

Market Daily Report



2024.06.07(금)

| | |
|----------------|--|
| 레포 | 마감 불확실성 증대되어 시은 장 초반부터 조달에 적극적이었으며, 콜거래 주를 이룬 가운데 일부 은행 간 레포 거래도 성사되었음. 운용사 및 신탁 자금 추가되어 전일자 1일물 거래 홀오버 무난했고, 오후 실시간 재정 유입과 함께 지준 소폭 잉여 마감하였음. |
| 채권 | 한국 : 미 고용지표 둔화 조짐 영향에 이를 추중해 국고채 금리 강세를 보임. 외인 국채선물 순매수에 강세 폭 확대한 모습. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승 마감. 이날 ECB가 5년 만에 처음으로 기준금리를 인하했지만 미 채권시장은 크게 영향 받지 않는 모습임. 한편 미국 주간 신규 실업보험 청구자 수는 4주 만에 가장 많은 수치로 발표되었음. 시장은 하루 앞둔 5월 고용보고서를 기다리며 신중한 양상을 보임. |
| MONEY | 캐나다 중앙은행과 ECB가 기준금리를 예상과 같이 25bp 인하 단행했으나 ECB 금리인하에 대해선 매파적 인하라고 시장은 평가했음. 5일 달러 머니 시장에서는 6/6 휴일을 앞두고, 2일물 오버나잇은 5.35-5.38 수준으로 운용쇼 체결 되었고, FX 스왑 초단기물 (2일물)이 -13전에 거래 및 마감되면서 달러 환산 금리는 5.20까지 내려오자 온쇼 초단기 달러 차입 수요도 감소. 역외에서는 중국계 네임 거점 점포들의 6월 넘기는 1개월물 차입 금리를 5.60-5.62 사이로 거래 된 반면 한국계 및 대만계 네임간 1개월물은 5.55 언더로 체결 되면서 거래 규모와 네임에 따라 레벨 차등이 발생함. |
| FX SWAP | 외환스와프포인트는 에셋스와프 유입에 따라 장기물이 소폭 하락했으며, 1년과 6개월물이 거래일수 보정에 따른 시초가 대비 10전씩 하락한 것으로 파악됨. 최근 며칠 미국 채권 금리가 급하게 빠져서, 스와프시장에 우호적인 분위기가 조성되었는데도 에셋 물량이 우위를 보이면서 오퍼리쉬한 장세를 보였음. 초단기는 장 초반 현물환 수급에 의해 무거운 출발을 보였지만 오후들어서는 회복하며 마무리됨. |
| IRS | 전일 IRS는 6일 현충일 휴장을 앞두고 하락 마감. 대체로 국고채 금리와 연동되면서 움직이는 모습이었으며, 전체적으로 거래가 활발했으며 시장에서 1년 안쪽으로 포린 비드가 많이 나오는 모습을 보임. 장중 2*5년 스프레드가 -8.75,-9에 몇차례 거래가 이뤄졌으며, 장 막판에 7*10년 비드가 1.25까지 다소 강하게 올라오면서 5*7과 5*10이 버티플라이로 엮여 -1.25에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 1년 오퍼가 나오면서 50에 거래되었음, 마감 이후에 미국채 움직임에 연동되면서 3년 34.75 비드까지 올라오는 모습을 보임 |

| 단기자금시장 | | | | | | 전일 미국 국채 금리 | | | |
|---------------|--------|-------|---------|--------|---------|-------------|--------|--------|-----|
| 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | 기준금리 | CD(91일) | 금리 | | 전일대비 | |
| 2024.05.30(목) | 198.2 | 208.9 | 3.50% | 3.528% | 3.500% | 3.60% | 2년물 | 4.734% | 0.3 |
| 2024.05.31(금) | 193.2 | 203.5 | 3.57% | 3.580% | | 3.61% | 5년물 | 4.305% | 0.4 |
| 2024.06.03(월) | 195.5 | 205.0 | 3.55% | 3.539% | | 3.61% | 10년물 | 4.292% | 1.1 |
| 2024.06.04(화) | 197.6 | 206.0 | 3.50% | 3.483% | | 3.60% | 30년물 | 4.439% | 0.7 |
| 2024.06.05(수) | 199.1 | | 3.50% | 3.502% | | 3.60% | 10Y-2Y | -44.2 | 0.8 |

