

Market Daily Report



2024.05.31(금)

레포	MMF 환매대기자금 유효하여 금리 보합 출발했으나 매수 이른 시간에 소진되어 장 중 조달여건 악화되었음. 월말일 운용금리 상승할 것으로 예상되어 매수처 추가 운용 제한적이었으며, 기일물 조달금리 소폭 상승하였음.
채권	한국 : 외인 3년 및 10년 선물매도 강했지만 장중 대외금리 반락하며 약세 일부 제한됨. 미 PCE 대기 심리도 감지되었음. 미국 :미 국채금리는 전 구간 하락 마감함. 미국 1분기 GDP 성장을 잠재치가 지난 달 속보치 보다 둔화된 결과를 보이며 매수 심리 강화되었음. 이날 연준 인사들의 공개 발언에서는 "미국 경제가 균형점으로 가고있고 올 하반기에 인플레이션 완화 흐름이 나타날 것으로 본다" 며 물가상승률 둔화에 대해 낙관적인 전망을 내놓음.
MONEY	미국 채권 시장의 약세 분위기 속에 장기 채권 금리는 상승세를 보였고, 아시아 장에서도 미국의 국채 금리가 소폭 상승세를 이어가며 위험 회피 장세로 외국인 국 내주식 매도세로 이어지며 달러/원 환율은 장중 1380원을 터치했음. 다소 위축된 아시아장 분위기에 달러 머니 시장에서는 중국계 본점들의 월말 자금 커버 물량까지 등장하면서 월말 커버 1주물과 반기말 커버 스팟-1개월 레벨이 동반 상승하며, 1주물 5.45-5.55 1개월물 5.57-5.65 까지 Pay 하면서 레벨 상승세 주도.
FX SWAP	외환스와프포인트는 초단기물이 강세를 보임에 따라 오전중 밀렸던 레벨을 말아올리며 보험권에서 마감됨. 오전까지는 전일부터 달러 운용이슈로 무거웠던 흐름이 이어졌지만 오후 들어 강세로 분위기가 바뀌면서 기간물도 이에 영향을 받아 낙폭을 회복함. 초단기가 강세로 돌아선 것은 원화 유동성 이슈는 아닌 것으로 보이며, 손절성 매도가 끝나고 회복한 것으로 보는 시각도 있음.
IRS	전일 IRS는 미국 베이지북 발표로 투자 심리가 위축되자 미국채가 상승하였고, 이에 영향을 받아 소폭 상승 마감. 양도성예금증서(CD)의 하락 영향으로 단기쪽 호가가 많이 보였으며, 장 막판에는 6*12개월 오퍼가 -5.5까지 내려와 거래되었으며, 3년 비드가 올라와 45.25에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 2*5년 ND로 -4.25에 거래되었으며, 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.60이 고시됨.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.05.24(금)	190.2	206.8	3.56%	3.565%	3.500%	3.60%	2년물	4.935%	-4.8
2024.05.27(월)	190.7	206.1	3.55%	3.555%		3.61%	5년물	4.574%	-6.5
2024.05.28(화)	197.9	209.4	3.50%	3.520%		3.62%	10년물	4.551%	-6.7
2024.05.29(수)	201.9	210.1	3.50%	3.523%		3.61%	30년물	4.684%	-5.2
2024.05.30(목)	198.2		3.50%	3.528%		3.60%	10Y-2Y	-38.4	-1.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,635.44	-41.86	54-03-10	국고 24-2	900	지방채 3,143	지방채 2,576	
KOSDAQ	831.99	-6.46	43-09-10	국고 23-9	810	은행채 2,500	은행채 4,015	
달러-원	1,379.40원	14.40원	33-12-10	국고 23-11	520	여전채 2,100	여전채 3,550	
국고3Y	3.440%	1.5	40-09-10	국고 20-7	-140	회사채 300	회사채 640	
국고10Y	3.564%	2.8	25-09-10	국고 20-6	-300	공사채 386	공사채 235	
국고10Y-3Y	12.4	1.3	30-12-10	국고 20-9	-500			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	0.01	O/N	5.40	5.35	5.37	0.00
TN	5.46	5.39	5.42	0.04	TN	5.47	5.37	5.43	0.06
1W	5.45	5.35	5.41	-0.05	1W	5.45	5.35	5.42	-0.04
1S	5.57	5.47	5.52	0.04	1S	5.65	5.55	5.60	0.05
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.73	5.63	5.67	0.01
6S	5.68	5.53	5.63	0.00	6S	5.75	5.65	5.70	0.03
1YR	5.63	5.48	5.58	0.00	1YR	5.75	5.60	5.68	0.01

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-5	-6.0	5.07	-0.55	3.50	5.31000	1M MAR	-229	-224
TN	-24/-20	-22.0	5.41	-0.21	3.50	5.31064	1W*1S	-170	-160
1W	-58/-48	-52	5.44	-0.14	3.50	5.31448	1*2	-250	-240
1S	-240/-220	-230	5.54	-0.04	3.53	5.32920	1*3	-470	-455
3S	-720/-685	-705	5.62	-0.03	3.59	5.34734	1*6	-1170	-1150
6S	-1420/-1380	-1400	5.67	-0.03	3.61	5.32594	1*9	-1900	-1870
1YR	-2900/-2800	-2850	5.78	-0.03	3.63	5.21326	1*12	-2570	-2510

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)

