

Market Daily Report



2024.05.29(수)

레포	은행신탁 및 운용사 유동성 호전되어 금리 하락했으며, 은행권 장 초반부터 조달에 적극적으로 나서 거래 활발하였음. 회사채 해소 원활했고, 추가 자금 콜금리 수준에서 매칭되는 등 전일대비 조달여건 한층 개선된 모습을 보임.
채권	한국 : 특별한 재료가 없는 가운데 아시아 장중 미 국채 금리 따라 등락함. 우호적 수급 여건에 강보합 분위기 지속됨. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 상승 마감. 이날 두 번의 국채 입찰에서 모두 응찰률이 평균을 하회하는 모습을 보이며 국채 수요 약화로 매도 심리 우위인 모습을. 더불어 카시카리 미니애폴리스 연은 총재의 금리동결 장기화 가능성 언급과 "금리인상을 배제하지 않겠다." 등의 발언으로 채권시장 투자심리는 더욱 위축된 모습을 보임.
MONEY	이번주 미국의 개인소비지출(PCE) 가격지수 발표를 앞두고 시장 참가자들의 포지션이 제한적인 가운데, 금일 기업체 관련 네고 물량 및 예금 인출 그리고 매입 외 환 결제 관련해서 시중은행 자금 수요가 컸으며 은행권 롤오버 물량 등장으로 FX 스왑 초단기물 O/N이 장중 -9전 (달러 환산 5.89 수준)까지 밀리는 등 월말 마감 을 앞두고 다소 긴장된 모습을 보였음. 그러나 달러 머니 시장에서는 시은 숏이 발생하지 않았고, 막판 오퍼가 5.38에 남고 마무리 된 것 보여 타이트하게 마감 되진 않았음. 역외에서도 월말 & 반기말 오퍼도 급등세 없이 1개월물 5.53-5.55 2개월 5.55-5.60 사이로 제시 되면서 레벨 변동성은 크지 않게 마무리.
FX SWAP	FX스왑포인트는 미국 메모리얼데이 휴장이 끝나고 장세가 회복될 것으로 기대되었으나 다소 한산한 장세를 유지하며 보합권에서 마감됨. 다만 스왑 이내 초단 기물이 오퍼리쉬한 동향을 보이며 장 시작했으며, 시중은행이 몇 일간 달러운용이 제한적일 것이라는 소식이 들리며 오버나잇 탐넥 둘다 하방압력을 보였고 오버 나잇 -8.5전, 탐넥 -8전 등 이윤가를 하회하며 거래되고 종료됨.
IRS	전일 IRS는 하락 마감 미국 금융시장이 휴장한 가운데 해외 금리가 하락세를 나타내는 점에 연동한 분위기를 보임. 미국 개인소비지출(PCE) 발표를 앞두고 마땅한 재료가 없는 상황이나, 11월 금융통화위원회와 픽성이 겹치면서, 6개월 9개월, 9*12개월 등 단기쪽으로 호가가 많 이 형성되는 모습을 보임.시장에 전체적으로 거래가 많은 모습을 보였으며, 장 막판에는 2년과 10년이 엮여 2*10년이 -7.5에 거래가 이뤄졌으며, 10년이 36에 여러 차례 거래가 이뤄짐.이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.62이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.05.22(수)	196.7	210.0	3.50%	3.531%	3.500%	3.60%	2년물	4.987%	3
2024.05.23(목)	189.4	207.0	3.53%	3.556%		3.60%	5년물	4.601%	6.7
2024.05.24(금)	190.2	206.8	3.56%	3.565%		3.60%	10년물	4.555%	8.5
2024.05.27(월)	190.7	206.1	3.55%	3.555%		3.61%	30년물	4.669%	9.4
2024.05.28(화)	197.9		3.50%	3.520%		3.62%	10Y-2Y	-43.2	5.5