| 국내 금융시장 동향 | | | 전일 외국인 순매수 순매도 | | | 오늘의 채권 | | |
|------------|-----------|--------|----------------|---------|--------|------------|------------|---------------|
| 항목 | 지표 | 전일대비 | 만기 | 종목 | 금액 | 채권 발행 | 채권 만기 | 채권 입찰 |
| KOSPI | 2,689.50 | 27.40 | 24-08-09 | 재정채 | 510 | 은행채 12,000 | 은행채 6,700 | 물가채 10년 1,000 |
| KOSDAQ | 850.75 | 4.91 | 26-03-10 | 국고 24-3 | 1,045 | 여전채 6,230 | 여전채 10,100 | |
| 달러-원 | 1,373.00원 | -3.00원 | 31-06-10 | 국고 21-5 | 900 | 회사채 4,640 | 회사채 9,580 | |
| 국고3Y | 3.345% | -4.5 | 25-03-10 | 국고 23-3 | -200 | 공사채 3,000 | 공사채 1,900 | |
| 국고10Y | 3.430% | -4 | 27-09-10 | 국고 22-8 | -250 | | | |
| 국고10Y-3Y | 8.5 | 0.5 | 24-09-10 | 국고 14-5 | -1,700 | | | |

| Money Market Closing | | | | | | | | | |
|----------------------|----------------|------|------|-------|-----|---------|------|------|-------|
| 기간 | KOREAN/FOREIGN | | 증가 | 전일대비 | 기간 | CHINESE | | 증가 | 전일대비 |
| O/N | 5.39 | 5.32 | 5.36 | 0.00 | O/N | 5.40 | 5.30 | 5.37 | 0.01 |
| TN | 5.41 | 5.34 | 5.38 | 0.00 | TN | 5.40 | 5.30 | 5.38 | 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 | 5.60 | 0.02 |
| 3S | 5.63 | 5.53 | 5.58 | 0.00 | 3S | 5.72 | 5.62 | 5.65 | -0.03 |
| 6S | 5.68 | 5.53 | 5.61 | -0.01 | 6S | 5.75 | 5.60 | 5.68 | -0.02 |
| 1YR | 5.65 | 5.50 | 5.57 | -0.01 | 1YR | 5.75 | 5.60 | 5.68 | -0.02 |

| FX SWAP CLOSING | | | | | | | ND SPREAD | | |
|-----------------|-------------|---------|---------|-------|---------|---------|-----------|-------|-------|
| 기간 | BID/OFFER | CLOSING | USD환산금리 | 전일대비 | KORIBOR | SOFR | TENOR | BID | OFFER |
| O/N | -15/-11 | -13 | 5.20 | -0.13 | 3.50 | 5.31000 | 1M MAR | -215 | -211 |
| TN | -23/-19 | -21 | 5.34 | -0.12 | 3.50 | 5.31058 | 1W*1S | -172 | -167 |
| 1W | -52/-48 | -50 | 5.37 | 0.04 | 3.50 | 5.31409 | 1*2 | -240 | -230 |
| 1S | -235/-215 | -225 | 5.51 | 0.02 | 3.53 | 5.32752 | 1*3 | -455 | -450 |
| 3S | -700/-670 | -685 | 5.58 | 0.00 | 3.60 | 5.33849 | 1*6 | -1160 | -1120 |
| 6S | -1430/-1370 | -1400 | 5.68 | 0.02 | 3.61 | 5.29862 | 1*9 | -1870 | -1830 |
| 1YR | -2900/-2780 | -2840 | 5.77 | 0.00 | 3.61 | 5.15295 | 1*12 | -2550 | -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 / 12.17~12.18 |
| 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) |

