

Market Daily Report



2024.04.19(금)

레포	전일 타이트했던 수급 상황 반영되어 금리 상승 출발했으며, 장 초반부터 시은 매도 몰려 수급 빠듯한 모습을 보임. 한편 RP 재매각 규모 크게 줄어 은행권 안정을 되찾았으나 장 중 추가 매수 많지 않아 막판까지 조달 정체되었음.
채권	미 국채금리는 일제히 상승함. 시장은 연준 인사들의 매파적 발언에 영향을 받으며 국채금리를 밀어올림. 그간 연준 인사들이 대체로 매파적이지만 신중하게 발언해왔다면, 이제는 연말에나 금리인하가 가능하다거나 금리인상이 불가능한 것도 아니라는 언급 나오기 시작. 이날 발표된 주간 신규 실업보험 청구건수는 예상치 하회함.
MONEY	중동사태가 확산 없는 대치상태 진입하자 유가 하락. 미국채 20년물 입찰에서도 강한 수요 확인해 달러 장기물 금리 상승세 진정. 아시아장은 6달-1년 금리 5.70% 오피 대기한 반면 단기는 2주 월말 커버 수요가 증가. 2주~1년 전 구간 5.50-5.70%사이 형성됨. 한편 당국의 강한 환율안정 의지와 외화유동성에 대한 관심 합쳐져 국내은행들은 최대한 보수적 관리 중임. 자금 잉여와 역외 비드들 상승으로 종전 운용 타겟 수준을 넘어섰지만 운용 중단 뚜렷. 역외 차입 레벨 상승하면서 서울 마켓 비드/오피 갭 추가 확대됨.
FX SWAP	한국과 미국, 일본 당국이 구두 개입에 적극 나서면서 이에 시장이 반응하며 FX스왑포인트는 소폭 강세를 보임. 그러나 오후 들어서는 반등세를 잊지 못하고 바 이셀 실물량이 우위를 점하며 상승폭은 제한적인 모습을 보였음. 시장에서는 중동발 지정학적 리스크가 완전히 해소되지 않은 것으로 받아들이고 있으며, 펀더멘털 자체가 달라진 것이 아니어서 반등폭이 크지 않았던 것으로 보고 있음.
IRS	전일 IRS는 달러-원 환율의 하향 안정화에 영향을 받아 하락 마감. 10*20년 오피가 -10까지 내려오면서 초장기 쪽으로 커브가 움직였으며, 양도성예금증서(CD)의 영향을 받아 9개월 관련해서 스프레드 호가가 많이 보임. 장 막판에 1년 오피가 52.5까지 내려오면서 거래가 이뤄졌으며, 5*6년이 par거래, 3*5년이 -0.5 비드가 나오며 따라 3년쪽 레벨이 다소 높림. 장 마감 후 미국채가 상승함에 따라 1.5년이 495-50, 5년이 42.5까지 올라오고, 2년이 48에 시장거래가 들리면서 전체적으로 레벨이 올라옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.12(금)	187.0	205.0	3.45%	3.500%	3.500%	3.56%	2년물	4.995%	5.2
2024.04.15(월)	188.0	205.2	3.40%	3.494%		3.56%	5년물	4.684%	6.2
2024.04.16(화)	193.9	208.4	3.30%	3.420%		3.56%	10년물	4.638%	4.5
2024.04.17(수)	200.7	211.0	3.30%	3.485%		3.55%	30년물	4.734%	3.1
2024.04.18(목)	200.2		3.40%	3.519%		3.55%	10Y-2Y	-35.7	0.7

