

# Market Daily Report



2024.06.14(금)

<b>레포</b>	장 초반부터 은행권 운용에 적극적으로 나서 국고금 환수 및 청약자금 환불 영향 제한적이었으며, 조달여건 양호하였음. 한국은행 RP매각 증액 규모 크지 않아 입찰 후 추가 매도 많지 않았으며, 월 내 만기 기일을 조달 수요 감소세를 보임.
<b>채권</b>	한국 : 5월 CPI와 FOMC 결과 소화하며 미 국채금리 하락 영향에 소폭 강세를 보였음. 미국 : 미 국채 금리는 전 구간 하락 마감. 인플레이션 지표로서 CPI에 이어 PPI 지수도 하락하면서 사흘째 강세 유지하였음. 더불어 주간 실업보험 청구자수도 10개월 만에 가장 많은 수준을 기록하며 금리 하락 재료로 작용하였음. 인플레이션 둔화 조짐과 고용 시장 냉각 시그널이 동시에 보이자 채권 매수 심리 강화되었음.
<b>MONEY</b>	시장의 예상과 같이 연준은 7회 연속 기준 금리를 동결했으며, 점도표상 연내 한번의 인하는 매파적이었으나, 5월 CPI와 PPI의 호조 및 실업 보험 청구자수 증가로 글로벌 마켓은 달러 약세 & 채권, 주식 등 강세를 보였음. 달러 머니 시장은 역외 중국계 은행들의 반기말 커버 달러 펀딩이 일부 진전되었고, 월말 커버 구간이 스팟-2주물로 접어들면서 어느정도 포지션의 윤곽이 나오며 오픈 등장. 긴쪽 구간 테너 체결이 역외에서 진행되며 연내 1회 금리 인하 예상에도 레벨 상승세가 지난주 부터 선반영된 영향으로 추가 상승은 제한됨. SOFR 금리는 연준 발표 이후, 6개월과 12개월이 큰폭으로 하락했음.
<b>FX SWAP</b>	외환스와프포인트는 미국채 금리가 다소 큰 폭으로 하락했지만, 장기를 에셋스와프 물량이 나오면서 대부분 소폭 하락한 것으로 파악됨. 시장은 미국의 5월 소비자물가 지수가 예상보다 둔화한 것으로 나오면서 미국채 금리가 크게 떨어지면서 약세를 보였음. 펀더멘털 상으로는 빠질 이유가 없는 장이었지만, 에셋스와프 수급의 영향이 컸던 것으로 파악되며, 전반적으로 약보합세를 보이며 장 마감됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 미국 5월 소비자물가지수(CPI)와 6월 FOMC를 소화하는 분위기 속에 하락 마감. 단기쪽으로 호가가 많이 형성되는 분위기였으며, 6*9개월이 -4.75-5에 몇 차례 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 5년 비드가 올라오면서 24.5에 거래되었으며, 6년이 24에 거래후 비드는 분위기였고 24에 추가 거래됨. 마감 이후에는 nd로 6년 24.25 오퍼가 나와 거래가 이뤄졌으며, 미국채 움직임과 연동되어 5년 24.75 비드가 나온.

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	
2024.06.07(금)	197.1	204.9	3.58%	3.587%	3.500%	3.60%	2년물	4.705%	-5.7
2024.06.10(월)	195.9	201.3	3.58%	3.599%		3.60%	5년물	4.251%	-7.3
2024.06.11(화)	198.1	201.2	3.58%	3.591%		3.60%	10년물	4.249%	-7.1
2024.06.12(수)	199.9	200.7	3.55%	3.556%		3.60%	30년물	4.399%	-7.9
2024.06.13(목)	200.4		3.55%	3.531%		3.60%	10Y-2Y	-45.6	-1.4

