

Market Daily Report



2024.06.24(월)

레포	전일의 빠듯했던 장세와 청약 환불 등의 요인 반영되어 금리 급등했으며, 은행권 매도 감소한 반면, 운용 규모 크게 증가하였음. 장 중 일반채 해소 원활했으나 회사채 정체는 막판까지 계속되었고, 추가 자금 유입 많지 않아 시은 저금리 조달 쉽지 않았음. [공모주] 에이치비이엠, 모집 : 2024.06.19(수) ~ 2024.06.20(목) / 환불 : 2024.06.24(월) / 증거금 : NH증권 5.19조
채권	한국 : 외국인인 국채선물을 대거 매수해 강세 압력을 가한 데 영향을 받았음. 미국 : 미 국채금리는 30년물 제외 하락하며 혼조 마감. 6월 미국 서비스업 PMI가 예상치를 상회하며 여전히 확장 흐름에 있다는 소식에 투자심리 숨고르기 들어가 국채 금리 소폭 하락하였음. 반면 5월 경기선행지수는 예상을 상회하여 미국 경기에 대한 지표 시그널이 엇갈리면서 미 국채 금리 등락은 제한적이었음.
MONEY	금일 달러 머니 시장은 주말을 앞두고, 한산한 장세 속에 온쇼 초단기물 체결이 주를 이루며, 온쇼 오버나잇 5.32-5.35 수준, 역외는 5.37-5.40 수준으로 체결 되었으며, 월말 커버 2주물도 5.57-5.60에 매칭되며 마감됨. 글로벌 달러 강세 속에 이중 통화 환율도 약세를 보이며, 특히 위안화는 중국 경제 전망에 대한 비관론으로 PBOC가 환율 방어에 나서고 있는 상황. 과거에는 환율 영향으로 역외 위안화 단기 금리의 변동성이 컸으나, 최근 인민은행이 환율 방어 및 위안화 단기 유동성을 관리하고 있어, 역외 위안화 금리는 CNH o/n 1.50-1.80, 1s 2.30-2.60 3s 2.50-2.80 6s 2.70-3.00 수준으로 형성되며 월말 구간임에도 변동성은 제한적임.
FX SWAP	외환스와프포인트는 미국채 금리가 오르고 에셋스와프 물량이 유입된 영향으로 전 테너 구간에서 하락한 모습을 보임. 전일 미국의 실업보험 청구자 수가 크게 줄었다는 소식에 금리 인하 기대감이 후퇴했고 미국채 금리가 상승한 것에 연동했으며, 이에 장중에는 에셋스와프가 나와 매도가 많았던 것으로 파악됨. 한편 초단기쪽으로는 전일 RP 매각소식이 들렸지만 원화 유동성이 풍부한 영향으로 스와프 레벨 상승이 제한되었음.
IRS	전일 IRS는 짧은 반등 이후 재차 하락 마감함. 미국 주택지표가 둔화해 국채선물 시장에서 외국인의 적극적인 매수가 다시 이어지면서 금리 인하에 베풀하는 분위기가 지속됨에 따라 이에 연동되어 움직이는 분위기. 1년쪽으로 호가가 형성되면서 39-38.5까지 거래됐으며, 5*7*10년이 -1.75에 거래되면서 커브가 움직임. 장 막판에는 2년 오피가 23.5까지 내려오고, 3*5년 비드가 -4.75까지 올라오는 모습을 보임. 이후에는 3년 오피가 16.75까지 내려오면서 거래가 몇차례 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비
2024.06.17(월)	201.5	202.9	3.47%	3.503%	3.500%	2년물	4.741%	-0.9
2024.06.18(화)	202.7	204.0	3.47%	3.506%		5년물	4.280%	-0.2
2024.06.19(수)	204.9	204.0	3.47%	3.505%		10년물	4.261%	-0.5
2024.06.20(목)	211.0	199.8	3.48%	3.519%		30년물	4.400%	0.1
2024.06.21(금)	205.2		3.57%	3.560%		10Y-2Y	-48	0.4

