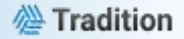


Market Daily Report

2024.12.31(화)



레포	한은RP매입 만기(14조) 도래했으나 연말 환대대기자금 운용과 은행권 매수에 힘입어 일반채 해소 원활하였음. 장 초반 매도 일부 정제됐으나 한은RP 재매입(9조, 8일물) 후 유동성 호전되어 오후에 무리 없이 해소되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 하락 마감. 약세 출발했지만 대체로 그 폭을 반납했고 장 후반에는 강세 전환. 외국인의 매도가 지속됐지만 단기적 저점 인식에 따라 장 후반 강세 압력이 나타남. 개장 전 발표된 올해 11월 공공업 생산은 시장 예상치(0.55% 감소)를 밑돌면서 전월보다 0.7% 감소. 미국 : 미국 국채 가격은 모두 상승 마감. 트레저리 10년물 금리는 4.5% 중반대로 후퇴. 뉴욕증시가 기술주 중심으로 약세를 이어간 가운데, 미국의 지역 제조업 협황이 예상보다 더 크게 악화했다는 소식이 나오면서 최근의 하락 흐름을 되돌림. 12월 시카고 구매관리자지수(PMI) 결과 미국 중서부 지방의 12월 제조업 활동은 예상과 달리 더 크게 위축된 것으로 나타남. 경기 위축 국면에 계속 머문 가운데 7개월 만의 최저치로 후퇴. 다만 연준이 내년 1월 금리를 동결할 것이라는 전망은 그다지 흔들리지 않고 있음. □
MONEY	본격 연 마감에 돌입하며, 1달 이하의 단기 구간 위주로 마켓 형성 함. 특히 연 이네 스타트 워크 구간 중심으로 운용세 물리면서, 투데이/탐 시작 1주 대만계 4.70~4.80 레벨을 시작으로, 중국계 4.50~4.60, 말레이계 4.60, 이외 포린 네임 4.35~4.45 각각 네임별로 레벨 형성. 이후 4.60~4.70 레벨에 오후에도 워크 오피 대기 되면서, 지난주와는 상반되게 마켓 단기 렌딩 적극적으로 나눔. 내일 보다 확실한 가닥이 잡히겠지만, 연커버의 탐넥 2일물 구간으로도 4.40~4.50 레벨선에 마켓 일부 오피 제시 되면서, 연말 큰 변동 없이 마감 될 분위기. 기간물 구간의 경우 일부 중국계 네임간 1달 4.62, 6달 4.63 정도만 체결 이어 지면서, 내년 1월 벨류의 장기 구간 레벨 형성은 조금 더 지켜 봐야 할 것으로 예상 됨.
FX SWAP	금일 외환 스와프포인트는 현물환 시장에서의 원화 약세에 맞춰 전반적으로 하락하는 모습을 보임. 1년 만기물의 증가는 -26.80원으로 전장보다 20전 상승했으나 6개월 만기물은 전장보다 30전 하락한 -12.60원의 증가를 기록했으며 3개월물과 1개월물 역시 전장보다 하락 마감함. 거래량이 많지 않았던 가운데 국내 정국 불안 이슈로 인한 현물환에서의 원화 약세가 외화자금시장에도 영향을 미친 것으로 보임. 단기물에서는 탐넥이 만기가 내년 1월 2일인 해를 넘어가는 기간으로 정규 장 마감 이후 +30전까지 거래가 되면서 수급의 영향을 강하게 받음. 