

Market Daily Report



2024.05.02(목)

레포	공모주 청약 환불 및 월말 MMF 환매 영향으로 운용사-신탁 매수 감소하여 조달금리 급등했으며, 은행권 매수 의존도 증대되었음. 장 중 은행 및 증권 매도 더해져 조달 정체 계속됐으나 통안계정 감액 후 추가자금 운용되어 큰 문제 없이 마무리됨. [에이치디현대마린솔루션 모집 환불일] 증거금 합계 25.09조 : KB 13.41조 / 신한 4.77조 / 하나 4.59조 / 대신 1.23조 / 삼성 1.09조
채권	한국 : (4/30 기준) 근로자의 날 휴장과 FOMC를 앞두고 글로벌 강세 흐름 추종하며 커브 플랫트닝되며 국채 금리는 하락 마감함. 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 파월 의장이 금리 인하 가능성을 열어두고, 금리 인상 시나리오에 대해 부정적인 입장을 표명하며 저가 매수세 강력하게 유입. 금번 FOMC에서는 금리를 5.25~5.50%로 동결. 연준이 6월부터 양적긴축(QT) 속도조절에 나서겠다는 계획을 발표하며 국제시장은 안도함.
MONEY	말일 머니 시장은 5월초 한국을 비롯 역외 주요국들의 휴장 (5/1-5/5 중국), (5/3-5/6 일본)으로 대부분 월말 북마감을 오전 중으로 마무리 했음. 역외에서는 TOD-6일물 중국계 은행들의 비드 우위로 5.50-5.60 수준, 2일물 오버나잇 대만계 은행들 5.40-5.45 수준으로 체결 되었으나 오후 들어 북 마감 자금 처분으로 말일 커버 오버나잇 5.35-5.40 수준으로 증가 형성하며 오전/오후 레벨 온도차 심화. FOMC 대기 속에 장기물 조달 및 운용 포지션은 연휴 이후로 대부분 연기 했으며, 5월초 시작하는 1개월물 이내 역내외 운용물량의 등장으로 금리는 고점 5.55, 저점 5.45 수준으로 레벨 형성 되며 마감됨.
FX SWAP	근로자의 날 휴일과 FOMC를 앞두고 변동성은 다소 제한적인 장세를 보임. 1년, 6개월 스왑프가 각각 시가 대비 10전 하락하며 증가 거래가 있었지만 구간별로 등락은 엇갈리며 변동폭은 미미한 수준을 나타냄. 한편 초단기 스왑프는 공모주 및 MMF 환매로 인한 현물환 수급으로 인해 오버나잇 2일물은 -17전부터 -22전, 탭넥 1일물은 -6.5전부터 -8전까지 하락 거래 체결되며 장 종료됨.
IRS	전일 IRS는 국채 선물시장이 장기물 위주로 강세를 보인 영향을 받아 장기물 위주로 하락 마감. 다만 국내 시장 휴장 후 발표되는 연방공개시장위원회(FOMC) 회의 결과에 대한 경계감도 나타나는 분위기를 보임. 초단기쪽으로 9개월과 9*12개월 스프레드로 호가가 나오면서, 9개월이 장 초반 59.25에 거래가 이뤄졌으며, 10년 관련한 4*10, 5*10년쪽으로도 꾸준히 호가가 형성됨. 장 막판 10년 오퍼가 다소 강하게 나오면서 57.5 에 거래가 있었으며, 장 마감 후 미국채 움직임에 연동되면서 2년 비드가 57.5까지 올라와 거래가 이뤄짐.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.24(수)	192.6	205.6	3.48%	3.519%	3.500%	3.56%	2년물	4.968%	-7.8
2024.04.25(목)	186.3	203.4	3.55%	3.562%		3.57%	5년물	4.655%	-6.8
2024.04.26(금)	185.8	201.4	3.60%	3.581%		3.57%	10년물	4.634%	-5.2
2024.04.29(월)	187.4	199.6	3.58%	3.573%		3.57%	30년물	4.753%	-3.4
2024.04.30(화)	186.7		3.65%	3.655%		3.57%	10Y-2Y	-33.4	-2.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,692.06	4.62	24-07-04	재정채	1,820	은행채 3,000	은행채 4,300	통안채 2년물 25,000
KOSDAQ	868.93	-0.79	54-03-10	국고 24-2	966	회사채 101	여전채 250	
달러-원	1,382.00원	5.00원	43-09-10	국고 23-9	319		회사채 2,000	
국고3Y	3.529%	-2.3	47-03-10	국고 17-1	-202		공사채 1,600	
국고10Y	3.656%	-4.8	28-12-10	국고 18-10	-227			
국고10Y-3Y	12.7	-2.5	26-12-10	국고 16-8	-679			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.35	-0.02	O/N	5.60	5.30	5.45	0.09
TN	5.40	5.30	5.36	-0.09	TN	5.40	5.35	5.38	-0.17
1W	5.48	5.38	5.43	-0.05	1W	5.50	5.40	5.43	-0.07
1S	5.58	5.48	5.53	0.00	1S	5.60	5.50	5.55	-0.05
3S	5.70	5.60	5.66	0.00	3S	5.80	5.70	5.73	-0.02
6S	5.75	5.65	5.72	0.00	6S	5.80	5.70	5.75	0.00
1YR	5.77	5.67	5.72	0.00	1YR	5.80	5.70	5.77	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-22/-18	-20.0	6.11	0.26	3.50	5.31000	1M MAR	-207	-204
TN	-9/-6	-7.0	5.32	-0.40	3.50	5.31010	1W*1S	-165	-160
1W	-51/-49	-50	5.36	0.07	3.50	5.31072	1*2	-215	-207
1S	-225/-215	-220	5.38	0.05	3.53	5.31317	1*3	-465	-455
3S	-710/-690	-695	5.54	0.00	3.58	5.32681	1*6	-1190	-1170
6S	-1450/-1430	-1440	5.71	-0.01	3.62	5.30909	1*9	-1940	-1910
1YR	-2950/-2910	-2930	5.88	0.00	3.68	5.23653	1*12	-2670	-2640

