

Market Daily Report



2024.05.07(화)

레포	월말세입에 상응하는 국고여유자금 유입되어 금리 급락했으며, 장 초반부터 은행권 조달에 나서 매수 급속도로 소진되었음. 장 중 증권사 매도 계속됐으나 운용사 및 신탁 추가 운용여력 크지 않아 막판 조달금리 소폭 상승하였음.
채권	한국 : 뉴욕 연동해 강세 출발했으나 매파적 한은총채 발인과 또 장중 美 금리 상승 영향에 강보합 마감함. 미국 : 미 국채 금리는 2년물을 제외하고 전 구간 하락마감. 채권 시장 역시 노동 시장이 적당히 둔화함에 따라 금리 인하 단행에 대한 기대감이 증폭되었고, 인하에 앞서 시장에 뛰어들어 수익률을 확보하려는 심리가 반영된 것으로 보임.(현지 5/6 증가 기준)
MONEY	미국 고용지표 발표 대기중이나, 금리 인상은 없을 것이라는 낙관 속에 달러 약세 전환. 머니 시장에서는 역외 오피도 1개월물 5.48%-5.50%, 3개월물 5.58%-5.61% 사이로 전월 대비 7-10 bp 가량 하향 조정되었고, 한동안 보기 어려웠던 1년물 오피도 5.70% 상단을 타겟으로 제시 되면서 달러 금리 안정세 시현. 역내외 휴장을 마치고 본격적인 5월 시작인 다음 주 부터는 전테너 레벨은 안정권을 형성 할 것으로 예상됨. 다만, 금일 초단기 레벨은 원화 기준일을 앞두고 FX 스왑 o/n~1w 구간이 무거운 흐름을 보이며 1주일 5.48% 이혼가로 환산 되면서 머니 운용 금리와 다소 상반된 분위기가 형성 되었음.
FX SWAP	FX스왑포인트는 미국의 비농업 부문 고용 발표를 앞두고 관망세를 나타냄. 간밤 미국채 금리가 다소 큰폭으로 밀렸음에도 FOMC 이후 높아진 경제심에 변동성은 제한된 모습을 보였음. 시장참여자 대부분은 오늘밤 발표되는 미국 비농업 고용지표를 확인하고 포지션 셋업을 하려는듯 했으며 1년이 20전 밀린것을 제외하고는 다른 기간물의 두드러진 움직임은 보이지 않았음. 초단기 현물환 스왑프는 장초반 국고여유자금 유입규모가 컸으며 원화 잉여세로 -9전까지 밀리면서 체결되다 장 막판 -8전까지 거래되며 소폭 오름세를 보이고 종료됨.
IRS	전일 IRS는 미국의 4월 고용지표를 주시하는 가운데 하락 마감. 이날 미국의 4월 고용지표 발표를 앞두고 있고, 어린이날 대체 휴일을 앞두고 있어 전체적으로 관망심리가 짙은 분위기를 띠. 25*30, 20*30년 등 30년 관련 스프레드쪽으로 호가가 나오면서 초장기쪽으로 레벨이 움직임. 1.5년 아우라와 1.5*2년 스프레드쪽으로 호가가 많이 형성되면서 1.5년이 56.5 레벨에 거래됐으며, 장 막판에 10년이 48.75에 거래됨. 장 마감 후 2년과 3년 비드가 계속해서 올라오면서 3년이 50.75까지 거래가 됐으며. 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.58에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.26(금)	185.8	201.4	3.60%	3.581%	3.500%	3.57%	2년물	4.841%	1.5
2024.04.29(월)	187.4	199.6	3.58%	3.573%		3.57%	5년물	4.493%	-1.2
2024.04.30(화)	186.7	197.1	3.65%	3.655%		3.57%	10년물	4.492%	-2.2
2024.05.02(목)	182.2	200.3	3.50%	3.489%		3.57%	30년물	4.638%	-2.9
2024.05.03(금)	192.2		3.30%	3.475%		3.58%	10Y-2Y	-34.9	-3.7

