

Market Daily Report



2024.05.22(수)

레포	지난 월요일 장 막판 잉여세 반영되어 금리 소폭 하락했으며, 은행권 기준금리 수준 매도와 시작금리 전후 매수 흔재한 모습이었음. 통안계정은 만기 대비 감액(0.7조 → 0.1조) 실시했고, 장 중 잉여자금 지속 유입했으나 금리 낙폭은 제한적이었음.
채권	한국 : 질은 금통위 관망 분위기 속에 외인 선물 매도에도 금리 쉽게 상승하지 않아 시장 기대 확인함. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 하락 마감. 매파적 인사로 꼽히는 월러 연준 이사가 "1분기 인플레이션 지표가 나빴지만, 금리인상이 필요한 정도가 아니다." 발언은 채권시장에 긍정적으로 작용함. 시장 참여자들은 5월 FOMC 의사록을 기다리며 파월 의장의 메시지를 읽는데 집중할 예정임.
MONEY	연준의원들의 매파발언과 호주 기준금리 인상 가능성이 제기되면서 달러 강세 재시현. 24일 금통위를 앞두고, 서울 시장 포지션이 제한적인 가운데 금일 온소 달러 자금은 여유있는 모습. 오버나잇 5.35-5.37 수준으로 전일 대비 소폭 하락 & 오퍼 우위의 장세를 보였고, 온소 메이저 은행들의 6월 만기 이내 구간 운용 선호로 오퍼가 제시되면서 온소 1개월물 5.47-5.49 사이로 레벨 형성 및 체결 되었음. 연준의 연내 금리 인하 가능성이 유효한 가운데 윌슨 렌더들은 긴쪽 테너 오퍼 선호로 1년물 5.65-5.60 사이로 오퍼 제시되었고, 3개월물-1년물 레벨은 아시아계 네임은 대부분 5.60-5.65 사이로 FLAT하게 형성 중.
FX SWAP	외환스와프포인트는 다소 한산한 장세 속에 관망 분위기를 이어감. 초단기 약세가 지속되며 데일리 -8.5전 수준으로 거래 마감되었고, 기간물은 6개월만 소폭 오르고 나머지는 보험권에서 움직인 것으로 파악됨. 최근에 장기물이 올랐지만, 연방준비제도 인사들이 매파적인 발언을 계속하는 분위기여서 관망하는 장세로 보여지며, 초단기의 경우 원화 유동성 이슈가 월초부터 이어지고 있는것으로 분석되고 있음.
IRS	전일 IRS는 보험권에서 마감함. 다가오는 23일에 금융통화위원회(금통위)를 앞두고 방향성을 제공할 만한 특별한 요인이 없었으며, 한은의 향후 정책 방향이 어떻게 변화할 것인지에 대한 전망도 다 다른 분위기를 보임. 전체적으로 한산한 모습이었으며, 장 막판에 10년 오퍼가 소폭 내려오고 2*10년 비드가 -10.75까지 올라오면서 2년이 47.5, 10년이 36.75에 거래됨 .

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.05.14(화)	190.0	205.2	3.57%	3.563%	3.500%	3.60%	2년물	4.839%	-1.9
2024.05.16(목)	194.1	206.5	3.53%	3.542%		3.60%	5년물	4.441%	-3.2
2024.05.17(금)	195.6	208.1	3.53%	3.534%		3.60%	10년물	4.417%	-3.2
2024.05.20(월)	192.2	208.6	3.53%	3.539%		3.60%	30년물	4.551%	-3.7
2024.05.21(화)	195.1		3.52%	3.531%		3.60%	10Y-2Y	-42.2	-1.3

