

Market Daily Report

2024.06.13(목)



레포	국고여유자금-공자자금 유입 및 청약자금 운용 영향으로 조달여건 크게 개선됐으며, 은행권 매수 증가하여 장 중 금리 하락하였음. 일부 회사채 난항을 겪기도 했으나 오후계 정세 해소되었고, 월 내 단기 기일물 조달금리 소폭 하락하였음.
채권	한국 : 미 국제 강제 연동되며 미 CPI와 FOMC 등 주요 이벤트 앞둔 대기장세 지속되었음. 미국 : 미 국제금리는 전 구간 하락 마감. 장 초반 5월 CPI 상승률이 완화된 것으로 나오자 채권 투자자들은 매수 주문을 강하게 넣으며 반색하였음. 하지만 오후 장에서 연준이 연내 금리인하 횟수를 3회에서 1회로 낮춘 소식에 금리 하락 분 일부 반등하였음. 다만 소비자 물가 둔화 소식과 파월의장이 점도표에 매몰되지 말 것을 강조하며 통심리 우세하였음.
MONEY	12일 서울 시장은 새벽에 발표될 FOMC와 미국의 5월 CPI를 앞두고 내년도 미국 금리 점도표를 주시하는 분위기 속에 거래는 소강상태를 보였음. 달러 머니 시장은 반기말 앞두고 역외 대출 자산 매칭과 비율 관리를 위한 달러 차입 수요가 꾸준히 들어오면서 중국계 은행들의 1개월물 레벨이 5.60-5.62 사이로 거래된 반면, 일본계, 싱가포르계로 향하는 1개월물 오피 레벨은 5.44-5.45 수준으로 제시 및 거래되면서 차입 규모가 크고 네임별 센터가 많은 중국계 은행과의 레벨갭이 15bp 이상 확대되는 모습. 한국계 은행들은 단기 자금 룭 유지 하면서 차입이 제한적인 가운데 반기말 커버 1개월물은 5.48-5.52 수준으로 형성되고 있음.
FX SWAP	외환스와프포인트는 미 연방공개시장위원회 정례회의를 앞두고 대체로 소폭 상승했지만, 5월 CPI와 점도표 발표라는 빅 이벤트를 앞두고 거래량은 많지 않았던 것으로 파악됨. 미국채 금리가 하락해 스와프포인트가 소폭 오르는 했지만 전체적인 방향성에 유의미한 흐름은 아닌것으로 판단되며, 3달 이내 단기스와프만 소량 거래되며 시장 마감됨.
IRS	전일 IRS는 미국 5월 소비자물가지수(CPI) 발표와 6월 FOMC를 대기하는 분위기 속에 하락 마감. 1년이 50.25에 몇 차례 거래되었으며, 20*30년 -34 마켓 거래 소식으로 30년쪽 커버가 스티핑. 장 막판에는 오피 레벨이 내려오면서 2년이 37.25, 5년이 27.5에 거래가 이뤄졌으며, 9개월 54, 1년 49.5 마켓 거래 소식으로 단기쪽 레벨도 같이 내려오게 됨. 마감 이후에는 미국채 움직임과 연동되어 막판 거래 레벨에서 비드분 분위기였으며, 3년이 31.25에 한 차례 거래가 이뤄짐

단기자금시장						전일 미국 국제 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
							한국시간 오전 07:05 기준		
							단위 : bp		
2024.06.05(수)	199.1	205.0	3.50%	3.502%	3.500%	3.60%	2년물	4.762%	-8.3
2024.06.07(금)	197.1	204.9	3.58%	3.587%		3.60%	5년물	4.324%	-10.1
2024.06.10(월)	195.9	201.3	3.58%	3.599%		3.60%	10년물	4.320%	-8.7
2024.06.11(화)	198.1	201.2	3.58%	3.591%		3.60%	30년물	4.478%	-6.1
2024.06.12(수)	199.9		3.55%	3.556%		3.60%	10Y-2Y	-44.2	-0.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부형 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,728.17	22.85	24-08-15	재정채	2,800	은행채 1,500	은행채 8,700	
KOSDAQ	870.67	2.31	26-03-10	국고 24-3	480	여전채 5,400	여전채 2,160	
달러-원	1,376.20원	-2.20원	26-12-10	국고 23-10	460	회사채 1,155	회사채 1,950	
국고3Y	3.307%	-3.4	25-06-10	국고 15-2	-346		공사채 2,100	
국고10Y	3.382%	-4.3	32-12-10	국고 22-14	-409			
국고10Y-3Y	7.5	-0.9	25-09-10	국고 20-6	-1,000			