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	2,754.89	26.72	34-06-10	국고 24-5	1,325	여전채 3,800	은행채 11,300	국고채 50년 4,000
KOSDAQ	871.33	0.66	54-03-10	국고 24-2	931	회사채 1,868	여전채 6,900	
달러-원	1,373.90원	-2.30원	26-03-10	국고 24-3	720	공사채 5,000	회사채 7,020	
국고3Y	3.277%	-3	51-03-10	국고 21-2	-110		공사채 4,100	
국고10Y	3.345%	-3.7	33-12-10	국고 23-11	-150			
국고10Y-3Y	6.8	-0.7	25-09-10	국고 20-6	-400			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	-0.01	O/N	5.38	5.32	5.35	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	-0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.46	5.36	5.41	0.00	1W	5.43	5.38	5.41	0.00
1S	5.56	5.46	5.51	-0.01	1S	5.65	5.55	5.60	0.00
3S	5.63	5.53	5.58	0.00	3S	5.75	5.60	5.66	0.00
6S	5.70	5.55	5.62	-0.01	6S	5.75	5.60	5.67	0.00
1YR	5.65	5.50	5.57	-0.01	1YR	5.75	5.60	5.70	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	-223	-220
TN	-25/-21	-23	5.51	0.18	3.50	5.31068	1W*1S	-173	-168
1W	-57/-51	-54	5.52	0.04	3.50	5.31477	1*2	-250	-240
1S	-240/-220	-230	5.55	0.02	3.54	5.33046	1*3	-485	-477
3S	-740/-710	-725	5.64	0.02	3.59	5.34661	1*6	-1160	-1150
6S	-1460/-1400	-1430	5.72	0.02	3.61	5.30741	1*9	-1860	-1840
1YR	-2900/-2820	-2860	5.75	-0.01	3.58	5.14544	1*12	-2570	-2530

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)

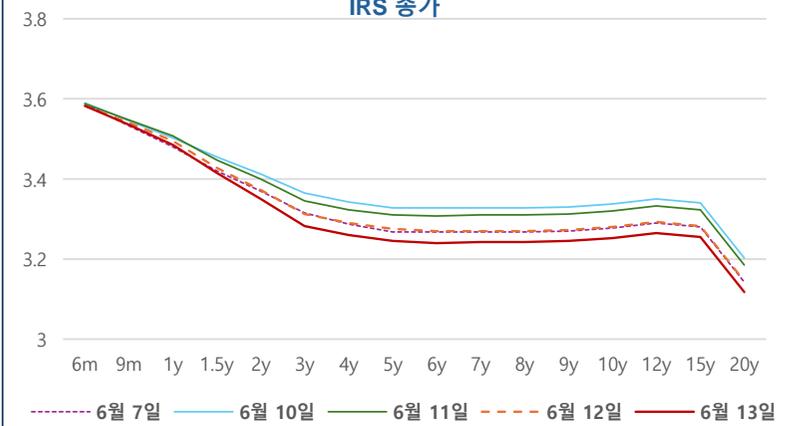
IRS 데일리 증가

6월 13일

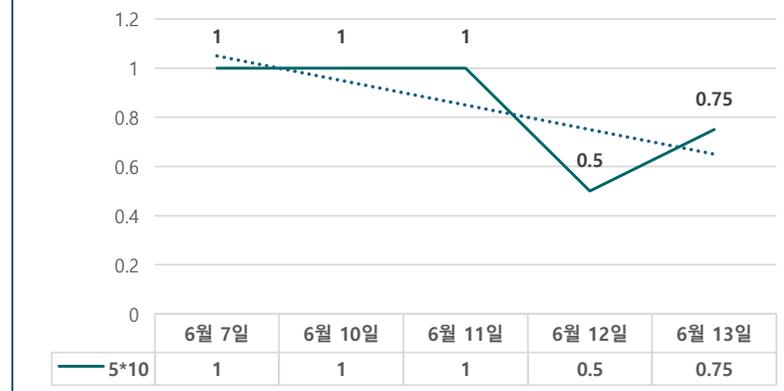
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5825	0.00
9m	3.5350	-0.50
1y	3.4850	-1.00
1.5y	3.4150	-1.25
2y	3.3500	-2.25
3y	3.2825	-3.00
4y	3.2600	-3.00
5y	3.2450	-3.00
6y	3.2400	-3.00
7y	3.2425	-2.75
8y	3.2425	-2.75
9y	3.2450	-2.75
10y	3.2525	-2.75
12y	3.2650	-2.75
15y	3.2550	-2.75
20y	3.1175	-2.75

