

Market Daily Report



2024.05.28(화)

레포	별다른 유동성 개선요인 없어 당일기준 양전환 후 적수 부족폭 축소됐음에도 조달여건 크게 호전되지 못함. 시은 저금리 조달日止 꾸준했으나 장 중 추가 자금 많지 않아 금리 낙폭 제한적이었으며, 회사채 정채 지속되었음.
채권	한국 : 미 금융시장 휴장을 앞두고 질은 관망 분위기 속에 어제 뉴욕 채권시장 흐름 따라 수익률곡선의 플래트닝 분위기 유지함. 미국 : '메모리얼 데이' 로 휴장함. 유럽 주요 국 채 금리는 대체로 하락 마감함. 6월 금리 인하를 시사하는 ECB 위+원들의 발언에 국채 투자 심리가 개선된 영향으로 풀이됨.
MONEY	이번주에는 미국, 유로존, 일본의 인플레이션 지표 및 중국 제조업 건전성 발표가 예정되어 있음. 금일 뉴욕 휴장으로 머니 시장이 한가한 가운데, KEB 하나 이체로 o/n 5.34-5.35 체결 되었고, 역내의 월말 커버 1주물만 비디시한 모습을 보이며, 1주물 5.47-5.42 사이로 형성. FX 스왑 반기말 넘기는 2개월물도 -450 전까지 올라오면서 달러 2개월물 금리 5.52-5.54 사이로 환산, 머니 시장에서도 반기말 커버 구간 숏2개월물 (35-37일물)도 5.50-5.58 사이로 거래되면서 현재 반기 마감에 따른 프리미엄은 반영되지 않고 있음.
FX SWAP	미국 휴장을 맞아 다소 한산한 장세를 보였으며 대체로 보험권에서 실수율 몰량만 소량 거래되는 분위기였음. 1년 만기스와프만 전장보다 50전 밀린 -2830전, 6개월물은 전일과 같은 -1400전에 증가를 형성함. 미국 메모리얼데이 휴장을 앞두고 1년물만 소폭 밀렸으며, 시중은행의 오퍼로 에셋 스와프가 나왔을 가능성이 높은 것으로 판단됨.
IRS	전일 IRS는 소폭 하락 마감. 27일 미국 '메모리얼 데이'로 인한 휴장을 앞두고 한산한 분위기를 이어갔으며, 변동성을 줄만한 재료가 부진해 보임. 3년이 40.75/40.5로 대치되다 40.75에 거래가 이뤄졌으며, 장 막판에는 10년 오퍼가 37.75까지 내려와 거래됨. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.61이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.05.21(화)	195.1	208.0	3.52%	3.531%	3.60%	2년물	4.957%	0	
2024.05.22(수)	196.7	210.0	3.50%	3.531%	3.60%	5년물	4.534%	0	
2024.05.23(목)	189.4	207.0	3.53%	3.556%	3.60%	10년물	4.470%	0	
2024.05.24(금)	190.2	206.8	3.56%	3.565%	3.60%	30년물	4.575%	0	
2024.05.27(월)	190.7		3.55%	3.555%	3.61%	10Y-2Y	-48.7	0	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,722.99	35.39	54-03-10	국고 24-2	605	은행채 2,200	은행채 3,000	
KOSDAQ	847.99	8.58	25-12-10	국고 15-8	7	여전채 8,515	여전채 2,350	
달러-원	1,363.80원	-5.70원	40-09-10	국고 20-7	4	회사채 4,400	회사채 6,350	
국고3Y	3.413%	-1	51-03-10	국고 21-2	-200	통안채 6,200	통안채 3,400	
국고10Y	3.498%	-1.7	-	-	-	공사채 4,000		
국고10Y-3Y	8.5	-0.7	-	-	-			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.35	-0.02	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.38	5.33	5.36	-0.02
1W	5.50	5.40	5.46	0.01	1W	5.48	5.43	5.46	0.01
1S	5.53	5.43	5.48	0.00	1S	5.57	5.47	5.53	0.00
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	5.55	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
O/N	-	-	-	-	3.50	5.31000	1M MAR	-218	-215
TN	-8/-6	-7.0	5.35	-0.12	3.50	5.31059	1W*1S	-175	-170
1W	-54/-50	-52	5.46	0.01	3.50	5.31415	1*2	-225	-220
1S	-230/-210	-220	5.48	0.04	3.53	5.32778	1*3	-450	-440
3S	-700/-670	-685	5.58	0.01	3.59	5.34288	1*6	-1150	-1130
6S	-1420/-1380	-1400	5.70	0.03	3.63	5.31634	1*9	-1860	-1830
1YR	-2850/-2800	-2830	5.80	0.05	3.63	5.20029	1*12	-2520	-2480

