

Market Daily Report



2024.04.22(월)

레포	주초 원천세 본납 영향으로 당일기준 잉여폭 축소했으나 지준 적립기간 초반 은행권 조달에 적극적이지 않아 수급 무난하였음. 통안계정 증액 실시했음에도 조달금리 낮은 수준 유지되었고, 건보자금 및 재정 유입되어 운용사-신탁 중심 잉여세 심화되었음. 주 중반 이후 시은 매도 증가하여 금리 상승 전환했으며, 배당금 관련 법인자금 환매됨에 따라 조달여건 악화되었음.
채권	미 국채 금리는 2년물 소폭 상승을 제외 하락 마감함. 이스라엘의 이란 본토 공격으로 10년물 금리가 10bp 이상 급락하였으나 핵 시설이 아닌 군사 시설에 대한 드론 공격임이 보도되며 낙폭을 회복하며 10년물 국채 금리는 1.3bp 하락 마감. 즉각적인 전쟁 확산 우려가 일정 부분 해소되며 단기 차익을 실현한 것으로 풀이 됨.
MONEY	뉴욕연은 의장의 "목표 달성을 위해 인상 해야 된다면 그렇게 하길 원할 것" 발언과 이스라엘의 이란 폭격으로 미국채 금리는 급등락을 오가는 양복달리기. 이에 머니 1년물은 오히려 5.70%오퍼 수준 유효 했으나 단기 장은 중동 리스크에 환율 상승 후 1주-3달까지 금리 상승 압박 받음. 대만계 3달 5.65 중국계 3달 5.75% 까지 체결 상단 올라와 서울 마켓은 peer들 (중국,대만등)의 상승에 연동하고 국내 렌더들의 운용 공백 체감하며 3달 60-65 사이 비드 하는 네임들이 다양해짐. 실수오 펀딩 물량이 국내 장에서 소화되지 못하고 있는 것으로 보임.
FX SWAP	간밤 뉴욕 금융시장에서 금리 인상을 배제하고 있지 않다는 연준 인사의 발언이 나오며, 달러와 미 국채 금리가 동반 상승했음. 또한 장 초반 이란에서 이스라엘의 미사일 보복이 감행되었다는 추측성 보도가 이어지며, 시장은 리스크오프로 강한 전환이 이어짐. 특히 장기를 스와프 포인트가 바닥을 찾지 못하는 상황에서 현 상황이 격화 될 수 있으니 비용을 지르더라도 달러를 확보해두려는 수요가 이어지며 스와프 포인트 증가는 전일보다 큰 하락폭을 보였음.
IRS	전일 IRS는 이스라엘 미사일이 이란을 타격했다는 소식이 전해지면서 미 국채 금리가 2년, 10년물 모두 10bp 이상 급락하면서 이에 영향을 받아 상승 마감. 1.5년 아우라와 1.5년 관련한 스프레드 9개월*1.5년, 1.5*3년 등으로 호가가 많이 형성됐으며, 초단기 6개월 쪽으로도 비드가 계속 나오면서 58-58.5 레벨에 여러 차례 거래가 이뤄지는 모습을 보임. 장 막판에 10년 오퍼가 다소 강하게 나오면서 45.5에 거래가 이뤄졌으며, 장 마감 후에도 2년, 5년쪽으로 비드가 나왔으며 5년이 46에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.15(월)	188.0	205.2	3.40%	3.494%	3.500%	3.56%	2년물	4.997%	0.2
2024.04.16(화)	193.9	208.4	3.30%	3.420%		3.56%	5년물	4.677%	-0.7
2024.04.17(수)	200.7	211.0	3.30%	3.485%		3.55%	10년물	4.625%	-1.3
2024.04.18(목)	200.2	211.0	3.40%	3.519%		3.55%	30년물	4.713%	-2.1
2024.04.19(금)	194.2		3.50%	3.514%		3.55%	10Y-2Y	-37.2	1.5