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)

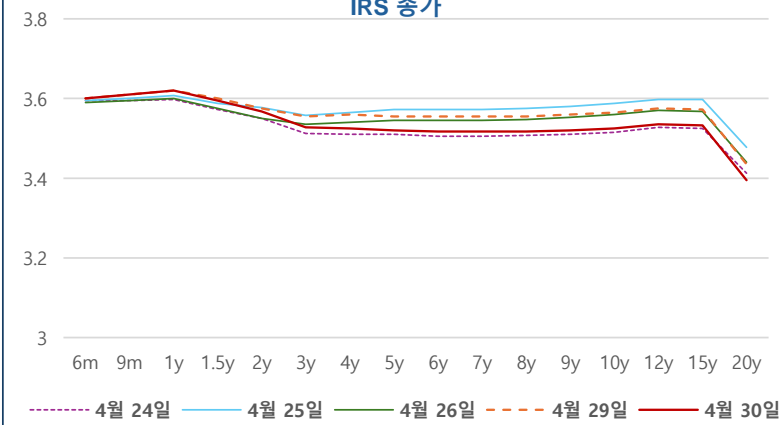
IRS 데일리 증가

4월 30일

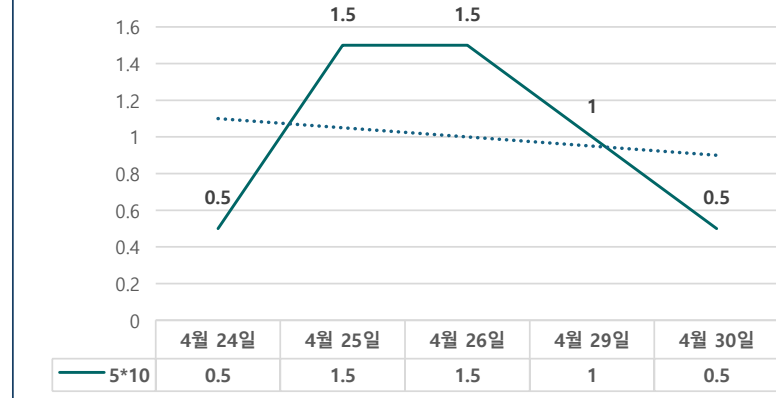
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6000	0.00
9m	3.6100	0.00
1y	3.6200	0.00
1.5y	3.5950	-0.50
2y	3.5675	-0.75
3y	3.5275	-2.75
4y	3.5250	-3.50
5y	3.5200	-3.50
6y	3.5175	-3.75
7y	3.5175	-3.75
8y	3.5175	-3.75
9y	3.5200	-4.00
10y	3.5250	-4.00
12y	3.5350	-4.00
15y	3.5325	-4.00
20y	3.3950	-4.00