IRS 증가



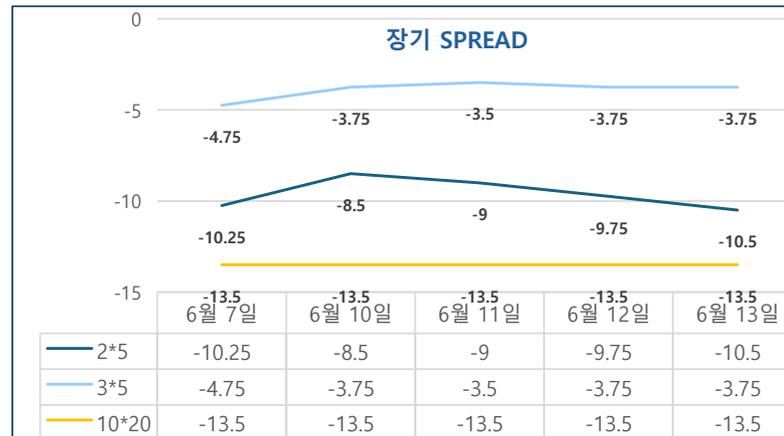
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

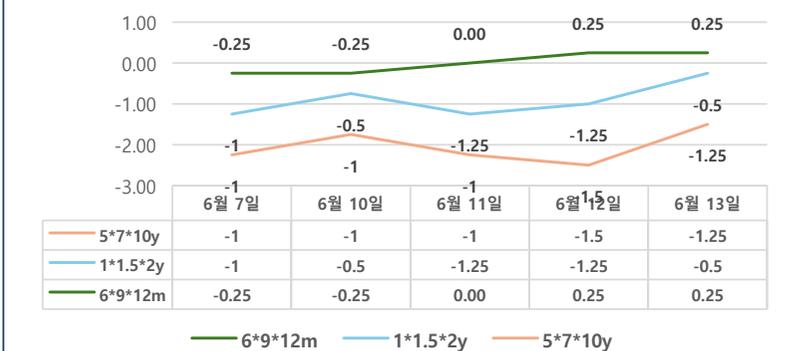


IRS 주요 커브

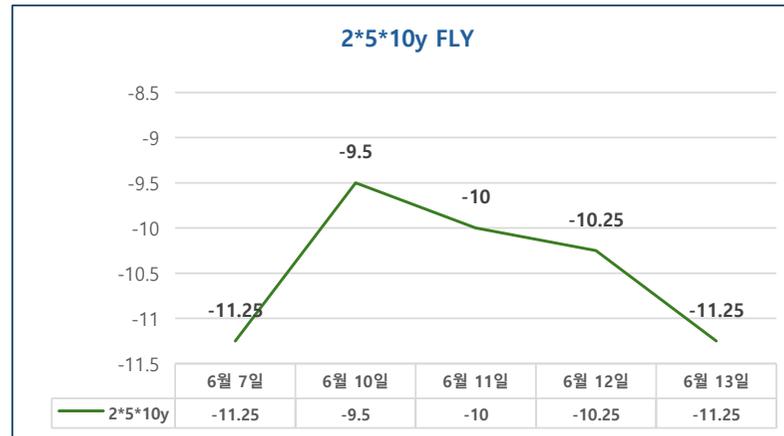
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.50	-1.25
1*3y	-20.25	-2.00
2*5y	-10.50	-0.75
3*5y	-4.00	0.00
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	0.25	0.00
1*1.5*2y	-0.50	0.75
2*5*10y	-11.25	-1.00
5*7*10y	-1.25	0.25