

# Market Daily Report



2024.06.10(월)

<b>레포</b>	지준일(5일) 은행 간 콜-레포 조정 거래 활발했으며, 오후에 실시간 재정 유입되며 소폭 잉여 마감하였음. 주말 전 국고채 상환 재원 마련을 위한 대규모 국고금 환수(7일) 선행되어 시장 부족 전환됐으며, 시은 매수에 힘입어 일반채 해소는 무난했던 반면, 회사채 정체 극심하였음.
<b>채권</b>	한국 : 현충일 휴장 기간 중 BOC와 ECB의 연이은 통화정책 피벗을 소화하며 강세 흐름 지속되었음. 외인 국채선물을 모두 강하게 순매수 하였음. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승 마감. 이날 미국 5월 비농업 고용 지표는 시장 예상치 대폭 상회하였음. 특히 전일 ECB가 금리인하를 발표하며 더욱 9월 금리인하 가능성에 베팅하던 채권 투자자들은 미 국채를 투매하며 가격이 급락하였음.
<b>MONEY</b>	BOC와 ECB가 예상대로 기준금리를 25bp 인하하였으나, ECB의 인플레이션 경계감으로 매파적 인하로 인식되면서 오히려 독일 분트채 2년물 수익률이 상승하는 등 이례적인 분위기 연출. 미국의 비농업 고용지표 발표와 주말을 앞두고 거래는 제한적이었음. 달러 머니 시장은 다음주 월요일 단오절로 중국, 홍콩 그리고 대만의 휴장으로 4일물 오버나이트 5.33-5.37 수준으로 체결 되었고, 대만계 및 말레이시아계 네임은 3개월물 위주로 5.60-5.65 사이로 역의 체결 소식 전했음. ECB가 25bp 금리를 인하 했음에도 유로 금리는 기존 실 거래 금리가 기준금리 이하로 거래 되면서 이미 선반영 된 영향과 ECB의 매파성 발언으로 금리 변동성이 제한적임.
<b>FX SWAP</b>	외환스와프포인트는 미국채 금리가 6거래일째 하락함에 따라 장기물을 중심으로 상승했으며 1년 만기스와프 레벨은 전장보다 30전 오른 -2810전에 증가를 형성함. 최근, 계속 미국 금리가 빠지면서 스와프포인트가 다소 오를것으로 예상했었지만 국내 금리가 많이 빠지고 에셋스와프 물량이 주 초반부터 6개월 만기 이후로 많이 나옴것에 연동해 시장은 다소 안정적인 모습을 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 주요국 중앙은행의 금리 인하 속에서 하락 마감 전일 국내 현충일 휴장 중 미국의 경제 지표가 혼재됐으며, 5월 5월 서비스업 구매관리지수(PMI)는 시장 예상을 웃돌았지만, ADP 민간고용과 주간 실업보험 청구자 수, 구인 구직 보고서 등은 고용의 둔화를 가리키면서 이에 영향을 받아 움직이는 모습을 보임. 유럽중앙은행(ECB)과 캐나다중앙은행(BOC)이 금리 인하를 단행하면서 주요국 중앙은행의 피벗도 본격화되는 분위기를 띠. 초단기쪽으로 호가가 형성되면서 6개월이 58.5에 초이스되다 거래가 됐으며, 5년쪽으로 오퍼가 다소 내려오면서 56.75에 거래가 이뤄짐. 장 마감 후 6*9개월로 9.9가 9개월이 53.25 레벨에 거래가 이뤄졌으며, 3년쪽으로 호가가 형성되면서 31.75-31.5에 거래가 됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.05.31(금)	193.2	203.5	3.57%	3.580%	3.500%	3.61%	2년물	4.862%	12.8
2024.06.03(월)	195.5	205.0	3.55%	3.539%		3.61%	5년물	4.440%	13.5
2024.06.04(화)	197.6	206.0	3.50%	3.483%		3.60%	10년물	4.413%	12.1
2024.06.05(수)	199.1	205.0	3.50%	3.502%		3.60%	30년물	4.535%	9.6
2024.06.07(금)	197.1		3.58%	3.587%		3.60%	10Y-2Y	-44.9	-0.7

