

# Market Daily Report



2024.05.10(금)

<b>레포</b>	공모주 청약(아이씨티케이) 환복 및 국고여유자금 4.2조 환수 영향으로 유동성 축소 예상됨. 은행권 조달 강도에 따라 체결 분위기 가변적일 전망.
<b>채권</b>	한국 : 대통령 기자 회견 중 추경 가능성 제기되지 않으며 시장 안도하는 모습. 이후 대외 금리에 연동되며 국고채 금리는 상승 마감함. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 하락 마감함. 고용시장 지표인 실업보험 청구자 수가 23.1만명으로 예상치를 크게 상회하며 발표됨. 미 노동시장의 약세로 금리인하 가능성에 대한 기대가 커진 것으로 보임. 또한 이날 30년 미 국채 입찰도 호조를 보이며 국채 매수세 우위.
<b>MONEY</b>	미국채 10년물 입찰 약세에도 2년물 금리 약보합선 마감하며 시장은 9월 인하 개시 준비모드 돌입한 듯 1년물 금리 속락함. 1년구간 비드가 얇아지면서 대만계 렌더들 5.57%까지 오퍼 내려 전일비 7BP 하락. 다만 EUR, JPY등의 1년 차입은 달러기준 5.75~5.80레벨에서 더 낮아지지못해 일시적인 매칭 물량 유입으로 큰 폭 하락했을 가능성도 있음. 수출입은행 캄거루본드 10억호주불 발행에 서울장은 3달 이내 유동성 추가 공급 기대감도 있음.
<b>FX SWAP</b>	FX스왑포인트는 시장을 움직일 만한 재료가 부재한 가운데 대체로 약보합세를 나타냄. 3개월 쪽으로 에셋스왑프가 나온 것으로 파악되며, 이는 최근 높았던 레벨이 조정되는 수준으로 그친것으로 사료됨. 초단기 스왑프는 지준이 지나고 현물환 수급에 의해 무거운 모습을 보이며 오버나잇 데일리 -9전, 탐넥은 데일리 -8 전 거래로 시작됐지만, 오후들어 이론가 근처로 올라가며 회복되는 모습을 보였음.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 상승 마감. 국내외에서 특별한 이벤트가 없었으며, 최근의 금리 하락을 일부 되돌리는 모습이었으며 다음주 발표될 미국의 4월 물가지표 등에 대한 경계감은 여전한 분위기. 전체적으로 고요한 분위기였으며 20*30년으로 꾸준히 호가가 나오면서 초장기 레벨이 움직였고, 9개월쪽으로 59.5에 D/ND로 초이스가 붙었다 거래가 됨. 장 막판에는 5*10년 비드가 01까지 올라오고, 10년 비드도 올라오면서 43.25에 거래가 됐으며, 2년 오퍼가 나오면서 50에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.05.02(목)	182.2	200.3	3.50%	3.489%	3.500%	3.57%	2년물	4.826%	-2.1
2024.05.03(금)	192.2	207.0	3.30%	3.475%		3.58%	5년물	4.474%	-3.1
2024.05.07(월)	187.2	210.5	3.52%	3.500%		3.58%	10년물	4.459%	-4
2024.05.08(수)	188.2	210.9	3.52%	3.500%		3.58%	30년물	4.611%	-3.1
2024.05.08(수)	191.4		3.43%	3.485%		3.58%	10Y-2Y	-36.7	-1.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,712.14	-32.91	54-03-10	국고 24-2	1,017	은행채 7,600	은행채 2,100	국고채 50년 5,000
KOSDAQ	870.15	-2.27	26-03-10	국고 24-3	600	여전채 7,950	여전채 100	
달러-원	1,370.10원	8.60원	34-06-10	국고 24-5	250	회사채 6,107	회사채 2,000	
국고3Y	3.453%	1.4	51-03-10	국고 21-2	-101	통안채 4,600	통안채 14,200	
국고10Y	3.556%	2.6	24-09-10	국고 19-5	-154	공사채 1,900	공사채 931	
국고10Y-3Y	10.3	1.2	24-08-17	수출입	-600			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.35	0.02	O/N	5.38	5.28	5.33	-0.02
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.40	5.30	5.36	-0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.41	0.00
1S	5.53	5.43	5.47	-0.01	1S	5.60	5.50	5.55	-0.01
3S	5.63	5.53	5.57	-0.01	3S	5.70	5.60	5.65	-0.02
6S	5.65	5.55	5.64	-0.03	6S	5.73	5.63	5.67	-0.03
1YR	5.65	5.50	5.60	-0.05	1YR	5.70	5.60	5.65	-0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-7	-7.0	5.34	-0.01	3.50	5.31000	1M MAR	-220	-218
TN	-24/-23	-23.0	5.53	-0.22	3.50	5.31036	1W*1S	-172	-168
1W	-55/-52	-53	5.50	0.00	3.50	5.31253	1*2	-231	-220
1S	-230/-225	-230	5.49	0.03	3.53	5.32086	1*3	-440	-440
3S	-680/-675	-675	5.54	0.02	3.58	5.32577	1*6	-1130	-1110
6S	-1390/-1380	-1380	5.65	0.01	3.62	5.29350	1*9	-1840	-1820
1YR	-2850/-2750	-2780	5.76	-0.02	3.64	5.14913	1*12	-2490	-2470

