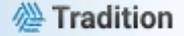


Market Daily Report



2024.11.19(화)

레포	지방소비세 유입되어 당일잔액 양전환 했으며, 운용사 및 신탁 운용성 풍부하여 금리 소폭 하락하였음. 조달여건 양호한 가운데 장 중 잉여 분위가 형성됐으나 오후에 증권사 추가 매도 이어져 금리 낙폭 크지 않았음.
채권	한국 : 국채금리는 하락 마감. 외국인인 국채선물을 대거 사들이면서 강세 압력을 가세한 데 영향을 받음. 전 거래일 미국 중단기 금리 하락도 강세 재료로 작용. 미국 : 미 국채금리는 혼조 속 모두 하락 마감. 시장을 좌우할 이벤트는 없었던 가운데 10년물 금리는 다시금 4.5% 저항선 돌파를 시도했으나, 저가 매수세 유입으로 금리는 하락. 다음 달 FOMC 이전까지 굵직한 이벤트가 많지 않아 미 국채금리는 단기적으로 4.5% 선을 두고 공방을 벌일 전망이다. 한편 전미주택건설협회(NAHB) 11월 주택시장지수는 46으로 전월(43)대비 상승, 시장 예상치(44)도 상회. 주택건설업 경기 체감도의 기준선인 50에는 여전히 못 미쳤으나 7개월만의 최고치를 기록.
MONEY	지속되는 1주~1달 단기 차입세 분위기 속에, 3달 구간까지 상승세 영향 받으면서 마켓 체결 이어짐. 특히, 지난주에 내년 초 만기 구간인 2달~3달 대만계 4.90~4.95 레벨 마감 후, 오늘 5.00 레벨선까지 일부 터치되면서, 연커버 구간 2달은 5.00, 3달은 4.95~4.98 까지 마켓 체결 리프트 됨. 중국계는 2달 구간 중심으로 4.80~4.83 레벨 선에 펀딩 수요 몰림. 하루짜리의 경우 대만계 4.60 후반, 중국계 및 말레이시아계 4.60 초반, 온소 4.50대로 네임에 따라 금리대가 각각 상이하게 형성 되는 중이며, 한국계 및 온소는 다른 네임에 비해 상대적으로 초단기 구간 안정적이고 낮은 수준 유지 되고 있는 중.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 1년 만기물을 제외하고 전장과 마찬가지로 대부분의 만기에서 하락세가 지속됨. 1년 만기물의 증가는 전장보다 20전 상승한 -24.60원을 형성했고 6개월 만기물은 전장보다 10전 하락한 -12.00원의 증가를 기록함. 외화 자금시장에서 되돌림의 성격으로 소폭 상승한 1년 만기물을 제외한 대부분의 만기물은 전일과 마찬가지로 하락함. 다만 네고 물량 유입이나, 역외 NDF 매도세가 동반된 하락이 아닌 그간 상승분에 대한 일시적인 되돌림으로 보이며 금일 대두된 롯데그룹 유동성 위기가설이 스와프포인트 방향성에 영향을 줄 것인지는 미지수인 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 변동성을 줄만한 특별한 재료가 없는 가운데 대체로 대외 금리와 연동되어 소폭 하락 마감. 초반에는 3년 비드가 나오며 95.25-95.5에 거래가 이뤄졌고 4년이 94에 거래됨. 이후에는 한동안 한산한 분위기를 보이다가 1.5*3년 비드가 -10.5까지 올라왔고 4년 비드가 꾸준히 나오는 모습을 보이며 94/93.75로 대치를 이루다 93.75에 거래됨. 막판에는 1년과 10년 오퍼가 강하게 15, 95.5에 내려왔고 9개월 오퍼도 내려와 22.5에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 5년 비드가 93.25로 나왔고 미국채 움직임과 연동되며 1*1.5년 비드가 올라와 -9.5/-9.75를 이루다 d.ndro -9.75에 몇 차례 거래되는 모습을 보임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.11.12(화)	216.4	196.9	3.27%	3.273%	3.25%	3.44%	2년물	4.282%	-2.5
2024.11.13(수)	217.6	199.7	3.27%	3.276%		3.44%	5년물	4.278%	-3.1
2024.11.14(목)	217.5	200.8	3.26%	3.266%		3.44%	10년물	4.416%	-2.5
2024.11.15(금)	217.6	201.7	3.26%	3.264%		3.44%	30년물	4.611%	-0.8
2024.11.18(월)	217.4		3.25%	3.267%		3.44%	10Y-2Y	13.4	0.0

