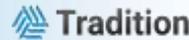


# Market Daily Report



2024.04.24(수)

|                |   |
|----------------|---|
| <b>레포</b>      | 전일 막판 빠듯했던 자금상황 반영되어 금리 소폭 상승 출발했으며, 일부 시은 장 초반부터 조달에 나서 매수 일찌감치 소진되었음.<br>장 중 저금리 매도 수요 꾸준했으나 추가 자금 많지 않아 매칭 제한적이었음. 불안계정 만기 대비 대폭 감액함에 따라 당일기준 잉여폭 확대되었음.   |
| <b>채권</b>      | 미 국채 금리는 30년물 제외 하락 마감. 4월 제조업 PMI가 49.9로 컨센서스였던 52를 하회하였으며 위축국면에 들어서며 금리 인하 기대감이 형성된 점이 주요 이유로 보임. 4월 서비스업 PMI도 50.9로 컨센서스 52를 하회하며 5개월만의 최저치를 기록.   |
| <b>MONEY</b>   | 어제 이어 아시아 역외자금 시장이 1주-2주 월말 커버 수요로 솟 커져 3달까지 상승해 2주 5.55 3달 5.70까지 비드 하단 올라와, 반면 6달-1년물은 5.75% suggest 유지되어 금리flat해짐. 서울마켓은 월말 원화 수요와 (머니장에 유입되지 않는) 증권, 커스터디 연계 등 달러 단기자금이 fx swap cash강세 이끌고 달러직접 차입 수요 미미. 국내 렌더들 역외 상승세 고려해 월말과 6월 분기 전 자금 운용 나서 2주. 55 2달 5.60-5.56 체결됨.                     |
| <b>FX SWAP</b> | FX스와프는 이번주 발표되는 미국의 GDP와 PCE 지표 결과를 대기하며 다소 한산한 장세를 보였음. 지난 주 대비 환율이 조금 안정적인 레벨로 내려오면서 투심이 회복되는 모습을 보였지만, 6개월 스와프를 중심으로 소폭 오른 것을 제외하고는 특이 동향은 없음. 연준이 블랙아웃 기간에 들어간 만큼, 5월 초 FOMC 결과 까지 확인 후 포지션을 정하려는 심리가 강한것으로 풀이됨.  |
| <b>IRS</b>     | 전일 IRS는 소폭 반락 마감.<br>중동지역의 긴장이 다소 진정되는 가운데, 미국 1분기 국내총생산(GDP) 및 3월 개인소비지출(PCE) 가격 지수 등 지표 발표를 앞두고 지켜보는 분위기를 띠며. 20*30년쪽으로 -25오퍼가 나오면서 초장기쪽 레벨이 움직였으며, 장 막판에 10년이 49.5-49.75까지 비드가 올라오면서 49.75에 거래가 이뤄짐.<br>마지막에 5년 오퍼가 강하게 나오면서 49에 거래가 이뤄졌으며, 마감 후에도 미국채 움직임에 연동되어 3년쪽으로 비드가 50.5까지 올라오는 모습을 보임. |

| 단기자금시장        |         |        |       |         |        | 전일 미국 국채 금리      |        |        |      |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|------------------|--------|--------|------|
|               |         |        |       |         |        | 한국시간 오전 07:05 기준 |        |        |      |
|               | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리  | 콜금리(C2) | 기준금리   | CD(91일)          | 금리     | 전일대비   |      |
| 2024.04.17(수) | 200.7   | 211.0  | 3.30% | 3.485%  | 3.500% | 3.55%            | 2년물    | 4.935% | -4.5 |
| 2024.04.18(목) | 200.2   | 209.6  | 3.40% | 3.519%  |        | 3.55%            | 5년물    | 4.635% | -2.3 |
| 2024.04.19(금) | 194.2   | 208.8  | 3.50% | 3.514%  |        | 3.55%            | 10년물   | 4.606% | -0.8 |
| 2024.04.22(월) | 192.3   | 208.4  | 3.50% | 3.533%  |        | 3.56%            | 30년물   | 4.730% | 1.5  |
| 2024.04.23(화) | 191.3   |        | 3.52% | 3.532%  |        | 3.56%            | 10Y-2Y | -32.9  | -3.7 |

