

Market Daily Report

2024.11.12(화)



레포	국고여유자금 환수 및 원천세 납부 관련 환매 영향으로 금리 소폭 상승했으나 은행권 매수 증가하여 조달여건 양호하였음. 장 중 증권사 매도 일부 저금리 매칭되기도 했으나 막판 체결금리 3.27% 수준으로 회귀했고, 회사채 소화 쉽지 않았음.
채권	한국 : 국채금리는 중단기 구간 위주로 상승 마감. 지난주 빅 이벤트였던 미 대선을 소화한 이후 대외금리에 연동된 장세가 이어짐. 특별한 재료가 부족한 상황에서 당분간 미 금리에 연동되는 움직임이 계속 나올 것으로 전망. 미국 : 미 국채 시장, '재향군인의 날'을 맞아 휴장. 영국과 독일 등 주요국 장기국채 수익률은 하락.
MONEY	금일 '재향군인의 날(Veteran's Day)' 뉴욕 휴장으로 머니 시장은 한산한 장세 속, 국내 이체 스물 거래 된 후 마감 (4.50-4.53 수준). 역외에서 탐내는 4.65 수준에 비드 형성되며 1주 4.65-4.68 2주 4.65-4.70 1개월물 4.68-4.73 사이로 대만계 & 중국계 & 말레이계 등 역외 위주로 체결. 연말 커버 구간은 온 & 오프 2개월물 4.80% 오피 제시되며 체결 되었고, 아직 중국계 은행들의 차입 수요가 적극적이지 않아 레벨 변동은 제한적임. 지난 주부터 상승세를 보였던 유럽계 굿네임 비드가 4.60 근접 수준까지 오르면서 아시아장에서도 1년물 오피 금리도 4.60%대 수준으로 제시하며 sofr 대비 스프레드는 38-40bp 사 이로 형성 중.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 트럼프 미 대통령 당선에 따른 미국 국채금리 상승과 국내 증시 약세 여파로 장기를 위주로 하락하는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 60전 하 락한 -24.80원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 20전 하락한 -12.50원의 증가를 기록함. 트럼프 자기 행정부의 미국 우선주의에 대한 우려로 외국인인 국내 증시에서 6,000억원 이상의 순매도를 기록하며 커스터디 매수세가 강했고 전반적인 외화 자금시장에서 원화 약세가 이어짐. 장기물은 그간 선반영 되었던 미국 금리 인하의 되돌림 영향으로 외국은행들 의 달러 공급이 이어졌던 단기물에서보다 더 큰 하락폭을 보임.
IRS	전일 irs는 변동성을 줄만한 재료가 부족한 가운데 국채선물과 연동되며 소폭 상승 마감. 초반에는 2년이 98/97.5에서 98에 거래되었고 이후 한동안 한산한 분위기를 보이다 오후에 5년이 91.5/90.5로 대치를 이뤘고 10년이 93.5에 초이스를 이루다 거래가 이뤄짐. 또한 1 년 비드가 올라오며 13.75에 초이스를 이루다 거래되었고 1년 비드가 다소 많아 보였음. 막판에는 1년 비드가 14.25로 올라오며 2년 98.75 오피와 역인 1*2년이 -15.5에 거래가 이뤄졌고 2*10년 비드가 -4.75로 올라와 2년 비드와 10년 오피가 레깅되어 2년과 10년이 사이 즈 초이스를 이루다 2년은 98.5, 10년은 93.75에 거래되며 2*10년은 -4.75에 거래됨. 마감 이후에는 계속해서 대치중이던 15*20년이 오피가 내려오며 nd로 -16에 거래되었고 1*1.5 년 비드가 나오며 -10.25에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	클금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		
2024.11.05(화)	214.4	200.6	3.23%	3.192%	3.25%	3.44%	2년물	4.256%	0.0
2024.11.06(수)	214.7	201.4	3.23%	3.236%		3.44%	5년물	4.193%	0.0
2024.11.07(목)	214.2	200.9	3.24%	3.258%		3.43%	10년물	4.307%	0.0
2024.11.08(금)	214.6	198.3	3.25%	3.273%		3.43%	30년물	4.471%	0.0
2024.11.11(월)	215.6		3.27%	3.277%		3.43%	10Y-2Y	5.1	0.0