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)

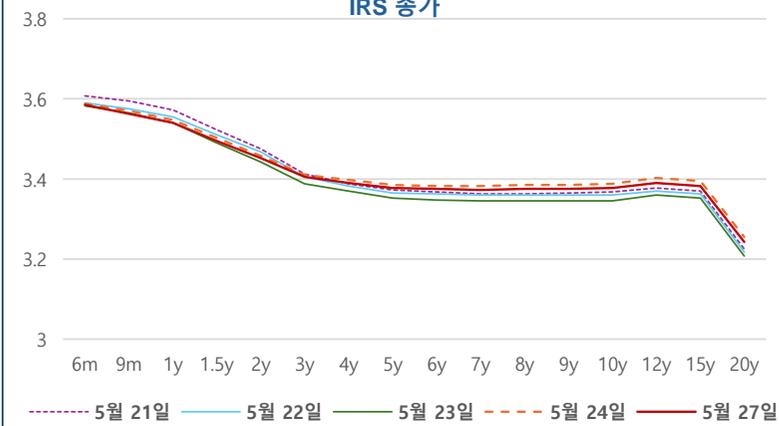
IRS 데일리 증가

5월 27일

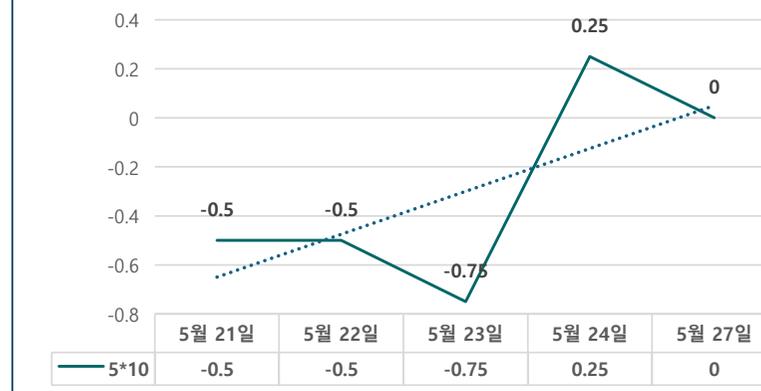
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5850	-0.25
9m	3.5625	-0.75
1y	3.5400	-0.75
1.5y	3.4950	-0.75
2y	3.4525	-0.50
3y	3.4050	-0.50
4y	3.3900	-0.75
5y	3.3775	-0.75
6y	3.3750	-0.75
7y	3.3725	-1.00
8y	3.3750	-1.00
9y	3.3750	-1.00
10y	3.3775	-1.00
12y	3.3900	-1.25
15y	3.3825	-1.25
20y	3.2425	-1.25