내년 초에는 지속적인 달러 강세로 내년으로 이연된 네고 물량과 국내 정국 불안 이슈가 계속해서 외환 시장 변동성의 원인이 될 것으로 보이며 1월2일 오전에 있을 이창용 한국은행 총재의 신년사도 영향을 미칠 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 24년도 한국거래소 마지막 거래일로 연말 클로징 분위기와 함께 정치 불확실성으로 인한 경기 부진 우려로 단기쪽은 소폭 상승 및 나머지 구간에서는 하락 마감. 초반에는 12*15년 오피가 -4로 내려와 장기쪽 커브가 움직였으며 이후에 -4.5에까지 오피가 내려왔고 2*3년 비드가 -2.5로 나눔. 오후에는 2*3년 오피가 내려와 -2에 거래되었고 3년 이 71.75/71.5로 대치를 이루다 71.5에 거래가 이뤄짐. 막판에는 국제선물 움직임과 연동되어 3*7년 오피가 다소 강하게 내려와 3.5에 거래되었고 6*9개월 오피와 1.5년 오피가 -17, 77로 내려왔으며 1*1.5*2년 비드가 올라와 -5에 거래되었고 10년 오피가 77.5로 나눔.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	클금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준		
2024.12.23(월)	233.9	178.4	3.10%	3.103%	3.00%	3.39%	2년물 4.246%	-8.6
2024.12.24(화)	234.5	177.1	3.08%	3.067%		3.40%	5년물 4.361%	-10.3
2024.12.26(목)	237.0	174.7	3.08%	3.160%		3.40%	10년물 4.535%	-9.2
2024.12.27(금)	236.8	170.4	3.08%	3.100%		3.44%	30년물 4.752%	-6.7
2024.12.30(월)	236.9		3.08%	3.060%		3.44%	10Y-2Y 28.9	-0.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,399.49	-5.28	34.06.10	국고 24-5	1,671	지방채 4,231	지방채 3,734	
KOSDAQ	678.19	12.22	27.12.10	국고 24-12	1,360	공사채 917	은행채 2	
달러-원	1,472.30원	1.80원	33.12.10	국고 23-11	1,198		회사채 100	
국고3Y	2.597%	-3.7	29.12.10	국고 19-8	-615		공사채 607	
국고10Y	2.855%	-2.1	27.09.10	국고 22-8	-649			
국고10Y-3Y	25.8	1.6	25.06.10	국고 15-2	-1,150			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.33	4.28	4.31	-0.02	O/N	4.35	4.27	4.31	-0.01
T/N	4.40	4.30	4.37	0.04	T/N	4.50	4.40	4.45	0.13
1W	4.50	4.30	4.40	-0.30	1W	4.70	4.50	4.60	-0.15
1S	4.70	4.50	4.60	-0.10	1S	4.70	4.60	4.65	-0.05
3S	4.80	4.60	4.70	-0.02	3S	4.80	4.65	4.70	0.00
6S	4.80	4.60	4.70	0.00	6S	4.70	4.55	4.63	-0.02
1YR	4.83	4.63	4.70	0.02	1YR	4.80	4.65	4.74	0.06

