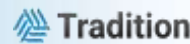


Market Daily Report



2024.04.23(화)

레포	청약자금 운용 규모 크지 않아 유동성 개선 효과 미미했으나 은행 및 증권 매도 감소하여 조달여건 대체로 양호한 모습을 보임. 장 중 잉여세 심화되어 체결금리 하락했으며, 조달금리 부담으로 기일물 매도 수요 제한적이었음.
채권	미 국채 금리는 30년 제외 하락 마감. 10년물 기준 장 초반 3bp 이상 상승하였으나 이후 상승 폭을 회수하며 1.1bp 하락 마감. 중동 갈등에 대한 우려가 완전히 해소되지 못한 상황에서 시장이 방향을 설정하지 못하고 있는 것으로 풀이됨. 이번 주 예정된 3월 PCE, 1분기 미국 경제성장률 예비치 등 주요 경제지표 발표 후 뚜렷한 방향성을 띠 것으로 보임.
MONEY	이란의 확전 자제에 안전자산 수요가 진정되며 미국채 금리상승. 연준 블랙아웃기간 (4/20-4/30) 앞두고 비둘기파 굴스비 시카고 총재도 지켜보자 선회하며 시장은 9월 1회 인하 후 연말까지 금리 동결 가능성 점차 머니 금리 정배열. 달러 강세 진정되자 원화는 대기성 결제 수요 증가해 월말 자금 잉여 증가, 1주. 42오퍼 형성됨. 반면 인민은행 금리 동결에 위안화 약세 심화로 중국계통 단기 숏 확대. 5월초 청명절 휴장 앞두고 월커버 자금 수요 증가도 영향 줌. 역외장 숏 영향 한국계 차입 여건 악화 6달 5.65가 비드 하단됨.
FX SWAP	FX스왑프에서 초단기 달러 셀엔 바이로 원화를 구하려는 수요가 있었으며, 거래체결이 데일리 -6.5전까지 올라가며 단기 레벨 이론가를 상회했고, 이 영향으로 기간물 스왑포인트가 다소 상승한 것으로 판단됨. 장기물의 경우 1년물로 부채스왑프가 나오면서 지난주 리스크오프로 떨어진 스왑프레벨을 말아올리며 다시 상승했으며, 1년물은 지난주 연 저점인 -3030전에서 50전 오른 -2980전에 증가를 형성함.
IRS	전일 IRS는 상승 마감, 장중에 비드가 많은 분위기였으며 국채 선물에 연동되어 움직이는 모습을 보임. 시장에 1년, 1.5년에 비드가 많이 나오면서 거래가 이뤄짐. 장 막판에 5*10년이 01/0.75로 대치하다 01에 거래가 이뤄지고, 10년 오퍼가 51.25까지 나옴에 따라 장기쪽 레벨이 움직였으며, 장 마감 후 10년은 51까지 시장에서 거래가 됨. 이날 CD 금리는 상승하여 3.56에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.04.16(화)	193.9	208.4	3.30%	3.420%	3.500%	3.56%	2년물	4.980%	-1.7
2024.04.17(수)	200.7	211.0	3.30%	3.485%		3.55%	5년물	4.658%	-1.9
2024.04.18(목)	200.2	209.6	3.40%	3.519%		3.55%	10년물	4.614%	-1.1
2024.04.19(금)	194.2	208.8	3.50%	3.514%		3.55%	30년물	4.715%	0.2
2024.04.22(월)	192.3		3.50%	3.533%		3.56%	10Y-2Y	-36.6	-0.6

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	2,629.44	37.58	54-03-10	국고 24-2	1,200	은행채 2,100	은행채 2,100	국고채 20년 7,000억
KOSDAQ	845.82	3.91	52-03-10	국고 22-2	200	여전채 1,000	여전채 3,200	
달러-원	1,379.20원	-3.00원	43-09-10	국고 23-9	200	회사채 4,000	회사채 6,800	
국고3Y	3.512%	4.4	25-06-10	국고 15-2	-3	통안채 7,000	통안채 9,100	
국고10Y	3.650%	6.7	26-12-10	국고 16-8-10	-100	공사채 1,000	공사채 5,400	
국고10Y-3Y	13.8	2.3	50-03-10	국고 20-2	-10			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.30	5.35	0.00	O/N	5.40	5.30	5.36	-0.01
TN	5.40	5.30	5.37	0.00	TN	5.45	5.35	5.38	-0.02
1W	5.45	5.35	5.41	-0.01	1W	5.50	5.40	5.45	0.02
1S	5.55	5.45	5.52	-0.01	1S	5.65	5.55	5.60	0.02
3S	5.70	5.60	5.68	0.00	3S	5.75	5.65	5.71	0.01
6S	5.75	5.65	5.72	0.00	6S	5.75	5.65	5.72	0.02
1YR	5.75	5.65	5.70	0.00	1YR	5.80	5.70	5.75	0.02

