

Market Daily Report



2024.05.27(월)

레포	행안부 재정 유입되어 당일기준 호전되었으나 회사채 담보 해소 쉽지 않아 시작금리 소폭 상승 출발하였음. 조달금리 부담으로 시은 매도 감소하여 일반채 해소 원활했던 반면, 회사채 정체는 오후까지 계속되었음.
채권	한국 : 뉴욕 채권시장 분위기 연동해 금리 상승세 지속되었음. 2년물 美 국채금리 하락으로 금리 상승세 제한되며 관망세 유지되었음. 미국 : 미 국채 금리는 2년물 제외 하락하며 혼조 마감. 연후를 앞두고 채권시장은 비교적 한산한 분위기 속 장 초반 고금리 환경에서 조차 미 경제가 확장하고 있다는 소식에 매도세 형성됨. 편 미시간대 소비자심리지수는 5월 들어 크게 급락했고, 단기 기대 인플레이션은 오르며 채권시장의 양면적인 시그널에 힘입어 국채 금리는 혼조세 강화되었음.
MONEY	5월 미국 서비스업 및 제조업 PMI 예비치가 시장 전망치를 웃돌았고, 미국의 보조 경제지표 호조에 미국 10년물 국채 금리 수익률은 전주 대비 상승세를 보이며, SOFR 금리도 전일 대비 전 구간 소폭 상승세를 보였음. 중국과 대만의 지정학적 리스크가 여전하지만 중국 및 홍콩의 위안화와 금리는 대체적으로 안정적인 수준으로 CNH o/n 1.50-1.80 1개월물 2.30-2.80 사이로 유지 되면서 마감. 월요일 5/27 Memorial Day 로 미국 휴장을 맞아 온 & 오프쇼 4일물 오버나잇 레벨은 장 마감 경 오퍼가 남아 마무리 되면서 5.35-5.37 사이로 형성됨.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 구간별로 등락이 엇갈렸으며, 1년물은 전장보다 40전 내린 -2780전, 6개월물은 20전 내린 -1400전에 최종 호가되었음. 오는 27일 미국 메모리얼 데이 를 맞아 다소 한산한 장세를 보였으며, 1달 안쪽 단기 구간만 역외 달러 매수에 따른 강세 흐름이 있었던 것으로 보임. 오프쇼어 1개월물 NDF 거래 유입에 비드가 강했으며, 이에 연동한 온쇼어 달러버리 1달 비드가 다소 가벼워진 것으로 파악됨.
IRS	전일 IRS는 미국 서비스업 pmi지수가 예상치 상회로 금리 인하 불확실성이 커진 영향에 따라 상승 마감. 대체로 한산한 분위기였으며 장 막판에는 2년이 45.75, 5년이 38.5에 거래되었으며 10년이 39 거래 후 오퍼가 38.75까지 내려옴. 마감 이후에는 5년이 38.5/38.25, 10년이 39/38.75에 대체되다 5년은 38.5, 10년은 39에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
단위 : 조 원						단위 : bp			
						한국시간 오전 07:05 기준			
2024.05.20(월)	192.2	208.6	3.53%	3.539%	3.500%	3.60%	2년물	4.957%	1.1
2024.05.21(화)	195.1	208.0	3.52%	3.531%		3.60%	5년물	4.534%	-0.3
2024.05.22(수)	196.7	210.0	3.50%	3.531%		3.60%	10년물	4.470%	-1.1
2024.05.23(목)	189.4	207.0	3.53%	3.556%		3.60%	30년물	4.575%	-0.8
2024.05.24(금)	190.2		3.56%	3.565%		3.60%	10Y-2Y	-48.7	-2.2

