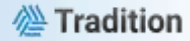


Market Daily Report



2024.06.21(금)

레포	청약자금 유출입 존재하여 금리 소폭 상승 출발한 가운데 시은 조달에 적극적으로 나서 자금 이른시간에 소진되었음. 장 중 은행 및 운용사 추가 자금 유입됐음에도 조달 정체 계속됐으며, 익일물 및 기일물 체결금리 동반 상승하였음. [공모주] 하이젠알앤엠, 모집 : 2024.06.18(화) ~ 2024.06.19(수) / 환불 : 2024.06.21(금) / 증거금 : 한투증권 7.58조 [공모주] 에이치비이엠, 모집 : 2024.06.19(수) ~ 2024.06.20(목) / 환불 : 2024.06.24(월) / 증거금 : NH증권 5.19조
채권	한국 : 글로벌 약세에 비해 강하게 개장한 뒤 장중 약세 폭 확대되었고, 최근 금리 하락 분에 차익실현 심리 형성되었음. 미국 : 미 국채금리는 전 구간 상승 마감. 주간 신규 실업보험 청구자수가 예상보다 더 큰 폭 감소하며 숏 재료로 작용하였음. 이후 5년물 입찰에서 강한 수요 확인되어 낙폭 축소 했지만 지난 주 강세에 비해서 실업보험 청구건수 감소에 시장은 고점 매도 심리 우세하였음.
MONEY	역외 머니 시장은 스왑-1주물이 6월 반기말 커버 구간으로 전환되면서 1-2주 비딩이 강세를 보였고 레벨은 5.55-5.60 까지 레인지 형성. 역외 기존 빅렌더들도 초단기 차입에 조인하면서 장 후반 분위기는 다소 타이트하게 마무리됨. 대조적으로 온쇼 달러 머니 시장은 롱포지션 유지 중, FX 오버나잇 스왑이 -6전까지 올라오면서 포린 네임의 스왑 연계 달러 펀딩 수요도 감소하면서 오버나잇 비드 규모도 작아 레벨은 5.32-5.34 사이로 거래 후 마감.
FX SWAP	외환스와프포인트는 한산한 장세속에 현물환율이 다소 오른것이 반영되어 대체적으로 하락한 모습을 보임. 전일 미국 금융시장이 휴장한 데 따라 시장을 움직일 만한 특별한 재료가 없었던 것으로 보였지만, 환율은 1,380원 중반대로 두 달만에 최고치로 오른 것에 연동함. 조용한 시장 흐름이 이어지며 스와프포인트 자체는 한쪽으로 쓸릴만한 재료가 없었으며 수급에 따른 거래도 이른가 수준에서 거래된 것으로 파악됨.
IRS	전일 IRS는 반등 마감, 미국 국채 금리가 다소 반등하면서 국내 시장에서도 그간의 랠리가 다소 주춤하는 모습을 보이면서 이에 연동되어 움직임. 외국인의 국채선물 시장 움직임을 주시하는 분위기를 땀, 장 막판에 12*15년 오피가 -1.75가 나오면서 초장기쪽 레벨이 움직였으며 1*3년 비드가 -20.25까지 올라오면서 단기쪽 커버도 움직임. 9개월이 47.25-47까지 여러 차례 거래 됐으며, 장 마감 후에는 8*9년이 0.5 레벨에 ND,D로 여러 차례 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
						금리	전일대비		
2024.06.14(금)	200.7	203.3	3.50%	3.503%	3.500%	3.60%	2년물	4.750%	2.5
2024.06.17(월)	201.5	202.9	3.47%	3.503%		3.60%	5년물	4.282%	3.1
2024.06.18(화)	202.7	204.0	3.47%	3.506%		3.60%	10년물	4.266%	3.9
2024.06.19(수)	204.9	204.0	3.47%	3.505%		3.60%	30년물	4.399%	4.2
2024.06.20(목)	211.0		3.48%	3.519%		3.60%	10Y-2Y	-48.4	1.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,807.63	10.30	27-03-10	국고 22-1	1,037	여전채 3,350	은행채 14,100	
KOSDAQ	857.51	-3.66	26-09-10	국고 21-7	1,000	회사채 2,230	여전채 4,700	
달러-원	1,384.70원	2.90원	43-09-10	국고 23-9	637	공사채 2,600	회사채 1,790	
국고3Y	3.196%	3.4	31-06-10	국고 21-5	-500		공사채 3,100	
국고10Y	3.269%	3.8	31-12-10	국고 21-11	-500			
국고10Y-3Y	7.3	0.4	28-03-10	국고 23-1	-1,110			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.34	-0.01	O/N	5.38	5.33	5.36	0.01
TN	5.40	5.33	5.35	-0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.56	5.46	5.51	0.10	1W	5.58	5.48	5.55	0.14
1S	5.55	5.45	5.50	0.00	1S	5.70	5.60	5.65	0.03
3S	5.62	5.52	5.56	-0.01	3S	5.75	5.65	5.68	0.00
6S	5.65	5.50	5.59	0.01	6S	5.75	5.65	5.68	0.00
1YR	5.61	5.46	5.52	-0.01	1YR	5.75	5.65	5.70	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-5	-6	5.06	-0.28	3.50	5.31000	1M MAR	-237	-232
TN	-24/-22	-23	5.49	0.17	3.50	5.31104	1W*1S	-180	-175
1W	-56/-54	-55	5.55	0.07	3.50	5.31728	1*2	-245	-240
1S	-240/-230	-235	5.57	0.02	3.53	5.34225	1*3	-480	-475
3S	-730/-700	-715	5.64	-0.02	3.59	5.34741	1*6	-1190	-1170
6S	-1480/-1440	-1460	5.71	0.00	3.58	5.28331	1*9	-1910	-1890
1YR	-2880/-2840	-2860	5.68	-0.01	3.53	5.06444	1*12	-2590	-2560