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,469.07	52.21	25.02.18	통안채	3,200	여전채 50억	은행채 600억	국고채 30년 4,000억원 교환 입찰
KOSDAQ	689.55	4.13	25.06.10	국고 22-4	1,000	회사채 50억	여전채 1,000억	통안채 20,000억원 조기환매
달러-원	1,393.50원	-6.00원	29.12.10	국고 19-8	901	통안채 6,600억	통안채 5,000억	
국고3Y	2.915%	-2.6	27.06.10	국고 17-3	-470	공사채 800억	공사채 8,300억	
국고10Y	3.063%	-2.1	27.03.10	국고 07-3	-630			
국고10Y-3Y	14.8	0.5	24.12.24	통안채	-650			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
O/N	4.54	4.46	4.51	0.00	O/N	4.65	4.58	4.60	0.00
T/N	4.56	4.48	4.53	-0.01	T/N	4.65	4.58	4.62	0.00
1W	4.73	4.63	4.67	0.01	1W	4.68	4.58	4.65	0.02
1S	4.76	4.66	4.72	0.01	1S	4.75	4.65	4.70	0.00
3S	4.90	4.75	4.83	0.00	3S	4.86	4.76	4.82	0.00
6S	4.80	4.65	4.73	0.00	6S	4.80	4.65	4.72	0.00
1YR	4.73	4.53	4.65	-0.02	1YR	4.72	4.52	4.65	-0.03

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-4	-6	4.80	0.35	3.25	4.58000	1M MAR	-142	-136
T/N	-7/-3	-5	4.54	0.26	3.25	4.58102	1W*1S	-105	-95
1W	-35/-29	-32	4.43	0.07	3.25	4.58711	1*2	-210	-205
1S	-150/-140	-145	4.55	0.17	3.30	4.61045	1*3	-412	-400
3S	-560/-540	-550	4.97	0.05	3.41	4.49113	1*6	-1050	-1030
6S	-1230/-1170	-1200	5.17	0.03	3.42	4.39191	1*9	-1680	-1650
1YR	-2510/-2410	-2460	5.10	0.00	3.27	4.24243	1*12	-2290	-2270

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)