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-4/-2	-3	3.73	-1.23	3.00	4.53000	1M MAR	-95	-85
T/N	0/+4	2	2.75	0.25	3.00	4.52459	1W*1S	-100	-90
1W	-33/-27	-30	4.05	1.05	3.00	4.49216	1*2	-180	-160
1S	-145/-135	-140	4.20	0.28	3.12	4.35701	1*3	-390	-370
3S	-525/-505	-515	4.78	0.04	3.36	4.32878	1*6	-1060	-1030
6S	-1290/-1230	-1260	5.07	0.02	3.33	4.28493	1*9	-1780	-1750
1YR	-2730/-2630	-2680	4.94	-0.03	3.05	4.23931	1*12	-2520	-2480

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)

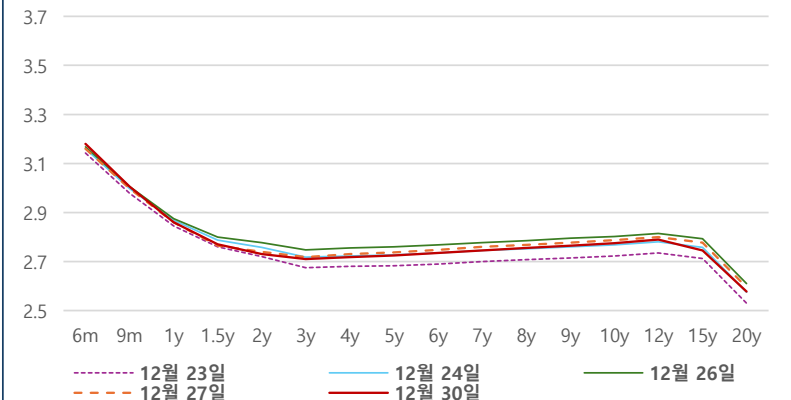
IRS 데일리 증가

12월 30일

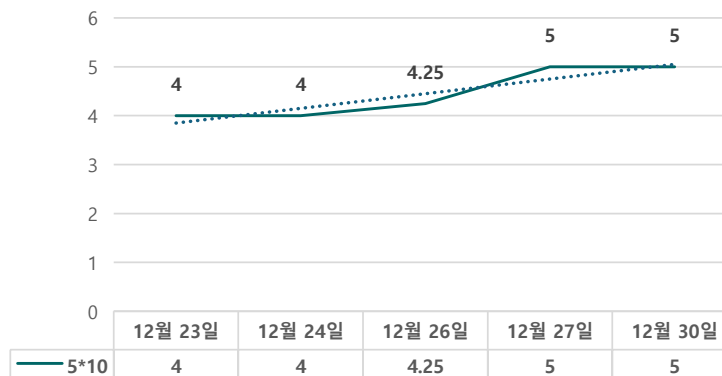
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1800	2.00
9m	3.0050	0.75
1y	2.8600	0.00
1.5y	2.7700	0.50
2y	2.7300	-1.00
3y	2.7100	-0.75
4y	2.7175	-1.25
5y	2.7250	-1.25
6y	2.7350	-1.25
7y	2.7450	-1.50
8y	2.7550	-1.25
9y	2.7650	-1.25
10y	2.7750	-1.25
12y	2.7900	-1.00
15y	2.7450	-3.25
20y	2.5775	-1.75

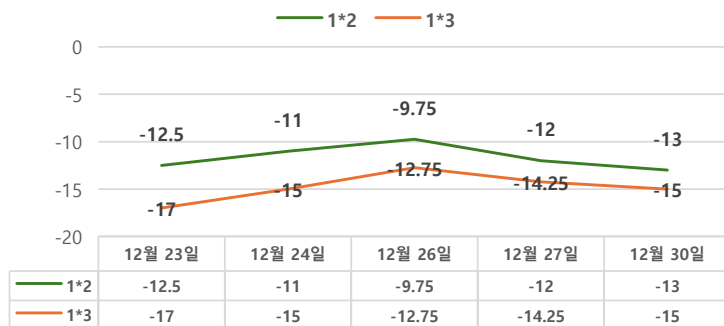
IRS 증가



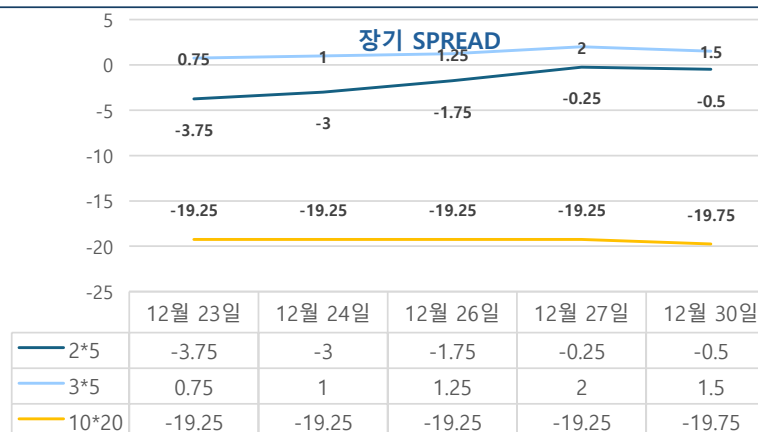
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

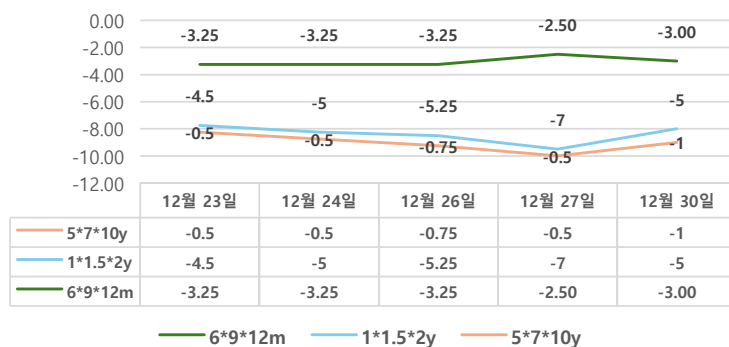
구분	증가	전일대비
1*2y	-13.00	-1.00
1*3y	-15.00	-0.75
2*5y	-0.50	-0.25
3*5y	1.50	-0.50
5*10y	5.00	0.00
10*20y	-19.75	-0.50

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.00	-0.50
1*1.5*2y	-5.00	2.00
2*5*10y	-5.50	-0.25
5*7*10y	-1.00	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY

