

Market Daily Report



2024.04.29(월)

레포	공모주 청약 환불 및 모집 혼재한 가운데 MMF 환매 계속되어 레포금리 추가 상승했으며, 장 초반부터 수급 빠듯한 모습을 보임. 시는 저금리 조달 수요 꾸준했으나 장 중 유동성 좀처럼 개선되지 못해 거래 제한적이었고, 월말 앞두고 증권사 기일물 수요 증가하였음. [에이치디현대마린솔루션 모집 마감일] 증거금 합계 25.09조 : KB 13.41조 / 신한 4.77조 / 하나 4.59조 / 대신 1.23조 / 삼성 1.09조
채권	한국 : 장중 미국 스테그플레이션 우려가 커졌으나 BOJ 금정위 동결 이후 아시아장에서 하락한 대외금리에 연동돼 금리 하락 마감. 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 이날 발표된 3월 근원 PCE 가격지수는 전월 대비로는 시장 예상치에 부합함. 전년 동기 대비로는 예상치를 소폭 상회. 이같은 결과에 채권 투자자들은 매수 우위로 반응하였음.
MONEY	미 전분기비 PCE가 예상 상회해 미국채 2년물 5% 넘기고 한국계 향함 1년물 금리도 5.75% 오퍼로 상향 조정되자 3달-6달 렌더 공백에 실수요 펀딩 금리 상승 압력 받음. 월말과 FOMC 앞두고 서울 기간물 운용 1달 이내로 위축. BOJ에서 금리 동결로 엔화 156엔까지 떨어져 아시아통화 전체 약세 이끌어 역외장은 월말 자금 부족, 동경 S/N이 5.60%까지 올라오고 월 커버 1주 5.55-60%형성. 서울 마켓 포인 슛 증가로 장중에 ON 5.35-5.37%대기 물량 컷지만 월을 넘기는 1주 수요가 없어, 월말 자금은 잉여 낙관함.
FX SWAP	미국의 1분기 GDP가 예상치 하회, PCE 물가가 높게 나오면서 스테그플레이션 전망이 강해지고 FX스와프는 장기를 위주로 하락하는 모습을 보임. 3개월 이하로는 단기물로는 에셋스와프가 나오면서 하방 압력이 강해졌으며, 초단기 스와프는 주요 IPO 관련 현물환 수급으로 큰 변동성을 보인 장세였음. 1년물은 전일보다 30전 내린 -2890전, 6개월은 30원 내린 -1440전, 3개월은 15전 내린 -685원에 증가를 형성하며 대체적으로 전일보다 하락폭을 키우며 종료됨
IRS	전일 IRS는 국채선물 움직임에 연동하여 하락 마감. 간밤 발표된 미국 국내총생산(GDP) 결과를 소화하면서 국채선물이 하락 출발하였으나, 장중 일본은행(BOJ) 통화정책 결정 등을 소화하면서 낙폭을 줄여 마감에 따라 IRS도 이에 연동되는 모습을 보임. 막판에 1.5년과 2년 오퍼가 다소 강하게 나오면서 2년은 55거래, 1.5년은 57.5까지 레벨이 높였으며, 10년 비드가 56까지 올라오면서 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	
2024.04.22(월)	192.3	208.4	3.50%	3.533%	3.500%	3.56%	2년물	5.006%	-0.2
2024.04.23(화)	191.3	205.9	3.52%	3.532%		3.56%	5년물	4.694%	-3
2024.04.24(수)	192.6	205.6	3.48%	3.519%		3.56%	10년물	4.670%	-3.9
2024.04.25(목)	186.3	203.4	3.55%	3.562%		3.57%	30년물	4.779%	-3.5
2024.04.26(금)	185.8		3.60%	3.581%		3.57%	10Y-2Y	-33.6	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	2,656.33	27.71	25-04-26	MBS 1-1	1,200	은행채 6,700	은행채 4,200	국고채 30년 39,000
KOSDAQ	856.82	3.56	54-03-10	국고 24-2	502	여전채 2,200	여전채 1,820	통안채 91일물 7,000
달러-원	1,375.30원	0.30원	26-04-26	MBS 1-2	500	회사채 6,012	회사채 3,950	
국고3Y	3.531%	-1.2	52-09-10	국고원금 22-9	-200	공사채 1,000	공사채 2,400	
국고10Y	3.694%	-1.3	33-06-10	국고 23-5	-225			
국고10Y-3Y	16.3	-0.1	24-12-10	국고 21-10	-600			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.33	5.36	-0.01	O/N	5.40	5.30	5.35	-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	5.55	-0.02	1W	5.60	5.50	5.55	-0.03
1S	5.58	5.48	5.55	-0.01	1S	5.65	5.55	5.60	-0.02
3S	5.70	5.60	5.66	0.00	3S	5.75	5.65	5.75	0.02
6S	5.75	5.65	5.72	0.00	6S	5.80	5.70	5.75	0.00
1YR	5.75	5.65	5.72	0.00	1YR	5.80	5.70	5.77	0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
						단위 : 전, % , %p			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-23/-21	-22.0	5.42	-0.31	3.50	5.31000	1M MAR	-223	-218
TN	-9/-7	-8.0	5.59	0.17	3.50	5.31028	1W*1S	-168	-163
1W	-51/-48	-50	5.37	0.03	3.50	5.31193	1*2	-205	-200
1S	-220/-215	-215	5.35	-0.01	3.53	5.31826	1*3	-460	-445
3S	-690/-680	-685	5.55	0.04	3.57	5.32487	1*6	-1185	-1175
6S	-1440/-1420	-1430	5.69	0.01	3.60	5.29366	1*9	-1950	-1920
1YR	-2920/-2850	-2890	5.86	0.06	3.66	5.19722	1*12	-2650	-2630

