

# Market Daily Report



2024.05.24(금)

<b>레포</b>	수요일의 빠듯했던 장세 반영되어 금리 소폭 상승 출발한 가운데 장 초반 시은 저금리 탐색하며 조달에 신중한 모습이었음. 운용사 및 신탁 매수 감소하여 회사채 해소에 난항을 겪었으며, 장 중 일반채 역시 일시적인 조달 정체를 보였음. ※ 한국은행 기준금리 연 3.5%로 11차례 연속 동결
<b>채권</b>	한국 : 금통위 결과와 한은 총재 발언이 시장 기대보다 비둘기파로 확인되며 안도함.외인, 마감 전 선물매수 대응함. 미국 : 미 국채 금리는 전구간 상승 마감함. 장 초반 금리는 하락세를 보였지만 미국 서비스업 및 제조업 업황이 빠르게 개선되었다는 소식에 상방으로 전환됨. 이날 10년 물가채 입찰에서도 지난 6번의 입찰 평균 금리를 상회하는 금리로 결정되고 응찰률 역시 평균치를 밑돌며 약한 수요를 확인함.
<b>MONEY</b>	ECB 중앙은행은 6월 금리인하에 무게를 두었고, FOMC 의사록에 따르면 연준 인사들은 금리 인하에 신중론을 보였다는 해석. 반면, 미국 경제 지표가 호조를 보이며 달러 가치는 하락세를 보였음. 최근 중국과 대만의 지정학적 리스크가 부각되었으나 아시아 시장 달러 롱이 깊어 월말 커버 구간의 초단기 달러 금리는 변동성 없이 안정적인 모습. 전월 월말 커버 구간의 1주 레벨이 5.60-5.70대까지 급등 했던 것에 비해 금주 월커버 1주물은 5.40-5.45 수준에서 오피 우위를 보이며 마감될 것으로 예상. 1년물 오피는 중국계로 5.60-5.65, 한국계로 5.50-5.55 수준으로 제시중.
<b>FX SWAP</b>	외환스와프포인트는 1년물이 다소 하락하는 흐름을 나타냈으며, 미국채 금리는 오르고, 국고채 금리는 내리면서 스와프포인트가 밀린 것으로 파악됨. 장기를 위주로 조금 빠졌는데 FOMC 의사록 나온 것을 시장은 매파적으로 해석됐고 금통위를 비둘기파적으로 인식하며 스와프포인트가 연동함.
<b>IRS</b>	금일 IRS는 소폭 하락 마감했으나 20*30년 -37 온소 거래로 초장기 레벨은 올라가게 됨. 금융통화위원회를 소화하면서 국채선물에 연동되어 움직이는 분위기였으며, 장 막판에는 7년과 10년이 34.5에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 6*12개월 비드가 -4.25까지 올라오면서 6개월은 58, 1년은 53.75에 거래됐으며, 1.5년이 49 비드까지 나옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
2024.05.17(금)	195.6	208.1	3.53%	3.534%	3.500%	3.60%	2년물	4.946%	6.6
2024.05.20(월)	192.2	208.6	3.53%	3.539%		3.60%	5년물	4.537%	6.8
2024.05.21(화)	195.1	208.0	3.52%	3.531%		3.60%	10년물	4.481%	5.4
2024.05.22(수)	196.7	210.0	3.50%	3.531%		3.60%	30년물	4.583%	4.3
2024.05.23(목)	189.4		3.53%	3.556%		3.60%	10Y-2Y	-46.5	-1.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,721.81	-1.65	27-06-10	국고 24-4	727	은행채 6,100	은행채 15,500	
KOSDAQ	846.58	0.86	41-09-10	국고 21-9	350	여전채 5,800	여전채 6,700	
달러-원	1,362.40원	-0.50원	54-03-10	국고 24-2	300	회사채 2,640	회사채 1,110	
국고3Y	3.402%	-0.7	31-12-10	국고 21-11	-6		공사채 3,600	
국고10Y	3.472%	-0.6	43-09-10	국고 23-9	-10			
국고10Y-3Y	7	0.1	26-06-10	국고 23-4	-25			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.00	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.40	5.35	5.38	0.01
1W	5.47	5.37	5.42	0.02	1W	5.46	5.40	5.43	0.03
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.56	5.46	5.52	0.00
3S	5.65	5.55	5.58	0.00	3S	5.68	5.58	5.63	-0.02
6S	5.65	5.50	5.60	0.00	6S	5.70	5.60	5.65	0.00
1YR	5.60	5.45	5.55	-0.03	1YR	5.68	5.58	5.63	-0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7.5/-6.5	-7.0	5.35	-0.26	3.50	5.31000	1M MAR	-227	-223
TN	-32/-30	-31.0	5.55	-0.06	3.50	5.31157	1W*1S	-175	-170
1W	-54/-50	-52	5.46	-0.04	3.50	5.31275	1*2	-225	-215
1S	-240/-220	-230	5.50	0.00	3.53	5.32216	1*3	-450	-440
3S	-700/-670	-685	5.58	-0.01	3.59	5.33085	1*6	-1130	-1100
6S	-1400/-1360	-1380	5.64	0.00	3.62	5.29392	1*9	-1830	-1800
1YR	-2760/-2720	-2740	5.73	0.02	3.63	5.14754	1*12	-2480	-2450

