

Market Daily Report



2024.05.13(월)

레포	원천세 본산 및 국고여유자금 환수 영향으로 자금 이탈 계속되겠으며, 은행 적수폭 마이너스 폭 확대되어 조달 이어질 전망, 일부 은행권 매수 가담 없다면 매우 타이트한 수급 이어질 것으로 예상
채권	한국 : 국고채 금리는 소폭 하락함. 미국 주간 고용지표가 부진하게 나온 영향으로 분석됨. 외국인도 국채선물 매수로 강세 에 압력을 더함. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승마감. 기대 인플레이션 상승으로 연준의 금리인하 가능성에 약간의 의구심을 가지는 양상임. 또한 장중 오후에 연준 당국자들이 대거 '금리인상 카드'를 배제하지 않을 것이라는 언급 이후 시장 분위기가 다시 매파 쪽에 초점을 맞춤.
MONEY	어제 선제적으로 하락했던 아시아장 달러 1년금리는 미국채 강세에도 횡보세 보임. 대만계 렌더들의 일회성 매칭 수요였을 것으로 추정되며 5.60/5.55%로 전일 체결금리 하단에 비드 대기함. 서울마켓 단기 예치성 자금 유입으로 1주-END MAY까지 잉여 증가해 1주 5.38% 2주 5.41%로 제시됐지만 서울 참가자들 단기자 입 수요 부재로 거의 역외로 매칭됨.
FX SWAP	FX스와프포인트는 미국의 고용둔화 소식에 미국채 금리가 소폭 하락함에 따라 대부분 상승함. 스와프포인트는 미국의 실업수당 청구건수가 나쁘게 나오자 미국 국채금리가 빠짐에 연동하는 모습을 보였지만 변동폭은 크지 않았던 것으로 보임. 최근 발표되는 경제지표가 확실한 방향을 만들지는 못함세, 스와프거래도 대부분 스프레드 거래가 많이 나오는듯 했으며, 이는 최근 시장의 변동성을 제한적으로 만든것으로 판단됨.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 국고채 선물에 연동되면서 움직이는 분위기였으며, 특이한 것없이 전체적으로 한산한 모습을 보임. 장 초반에 7년쪽으로 호가가 형성되면서 40에 거래가 이뤄졌으며 ND/D로 초이스가 이뤄짐. 장 막판에 5년 오퍼가 내려오면서 40.25에 거래가 이뤄졌으며, 2*5년이 -7.75까지 거래가 되면서 커브 레벨이 움직임. 마감 뒤 2년 오퍼가 48.25까지 내려오면서 거래 됐으며, 3년이 43.25에 ND 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준			
						금리	전일대비		
2024.05.02(목)	182.2	200.3	3.50%	3.489%	3.500%	3.57%	2년물	4.874%	4.8
2024.05.03(금)	192.2	207.0	3.30%	3.475%		3.58%	5년물	4.519%	4.5
2024.05.07(월)	187.2	210.5	3.52%	3.500%		3.58%	10년물	4.501%	4.2
2024.05.08(수)	188.2	210.9	3.52%	3.500%		3.58%	30년물	4.642%	3.1
2024.05.08(수)	191.4		3.43%	3.485%		3.58%	10Y-2Y	-37.3	-0.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,727.63	15.49	26-03-10	국고 24-3	828	은행채 7,200	은행채 1,200	국고채 10년 16,000
KOSDAQ	864.16	-5.99	54-03-10	국고 24-2	635	여전채 4,380	여전채 8,550	국고채 10년(선매출) 11,000
달러-원	1,368.10원	-2.00원	25-04-02	통안채	630	회사채 470	회사채 3,350	통안채 91일 7,000
국고3Y	3.440%	-1.3	51-03-10	국고 21-2	-400		공사채 600	
국고10Y	3.538%	-1.8	24-06-10	국고 22-7	-750			
국고10Y-3Y	9.8	-0.5	25-09-10	국고 20-6	-800			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.35	0.00	O/N	5.38	5.28	5.33	0.00
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.40	5.30	5.36	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	-0.01
1S	5.53	5.43	5.47	0.00	1S	5.60	5.50	5.55	0.00
3S	5.63	5.53	5.57	0.00	3S	5.70	5.60	5.65	0.00
6S	5.65	5.55	5.61	-0.03	6S	5.73	5.63	5.67	0.00
1YR	5.65	5.50	5.57	-0.03	1YR	5.70	5.60	5.65	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-22/-20	-20.0	5.26	-0.08	3.50	5.31000	1M MAR	-221	-219
TN	-8/-7.5	-7.5	5.46	-0.07	3.50	5.31036	1W*1S	-175	-170
1W	-54/-52	-53	5.50	0.00	3.50	5.31253	1*2	-228	-223
1S	-230/-225	-225	5.49	0.00	3.53	5.32085	1*3	-440	-438
3S	-685/-675	-680	5.55	0.01	3.58	5.32353	1*6	-1170	-1120
6S	-1380/-1370	-1380	5.65	0.00	3.62	5.28979	1*9	-1840	-1810
1YR	-2880/-2740	-2750	5.74	-0.02	3.64	5.14959	1*12	-2480	-2460

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)

