

Market Daily Report



2024.05.21(화)

레포	건강보험공단 관련 설정 자금 유효하여 한은RP매입(6조) 만기 도래했음에도 시장 유동성에 큰 변화 없었음. 지난주 지방소비세 유입 후 적수 부족폭 축소되어 시은 매도 감소했으며, 장 중 추가자금 운용되어 체결금리 하락하였음.
채권	한국 : 뚜렷한 재료 부재한 가운데 오는 23일(목) 금통위 앞두고 경계심리 강화됨. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승 마감함. 시장은 연준 인사들의 대거 공개발언에 주목. 마이클 바 연준 부의장은 "1분기 인플레이션 수치는 실망"이라며 금리인하에 대한 추가적인 자신감을 주지 못했다고 언급하였음. 시장은 금리인상 가능성을 여전히 열고 매도세 우위로 마감됨.
MONEY	미 연준 인사들의 매파 발언과 중국 정부의 초장기 특별국채 발행 및 부동산 부양책 발표에 위안화 절하와 연계한 아시아 통화들이 약세를 보였음. 오전 장부터 초단기 달러 오버나잇 금리는 온쇼 5.36-5.38 수준으로 형성 및 체결 되었으며, 월말 커버 구간인 2주물이 아시아쪽 메인 차입 테너로 부각되면서 네 임별로 5.42-5.45 사이로 수렴되는 모습. 반면, 6월 분기 마감 자금 관리를 위해 온 & 윌슨 랜더들의 메인 운용 테너는 6월말 이내로 도래하는 1개월물로 5.48-5.53 사이로 제시 되면서 머니시장에서는 월말 마감과 분기마감 선관리를 위한 2주-1개월물 거래에 초점을 두고 있음.
FX SWAP	FX스와프포인트는 현물환 수급에 연동해서 초단기물의 변동성이 큰 가운데 단기 기간물이 소폭하락하며 장을 마감함. 오버나잇은 -9전, 탭백은 -8.5까지 이론가보다 낮은 수준으로 체결되었으며, 이는 중장기물의 하방압력에 힘을 더한 것으로 파악됨. 주말 미국채 금리가 소폭 반등했지만, 국고채 금리도 오르면서 장기물은 보합세를 보이며 마감함.
IRS	전일 IRS는 장기물 위주로 상승 마감, 지난주 미국 물가 발표 이후 계속된 강세 흐름이 주춤하면서 이번주에 다가올 금융통화위원회(금통위)를 대기하는 분위기를 보임, 전체적으로 한산한 모습을 보였으며, 시장에서 5년쪽으로 호가가 형성되면서 거래가 여러 차례 이뤄짐, 장 막판에 5년이 37/36.75가 대치되다, 36.75에 거래가 이뤄졌으며, 장 마감 후 3년 오퍼가 내려오면서 40.75에 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			
2024.05.13(월)	188.1	204.9	3.57%	3.546%	3.500%	3.59%	2년물	4.858%	2.3
2024.05.14(화)	190.0	205.2	3.57%	3.563%		3.60%	5년물	4.473%	2.2
2024.05.16(목)	194.1	206.5	3.53%	3.542%		3.60%	10년물	4.449%	2.4
2024.05.17(금)	195.6	208.1	3.53%	3.534%		3.60%	30년물	4.588%	2.6
2024.05.20(월)	192.2		3.53%	3.539%		3.60%	10Y-2Y	-40.9	0.1

