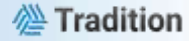


Market Daily Report



2024.06.19(수)

레포	공자자금 및 공모주(에스오에스) 청약자금 운용되어 은행신락 중심 매수 증가했으며, 전일에 이어 유동성 매우 풍부하였음. 장 중 운용사 추가 설정자금 유입되어 시은 저금리 조달 가능했고, 기일물 매도 원활하였음.
채권	한국 : 한은 물가설명회 중 금리인하 기대감이 되돌려지며 장 후반 중단기 중심의 금리 상승하였음. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 하락 마감. 미국 소비가 전월 대비 개선됐지만 예상치를 밑돌자 경기 둔화에 대한 우려와 함께 기준금리 인하 기대감 확대되었음. 또한 이날 20년물 국제 입찰에서 강한 수요가 확인된 점도 국제 매수 심리를 자극 하였음.
MONEY	미 재무부의 보유현금액이 지난 주말 기준 6천700억불로 목표 달성 (7천500억불)을 위해서는 이달말까지 유동성을 흡수해야 한다는 보도가 나왔고, 시장의 달러 강세는 지속되면서 달러 인덱스는 105 수준을 유지했음. 인플레이션 둔화가 예상보다 느리다는 평가로 RBA 는 금일 기준금리를 동결 했음. 내일 달러 휴장을 맞아, 온쇼 2일물 오버나잇은 5.34-5.36 수준으로 거래 되었으며, 역외에서는 대만계 5.40 까지 터치 했고, 월말 커버 2주물이 중국계 홍콩 센터들의 비딩으로 상승세를 보였으나, 중국계 & 대만계를 제외한 그 외 네임들의 단기 차입 수요가 제한적으로 오피가 테너별로 대기 중으로 장기 구간의 편딩 레벨은 좀더 하락 조정 될 것으로 예상됨.
FX SWAP	외환스와프포인트는 그동안 수급 및 에셋스와프로 눌린 레벨을 일부 되돌리며 전장대비 상승했으며, 1년 만기는 20전 오른 -2890전, 6개월물은 10전 오른 -1460전에 강가를 형성함. 지난 주부터 연일 펀더멘탈에 비해 괴리가 생겼고 수급의 영향 강하게 받으며 밀려왔지만, 장기를 위주로 매수세가 유입되면서 금리차를 되돌렸고 스와프 레벨은 상승함.
IRS	전일 IRS는 소폭 하락 마감. 지난밤 미국 국채 금리가 최근 랠리 이후 다소 반등한 가운데 국내외에서 다소 매파적인 재료들이 나오며 강세가 제한되는 모습을 보임. 이창용 한국은행 총재가 물가설명회에서 물가 상황에 대한 진단이 지난 5월과 달라진 바가 없다고 말하면서, 최근 금리 인하 요구 분위기에 대해 선을 긋는 모습을 보임. 장 초반 3년 비드가 다소 강하게 나오면서 22에 여러 차례 거래가 이뤄졌으며, 2년은 29.5-29.25에 몇차례 거래됨. 장 막판에는 오피가 다소 내려오는 분위기를 보였으며, 마감 이후에는 미국채와 연동되면서 5년이 17.25 비드까지 올라왔으며 2년이 30.25에 거래, 2*10년이 -12 거래 후 ND/D로 초이스가 이뤄짐.

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
2024.06.12(수)	199.9	200.7	3.55%	3.556%	3.500%	3.60%	2년물	4.725%	-4.9
2024.06.13(목)	200.4	202.9	3.55%	3.531%		3.60%	5년물	4.251%	-5.9
2024.06.14(금)	200.7	203.3	3.50%	3.503%		3.60%	10년물	4.227%	-5.8
2024.06.17(월)	201.5	202.9	3.47%	3.503%		3.60%	30년물	4.357%	-5
2024.06.18(화)	202.7		3.47%	3.506%		3.60%	10Y-2Y	-49.8	-0.9

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종요가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,763.92	19.82	28-06-10	국고 18-4	5,090	은행채 300	은행채 8,600	통안채 3년 12,000
KOSDAQ	858.95	-0.01	28-03-10	국고 23-1	2,697	여전채 4,500	여전채 200	재정증권 63일 20,000
달러-원	1,381.10원	-0.10원	27-09-10	국고 22-8	1,500	회사채 201	회사채 580	
국고3Y	3.214%	0.2	31-12-10	국고 11-7	-200	공사채 2,000	공사채 1,000	
국고10Y	3.279%	-0.4	33-12-10	국고 23-11	-248			
국고10Y-3Y	6.5	-0.6	24-09-10	국고 22-10	-260			

