

Market Daily Report

2024.06.05(수)



레포	빠듯한 마감 예상됨에 따라 은행권 조달에 적극적이었고, 매수자금 이른 시간에 소진되어 부족 분위기 형성되었음. 장 중 익일물 및 기일물 조달금리 동반 상승했으며, 3일물 자금 많지 않아 1일물 거래 활발하였음.
채권	한국 : 예상을 밑돈 미 ISM 제조업 PMI 지표 소화하며 강세 분위기 지속되었음. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 하락 마감. 미국 구인 건수가 예상치 보다 크게 줄면서 이에 따라 비농업 고용지표도 둔화 신호를 보낼 것이라 기대감 확산되었음. 시장은 경기 호조 속에 인플레이션 완화로 금리가 내려가길 바라는 최근 경기 지표 결과로 보아 미국 경기 둔화에 의한 기준 금리 하락 가능성이 주목 받음.
MONEY	이번주 ECB의 금리 인하와 미국의 경제지표에 주목하면서 시장 참가자들의 관망세가 짙은 모습. 머니 시장에서는 이번달 중국 해외 상장 국가들의 배당금 지급과 계절적 수요 (6월 반기마감)에 따른 달러 수요가 급증하면서 아시아장 레벨 상승세 견인. 위안화 약세와 더불어 역외 자금이 본토로 유입되고 있다는 보도와 함께 반기마감을 위한 편딩에 집중하며 중국계 유입 및 중동 센터들의 호가 상승으로 1개월물 5.58-5.60 3개월물-1년물 5.70-5.72 수준을 터치하면서 수급에 의한 레벨 상승세 반영 중. 온쇼 시중은행들의 비율 및 반기말 자금 관리로 운용은 보수적으로 접근, 6월 넘기는 자금 편딩이 월초부터 쉽지 않은 모습.
FX SWAP	외환스와프포인트는 국고채 금리가 다소 큰 폭으로 내리고 장기를 위주로 예셋스와프가 유입됨에 따라 1년물 중심으로 하락함. 간밤 미국 제조업 지표 부진에 미국채 금리가 하락했음에도 대부분 약세를 나타냈으며, 뉴욕 채권시장이 강세를 보인 것에 연동해 우리나라 국고채 금리가 더 떨어지는데 스와프 포인트가 동조한 것으로 파악됨.
IRS	전일 IRS는 국내 소비자물가지수(CPI) 둔화와 미국 제조업 지표 부진의 영향을 받아 하락 마감.우리나라의 5월 소비자물가지수(CPI)는 전년동월대비 2.7% 올라 둔화 흐름을 유지했으며, 간밤 발표된 미국의 5월 공급관리협회(ISM) 제조업 구매관리자지수(PMI)도 48.7로 시장의 예상을 하회하면서 연방준비제도(Fed-연준)의 9월 금리 인하 전망에 힘을 보태면서 이에 연동되어 움직이는 모습을 보임. 초단기쪽 6*12개월, 6*9개월쪽이 호가가 형성되면서 거래가 이뤄졌으며, 장 막판에 4년이 37.25, 10년이 36.75까지 레벨이 올라오면서 거래가 이뤄짐. 장 마감 후 미국채에 연동되면서 단기쪽 9개월 아우라와 9개월*2년쪽으로 호가가 나오는 모습을 보였으며, 이날 양도성예금증서(CD)는 하락하여 3.60이 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준			
						금리	전일대비		
2024.05.29(수)	201.9	210.1	3.50%	3.523%	3.500%	2년물	4.781%	-3.7	
2024.05.30(목)	198.2	208.9	3.50%	3.528%		5년물	4.352%	-6.1	
2024.05.31(금)	193.2	203.5	3.57%	3.580%		10년물	4.333%	-6	
2024.06.03(월)	195.5	205.0	3.55%	3.539%		30년물	4.476%	-6.5	
2024.06.04(화)	197.6		3.50%	3.483%		10Y-2Y	-44.8	-2.3	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,662.10	-20.42	25-06-04	주금공MBS	1,000	여전채 4,700	은행채 3,000	통안채 2년 22,000
KOSDAQ	845.84	1.12	26-06-04	주금공MBS	800	회사채 303	여전채 1,900	
달러-원	1,376.00원	-0.10원	34-06-10	국고 24-5	675	공사채 2,100	회사채 450	
국고3Y	3.390%	-4.4	53-09-10	국고 23-7	-204		공사채 3,200	
국고10Y	3.470%	-6.2	26-06-10	국고 16-3	-300			
국고10Y-3Y	8	-1.8	28-03-10	국고 23-1	-304			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	-0.01	O/N	5.40	5.30	5.36	-0.02
TN	5.41	5.34	5.38	0.00	TN	5.40	5.30	5.37	-0.01
1W	5.45	5.35	5.40	0.00	1W	5.45	5.35	5.40	0.00
1S	5.58	5.48	5.54	0.00	1S	5.63	5.53	5.58	0.01
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.72	5.62	5.68	0.01
6S	5.68	5.53	5.62	0.00	6S	5.75	5.60	5.70	0.02
1YR	5.65	5.50	5.58	0.00	1YR	5.75	5.60	5.70	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.33	-0.26	3.50	5.31000	1M MAR	-214	-211
TN	-17/-13	-15	5.46	0.26	3.50	5.31058	1W*1S	-175	-170
1W	-51/-47	-49	5.33	0.00	3.50	5.31405	1*2	-222	-218
1S	-240/-220	-230	5.49	0.02	3.54	5.32794	1*3	-465	-460
3S	-720/-680	-700	5.58	0.01	3.60	5.33995	1*6	-1160	-1130
6S	-1430/-1390	-1410	5.66	0.00	3.61	5.30726	1*9	-1860	-1830
1YR	-2900/2800	-2850	5.77	0.01	3.62	5.18353	1*12	-2550	-2520