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	1.10(수) / 2.7(수) / 3.6(수) / <b>4.10(수)</b> / 5.8(수) / 6.5(수) / 7.10(수) / 8.7(수) / 9.11(수) / <b>10.9(수)</b> / 11.6(수) / 12.11(수)

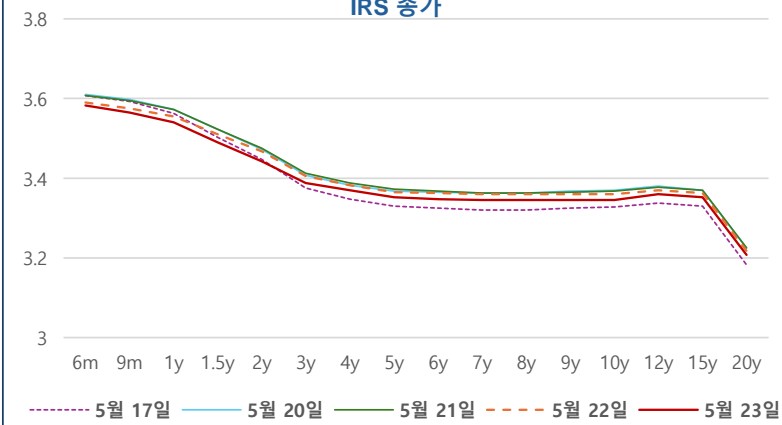
IRS 데일리 증가

5월 23일

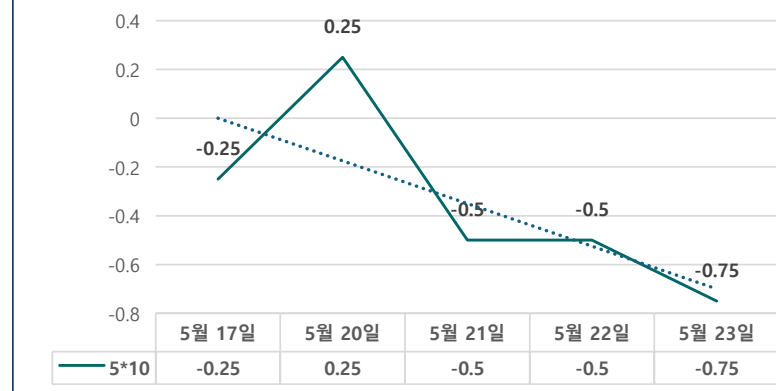
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5825	-0.75
9m	3.5650	-1.00
1y	3.5400	-1.50
1.5y	3.4900	-2.00
2y	3.4425	-2.50
3y	3.3875	-1.75
4y	3.3700	-1.25
5y	3.3525	-1.25
6y	3.3475	-1.50
7y	3.3450	-1.50
8y	3.3450	-1.50
9y	3.3450	-1.50
10y	3.3450	-1.50
12y	3.3600	-1.00
15y	3.3525	-1.00
20y	3.2075	-1.00