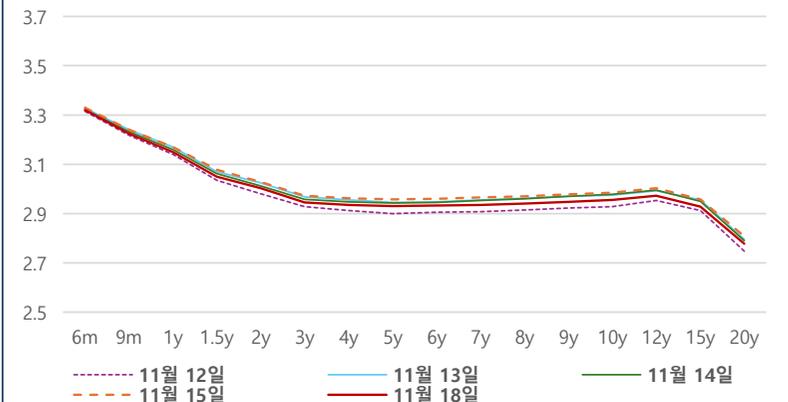
IRS 데일리 증가

11월 18일

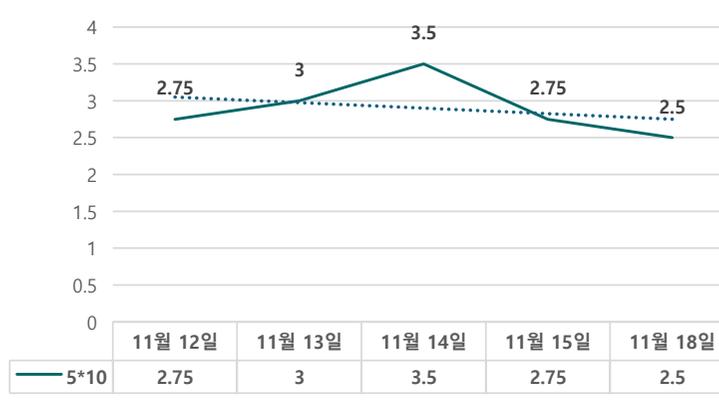
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3200	-1.00
9m	3.2250	-1.50
1y	3.1500	-2.00
1.5y	3.0500	-2.75
2y	3.0025	-2.50
3y	2.9450	-2.75
4y	2.9350	-2.75
5y	2.9300	-2.75
6y	2.9325	-2.75
7y	2.9350	-3.00
8y	2.9400	-3.00
9y	2.9475	-3.00
10y	2.9550	-3.00
15y	2.9275	-3.00
20y	2.7775	-3.00

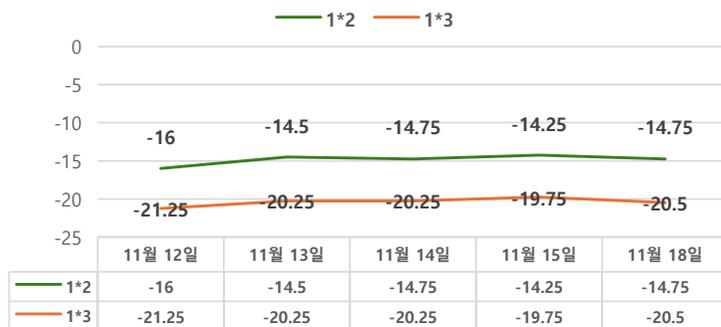
IRS 증가



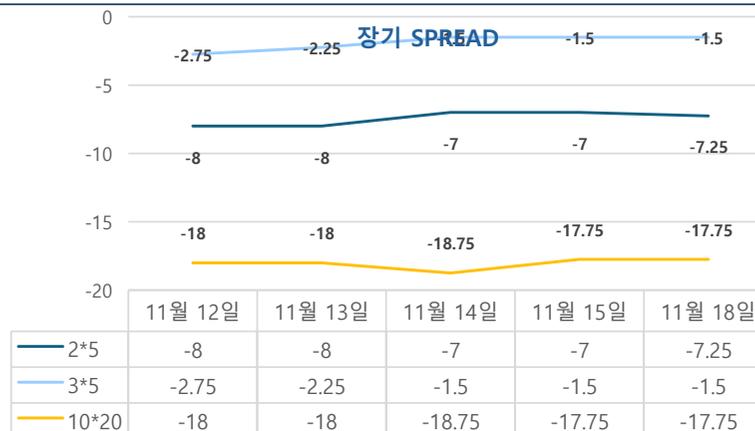
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

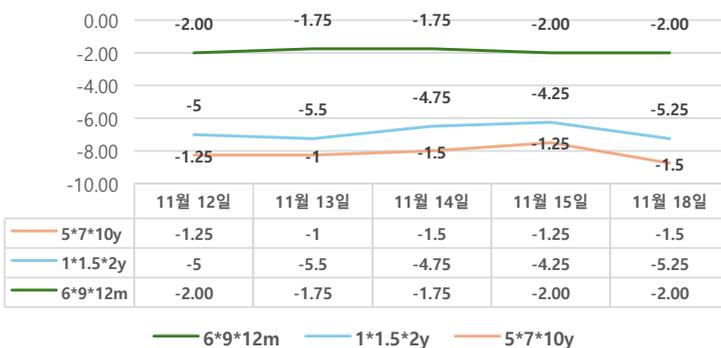


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.75	-0.50
1*3y	-20.50	-0.75
2*5y	-7.25	-0.25
3*5y	-1.50	0.00
5*10y	2.50	-0.25
10*20y	-17.75	0.00

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.00	0.00
1*1.5*2y	-5.25	-1.00
2*5*10y	-9.75	0.00
5*7*10y	-1.50	-0.25

2*5*10y FLY

