

Market Daily Report



2024.04.25(목)

레포	당일지준 잉여폭 확대되어 은행권 매도 감소할 것으로 예상했으나 레포금리 콜 수준으로 하락함에 따라 조달 강도 유지되었음. 매수 자금 일찌감치 소진된 가운데 장 중 운용사 및 신탁 추가 운용 여력 크지 않아 막판까지 조달 정체되었음.
채권	한국 : 미 PCE 앞두고 관망 분위기 속에 호주 물가지표 예상치 상회로 금리 상승함. 국고 3년물은 2bp 상승한 3.509% 미국 : 미 국채 금리는 상승. 10년물과 30년물은 4bp이상 상승 마감. 전일 제조업 PMI 발표에 따른 국채 금리 하락분을 빠르게 흡수함. 3월 내구재 수주 실적이 전월 대비 2.6% 증가하며 호조세를 보인 가운데 고금리 장기화에 대한 우려가 반영된 것으로 풀이됨.
MONEY	미국PMI 예상하회와 2년물 입찰강세로 달러금리 하락. 역외장 월말 커버 1-2주 조달 수요 급증으로 월커버 1주 5.56-58까지 올라옴. 서울 마켓도 역외 통 정리와 월말 네고 겹치며 환율1370원 하회하자 투데이 수요 증가로 ON 5.35-37에 월커버 1주도 5.45%이상 비드 증가했으나 국내은행들 자금은 역외 1-2주 매칭으로 소진됨, 2달 이상은 서울장 롤오버 물량이 6월말전 선호하며 운용 유입되어 2달5.56 오피, 3달 5.65&1Y 5.70 역외 오피 유입되어 한국계 1년 5.70/5.68 하락 마감해 오랜만에 1년물 5.70 오피 FIRM 확인됨.
FX SWAP	금일 FX스왑프는 현물환 수요에 따라 초단기 변동폭이 다소 컸으며 상당 -7전부터 하단 -8.5전까지 최근들어 가장 낮은 레벨에 거래됨. 추세적으로 하방압력은 아닌 것으로 파악되었으며, 1달은 다소 안정적인 모습을 보이면서 보합세를 보였음. 1년 스왑프는 최근 발표되는 미국 경제지표가 둔화될 것으로 기대되는 가운데 Bad news is good news라는 인식에 힘입어 어제보다 상승한 -2920전에 증가를 형성함.
IRS	전일 IRS는 호주 물가 상승 여파로 상승 마감. 시장에서 9개월 오피가 꾸준히 나오면서 9*12개월이 par에 여러 차례 거래가 이뤄졌으며, 1년쪽 아우라로 호가가 계속 형성됨. 장 막판에 2년이 55.5와 55 거래가 동시에 이뤄지고 9*12개월 0.25 오피, 1*1.5*2년 나비 par 오피가 나오면서 1년, 1.5년, 2년쪽 레벨이 다른 하우스에 비해 다소 높았으며, 10년 오피가 마지막에 51.5에 나오면서 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : 조 원			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.04.18(목)	200.2	209.6	3.40%	3.519%	3.500%	3.55%	2년물	4.937%	0.2
2024.04.19(금)	194.2	208.8	3.50%	3.514%		3.55%	5년물	4.662%	2.7
2024.04.22(월)	192.3	208.4	3.50%	3.533%		3.56%	10년물	4.646%	4
2024.04.23(화)	191.3	205.9	3.52%	3.532%		3.56%	30년물	4.774%	4.4
2024.04.24(수)	192.6		3.48%	3.519%		3.56%	10Y-2Y	-29.1	-3.8

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	2,675.75	52.73	26-06-10	국고 23-4	1,100	은행채 8,900	은행채 7,200	
KOSDAQ	862.23	16.79	27-09-10	국고 22-8	1,085	여전채 3,200	여전채 2,600	
달러-원	1,369.20원	-9.10원	54-03-10	국고 24-2	1,072	회사채 9,570	회사채 4,830	
국고3Y	3.509%	2	52-09-10	국고 22-9	-9	공사채 1,800	공사채 714	
국고10Y	3.645%	2	26-09-10	국고 21-7	-29			
국고10Y-3Y	13.6	0	42-09-10	국고 22-11	-301			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.33	5.37	0.02	O/N	5.40	5.30	5.37	0.01
TN	5.43	5.33	5.40	0.03	TN	5.45	5.35	5.38	0.00
1W	5.55	5.45	5.48	0.05	1W	5.60	5.50	5.55	0.10
1S	5.57	5.47	5.55	0.02	1S	5.65	5.55	5.62	0.02
3S	5.70	5.60	5.65	-0.03	3S	5.75	5.65	5.73	0.01
6S	5.75	5.65	5.70	-0.02	6S	5.80	5.70	5.75	0.00
1YR	5.75	5.65	5.70	-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	-10/-8	-9.0	5.87	0.54	3.50	5.31000	1M MAR	-215	-209
TN	-11/-8	-9.0	5.87	0.54	3.50	5.31023	1W*1S	-178	-172
1W	-54/-46	-52	5.46	0.17	3.50	5.31160	1*2	-210	-200
1S	-235/-225	-225	5.37	0.03	3.51	5.31685	1*3	-435	-425
3S	-675/-670	-670	5.52	0.01	3.56	5.32355	1*6	-1180	-1170
6S	-1450/-1440	-1440	5.71	-0.01	3.60	5.29770	1*9	-1950	-1930
1YR	-2940/-2900	-2900	5.84	-0.03	3.63	5.21061	1*12	-2680	-2610

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)

