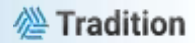


Market Daily Report



2024.05.08(수)

레포	지준 마감 불확실성 확대되어 조달금리 급등했으며, 장 초반부터 은행권 조달에 적극적인 모습을 보임. 마감일 전 운용 제약으로 2일물 매수 많지 않아 매칭 제한적이었고, 장 중 자금 유입 크지 않아 매도 정체되었음.
채권	한국 : 미국 고용시장 및 경기 둔화 소식에 금리 인하 기대 되살아나며 하락 마감. 미국 : 미 국제금리는 전구간 하락 마감. 장중 미니애폴리스 연은 총재가 "금리 인하를 서두르지 않겠다"는 발언에 시장은 다시 의구심을 가짐. 하지만 국제 유가가 하락하는 점이 금리인하 기대를 뒷받침하며 하락 마감함.
MONEY	미국 고용보고서가 신규 고용 감소 예상 하회, 실업률은 소폭 상승하며 고용지표는 악화되고 시간당 임금 상승률은 예상보다 하락해 물가 부담은 줄이는 방향으로 나오자 달러 장기 금리 하락함. 아시아장 한국계 향한 9달-1년 5.65%로 전 주말 대비 금리 5bp 하락해 오피 제시되고 3달도 5.60%에 오피 상단 형성되며 호가 안정됨. 원화가 1385원대까지 강해지고 지지 받자 달러매수 수요 증가, cash증가로 오버나잇-1달까지도 운용 관심 커져 1달 역내 금리 5.46까지 오피 제시됨. 다만 데포 예치금리를 고려해 1주-1달 5.40-5.45로 금리 하단 더 내려가지는 못함.
FX SWAP	FOMC 이후 발표된 비농업고용지표가 시장예상치를 하회하며 금리유지 또는 인하에 무게를 실는 분위기를 만들었으며, 미 재무부가 20여년만에 최대 \$15B 규모의 채권 Buyback을 발표함에 따라 미국채 금리 하락이 가속화됨. 이에 금일 FX스와프 시장은 장기물을 중심으로 미국채 금리 하락을 반영하는듯 했으며, 1년은 전 거래일 대비 60전 오른 -2760전에 스크린 증가를 나타냄. 단기 스와프는 특별한 이슈는 없었지만, 초단기는 현물환 수급에 의해 장초반 -7전까지 올라가며 거래되었지만 오후들어 원화 잉여세가 강해지며 -8전까지 체결되는 등 오후에 오피가 다소 무거운 분위기를 만들어지며 장 종료됨.
IRS	신설 IRS는 미국의 4월 고용이 시장의 예상보다 둔화한 영향으로 큰 폭 하락 마감. 미국의 4월 고용이 17만5천명 증가로 시장 예상을 하회했으며, 실업률 역시 3.9%로 다시 오르자 연방준비제도(Fed.연준)의 금리 인하감이 다시 되살아났고, 장중 호주중앙은행(RBA)의 기준금리 동결 발표에 영향을 받아 움직이는 모습을 보임. 20*30년로 호가가 나오면서 초장기 쪽으로 레벨이 높였으며, 장 막판에 5*10년 비드가 0.25까지 올라오고, 2*5년이 -7.5비드가 나오면서 1.5년부터 전체적으로 레벨이 움직였으며, 2*5년이 마지막에 -7.5에 거래가 이뤄짐. 장 마감 후 미국채에 연동되면서 1년 비드가 56.25까지 올라오고, 2년이 49.25/49에 대치됐으며, 10년 이 41.5에 ND.D로 여러 차례 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국제 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.04.29(월)	187.4	199.6	3.58%	3.573%	3.500%	3.57%	2년물	4.839%	-0.2
2024.04.30(화)	186.7	197.1	3.65%	3.655%		3.57%	5년물	4.477%	-1.6
2024.05.02(목)	182.2	200.3	3.50%	3.489%		3.57%	10년물	4.462%	-3
2024.05.03(금)	192.2	207.0	3.30%	3.475%		3.58%	30년물	4.601%	-3.7
2024.05.07(월)	187.2		3.52%	3.500%		3.58%	10Y-2Y	-37.7	-2.8