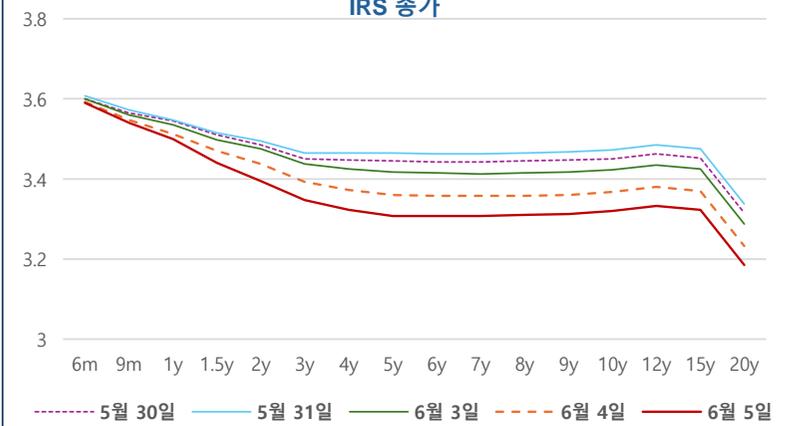
IRS 데일리 증가

6월 5일

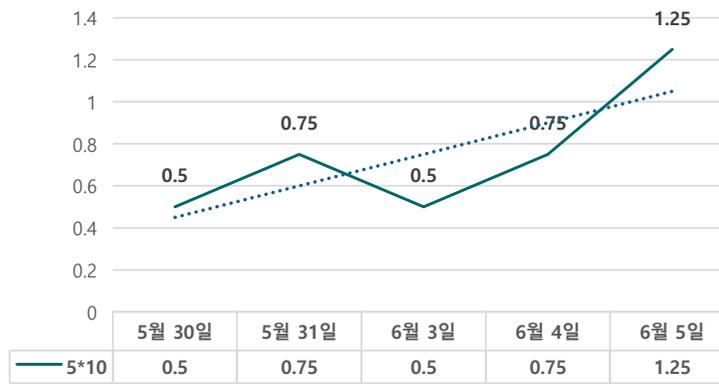
단위 : %, bp

| 구분 | 증가 | 전일대비 |
|------|--------|-------|
| 6m | 3.5900 | -0.25 |
| 9m | 3.5400 | -0.75 |
| 1y | 3.5000 | -1.25 |
| 1.5y | 3.4400 | -3.00 |
| 2y | 3.3950 | -4.25 |
| 3y | 3.3475 | -4.50 |
| 4y | 3.3225 | -5.00 |
| 5y | 3.3075 | -5.25 |
| 6y | 3.3075 | -5.00 |
| 7y | 3.3075 | -5.00 |
| 8y | 3.3100 | -4.75 |
| 9y | 3.3125 | -4.75 |
| 10y | 3.3200 | -4.75 |
| 12y | 3.3325 | -4.75 |
| 15y | 3.3225 | -4.75 |
| 20y | 3.1850 | -4.75 |

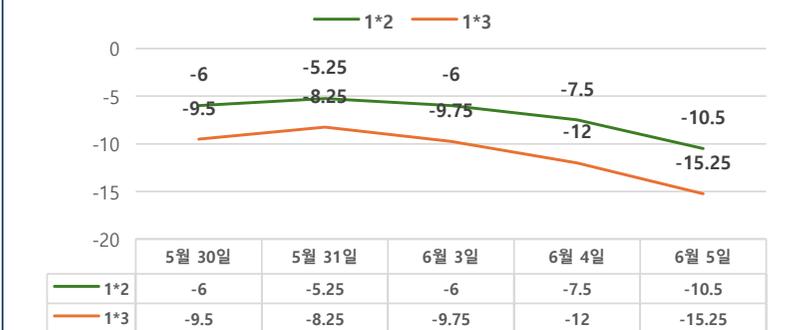
IRS 증가



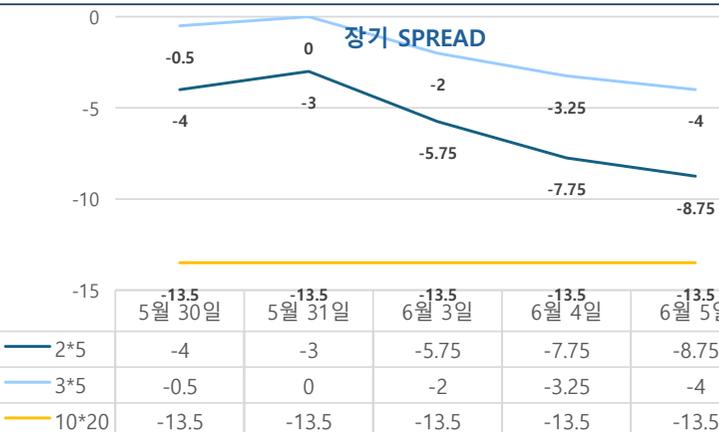
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

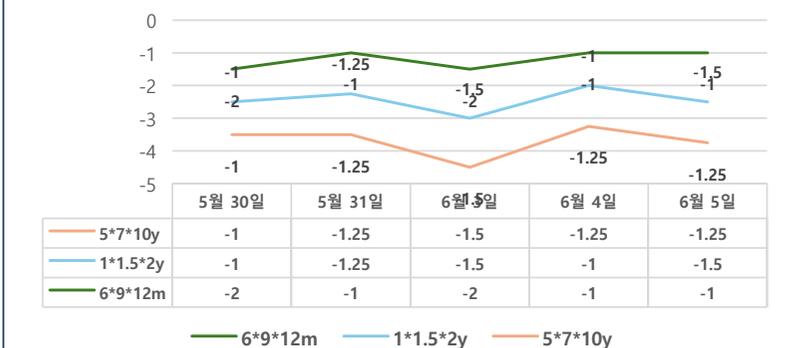


IRS 주요 커브

SPREAD

| 구분 | 증가 | 전일대비 |
|--------|--------|-------|
| 1*2y | -10.50 | -3.00 |
| 1*3y | -15.25 | -3.25 |
| 2*5y | -8.75 | -1.00 |
| 3*5y | -4.00 | -0.75 |
| 5*10y | 1.25 | 0.50 |
| 10*20y | -13.50 | 0.00 |

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

| 구분 | 증가 | 전일대비 |
|----------|--------|-------|
| 6m*9m*1y | -1.00 | 0.00 |
| 1*1.5*2y | -1.50 | -0.50 |
| 2*5*10y | -10.00 | -1.50 |
| 5*7*10y | -1.25 | 0.00 |