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
KOSPI	2,687.60	-34.21	27-12-10	국고 17-7	5,650	여전채 3,000	여전채 3,150	통안채 91일 7,000
KOSDAQ	839.41	-7.17	54-03-10	국고 24-2	1,216	회사채 250	회사채 1,800	
달러-원	1,369.50원	7.10원	28-03-10	국고 23-1	1,000	공사채 1,800		
국고3Y	3.423%	2.1	52-03-10	국고 22-2	-400			
국고10Y	3.515%	4.3	25-03-10	국고 23-3	-800			
국고10Y-3Y	9.2	2.2	31-12-10	국고 21-11	-3,004			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
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	0.00
1W	5.50	5.40	5.45	0.03	1W	5.48	5.43	5.45	0.02
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.58	5.48	5.53	0.01
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.68	5.58	5.63	0.00
6S	5.65	5.50	5.60	0.00	6S	5.70	5.60	5.65	0.00
1YR	5.60	5.45	5.53	-0.02	1YR	5.68	5.58	5.63	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
O/N	-28/-26	-27.0	5.28	-0.07	3.50	5.31000	1M MAR	-218	-215
TN	-8/-7	-7.5	5.47	-0.08	3.50	5.31048	1W*1S	-175	-170
1W	-54/-50	-52	5.45	-0.01	3.50	5.31336	1*2	-225	-220
1S	-230/-220	-225	5.44	-0.06	3.53	5.32488	1*3	-450	-440
3S	-700/-670	-685	5.57	-0.01	3.59	5.33589	1*6	-1150	-1130
6S	-1420/-1380	-1400	5.67	0.03	3.63	5.30080	1*9	-1860	-1830
1YR	-2760/-2720	-2780	5.75	0.02	3.63	5.16692	1*12	-2520	-2480

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)

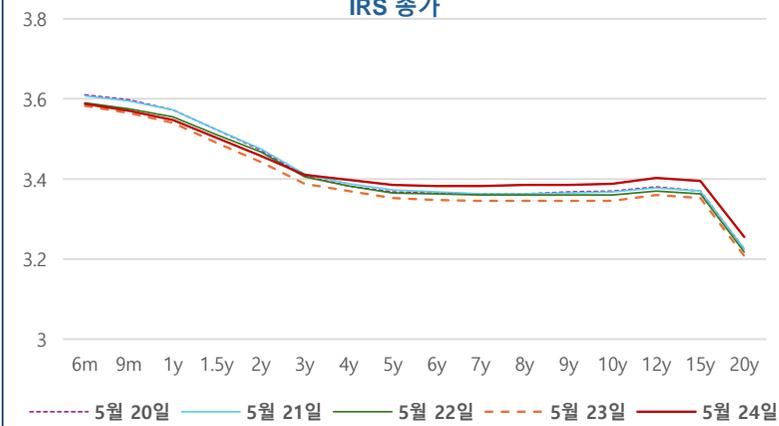
IRS 데일리 증가

5월 24일

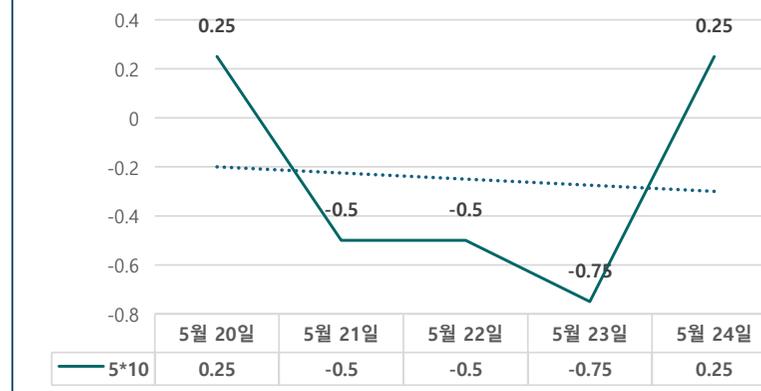
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5875	0.50
9m	3.5700	0.50
1y	3.5475	0.75
1.5y	3.5025	1.25
2y	3.4575	1.50
3y	3.4100	2.25
4y	3.3975	2.75
5y	3.3850	3.25
6y	3.3825	3.50
7y	3.3825	3.75
8y	3.3850	4.00
9y	3.3850	4.00
10y	3.3875	4.25
12y	3.4025	4.25
15y	3.3950	4.25
20y	3.2550	4.75

