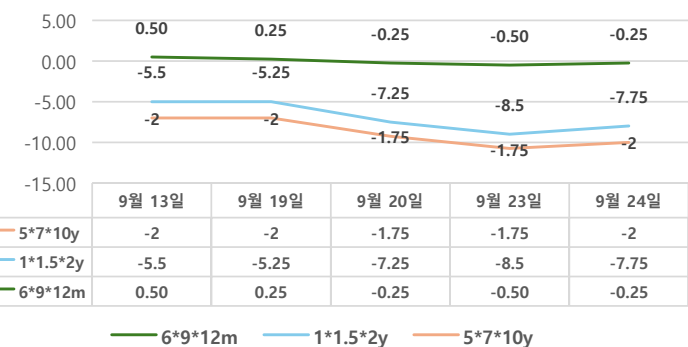
구분	증가	전일대비
1*2y	-21.75	1.25
1*3y	-28.50	1.75
2*5y	-8.25	1.50
3*5y	-1.50	1.00
5*10y	3.50	0.25
10*20y	-8.50	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.25
1*1.5*2y	-7.75	0.75
2*5*10y	-11.75	1.25
5*7*10y	-2.00	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