| 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       | 2,623.02  | -6.42  | 26-04-23       | 산금채      | 1,500 | 은행채 3,800 | 은행채 2,900 | 통안채 3년물 3,000억 모집 |
| KOSDAQ      | 845.44    | -0.38  | 54-03-10       | 국고 24-2  | 800   | 여전채 1,500 | 여전채 1,800 | 통안채 2년물 5,000억 모집 |
| 달러-원        | 1,378.30원 | -0.90원 | 28-12-10       | 국고 18-10 | 600   | 공사채 2,000 | 공사채 500   | 재정증권 63일물 20,000  |
| 국고3Y        | 3.489%    | -2.3   | 26-03-10       | 국고 21-1  | -81   |           |           |                   |
| 국고10Y       | 3.625%    | -2.5   | 29-06-10       | 국고 19-4  | -90   |           |           |                   |
| 국고10Y-3Y    | 13.6      | -0.2   | 27-03-10       | 국고 22-1  | -102  |           |           |                   |

| 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 | 0.00 |
| TN                   | 5.40           | 5.30 | 5.37 | 0.00 | TN  | 5.45    | 5.35 | 5.38 | 0.00 |
| 1W                   | 5.45           | 5.35 | 5.43 | 0.02 | 1W  | 5.50    | 5.40 | 5.45 | 0.00 |
| 1S                   | 5.55           | 5.45 | 5.53 | 0.01 | 1S  | 5.65    | 5.55 | 5.60 | 0.00 |
| 3S                   | 5.70           | 5.60 | 5.68 | 0.00 | 3S  | 5.75    | 5.65 | 5.72 | 0.01 |
| 6S                   | 5.75           | 5.65 | 5.72 | 0.00 | 6S  | 5.80    | 5.70 | 5.75 | 0.03 |
| 1YR                  | 5.75           | 5.65 | 5.72 | 0.02 | 1YR | 5.80    | 5.70 | 5.75 | 0.00 |

| FX SWAP CLOSING |             |         |         |       |         |         | ND SPREAD      |       |       |
|-----------------|-------------|---------|---------|-------|---------|---------|----------------|-------|-------|
|                 |             |         |         |       |         |         | 단위 : 전, % , %p |       |       |
| 기간              | BID/OFFER   | CLOSING | USD환산금리 | 전일대비  | KORIBOR | SOFR    | TENOR          | BID   | OFFER |
| O/N             | -7.5/-6.5   | -7.0    | 5.33    | 0.00  | 3.50    | 5.31000 | 1M MAR         | -218  | -215  |
| TN              | -8/-7       | -7.0    | 5.33    | 0.00  | 3.50    | 5.31019 | 1W*1S          | -180  | -175  |
| 1W              | -49/-47     | -48     | 5.29    | 0.08  | 3.50    | 5.31133 | 1*2            | -210  | -200  |
| 1S              | -235/-230   | -230    | 5.34    | -0.05 | 3.51    | 5.31571 | 1*3            | -435  | 425   |
| 3S              | -685/-675   | -675    | 5.51    | -0.12 | 3.55    | 5.32294 | 1*6            | -1180 | -1150 |
| 6S              | -1460/-1450 | -1450   | 5.72    | -0.08 | 3.59    | 5.29803 | 1*9            | -1960 | -1940 |
| 1YR             | -2980/-2960 | -2970   | 5.87    | -0.01 | 3.62    | 5.21604 | 1*12           | -2680 | -2640 |

