

Market Daily Report



2024.04.30(화)

레포	공모주 청약자금 운용 기대되어 금리 소폭 하락 출발했으나 은행 및 증권 매도 증가하여 장 초반부터 부족 분위기 형성되었음. 회사채 보다 일반채 담보 난항을 겪었으며, 장 중 매도 지속적으로 추가되어 막판까지 조달 정체 극심한 모습을 보임. [에이치디현대마린솔루션 모집 마감일] 증거금 합계 25.09조 : KB 13.41조 / 신한 4.77조 / 하나 4.59조 / 대신 1.23조 / 삼성 1.09조
채권	한국 : 국고 30년 입찰에 수급 부담 커진 중 추경 편성 관련 불확실성에 따른 투자 심리 제약에 국채 금리 상승 마감함. 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 지난 5주간 채권가격이 크게 밀렸던 만큼 일부 저가 매수세가 유입된 것으로 풀이. 금주 예정된 FOMC는 기준금리 동결이 기정사실화됨. 대신 파월 의장이 회의 후 기자회견에서 어떤 발언을 내놓을지에 집중.
MONEY	4월 마감을 앞두고, 지난주 역외발 초단기 레벨 급등세는 금주 들어 마감 자금 수요가 어느정도 소화되면서 월커버 T/N-1 주물은 5.53-5.57 사이로 정리되며 상승세는 진정됨. 다만, FX 오버나잇 스왑이 장중 -9전까지 밀리면서 MONEY 시장에서 온쇼 오버나잇 비드 대기 시간이 길었음. 금주 이벤트로 FOMC 회의 (4/30-5/1)로 연준의 금리 동결이 우세한 가운데 당분간 금리 인하 보다는 양적 긴축 감축에 우위를 보이며, 파월의장의 스탠스에 주목. 그리고 5월초 중국, 홍콩 휴장으로 거래는 소강 상태를 보일 것으로 보임. 연준의 금리 인상 시기가 9월 이후로 지연 될 것이라는 전망이 우세해 지면서 월말 마감 이후, 역외 고점 레벨을 형성하는 중국계 3-6개월물 차입 강도에 따라 MONEY 마켓 기간물 펀딩 및 운용 레벨은 지켜봐야 할 듯.
FX SWAP	전 거래일 스테이블플레이션 우려가 이어지는 분위기였으며, 1년, 6개월 각각 20전 하락한 -2910전, -1460전에 증가를 형성함. 1년 쪽으로 에셋 스와프가 나오는 듯 했지만, 다른 기간물로는 특이 동향은 없었음. 초단기 스와프는 IPO관련 현물환 수급에 의해 2일물 탐넥이 데일리 -8.5전까지 내려오면서 거래됨. 지난주 PCE 결과 안정되는 방향은 아니었지만 시장은 FOMC등 이번주에 발표되는 굵직한 시장지표를 대기하며 한산한 장세를 보였음.
IRS	인월 IRS는 단기를 위주로도 경중 마감, 이날 진행된 30년물 입찰이 금리 불안감에도 불구하고 무난하게 진행된 것에 영향을 받아 상대적으로 장기물의 움직임이 적었으며, 장중 달러-엔 환율이 급변하는 분위기를 따라 IRS도 움직이는 모습을 보임. 장 막판에 2,3년쪽으로 비드가 다소 강하게 올라오면서 2년은 57.5, 3년은 55.5에 마감했으며, 1년 오퍼가 내려오면서 62에 거래가 이뤄짐. 10년 비드가 조금 올라오면서 56.5/56으로 대체했으며, 잭 마감후 6개월*1.5년이 0.5에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
							한국시간 오전 07:05 기준		
							단위 : bp		
2024.04.23(화)	191.3	205.9	3.52%	3.532%		3.56%	2년물	4.987%	-1.9
2024.04.24(수)	192.6	205.6	3.48%	3.519%		3.56%	5년물	4.651%	-4.3
2024.04.25(목)	186.3	203.4	3.55%	3.562%	3.500%	3.57%	10년물	4.619%	-5.1
2024.04.26(금)	185.8	201.4	3.60%	3.581%		3.57%	30년물	4.734%	-4.5
2024.04.29(월)	187.4		3.58%	3.573%		3.57%	10Y-2Y	-36.8	3.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,687.44	31.11	54-03-10	국고 24-2	2,242	지방채 3,256	지방채 2,590	
KOSDAQ	869.72	12.90	28-09-10	국고 23-6	1,240	은행채 7,400	은행채 1,004	
달러-원	1,377.00원	1.70원	29-03-10	국고 24-1	631	여전채 2,710	여전채 1,650	
국고3Y	3.552%	2.1	26-03-10	국고 21-1	-30	회사채 752	회사채 2,450	
국고10Y	3.704%	1	24-12-10	국고 21-10	-51	통안채 4,800	통안채 10,000	
국고10Y-3Y	15.2	-1.1	51-03-10	국고 21-2	-500	공사채 915	공사채 1,415	

