

Market Daily Report



2024.05.17(금)

레포	공모주 및 실권주(노브랜드, 원팩) 청약자금 유입되어 금리 하락한 가운데 조달여건 크게 개선되어 장 초반부터 매도 해소 원활하였음. 당일지주 부족세 지속됨에 따라 은행권 콜-레포 조달 꾸준했으나 레포 매도 희망금리 3.50% 이하로 형성되어 거래 제한적이었음.
채권	한국 : 국고 금리는 큰 폭으로 하락 마감함. 美 CPI 예상치 하회로 채권/원화/주식 모두 강세를 보임, 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 상승 마감함. 수입 물가가 WSJ 예상치인 0.3% 상승에서 0.9% 상승으로 큰 폭 상회한 결과는 연료와 비연료 수입 물가가 모두 올랐음. 이에 매수세가 위축되는 결과를 보임. CPI 결과에 대해서도 연준인사들은 여전히 연준이 원하는 수준을 달성하지 못했다는 시각이 존재.
MONEY	미국 4월 CPI 예상 소폭 하회 & 파월의장도 금리 인상 고려 없고 PPI상승은 전월치기 -로 수정된것 봤을 때 혼재되어 있다 의미 축소하자 9월인하 가능성 견고해짐. 달러 머니 1년물 5.53%까지 내려와 전일 비 오퍼 RATE -4BP 하락. 아시아인 PEER들은 3달 이내 금리만 강한 상승세 보이며 3달 5.60-5.70까지 비드해 3달-1년 금리 역전 폭 커짐. CASH는 원달러 환율이 1340원대 까지 강해지며 롱 줄어 오버나잇 체결 5.37-5.39 타이트해지고 1주스왑도 환산금리 5.58%까지 상승하자 국내장 1달이내 오퍼도 일시 위축됨.
FX SWAP	외환스왑포인트는 미국의 오는 9월 금리 인하 기대감이 되살아남에 따라 장기물 위주로 상승함. 2년물 미국채 금리가 2거래일동안 14bp, 10년물은 14.60 bp가 하락함에 따라 스왑포인트도 연동하는 모습을 보였으며, 그동안 상대적으로 많이 밀렸던 1년이 6개월 스왑에 비해 더 오를 것으로 파악됨. 1달 스왑은 양방향 수급이 팽팽하게 나오며 보합세를 보였고, 초단기는 다소 밀리긴했지만 특별한 이슈는 없었던 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 미국의 물가 상승률이 예상 수준으로 둔화한 데 힘 입어 큰 폭으로 하락 마감, 지난밤 발표된 미국의 4월 물가 상승률이 시장 예상치에 대체로 부합하는 수준으로 둔화한 것으로 발표됐으며, 물가가 상승 되는 것이 지속될 것이라는 우려가 있던 시장에는 호재로 작용되면서 달러-원 환율도 1350선 아래로 급락하는 모습을 보임, 시장에서 4.5,10년쪽으로 거래가 많이 이뤄졌으며 10*20년이 -14.5까지 거래 소식이 들림, 장 막판에 10년이 비드 다소 올라오면서 34.5에 거래되었고, 34.25 오퍼까지 바로 나오면서 다소 레벨이 높았으며, 장 마감 후 2년이 44.75에 거래가 이뤄지고, 5년이 34.25 오퍼가 나옴,

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.05.09(목)	191.4	208.8	3.43%	3.500%	3.500%	3.58%	2년물	4.806%	7.2
2024.05.10(금)	186.6	206.1	3.53%	3.546%		3.58%	5년물	4.406%	5.5
2024.05.13(월)	188.1	204.9	3.57%	3.546%		3.59%	10년물	4.379%	3.4
2024.05.14(화)	190.0	205.2	3.57%	3.563%		3.60%	30년물	4.516%	1.3
2024.05.16(목)	194.1		3.53%	3.542%		3.60%	10Y-2Y	-42.7	-3.8