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,784.26	-23.37	25-09-10	국고 23-8	1,000	여전채 2,700	여전채 5,000	국고채 5년 23,000
KOSDAQ	852.67	-4.84	27-12-10	국고 17-7	1,000	회사채 185	공사채 4,033	통안채 91일 6,000
달러-원	1,388.30원	3.60원	54-03-10	국고 24-2	600			
국고3Y	3.176%	-2	27-03-10	국고 22-1	-3			
국고10Y	3.255%	-1.4	49-03-10	국고 19-2	-10			
국고10Y-3Y	7.9	0.6	28-03-10	국고 23-1	-750			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	0.01	O/N	5.38	5.33	5.36	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	0.01	TN	5.40	5.35	5.38	0.00
1W	5.55	5.45	5.50	-0.01	1W	5.60	5.50	5.57	0.02
1S	5.55	5.45	5.50	0.00	1S	5.70	5.60	5.65	0.00
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.75	5.65	5.68	0.00
6S	5.67	5.52	5.60	0.01	6S	5.75	5.65	5.68	0.00
1YR	5.60	5.45	5.52	0.00	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	-23/-21	-22	5.40	0.34	3.50	5.31000	1M MAR	-235	-232
TN	-8/-6	-7	5.31	-0.18	3.50	5.31112	1W*1S	-180	-175
1W	-56/-54	-55	5.54	-0.01	3.50	5.31785	1*2	-250	-240
1S	-240/-230	-235	5.57	0.00	3.53	5.34364	1*3	-480	-471
3S	-740/-710	-725	5.67	0.03	3.59	5.34746	1*6	-1230	-1205
6S	-1500/-1440	-1480	5.73	0.01	3.58	5.27772	1*9	-1940	-1920
1YR	-2920/-2860	-2890	5.71	0.02	3.53	5.04675	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)

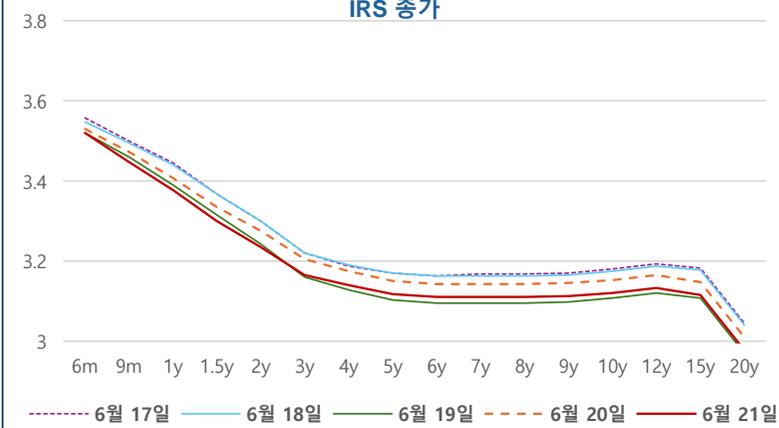
IRS 데일리 증가

6월 21일

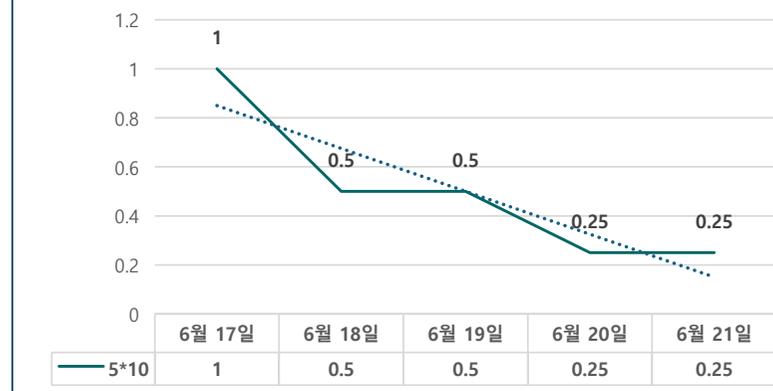
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5200	-1.00
9m	3.4475	-2.50
1y	3.3775	-3.00
1.5y	3.3000	-3.50
2y	3.2350	-4.00
3y	3.1650	-4.00
4y	3.1400	-3.50
5y	3.1175	-3.25
6y	3.1100	-3.25
7y	3.1100	-3.25
8y	3.1100	-3.25
9y	3.1125	-3.25
10y	3.1200	-3.25
12y	3.1325	-3.25
15y	3.1150	-3.25
20y	2.9775	-3.25

