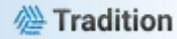


Market Daily Report

2024.10.04(금)



레포	월초 MMF 설정으로 운용사 및 은행신탁 자금 회복된 가운데 은행권 매수세 꾸준하여 조달금리 크게 하락하였음. 회사채 정체도 이른 시간에 해소됐으며, 통안계정 증액했음에도 잉여세 심화되어 장 중 저금리 거래 활발하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 금락 마감. 중단기 금리보다 장기 금리가 더 하락하는 모습. 이란의 이스라엘 공격 소식과 1%대 물가 지표가 강제 채료로 작용. 외국인인 3년과 10년 국채선물을 대거 사들여 강제 압력을 가했음. 미국 : 미 국채금리는 모두 상승 마감. 이스라엘의 이란 석유시설 타격설로 국제 유가가 폭등하자 인플레이션 우려라 확산된 탓. 미국 항만 노조의 파업이 아직 해결 기미를 보이고 있지 않다는 점도 인플레이션 불확실성을 키우는 요소. ISM 9월 서비스업 PMI는 54.9로 2023년 2월 이후 가장 높은 수치를 기록. 고용지표는 엇갈리게 나왔지만 전반적으로 양호.
MONEY	10/2 머니 시장은 월초 북을 오픈 하면서 9월말까지 쌓아둔 자금을 본격적으로 개시, 오버나잇 4.84-4.88, 1주물은 4.90-4.93, 1개월물은 4.95-5.05 수준에서 일부 매칭되었음. 중국이 국경절로 7일까지 휴일을 맞이하면서 대만계, 말레이계, 한국계 아시아계 네임은 5% 언더 비드 레벨 제시로, 비드-오퍼 호가가 많지 않아 한산한 장세를 보였음. 3개월물 이상 구간은 역외에서 3개월물 5.05% 오퍼 중국계로 제시되며 카운터 비드는 4.95-5.00 수준으로 나오고 있음. 금주 역외 유창이 많아 이번주 머니 시장 호가는 매우 제한적인 관계로 10월 머니 시장 금리는 다음주 부터 본격적으로 형성 될 것으로 예상됨.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 미국 연준의 11월 빅컷 가능성이 약화하고 간밤 이스라엘-이란 분쟁으로 인한 위험회피 심리로 중장기물에서 약세를 나타냄. 1년 만기물의 증가는 전장보다 60전 내린 -19.60원에 형성됐고 6개월물은 전장보다 30전 내린 -12.30원의 증가를 기록함. 반면 초단기물을 비롯한 단기물은 분기말이 지나면서 회복세를 보여 장기물과 엇갈린 방향성을 보임. 금일 외화자금시장에서는 지정학적 리스크로 인한 달러 강세를 반발성 네고 물량이 제한하는 모습을 보임. 지정학적 리스크가 큰 영향 없이 해결됐을 경우 미국 고용보고서에 따라 방향성을 예측할 수 있을 것으로 보임.
IRS	전일 irs는 중동발 분쟁이 격화됨에 따라 국제 정세가 불안해졌고 9월 국내 cpi는 1.6%로 3년 6개월만에 최저치를 기록하면서 국내 물가가 둔화됨을 보여 국채선물이 강세를 보임에 따라 하락 마감. 초반에는 1년쪽으로 호가 형성되어 5.75-6에 몇차례 거래되었고 오후에는 2년쪽으로 호가가 나오는 모습을 보임. 2년 비드가 올라와 83/82.5를 이루다 82.5에 거래가 이뤄졌으며 2년 비드가 다소 많이 보였고 한때 nd/d로 82.5에 초이스를 이룸. 또한 1*1.5*2년 오퍼가 내려와 -6.75/-7를 이루다 -7에 거래되었고 전체적으로 커브가 플랫되는 분위기를 보임. 막판에는 2년과 3년 비드가 76.25, 83으로 올라왔고 4년 오퍼가 내려와 74.25에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 3년이 76.5/76.25에서 76.5에 거래된 후 76.5에 비드는 분위기였으며 5년 비드가 73에 나옴. 이날 양도성예금증서(cd)는 하락하여 3.52이 고시됨.