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,753.00	22.66	27-06-10	국고 24-4	600	회사채 134	여전채 1,850	주금공 MBS 2024-10 4,800
KOSDAQ	870.37	8.22	29-03-10	국고 24-1	320		회사채 125	
달러-원	1,345.00원	-24.10원	33-06-10	국고 23-5	300		공사채 1,500	
국고3Y	3.375%	-7.9	52-03-10	국고 22-2	-227			
국고10Y	3.458%	-8.8	25-10-02	통안채	-320			
국고10Y-3Y	8.3	-0.9	26-12-10	국고 23-10	-600			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.37	0.02	O/N	5.38	5.28	5.35	0.00
TN	5.40	5.30	5.38	0.00	TN	5.40	5.30	5.37	0.00
1W	5.45	5.35	5.41	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.53	5.43	5.50	0.02	1S	5.60	5.50	5.53	0.00
3S	5.63	5.53	5.60	0.02	3S	5.70	5.60	5.67	0.00
6S	5.65	5.55	5.60	0.00	6S	5.73	5.63	5.68	0.00
1YR	5.60	5.50	5.54	-0.02	1YR	5.65	5.55	5.65	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-7.5	-8.0	5.64	0.03	3.50	5.31000	1M MAR	-235	-230
TN	-25/-24	-24.0	5.64	0.17	3.50	5.31035	1W*1S	-168	-165
1W	-63/-62	-62	5.58	0.10	3.50	5.31246	1*2	-225	-215
1S	-235/-230	-230	5.53	0.10	3.53	5.32055	1*3	-440	-430
3S	-680/-675	-675	5.58	0.05	3.59	5.32933	1*6	-1120	-1110
6S	-1380/-1360	-1380	5.67	0.00	3.62	5.29573	1*9	-1800	-1780
1YR	-2710/-2700	-2700	5.75	-0.01	3.65	5.15640	1*12	-2425	-2410

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 / 12.17~12.18D
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)

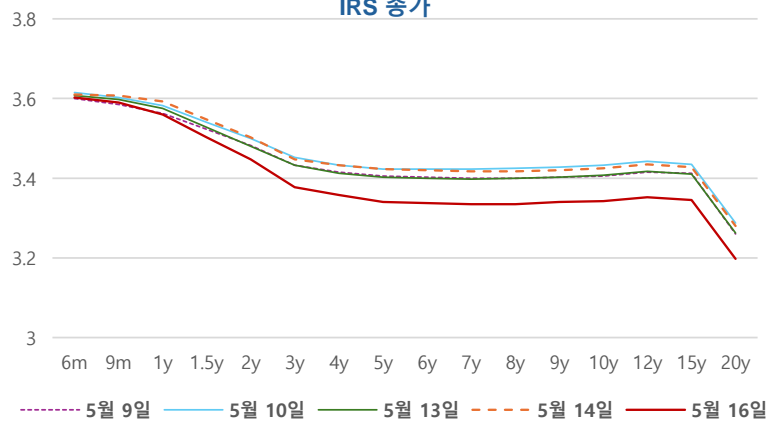
IRS 데일리 증가

5월 14일

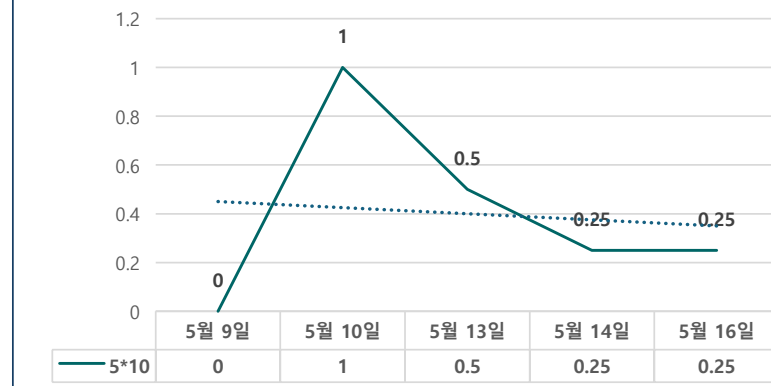
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6025	-0.75
9m	3.5900	-1.75
1y	3.5600	-3.25
1.5y	3.5025	-4.50
2y	3.4475	-5.50
3y	3.3775	-7.00
4y	3.3575	-7.50
5y	3.3400	-8.25
6y	3.3375	-8.25
7y	3.3350	-8.25
8y	3.3350	-8.25
9y	3.3400	-8.00
10y	3.3425	-8.25
12y	3.3525	-8.25
15y	3.3450	-8.25
20y	3.1975	-8.25

