

Market Daily Report

2024.11.15(금)



레포	건보자금 유입되어 조달여건 호전되었으며, 장 중 매수 자금 꾸준히 유입되어 일반채 소화 원활하였음. 증권사 저금리 매도 간헐적으로 체결했으나 금리 낙폭 크지 않았고, 회사채 정체 오후에 해소되었음.
채권	한국 : 국채금리는 중단기 금리 하락, 장기금리 상승 마감. 큰 틀에서 미 국채금리와 연동하는 양상. 단기 구간을 중심으로 나타난 탄탄한 현물 수요도 이같은 추세에 힘을 보탬. 미국 : 미 국채금리는 혼조세를 보이며 2,5년물은 상승, 10,30년물은 하락. 파월 의장이 인플레이션을 집중적으로 거론하며 금리인하를 서두를 필요가 없다고 말하자 단기를 가격이 급락. PPI는 MoM 0.2% 상승으로 예상치는 부합했으나 전월대비 상승. 근원 PPI는 MoM 0.3% 상승으로 예상치와 전월치를 모두 상회. 특히 연준이 통화정책의 준거로 삼는 PCE 가격 지수에 포함되는 서비스가격이 PPI를 밀어올린 만큼 연준의 금리인하 경로 재설정 가능성이 급부상. 한편 미국에서 한 주간 신규 실업보험 청구자수는 계절조정 기준 직전주보다 4천명 감소한 21만 7천명으로 집계.
MONEY	단기 차입 불륨이 큰 대만계 중심으로 3달 이하의 기간물 구간 위주로 시장 상승세 이어짐. o/n 4.60대 후반, 위크 구간 4.70대 초중반, 1달 구간도 4.80 레벨 근방으로 유지 되는 모습. 특히 내년 1월~2월 만기의 2달~3달 연커버 구간으로는 4.90대 레벨로 본격 진입 하면서 마켓 레벨 상승 견인 하고 있음. 단기 차입에 몰두 되면서, 그간 비중국계한테로 일부 제시 되었던 3달 이상의 대만계 장기 운용은 제한 되어 가는 중이며, 중국계 타깃으로 마켓에 제시 되고 있는 6달 4.80~4.85, 1년 4.70~4.75 운용 레벨선에 맞춰 장기 차입 또한 네임별로 점차 상승 조율 되어 가는 중임.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 역외 비드가 지속되면서 전 구간에서 강세 흐름이 계속됨. 1년 만기물의 증가는 전장보다 70전 상승한 -24.20원에 형성됐고 6개월 만기물은 전장보다 30전 상승한 -4.95원의 증가를 기록함. 6개월과 1년 만기물의 거래일수가 전일보다 각각 3일과 2일이 감소한 영향도 있으나 거래일수 보정 시에도 장기물에서 스와프포인트가 강세 흐름을 보임. 전반적으로 역외 비드가 강하게 나오면서 외화 자금시장 내 달러 유동성이 풍부한 상황이 지속되고 있으나 대외 재료가 아닌 수급에 의한 장세라는 점에서 향후 스와프포인트 강세가 지속될지 여부는 미지수인 것으로 예상됨
IRS	전일 irs는 미국채 시장 흐름에 동조하는 분위기 속에 소폭 하락 및 보합 마감하며 커브가 스티플. 초반에는 초장기쪽 호가가 나오며 15*20년 비드는 -15.5까지 올라왔고 국채선물 움직임과 연동되어 1년이 17.25/17에서 17에 거래가 이뤄짐. 2년이 2.5에 몇차례 거래되었고 2년 비드와 1*2년 -14.25 오퍼가 섞인 1년이 16.75에 거래가 이뤄짐. 오후에는 1*2년이 -15에 거래가 이뤄졌고 1.5*2년 -4.75/-5로 대치를 이루다 -5에 nd로 거래됨. 12*20년 오퍼가 꾸준히 내려오며 한때 -20.5에 d/nd로 초이스를 이뤘다 거래됨. 막판에는 6개월이 32.5/32.25에서 32.25에 거래되었고 1년은 16에 거래됨. 또한 5*10년 오퍼는 3.5에, 1*1.5*2년 오퍼는 -4.75로 내려왔고 3년 비드는 95.75로 올라왔고 마감 이후에는 10년 오퍼가 97.5로 나눔.

