

Market Daily Report



2024.05.03(금)

레포	월초 자산운용사 및 은행신탁 매수 회복되어 금리 급락했으며, 은행권 매도 많지 않아 장 초반부터 잉여세 형성되었음. 차주 마감 일정 고려하여 한국은행RP매각 감액 실시했고, 오후에 매수 자금 추가되어 일부 저금리 거래되었음.
채권	한국 : 파월의장의 금리인상 일축 발언에 강세. 비농업 고용지표 발표 앞두고 경계감 지속되며 금리는 하락 마감함. 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 전일 파월 의장이 비둘기파적 발언을 한 뒤 매수 심리 강해짐. 이날 2년물 금리는 약 한달래 가장 낮은 수준으로 거래를 마친. 시장은 3일 발표되는 미국 비농업 부문 고용지표와 실업률에 주목함.
MONEY	-FOMC 금리동결 후 현재 금리 충분히 제약적이고 인상 가능성없다 확인 및 국채에 대한 양적긴축QT 규모를 월 250억달러(현 600억달러)로 줄이기로 하면서 비둘기적 결과로 해석됨. 그러나 머니장 커브는 1-2회 인하 후 4.75%수준 금리 동결 시간이 상당기간 유지될 것을 반영해 선반영한 1년물 5.70 금리 CAP수준 유지됨. 서울장 FOMC 이벤트 지나고 월초 잉여 자금 단기 운용 나서, 6월말 분기전 충분한 잉여 상태로 1달 5.58-5.50% 운용 리포트됨.
FX SWAP	간밤 FOMC 결과가 비둘기파적으로 해석되고 미국의 일부 경제지표들이 둔화 흐름을 보인데 따라, 장기를 스와프포인트 위주로 상승세를 보였음. 제롬 파월 미 연준 의장은 금리 인상에 대한 선을 그으며 그동안 과도했던 시장의 경계감을 완화시켰고 1년은 전일보다 90전 오른 -2840전, 6개월은 40전 오른 -1410전에 증가를 형성함. 초단기는 현물환 수급에 특별한 이슈를 보이지 않으며 데일리 -8~-7전 범위의 이론가 부근에서 거래가 체결됨.
IRS	전일 IRS는 연방공개시장위원회(FOMC) 결과에 안도하며 하락 마감. 지난밤 FOMC에서 제롬 파월 연방준비제도(Fed-연준) 의장이 금리 인상 가능성에 선을 긋는 등 비둘기파적 스탠스를 보이면서 시장에 안도감을 제공했지만, 곧 발표될 4월 고용 등 지표에 대한 경계감은 여전히 분위기를 보임. 전체적으로 국채선물에 연동하여 움직이는 모습을 보였으며, 장 초반에 10년쪽으로 비드가 나오면서 51.5에 거래가 이뤄짐. 장 막판에 1.5년쪽으로 오퍼가 꾸준히 나오면서 57.5에 맞춰져 거래됐으며, 장 마감 후 미국채와 연동되며 5년이 50, 10년이 51까지 비드가 올라오는 모습을 보임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.25(목)	186.3	203.4	3.55%	3.562%	3.500%	3.57%	2년물	4.883%	-8.5
2024.04.26(금)	185.8	201.4	3.60%	3.581%		3.57%	5년물	4.577%	-7.8
2024.04.29(월)	187.4	199.6	3.58%	3.573%		3.57%	10년물	4.587%	-4.7
2024.04.30(화)	186.7	197.1	3.65%	3.655%		3.57%	30년물	4.731%	-2.2
2024.05.02(목)	182.2		3.50%	3.489%		3.57%	10Y-2Y	-29.6	3.8

