

Market Daily Report



2024.05.23(목)

레포	공모주 청약자금(미래에셋비전스팩4호) 유입 기대되어 금리 하락 출발했으며, 시은 매도 급증하여 자금 급속도로 소진되었음. 장 중 추가 매수 많지 않아 막판까지 빠듯한 장세 지속되었고, 월 넘기는 기일을 조달금리 소폭 상승하는 모습을 보임.
채권	한국 : 금통위 앞두고 경계감 확산 중 영국 물가지표 서프라이즈, 뉴질랜드 통화정책회의 영향에 금리하락 일부 반납함. 미국 : 미 국채금리는 30년물 제외 상승하며 혼조 마감함. 5월 FOMC 회의 당시에 나온 물가 및 고용지표가 좋지 않았던 영향으로 5월 FOMC 의사록은 매파적임. 통화정책에 민감한 단기 2년물은 4.1bp 가량 상승했으나, 중장기물은 크게 반응하지 않은 모습임.
MONEY	금일 기재부의 발표에 따르면, 1분기 대외 채무가 작년말 대비 감소했고 특히 단기 외채 비율이 감소 하면서 LCR도 147.5%로 규제비율인 80%를 크게 상회했다는 소식. 온쇼 달러 자금은 4월말 구간 자금 변동성이 컸던것에 비해 시중은행들은 5월 월말 구간의 자금 여유분 확보로 반기마감 준비에 돌입. 1개월 운용 가능 상품이 머니 시장 금리 대비 큰 메리트가 없는 것도 일부 유입 되고 있는 것으로 보여 5월말 마감은 수월 할 것으로 예상됨. 월말 커버 2주물과 1개월물 레벨은 변동성이 제한적인 가운데 5.45-5.50 사이로 형성중.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 수급을 처리하며 대체로 소폭 오른것으로 파악되며, 1년 만기 스와프는 전장보다 10전 오픈 -2740전, 6개월도 10전 오른 -1380전에 증가가 형성됨. 외화자금시장은 이번주 관망 분위기가 이어지며 변동성이 제한되는 흐름을 보이고 있으며, 미국채와 국고채 금리의 움직임에 양방향 연동하며 좁은 레인 지 안에서 움직임은 제한되고 있음. 초단기의 경우, 최근 이론가 아래에서 체결이 주로 되었지만 오늘은 이론가 수준에서 거래가 많았던 것으로 파악됨.
IRS	전일 IRS는 단기 위주로 하락 마감. 전일 미 국채 시장과 연동되면서 채권이 장중 강세를 보임에 따라, 이에 연동되는 모습을 보였으며 금융통화위원회(금통위)를 하루 앞두고 경계하는 분위기도 형성됨. 장 막판 예상을 웃돈 영국 소비자물가지수(CPI) 발표 후 글로벌에 연동되면서 국내 시장 역시 급격히 약세로 전환됐으며, 이날 발표된 영국의 4월 CPI는 전년대비 2.3% 상승하면서 예상치를 상회함. 3개월 뒤 픽싱이 다음 금융통화위원회(금통위)인 8월 22일이라 단기쪽으로 오퍼가 많 이 나오는 모습을 보였으며 1년이 55-55.5에 거래가 이뤄짐. 장 막판에 10년이 비드 오퍼가 다 나오면서 36에 거래가 이뤄졌으며, 장 마감 후 9개월이 57.25오퍼 까지 시장에서 나옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.05.16(목)	194.1	206.5	3.53%	3.542%	3.500%	3.60%	2년물	4.880%	4.1
2024.05.17(금)	195.6	208.1	3.53%	3.534%		3.60%	5년물	4.469%	2.8
2024.05.20(월)	192.2	208.6	3.53%	3.539%		3.60%	10년물	4.427%	1
2024.05.21(화)	195.1	208.0	3.52%	3.531%		3.60%	30년물	4.540%	-1.1
2024.05.22(수)	196.7		3.50%	3.531%		3.60%	10Y-2Y	-45.3	-3.1

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,723.46	-0.72	24-07-25	재정채	810	은행채 3,300	은행채 11,200	
KOSDAQ	845.72	-0.79	54-03-10	국고 24-2	710	여전채 4,600	여전채 2,900	
달러-원	1,362.90원	-0.40원	26-03-10	국고 24-3	500	회사채 2,002	회사채 70	
국고3Y	3.409%	-0.2	28-03-10	국고 23-1	-70	공사채 2,000	공사채 1,762	
국고10Y	3.478%	-1.3	27-09-10	국고 22-8	-150			
국고10Y-3Y	6.9	-1.1	32-06-10	국고 22-5	-300			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.01	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.41	5.34	5.38	0.01	TN	5.38	5.33	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	0.00	1S	5.56	5.46	5.52	-0.01
3S	5.65	5.55	5.58	0.00	3S	5.68	5.58	5.65	0.00
6S	5.65	5.50	5.60	0.00	6S	5.70	5.60	5.65	0.00
1YR	5.63	5.48	5.58	0.00	1YR	5.68	5.58	5.65	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8.5/-7.5	-8.0	5.61	0.13	3.50	5.31000	1M MAR	-228	-226
TN	-9.0/-7.0	-8.0	5.61	-0.13	3.50	5.31040	1W*1S	-176	-165
1W	-55/-51	-53	5.50	0.00	3.50	5.31277	1*2	-213	-214
1S	-240/-220	-230	5.50	-0.02	3.53	5.32225	1*3	-460	-455
3S	-720/-680	-700	5.59	-0.01	3.59	5.32946	1*6	-1120	-1100
6S	-1400/-1360	-1380	5.64	0.00	3.62	5.29466	1*9	-1820	-1790
1YR	-2760/-2720	-2740	5.71	0.00	3.63	5.15806	1*12	-2460	-2420