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	2,591.86	-42.84	24-07-16	통안채	600	은행채 5,600	여전채 2,600	국고채 5년 23,000
KOSDAQ	841.91	-13.74	30-12-10	국고 20-9	480	여전채 5,900	회사채 8,200	통안채 91일물 7,000
달러-원	1,382.20원	9.30원	26-03-10	국고21-1	400	회사채 150		
국고3Y	3.468%	4.1	26-03-10	국고 6-1	-80	공사채 1,000		
국고10Y	3.583%	2.1	30-06-10	국고 20-5	-100			
국고10Y-3Y	11.5	-2	53-09-10	국고 23-7	-100			

Money Market Closing								단위 : % , %p	
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.35	-0.01	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	0.00
1W	5.45	5.35	5.42	0.01	1W	5.50	5.40	5.43	0.00
1S	5.55	5.45	5.53	0.01	1S	5.65	5.55	5.58	0.00
3S	5.70	5.60	5.68	0.03	3S	5.75	5.65	5.70	0.00
6S	5.75	5.65	5.72	0.02	6S	5.75	5.65	5.70	0.00
1YR	5.75	5.65	5.70	0.02	1YR	5.80	5.70	5.73	0.00

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	-23.0	5.50	0.16	3.50	5.31000	1M MAR	-212	-208
TN	-7.5/-7	-7.0	5.32	-0.10	3.50	5.31018	1W*1S	-167	-163
1W	-51/-49	-49	5.32	-0.03	3.50	5.31127	1*2	-235	-230
1S	-235/-230	-220	5.47	0.02	3.51	5.31544	1*3	-470	-455
3S	-700/-680	-695	5.57	0.02	3.55	5.32456	1*6	-1250	-1220
6S	-1500/-1450	-1490	5.76	0.05	3.57	5.29978	1*9	-2030	-1990
1YR	-3010/-2980	-3030	5.87	0.03	3.58	5.20367	1*12	-2750	-2700

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)

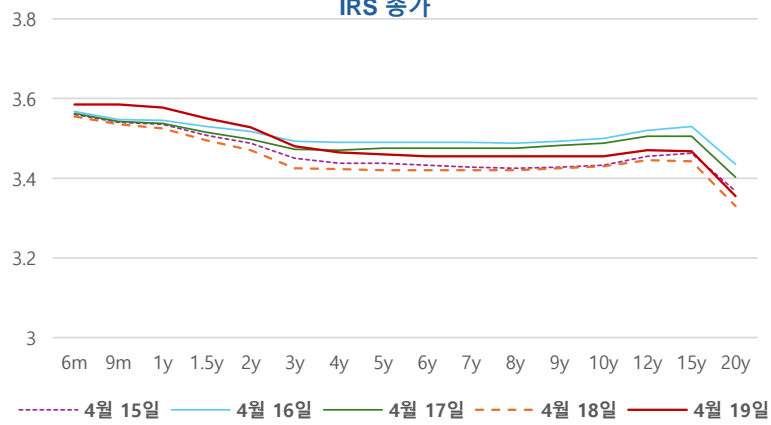
IRS 데일리 증가

4월 19일

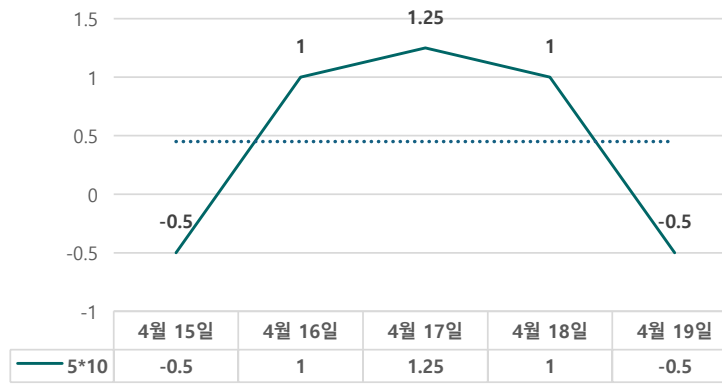
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5850	3.00
9m	3.5850	5.00
1y	3.5775	5.25
1.5y	3.5500	5.50
2y	3.5275	5.75
3y	3.4800	5.50
4y	3.4650	4.25
5y	3.4600	4.00
6y	3.4550	3.50
7y	3.4550	3.50
8y	3.4550	3.50
9y	3.4550	3.00
10y	3.4550	2.50
12y	3.4700	2.50
15y	3.4675	2.50
20y	3.3550	2.50