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	2,634.70	50.52	24-09-10	국고 14-5	800	은행채 6,000	은행채 8,700	
KOSDAQ	855.65	22.62	54-03-10	국고 24-2	754	여전채 5,000	여전채 9,000	
달러-원	1,372.90원	-13.90원	24-06-06	재정채	500	공사채 11,566	회사채 4,050	
국고3Y	3.427%	-4.8	24-06-10	국고 21-4	-20		공사채 831	
국고10Y	3.562%	-7	29-12-10	국고 19-8	-95			
국고10Y-3Y	13.5	-2.2	52-03-10	국고 22-2	-300			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.36	0.00	O/N	5.40	5.30	5.37	0.00
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.45	5.35	5.40	0.02
1W	5.45	5.35	5.41	0.00	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	0.00	3S	5.75	5.65	5.70	0.00
6S	5.75	5.65	5.70	0.00	6S	5.75	5.65	5.70	-0.02
1YR	5.75	5.60	5.68	0.00	1YR	5.80	5.70	5.73	-0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
						단위 : 전, % , %p			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-7.5	-7.0	5.34	-0.11	3.50	5.31000	1M MAR	-220	-210
TN	-7.5/-7	-22.0	5.42	0.10	3.50	5.31029	1W*1S	-164	160
1W	-51/-49	-49	5.35	-0.01	3.50	5.31206	1*2	-239	-233
1S	-235/-230	-220	5.45	0.00	3.51	5.31882	1*3	-445	-442
3S	-700/-680	-685	5.55	0.00	3.55	5.32656	1*6	-1190	-1170
6S	-1500/-1450	-1450	5.71	0.00	3.57	5.30154	1*9	-1980	-1950
1YR	-3010/-2980	-2970	5.84	0.00	3.58	5.21009	1*12	-2710	-2680

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)

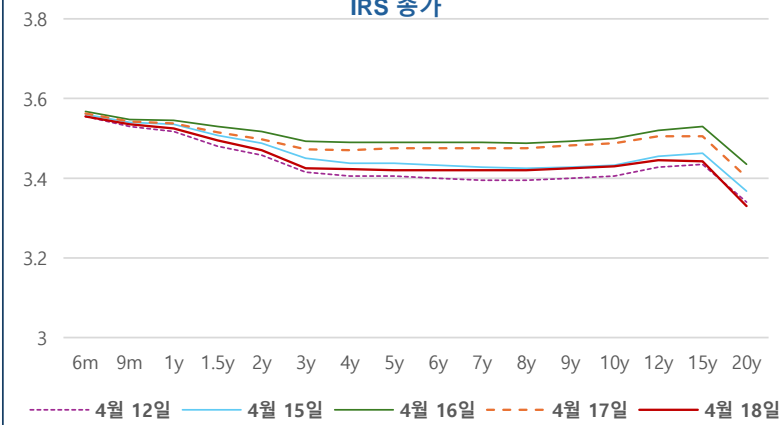
IRS 데일리 증가

4월 18일

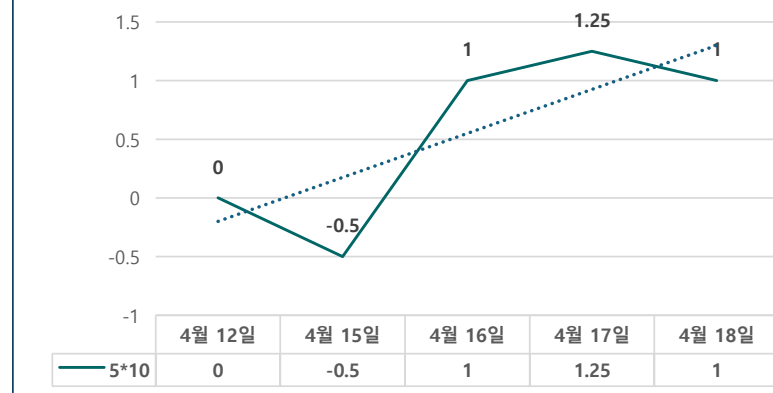
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5550	-0.75
9m	3.5350	-0.75
1y	3.5250	-1.25
1.5y	3.4950	-2.00
2y	3.4700	-2.75
3y	3.4250	-4.75
4y	3.4225	-4.75
5y	3.4200	-5.50
6y	3.4200	-5.50
7y	3.4200	-5.50
8y	3.4200	-5.50
9y	3.4250	-5.75
10y	3.4300	-5.75
12y	3.4450	-6.00
15y	3.4425	-6.25
20y	3.3300	-7.25

