

Market Daily Report



2024.04.17(수)

레포	건보자금 및 공자자금 유입 이어져 운용사-신탁 중심 잉여세 심화됐으며, 장 초반부터 시은 저금리 매도 활발한 모습을 보임. 동안계정 2개 종목(28일물/7일물)으로 나눠 증액 실시했음에도 장 중 추가 조달 많지 않아 익일물 및 기일물 체결금리 하락하였음.
채권	미 국채금리는 일제히 상승 마감. 승총 불안이 지속되는 가운데, 파월 의상이 금리 인하 시기를 늦출 수 있다는 발언을 내놓으면서 매도 심리가 우위. 2년 만기 미 국채 금리는 장 중 한때 5.017%로 고점을 높임. 10년물 금리도 장 중 4.698%까지 튀어 오르며 작년 11월 이후 최고치 기록. 파월 의장은 이날 "최근의 경기지표는 인플레이션이 연준의 목표치를 향해 가고 있다는 자신감을 더해 주지 못했다"며 "오히려 그런 자신감을 갖는 데 예상보다 더 오래 걸릴 가능성이 있다는 것을 나타냈다" 발언.
MONEY	미국 소매 판매지표 예상 2배 상회, 1분기 GDP 전망치도 상향. 샌프란시스코 연은 총재 "금리 인하할 긴급한 상황 아니다" 밝혀 연준 내부의 선부른 금리인하 경계론 재부각, 연방기금선물 반영 24년말 금리는 4.90%(35BP인하).원달러 1400원터치에도 달러 롱포지션 영향 국내 달러자금은 1달 이내 남는 방향 변동없으나 해외 장 기간물 레벨 상승에 노출되어 3달~1년 5.65%선 금리까지 체결 가능 금리대 열여뒤.
FX SWAP	6개월 이상 장기물 위주로 밀리는 장세가 지속 되었으며, 증가는 6개월 1년 각각 데일리 -8전 밀로 내려가며 하락폭을 키움. 장중에는 긴 테너 위주로 손절성 매도로 추측되는 오퍼가 보이기도 했고, 에셋스와프까지 나오면서 낙폭이 커지는 모습을 보임. 최근 중동발 지정학적 이슈와 미국 경제지표 호조가 물가상승을 자극하는 한 스와프포인트는 하방 압력이 지속될 것으로 사료됨
IRS	전일 IRS는 중동정세와 환율 급등 등에 따른 위험 심리가 반영되면서 상승 마감. 중동 정세의 불안이 지속되는 분위기 속에, 소매 판매 지표가 시장예상보다 양호하게 발표되면서 미 국채 금리가 금등함에 따라 이에 연동되어 움직임. 장 막판에 5년과 7년쪽으로 비드가 올라왔으며, 장 마감후에도 3년 쪽으로 호가가 나오면서 49.25-5 레벨에 여러 차례 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
						한국시간 오전 07:05 기준		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2024.04.09(화)	190.3	203.6	3.55%	3.461%	3.500%	3.57%	2년물 5.00%	6.7
2024.04.11(목)	188.4	202.8	3.50%	3.503%		3.57%	5년물 4.71%	8
2024.04.12(금)	187.0	205.0	3.45%	3.500%		3.56%	10년물 4.67%	6.4
2024.04.15(월)	188.0	205.2	3.40%	3.494%		3.56%	30년물 4.77%	4.6
2024.04.16(화)	193.9		3.30%	3.420%		3.56%	10Y-2Y -32.6	0.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,609.63	-60.80	54-03-10	국고 24-2	1,097	은행채 7,100	은행채 6,200	통안채 3년물 1,200
KOSDAQ	832.81	-19.61	28-03-10	국고 23-1	1,000	여전채 1,800	여전채 200	재정증권 63일물 20,000
달러-원	1,394.50원	10.50원	32-12-10	국고 22-14	213	회사채 4,800	공사채 1,300	
국고3Y	3.469%	2.9	31-06-10	국고 21-5	-200			
국고10Y	3.618%	5.7	31-12-10	국고 11-7	-300			
국고10Y-3Y	14.9	2.8	25-09-03	통안채	-700			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.37	5.27	5.32	-0.01	O/N	5.40	5.30	5.37	0.02
TN	5.40	5.30	5.36	0.00	TN	5.45	5.35	5.38	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.50	5.40	5.43	0.00
1S	5.55	5.45	5.52	0.02	1S	5.65	5.55	5.58	0.00
3S	5.70	5.60	5.63	-0.02	3S	5.70	5.60	5.68	0.00
6S	5.75	5.65	5.68	-0.02	6S	5.75	5.65	5.70	-0.05
1YR	5.70	5.60	5.65	0.00	1YR	5.75	5.65	5.70	-0.04

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.31	-0.27	3.50	5.31000	1M MAR	-225	-222
TN	-8/-7.5	-7.5	5.44	-0.01	3.50	5.31021	1W*1S	-174	-170
1W	-52/-49	-50	5.36	0.00	3.50	5.31146	1*2	-215	-210
1S	-235/-230	-230	5.37	0.02	3.51	5.31624	1*3	-450	-435
3S	-720/-690	-690	5.53	0.00	3.55	5.31707	1*6	-1200	-1180
6S	-1500/-1450	-1470	5.70	0.02	3.57	5.28184	1*9	-2010	-1980
1YR	-3010/-2980	-2980	5.80	0.04	3.57	5.17207	1*12	-2710	-2690

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)