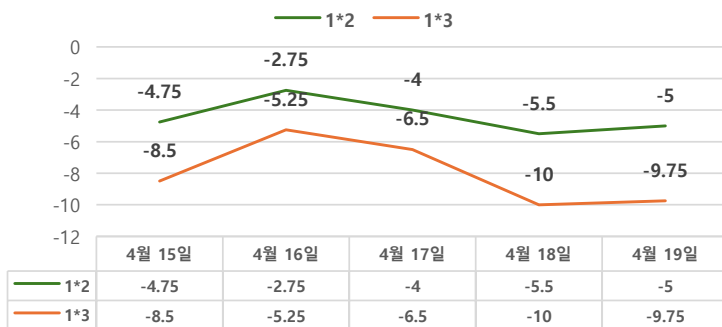
IRS 증가



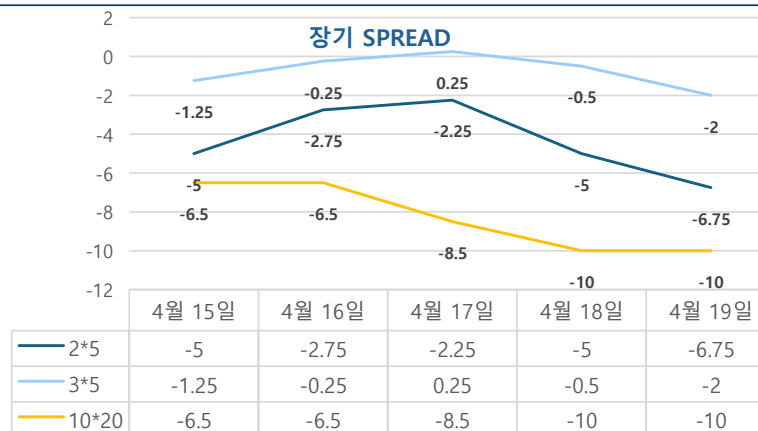
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

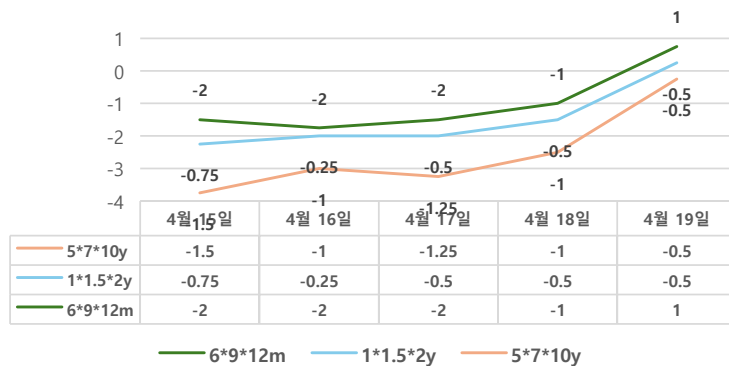


IRS 주요 커브

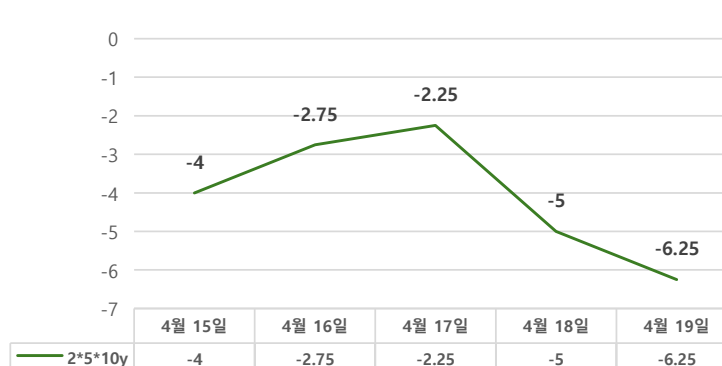
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.00	0.50
1*3y	-9.75	0.25
2*5y	-6.75	-1.75
3*5y	-4.00	-1.50
5*10y	-0.50	-1.50
10*20y	-10.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.75	1.75
1*1.5*2y	-0.50	0.00
2*5*10y	-6.25	-1.25
5*7*10y	-0.50	0.50