Money Market Closing								
KOREAN/FOREIGN					CHINESE			
기간			증가	전일대비	기간		증가	전일대비
O/N	5.39	5.32	5.36	-0.01	O/N	5.38	5.35	0.00
TN	5.40	5.33	5.37	-0.01	TN	5.40	5.38	0.00
1W	5.46	5.36	5.41	0.00	1W	5.43	5.41	0.01
1S	5.57	5.47	5.52	-0.01	1S	5.65	5.60	0.00
3S	5.63	5.53	5.58	-0.01	3S	5.75	5.66	0.01
6S	5.70	5.55	5.63	-0.02	6S	5.75	5.67	-0.01
1YR	5.66	5.51	5.58	-0.02	1YR	5.75	5.69	0.01

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	-222	-217
TN	-8/-6	-7	5.33	0.00	3.50	5.31067	1W*1S	-183	-179
1W	-56/-50	-53	5.48	0.00	3.50	5.31469	1*2	-225	-220
1S	-245/-225	-235	5.53	0.02	3.54	5.33075	1*3	-500	-490
3S	-760/-720	-740	5.62	-0.01	3.59	5.34680	1*6	-1160	-1140
6S	-1460/-1400	-1430	5.69	0.01	3.61	5.31249	1*9	-1880	-1840
1YR	-2900/-2840	-2870	5.76	0.00	3.59	5.15877	1*12	-2530	-2500

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 / 12.17~12.18
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)

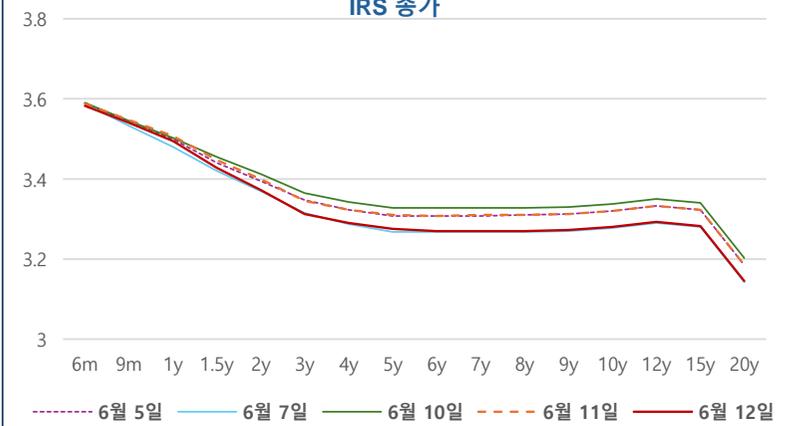
IRS 데일리 증가

6월 12일

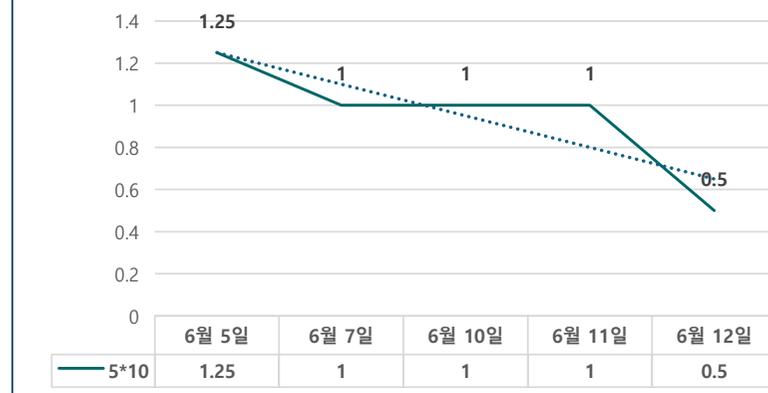
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5825	-0.50
9m	3.5400	-0.75
1y	3.4950	-1.25
1.5y	3.4275	-2.00
2y	3.3725	-2.75
3y	3.3125	-3.25
4y	3.2900	-3.25
5y	3.2750	-3.50
6y	3.2700	-3.75
7y	3.2700	-4.00
8y	3.2700	-4.00
9y	3.2725	-4.00
10y	3.2800	-4.00
12y	3.2925	-4.00
15y	3.2825	-4.00
20y	3.1450	-4.00

