

# Market Daily Report



2024.04.18(목)

<b>레포</b>	별다른 자금 이탈요인 없어 레포금리 보합 출발했으며, 시은 조달에 적극적으로 나서 잉여 자금 일찌감치 소진되었음. 장 증 일시적인 부족세 형성되기도 했으나 추가 매수 유입되어 수급 무난하였음. 향후 자금 흐름도 양호할 것으로 기대되어 기일물 3.40% 초반 유지되었음.
<b>채권</b>	미 국채금리는 하락 마감. 장 초반 국채금리는 보험권에서 혼조 양상. 이란과 이스라엘의 무력 갈등이 소강상태를 보이자 경계심을 갖고 큰 폭의 움직임을 자제. 하지만 오후로 접어들며 국채금리는 낙폭 확대. 3주동안 지속된 약세에 저가 매수 심리가 강해진 데다, 미국 재무부가 진행한 20년물 국채 입찰에서 강한 수요가 확인된 이유로 풀이.
<b>MONEY</b>	파월, "제약적인 금리 좀 더 용인해야" 발언해 입장 변화 보이자 시장은 연내 1회 인하 가능성 베팅이 증가, 1회 인하 후 데이터 지켜볼 것으로 보여 머니 금리는 9개월 (연말 커버 1월 만기물)이 가장 높게 형성, 한국계 1년물 역의 오피 5.70% 제시되어 5.70/5.65 마감. 한편 한일 공조 구두개입으로 원달러 1380원대까지 약세 진정되자 롱 포지션 정리와 지난 양쪽 간의 네고 여파로 투데이 자금 급감, 오버나잇 5.32-5.36 형성되며 타이트 전환. 다행히 1주-1달 구간 운용 여력은 레벨 상향 조정 후 다시 제시되어 1주 5.43 1달 5.53 이내 운용 여력은 이어짐.
<b>FX SWAP</b>	간밤에 제롬 파월 연방준비제도 의장의 금리 인하 지연 발언과 에셋스와프에 장기를 위주로 다시 밀리는 장세를 보이며, 1년은 전일 대비 20전 하락한 -3010전에 증가를 형성함. 전일 하락폭이 컸던만큼 시장은 스왑포인트를 더 밀기 보다 지켜보자는 심리가 강했고 조용한 장세를 이어감.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 소폭 하락 마감, 제롬 파월 연방준비제도(Fed.연준) 의장이 매파적인 발언을 내놓는 등 금리 인하 지연에 대한 우려가 여전히 남아있는 분위기. 동시호가 후 선물이 상승 마감하면서, IRS도 이에 연동되어 움직임. 3년과 5년쪽으로 호가가 형성됐으며 5년이 47.5-47.75 레벨에 거래가 몇차례 이뤄짐. 장 막판에 3*5년이 레깅으로 0.25에 거래되면서, 5*10년과 3*10년이 1.5와 1.25 레벨에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리				
						단위 : 조 원	한국시간 오전 07:05 기준			단위 : bp
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)		금리	전일대비	
2024.04.11(목)	188.4	202.8	3.50%	3.503%	3.500%	3.57%	2년물	4.94%	-5.5	
2024.04.12(금)	187.0	205.0	3.45%	3.500%		3.56%	5년물	4.62%	-8.5	
2024.04.15(월)	188.0	205.2	3.40%	3.494%		3.56%	10년물	4.59%	-7.9	
2024.04.16(화)	193.9	208.4	3.30%	3.420%		3.56%	30년물	4.70%	-6.3	
2024.04.17(수)	200.7		3.30%	3.485%		3.55%	10Y-2Y	-35	2.4	

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	2,584.18	-25.45	54-03-10	국고 24-2	1,300	은행채 3,500	은행채 3,400	
KOSDAQ	833.03	0.22	24-09-10	국고 14-5	800	여전채 3,300	여전채 2,300	
달러-원	1,386.80원	-7.70원	30-12-10	국고 20-9	500	회사채 222	회사채 7,200	
국고3Y	3.475%	0.6	52-03-10	국고 22-2	-300		공사채 700	
국고10Y	3.632%	1.4	25-06-10	국고 22-4	-560			
국고10Y-3Y	15.7	0.8	25-03-10	국고 23-3	-619			