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,724.18	-17.96	54-03-10	국고 24-2	1,292	여전채 6,500	은행채 12,700	통안채 3년물 모집 2,000
KOSDAQ	846.51	-0.57	52-03-10	국고 22-2	1,007	회사채 2,496	여전채 2,100	통안채 2년물 모집 5,000
달러-원	1,363.30원	7.40원	33-12-10	국고 23-11	259		공사채 1,200	재정증권 63일물 20,000
국고3Y	3.411%	-0.1	40-09-10	국고 20-7	-22			
국고10Y	3.491%	-0.6	44-12-10	국고 14-7	-26			
국고10Y-3Y	8	-0.5	72-09-10	국고 22-12	-200			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.33	5.36	-0.01	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.42	5.35	5.37	-0.02	TN	5.40	5.35	5.37	0.00
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.43	5.38	5.40	-0.02
1S	5.53	5.43	5.48	-0.01	1S	5.55	5.45	5.52	-0.01
3S	5.65	5.55	5.58	-0.02	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	5.58	0.03	1YR	5.70	5.60	5.65	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8.5/-6.5	-7.5	5.48	-0.14	3.50	5.31000	1M MAR	-226	-225
TN	-9.5/-7.5	-8.5	5.74	0.12	3.50	5.31033	1W*1S	-182	-177
1W	-55/-51	-53	5.50	-0.09	3.50	5.31232	1*2	-214	-211
1S	-250/-230	-240	5.52	-0.03	3.53	5.32059	1*3	-440	-436
3S	-700/-680	-690	5.60	-0.01	3.59	5.32672	1*6	-1130	-1115
6S	-1400/-1380	-1390	5.65	-0.03	3.62	5.28779	1*9	-1825	-1800
1YR	-2750/-2700	-2730	5.71	0.00	3.62	5.13941	1*12	-2460	-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)

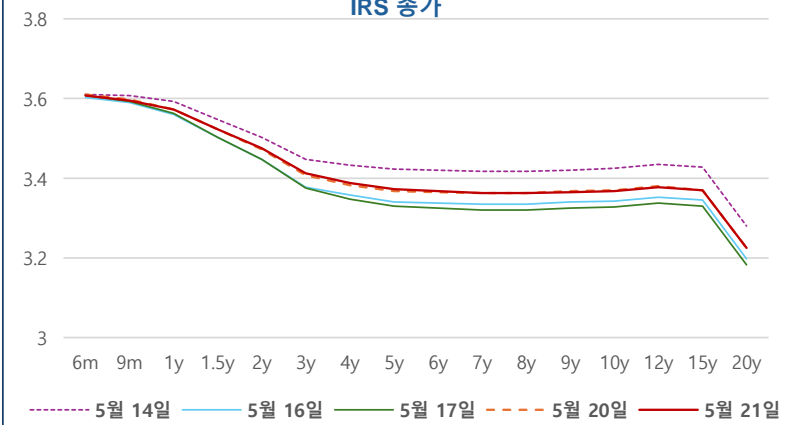
IRS 데일리 증가

5월 21일

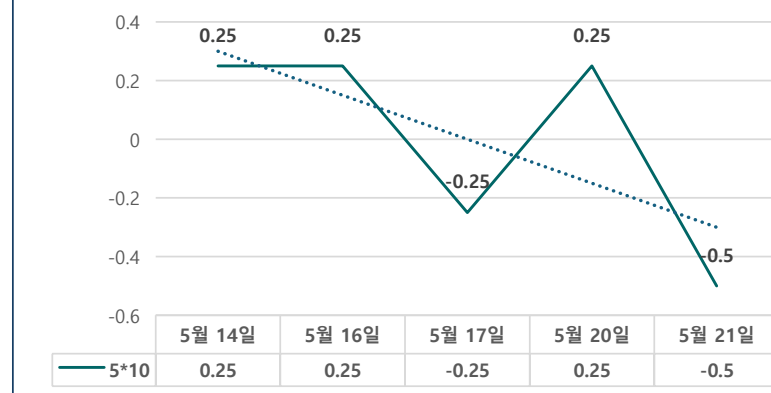
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6075	-0.25
9m	3.5950	-0.25
1y	3.5725	0.00
1.5y	3.5225	0.00
2y	3.4750	0.25
3y	3.4125	0.50
4y	3.3875	0.50
5y	3.3725	0.50
6y	3.3675	0.25
7y	3.3625	0.00
8y	3.3625	0.00
9y	3.3650	-0.25
10y	3.3675	-0.25
12y	3.3775	-0.25
15y	3.3700	0.00
20y	3.2250	0.00