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)

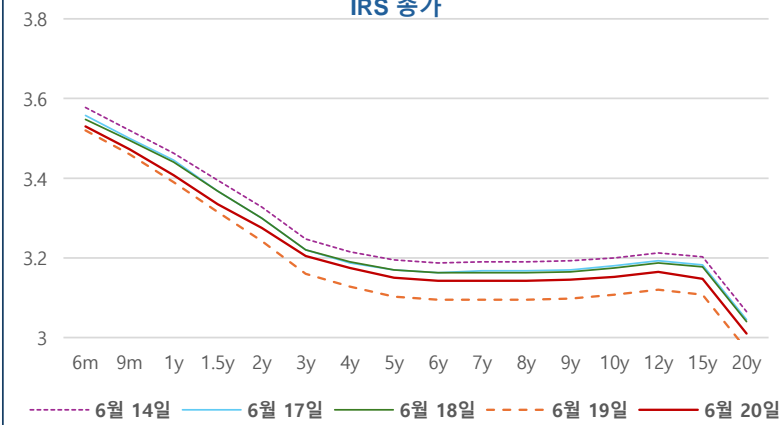
IRS 데일리 증가

6월 20일

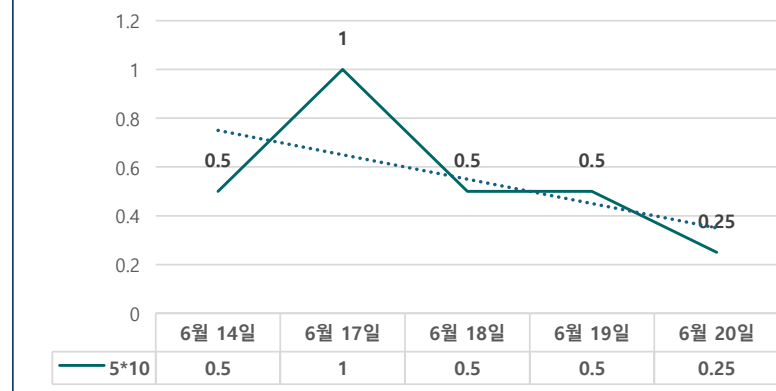
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5300	1.00
9m	3.4725	1.25
1y	3.4075	1.75
1.5y	3.3350	2.00
2y	3.2750	3.25
3y	3.2050	4.50
4y	3.1750	4.75
5y	3.1500	4.75
6y	3.1425	4.75
7y	3.1425	4.75
8y	3.1425	4.75
9y	3.1450	4.75
10y	3.1525	4.50
12y	3.1650	4.50
15y	3.1475	4.00
20y	3.0100	4.00