국내의 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)

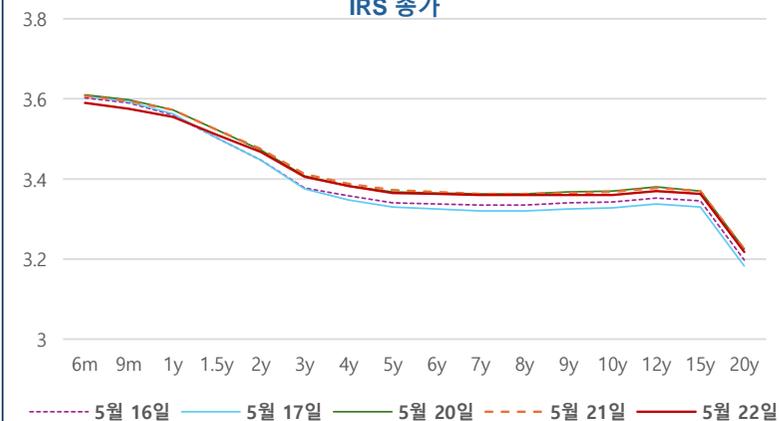
IRS 데일리 증가

5월 22일

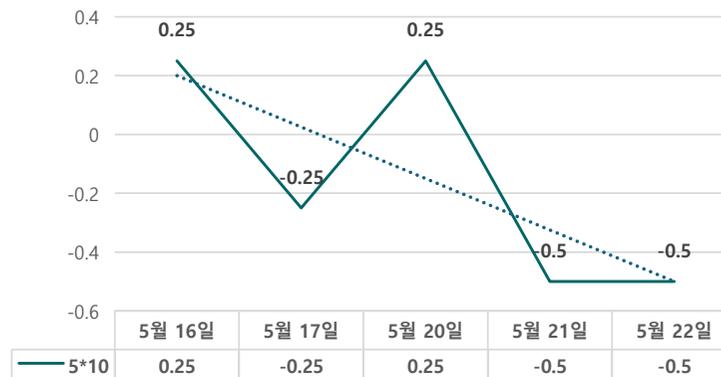
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5900	-1.75
9m	3.5750	-2.00
1y	3.5550	-1.75
1.5y	3.5100	-1.25
2y	3.4675	-0.75
3y	3.4050	-0.75
4y	3.3825	-0.50
5y	3.3650	-0.75
6y	3.3625	-0.50
7y	3.3600	-0.25
8y	3.3600	-0.25
9y	3.3600	-0.50
10y	3.3600	-0.75
12y	3.3700	-0.75
15y	3.3625	-0.75
20y	3.2175	-0.75

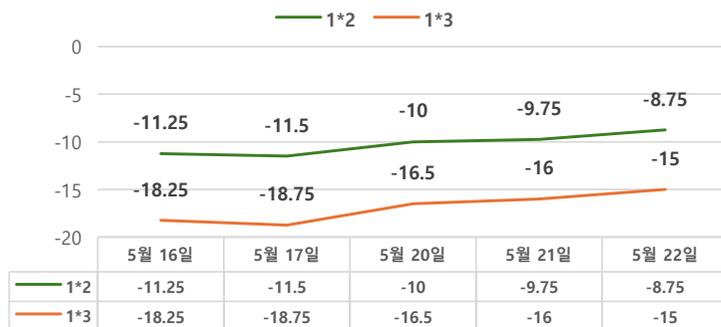
IRS 증가



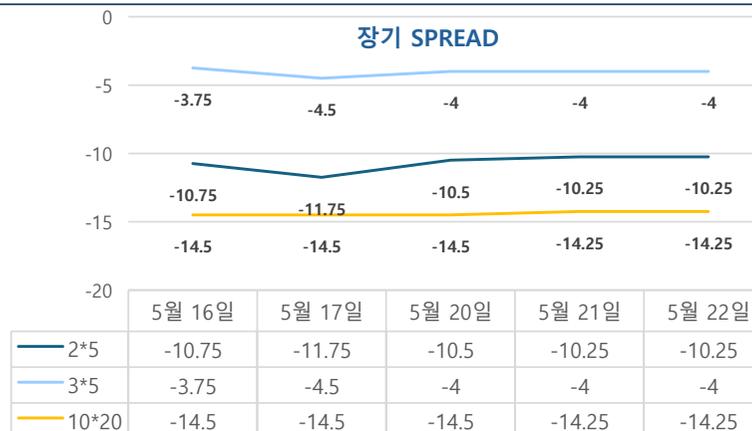
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

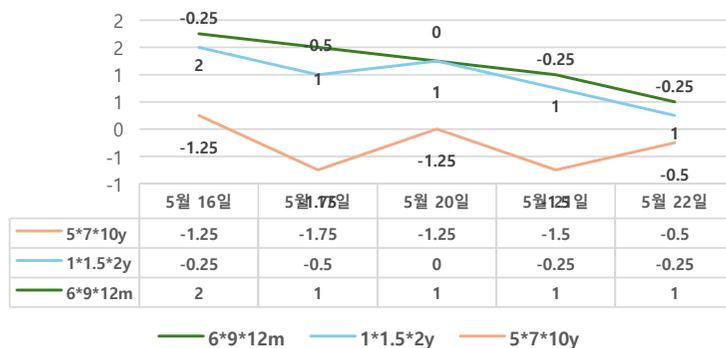


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-8.75	1.00
1*3y	-15.00	1.00
2*5y	-10.25	0.00
3*5y	-4.00	0.00
5*10y	-0.50	0.00
10*20y	-14.25	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.50	-0.50
1*1.5*2y	-0.25	0.00
2*5*10y	-9.75	0.00
5*7*10y	-0.50	1.00