Money Market Closing									
					단위 : % %p				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.42	5.32	5.36	0.04	O/N	5.40	5.30	5.37	0.00
TN	5.42	5.32	5.37	0.01	TN	5.45	5.35	5.38	0.00
1W	5.45	5.35	5.41	0.01	1W	5.50	5.40	5.43	0.00
1S	5.55	5.45	5.52	0.00	1S	5.65	5.55	5.58	0.00
3S	5.70	5.60	5.65	0.02	3S	5.75	5.65	5.70	0.02
6S	5.75	5.65	5.70	0.02	6S	5.75	5.65	5.72	0.02
1YR	5.75	5.60	5.68	0.03	1YR	5.80	5.70	5.75	0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD			
							단위 : 전, %, %p	단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER	
O/N	-8/-7.5	-8	5.45	0.14	3.50	5.32000	1M MAR	-220	-218	
TN	-7.5/-7	-7.0	5.32	-0.12	3.50	5.31996	1W*1S	-177	-172	
1W	-51/-49	-50	5.36	0.00	3.50	5.31974	1*2	-220	-215	
1S	-235/-230	-230	5.45	0.08	3.51	5.31889	1*3	-450	-440	
3S	-700/-680	-690	5.55	0.02	3.55	5.32693	1*6	-1210	-1190	
6S	-1500/-1450	-1480	5.71	0.01	3.57	5.30482	1*9	-1980	-1960	
1YR	-3010/-2980	-3010	5.84	0.04	3.57	5.22001	1*12	-2700	-2670	

국내의 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)

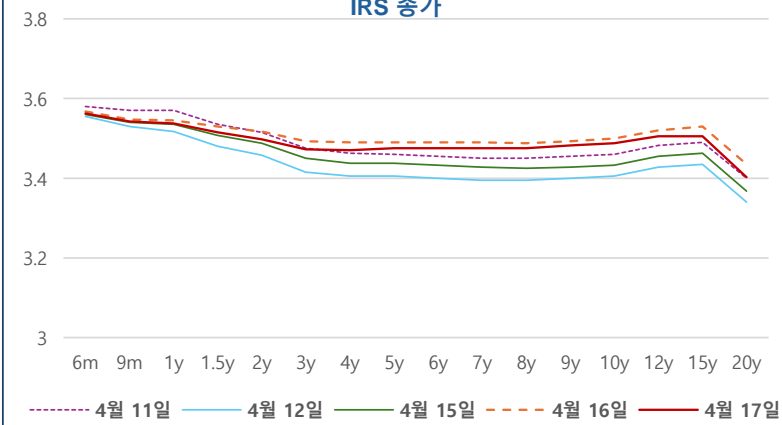
IRS 데일리 증가

4월 17일

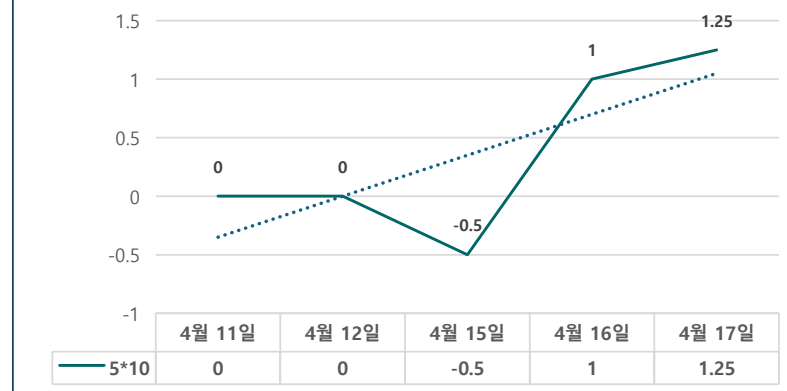
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5625	-0.50
9m	3.5425	-0.50
1y	3.5375	-0.75
1.5y	3.5150	-1.50
2y	3.4975	-2.00
3y	3.4725	-2.00
4y	3.4700	-2.00
5y	3.4750	-1.50
6y	3.4750	-1.50
7y	3.4750	-1.50
8y	3.4750	-1.25
9y	3.4825	-1.00
10y	3.4875	-1.25
12y	3.5050	-1.50
15y	3.5050	-2.50
20y	3.4025	-3.25

