

# Market Daily Report



2024.11.26(화)

<b>레포</b>	별다른 자금 개선요인 없었으나 장 초반부터 시중은행 매수에 적극적으로 나서 전일보다 조달여건 호전되었음. 일부 증권사 저금리 매도 대기했으나 장 중 추가 자금 유입 크지 않아 대부분 시작금리 수준에서 매칭되었음.
<b>채권</b>	한국 : 국채금리는 하락 마감. 미 재무장관 소식에 미 국채금리가 급락하면서 강세 분위기를 조성. 오는 28일 금융통화위원회를 앞두고 금리 인하 기대감이 커진 점도 강세 요인으로 작용. 외국인은 3년 국채선물 대규모 매수세를 이어감. 미국 : 미 국채금리는 모두 하락 마감. 이날 10년물 금리의 하락폭은 8월 2일 이후 최대. 신임 재무부 장관으로 스킷 베센트가 낙점되자 투자자들이 '트럼프 트레이드'를 빠르게 되돌리는 양상. 베센트는 기본적으로 '재정 매파'로 분류되어 재정감축에 나올 것이라는 분석이 우세해지자 금리는 하락. 이날 미국 재무부의 690억 달러 규모 2년물 국채입찰에서 앞선 6번의 입찰 평균치인 2.62%를 웃도는 2.77%의 응찰률을 보이며 강한 수요를 보인 점도 금리 하락 압력을 더함.
<b>MONEY</b>	월말 주간으로 초단기 자금 수요에 FX 스왑은 하루물 장중 -6전까지 거래되며, 그간 환율 상승 및 외국인 국내 주식 매도에 은행권 예금 인출량도 늘고, 월말 자금 수요 증가에 초단기 자금 잉여분도 감소 추세. 대만계 은행들의 월마감 워크를 편입을 전주에 대거 매칭하면서 금일 워크물 시장 차입 비드가 많지 않아 레벨은 1주물 4.80-4.81 수준에 마무리 되며 마감됨. 중국계 본토 및 홍콩쪽 오피는 꾸준히 시장에 제시되면서 중국계 은행들의 워크물 레벨은 1주 4.63-4.65 2주 4.65-4.68 & 기간물 3s 4.83-4.85 6s 4.70 1yr 4.60 수준에 꾸준히 체결되고 있음. 마켓 장기 렌더인 대만계 은행들의 연말 커브 3개월물 4.95 수준에 차입 물량이 늘어나면서 장기를 렌딩 부재 속, 한국계 은행들의 장기를 차입 금리는 6개월물-1년물 위주로 상승세를 보이고 있음.
<b>FX SWAP</b>	금일 외환 스와프포인트는 1년 만기물을 제외하고 대부분 구간에서 강세를 보임. 1년 만기물의 증가는 전장보다 30전 하락한 -25.60원에 형성됐으나 6개월 만기물은 전장보다 30전 상승한 -11.90원의 증가를 기록함. 3개월과 1개월 만기물 역시 각각 전장보다 25전,10전 상승한 증가를 기록하며 단기 원화 자금 수요로 인한 스와프포인트 상승세가 나옴. 1년 만기물의 경우 한국은행 금융통화위원회에서 금리 동결 예상이 지배적이었던 것과 달리 금리 인하 가능성이 대두되면서 미국과 한국의 정책 금리 전망 변화로 소폭 하락함.
<b>IRS</b>	금일 IRS는 이번주 예정된 금융통화위원회(금통위)가 비둘기파적일 것이라 기대가 커지고 있는 분위기 속에서 하락 마감 전반적으로 고요한 모습을 보였으며 장 초반에는 5년쪽으로 호가가 형성되면서 80에 거래가 이뤄졌고, 2년이 87.5에 거래된 후 88/87.5에 대치가 이뤄짐 오후들어 국채선물이 소폭 강해지면서 전체적인 레벨이 연동되어 움직였으며 9*12개월과 레깅으로 엮여 9개월이 00에 거래가 이뤄짐 이후 9개월과 1년 오피가 다소 강하게 내려왔으며, 장 막판에 10년 오피가 나오면서 82에 거래가 이뤄짐 이후 3년이 81.25/81에 대치되다 81에 거래가 이뤄짐