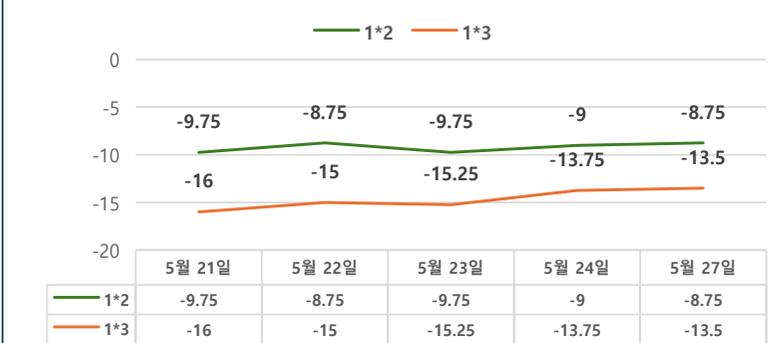
IRS 증가



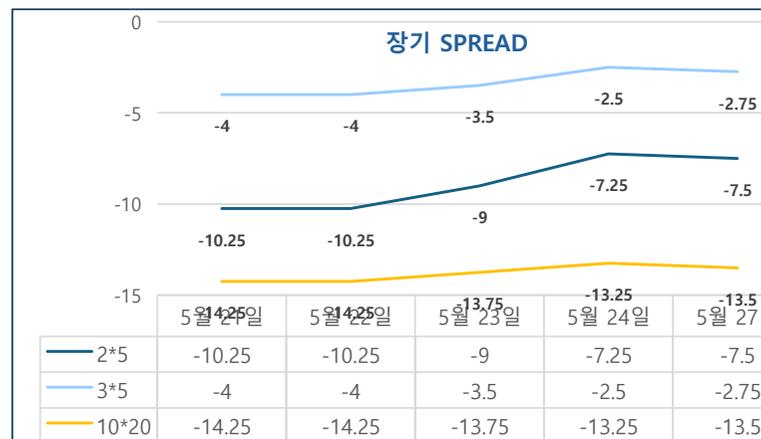
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

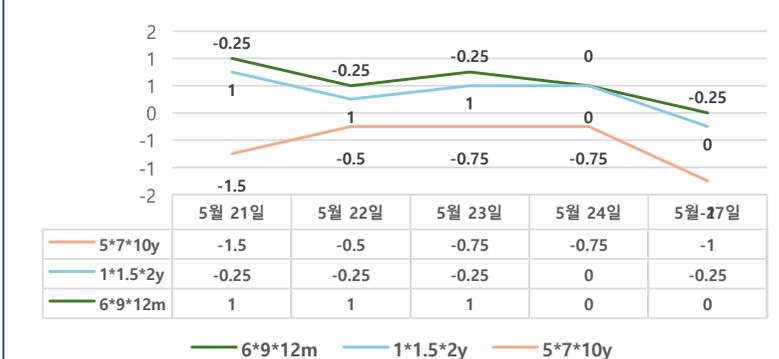


IRS 주요 커브

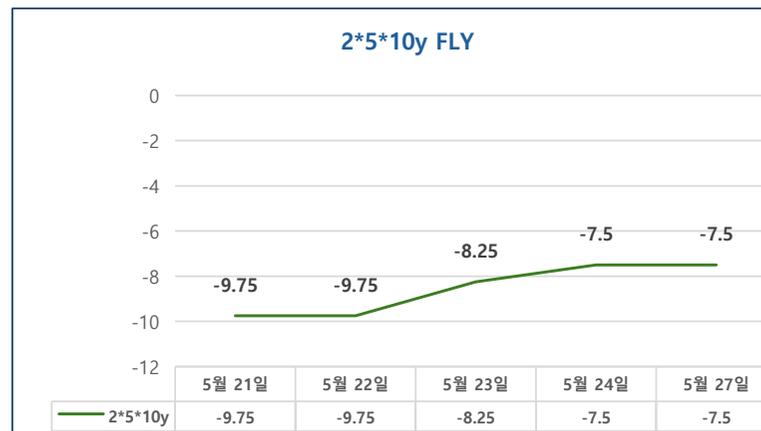
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-8.75	0.25
1*3y	-13.50	0.25
2*5y	-7.50	-0.25
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	0.00	-0.25
10*20y	-13.50	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	-0.50
1*1.5*2y	-0.25	-0.25
2*5*10y	-7.50	0.00
5*7*10y	-1.00	-0.25