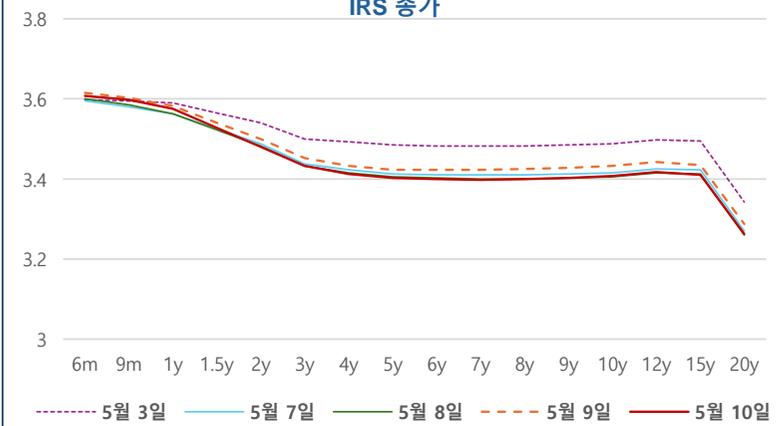
IRS 데일리 증가

5월 10일

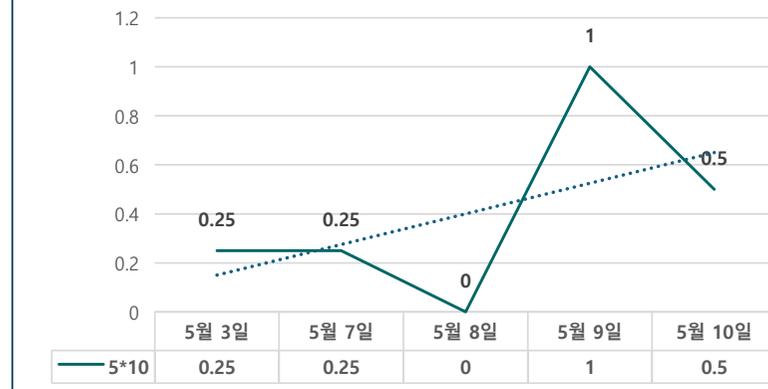
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6075	-0.75
9m	3.5975	-0.50
1y	3.5750	-0.75
1.5y	3.5275	-1.25
2y	3.4800	-2.00
3y	3.4325	-2.00
4y	3.4125	-2.00
5y	3.4025	-2.00
6y	3.4000	-2.25
7y	3.3975	-2.50
8y	3.4000	-2.50
9y	3.4025	-2.50
10y	3.4075	-2.50
12y	3.4175	-2.50
15y	3.4100	-2.50
20y	3.2625	-2.50

IRS 증가



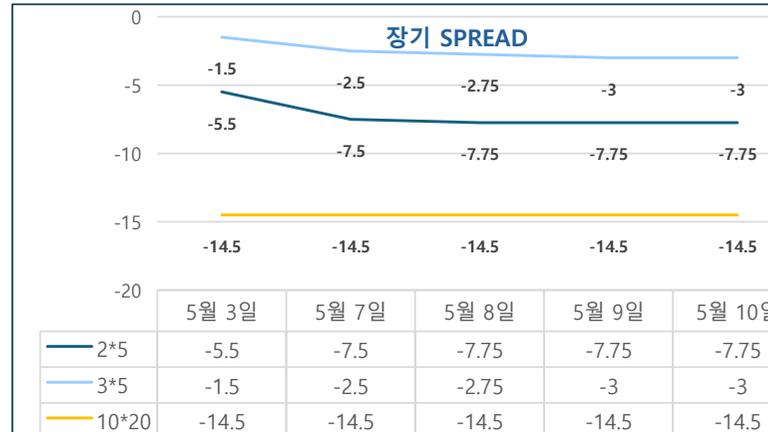
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

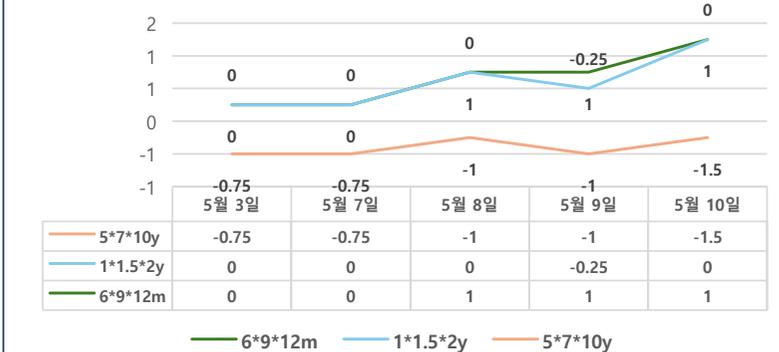


IRS 주요 커브

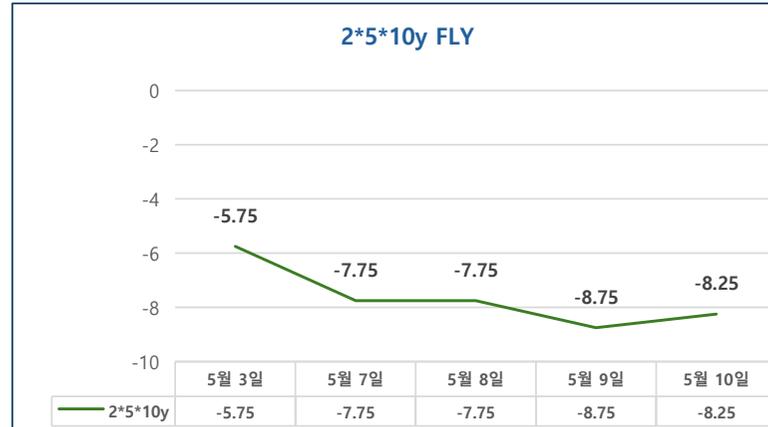
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-9.50	-1.25
1*3y	-14.25	-1.25
2*5y	-7.75	0.00
3*5y	-4.00	0.00
5*10y	0.50	-0.50
10*20y	-14.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	1.25	0.50
1*1.5*2y	0.00	0.25
2*5*10y	-8.25	0.50
5*7*10y	-1.50	-0.50