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,722.67	33.17	34-06-10	국고 24-5	920	국고채 50,730	국고채 181,580	국고채 3년 28,000
KOSDAQ	866.18	15.43	27-09-10	국고 22-8	400	여전채 3,600	은행채 7,000	통안채 91일 6,000
달러-원	1,365.40원	-7.60원	28-09-10	국고 23-6	398		여전채 4,200	
국고3Y	3.308%	-3.7	29-03-10	국고 24-1	-348		회사채 7,100	
국고10Y	3.385%	-4.5	25-03-10	국고 23-3	-503		공사채 3,000	
국고10Y-3Y	7.7	-0.8	33-06-10	국고 23-5	-1,799			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	0.00	O/N	5.38	5.33	5.36	-0.01
TN	5.40	5.33	5.37	-0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
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	5.65	5.55	5.60	0.00
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.75	5.60	5.68	0.03
6S	5.68	5.53	5.61	0.00	6S	5.75	5.60	5.68	0.00
1YR	5.65	5.50	5.57	0.00	1YR	5.75	5.60	5.68	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-22/-18	-20	5.26	0.06	3.50	5.31000	1M MAR	-220	-216
TN	-9/-7	-8	5.61	0.27	3.50	5.31054	1W*1S	-172	-170
1W	-54/-52	-53	5.49	0.12	3.50	5.31380	1*2	-235	-230
1S	-235/-225	-230	5.56	0.05	3.53	5.32630	1*3	-460	-450
3S	-710/-670	-690	5.59	0.02	3.59	5.33444	1*6	-1140	-1120
6S	-1430/-1370	-1400	5.69	0.01	3.61	5.27509	1*9	-1860	-1840
1YR	-2850/-2770	-2810	5.75	-0.02	3.60	5.09229	1*12	-2550	-2520

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

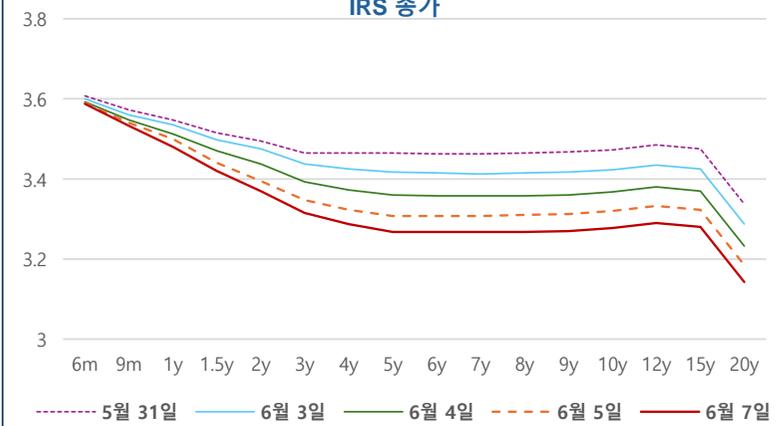
IRS 데일리 증가

6월 7일

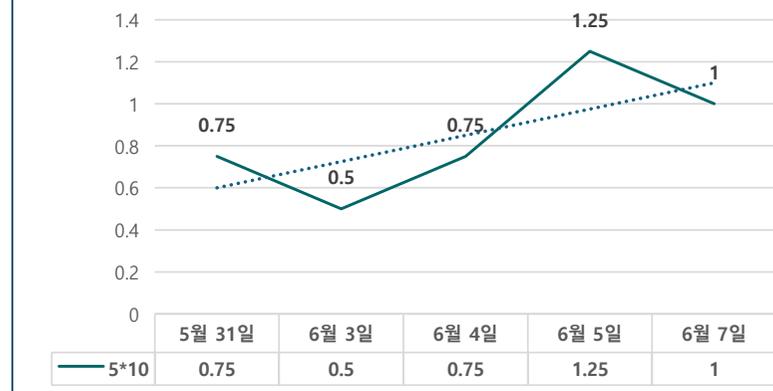
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5875	-0.25
9m	3.5325	-0.75
1y	3.4800	-2.00
1.5y	3.4200	-2.00
2y	3.3700	-2.50
3y	3.3150	-3.25
4y	3.2875	-3.50
5y	3.2675	-4.00
6y	3.2675	-4.00
7y	3.2675	-4.00
8y	3.2675	-4.25
9y	3.2700	-4.25
10y	3.2775	-4.25
12y	3.2900	-4.25
15y	3.2800	-4.25
20y	3.1425	-4.25