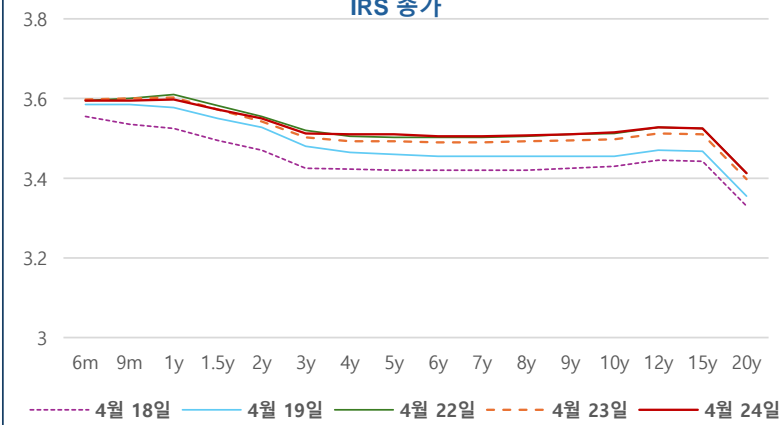
IRS 데일리 증가

4월 24일

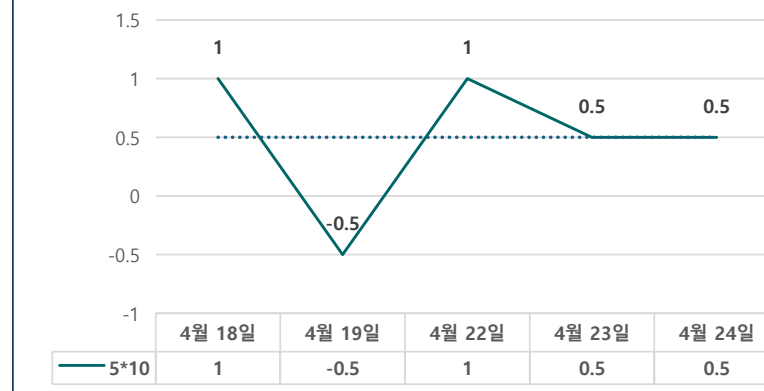
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5950	-0.25
9m	3.5950	-0.50
1y	3.5975	-0.50
1.5y	3.5725	0.00
2y	3.5500	0.75
3y	3.5125	1.00
4y	3.5100	1.75
5y	3.5100	1.75
6y	3.5050	1.50
7y	3.5050	1.50
8y	3.5075	1.50
9y	3.5100	1.50
10y	3.5150	1.75
12y	3.5275	1.50
15y	3.5250	1.50
20y	3.4125	1.50

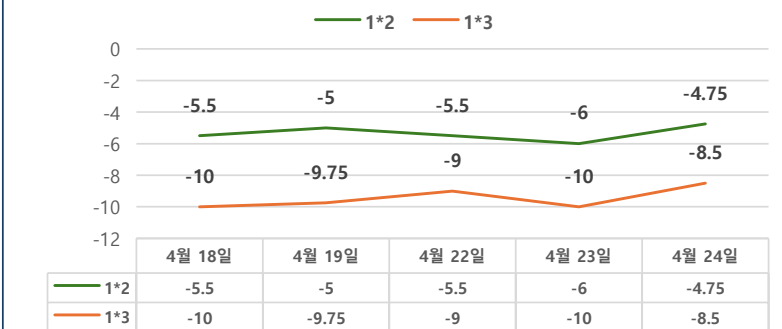
IRS 증가



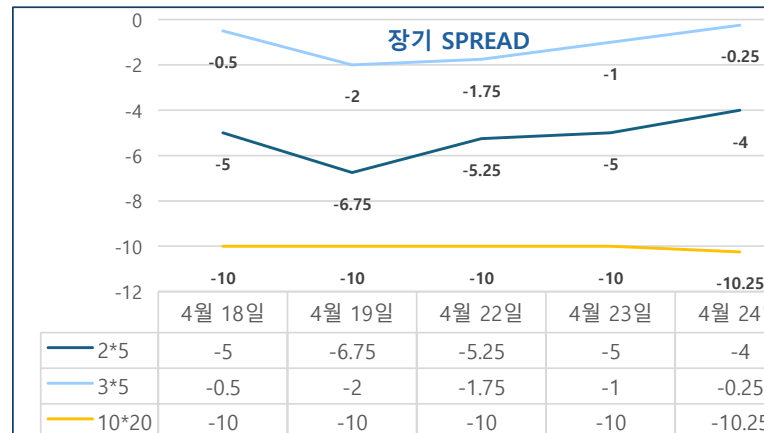
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

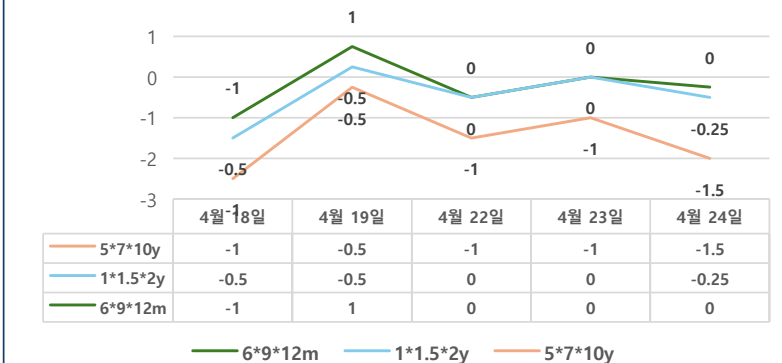
구분	증가	전일대비
1*2y	-4.75	1.25
1*3y	-8.50	1.50
2*5y	-4.00	1.00
3*5y	-4.00	0.75
5*10y	0.50	0.00
10*20y	-10.25	-0.25

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	-0.25
1*1.5*2y	-0.25	-0.25
2*5*10y	-3.50	1.25
5*7*10y	-1.50	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY