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	2,676.63	-7.02	33-06-10	국고23-5	600	은행채 11,200	은행채 1,700	국고채 3년 17,000
KOSDAQ	865.59	-1.89	54-03-10	국고24-2	430	여전채 2,030	여전채 3,300	국고채 3년(선매출) 12,000
달러-원	1,362.80원	-13.10원	33-12-10	국고23-11	291	회사채 2,000	회사채 2,330	통안채 91일 7,000
국고3Y	3.500%	-0.9	31-06-10	국고21-5	-157		통안채 7,400	
국고10Y	3.614%	-2.4	31-12-10	국고21-11	-349		공사채 10,000	
국고10Y-3Y	11.4	-1.5	40-09-10	국고20-7	-400			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.36	0.00	O/N	5.40	5.30	5.37	0.01
TN	5.40	5.30	5.38	0.00	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.48	5.38	5.42	0.00	1W	5.50	5.40	5.43	0.00
1S	5.58	5.48	5.50	-0.02	1S	5.60	5.50	5.55	-0.03
3S	5.70	5.60	5.62	-0.01	3S	5.70	5.60	5.65	-0.03
6S	5.75	5.65	5.70	-0.02	6S	5.80	5.70	5.72	-0.01
1YR	5.77	5.67	5.70	-0.02	1YR	5.77	5.67	5.72	-0.03

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
							단위 : 전, %, %p		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-33/-28	-30.0	5.48	-0.36	3.50	5.32000	1M MAR	-222	-219
TN	-9/-8	-8.0	5.61	0.29	3.50	5.32009	1W*1S	-170	-167
1W	-62/-59	-60	5.48	0.17	3.50	5.32066	1*2	-205	-195
1S	-240/-235	-235	5.42	0.08	3.53	5.32284	1*3	-430	-420
3S	680/-670	-670	5.53	-0.03	3.58	5.33593	1*6	-1130	-1110
6S	1410/-1380	-1390	5.67	-0.01	3.62	5.32846	1*9	-1830	-1810
1YR	-2840/2800	-2820	5.78	-0.06	3.69	5.25742	1*12	-2460	-2440

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 / 12.17~12.18D
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)

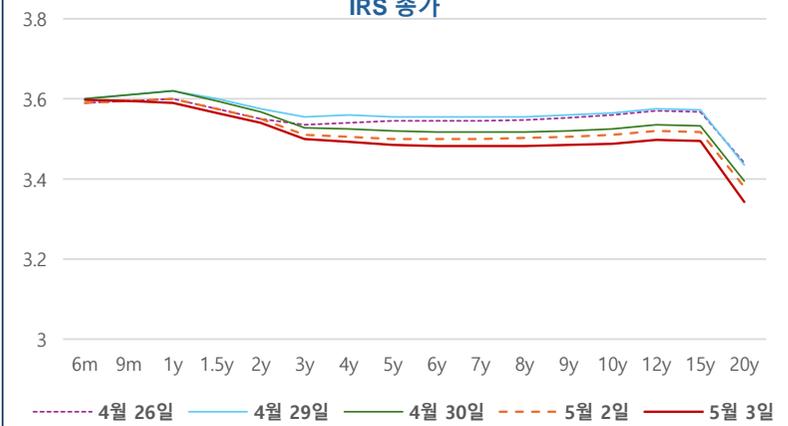
IRS 데일리 증가

5월 3일

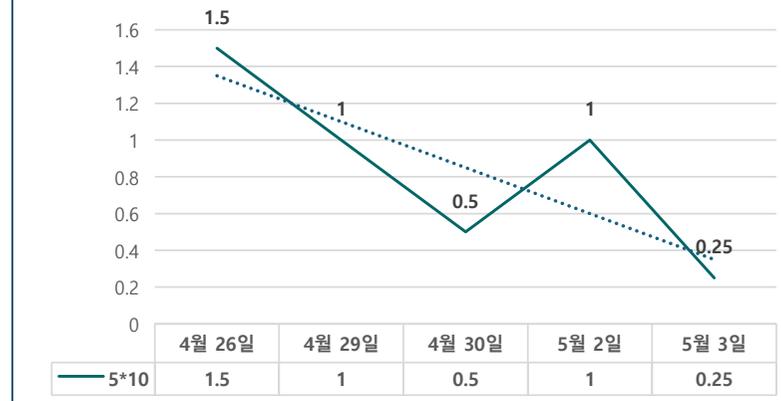
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5975	0.75
9m	3.5950	0.00
1y	3.5900	-1.00
1.5y	3.5650	-1.00
2y	3.5400	-1.00
3y	3.5000	-1.00
4y	3.4925	-1.25
5y	3.4850	-1.50
6y	3.4825	-1.75
7y	3.4825	-1.75
8y	3.4825	-2.00
9y	3.4850	-2.00
10y	3.4875	-2.25
12y	3.4975	-2.25
15y	3.4950	-2.25
20y	3.3425	-3.75