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
2024.09.25(수)	221.6	187.6	3.48%	3.509%	3.500%	3.53%	2년물	3.707%	6.4
2024.09.26(목)	222.1	185.5	3.53%	3.531%		3.53%	5년물	3.629%	7.4
2024.09.27(금)	223.7	184.6	3.55%	3.535%		3.53%	10년물	3.848%	6.5
2024.09.30(월)	226.9	176.2	3.58%	3.602%		3.53%	30년물	4.179%	4.7
2024.10.02(수)	227.0		3.48%	3.510%		3.52%	10Y-2Y	14.1	0.1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종 호가 수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,561.69	-31.58	25.10.02	통안채	2,100	은행채 4,400	은행채 9,600	
KOSDAQ	762.13	-1.75	29.03.10	국고 24-1	1,051	여전채 4,250	여전채 5,050	
달러-원	1,323.00원	6.20원	32.12.10	국고 22-14	519	회사채 9,500	회사채 1,500	
국고3Y	2.780%	-3.1	27.12.10	국고 17-7	-500		공사채 3,000	
국고10Y	2.932%	-6	29.06.10	국고 19-4	-1,000			
국고10Y-3Y	15.2	-2.9	27.06.10	국고 17-3	-1,501			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.90	4.82	4.86	-0.14	O/N	4.90	4.80	4.85	-0.20
TN	4.91	4.83	4.87	-0.03	TN	4.90	4.83	4.88	-0.07
1W	4.96	4.86	4.91	-0.04	1W	4.96	4.86	4.92	-0.13
1S	5.00	4.90	4.95	-0.03	1S	5.10	4.95	5.05	-0.03
3S	5.05	4.90	4.98	0.03	3S	5.10	4.90	5.02	-0.03
6S	4.85	4.60	4.75	0.05	6S	4.85	4.60	4.75	0.00
1YR	4.65	4.25	4.45	-0.05	1YR	4.70	4.40	4.55	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	-13/-11	-12	5.14	-1.80	3.50	4.96000	1M MAR	-243	-241
TN	-27/-23	-25	5.78	-0.89	3.50	4.95644	1W*1S	-182	-175
1W	-67/-61	-64	5.69	-0.49	3.50	4.93506	1*2	-205	-195
1S	-255/-245	-250	5.70	-0.02	3.49	4.84954	1*3	-455	-445
3S	-705/-685	-695	5.57	-0.02	3.48	4.60953	1*6	-930	-910
6S	-1250/1190	-1220	5.28	0.01	3.41	4.28402	1*9	-1350	-1330
1YR	-2000/1900	-1950	4.74	0.02	3.23	3.82124	1*12	-1650	-1630

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)

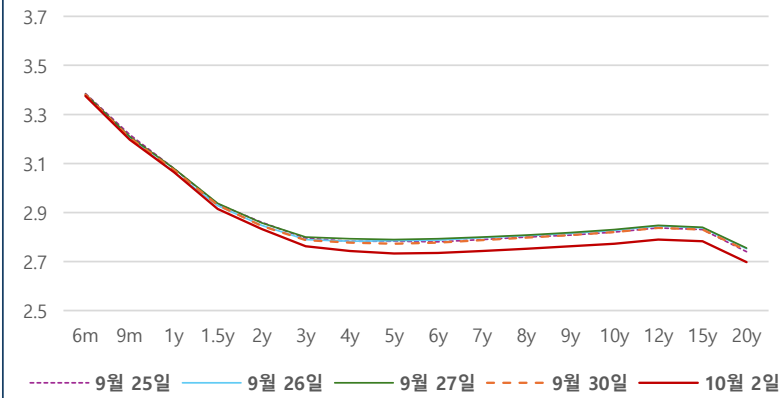
IRS 데일리 증가

10월 2일

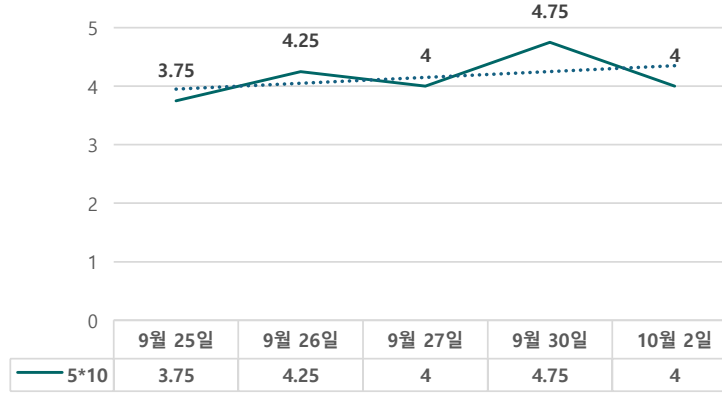
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3750	-0.50
9m	3.1975	-0.75
1y	3.0650	-1.00
1.5y	2.9150	-1.50
2y	2.8325	-1.25
3y	2.7625	-2.50
4y	2.7425	-3.50
5y	2.7325	-4.00
6y	2.7350	-4.25
7y	2.7425	-4.50
8y	2.7525	-4.50
9y	2.7625	-4.50
10y	2.7725	-4.75
12y	2.7900	-4.75
15y	2.7825	-4.75
20y	2.6975	-4.75