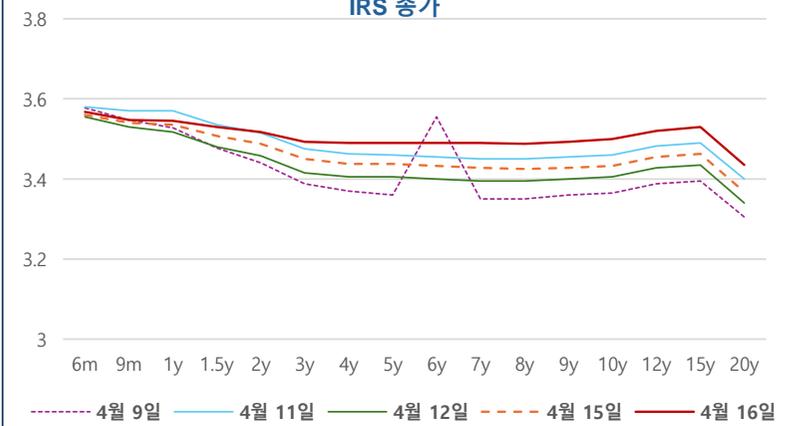
IRS 데일리 증가

4월 16일

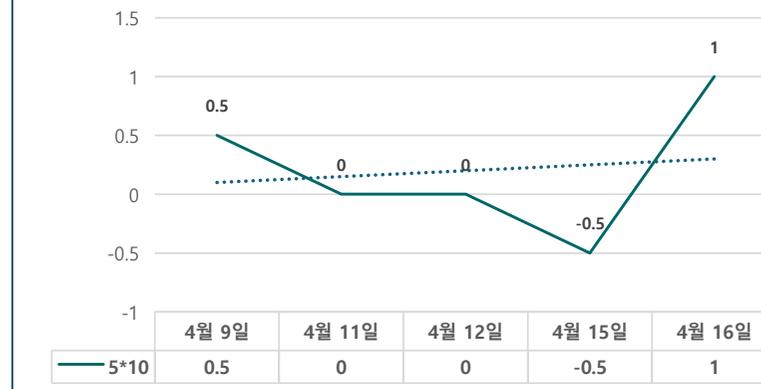
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5675	0.75
9m	3.5475	0.75
1y	3.5450	1.00
1.5y	3.5300	2.25
2y	3.5175	3.00
3y	3.4925	4.25
4y	3.4900	5.25
5y	3.4900	5.25
6y	3.4900	5.75
7y	3.4900	6.25
8y	3.4875	6.25
9y	3.4925	6.50
10y	3.5000	6.75
12y	3.5200	6.50
15y	3.5300	6.75
20y	3.4350	6.75

IRS 증가



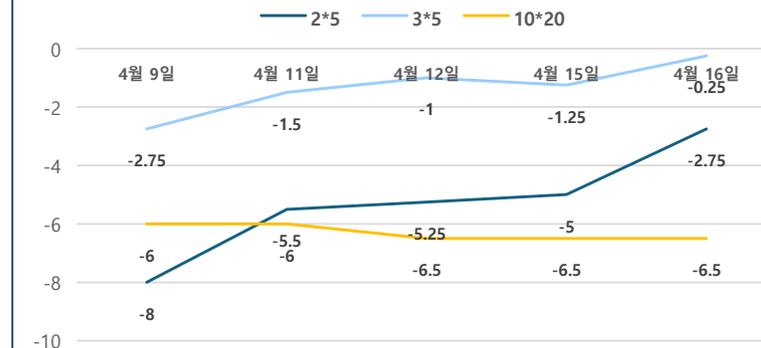
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

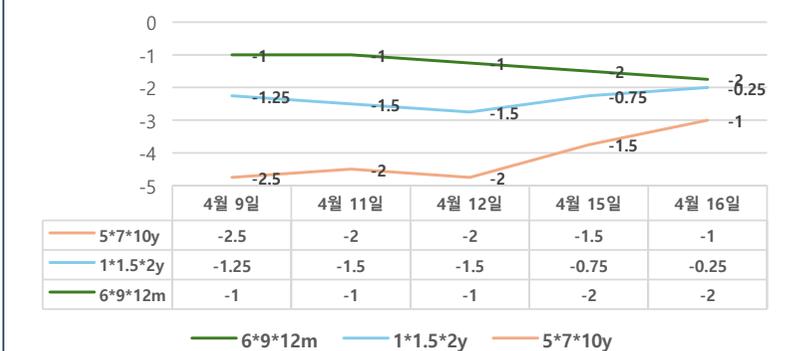


IRS 주요 커브

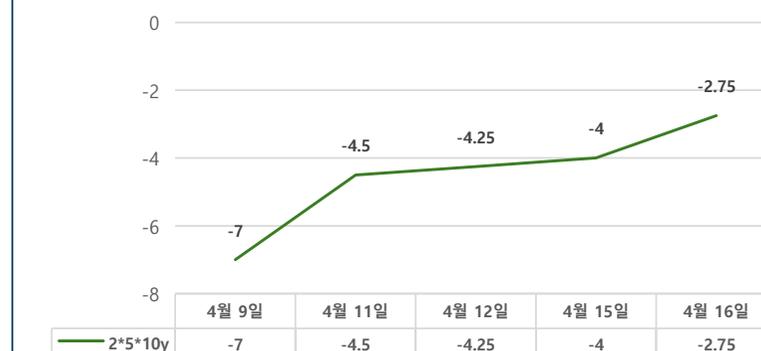
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-2.75	2.00
1*3y	-5.25	3.25
2*5y	-2.75	2.25
3*5y	-4.00	1.00
5*10y	1.00	1.50
10*20y	-6.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.75	-0.25
1*1.5*2y	-0.25	0.50
2*5*10y	-2.75	1.25
5*7*10y	-1.00	0.50