

Market Daily Report



2024.06.20(목)

레포	운용사-신탁은 물론 은행권 매수세 유지되어 조달여건 양호했고, 장 초반부터 매도 희망금이 낮게 형성되었음. 회사채 정체 이른시간에 해소됐으며, 오후에 공모주 청약자금 운용되어 일부 저금리 매칭되었음. [공모주 청약] 하이젠알앤앤, 모집 : 2024.06.18(화) ~ 2024.06.19(수) / 환불 : 2024.06.21(금) / 증거금 : 한투증권 7.58조
채권	한국 : 미 국채 분위기를 따른 뒤 외국인인 선물 대규모 대수세를 소화하며 강제 폭 확대하였음. 미국 : '준틴스 데이'로 휴장. 유럽 채권 시장은 적은 거래량 속 국채 금리 소폭 상승함.
MONEY	금일 머니 시장은 달러 휴장으로 한산했으나, 월말 구간에 접어들면서 역외은행들의 만기 도래 자금 수요의 증가로 초단기 자금 t/n, s/n 호가도 5.36-5.40 까지 올라서는 모습. 월말 커버를 위한 2-3주 레벨이 5.55-5.60 사이로 소폭 상승했고, 장기테너는 중국계 6달-1년물 5.70 터치후 추가 상승 시도. 단 한국계 및 포린 네임에 제시는 오퍼 레벨은 1년물 5.50-5.55 사이로 형성중이며, 일부 초이스 상태로 라인 및 리밋 영향에 따라 체결은 제한적임. 최근 머니 시장에서 1년물 통화별 오퍼 레벨은 USD 5.50-5.55, HKD 4.90-5.00, CNH 2.90-3.00, JPY 0.40-0.50 수준으로 제시되고 있음.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 미국 소매 판매 둔화에 따른 미국 금리 하락 등으로 시장 분위기가 우호적으로 변하자 대부분 구간이 상승세를 타며 마감됨. 그간, 미국의 금리 인하 가능성을 키우는 재료에도 에셋 스와프에 스와프포인트가 크게 오르지 않았는데 물량이 상당 부분 소화됐고, 미국의 소매 판매 둔화가 미국 금리를 떨어뜨리면서 스와프 포인트도 반등한 것으로 파악됨.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 19일 미국장 휴장을 앞두고, 한국은행의 기준 금리 인하 시기가 당겨질 것이라는 분위기가 형성되면서 이와 연동되어 움직임. 시장에 5년에서 10년쪽으로 외국인들의 오퍼가 많이 나오는 분위기였으며, 단기쪽으로 호가가 형성되는 모습을 보임. 장 막판에 전체적으로 오퍼가 내려오면서 6개월은 52, 2년은 24.25에 거래가 몇차례 이뤄짐. 장 마감 후 1년 비드가 39.5까지 올라오면서 거래가 이뤄졌으며, 5*10년이 0.25에 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	
2024.06.13(목)	200.4	202.9	3.55%	3.531%	3.500%	3.60%	2년물	4.725%	0
2024.06.14(금)	200.7	203.3	3.50%	3.503%		3.60%	5년물	4.251%	0
2024.06.17(월)	201.5	202.9	3.47%	3.503%		3.60%	10년물	4.227%	0
2024.06.18(화)	202.7	204.0	3.47%	3.506%		3.60%	30년물	4.357%	0
2024.06.19(수)	204.9		3.47%	3.505%		3.60%	10Y-2Y	-49.8	0

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	2,797.33	33.41	24-08-22	재정채	2,350	여전채 3,650	은행채 10,000	
KOSDAQ	861.17	2.22	27-03-10	국고 22-1	1,050	회사채 3,950	여전채 5,600	
달러-원	1,381.80원	0.70원	26-09-10	국고 21-7	1,000	통안채 6,200	회사채 534	
국고3Y	3.162%	-5.2	25-09-10	국고 23-8	-500	공사채 3,800	공사채 1,103	
국고10Y	3.231%	-4.8	28-03-10	국고 23-1	-600			
국고10Y-3Y	6.9	0.4	24-09-03	통안채	-660			