| 국내외 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) |

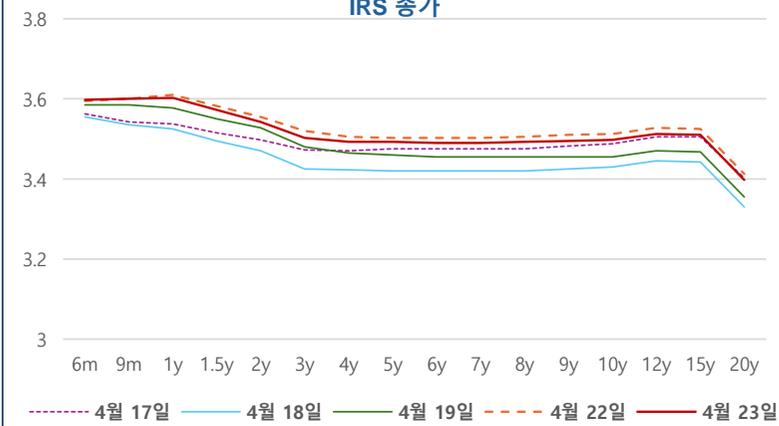
IRS 데일리 증가

4월 23일

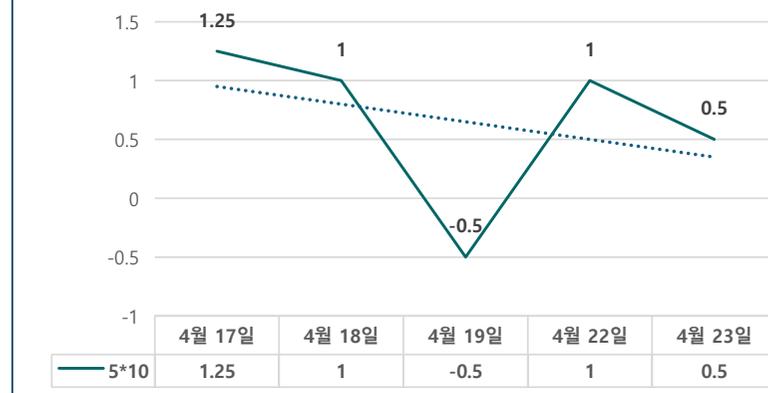
단위 : %, bp

| 구분   | 증가     | 전일대비  |
|------|--------|-------|
| 6m   | 3.5975 | 0.25  |
| 9m   | 3.6000 | 0.00  |
| 1y   | 3.6025 | -0.75 |
| 1.5y | 3.5725 | -1.00 |
| 2y   | 3.5425 | -1.25 |
| 3y   | 3.5025 | -1.75 |
| 4y   | 3.4925 | -1.25 |
| 5y   | 3.4925 | -1.00 |
| 6y   | 3.4900 | -1.25 |
| 7y   | 3.4900 | -1.25 |
| 8y   | 3.4925 | -1.25 |
| 9y   | 3.4950 | -1.50 |
| 10y  | 3.4975 | -1.50 |
| 12y  | 3.5125 | -1.50 |
| 15y  | 3.5100 | -1.50 |
| 20y  | 3.3975 | -1.50 |