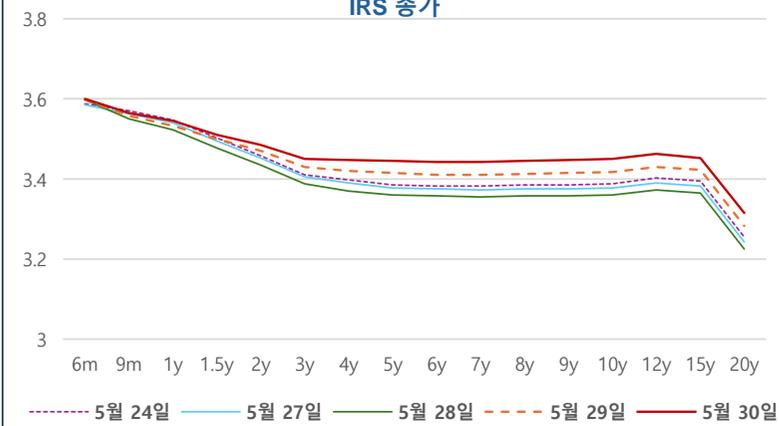
IRS 데일리 증가

5월 30일

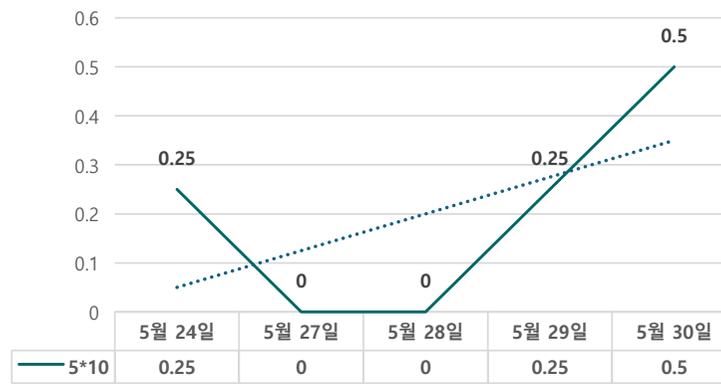
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.6000	0.25
9m	3.5650	0.75
1y	3.5450	1.25
1.5y	3.5100	1.00
2y	3.4850	1.50
3y	3.4500	2.00
4y	3.4475	2.75
5y	3.4450	3.00
6y	3.4425	3.25
7y	3.4425	3.25
8y	3.4450	3.25
9y	3.4475	3.25
10y	3.4500	3.25
12y	3.4625	3.25
15y	3.4525	3.00
20y	3.3150	3.25

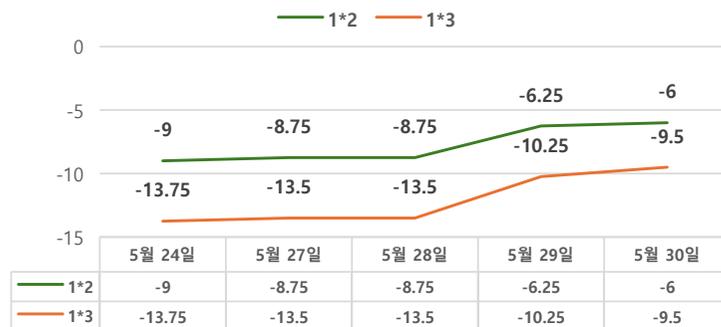
IRS 증가



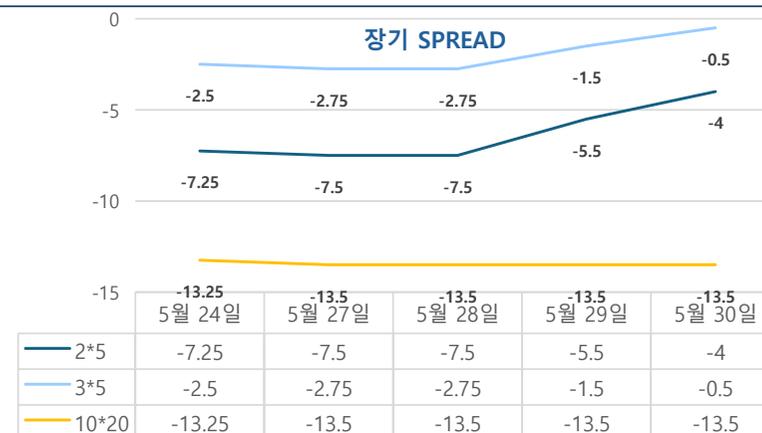
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD



IRS 주요 커브

SPREAD

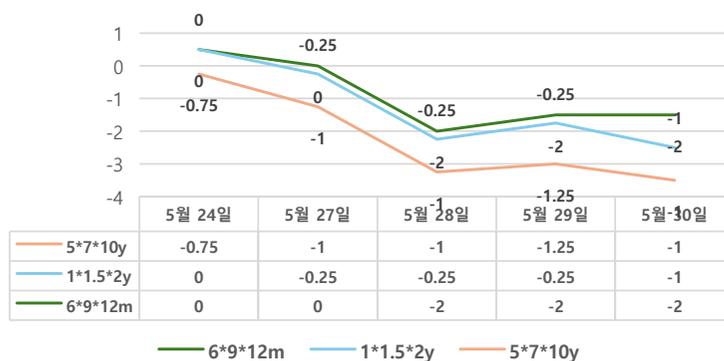
구분	증가	전일대비
1*2y	-6.00	0.25
1*3y	-9.50	0.75
2*5y	-4.00	1.50
3*5y	-4.00	1.00
5*10y	0.50	0.25
10*20y	-13.50	0.00

IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.50	0.00
1*1.5*2y	-1.00	-0.75
2*5*10y	-4.50	1.25
5*7*10y	-1.00	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY