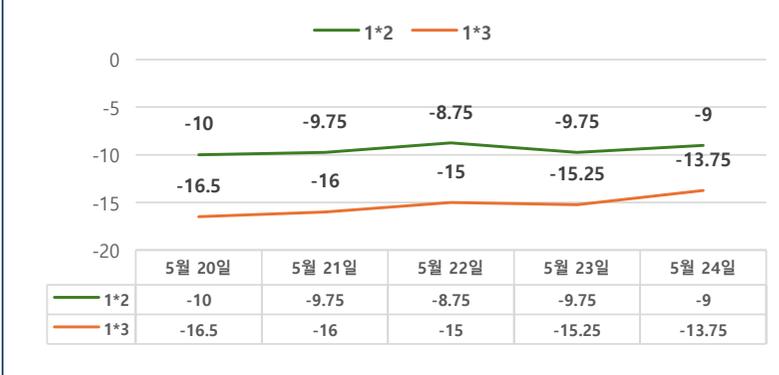
IRS 증가



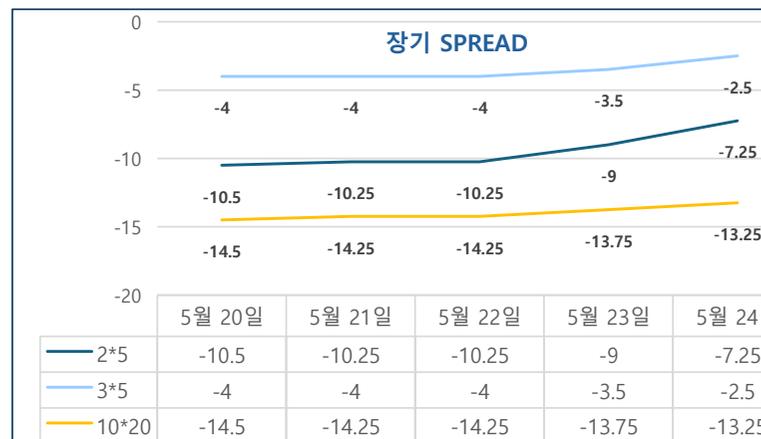
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

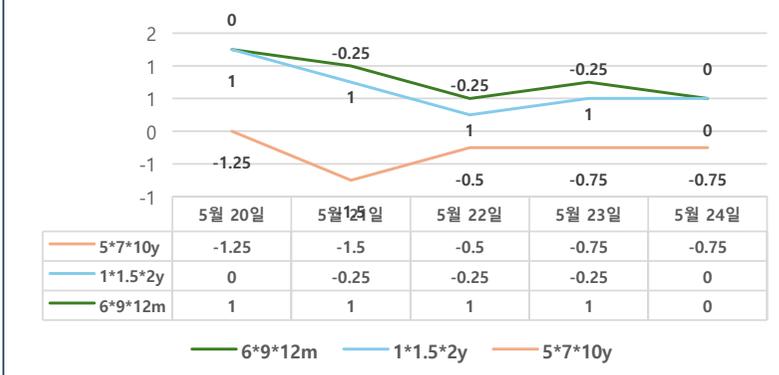
구분	증가	전일대비
1*2y	-9.00	0.75
1*3y	-13.75	1.50
2*5y	-7.25	1.75
3*5y	-4.00	1.00
5*10y	0.25	1.00
10*20y	-13.25	0.50

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.50	-0.25
1*1.5*2y	0.00	0.25
2*5*10y	-7.50	0.75
5*7*10y	-0.75	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY

