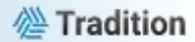


# Market Daily Report



2024.05.09(목)

<b>레포</b>	지준 마감일 이후 은행권 적수 소폭의 마이너스로 출발 하겠으나, 국고채 및 재정증권 발행분 공자기금 운용이 예상되며 단기자금 유동성은 다시금 여유있는 모습 보일 것으로 예상.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 소폭 하락함. 장중 눈에 띄는 재료가 없는 상황에서 국고채는 간밤 미 국채시장 분위기에 연동되었고, 외국인 투자자들의 수급을 참고하며 움직임을 보임. 미국 : 미 국채금리는 전구간 상승 마감함. 10년물은 금리인하 기대로 전일 장중 4.42%대 저점을 기록했으나 다시 상승. 이날 보스턴 연은 총재의 "인플레이션 목표치 달성을 위해 경제활동이 둔화될 것"이라는 발언에 금리 인상은 아니더라도 향후 인하가 둔화될 것이라는 우려가 반영됨.
<b>MONEY</b>	카시카리 총재의 연내 금리 동결 발언에도 시장은 큰 반응 없이 전일과 같이 9월 인하 49% 반영하며 1년물 5.65% 오픈 유지됨. 9월 인하 기대로 편딩을 짧게 선호하면 6월 분기말 수요가 더욱 강해질 것 예상되어 2-3달 구간 편딩 레벨 이미 상승 시작해 3달-1년금리 갭 5BP이내로 축소. 서울 렌더들은 중국계 쪽으로 5.70% 오픈 관심 보여줘 아시아장 3달 5.70/5.60선 형성하며 횡보함.
<b>FX SWAP</b>	FX스와프포인트는 수급을 처리하며 좁은 범위에서 등락이 엇갈림. 지난주 FOMC와 미국 비농업고용지수를 소화한 이후 시장은 움직임만한 특별한 재료를 찾지 못한채 보합세로 마감됨. 오버나잇은 지준일을 무난히 넘어가며 -7전에 시장 거래되었고, 탐벡은 오전 -7전 거래이후 오후 -8전까지 내려가면서 거래되었지만, 장종료이후 -8.5전까지 거래되면서 오픈 무거운 모습을 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 미국 고용지표 영향 등으로 혼조세를 보임. 전날 미국의 고용 둔화와 호주의 금리 동결 등으로 큰 폭으로 금리가 하락했지만, 이날은 다소 관망하는 모습이었으며 다음주 예정된 미국의 물가 지표 등 추가적인 지표 발표를 지켜봐야 한다는 분위기. 20*30년, 25*30년으로 호가가 나오면서 초장기쪽으로 레벨이 움직였으며, 장 막판에 6*12개월이 오픈가 다소 늘리면서 -3.75 거래가 됐으며, 2*5년이 -7.75비드까지 나옴. 장 마감 후 7년이 40에 ND/D로 초이스가 붙었다가 40에 거래가 됐으며, 2년이 48.25/48로 대체되다 48.25까지 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.04.30(화)	186.7	197.1	3.65%	3.655%	3.500%	3.57%	2년물	4.847%	0.8
2024.05.02(목)	182.2	200.3	3.50%	3.489%		3.57%	5년물	4.505%	2.8
2024.05.03(금)	192.2	207.0	3.30%	3.475%		3.58%	10년물	4.499%	3.7
2024.05.07(월)	187.2	210.5	3.52%	3.500%		3.58%	30년물	4.642%	4.1
2024.05.08(수)	188.2		3.52%	3.500%		3.58%	10Y-2Y	-34.8	2.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,745.05	10.69	24-07-11	재정채	3,000	은행채 7,600	은행채 2,100	
KOSDAQ	872.42	1.16	54-03-10	국고 24-2	1,094	여전채 7,950	여전채 100	
달러-원	1,361.50원	1.40원	33-06-10	국고 23-5	916	회사채 6,107	회사채 2,000	
국고3Y	3.439%	-0.9	53-09-10	국고 23-7	-36	통안채 4,600	통안채 14,200	
국고10Y	3.530%	-0.6	53-03-10	국고 23-2	261	공사채 1,900	공사채 931	
국고10Y-3Y	9.1	0.3	24-06-10	국고 21-4	-1,000			

