

Market Daily Report



2024.05.20(월)

레포	건보자금 및 지방소비세 유입에 따른 유동성 개선 기대되어 공모주 및 실권주 청약 환불에도 금리 포함 출발하였음. 은행권 주말 앞두고 기준금리 수준 매도 수요 꾸준했으나 장 중 추가 자금 많지 않아 저금리 매칭 제한적이었음.
채권	한국 : 美 채권 약세에도 금주 금통위 금리 동결을 예상하며, 美 금리인하 지연 전망으로 관망세 확산. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승 마감함. 지난 주 주간 기준 국채금리가 하락한 만큼 차익 실현하려는 매도 심리 우위로 금리 상승한 모습. 이날 연준 인사들의 발언은 중립적. 미셸 보먼 연준 이사는 금리 인하, 상승 어느 쪽에도 힘을 실지 않으며 신중한 모습을 보임.
MONEY	미국 수입물가가 예상 큰 폭 상회하고 고용보험청구 건수가 6주래 최저를 기록한 한편 다수 연준의원들도 금리 인하에는 더 많은 증거 필요하다는 입장 보였음. 그러나 머니장 금리는 6달-1년 렌더가 다양해지는 추세 이어가며 3달 이내 비드가 많아지는 공급 상황 지속됨. 아시아장은 2주 월커버 수요가 증가해 월말 모드가 조기에 시작되며 2주 5.47%까지 상승함. 서울장은 오후 들어 예치성 자금 증가로 오버나잇 잉여 커져 5.31%까지 운용 나서는 5.37-5.31%로 체결 레인지 벌어지며 타이트한 상황 개선됨.
FX SWAP	외환스와프포인트는 미국의 4월 수입물가가 시장 예상보다 높게 오름에 따라 미 국채 금리가 반등하면서 대부분 하락한 것으로 파악됨. 1년물은 전장보다 -20전 내린 -2730전, 6개월은 -10전 내린 -1390원에 증가를 형성함. CPI 발표이후 올랐던 스와프포인트 상승분을 되돌리는 분위기였으며, 거래는 다소 한산한 장세를 유지함. 초단기는 이번주 내내 이윤가 대비 하방압력이 지속됐으며, 하루물 기준 -8.5전까지 내려오며 거래되는 모습을 보임.
IRS	전일 IRS는 전체적으로 국고채에 연동되면서 움직였고, 고요한 분위기를 보임. 전날 미국 4월 소비자물가지수(CPI)를 소화한 뒤 변동성이 제한되는 모습을 보였으며, 국고채 현물 역시 대체로 보험권에서 마감됨. 전체적으로 거래 자체가 한산한 분위기였으며, 6*12월 오퍼가 내려오면서 단기쪽 레벨이 바뀌었고, 장 막판에 10년쪽으로 오퍼가 내려오면서 4*10년으로 엮여 32.75에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준			
단위 : 조 원						단위 : bp			
2024.05.10(금)	186.6	206.1	3.53%	3.546%	3.500%	3.58%	2년물	4.835%	2.9
2024.05.13(월)	188.1	204.9	3.57%	3.546%		3.59%	5년물	4.451%	4.5
2024.05.14(화)	190.0	205.2	3.57%	3.563%		3.60%	10년물	4.425%	4.6
2024.05.16(목)	194.1	206.5	3.53%	3.542%		3.60%	30년물	4.562%	4.6
2024.05.17(금)	195.6		3.53%	3.534%		3.60%	10Y-2Y	-41	1.7