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종요기수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,722.85	-0.14	26-03-10	국고 21-1	208	은행채 4,580	은행채 1,600	재정증권 63일 20,000
KOSDAQ	851.01	3.02	43-09-10	국고 23-9	202	여전채 5,050	여전채 1,450	
달러-원	1,358.50원	-5.30원	26-03-10	국고 24-3	200	회사채 3,593	회사채 2,400	
국고3Y	3.394%	-1.9	51-03-10	국고 21-2	-1	공사채 1,400	공사채 2,500	
국고10Y	3.481%	-1.7	25-06-10	국고 22-4	-500			
국고10Y-3Y	8.7	0.2	-	-	-			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간		증가	전일대비	기간		증가	전일대비	단위 : % , %p	
O/N	5.40	5.33	5.37	0.02	O/N	5.37	5.32	5.36	0.01
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.38	5.33	5.37	0.01
1W	5.50	5.40	5.46	0.00	1W	5.48	5.43	5.46	0.00
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	5.64	0.01
6S	5.68	5.53	5.62	0.02	6S	5.70	5.60	5.67	0.02
1YR	5.62	5.47	5.57	0.02	1YR	5.70	5.60	5.65	0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8.0	5.62	0.25	3.50	5.31000	1M MAR	-205	-200
TN	-8/-6	-7.0	5.35	0.00	3.50	5.31059	1W*1S	-155	-150
1W	-60/-58	-59	5.45	-0.01	3.50	5.31415	1*2	-240	-230
1S	-230/-210	-220	5.55	0.07	3.53	5.32778	1*3	-465	-455
3S	-700/-670	-685	5.59	0.01	3.59	5.34288	1*6	-1150	-1130
6S	-1400/-1360	-1380	5.69	-0.01	3.63	5.31634	1*9	-1885	-1860
1YR	-2850/-2800	-2820	5.80	0.00	3.63	5.20029	1*12	-2575	-2500

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 / 12.17~12.18D
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)

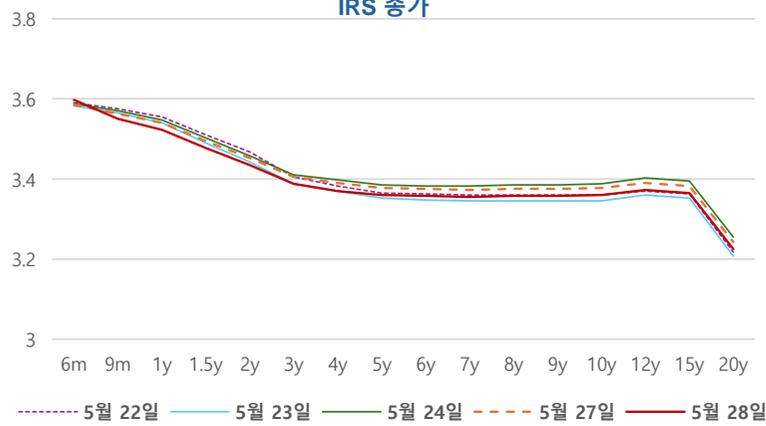
IRS 데일리 증가

5월 28일

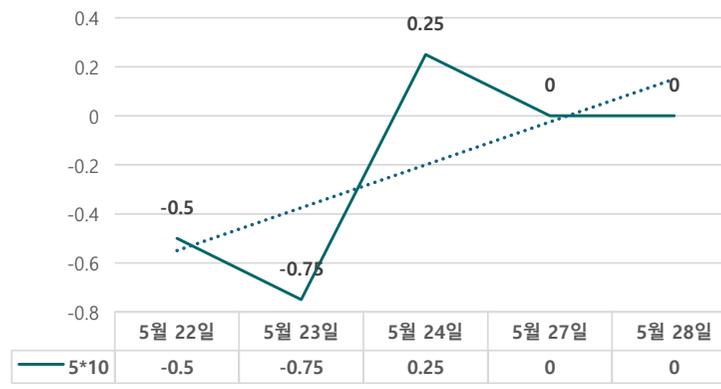
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5975	1.25
9m	3.5500	-1.25
1y	3.5225	-1.75
1.5y	3.4775	-1.75
2y	3.4350	-1.75
3y	3.3875	-1.75
4y	3.3700	-2.00
5y	3.3600	-1.75
6y	3.3575	-1.75
7y	3.3550	-1.75
8y	3.3575	-1.75
9y	3.3575	-1.75
10y	3.3600	-1.75
12y	3.3725	-1.75
15y	3.3650	-1.75
20y	3.2250	-1.75