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	-7.0	5.33	-0.17	3.50	5.30000	1M MAR	-223	-220
TN	-8/-635	-7.0	5.33	0.01	3.50	5.30056	1W*1S	-160	-150
1W	-53/-50	-52	5.21	-0.11	3.50	5.30394	1*2	-235	-225
1S	-215/-205	-210	5.39	-0.08	3.51	5.31690	1*3	-465	-455
3S	-685/-680	-680	5.63	0.06	3.55	5.32640	1*6	-1240	-1200
6S	-1480/-1460	-1470	5.80	0.04	3.58	5.30290	1*9	-2020	-2000
1YR	-3000/-2980	-2980	5.88	0.01	3.61	5.21451	1*12	-2740	-2710

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)

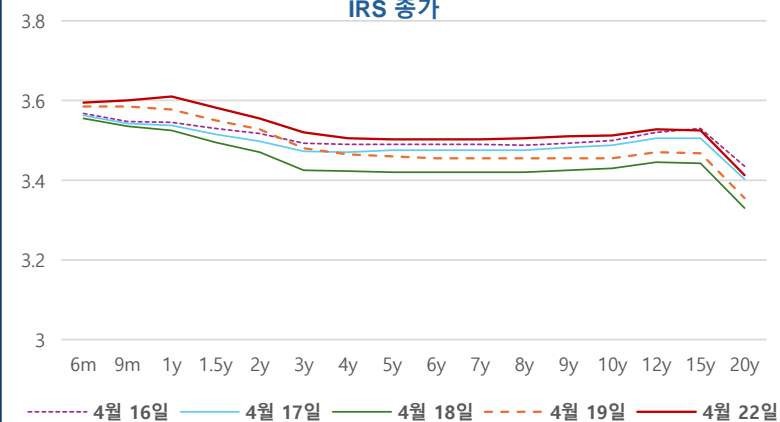
IRS 데일리 증가

4월 22일

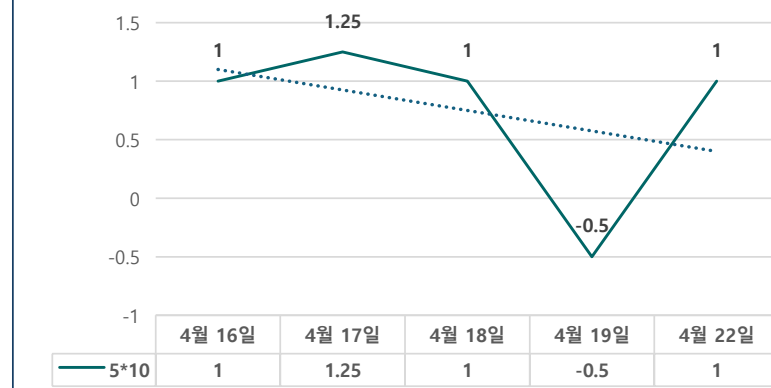
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5950	1.00
9m	3.6000	1.50
1y	3.6100	3.25
1.5y	3.5825	3.25
2y	3.5550	2.75
3y	3.5200	4.00
4y	3.5050	4.00
5y	3.5025	4.25
6y	3.5025	4.75
7y	3.5025	4.75
8y	3.5050	5.00
9y	3.5100	5.50
10y	3.5125	5.75
12y	3.5275	5.75
15y	3.5250	5.75
20y	3.4125	5.75