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	2,724.62	-28.38	51-03-10	국고 21-2	206	여전채 50	은행채 5,900	국고채 5년 23,000
KOSDAQ	855.06	-15.31	53-09-10	국고 23-7	90		여전채 200	통안채 91일물 7,000
달러-원	1,354.90원	9.90원	54-03-10	국고 24-2	68		회사채 750	
국고3Y	3.379%	0.4	52-03-10	국고 22-2	-100			
국고10Y	3.454%	-0.4	25-03-10	국고 23-3	-200			
국고10Y-3Y	7.5	-0.8	25-03-10	국고 20-1	-900			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
O/N	5.40	5.30	5.34	-0.03	O/N	5.38	5.28	5.33	-0.02
TN	5.40	5.30	5.37	-0.01	TN	5.40	5.30	5.36	-0.01
1W	5.45	5.35	5.40	-0.01	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.53	5.43	5.48	-0.02	1S	5.60	5.50	5.52	-0.01
3S	5.63	5.53	5.60	0.00	3S	5.70	5.60	5.65	-0.02
6S	5.65	5.55	5.60	0.00	6S	5.73	5.63	5.65	-0.03
1YR	5.60	5.50	5.53	-0.01	1YR	5.65	5.55	5.65	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	-22/-20	-22.0	5.47	-0.17	3.50	5.31000	1M MAR	-245	-240
TN	-8.5/-7.5	-8.0	5.64	0.00	3.50	5.31034	1W*1S	-175	-165
1W	-55/-53	-54	5.58	0.00	3.50	5.31235	1*2	-228	-224
1S	-235/-230	-230	5.51	-0.02	3.53	5.32008	1*3	-447	-440
3S	-685/-680	-680	5.58	0.00	3.59	5.32574	1*6	-1135	-1120
6S	-1400/-1380	-1380	5.67	0.00	3.62	5.27808	1*9	-1820	-1800
1YR	-2740/-2700	-2730	5.71	-0.04	3.62	5.10614	1*12	-2450	-2420

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)

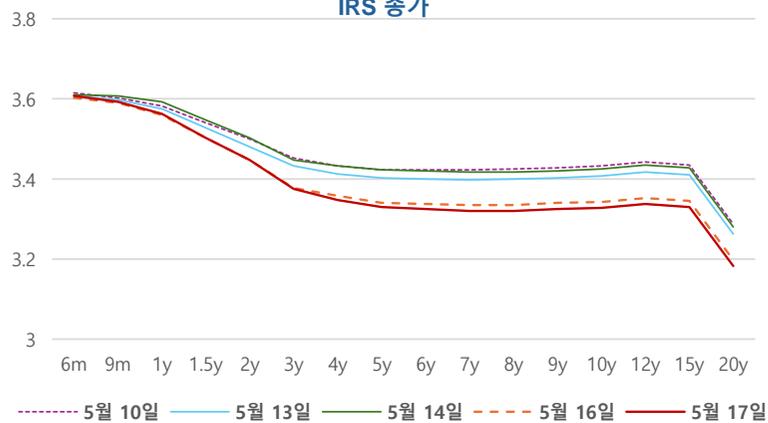
IRS 데일리 증가

5월 17일

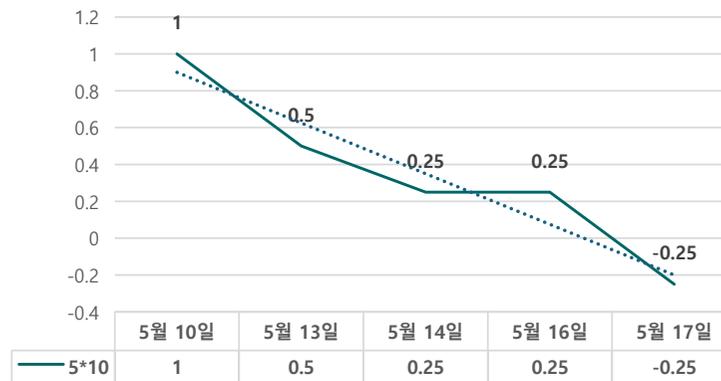
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6075	0.50
9m	3.5925	0.25
1y	3.5625	0.25
1.5y	3.5025	0.00
2y	3.4475	0.00
3y	3.3750	-0.25
4y	3.3475	-1.00
5y	3.3300	-1.00
6y	3.3250	-1.25
7y	3.3200	-1.50
8y	3.3200	-1.50
9y	3.3250	-1.50
10y	3.3275	-1.50
12y	3.3375	-1.50
15y	3.3300	-1.50
20y	3.1825	-1.50