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 / 12.17~12.18
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)

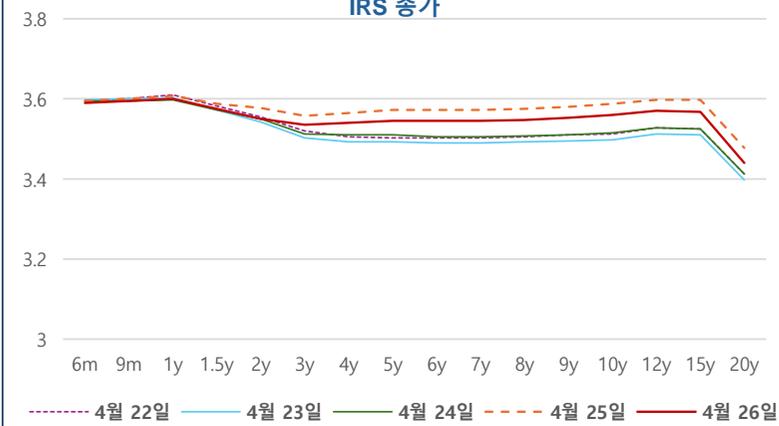
IRS 데일리 증가

4월 26일

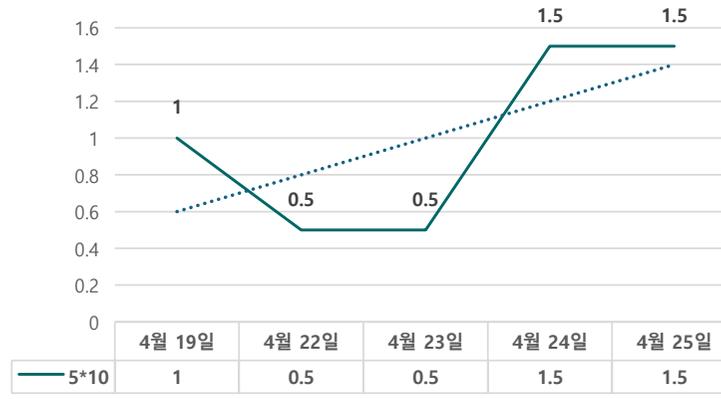
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5900	-0.50
9m	3.5950	-0.50
1y	3.6000	-0.75
1.5y	3.5750	-1.25
2y	3.5500	-2.75
3y	3.5350	-2.25
4y	3.5400	-2.50
5y	3.5450	-2.75
6y	3.5450	-2.75
7y	3.5450	-2.75
8y	3.5475	-2.75
9y	3.5525	-2.75
10y	3.5600	-2.75
12y	3.5700	-2.75
15y	3.5675	-3.00
20y	3.4400	-3.75

