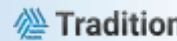


Market Daily Report



2024.06.11(화)

레포	대규모 국제 만기 도래했음에도 시장 유동성 나아지지 못해 금리 보험 출발했으며, 은행권 매수 여력 축소되어 장 중 부족세 심화되었음. 오후에 한국은행 RP매입을 통해 7일물 5조원 추가 공급하여 일반채 수급 호전됐으나 장 막판까지 회사채 정체 지속되었음.
채권	한국 : 미 고용 호조에 따른 금리 상승에도 외인 저가 매수로 미 금리 상승 대비 상승세 완만하였음. 미국 : 미 국제금리는 2년물 하락을 제외하고 상승 마감하였음. 이날 장 초반부터 마감까지 비슷한 상승폭 유지하였음. 시장은 이번 주 앞둔 FOMC회의에서 기준금리 동결이 기정사실로 받아들여지는 가운데 점도표 상 어떤 변화가 있을지 주목하며 경계심을 갖는 모습이었음.
MONEY	캐나다와 유럽연합(EU) 등 주요 선진국들이 피벗(통화정책 전환)에 본격적으로 합류했으나 시장의 시각은 매파성 인하로 일관. 주말에 발표된 미국 비농업 고용도 예상치를 웃돌면서 달러 인덱스는 105를 돌파하면서 강세를 보였고, 금주 12일(수요일)에 FOMC와 미국의 5월 소비자물가지수(CPI) 굵직한 이벤트 발표를 앞두고 시장은 경계 모드로 유지. 달러 머니 시장은 금일 단오절로 중국, 홍콩, 대만의 휴장으로 시장 가격이 제한적인 가운데 오버나잇 운소 5.37-5.38 수준으로 거래되었고, 중국계 기간물 비드 부재로 역내외 가격이 한정적이라 1개월물 운용 레벨이 운소 한국계 및 포린 네임으로 5.47-5.50 사이로 제시되며 평소보다 낮은 레벨로 일부 체결 되며 마무리.
FX SWAP	외환스와프포인트는 미국의 비농업 고용지표가 예상치보다 큰폭으로 높게 나온 데 따른 미국채 금리급등세에 연동하여 대부분 하락 마감함. 이에따라 미국의 금리인하 예상 스케줄이 9월 이후로 후퇴하는 것을 반영하는듯 했으며, 특히 1년 만기스와프가 전장 대비 60전 밀리면서 큰 폭 하락함. 초단기는 탐닉이 장 초반 -9전까지 거래되며 이윤가를 하회했지만 장 마감전 이윤가 레벨 부근으로 회복하는 모습을 보였고, 변동성이 큰 장세를 현물환 수급 관련 불안정한 모습을 이어감.
IRS	전일 IRS는 미국 고용지표 호조 영향으로 상당폭 반등 마감.미국 5월 신규 고용이 시장 예상치를 훌쩍 웃돌면서 연방준비제도(Fed-연준)의 금리 인하에 대한 기대가 후퇴함. 이번 주 연방공개시장위원회(FOMC)를 앞두고 매파적인 연준 스탠스에 대한 경계심도 한층 커진 모습을 보임. 장중 3년쪽으로 호가가 형성되면서 37에 몇차례 거래가 이뤄졌으며, ND/D에 초이스까지 이뤄짐.시장에서는 초단기쪽으로 시장에서 호가가 많이 형성됨. 장 막판에는 5년, 7년쪽으로 오퍼가 내려오면서 레벨이 움직였으며, 1년 오퍼가 내려오면서 50.5에 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국제 금리			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2024.06.03(월)	195.5	205.0	3.55%	3.539%	3.500%	3.61%	2년물	4.891%	-0.6
2024.06.04(화)	197.6	206.0	3.50%	3.483%		3.60%	5년물	4.488%	2.1
2024.06.05(수)	199.1	205.0	3.50%	3.502%		3.60%	10년물	4.472%	3.3
2024.06.07(금)	197.1	204.9	3.58%	3.587%		3.60%	30년물	4.600%	4.3
2024.06.10(월)	195.9		3.58%	3.599%			10Y-2Y	-41.9	3.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,701.17	-21.50	54-03-10	국고 24-2	1,120	여전채 700	은행채 1,000	국고채 2년 17,000
KOSDAQ	864.71	-1.47	33-06-10	국고 23-5	790	회사채 8	여전채 2,600	
달러-원	1,376.00원	10.70원	33-12-10	국고 23-11	600	통안채 5,100	회사채 3,000	
국고3Y	3.353%	4.5	53-03-10	국고 23-2	-100	공사채 4,700	통안채 5,400	
국고10Y	3.433%	4.8	31-06-10	국고 21-5	-499			
국고10Y-3Y	8	0.3	25-09-10	국고 20-6	-742			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.41	5.34	5.38	0.02	O/N	5.38	5.33	5.35	-0.01
TN	5.42	5.35	5.39	0.02	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	0.00
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	-8/-6	-7	5.33	0.07	3.50	5.31000	1M MAR	-234	-232
TN	-9/-7	-8	5.59	-0.02	3.50	5.31059	1W*1S	-165	-155
1W	-63/-59	-61	5.49	0.00	3.50	5.31412	1*2	-240	-230
1S	-235/-225	-230	5.56	0.00	3.54	5.32764	1*3	-471	-465
3S	-715/-695	-705	5.62	0.03	3.59	5.33399	1*6	-1180	-1150
6S	-1440/-1400	-1420	5.70	0.02	3.61	5.27129	1*9	-1910	-1870
1YR	-2900/-2840	-2870	5.77	0.02	3.59	5.07210	1*12	-2620	-2570