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,734.36	57.73	29-03-10	국고 24-1	993	여전채 4,000	은행채 3,800	국고채 2년 19,000
KOSDAQ	871.26	5.67	28-03-10	국고 23-1	500	회사채 500	여전채 2,250	통안채 1년물 7,000
달러-원	1,360.10원	-2.70원	54-03-10	국고 24-2	446		공사채 3,300	재정증권 63일물 20,000
국고3Y	3.448%	-5.2	33-12-10	국고 23-11	-68			
국고10Y	3.536%	-7.8	28--09-10	국고 23-6	-102			
국고10Y-3Y	8.8	-2.6	-	-	-			

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		전일대비
O/N	5.38	5.28	5.33	-0.03	O/N	5.40	5.30	-0.02
TN	5.40	5.30	5.37	-0.01	TN	5.42	5.32	0.02
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	-0.01
1S	5.53	5.43	5.48	-0.01	1S	5.60	5.50	0.02
3S	5.63	5.53	5.57	-0.03	3S	5.70	5.60	0.02
6S	5.70	5.60	5.67	-0.03	6S	5.80	5.70	-0.02
1YR	5.70	5.60	5.65	-0.05	1YR	5.77	5.67	-0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7.5/-7	-7.0	5.35	-0.13	3.50	5.31000	1M MAR	-214	-212
TN	-8/-7.5	-7.5	5.35	-0.26	3.50	5.31038	1W*1S	-175	-170
1W	-53/-49	-50	5.41	-0.07	3.50	5.31264	1*2	-210	-205
1S	-230/-225	-225	5.40	-0.02	3.53	5.32130	1*3	-437	-430
3S	-670/-665	-665	5.52	-0.01	3.58	5.31200	1*6	-1150	-1115
6S	-1400/-1380	-1380	5.63	-0.04	3.62	5.28248	1*9	-1860	-1800
1YR	-2770/-2750	-2760	5.80	0.02	3.68	5.13716	1*12	-2490	-2430

국내의 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)

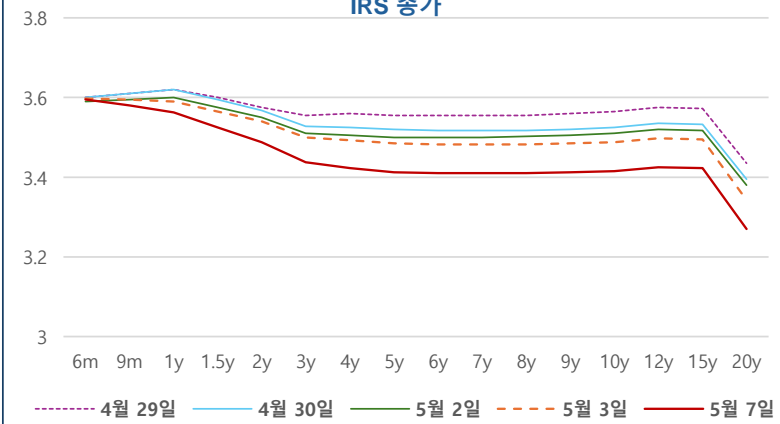
IRS 데일리 증가

5월 7일

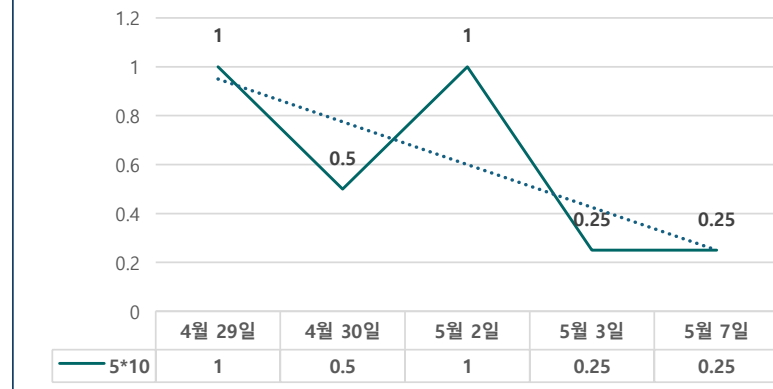
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5950	-0.25
9m	3.5800	-1.50
1y	3.5625	-2.75
1.5y	3.5250	-4.00
2y	3.4875	-5.25
3y	3.4375	-6.25
4y	3.4225	-7.00
5y	3.4125	-7.25
6y	3.4100	-7.25
7y	3.4100	-7.25
8y	3.4100	-7.25
9y	3.4125	-7.25
10y	3.4150	-7.25
12y	3.4250	-7.25
15y	3.4225	-7.25
20y	3.2700	-7.25