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.43	5.33	5.37	0.01	O/N	5.40	5.30	5.36	0.01
TN	5.50	5.40	5.45	0.05	TN	5.60	5.50	5.55	0.17
1W	5.53	5.43	5.48	-0.07	1W	5.55	5.45	5.50	-0.05
1S	5.58	5.48	5.53	-0.02	1S	5.65	5.55	5.60	0.00
3S	5.70	5.60	5.66	0.00	3S	5.80	5.70	5.75	0.00
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	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-10/-7.5	-9.0	5.85	0.43	3.50	5.31000	1M MAR	-210	-208
TN	-18/-12	-17.0	5.72	0.13	3.50	5.31018	1W*1S	-169	-166
1W	-49/-42	-48	5.29	-0.08	3.50	5.31125	1*2	-215	-200
1S	-225/-220	-220	5.34	-0.01	3.53	5.31573	1*3	-450	-435
3S	-690/-670	-680	5.54	-0.01	3.58	5.32950	1*6	-1200	-1180
6S	-1460/-1450	-1460	5.72	0.03	3.61	5.31384	1*9	-1950	-1920
1YR	-3000/-2910	-2910	5.87	0.01	3.67	5.24380	1*12	-2650	-2590

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)

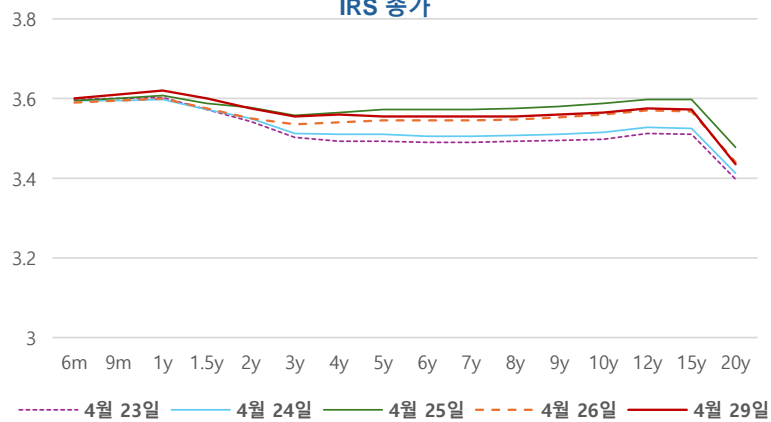
IRS 데일리 증가

4월 29일

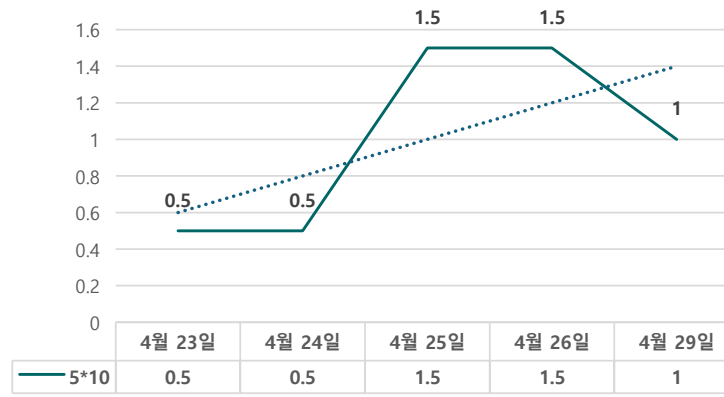
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6000	1.00
9m	3.6100	1.50
1y	3.6200	2.00
1.5y	3.6000	2.50
2y	3.5750	2.50
3y	3.5550	2.00
4y	3.5600	2.00
5y	3.5550	1.00
6y	3.5550	1.00
7y	3.5550	1.00
8y	3.5550	0.75
9y	3.5600	0.75
10y	3.5650	0.50
12y	3.5750	0.50
15y	3.5725	0.50
20y	3.4350	-0.50