IRS 증가



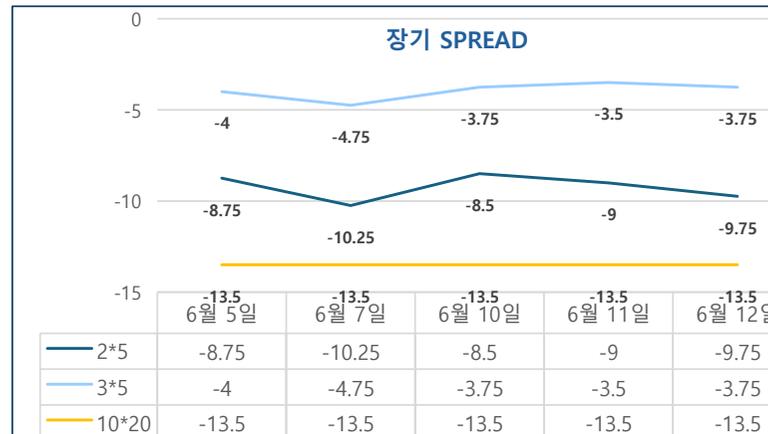
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

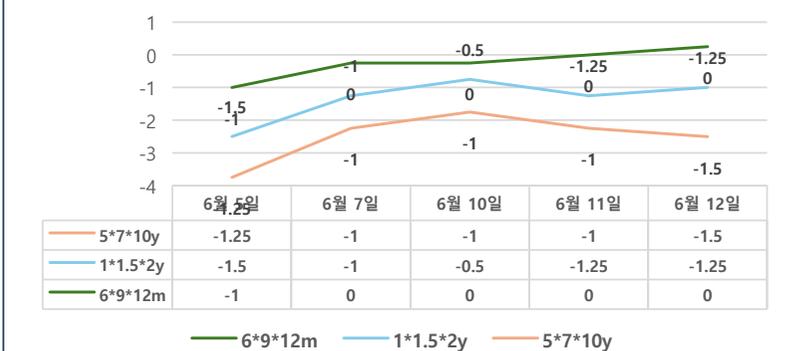


IRS 주요 커브

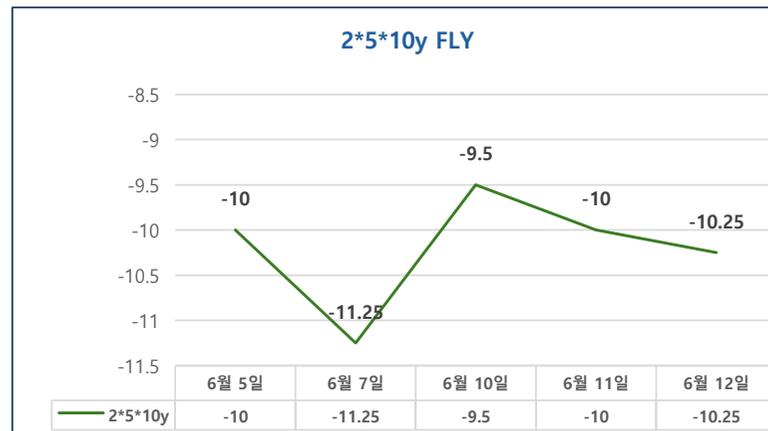
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-12.25	-1.50
1*3y	-18.25	-2.00
2*5y	-9.75	-0.75
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	0.50	-0.50
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.25	0.25
1*1.5*2y	-1.25	0.00
2*5*10y	-10.25	-0.25
5*7*10y	-1.50	-0.50