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	플금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		
2024.11.19(화)	218.5	202.3	3.25%	3.262%	3.25%	3.44%	2년물	4.275%	-10.4
2024.11.20(수)	219.2	201.8	3.24%	3.266%		3.44%	5년물	4.178%	-11.9
2024.11.21(목)	221.2	200.2	3.26%	3.271%		3.44%	10년물	4.278%	-12.7
2024.11.22(금)	223.4	199.1	3.28%	3.285%		3.44%	30년물	4.467%	-12.2
2024.11.25(월)	226.2		3.28%	3.290%		3.44%	10Y-2Y	0.3	-2.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,534.34	33.10	25.02.25	통안채	1,500	은행채 5,300	은행채 4,900	국고채 20년 3,000억원 입찰
KOSDAQ	696.83	19.82	25.08.22	중금채	600	여전채 6,500	여전채 2,800	
달러-원	1,399.00원	-7.40원	29.03.10	국고 24-1	400	회사채 250	회사채 80	
국고3Y	2.773%	-4.3	28.09.10	국고 23-6	-4	통안채 8,000	통안채 5,000	
국고10Y	2.920%	-5.6	32.12.10	국고 22-14	-102	공사채 3,424	공사채 3,628	
국고10Y-3Y	14.7	-1.3	25.06.10	국고 22-4	-1,000			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.54	4.46	4.51	-0.03	O/N	4.63	4.55	4.60	0.00
T/N	4.56	4.48	4.53	-0.03	T/N	4.65	4.55	4.60	0.00
1W	4.71	4.61	4.66	-0.01	1W	4.70	4.60	4.64	-0.01
1S	4.75	4.65	4.71	0.00	1S	4.75	4.65	4.70	0.00
3S	4.92	4.77	4.85	0.02	3S	4.87	4.77	4.84	0.01
6S	4.90	4.75	4.80	0.04	6S	4.85	4.65	4.73	0.00
1YR	4.78	4.58	4.68	0.01	1YR	4.70	4.50	4.62	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-4	-5	4.53	0.59	3.25	4.57000	1M MAR	-138	-134
T/N	-3/-1	-2	3.76	-0.26	3.25	4.57062	1W*1S	-103	-95
1W	-29/-25	-27	4.24	-0.22	3.25	4.57432	1*2	-215	-205
1S	-140/-130	-135	4.46	-0.09	3.30	4.58850	1*3	-405	-395
3S	-545/-525	-535	4.92	-0.07	3.41	4.52094	1*6	-1040	-1010
6S	-1220/-1160	-1190	5.14	-0.04	3.41	4.43716	1*9	-1710	-1680
1YR	-2610/-2510	-2560	5.14	0.03	3.25	4.29958	1*12	-2400	-2350

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)