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	2,683.65	-8.41	25-09-10	국고 23-8	1,350	은행채 3,800	은행채 2,200	물가채 10년 500억원 입찰
KOSDAQ	867.48	-1.45	29-03-10	국고 24-1	770	여전채 2,803	여전채 2,570	물가채 10년 500억원 선매출
달러-원	1,375.90원	-6.10원	27-06-10	국고 24-4	700	회사채 2,600	회사채 2,270	
국고3Y	3.509%	-2	52-03-10	국고 22-2	-111	공사채 2,100		
국고10Y	3.638%	-1.8	27-03-10	국고 22-1	-164			
국고10Y-3Y	12.9	0.2	26-09-10	국고 21-7	-216			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.36	0.01	O/N	5.40	5.30	5.36	-0.09
TN	5.40	5.30	5.38	0.02	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.48	5.38	5.42	-0.01	1W	5.50	5.40	5.43	0.00
1S	5.58	5.48	5.52	-0.01	1S	5.60	5.50	5.58	0.03
3S	5.70	5.60	5.63	-0.03	3S	5.70	5.60	5.68	-0.05
6S	5.75	5.65	5.72	0.00	6S	5.80	5.70	5.73	-0.02
1YR	5.77	5.67	5.72	0.00	1YR	5.77	5.67	5.75	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
						단위 : 전, %, %p			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-8	-9.0	5.84	-0.27	3.50	5.34000	1M MAR	-221	-219
TN	-29/-28	-29.0	5.32	0.00	3.50	5.33934	1W*1S	-164	-158
1W	-50/-47	-48	5.31	-0.05	3.50	5.33538	1*2	-220	-215
1S	-220/-215	-215	5.34	-0.04	3.53	5.32021	1*3	-445	-435
3S	-675/-665	-665	5.56	0.02	3.58	5.33272	1*6	-1170	-1140
6S	-1410/-1400	-1400	5.68	-0.03	3.62	5.32645	1*9	-1920	-1890
1YR	-2870/-2830	-2840	5.84	-0.04	3.69	5.26313	1*12	-2620	-2580

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)

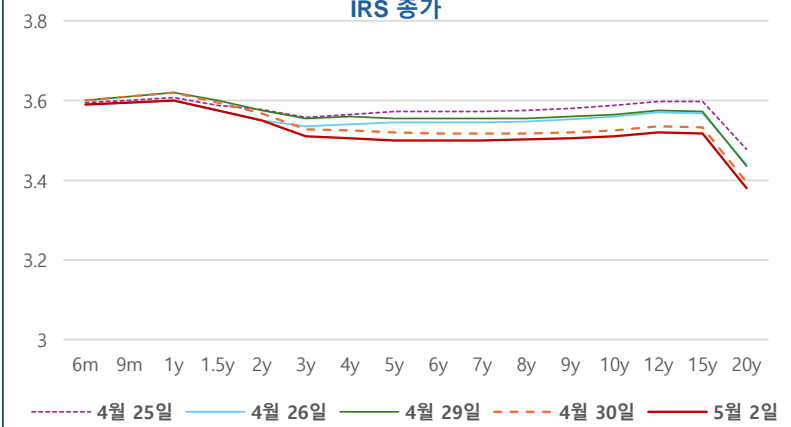
IRS 데일리 증가

5월 2일

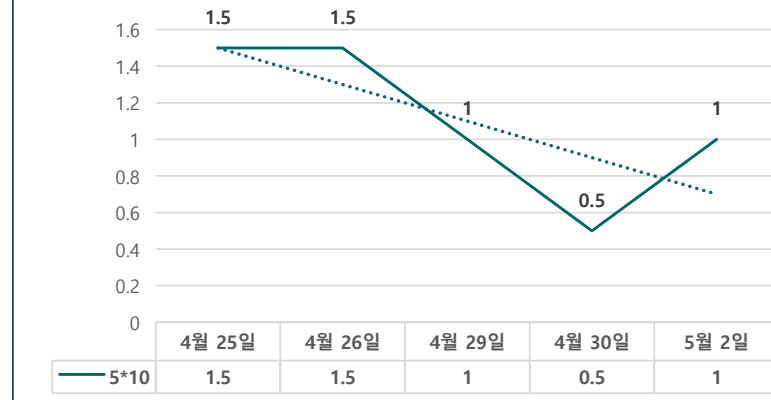
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5900	-1.00
9m	3.5950	-1.50
1y	3.6000	-2.00
1.5y	3.5750	-2.00
2y	3.5500	-1.75
3y	3.5100	-1.75
4y	3.5050	-2.00
5y	3.5000	-2.00
6y	3.5000	-1.75
7y	3.5000	-1.75
8y	3.5025	-1.50
9y	3.5050	-1.50
10y	3.5100	-1.50
12y	3.5200	-1.50
15y	3.5175	-1.50
20y	3.3800	-1.50