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	2,742.14	17.52	54-03-10	국고 24-2	1,048	통안채 3,300	은행채 1,500	국고채 20년 7,000
KOSDAQ	847.08	-7.98	32-12-10	국고 22-14	200	공사채 5,950	여전채 600	
달러-원	1,355.90원	1.00원	43-09-10	국고 23-9	100		통안채 3,000	
국고3Y	3.412%	3.3	25-03-10	국고 20-1	-450		공사채 2,600	
국고10Y	3.497%	4.3	25-06-10	국고 22-4	-500			
국고10Y-3Y	8.5	1	25-03-10	국고 23-3	-500			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
O/N	5.40	5.33	5.37	0.03	O/N	5.38	5.30	5.35	0.02
TN	5.42	5.35	5.39	0.02	TN	5.40	5.33	5.37	0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.38	5.42	0.02
1S	5.53	5.43	5.49	0.01	1S	5.58	5.48	5.53	0.01
3S	5.65	5.55	5.60	0.00	3S	5.68	5.58	5.65	0.00
6S	5.65	5.55	5.60	0.00	6S	5.70	5.60	5.65	0.00
1YR	5.60	5.50	5.55	0.02	1YR	5.70	5.60	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	-9/-7	-8.0	5.62	0.15	3.50	5.31000	1M MAR	-240	-235
TN	-8.5/-7.5	-8.0	5.62	-0.02	3.50	5.31031	1W*1S	-191	-187
1W	-56/-54	-55	5.59	0.01	3.50	5.31220	1*2	-210	-200
1S	-255/-245	-250	5.55	0.04	3.53	5.31976	1*3	-435	-425
3S	-695/-685	-690	5.61	0.03	3.59	5.32580	1*6	-1140	-1090
6S	-1400/-1380	-1390	5.68	0.01	3.62	5.28321	1*9	-1825	-1785
1YR	-2750/-2700	-2730	5.71	0.00	3.61	5.12252	1*12	-2450	-2400

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)

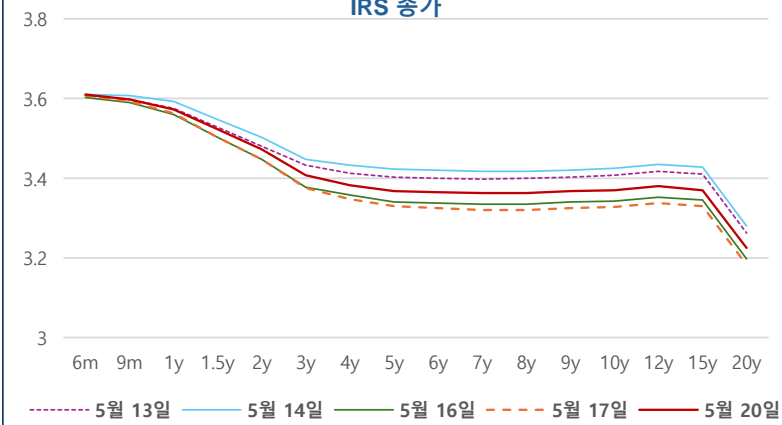
IRS 데일리 증가

5월 20일

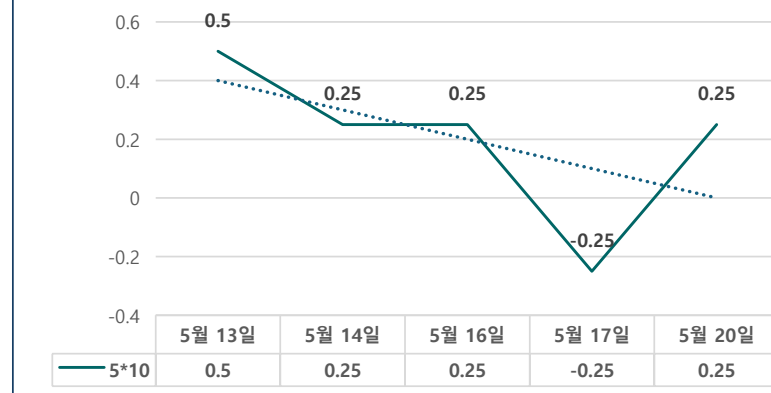
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6100	0.25
9m	3.5975	0.50
1y	3.5725	1.00
1.5y	3.5225	2.00
2y	3.4725	2.50
3y	3.4075	3.25
4y	3.3825	3.50
5y	3.3675	3.75
6y	3.3650	4.00
7y	3.3625	4.25
8y	3.3625	4.25
9y	3.3675	4.25
10y	3.3700	4.25
12y	3.3800	4.25
15y	3.3700	4.00
20y	3.2250	4.25