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
2024.11.08(금)	214.6	198.3	3.25%	3.273%	3.25%	3.43%	2년물	4.349%	5.9
2024.11.11(월)	215.6	196.3	3.27%	3.277%		3.43%	5년물	4.326%	1.8
2024.11.12(화)	216.4	196.9	3.27%	3.273%		3.44%	10년물	4.439%	-1.5
2024.11.13(수)	217.6	199.7	3.27%	3.276%		3.44%	30년물	4.588%	-5.0
2024.11.14(목)	217.5		3.26%	3.266%		3.44%	10Y-2Y	9.0	-7.4

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	2,418.86	1.78	25.11.09	통안채	650	회사채 600	은행채 1,000	국고채 50년 6,000억원 입찰
KOSDAQ	681.56	-8.09	54.09.10	국고 24-8	425	공사채 6,375	여전채 1,600	
달러-원	1,402.50원	5.00원	53.03.10	국고 23-3	362		회사채 901	
국고3Y	2.929%	-1.0	31.06.10	국고 21-5	-500		공사채 6,106	
국고10Y	3.074%	0.7	25.03.10	국고 23-3	-500			
국고10Y-3Y	14.5	1.7	25.01.27	통안채	-2,000			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.55	4.47	4.52	-0.02	O/N	4.65	4.58	4.60	0.00
T/N	4.60	4.52	4.56	0.00	T/N	4.65	4.58	4.62	0.00
1W	4.73	4.63	4.68	0.00	1W	4.66	4.56	4.63	-0.01
1S	4.76	4.66	4.72	0.00	1S	4.75	4.65	4.71	-0.02
3S	4.88	4.78	4.83	0.00	3S	4.86	4.76	4.82	0.00
6S	4.88	4.73	4.78	0.03	6S	4.83	4.63	4.78	0.03
1YR	4.80	4.60	4.70	0.03	1YR	4.75	4.55	4.70	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	-5/-1	-3	4.02	-0.25	3.25	4.60000	1M MAR	-88	-84
T/N	-9/-5	-7	3.85	0.09	3.25	4.60031	1W*1S	-80	-75
1W	-21/-15	-18	3.91	-0.07	3.25	4.60217	1*2	-225	-215
1S	-105/-95	-100	4.16	-0.01	3.30	4.60929	1*3	-400	-390
3S	-505/-485	-495	4.79	-0.13	3.40	4.52346	1*6	-1030	-1010
6S	-1180/-1120	-1150	5.06	-0.05	3.40	4.44343	1*9	-1680	-1660
1YR	-2470/-2370	-2420	5.06	-0.01	3.27	4.31679	1*12	-2300	-2250

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)