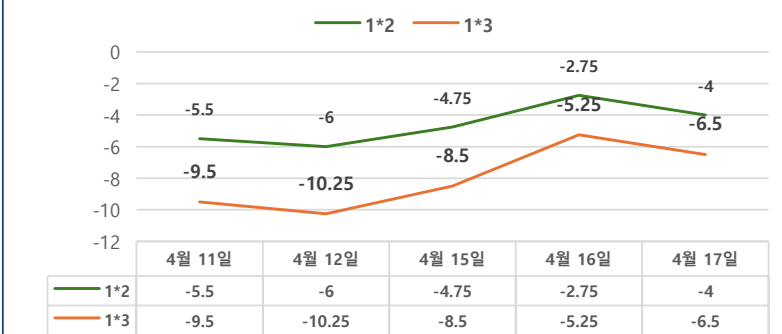
IRS 증가



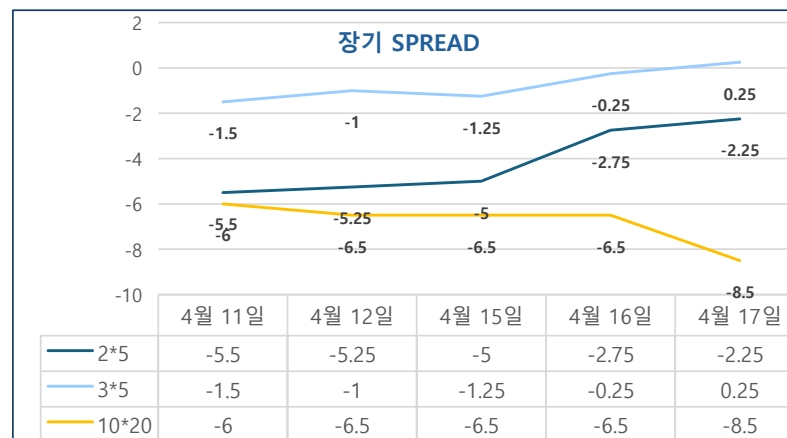
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

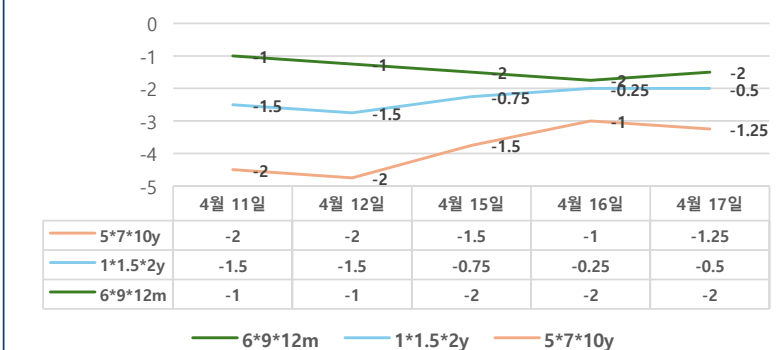


IRS 주요 커브

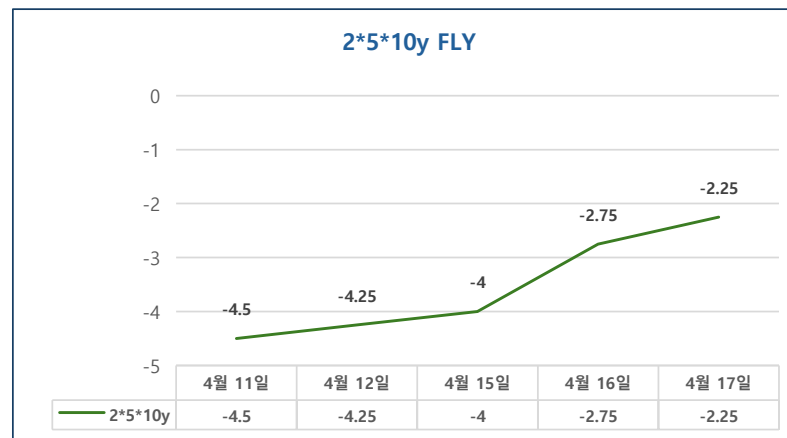
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-4.00	-1.25
1*3y	-6.50	-1.25
2*5y	-2.25	0.50
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	1.25	0.25
10*20y	-8.50	-2.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.50	0.25
1*1.5*2y	-0.50	-0.25
2*5*10y	-2.25	0.50
5*7*10y	-1.25	-0.25