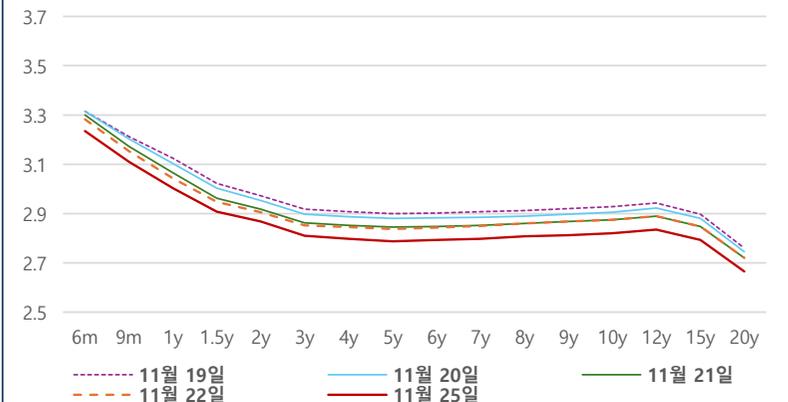
IRS 데일리 증가

11월 22일

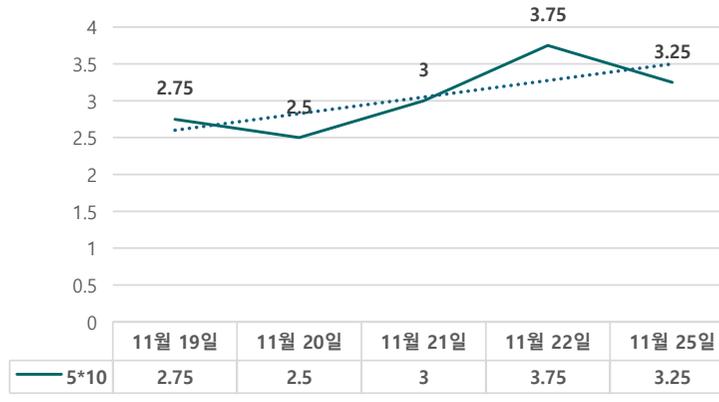
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2350	-4.75
9m	3.1100	-4.25
1y	3.0025	-4.00
1.5y	2.9075	-4.00
2y	2.8675	-3.75
3y	2.8100	-4.25
4y	2.7975	-4.75
5y	2.7875	-5.00
6y	2.7925	-5.00
7y	2.7975	-5.25
8y	2.8075	-5.25
9y	2.8125	-5.50
10y	2.8200	-5.50
12y	2.8350	-5.50
15y	2.7925	-5.50
20y	2.6650	-5.50

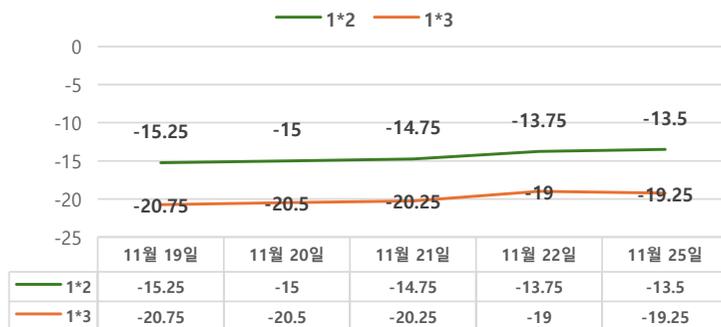
IRS 증가



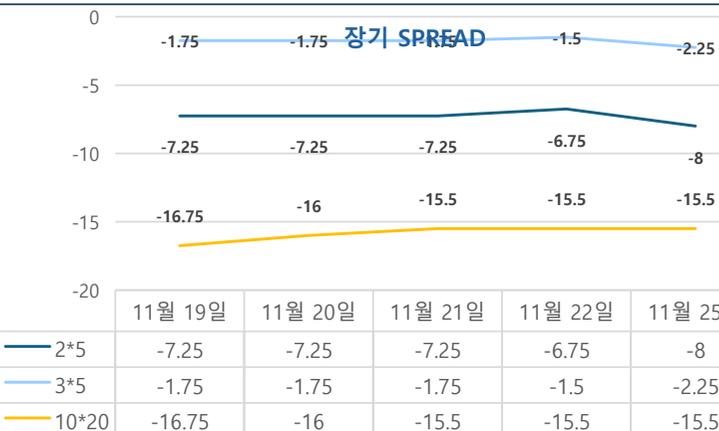
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

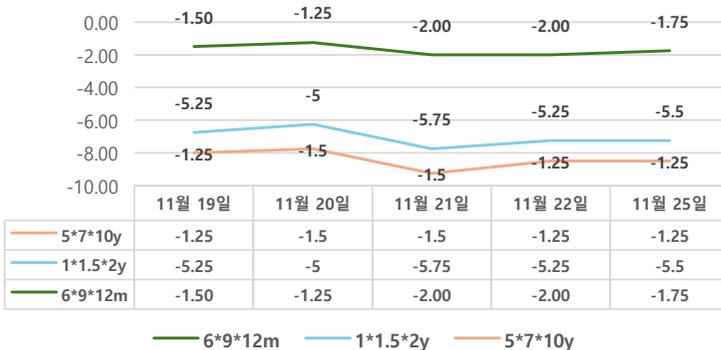
구분	증가	전일대비
1*2y	-13.50	0.25
1*3y	-19.25	-0.25
2*5y	-8.00	-1.25
3*5y	-2.25	-0.75
5*10y	3.25	-0.50
10*20y	-15.50	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.75	0.25
1*1.5*2y	-5.50	-0.25
2*5*10y	-11.25	-0.75
5*7*10y	-1.25	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY