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)

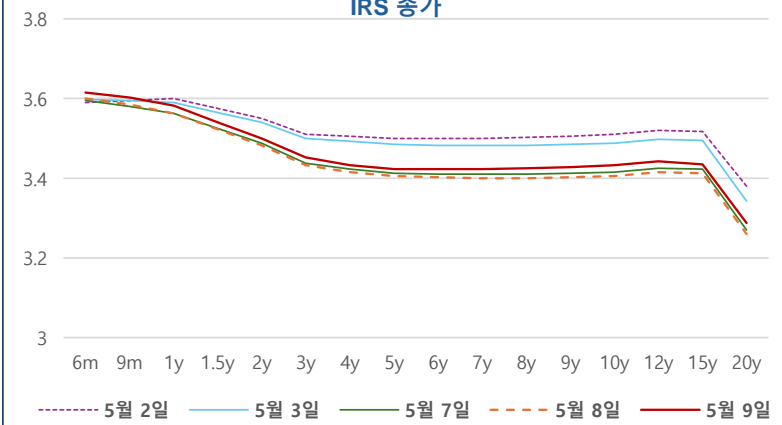
IRS 데일리 증가

5월 9일

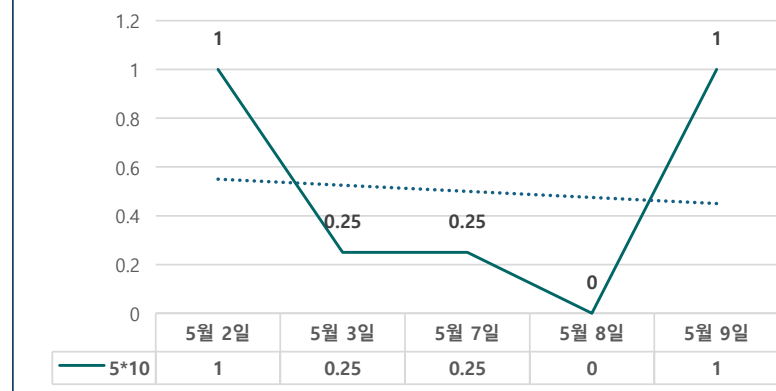
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6150	1.50
9m	3.6025	1.75
1y	3.5825	2.00
1.5y	3.5400	1.75
2y	3.5000	1.75
3y	3.4525	2.00
4y	3.4325	1.75
5y	3.4225	1.75
6y	3.4225	2.00
7y	3.4225	2.25
8y	3.4250	2.50
9y	3.4275	2.50
10y	3.4325	2.75
12y	3.4425	2.75
15y	3.4350	2.25
20y	3.2875	2.75

