

<b>레포</b>	마감 불확실성에 따른 은행권 양방향 움직임 혼재했으나 한은RP매입(1.5조원, 2일물) 실시 후 시장 안정을 되찾았고, 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감하였음. 1+2일물 롤오버를 제외한 신규 매도 제한적이었으며, 유동성 풍부하여 추가 조달 원활하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국채금리는 하락 마감. 아시아장에서 미국 국채 금리가 내린 데다 우리나라 국채의 세계국채지수(WGBI) 편입 기대감이 강세 압력으로 작용. 외국인은 대규모 국채선물 매도세를 이어감. 미국 : 9일 미 국채금리는 모두 하락 마감. 9월 FOMC 의사록에서 매파적 발언이 여럿 확인된 후 국채금리가 상승폭을 확대. 이번 의사록은 금리인하 경로가 예상보다 덜 매끄럽고 더 복잡해질 수 있다는 점을 시사. 시장의 11월 기준금리 동결 확률은 21%까지 상승. 이날 미국 재무부가 390억 달러 규모로 진행한 10년 만기 국채 입찰에서는 양호한 수요를 보임.
<b>MONEY</b>	10/9 한글날 휴장에 2일물 오버나이트는 온쇼 4.82-4.88 오퍼 대기 속 여유롭게 휴일 커버 펀딩 자금 클리어되었으며, FX 스왑 단기물이 올라오면서 온쇼 단기 펀딩 규모도 감소해 오버나이트 대기 시간은 짧게 마무리됨. FOMC 회의 일정 (11/6-11/7) 감안 시장에서는 2-3주물 위주의 단기 비드가 제시 되고 있고, 1개월물이나 구간 오퍼 강세에 1주-2주물은 4.88-4.92 사이에 체결 되었음. 중국이 국경절 연휴를 마치고, 오픈하면서 빅5 중국계 은행을 제외한 중국 본토 은행들 비드가 1개월물-3개월물 5.05-5.12까지 고정 비드가 등장했으며 추가 레벨 상승세 없이 정리되며 마무리. 전일 SOFR 금리 상승과 더불어 유럽계 네임들 1년물 4.40-4.50 사이에 네임별로 비드 제시 중이나, 대만계 및 중국계 비드는 상대적으로 제한적인 상황이라 중국계와 非중국계에 제시되는 장기 1년물 역의 오퍼는 모두 4.50-4.55 사이에 수렴중.
<b>FX SWAP</b>	달러-원 환율이 시장 예상을 훌쩍 뛰어넘은 미국 고용지표 충격에 두 자릿수 급등과 동시에 글로벌 달러 강세에도 네고 물량이 유입. 지난 주말에 나온 미국 9월 고용보고서가 깜짝 호조를 보인 여파를 반영한 듯 보인다. 반면 단기~중장기쪽으로 스왑레벨은 강한 추세를 보임. 1달 스왑포인트는 -265로 시작해서 10포인트 오른 -255레벨로 거래마감. 하루물은 장 초반에 비해 살짝 오른세를 보이며 데일리 -7전 정도 거래를 보임. 3개월물은 연을 넘기는 벨류로 다른 기간물들에 비해 낮은 스왑포인트를 형성.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 구간별 혼조세 마감. 이날 국채 현선물은 오전 중 약세를 보이다 오후 들어 강세 전환 후 그 폭을 키웠으며, IRS도 이에 영향을 받아 움직이는 모습을 보임. 아시아 장에서 미 국채 금리 하락과 WGBI(세계국채지수) 편입 등 기대감이 반영된 것으로 분석됨. 이날 IRS는 시장이 움직인 것에 비해서는 IRS 시장의 강세 압력은 제한 되는 분위기였으며, 장 초반에 2년 쪽으로 호가가 형성되면서 5.25/05에 대치 되다 5.25에 거래가 이뤄졌으며, 전체적으로 시장에서 1년쪽으로 거래 소식이 많이 들림. 10*15*20년 비드와 20년 오퍼가 다소 강하게 89까지 내려오면서 초장기쪽 레벨이 움직 이는 모습을 보임. 2*10년이 -6.5에 거래가 몇차례 이뤄졌으며, 이후 1년쪽으로 호가가 형성되면서 21/20.5에 대치되다 20.5에 거래된 후 국채선물의 움직임에 연동되어 오퍼가 내려오면서 19.75까지 거래가 이뤄짐.이후 2*3년 비드와 2년 비드가 엮인 3년이 6.5에 거래됐으며, 막판에는 2*7년 비드가 -7 까지 올라오면서 레벨이 움직임. 장 마감 후에는 미국채 의 움직임에 연동되면서 3년이 96에 거래가 이뤄졌으며, 9개월은 29.5/29.25에 대치되다 29.5에 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
2024.09.30(월)	226.9	176.2	3.58%	3.602%	3.500%	3.53%	2년물	4.024%	6.4
2024.10.02(수)	227.0	178.9	3.48%	3.510%		3.52%	5년물	3.918%	7.1
2024.10.04(금)	223.9	187.8	3.45%	3.494%		3.52%	10년물	4.075%	6.2
2024.10.07(월)	221.1	191.9	3.50%	3.473%		3.51%	30년물	4.343%	4.8
2024.10.08(화)	221.9		3.50%	3.483%		3.51%	10Y-2Y	5.1	-0.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,594.36	-16.02	30.12.10	국고 10-7	1,300	은행채 4,000	은행채 6,600	통안채 1년물 8,000억원 입찰
KOSDAQ	778.24	-2.77	54.09.10	국고 24-8	855	여전채 13,400	여전채 1,500	
달러-원	1,346.00원	1.50원	29.12.10	국고 19-8	740	회사채 180	회사채 800	
국고3Y	2.932%	-2.8	26.03.10	국고 21-1	-315	공사채 2,200		
국고10Y	3.077%	-2.4	54.03.10	국고 24-2	-373			
국고10Y-3Y	14.5	0.4	25.06.10	국고 22-4	-1,250			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.90	4.82	4.86	0.00	O/N	4.88	4.83	4.86	0.00
TN	4.91	4.83	4.87	0.00	TN	4.88	4.83	4.86	0.00
1W	4.95	4.85	4.90	0.00	1W	4.92	4.85	4.90	0.00
1S	4.99	4.89	4.94	-0.01	1S	5.05	4.95	5.00	0.00
3S	5.05	4.90	4.97	-0.01	3S	5.05	4.90	5.00	0.00
6S	4.80	4.65	4.72	0.02	6S	4.80	4.60	4.74	-0.01
1YR	4.65	4.35	4.53	-0.02	1YR	4.60	4.40	4.50	-0.10

