

# Market Daily Report



2024.04.26(금)

<b>레포</b>	공모주 청약 환불(디엔디파라텍, 유안타스팩16호) 및 MMF 환매 영향으로 금리 급등했으나 은행 매도 감소하여 수급 무난하였음. 일부 시은 저금리 조달에 나섰으나 장 중 잉여 자금 많지 않아 매칭 제한적이었음. 월말 앞두고 기일 매도 소폭 증가세를 보임.
<b>채권</b>	한국 : GDP 서프라이즈에 따른 기준 금리 인하 기대감 축소 및 미국 GDP 발표 경계감이 금리 상승함. 미국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 노동시장이 견조한 가운데 인플레이션이 지속되고 있어 매파적 분위기 형성. 2년물은 5%대로 상승. 전일 발표된 신규실업수당청구건수가 20만 7천명으로 전 주 대비 5천명이 감소한 가운데 근원 PCE 가격지수는 3.7%로 예상치 3.4%를 상회함.
<b>MONEY</b>	아시아장 월말 펀딩 급증에 서울 렌더들 역외 운용 물량 증가하고 운용 타겟도 높아져 국내장도 1주 머니 5.57%까지 체결되어 전일 비 9bp 상승함. 월말만 넘기는 운용 렌더들이 소수로 제한되어 렌더 주도의 금리 결정권 높아진 상태, 즉 롱 감소 수급. 국내 시은들은 월말 롱 확보로 오버나잇 5.45에는 운용 여력 크지만 시장 40/35 금리 cap 형성. 한편 2달-3달 운용 렌더들 매칭 물량이 마무리되자 다시 역외 금리 상승세 노출되어 6달-1년 5.70% 네임 초이스로 마무리됨.
<b>FX SWAP</b>	초단기 FX스왑은 데일리 -8~7전 범위에서 주로 움직이며 현물환 수급을 소화한 것으로 보임. 오전 내내 조용한 장세가 이어졌지만 3년, 10년 국고채 금리가 오른것에 연동해 6개월과 1년 스왑은 각각 20전, 40전 상승한 -1430전, -2860전에 증가를 형성함. 지난주 리스크오프 분위기가 상당부분 회복 전환된 것도 스왑 레벨의 상승의 한 원인으로 분석됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 우리나라의 1분기 성장률이 시장 예상을 큰 폭 뛰어넘은 영향을 받아 상승 마감. 이날 발표된 우리나라 1분기 국내총생산(GDP)이 전기비 1.3%, 전년동기대비 3.4% 상승하면서 시장은 예상치를 훌쩍 뛰어넘는 호조를 보임. 장중 10*20년 -11 오피, 20*30년 -25오피가 나옴에 따라 초장기쪽으로 커브가 눌렸으며, 전체적으로 시장에 거래가 많은 모습을 보임. 장 막판에 1.5년 오피가 58.75까지 내려오면서 레벨이 움직였으며, 10년 비드가 58.5-58.75까지 올라오면서 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.04.19(금)	194.2	208.8	3.50%	3.514%	3.500%	3.55%	2년물	5.008%	7.1
2024.04.22(월)	192.3	208.4	3.50%	3.533%		3.56%	5년물	4.724%	6.2
2024.04.23(화)	191.3	205.9	3.52%	3.532%		3.56%	10년물	4.709%	6.3
2024.04.24(수)	192.6	205.6	3.48%	3.519%		3.56%	30년물	4.814%	4
2024.04.24(목)	186.3		3.55%	3.562%		3.57%	10Y-2Y	-29.9	0.8

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	2,628.62	-47.13	26-04-24	주공금(사)	1,500	은행채 4,800	은행채 10,900	
KOSDAQ	853.26	-8.97	54-03-10	국고 24-2	900	여전채 2,665	여전채 10,400	
달러-원	1,375.00원	5.80원	42-09-10	국고 22-11	250	회사채 2,190	회사채 8,970	
국고3Y	3.543%	3.4	30-06-10	국고 20-5	-100	공사채 11,246	공사채 4,500	
국고10Y	3.707%	6.2	25-09-10	국고 20-6	-165			
국고10Y-3Y	16.4	2.8	52-09-10	국고 22-9	-200			

Money Market Closing								단위 : % , %p	
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.33	5.37	0.00	O/N	5.40	5.30	5.36	-0.01
TN	5.43	5.33	5.40	0.00	TN	5.45	5.35	5.38	0.00
1W	5.60	5.50	5.57	0.09	1W	5.60	5.50	5.58	0.03
1S	5.58	5.48	5.56	0.01	1S	5.65	5.55	5.62	0.00
3S	5.70	5.60	5.66	0.01	3S	5.75	5.65	5.73	0.00
6S	5.75	5.65	5.72	0.02	6S	5.80	5.70	5.75	0.00
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						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-8	-8.5	5.73	-0.14	3.50	5.31000	1M MAR	-213	-210
TN	-23/-21	-22.0	5.42	-0.45	3.50	5.31027	1W*1S	-157	-150
1W	-56/-53	-56	5.34	-0.12	3.50	5.31190	1*2	-225	-220
1S	-215/-210	-210	5.36	-0.01	3.52	5.31816	1*3	-455	-445
3S	-675/-670	-670	5.51	-0.01	3.56	5.32445	1*6	-1190	-1170
6S	-1430/-1410	-1410	5.68	-0.03	3.60	5.28965	1*9	-1925	-1900
1YR	-2870/-2820	-2850	5.80	-0.04	3.64	5.18826	1*12	-2630	-2595

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 / 12.17~12.18D
<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)

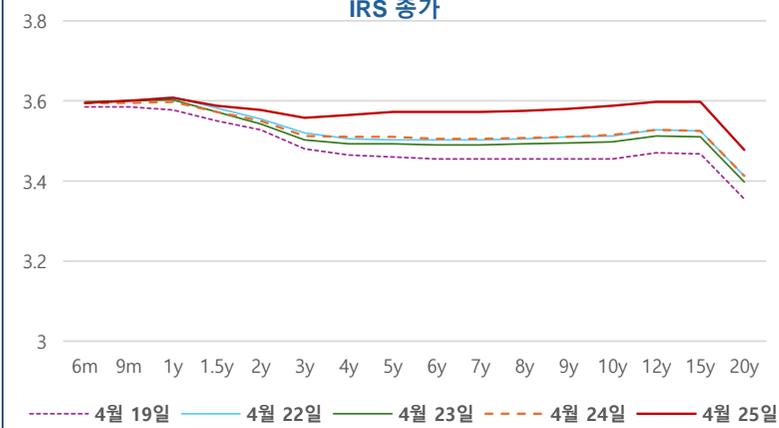
IRS 데일리 증가

4월 25일

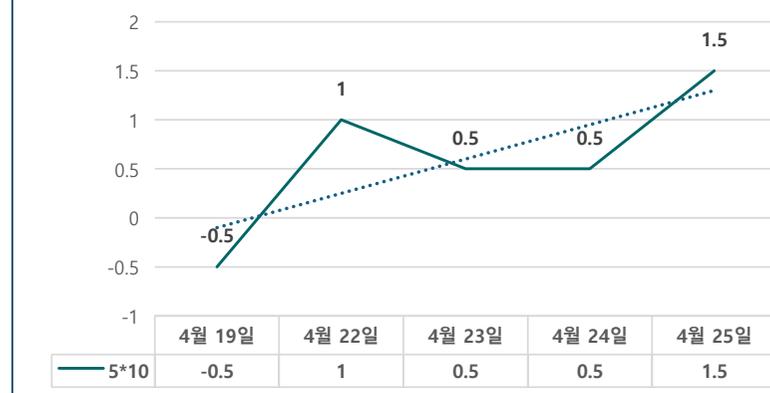
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5950	0.00
9m	3.6000	0.50
1y	3.6075	1.00
1.5y	3.5875	1.50
2y	3.5775	2.75
3y	3.5575	4.50
4y	3.5650	5.50
5y	3.5725	6.25
6y	3.5725	6.75
7y	3.5725	6.75
8y	3.5750	6.75
9y	3.5800	7.00
10y	3.5875	7.25
12y	3.5975	7.00
15y	3.5975	7.25
20y	3.4775	6.50