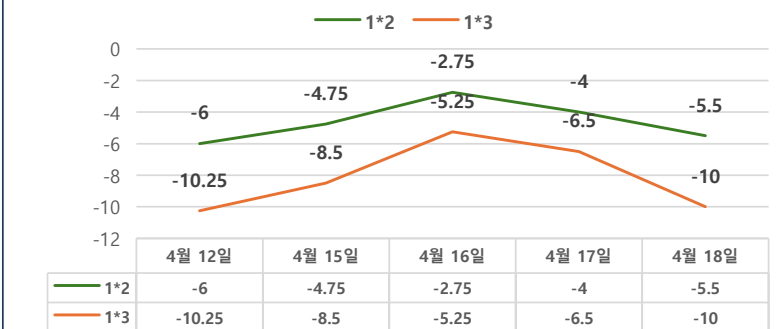
IRS 증가



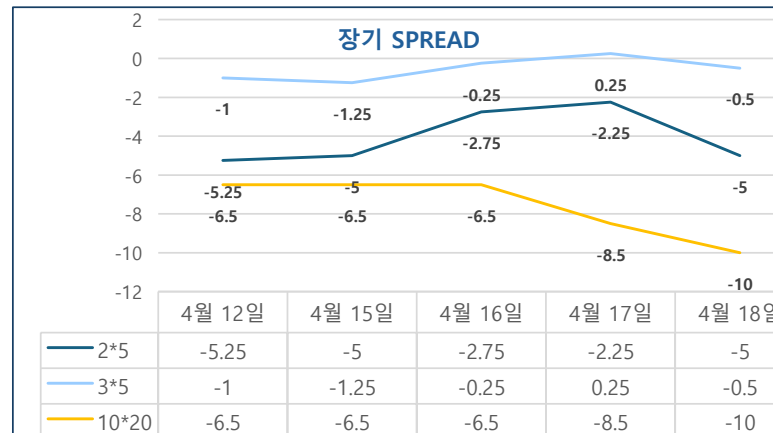
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

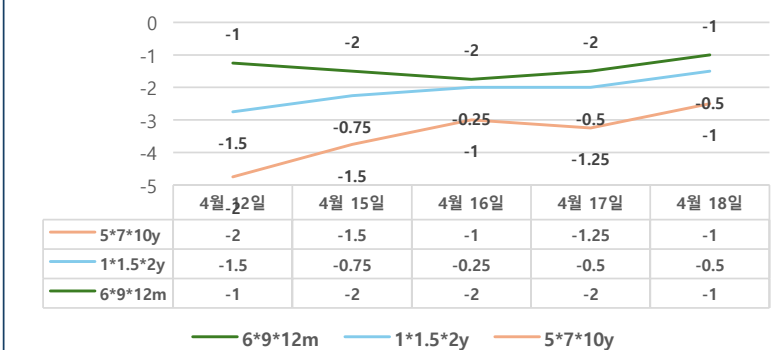


IRS 주요 커브

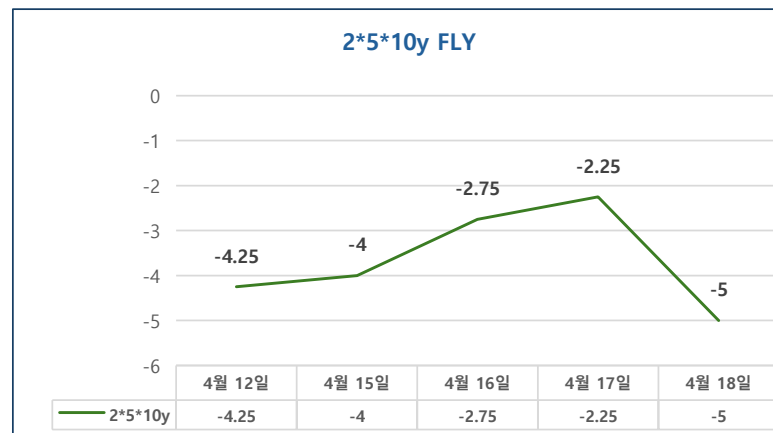
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.50	-1.50
1*3y	-10.00	-3.50
2*5y	-5.00	-2.75
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	1.00	-0.25
10*20y	-10.00	-1.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.00	0.50
1*1.5*2y	-0.50	0.00
2*5*10y	-5.00	-2.75
5*7*10y	-1.00	0.25