Money Market Closing									
KOREAN/FOREIGN					CHINESE				
기간		증가	전일대비	기간		증가	전일대비	단위: %, %p	
O/N	5.38	5.31	5.35	0.01	O/N	5.37	5.32	5.35	0.00
TN	5.40	5.33	5.36	0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.02
1W	5.46	5.36	5.41	0.00	1W	5.43	5.38	5.41	0.01
1S	5.55	5.45	5.50	0.00	1S	5.67	5.57	5.62	0.02
3S	5.62	5.52	5.57	0.00	3S	5.75	5.65	5.68	0.02
6S	5.65	5.50	5.58	0.01	6S	5.75	5.65	5.68	0.01
1YR	5.61	5.46	5.53	0.00	1YR	5.75	5.65	5.70	0.02

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위: 전, %, %p						단위: 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-	-	-	-	3.50	5.31000	1M MAR	-225	-223
TN	-8/-6	-7	5.32	-0.27	3.50	5.31104	1W*1S	-185	-180
1W	-55/-51	-53	5.48	-0.04	3.50	5.31728	1*2	-230	-220
1S	-250/-230	-240	5.55	0.01	3.53	5.34225	1*3	-495	-485
3S	-750/-720	-735	5.66	-0.01	3.59	5.34741	1*6	-1210	-1180
6S	-1490/-1450	-1470	5.71	-0.01	3.58	5.28331	1*9	-1940	-1920
1YR	-2900/-2840	-2870	5.69	-0.04	3.54	5.06444	1*12	-2610	-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)

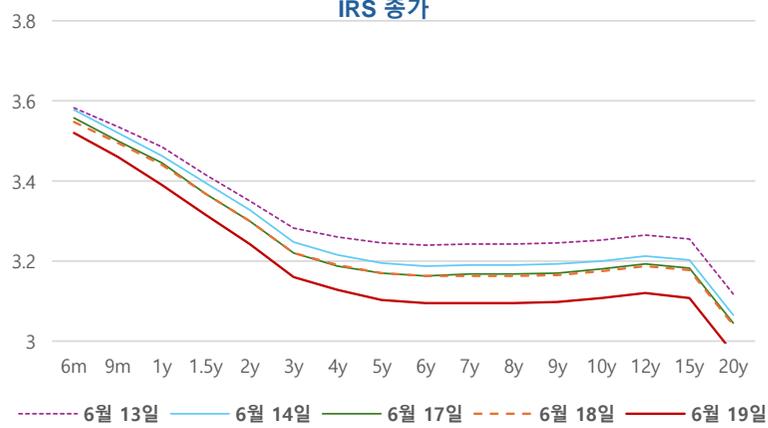
IRS 데일리 증가

6월 19일

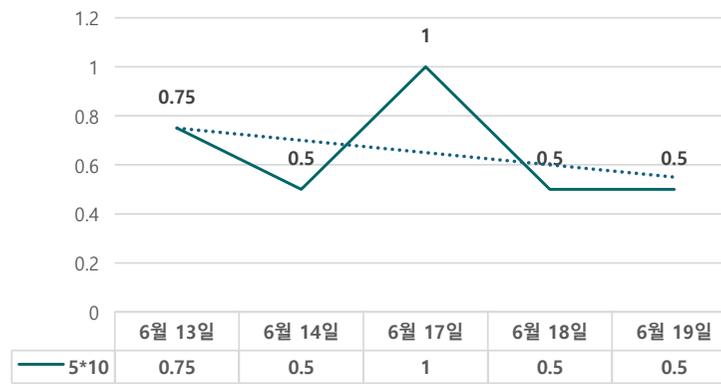
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5200	-2.75
9m	3.4600	-3.50
1y	3.3900	-5.00
1.5y	3.3150	-5.25
2y	3.2425	-5.75
3y	3.1600	-6.00
4y	3.1275	-6.25
5y	3.1025	-6.75
6y	3.0950	-6.75
7y	3.0950	-6.75
8y	3.0950	-6.75
9y	3.0975	-6.75
10y	3.1075	-6.75
12y	3.1200	-6.75
15y	3.1075	-7.00
20y	2.9700	-7.00