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종요가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,531.66	-29.49	27.06.10	국고 24-4	731	여전채 9,380	은행채 7,000	국고채 2년 6,000억원 입찰
KOSDAQ	728.84	-14.54	25.02.11	통안채	300	회사채 330	여전채 5,800	
달러-원	1,401.00원	4.00원	42.09.10	국고 22-11	300	통안채 3,900	회사채 1,480	
국고3Y	2.901%	1.2	25.09.10	국고 23-8	-500	공사채 8,600	통안채 5,000	
국고10Y	3.038%	-1.1	24.12.10	국고 21-10	-800		공사채 1,600	
국고10Y-3Y	13.7	-2.3	34.06.10	국고 24-5	-1,015			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	증가	전일대비	기간	증가	전일대비	기간	증가	전일대비	
O/N	4.55	4.47	4.51	-0.04	O/N	4.55	4.47	4.51	-0.09
T/N	4.61	4.53	4.57	0.00	T/N	4.63	4.58	4.60	-0.03
1W	4.70	4.60	4.65	0.00	1W	4.70	4.60	4.65	0.00
1S	4.75	4.65	4.70	0.00	1S	4.75	4.65	4.70	0.00
3S	4.84	4.74	4.79	0.00	3S	4.85	4.75	4.80	0.00
6S	4.75	4.60	4.68	0.01	6S	4.80	4.65	4.73	0.00
1YR	4.67	4.47	4.57	-0.03	1YR	4.70	4.50	4.59	-0.01

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
T/N	-3/-1	-2	3.77	0.26	3.25	4.82000	1M MAR	-132	-128
S/N	-3/-1	-2	3.76	-0.53	3.25	4.81322	1W*1S	-102	-98
1W	-29/-25	-27	4.24	-0.08	3.25	4.77251	1*2	-253	-247
1S	-135/-125	-130	4.43	-0.01	3.30	4.61648	1*3	-465	-455
3S	-610/-590	-600	5.11	0.01	3.40	4.51617	1*6	-1100	-1090
6S	-1280/-1220	-1250	5.23	0.03	3.40	4.40107	1*9	-1720	-1680
1YR	-2530/-2430	-2480	5.10	0.03	3.25	4.21872	1*12	-2325	-2300

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)