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	5.10	-0.01	3.50	4.83000	1M MAR	-220	-214
TN	-7/-5	-6	5.10	-0.14	3.50	4.82964	1W*1S	-180	-170
1W	-53/-49	-51	5.45	-0.16	3.50	4.82747	1*2	-215	-195
1S	-240/-230	-235	5.46	-0.11	3.49	4.81842	1*3	-485	-465
3S	-740/-720	-730	5.58	-0.09	3.48	4.63668	1*6	-1010	-970
6S	-1290/-1230	-1260	5.31	-0.04	3.42	4.39184	1*9	-1530	-1490
1YR	-2260/-2160	-2210	4.93	-0.02	3.25	4.04788	1*12	-1970	-1910

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)

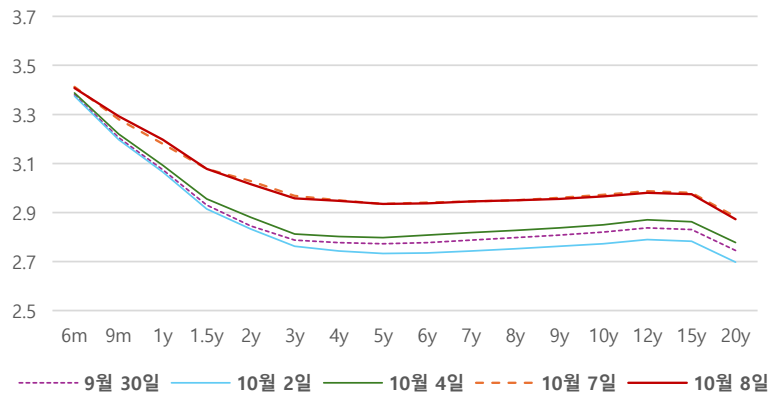
IRS 데일리 증가

10월 8일

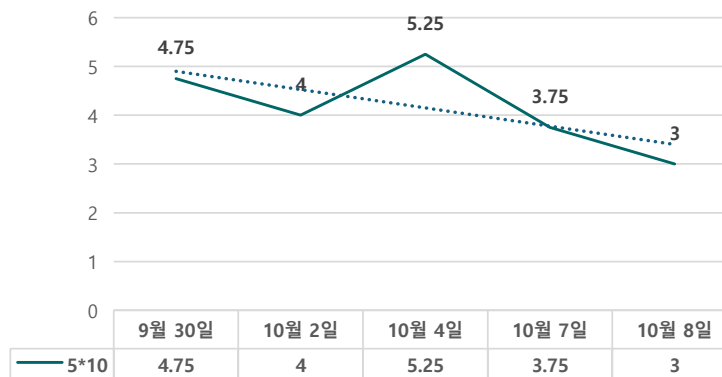
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.4075	-0.50
9m	3.2925	1.25
1y	3.1975	1.75
1.5y	3.0775	0.00
2y	3.0150	-1.25
3y	2.9575	-1.00
4y	2.9475	-0.25
5y	2.9350	0.00
6y	2.9375	-0.25
7y	2.9450	0.00
8y	2.9500	0.00
9y	2.9550	-0.50
10y	2.9650	-0.75
12y	2.9800	-0.75
15y	2.9750	-0.50
20y	2.8725	-1.00