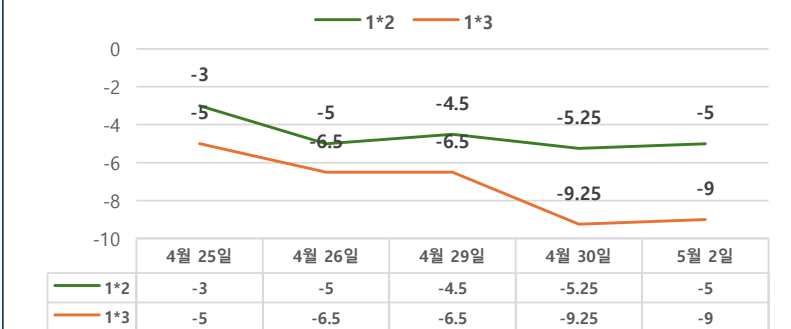
IRS 증가



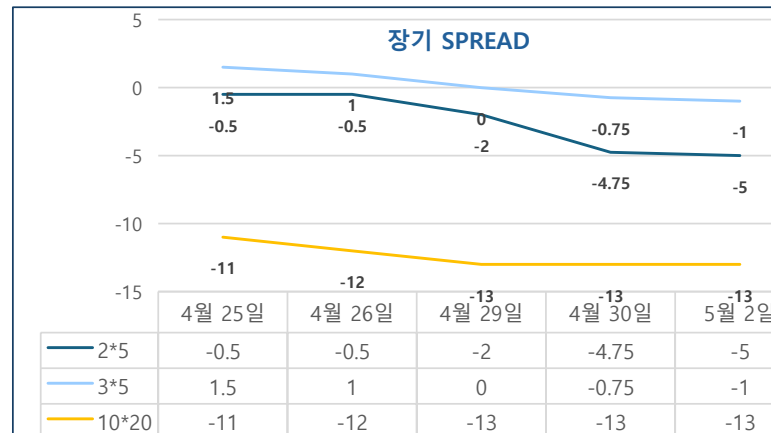
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

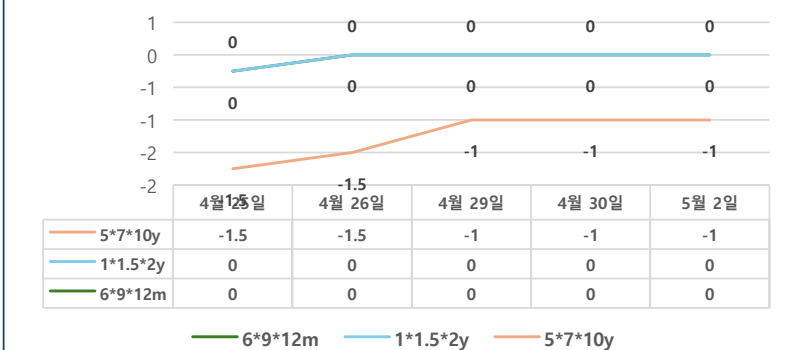


IRS 주요 커브

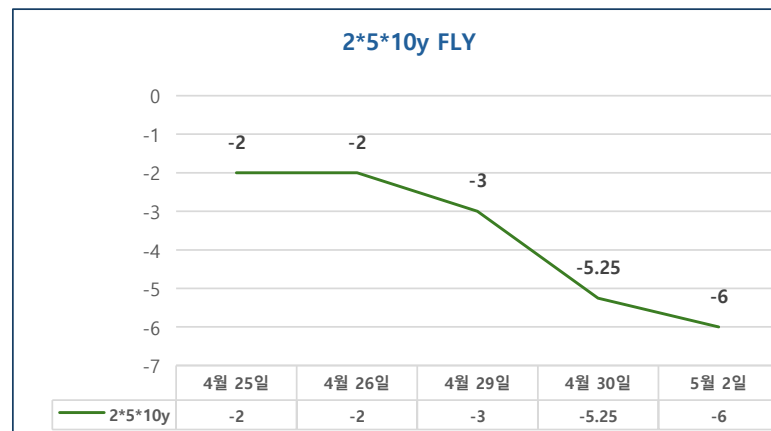
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.00	0.25
1*3y	-9.00	0.25
2*5y	-5.00	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	1.00	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	0.00	0.00
2*5*10y	-6.00	-0.75
5*7*10y	-1.00	0.00