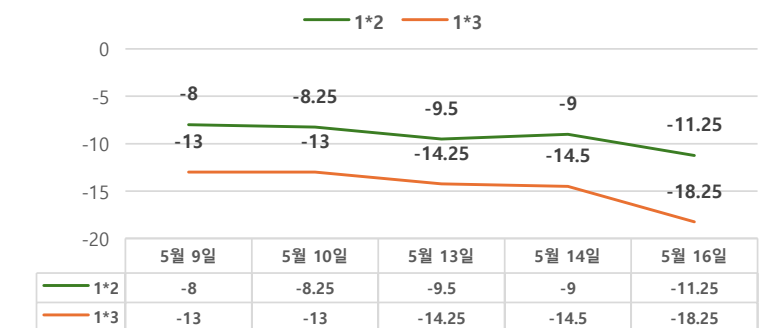
IRS 증가



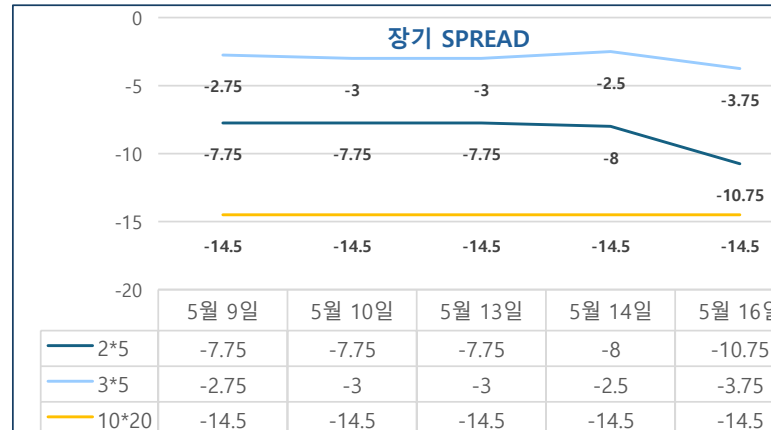
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

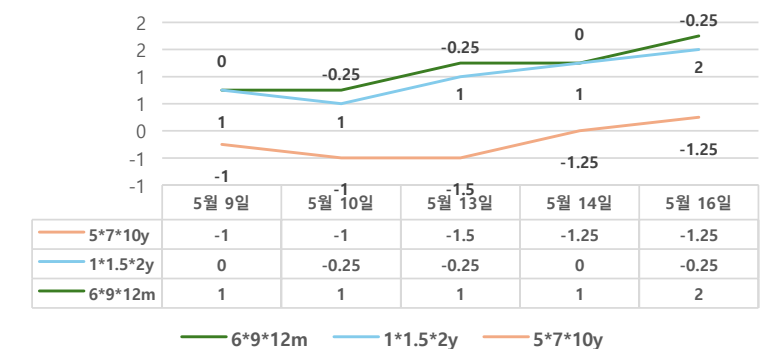


IRS 주요 커브

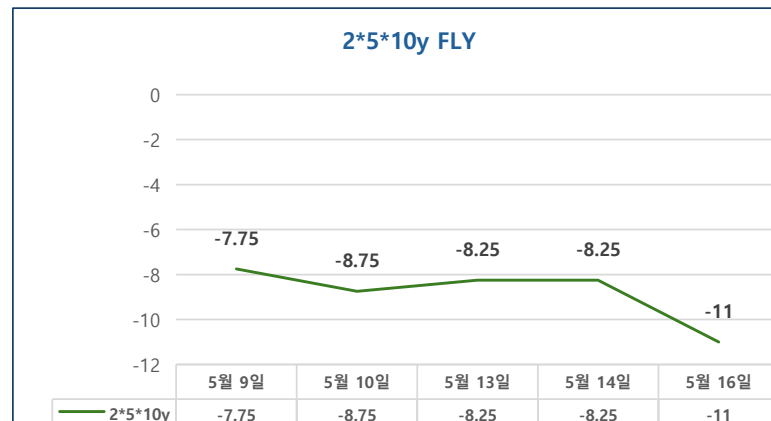
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-11.25	-2.25
1*3y	-18.25	-3.75
2*5y	-10.75	-2.75
3*5y	-4.00	-1.25
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	1.75	0.50
1*1.5*2y	-0.25	-0.25
2*5*10y	-11.00	-2.75
5*7*10y	-1.25	0.00