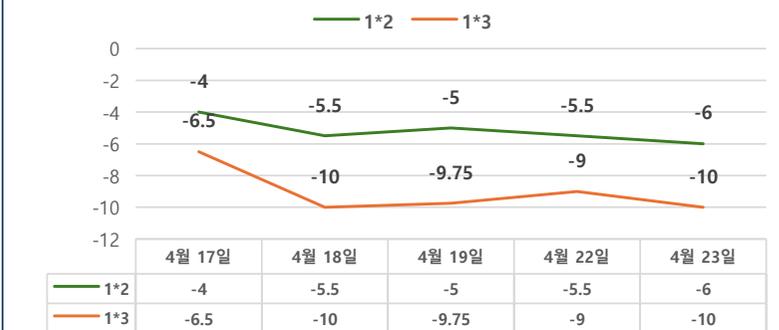
IRS 증가



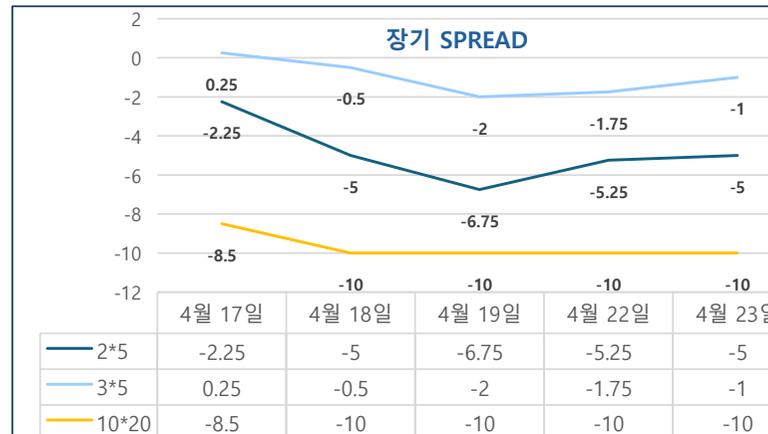
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

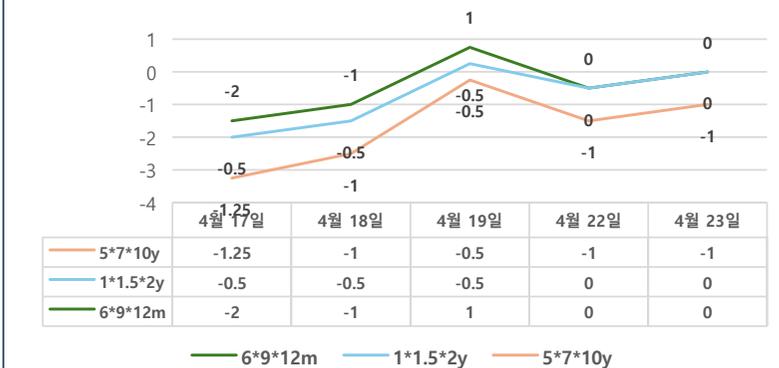


IRS 주요 커브

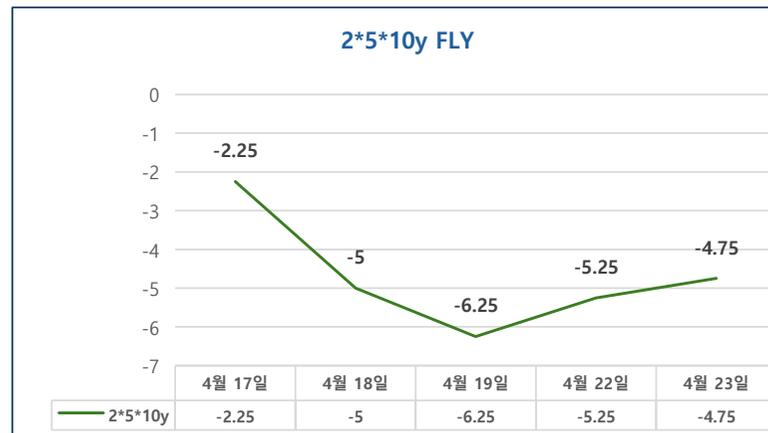
SPREAD

| 구분     | 증가     | 전일대비  |
|--------|--------|-------|
| 1*2y   | -6.00  | -0.50 |
| 1*3y   | -10.00 | -1.00 |
| 2*5y   | -5.00  | 0.25  |
| 3*5y   | -4.00  | 0.75  |
| 5*10y  | 0.50   | -0.50 |
| 10*20y | -10.00 | 0.00  |

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

| 구분       | 증가    | 전일대비 |
|----------|-------|------|
| 6m*9m*1y | 0.00  | 0.50 |
| 1*1.5*2y | 0.00  | 0.00 |
| 2*5*10y  | -4.75 | 0.50 |
| 5*7*10y  | -1.00 | 0.00 |