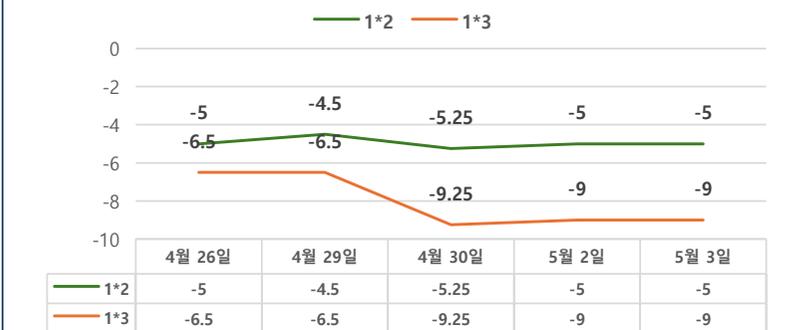
IRS 증가



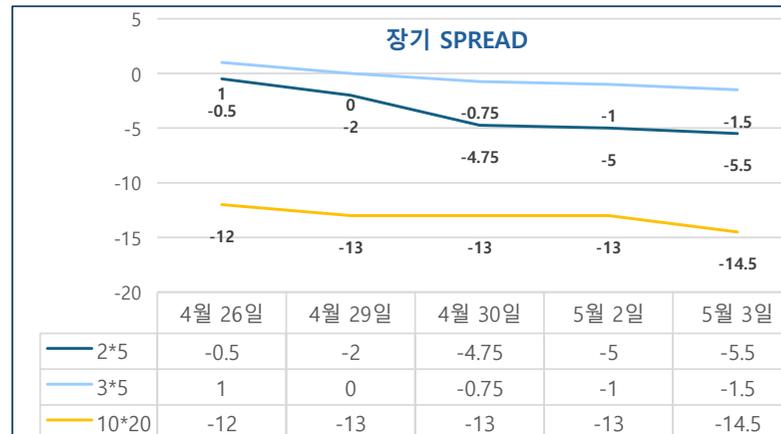
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

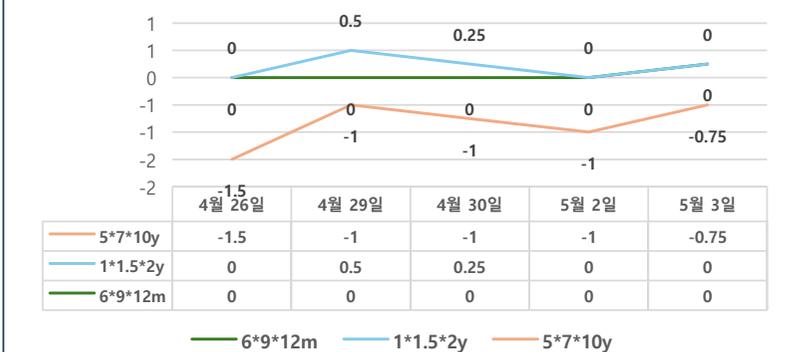


IRS 주요 커브

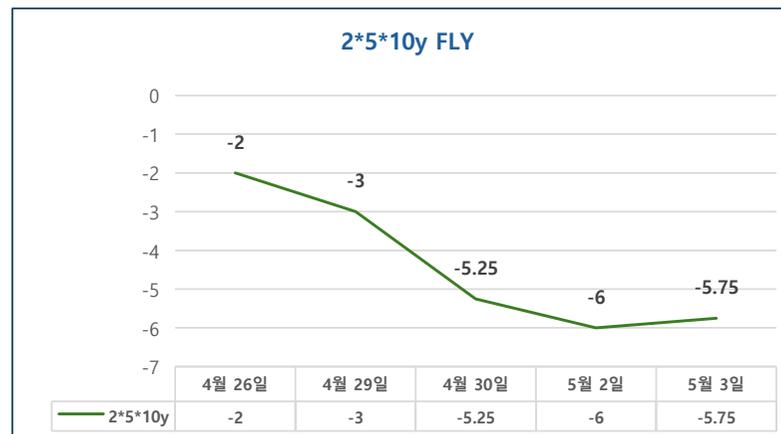
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.00	0.00
1*3y	-9.00	0.00
2*5y	-5.50	-0.50
3*5y	-4.00	-0.50
5*10y	0.25	-0.75
10*20y	-14.50	-1.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.25
1*1.5*2y	0.00	0.00
2*5*10y	-5.75	0.25
5*7*10y	-0.75	0.25