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 / 12.17~12.18D
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)

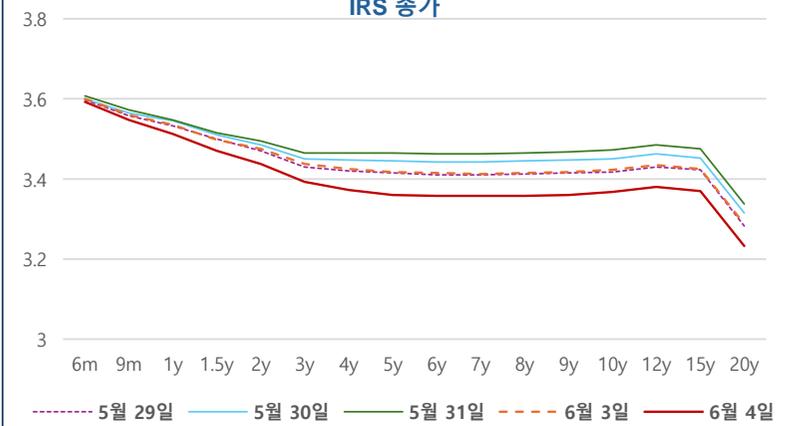
IRS 데일리 증가

6월 4일

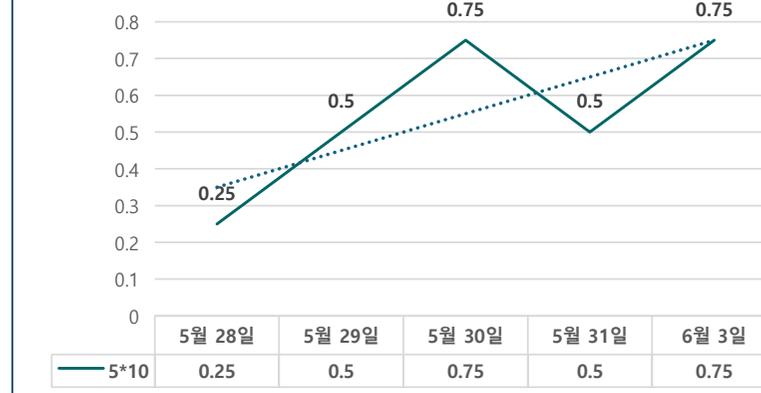
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5925	-0.75
9m	3.5475	-1.25
1y	3.5125	-2.25
1.5y	3.4700	-2.75
2y	3.4375	-3.75
3y	3.3925	-4.50
4y	3.3725	-5.25
5y	3.3600	-5.75
6y	3.3575	-5.75
7y	3.3575	-5.50
8y	3.3575	-5.75
9y	3.3600	-5.75
10y	3.3675	-5.50
15y	3.3700	-5.50
20y	3.2325	-5.50