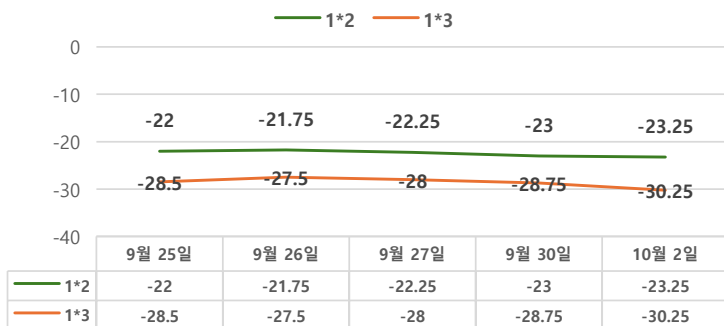
IRS 증가



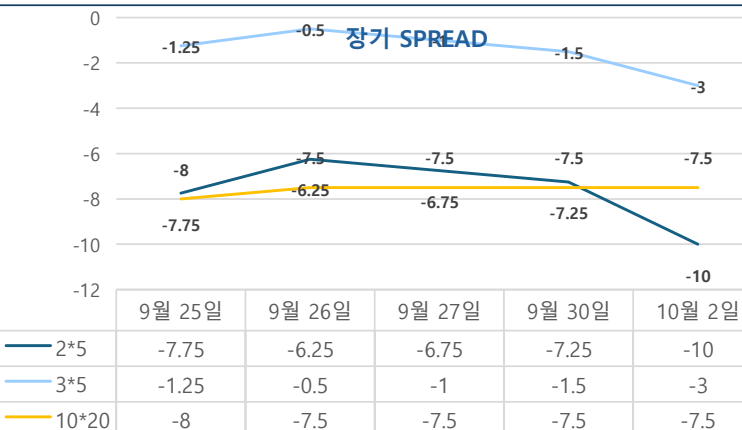
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

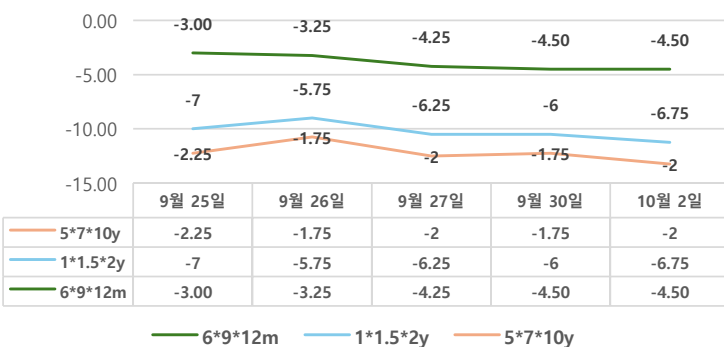


IRS 주요 커브

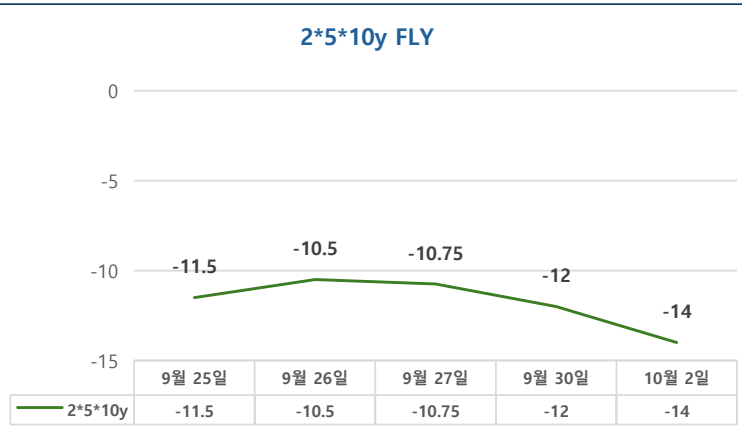
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-23.25	-0.25
1*3y	-30.25	-1.50
2*5y	-10.00	-2.75
3*5y	-3.00	-1.50
5*10y	4.00	-0.75
10*20y	-7.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-4.50	0.00
1*1.5*2y	-6.75	-0.75
2*5*10y	-14.00	-2.00
5*7*10y	-2.00	-0.25