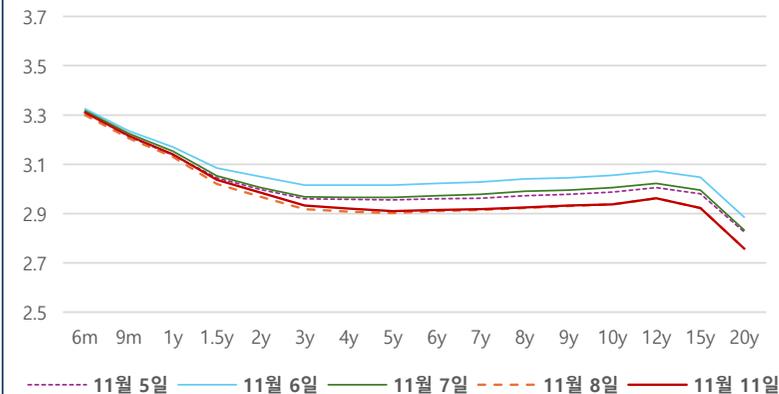
IRS 데일리 증가

11월 11일

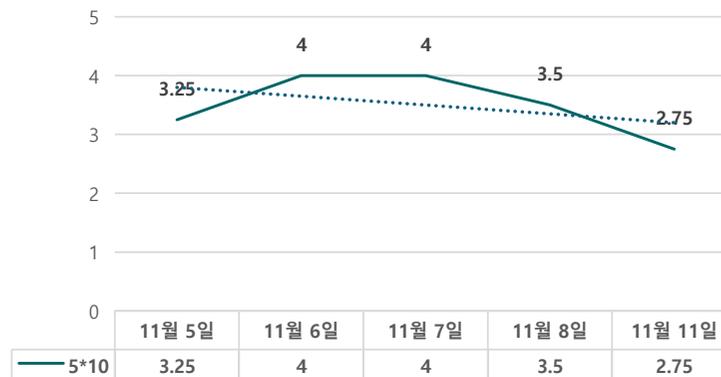
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3100	1.00
9m	3.2150	1.00
1y	3.1400	1.00
1.5y	3.0375	1.75
2y	2.9850	1.75
3y	2.9325	1.50
4y	2.9200	1.25
5y	2.9100	0.75
6y	2.9150	0.50
7y	2.9175	0.25
8y	2.9250	0.25
9y	2.9325	0.25
10y	2.9375	0.00
15y	2.9225	0.00
20y	2.7575	0.00

IRS 증가



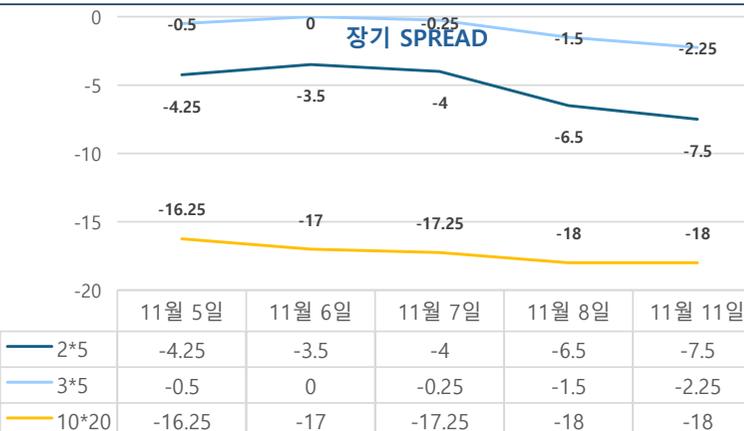
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

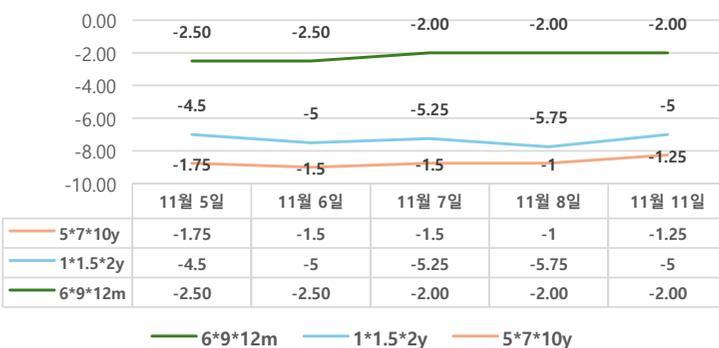


IRS 주요 커브

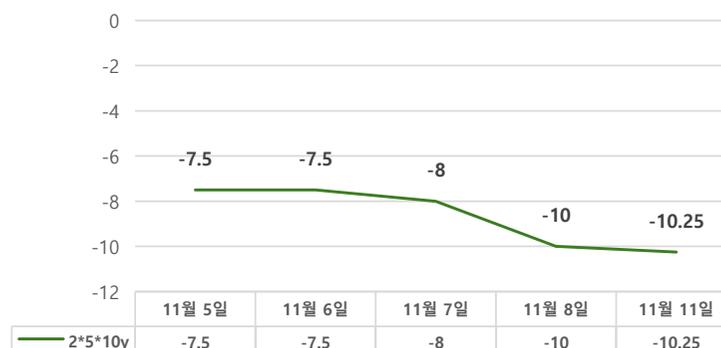
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-15.50	0.75
1*3y	-20.75	0.50
2*5y	-7.50	-1.00
3*5y	-2.25	-0.75
5*10y	2.75	-0.75
10*20y	-18.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.00	0.00
1*1.5*2y	-5.00	0.75
2*5*10y	-10.25	-0.25
5*7*10y	-1.25	-0.25