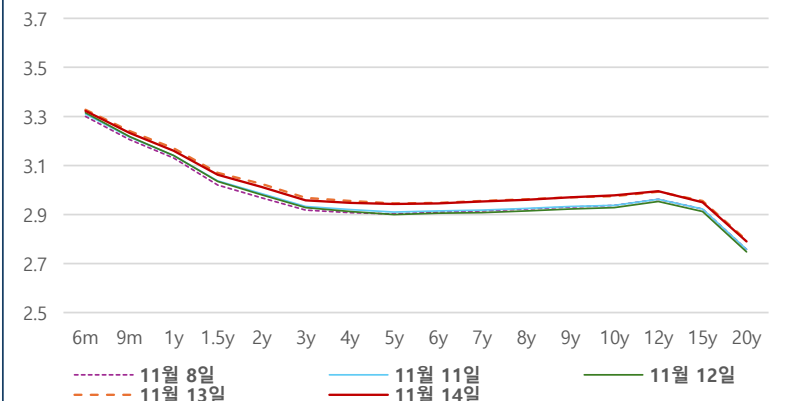
IRS 데일리 증가

11월 14일

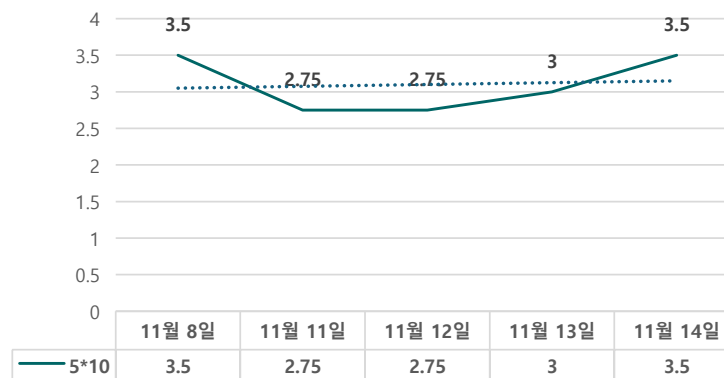
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3225	-0.50
9m	3.2325	-0.75
1y	3.1600	-1.00
1.5y	3.0625	-0.75
2y	3.0125	-1.25
3y	2.9575	-1.00
4y	2.9475	-0.75
5y	2.9425	-0.25
6y	2.9450	-0.25
7y	2.9525	-0.25
8y	2.9600	-0.25
9y	2.9700	0.00
10y	2.9775	0.25
15y	2.9500	-0.50
20y	2.7900	-0.50

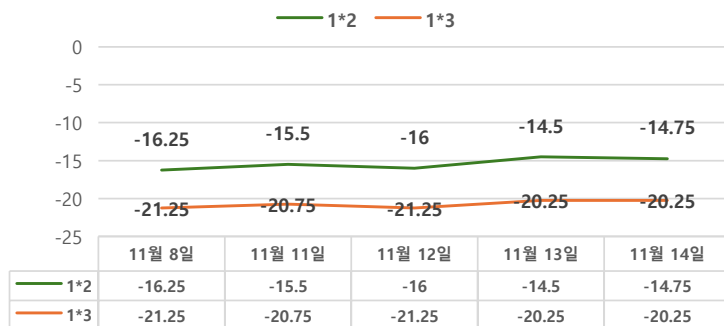
IRS 증가



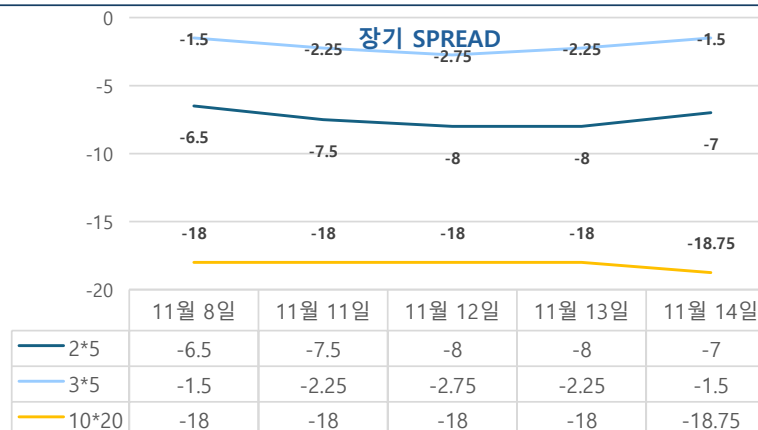
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

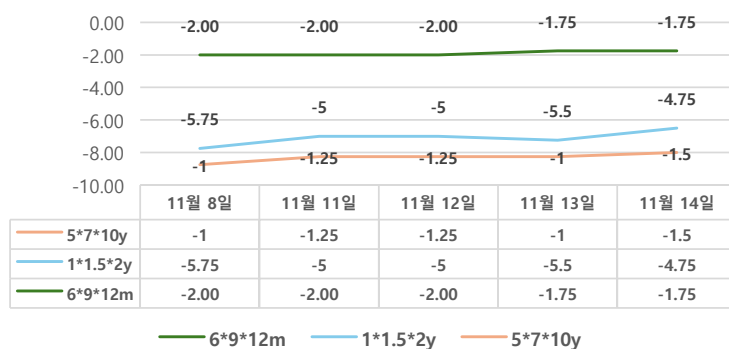
구분	증가	전일대비
1*2y	-14.75	-0.25
1*3y	-20.25	0.00
2*5y	-7.00	1.00
3*5y	-1.50	0.75
5*10y	3.50	0.50
10*20y	-18.75	-0.75

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.75	0.00
1*1.5*2y	-4.75	0.75
2*5*10y	-10.50	0.50
5*7*10y	-1.50	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY