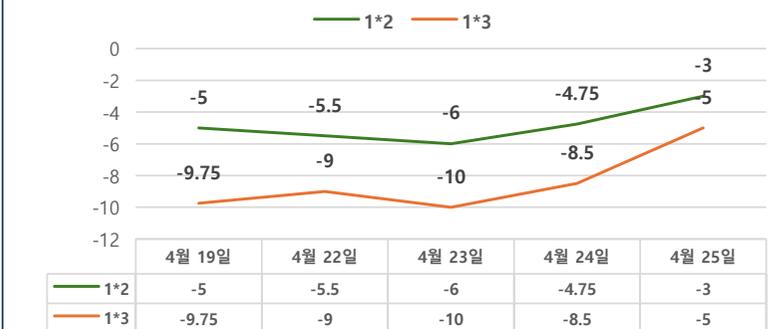
IRS 증가



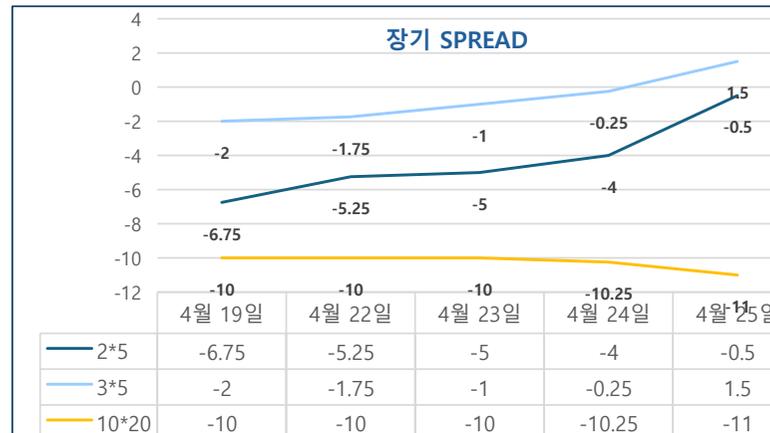
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

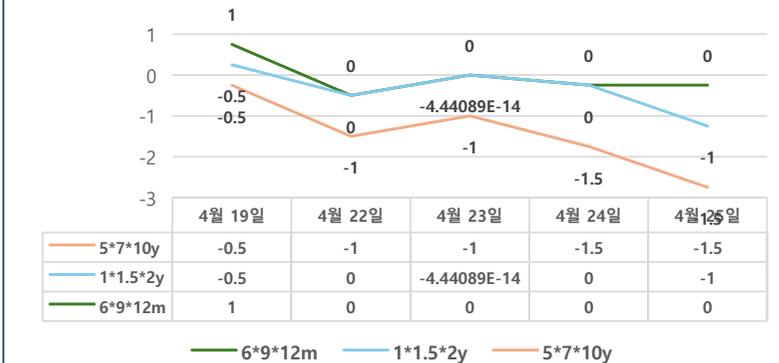


IRS 주요 커브

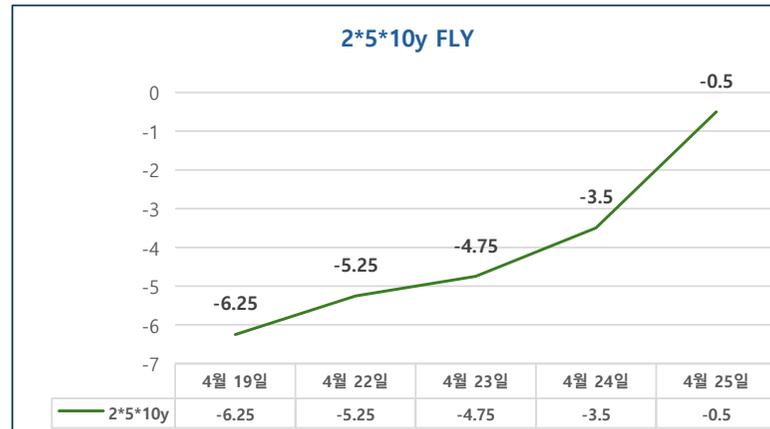
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-3.00	1.75
1*3y	-5.00	3.50
2*5y	-0.50	3.50
3*5y	-4.00	1.75
5*10y	1.50	1.00
10*20y	-11.00	-0.75

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-1.00	-1.00
2*5*10y	-0.50	3.00
5*7*10y	-1.50	0.00