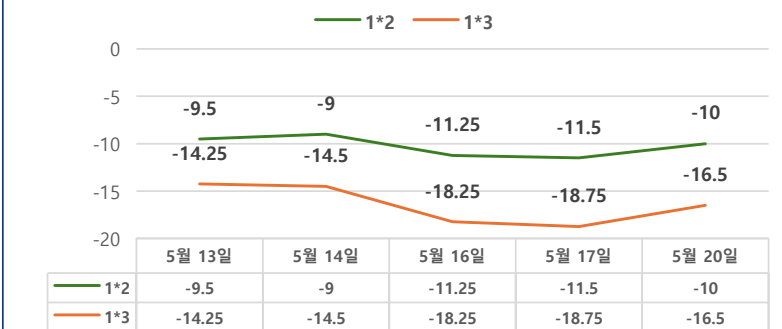
IRS 증가



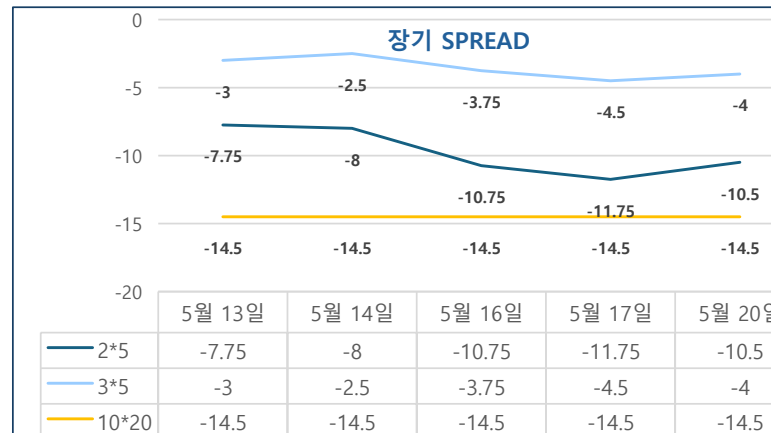
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

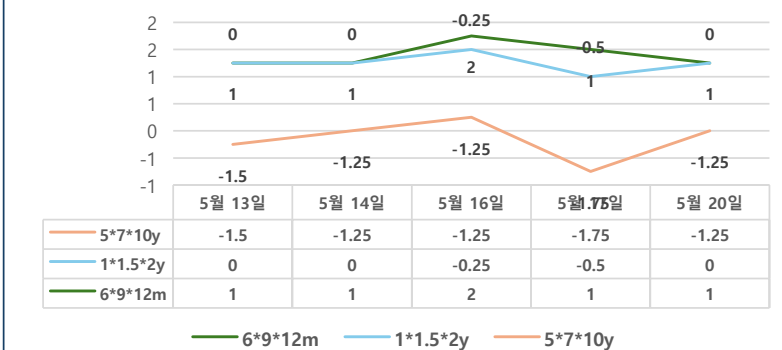


IRS 주요 커브

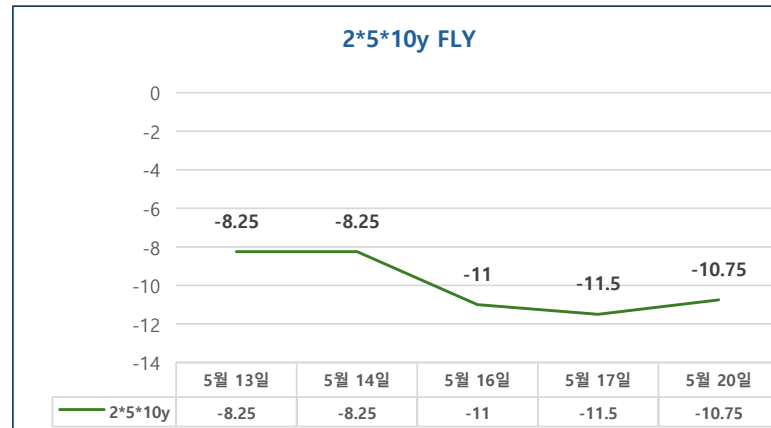
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-10.00	1.50
1*3y	-16.50	2.25
2*5y	-10.50	1.25
3*5y	-4.00	0.50
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	1.25	-0.25
1*1.5*2y	0.00	0.50
2*5*10y	-10.75	0.75
5*7*10y	-1.25	0.50