

# Market Daily Report



2024.06.12(수)

<b>레포</b>	국고여유자금 및 공자자금 유입되어 조달여건 소폭 개선됐으며, 은행권 매수에 힘입어 일반채 해소 원활하였음. 장 중 거래금리 상승하기도 했으나 오후에 추가 자금 유입되어 안정을 되찾았고, 회사채 또한 무난히 소화되었음.
<b>채권</b>	한국 : 미 대형 이벤트 앞두고 경계감 여전했으나 '밀리면 사자' 류의 강한 매수 심리에 방향성 제한되었음. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 하락 마감. 이날 10년물 국채 입찰에서 모처럼 강한 수요가 확인되어 국채 매수세에 힘이 실렸음. 또한 10년물의 경우 지난 2거래일 간 금리가 급등한 것에 대한 반발로 매수 심리가 작용되었음.
<b>MONEY</b>	ECB총재가 추가 기준 금리 인하까지는 휴지 기간이 있을 수 있다는 발언과 함께 FOMC와 미국의 5월 CPI 발표를 앞두고 시장 거래는 다소 소강 상태. 연준의 매파적인 통화 정책 기조 발표를 앞두고 위안화와 엔화 등 아시아 통화는 달러 강세에 약세를 지속하며 엔화는 157엔을 터치 하였고, 위안화는 7개월래 최저치를 보이자 당국의 개입이 등장했음. 머니 시장은 달러 강세에 따른 SOFR 금리도 장기 구간 (6m-12m) 상승하면서 홍콩과 중국 개장과 함께 위안화 약세에 따른 달러 수요 급증으로 중국계 비드가 1개월물 이상 구간에 강세를 보였으며, 공격적인 호가를 제시하는 중국계 유럽 & 중동 센터의 비드로 1개월 5.60 3개월물-1년물은 5.65-5.70 레벨 사이에 거래되었음. 다만, 6월이내 구간으로 운용하는 역내의 다수 오피로 2주물 운용 가능 레벨은 1-2bp 소폭 하락 조정됨.
<b>FX SWAP</b>	전일 외환스와프포인트는 6월 FOMC와 5월 미국 소비자물가지수를 대기하며 한산한 장세를 유지함. 대부분 보험권 레벨에서 거래됐으며, 포지션 플레이뿐만 아니라 수급도 많지 않아 거래 자체가 적었던 것으로 파악됨. 금일 발표되는 FOMC 점도표가 중요하며 연내 1회 인하로 조정된다면 스와프포인트가 추가하락할 것으로 예측됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 단기물을 제외하고 대체로 하락 마감함. 1년 이내 단기쪽 구간에서 포린들의 비드가 많이 나오는 모습을 보였으며, 이외에는 크게 특이한 모습은 보이지 않고 전체적으로 채권시장의 움직임과 연동되면서 움직이는 모습을 보임. 장 막판에 2년 오피가 꾸준히 내려오면서 40에 거래가 이뤄졌으며, 10년이 32오피가 나오고 5년 비드가 다소 올라오면서 5년이 31에 거래됨. 장 마감 후에는 1*3년이 -16.25 비드가 나오면서 거래됐으며, 이후 미국채 움직임과 연동되면서 2년이 40.5/40.25에 호가가 형성되다 40.25에 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp	
2024.06.04(화)	197.6	206.0	3.50%	3.483%	3.500%	2년물	4.845%	-4.6	
2024.06.05(수)	199.1	205.0	3.50%	3.502%		5년물	4.425%	-6.3	
2024.06.07(금)	197.1	204.9	3.58%	3.587%		10년물	4.407%	-6.5	
2024.06.10(월)	195.9	201.3	3.58%	3.599%		30년물	4.539%	-6.1	
2024.06.11(화)	198.1		3.58%	3.591%		10Y-2Y	-43.8	-1.9	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,705.32	4.15	29-03-10	국고 24-1	1,510	은행채 4,400	은행채 4,800	통안채 1년 6,000
KOSDAQ	868.36	3.65	26-12-10	국고 23-10	1,006	여전채 2,000	여전채 400	재정채 63일 20,000
달러-원	1,378.40원	2.40원	25-06-11	중금채	1,000	회사채 7,710	회사채 1,500	
국고3Y	3.341%	-1.2	33-12-10	국고 23-11	-100	공사채 5,000	공사채 3,100	
국고10Y	3.425%	-0.8	25-09-10	국고 20-6	-500			
국고10Y-3Y	8.4	0.4	25-03-10	국고 23-3	-800			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.40	5.33	5.37	-0.01	O/N	5.38	5.33	5.35	0.00
TN	5.41	5.34	5.38	-0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.46	5.36	5.41	0.01	1W	5.43	5.38	5.40	0.00
1S	5.57	5.47	5.53	-0.01	1S	5.63	5.55	5.60	0.00
3S	5.64	5.54	5.59	0.01	3S	5.75	5.60	5.65	-0.03
6S	5.72	5.57	5.65	0.04	6S	5.75	5.60	5.68	0.00
1YR	5.68	5.53	5.60	0.03	1YR	5.75	5.60	5.68	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.33	0.00	3.50	5.31000	1M MAR	-230	-226
TN	-8/-6	-7	5.33	-0.26	3.50	5.31060	1W*1S	-186	-180
1W	-56/-50	-53	5.48	-0.01	3.50	5.31417	1*2	-225	-220
1S	-250/-230	-240	5.51	-0.05	3.54	5.32907	1*3	-450	-440
3S	-715/-695	-705	5.62	0.00	3.59	5.34321	1*6	-1160	-1130
6S	-1440/-1380	-1410	5.68	-0.02	3.61	5.30144	1*9	-1890	-1860
1YR	-2900/-2840	-2870	5.76	-0.01	3.59	5.13965	1*12	-2575	-2555

