

Market Daily Report



2024.05.30(목)

레포	별다른 자금 변동요인 없어 벤치마크 금리 포함 출발했고, 장 초반부터 은행권 조달에 적극적으로 나서 매수 자금 급속도로 소진되었음. 월말 직전임에도 조달여건 양호하여 기일을 금리 소폭 하락했으며, 장 중 추가 자금 일부 저금리 매칭됐으나 그 규모는 크지 않았음.
채권	한국 : 미 장중 국채 금리 상승한데다 오전 호주 CPI가 예상치 상회하며 금리 상승세 지속되었음. 외인, 3년 및 10년 국채선물 동시매도함. 미국 : 미 국채 금리는 2년물 제외하고 상승 마감함. 이날 7년물 국채 입찰에서도 냉랭한 수요가 보이자 증장기를 위주로 가격이 급락하였음. 또한 연준의 경기평가 보고서 5월 페이지북에서 미국 경제가 확장세를 유지하고 있다고 평가한 점도 채권 투자심리에 부정적 영향을 끼침.
MONEY	미국의 PCE 지표 발표 대기속. 호주 소비자물가지수 CPI의 예상치 상회로 달러 강세 재시현. 월말 마감을 앞두고 역의 중국계 유럽 센터들의 S/N (5/31-6/3) 구간의 차입 레벨이 5.60까지 호가를 냈고, 1개월물 6/3 시작 반기말 커브 구간의 비드가 5.55-5.60 사이로 제시되면서 중국계 네임 우선으로 레벨 상승세 가시화. 전주 대비 1년물 SOFR 금리도 6bp 상승 반영되면서 런던 & 유럽 네임들 (1년물 5.60 터치)과 중국계 유럽 센터들의 기간별 스프레드 감안 장기 구간 ALL IN PRICE도 상승 반영되는 중.
FX SWAP	외환스와프포인트는 간밤 미 국채금리 상승과 네고물량 유입에 따라 일제히 하락함. 1년 만기 FX 스와프포인트는 전장보다 30전 내린 -2850전에서 증가 거래됨. 3달 이내 월말 네고물량이 시장에 많이 출현했으며, 이 때문에 오퍼가 무거웠던 것으로 파악됨. 초단기도-8전에서 -9전까지 거래되는 등 현물환 수급에 의한 하방 압력이 지속되며 장 종료됨.
IRS	전일 IRS는 연방준비제도(Fed.연준)의 금리 인하에 대한 기대가 또다시 후퇴하면서 큰 폭으로 상승 마감. 닐 카시카리 미니애폴리스 연방준비은행 총재의 매파적인 발언과 높은 주택가격 등 강한 미국 경제지표가 어우러지면서 연준의 금리 인하에 대한 기대가 다시 후퇴되는 분위기를 보임. 연준이 올해 금리 인하를 하지 않을 것이라는 전망도 함께 나오는 모습. 시장에 전체적으로 거래가 많은 모습을 보였으며, 3*5년이 -1.5, 10년이 42에 몇차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 9개월 오퍼가 55.75까지 내려왔으며, 2년이 47까지 거래가 이뤄짐. 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.61에 고시됨.

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			
2024.05.23(목)	189.4	207.0	3.53%	3.556%	3.500%	3.60%	2년물	4.983%	-0.4
2024.05.24(금)	190.2	206.8	3.56%	3.565%		3.60%	5년물	4.639%	3.8
2024.05.27(월)	190.7	206.1	3.55%	3.555%		3.61%	10년물	4.618%	6.3
2024.05.28(화)	197.9	209.4	3.50%	3.520%		3.62%	30년물	4.736%	6.7
2024.05.29(수)	201.9		3.50%	3.523%		3.61%	10Y-2Y	-36.5	6.7