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)

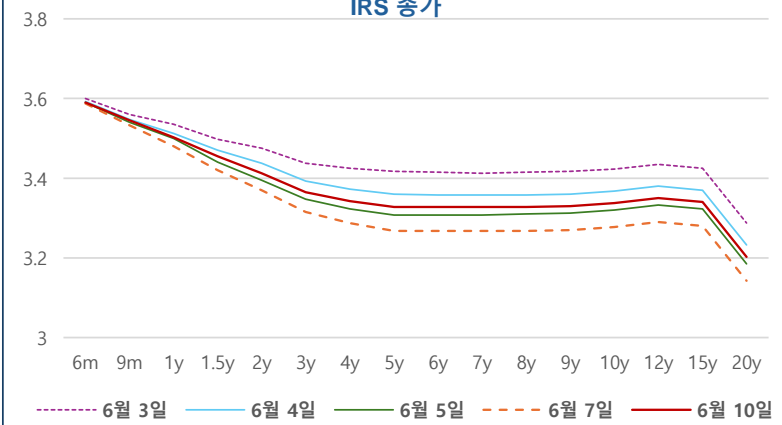
IRS 데일리 증가

6월 10일

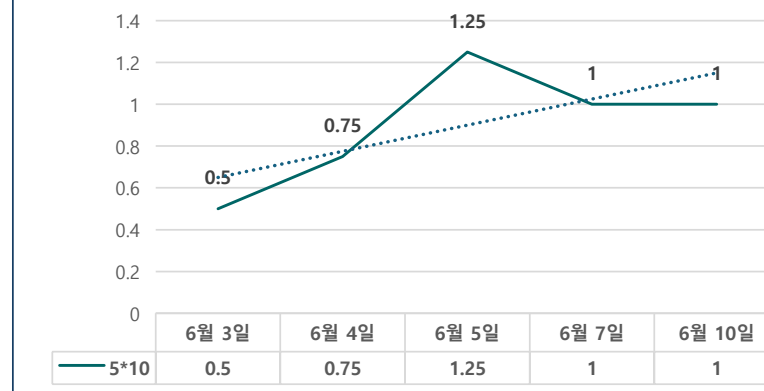
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5900	0.25
9m	3.5450	1.25
1y	3.5025	2.25
1.5y	3.4550	3.50
2y	3.4125	4.25
3y	3.3650	5.00
4y	3.3425	5.50
5y	3.3275	6.00
6y	3.3275	6.00
7y	3.3275	6.00
8y	3.3275	6.00
9y	3.3300	6.00
10y	3.3375	6.00
12y	3.3500	6.00
15y	3.3400	6.00
20y	3.2025	6.00