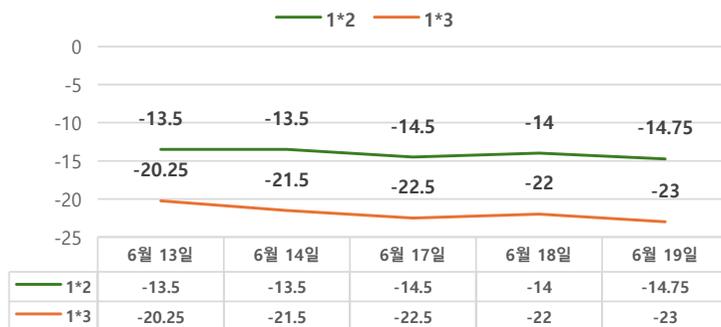
IRS 증가



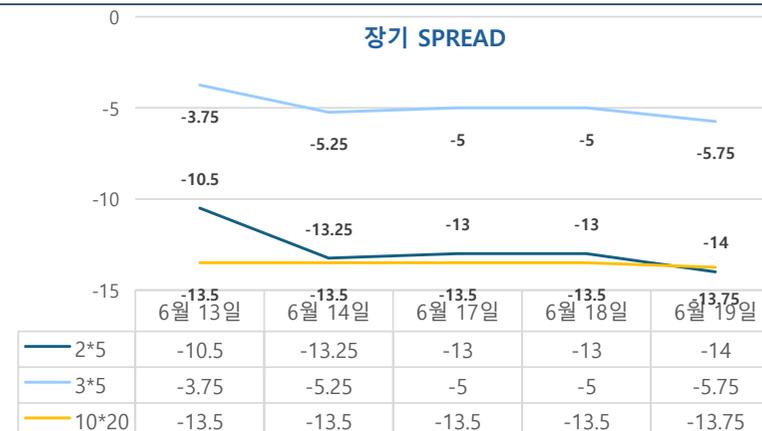
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

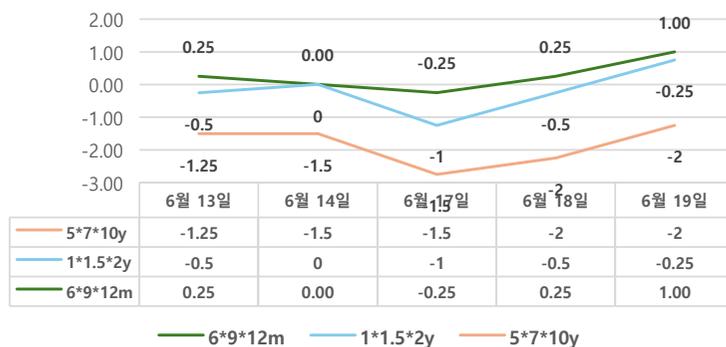


IRS 주요 커브

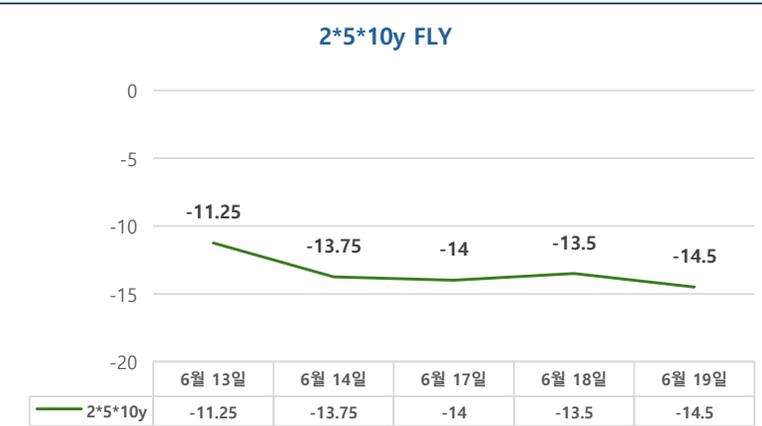
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.75	-0.75
1*3y	-23.00	-1.00
2*5y	-14.00	-1.00
3*5y	-4.00	-0.75
5*10y	0.50	0.00
10*20y	-13.75	-0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	1.00	0.75
1*1.5*2y	-0.25	0.25
2*5*10y	-14.50	-1.00
5*7*10y	-2.00	0.00