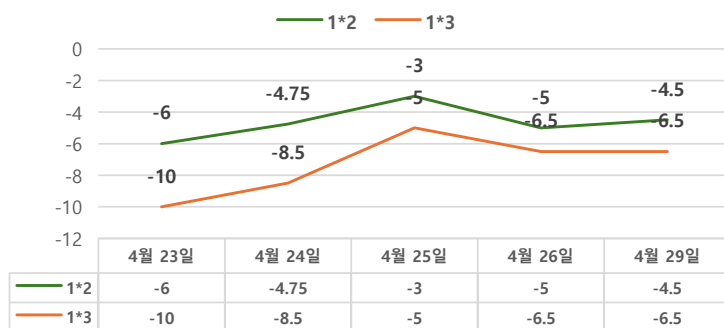
IRS 증가



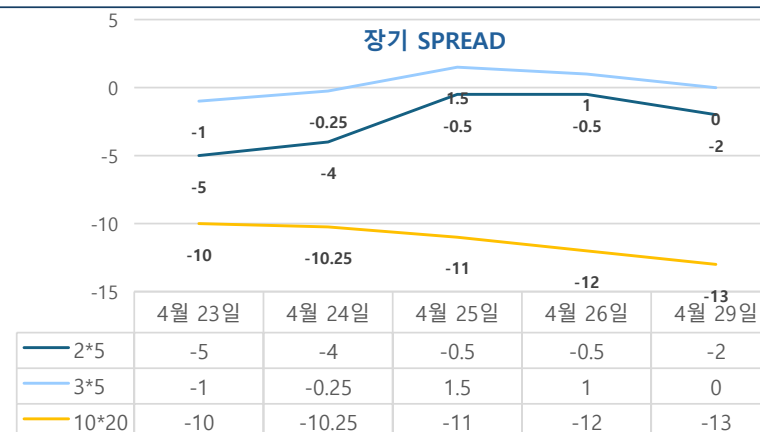
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

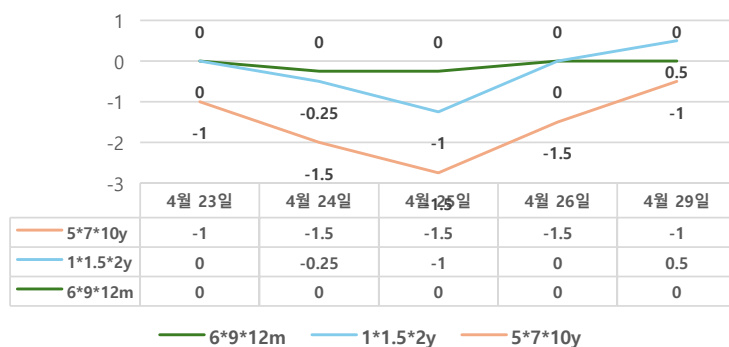


IRS 주요 커브

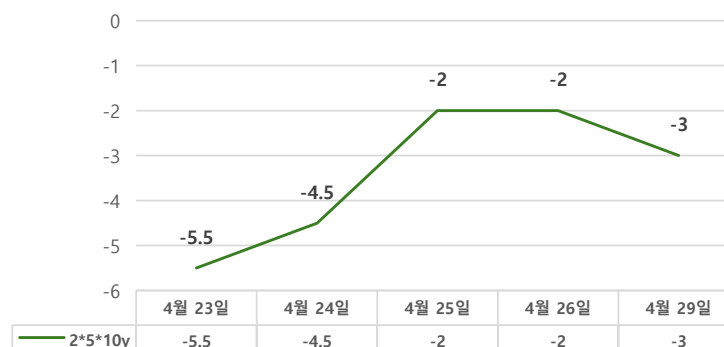
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-4.50	0.50
1*3y	-6.50	0.00
2*5y	-2.00	-1.50
3*5y	-4.00	-1.00
5*10y	1.00	-0.50
10*20y	-13.00	-1.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

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