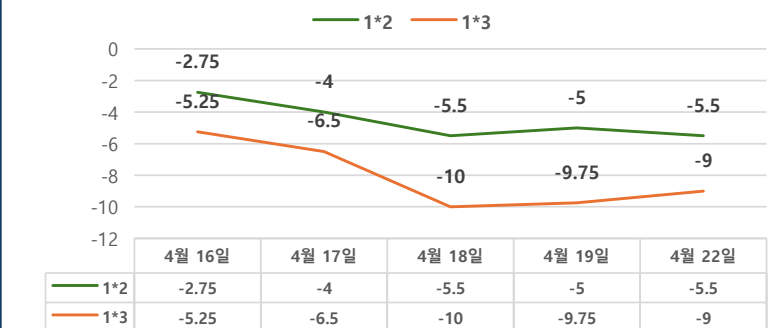
IRS 증가



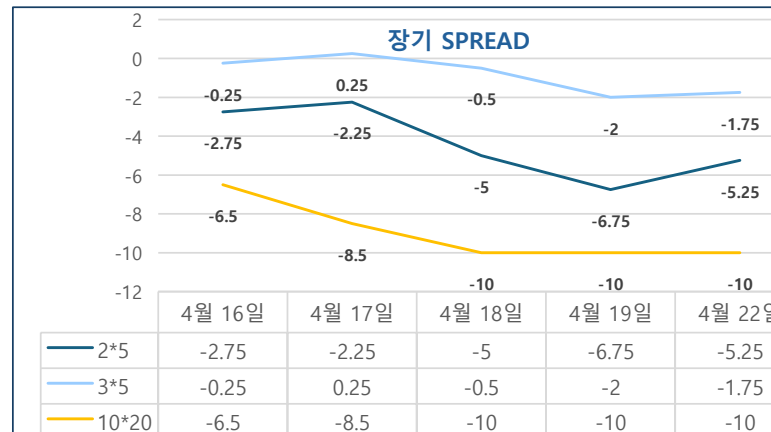
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

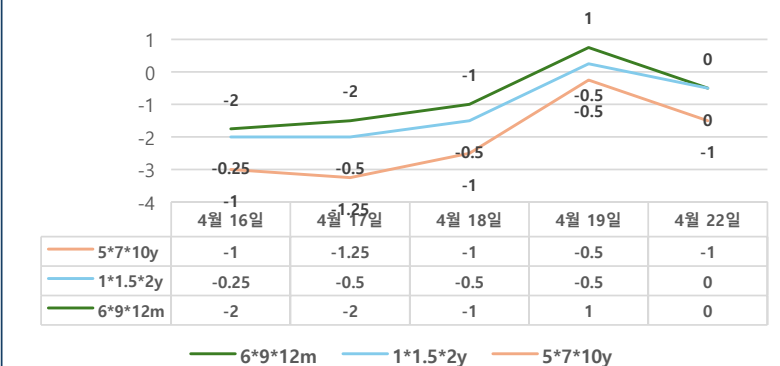


IRS 주요 커브

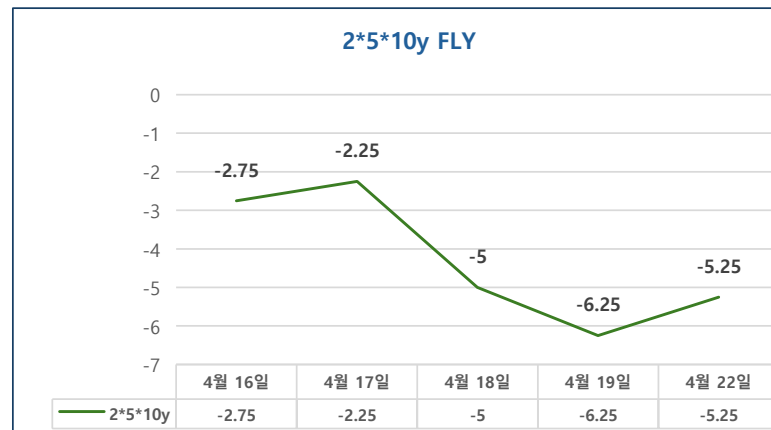
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.50	-0.50
1*3y	-9.00	0.75
2*5y	-5.25	1.50
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	1.00	1.50
10*20y	-10.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.50	-1.25
1*1.5*2y	0.00	0.50
2*5*10y	-5.25	1.00
5*7*10y	-1.00	-0.50