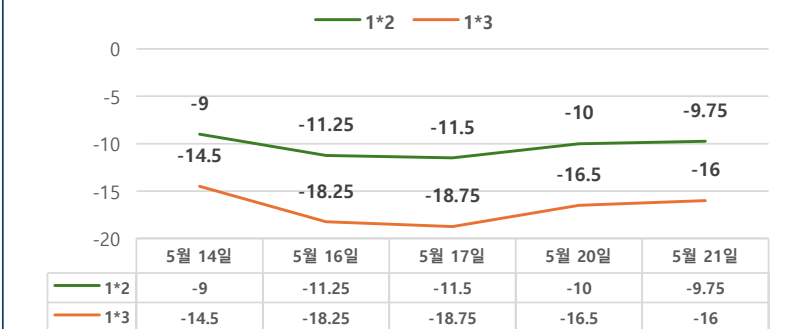
IRS 증가



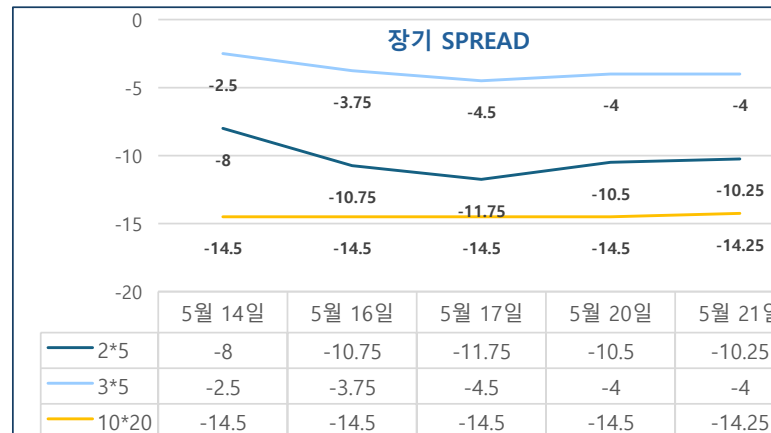
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

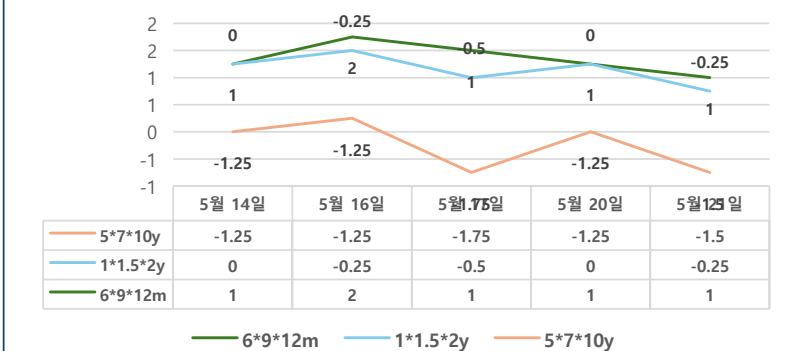


IRS 주요 커브

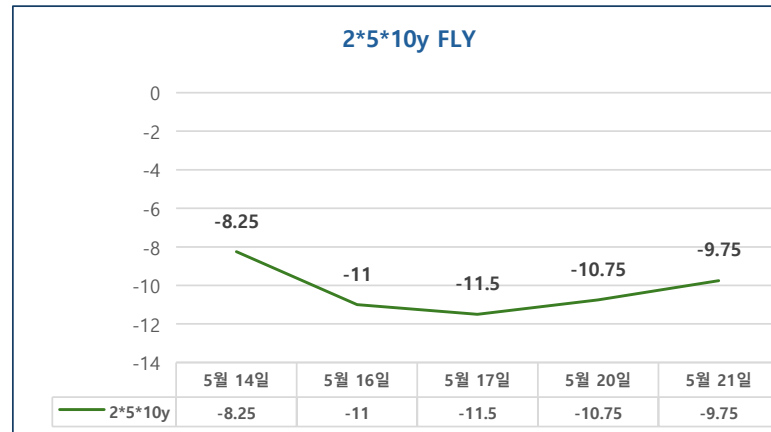
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-9.75	0.25
1*3y	-16.00	0.50
2*5y	-10.25	0.25
3*5y	-4.00	0.00
5*10y	-0.50	-0.75
10*20y	-14.25	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	1.00	-0.25
1*1.5*2y	-0.25	-0.25
2*5*10y	-9.75	1.00
5*7*10y	-1.50	-0.25