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	2,677.30	-45.55	54-03-10	국고 24-2	996	은행채 3,600	은행채 9,000	
KOSDAQ	838.45	-12.56	24-08-01	재정채	850	여전채 3,570	여전채 6,450	
달러-원	1,365.00원	6.50원	33-12-10	국고 23-11	750	회사채 11,341	회사채 1,995	
국고3Y	3.425%	3.1	52-03-10	국고 22-2	-511	공사채 2,000	공사채 3,700	
국고10Y	3.536%	5.5	24-09-10	국고 14-5	-550			
국고10Y-3Y	11.1	2.4	31-12-10	국고 21-11	-3,091			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
O/N	5.40	5.33	5.36	-0.01	O/N	5.40	5.35	5.37	0.01
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.40	5.35	5.37	0.00
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	5.58	5.48	5.55	0.02
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.72	5.62	5.66	0.02
6S	5.68	5.53	5.63	0.01	6S	5.70	5.60	5.67	0.00
1YR	5.63	5.48	5.58	0.01	1YR	5.70	5.60	5.67	0.02

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
O/N	-9/-7	-8.0	5.62	0.00	3.50	5.31000	1M MAR	-227	-215
TN	-9/-7	-8.0	5.62	0.27	3.50	5.31066	1W*1S	-163	-157
1W	-60/-50	-55	5.58	0.13	3.50	5.31460	1*2	-245	-240
1S	-220/-210	-215	5.58	0.03	3.53	5.32838	1*3	-475	-465
3S	-710/-680	-695	5.65	0.05	3.59	5.34625	1*6	-1165	-1140
6S	-1410/-1370	-1390	5.69	0.01	3.61	5.32377	1*9	-1910	-1860
1YR	-2900/-2800	-2850	5.81	0.01	3.62	5.21487	1*12	-2600	-2580

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)

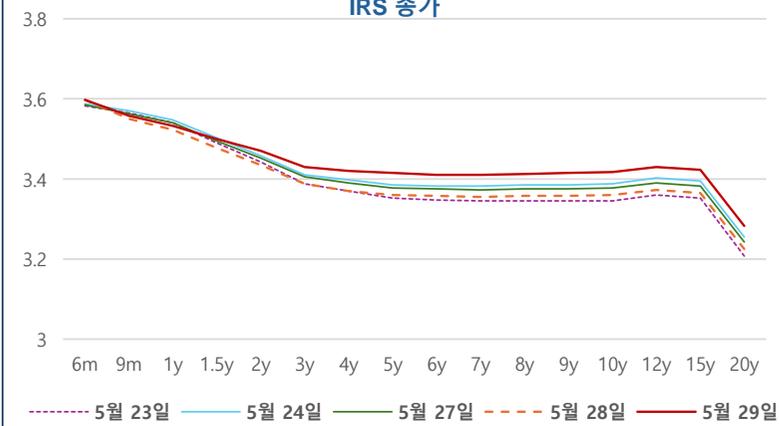
IRS 데일리 증가

5월 29일

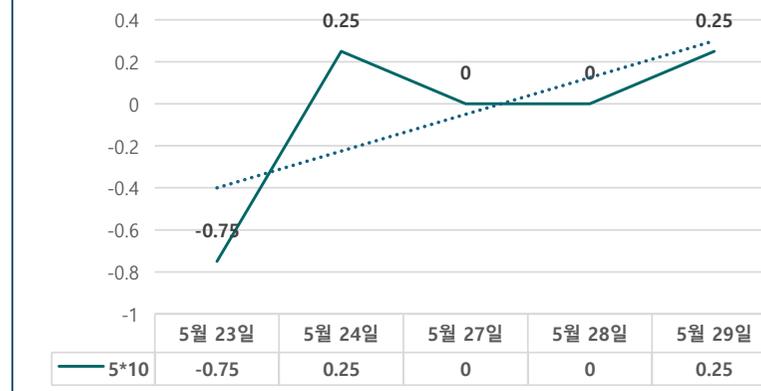
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5975	0.00
9m	3.5575	0.75
1y	3.5325	1.00
1.5y	3.5000	2.25
2y	3.4700	3.50
3y	3.4300	4.25
4y	3.4200	5.00
5y	3.4150	5.50
6y	3.4100	5.25
7y	3.4100	5.50
8y	3.4125	5.50
9y	3.4150	5.75
10y	3.4175	5.75
12y	3.4300	5.75
15y	3.4225	5.75
20y	3.2825	5.75