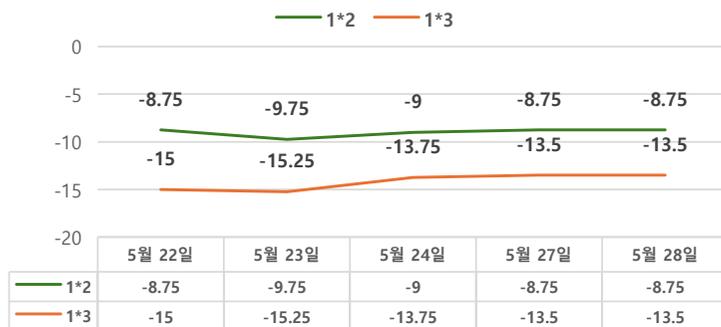
IRS 증가



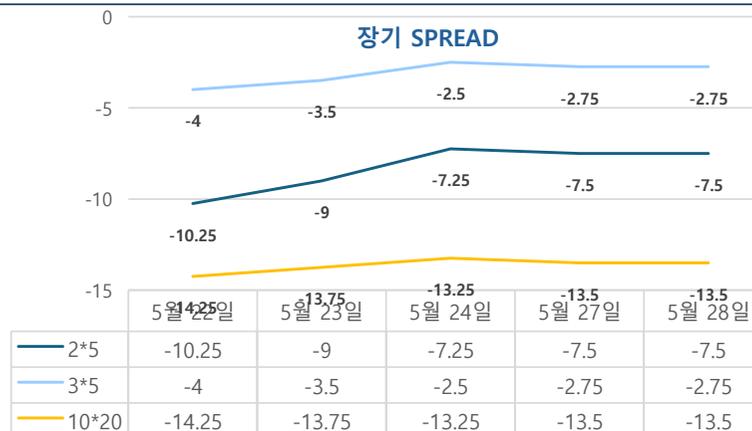
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

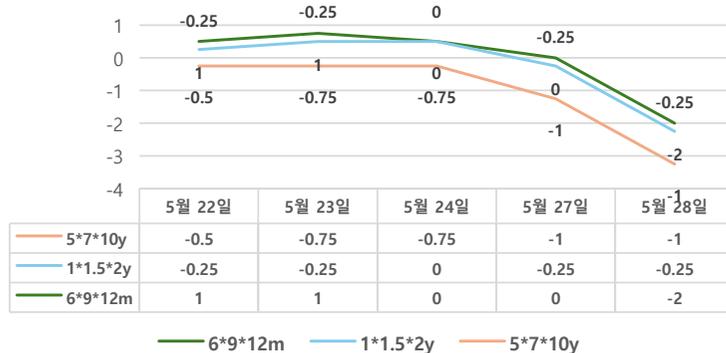


IRS 주요 커브

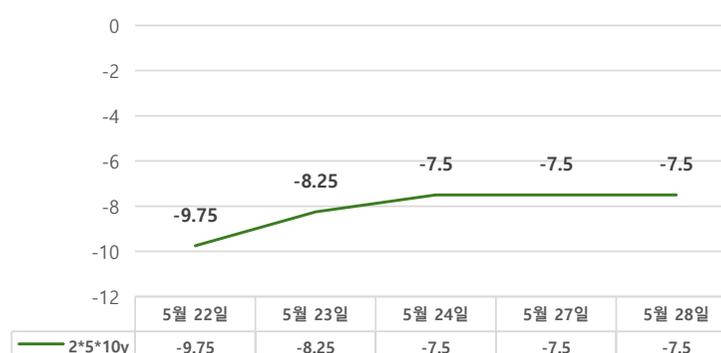
SPREAD

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

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.00	-2.00
1*1.5*2y	-0.25	0.00
2*5*10y	-7.50	0.00
5*7*10y	-1.00	0.00