Money Market Closing									
		KOREAN/FOREIGN			CHINESE				
기간		증가	전일대비	기간		증가	전일대비	단위 : % , %p	
O/N	5.37	5.30	5.34	-0.01	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.39	5.32	5.35	-0.01	TN	5.40	5.34	5.36	0.00
1W	5.46	5.36	5.41	0.00	1W	5.43	5.38	5.40	0.00
1S	5.55	5.45	5.50	-0.01	1S	5.63	5.53	5.60	0.00
3S	5.62	5.52	5.57	-0.01	3S	5.72	5.62	5.66	0.01
6S	5.65	5.50	5.57	-0.03	6S	5.72	5.62	5.67	0.00
1YR	5.61	5.46	5.53	-0.02	1YR	5.72	5.62	5.68	-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	-15/-11	-13.50	5.26	-0.33	3.50	5.31000	1M MAR	-233	-231
TN	-	-	-	-	3.50	5.31090	1W*1S	-195	-189
1W	-56/-52	-54	5.52	-0.04	3.50	5.31627	1*2	-225	-220
1S	-250/-240	-245	5.54	-0.03	3.53	5.33867	1*3	-465	-460
3S	-730/-710	-720	5.66	-0.01	3.59	5.34357	1*6	-1190	-1180
6S	-1480/-1440	-1460	5.72	-0.03	3.58	5.26892	1*9	-1930	-1910
1YR	-2920/2860	-2890	5.74	-0.02	3.55	5.02820	1*12	-2610	-2590

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 / 12.17~12.18D
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)

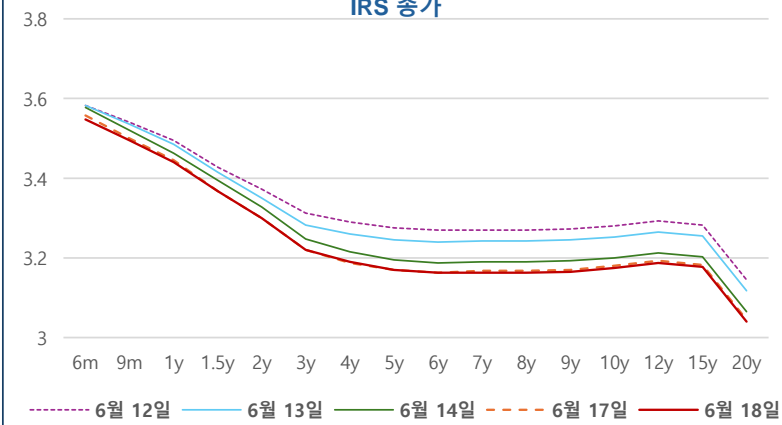
IRS 데일리 증가

6월 18일

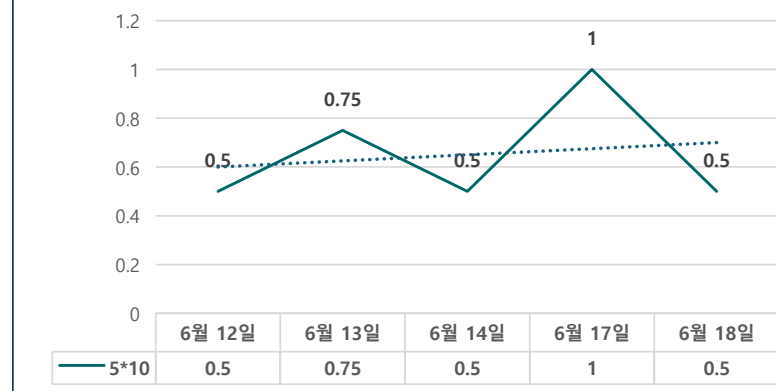
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5475	-1.00
9m	3.4950	-0.50
1y	3.4400	-0.50
1.5y	3.3675	0.00
2y	3.3000	0.00
3y	3.2200	0.00
4y	3.1900	0.25
5y	3.1700	0.00
6y	3.1625	0.00
7y	3.1625	-0.50
8y	3.1625	-0.50
9y	3.1650	-0.50
10y	3.1750	-0.50
12y	3.1875	-0.50
15y	3.1775	-0.50
20y	3.0400	-0.50