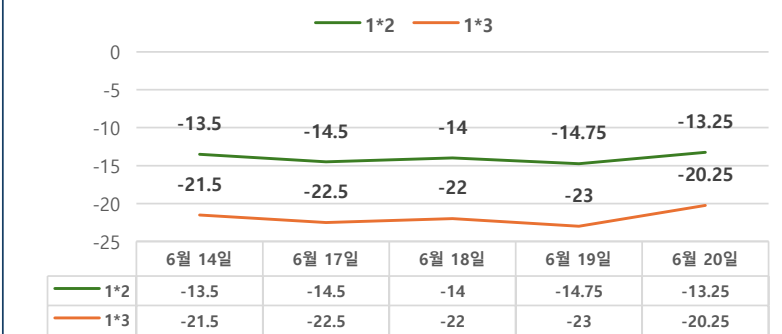
IRS 증가



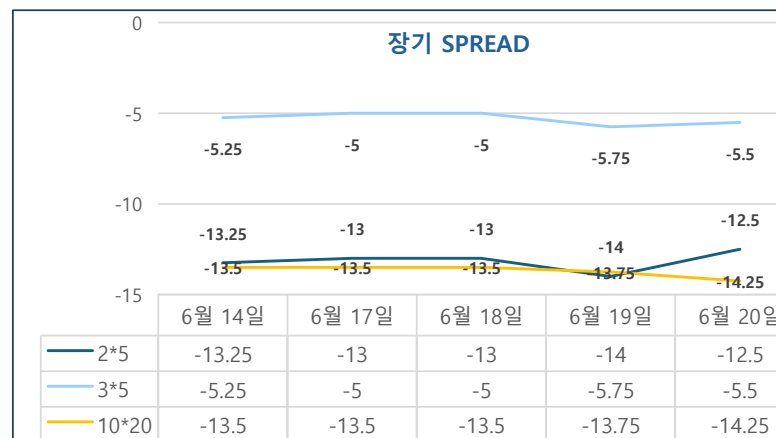
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

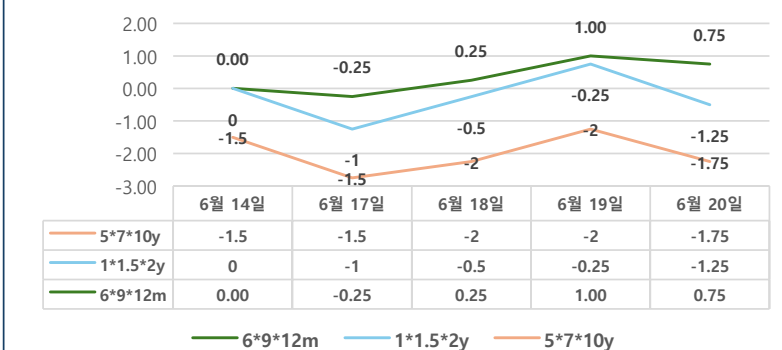


IRS 주요 커브

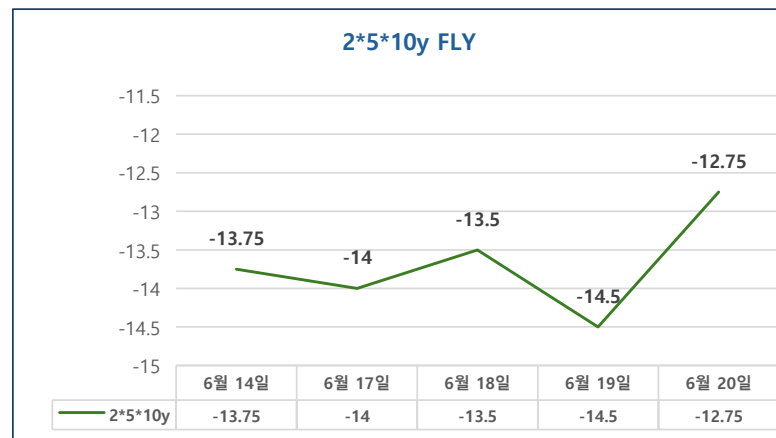
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-13.25	1.50
1*3y	-20.25	2.75
2*5y	-12.50	1.50
3*5y	-4.00	0.25
5*10y	0.25	-0.25
10*20y	-14.25	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.75	-0.25
1*1.5*2y	-1.25	-1.00
2*5*10y	-12.75	1.75
5*7*10y	-1.75	0.25