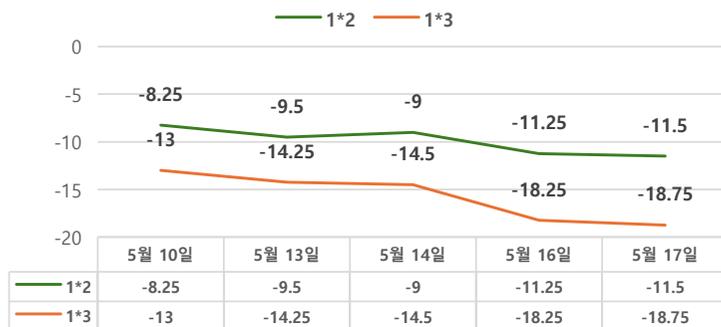
IRS 증가



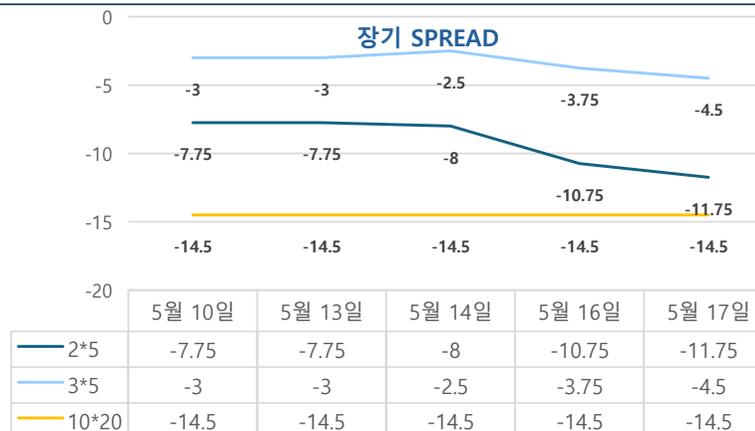
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

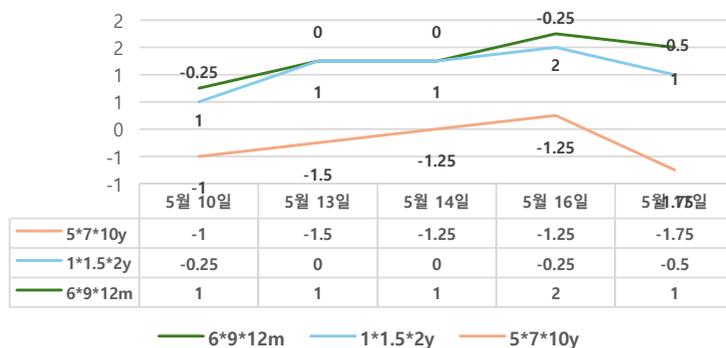


IRS 주요 커브

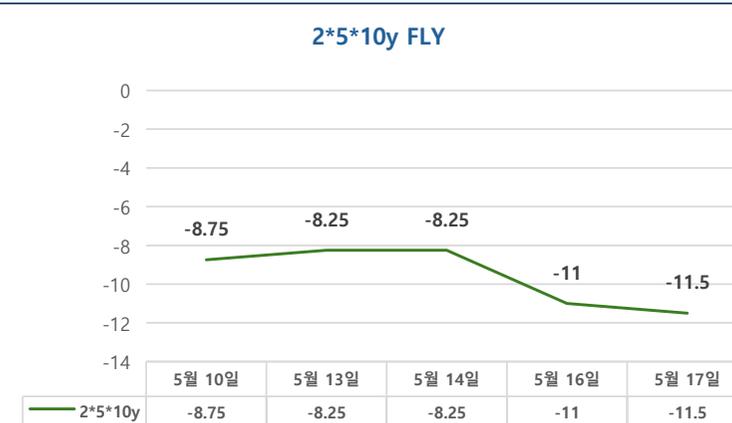
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-11.50	-0.25
1*3y	-18.75	-0.50
2*5y	-11.75	-1.00
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	-0.25	-0.50
10*20y	-14.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	1.50	-0.25
1*1.5*2y	-0.50	-0.25
2*5*10y	-11.50	-0.50
5*7*10y	-1.75	-0.50