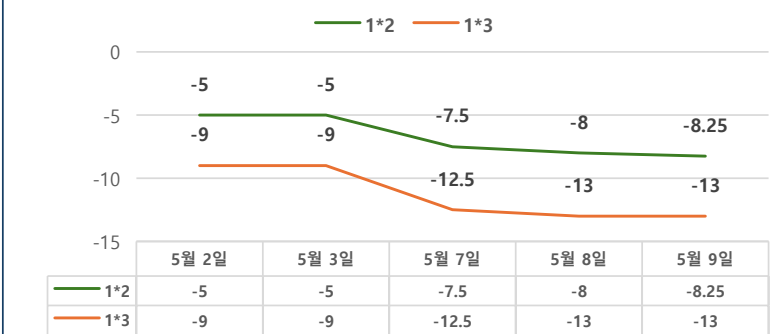
IRS 증가



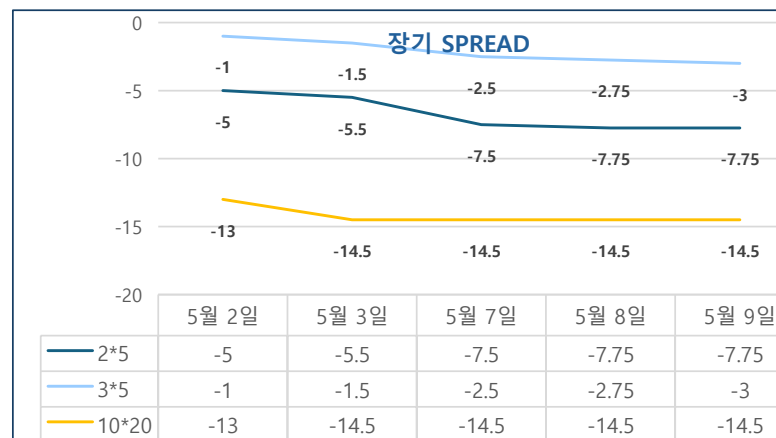
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

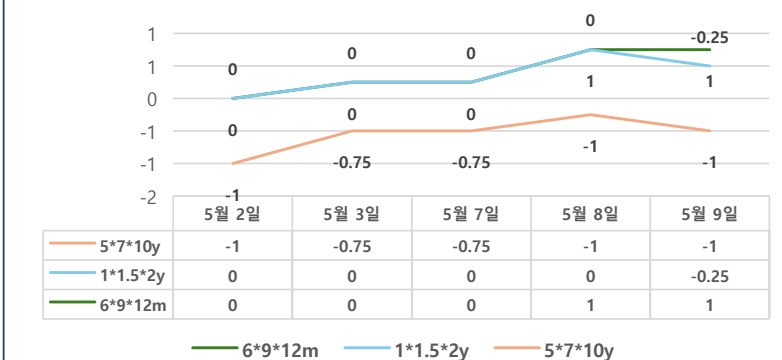


IRS 주요 커브

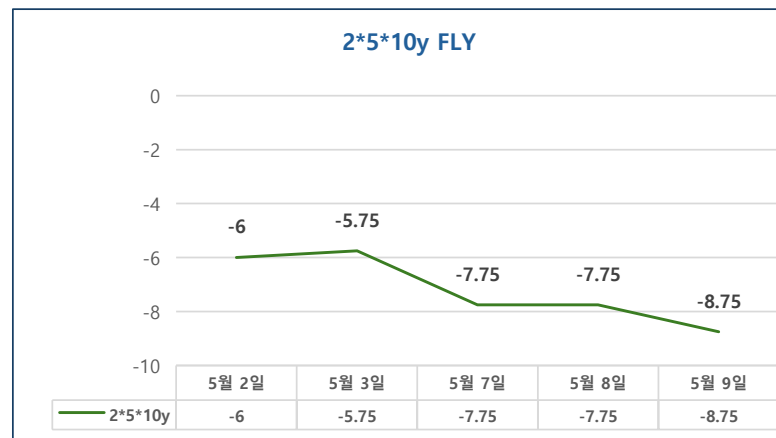
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-8.25	-0.25
1*3y	-13.00	0.00
2*5y	-7.75	0.00
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	1.00	1.00
10*20y	-14.50	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.75	0.00
1*1.5*2y	-0.25	-0.25
2*5*10y	-8.75	-1.00
5*7*10y	-1.00	0.00