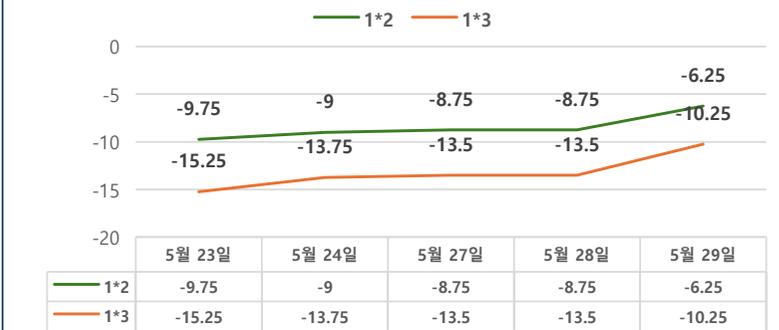
IRS 증가



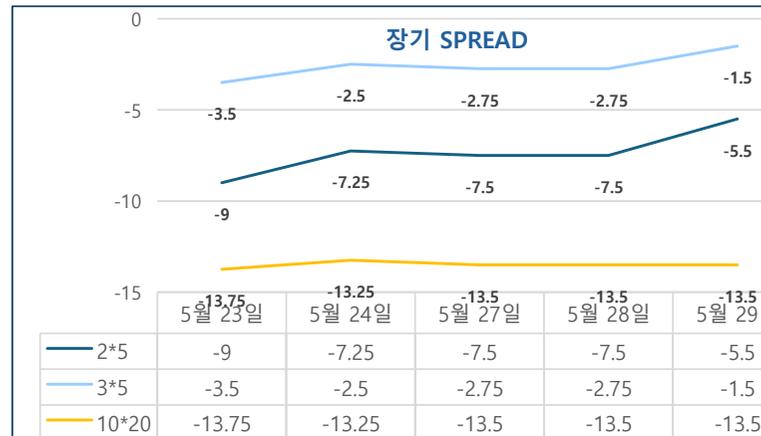
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

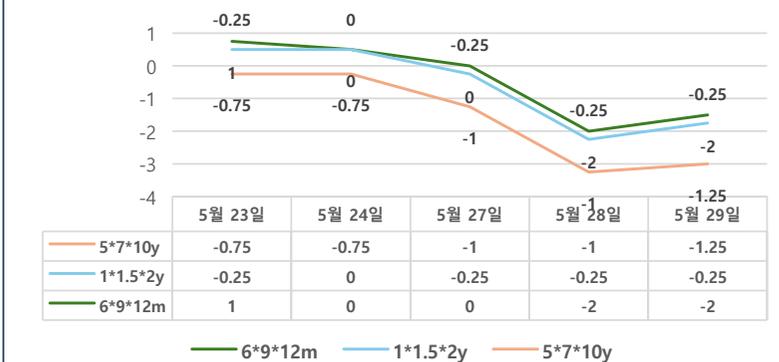


IRS 주요 커브

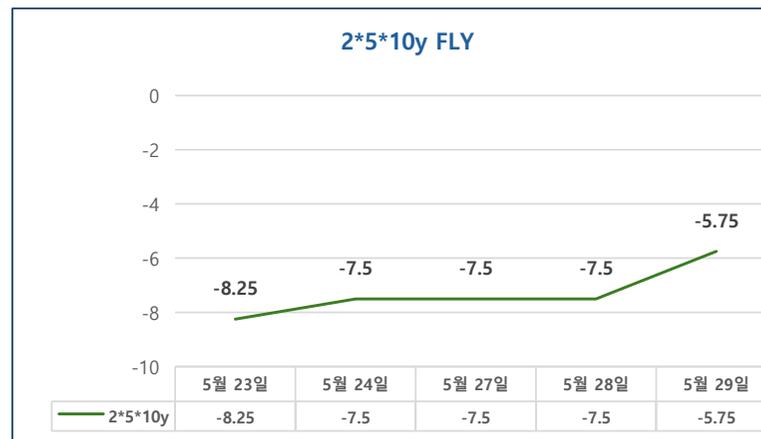
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-6.25	2.50
1*3y	-10.25	3.25
2*5y	-5.50	2.00
3*5y	-4.00	1.25
5*10y	0.25	0.25
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.50	0.50
1*1.5*2y	-0.25	0.00
2*5*10y	-5.75	1.75
5*7*10y	-1.25	-0.25