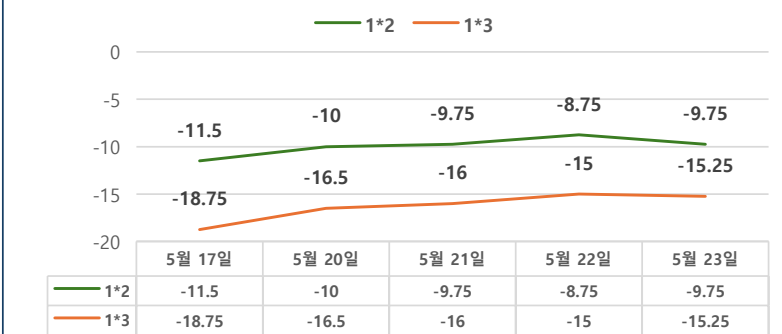
IRS 증가



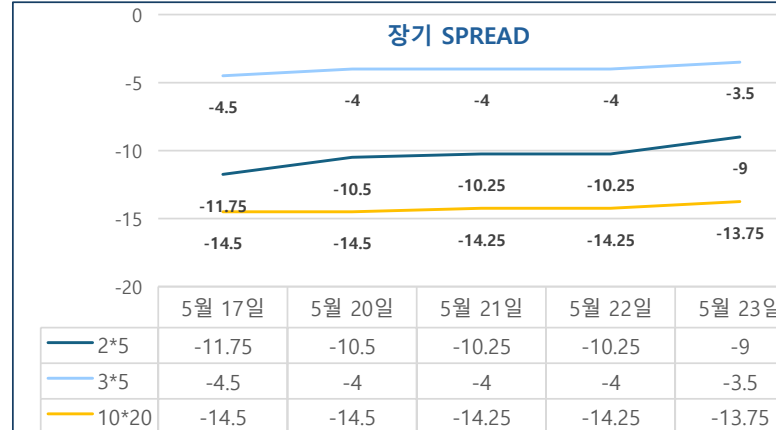
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

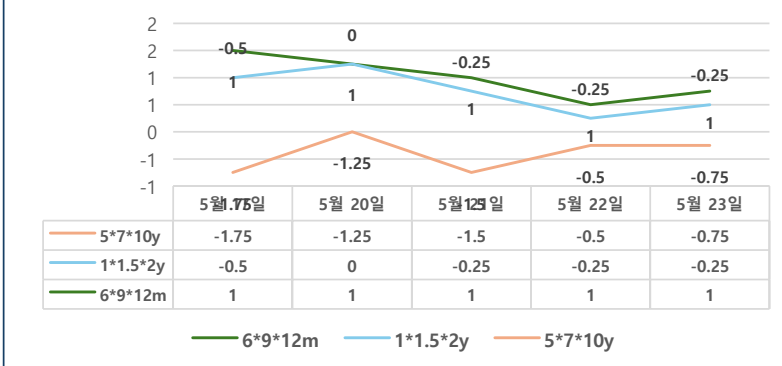


IRS 주요 커브

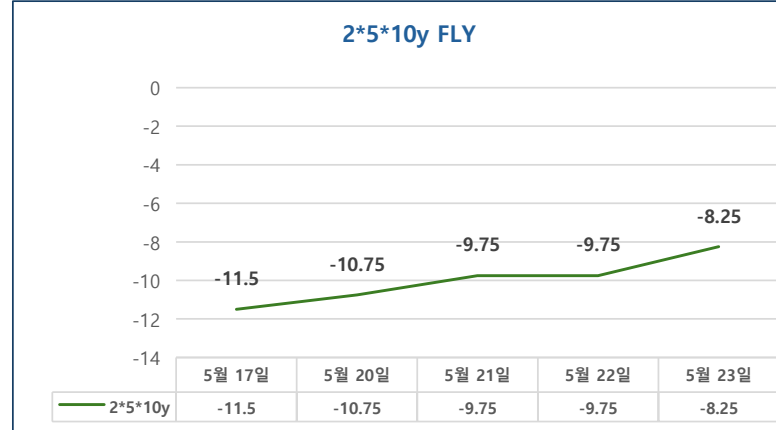
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-9.75	-1.00
1*3y	-15.25	-0.25
2*5y	-9.00	1.25
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	-0.75	-0.25
10*20y	-13.75	0.50

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.75	0.25
1*1.5*2y	-0.25	0.00
2*5*10y	-8.25	1.50
5*7*10y	-0.75	-0.25