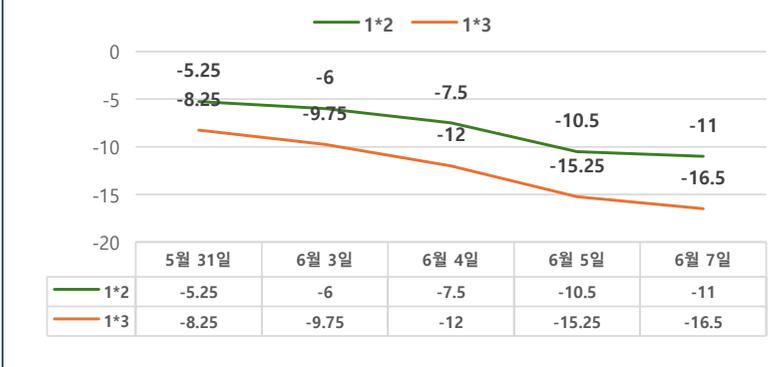
IRS 증가



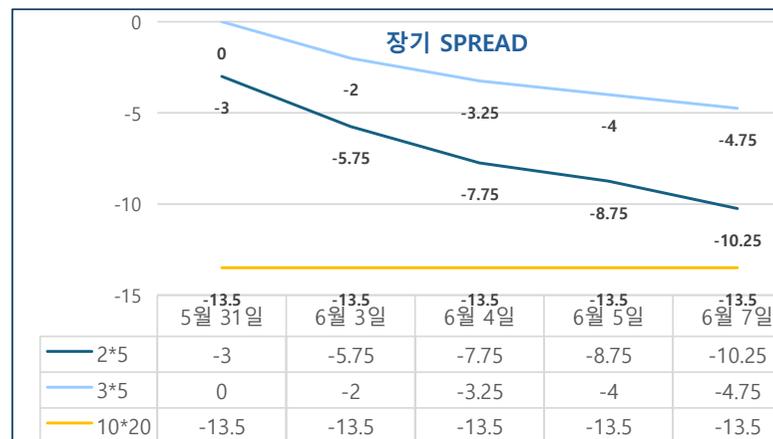
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

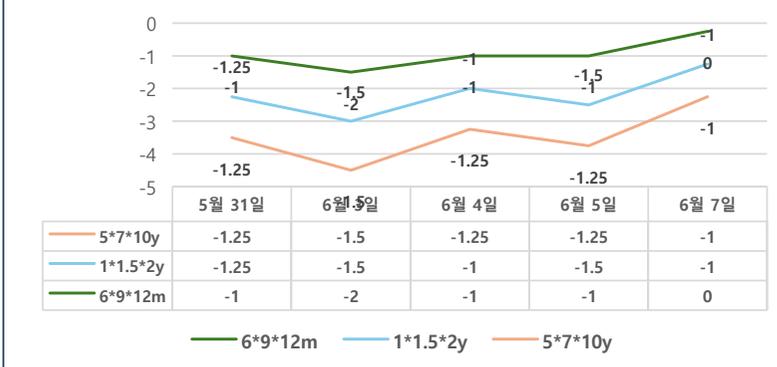


IRS 주요 커브

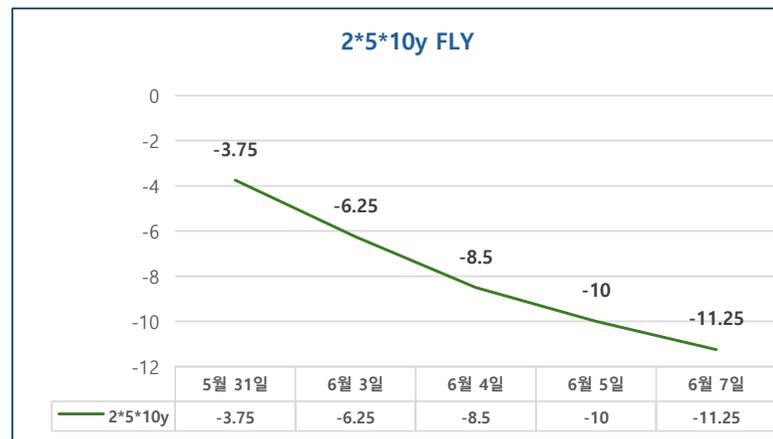
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-11.00	-0.50
1*3y	-16.50	-1.25
2*5y	-10.25	-1.50
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	1.00	-0.25
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.75
1*1.5*2y	-1.00	0.50
2*5*10y	-11.25	-1.25
5*7*10y	-1.00	0.25