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)

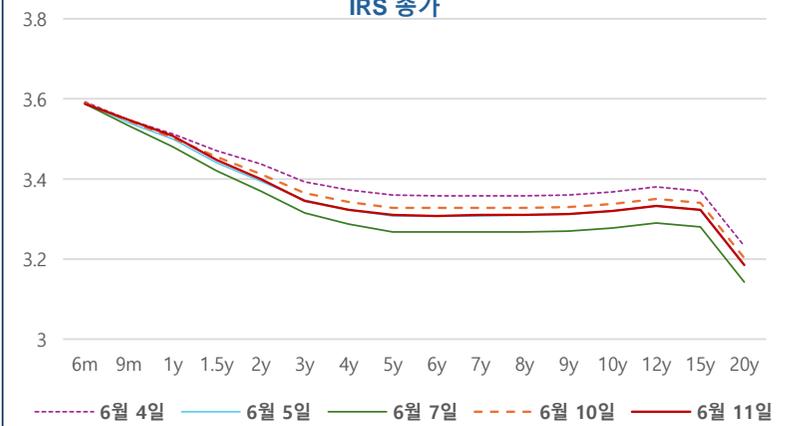
IRS 데일리 증가

6월 11일

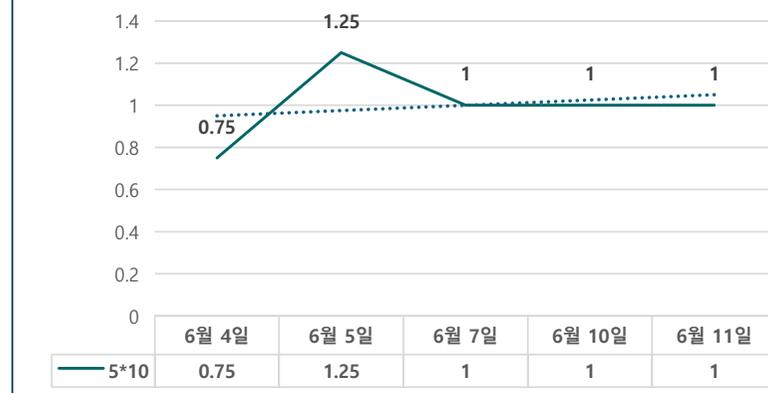
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5875	-0.25
9m	3.5475	0.25
1y	3.5075	0.50
1.5y	3.4475	-0.75
2y	3.4000	-1.25
3y	3.3450	-2.00
4y	3.3225	-2.00
5y	3.3100	-1.75
6y	3.3075	-2.00
7y	3.3100	-1.75
8y	3.3100	-1.75
9y	3.3125	-1.75
10y	3.3200	-1.75
12y	3.3325	-1.75
15y	3.3225	-1.75
20y	3.1850	-1.75