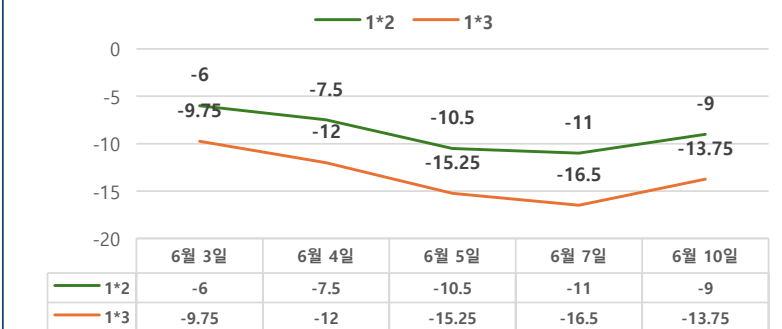
IRS 증가



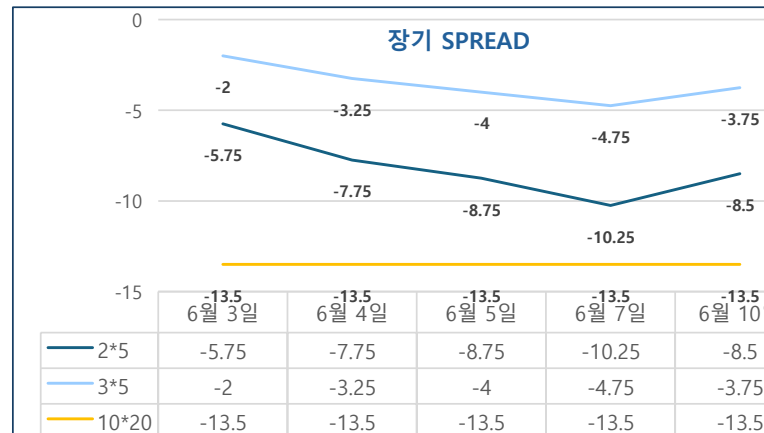
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

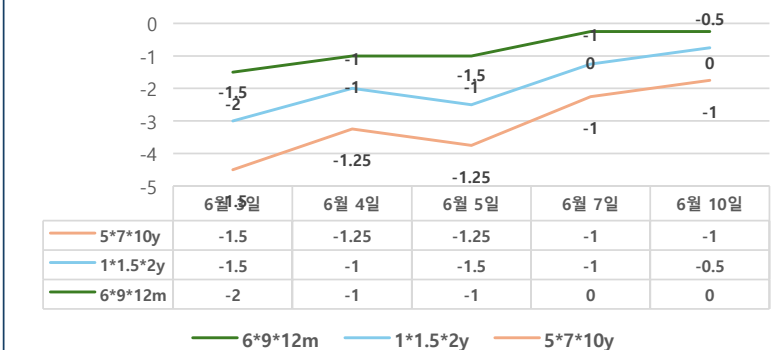


IRS 주요 커브

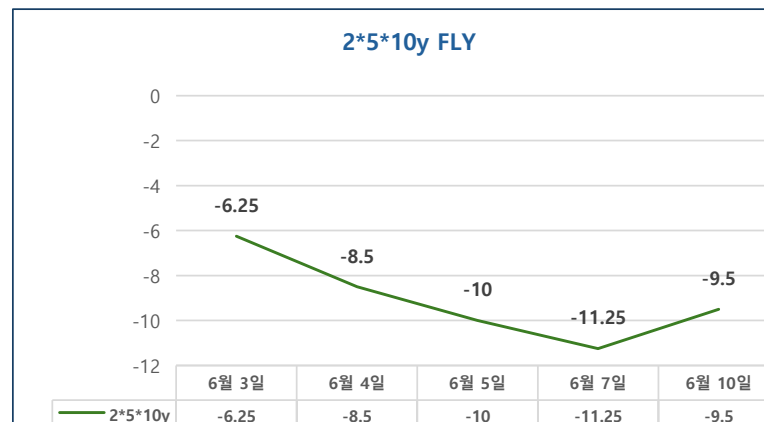
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-9.00	2.00
1*3y	-13.75	2.75
2*5y	-8.50	1.75
3*5y	-4.00	1.00
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	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-0.50	0.50
2*5*10y	-9.50	1.75
5*7*10y	-1.00	0.00