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가
O/N	5.38	5.28	5.33	0.00	O/N	5.40	5.30	5.35
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.42	5.32	5.37
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.41
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.60	5.50	5.56
3S	5.63	5.53	5.58	0.01	3S	5.70	5.60	5.67
6S	5.70	5.60	5.67	0.00	6S	5.80	5.70	5.70
1YR	5.70	5.60	5.65	0.00	1YR	5.77	5.67	5.70

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-5	-7.0	5.35	0.00	3.50	5.31000	1M MAR	-218	-213
TN	-9/-8.5	-8.5	5.75	0.40	3.50	5.31033	1W*1S	-166	-163
1W	-54/-51	-53	5.50	0.09	3.50	5.31230	1*2	-215	-211
1S	-230/-225	-225	5.46	0.06	3.53	5.31987	1*3	-454	-450
3S	-685/-680	-680	5.52	0.00	3.58	5.32322	1*6	-1139	-1110
6S	-1400/-1360	-1380	5.64	0.01	3.62	5.28738	1*9	-1845	-1835
1YR	-2830/-2750	-2780	5.78	-0.02	3.65	5.14518	1*12	-2510	-2490

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

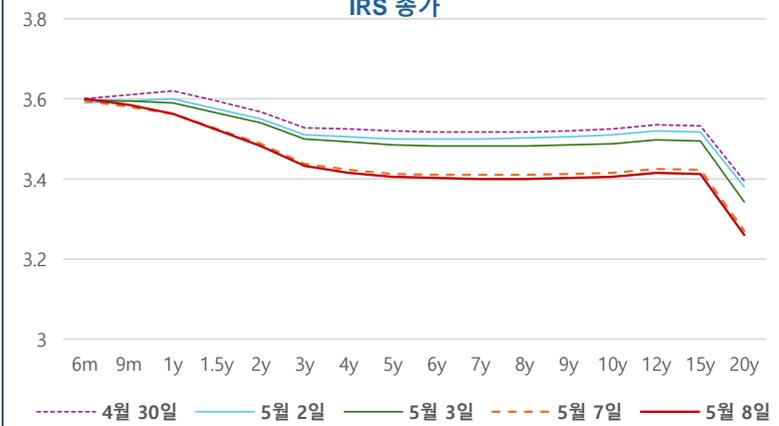
IRS 데일리 증가

5월 8일

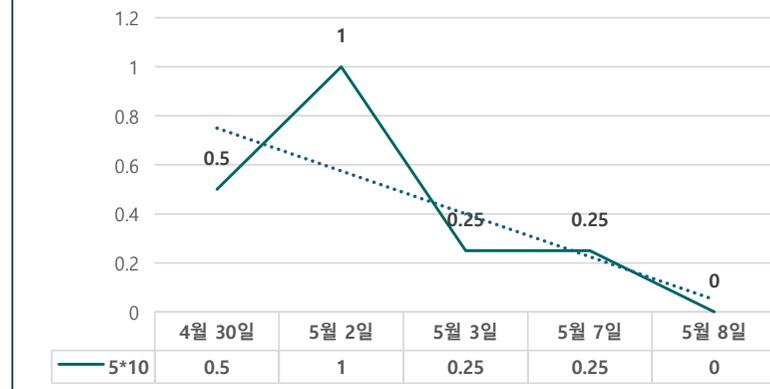
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6000	0.50
9m	3.5850	0.50
1y	3.5625	0.00
1.5y	3.5225	-0.25
2y	3.4825	-0.50
3y	3.4325	-0.50
4y	3.4150	-0.75
5y	3.4050	-0.75
6y	3.4025	-0.75
7y	3.4000	-1.00
8y	3.4000	-1.00
9y	3.4025	-1.00
10y	3.4050	-1.00
12y	3.4150	-1.00
15y	3.4125	-1.00
20y	3.2600	-1.00