IRS 증가



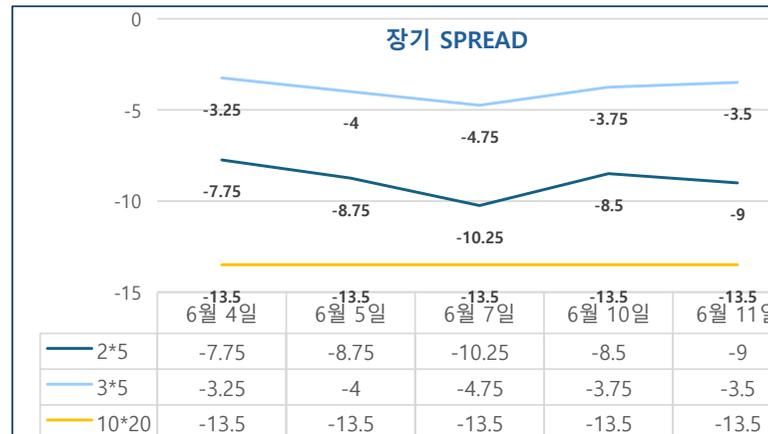
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

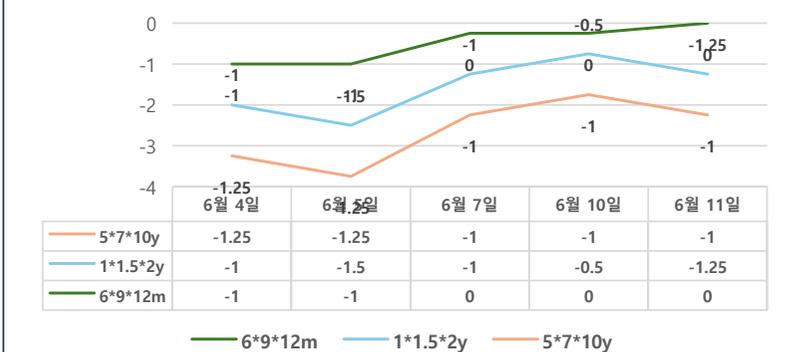


IRS 주요 커브

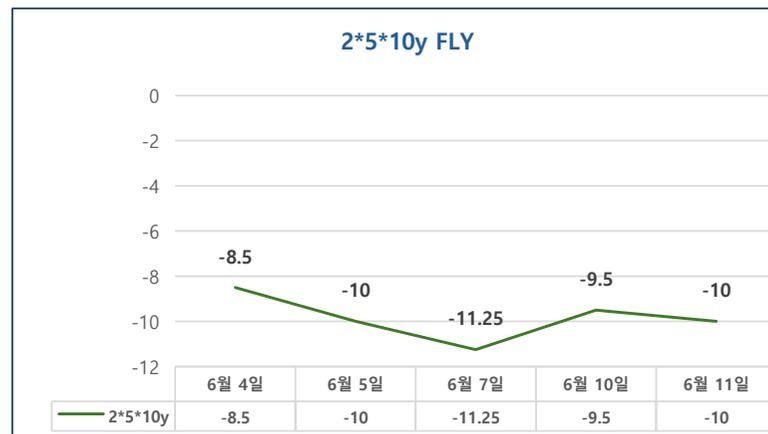
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-10.75	-1.75
1*3y	-16.25	-2.50
2*5y	-9.00	-0.50
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	1.00	0.00
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.25
1*1.5*2y	-1.25	-0.75
2*5*10y	-10.00	-0.50
5*7*10y	-1.00	0.00