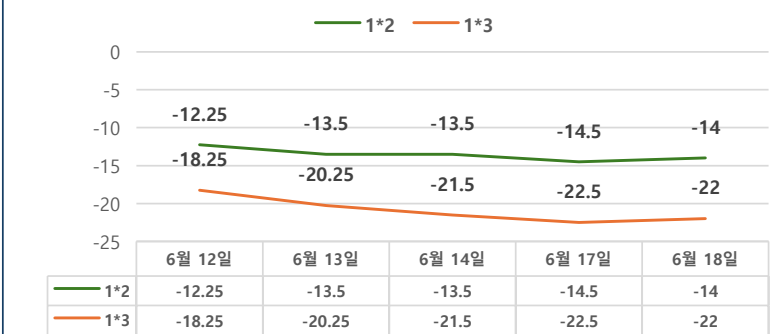
IRS 증가



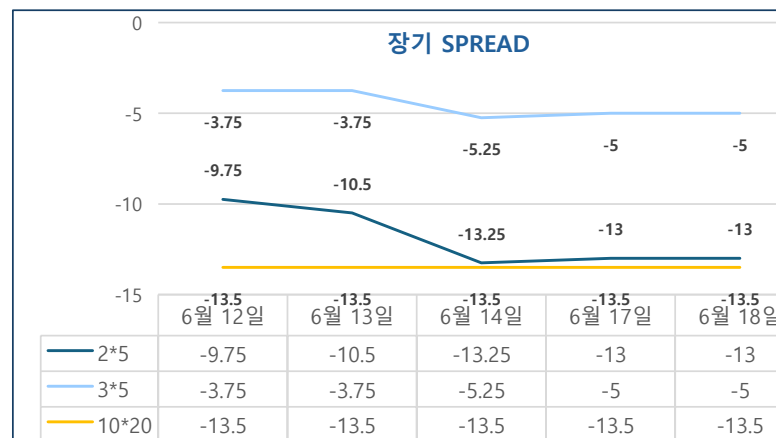
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

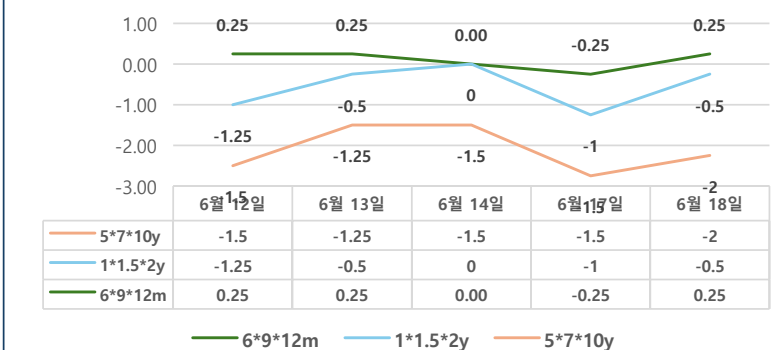


IRS 주요 커브

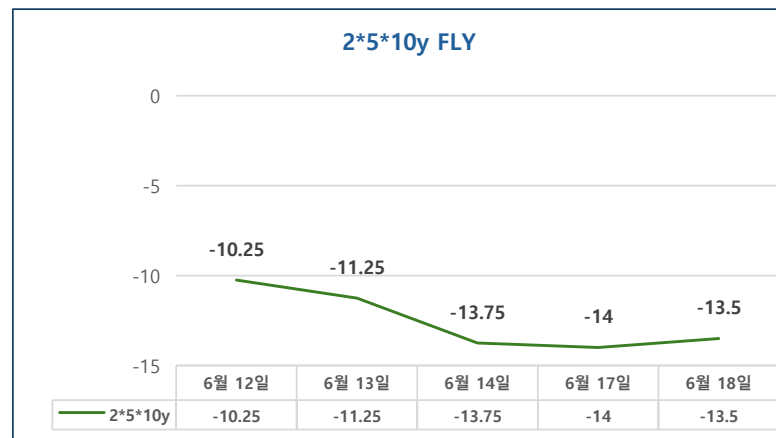
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.00	0.50
1*3y	-22.00	0.50
2*5y	-13.00	0.00
3*5y	-4.00	0.00
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	0.50
1*1.5*2y	-0.50	0.50
2*5*10y	-13.50	0.50
5*7*10y	-2.00	-0.50