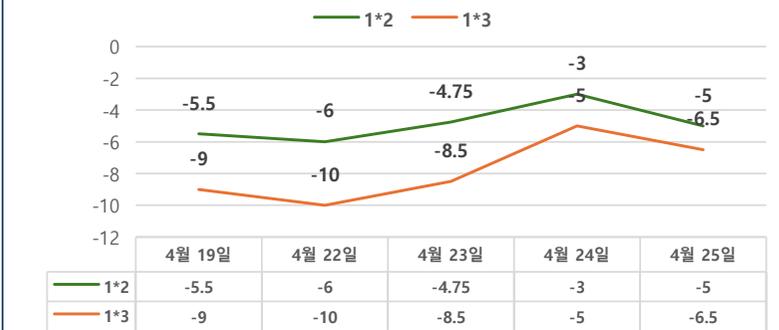
IRS 증가



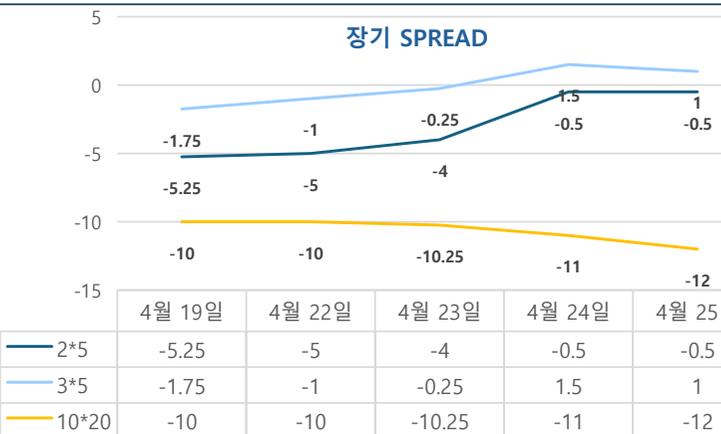
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

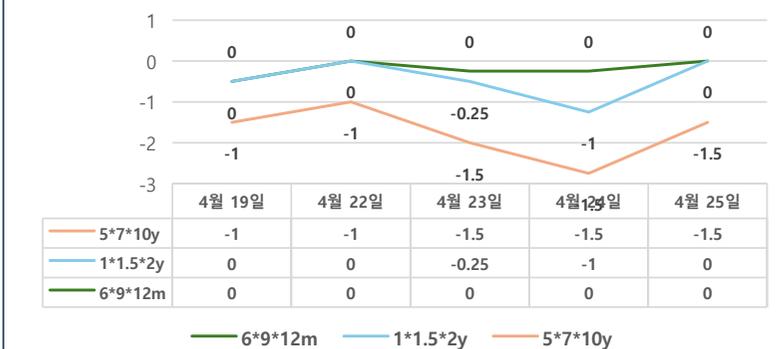


IRS 주요 커브

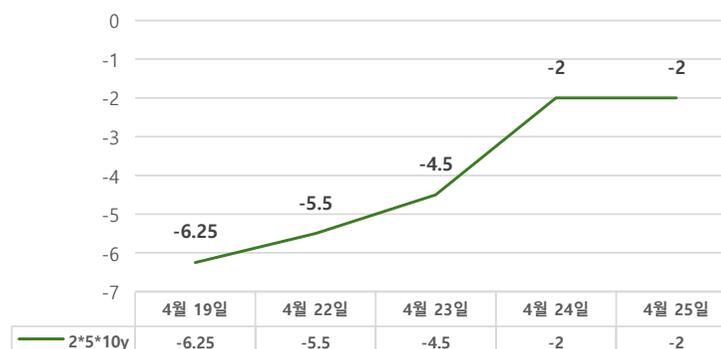
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-5.00	-2.00
1*3y	-6.50	-1.50
2*5y	-0.50	0.00
3*5y	-4.00	-0.50
5*10y	1.50	0.00
10*20y	-12.00	-1.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.25
1*1.5*2y	0.00	1.00
2*5*10y	-2.00	0.00
5*7*10y	-1.50	0.00