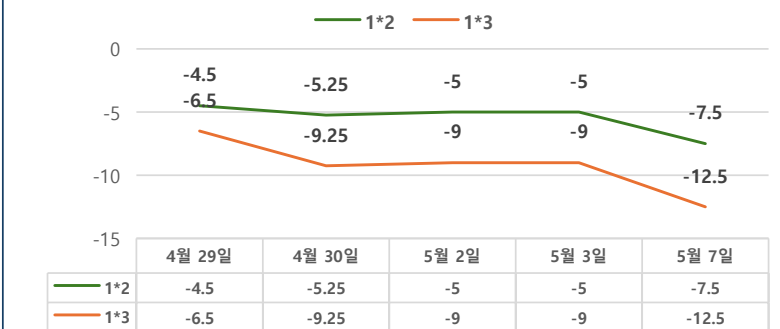
IRS 증가



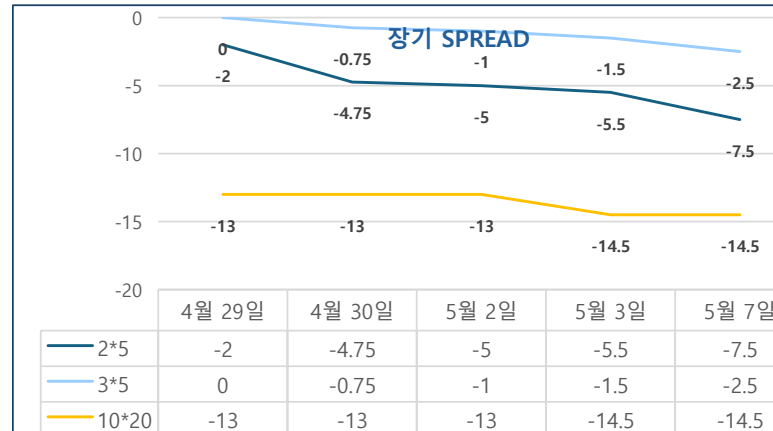
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

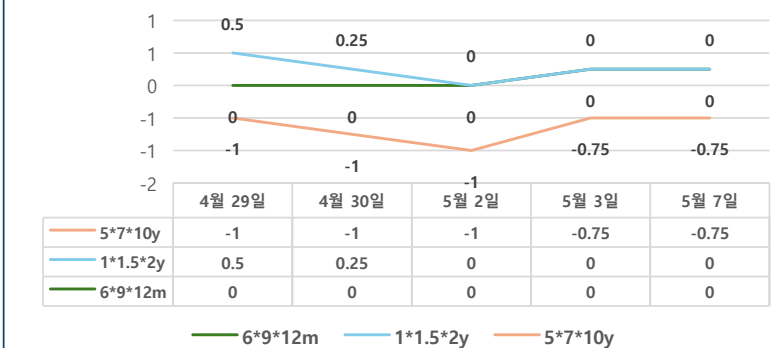


IRS 주요 커브

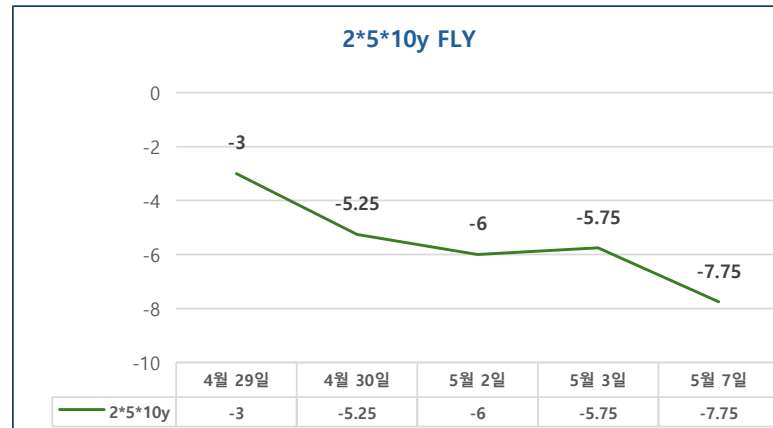
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-7.50	-2.50
1*3y	-12.50	-3.50
2*5y	-7.50	-2.00
3*5y	-4.00	-1.00
5*10y	0.25	0.00
10*20y	-14.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.00
1*1.5*2y	0.00	0.00
2*5*10y	-7.75	-2.00
5*7*10y	-0.75	0.00