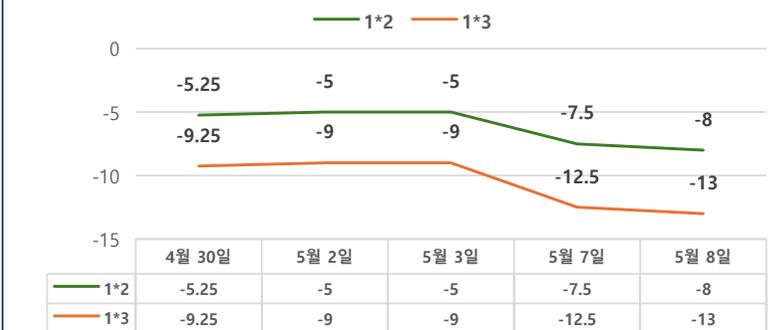
IRS 증가



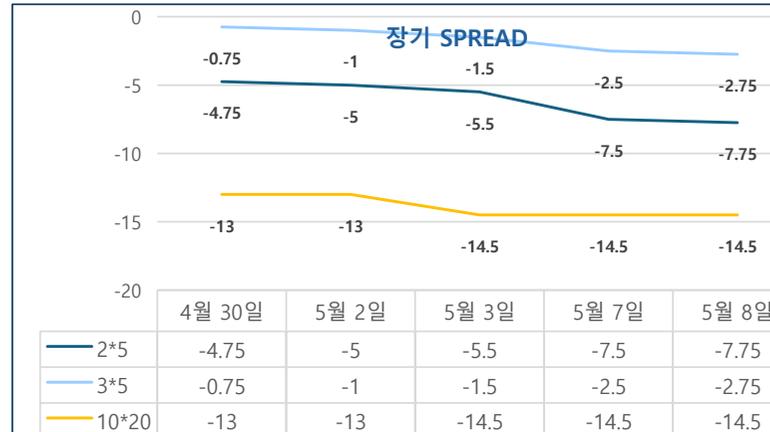
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

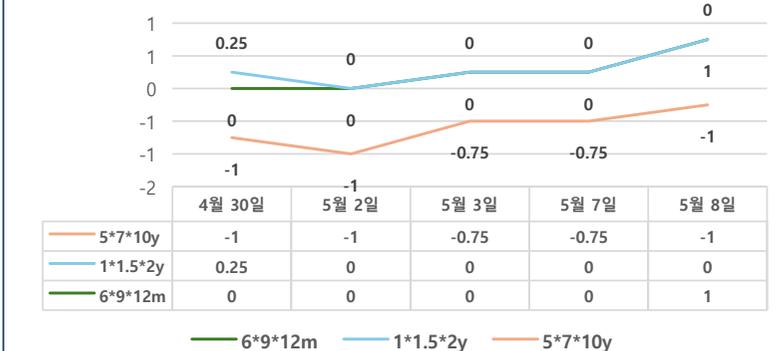


IRS 주요 커브

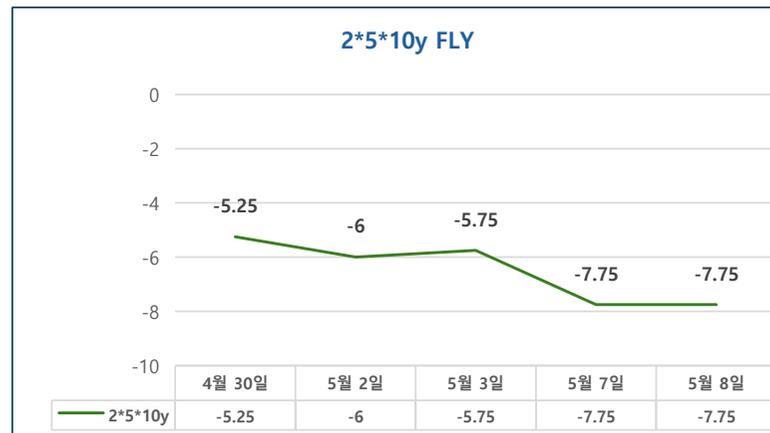
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-8.00	-0.50
1*3y	-13.00	-0.50
2*5y	-7.75	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	0.00	-0.25
10*20y	-14.50	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.75	0.50
1*1.5*2y	0.00	0.00
2*5*10y	-7.75	0.00
5*7*10y	-1.00	-0.25