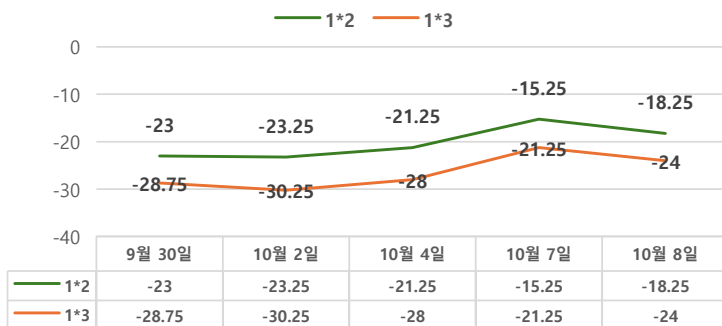
IRS 증가



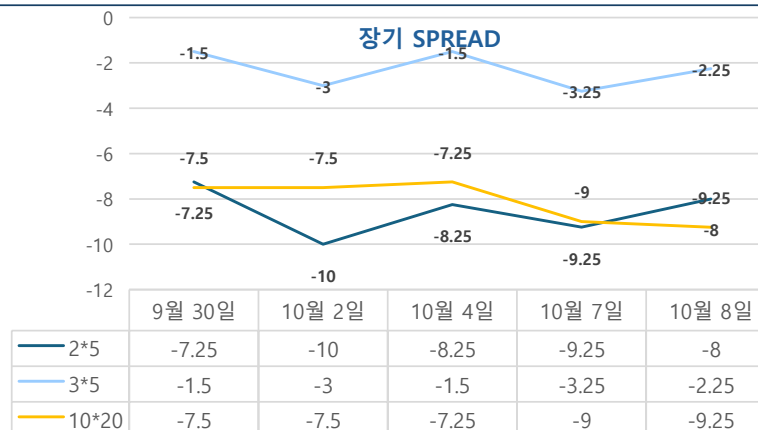
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

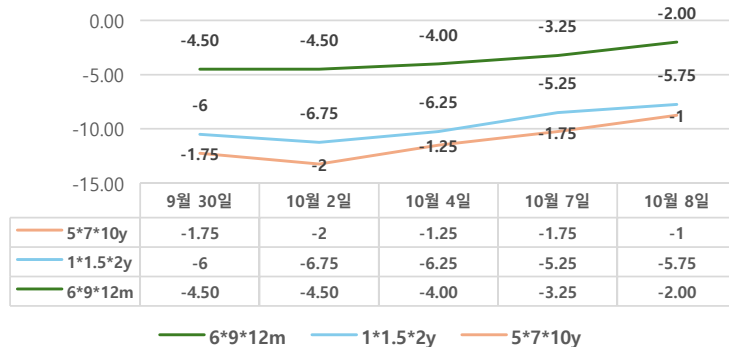


IRS 주요 커브

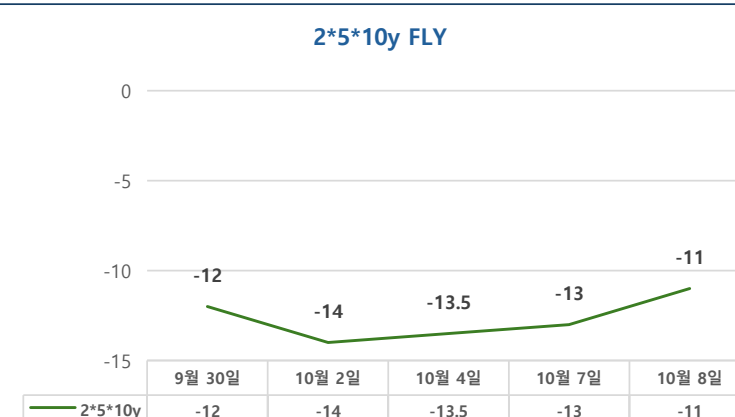
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-18.25	-3.00
1*3y	-24.00	-2.75
2*5y	-8.00	1.25
3*5y	-2.25	1.00
5*10y	3.00	-0.75
10*20y	-9.25	-0.25

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.00	1.25
1*1.5*2y	-5.75	-0.50
2*5*10y	-11.00	2.00
5*7*10y	-1.00	0.75