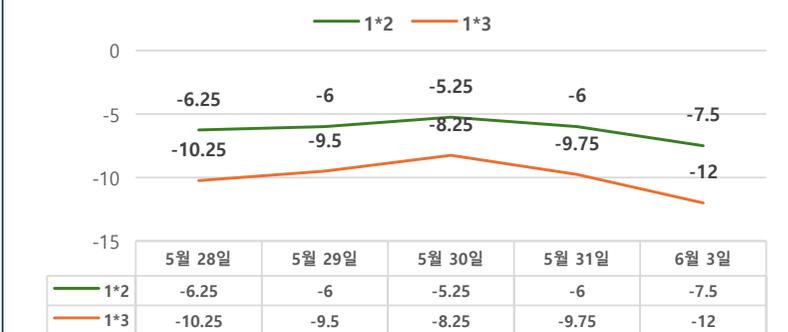
IRS 증가



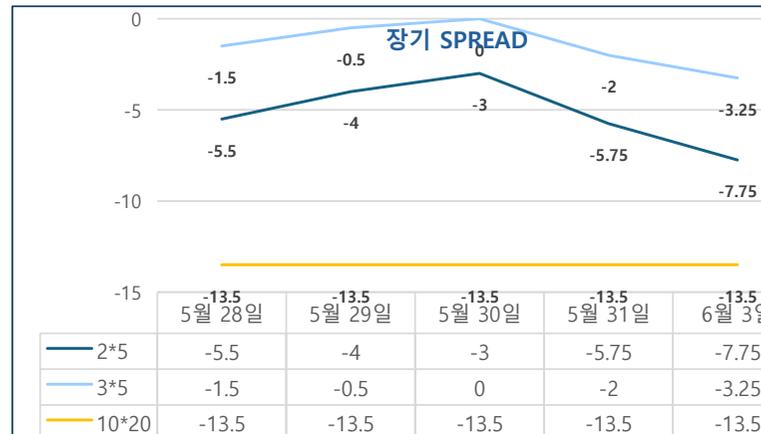
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

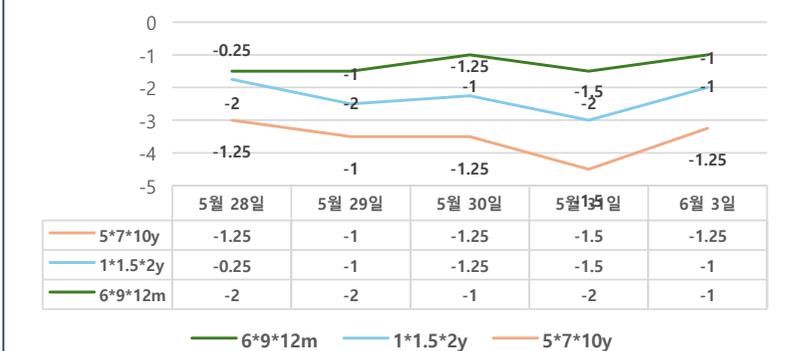


IRS 주요 커브

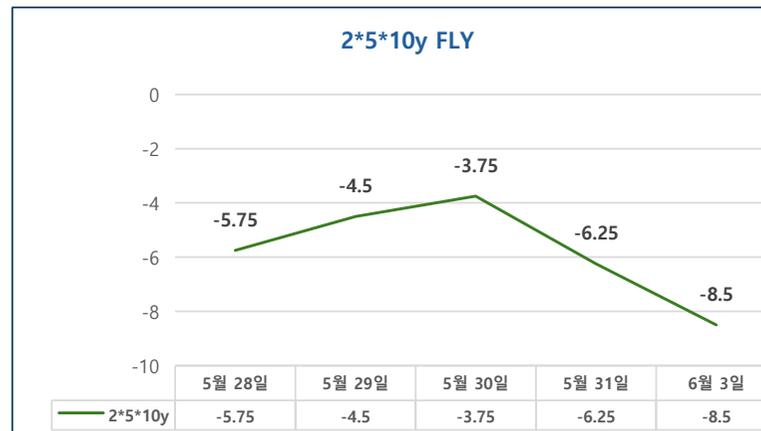
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-7.50	-1.50
1*3y	-12.00	-2.25
2*5y	-7.75	-2.00
3*5y	-4.00	-1.25
5*10y	0.75	0.25
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-1.00	0.50
1*1.5*2y	-1.00	0.50
2*5*10y	-8.50	-2.25
5*7*10y	-1.25	0.25