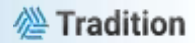


Market Daily Report



2024.05.09(목)

레포	지준 마감일 이후 은행권 적수 소폭의 마이너스로 출발 하겠으나, 국고채 및 재정증권 발행분 공자기금 운용이 예상되며 단기자금 유동성은 다시금 여유있는 모습 보일 것으로 예상.
채권	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.
MONEY	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.
FX SWAP	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.
IRS	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	전일대비
O/N	5.38	5.28	5.33	0.00	O/N	5.40	5.30	5.35	0.00
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.42	5.32	5.37	-0.03
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.41	-0.01
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.60	5.50	5.56	-0.01
3S	5.63	5.53	5.58	0.01	3S	5.70	5.60	5.67	0.00
6S	5.70	5.60	5.67	0.00	6S	5.80	5.70	5.70	0.00
1YR	5.70	5.60	5.65	0.00	1YR	5.77	5.67	5.70	0.00

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	
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)

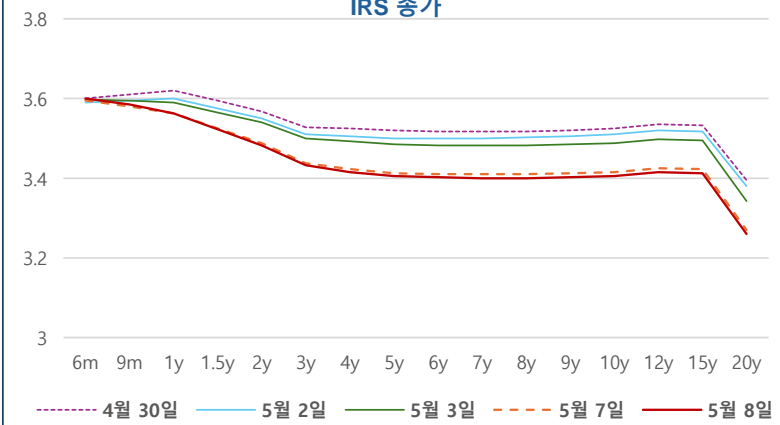
IRS 데일리 증가

5월 8일

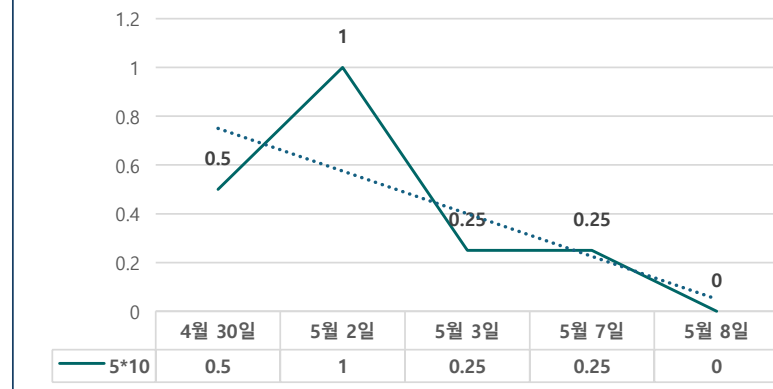
단위 : %, bp

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

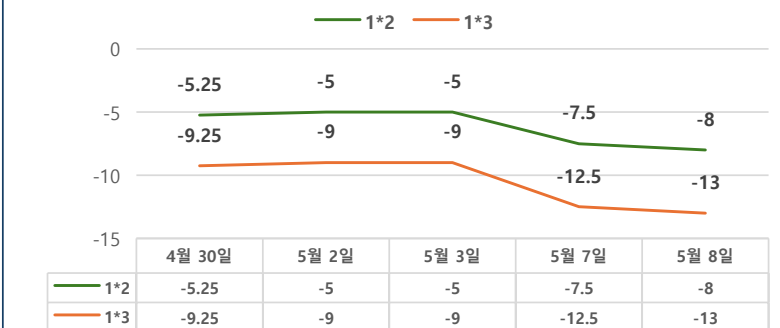
IRS 증가



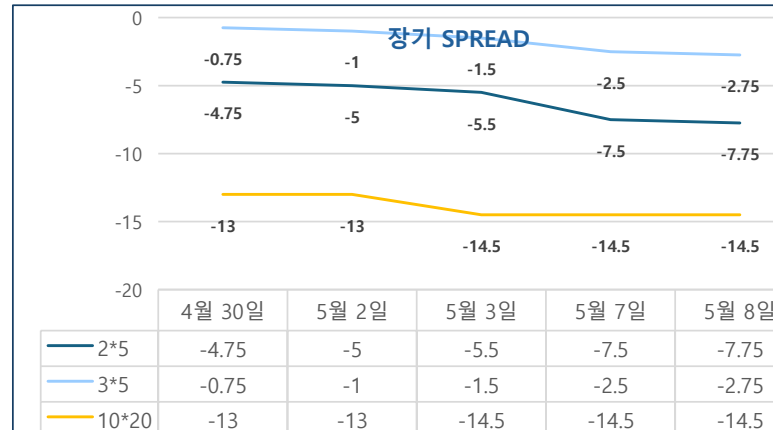
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

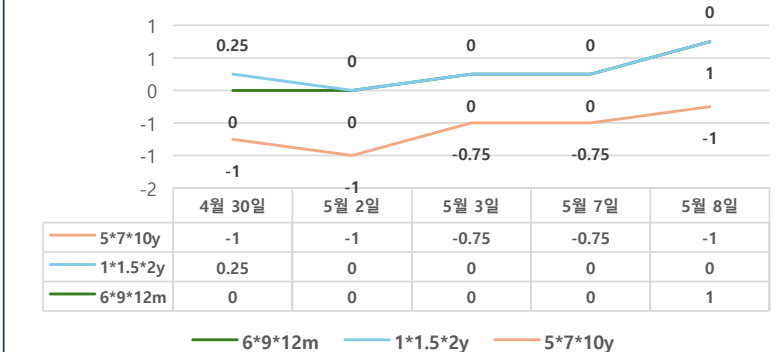


IRS 주요 커브

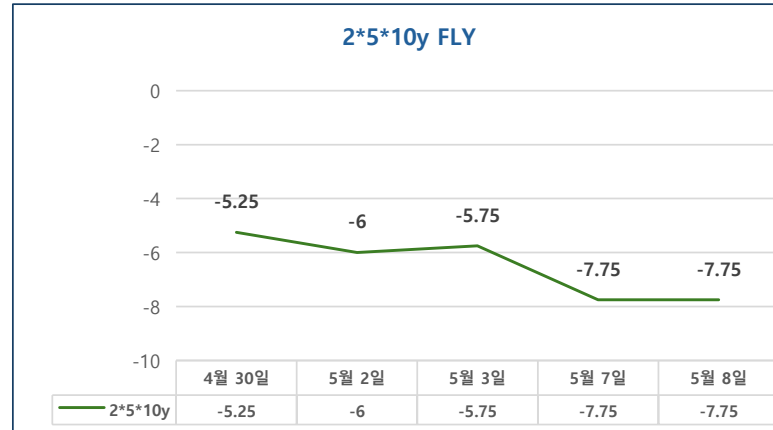
SPREAD

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