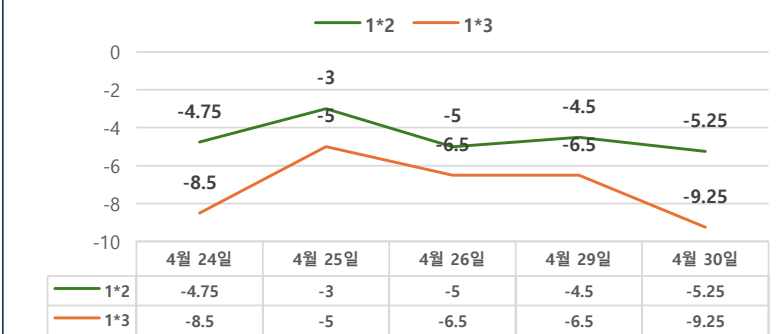
IRS 증가



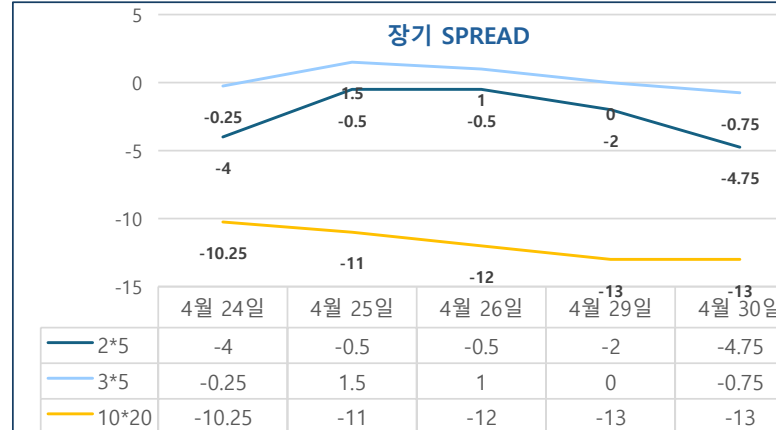
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

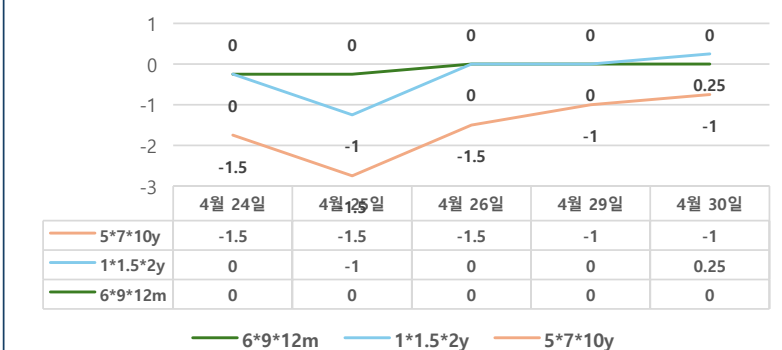


IRS 주요 커브

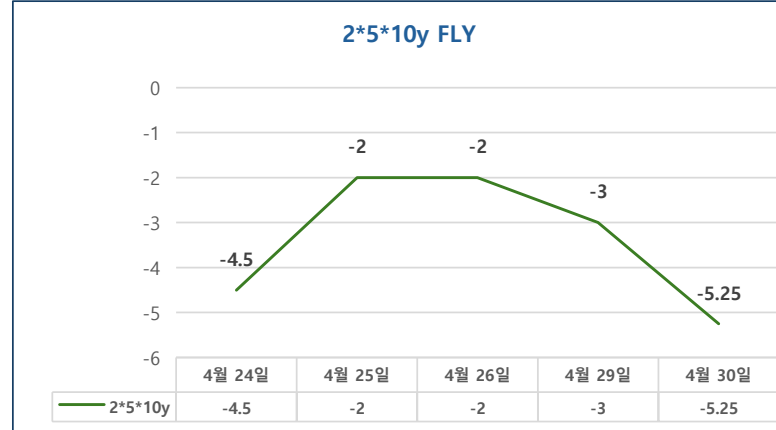
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.25	-0.75
1*3y	-9.25	-2.75
2*5y	-4.75	-2.75
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	0.50	-0.50
10*20y	-13.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.00
1*1.5*2y	0.25	0.25
2*5*10y	-5.25	-2.25
5*7*10y	-1.00	0.00