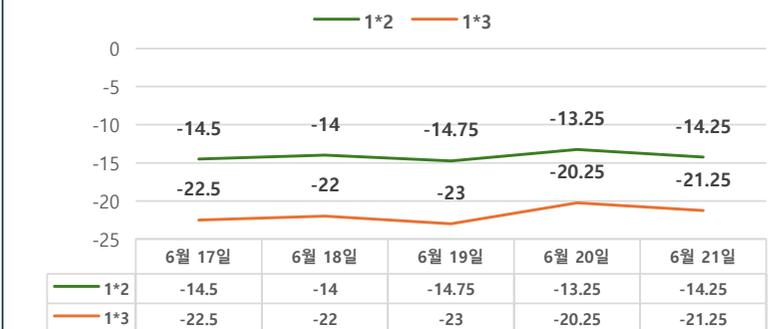
IRS 증가



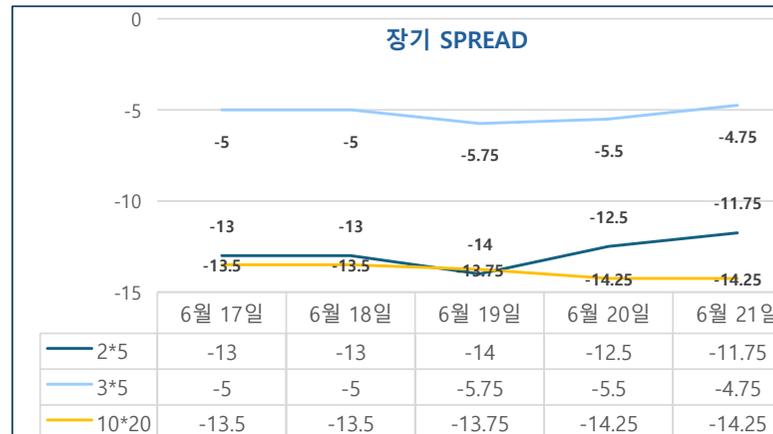
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

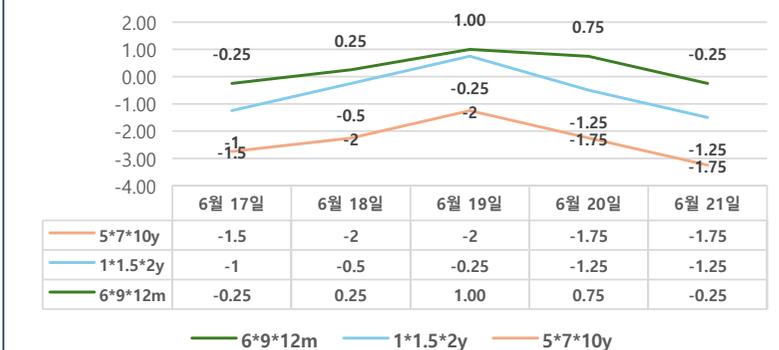


IRS 주요 커브

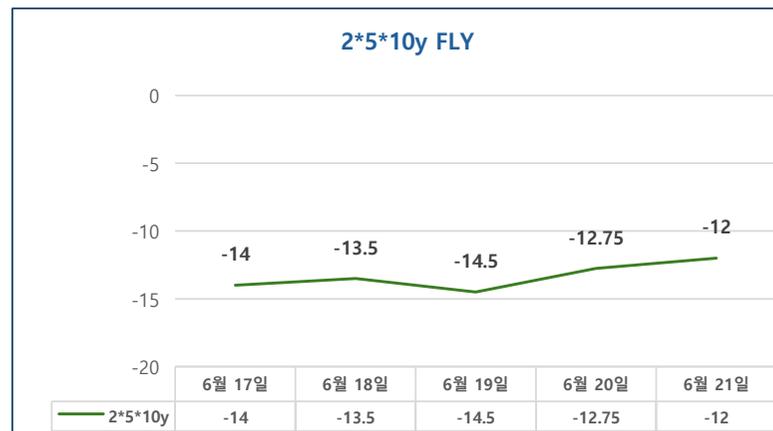
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.25	-1.00
1*3y	-21.25	-1.00
2*5y	-11.75	0.75
3*5y	-4.00	0.75
5*10y	0.25	0.00
10*20y	-14.25	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	-1.00
1*1.5*2y	-1.25	0.00
2*5*10y	-12.00	0.75
5*7*10y	-1.75	0.00