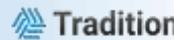


Market Daily Report

2024.06.25(화)



레포	공모주 청약자금 운용 기대되어 금리 소폭 하락 출발했으며, 은행권 매수 꾸준하여 조달여건 양호했음. 시는 콜금리 수준 매도 대기했으나 장 중 금리 낙폭 크지 않아 매칭 제한적이었고, 회사채 정채 완화되었음. [공모주] 에이치비이엠, 모집 : 2024.06.19(수) ~ 2024.06.20(목) / 환불 : 2024.06.24(월) / 증거금 : NH증권 5.19조 [공모주] 이노스페이스, 모집 : 2024.06.20(목) ~ 2024.06.21(금) / 환불 : 2024.06.25(화) / 증거금 : 미래증권 7.96조, 신한증권 3,281억
채권	한국 : 외국인이 매수세를 이어갔으나 최근 낙폭이 과도했던 판단에 조정 압력이 커진데 영향을 받았음. 미국 : 미 국제금리는 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 국제 금리 등락은 제한적이었음.
MONEY	금일 머니 시장은 6월 마지막주 반기 마감을 앞두고, 단기 자금 위주로 호가 형성 및 체결되었음. 역외 국내임 (싱가폴계) 홍콩 센터의 파격적인 T/N 비드 5.48 레벨 등장으로 금주 월말 마감을 앞두고 다소 긴장되는 모습. 우선, 중국계 은행들의 오버나잇은 5.35-5.36 수준으로 안정적인 레벨로 형성중이나, 월말 커버 물량의 증가로 중국계 홍콩 센터들의 비딩이 본격화 되면서 레벨 상승세 이끌어 1주 5.70 까지 일부 터치 후 5.60-5.63 레벨에 수렴하는 모습. 서울 온소 마켓은 월말 구간으로 자금 인출 및 포지션 변동 예상으로 운용 자재 분위기가 지속된 가운데, 오버나잇 차입 규모는 크지 않아 5.33-5.35 수준으로 정리되고 마무리. 최근 엔화 약세로 달러/엔 환율이 160을 목전에 두고, 역외에서는 달러 직접 차입이 용이 하지 않자, 대신 달러/엔 스왑 연계로 엔화를 차입해서 달러 편입 하는 차입 비용 감소 효과를 기대하며 엔화 차입 수요가 일부 늘어나고 있음.
FX SWAP	금일 외환스와프포인트는 지난 거래일 하락분을 대부분 되돌리는 분위기였으며, 미국의 PCE 물가가 시장의 예상보다 낮게 나올 수 있다는 낙관적 분위기를 반영하며 기간을 위주로 오름세를 보임. 시장 참가자들은 일찌감치 주 후반 발표될 미국의 5월 개인소비지출(PCE) 물가지표 대기 모드에 들어갔으며, 지난 금요일 거래에서 10전 이상씩 빠진 부분이 다시 올라온 것으로 파악됨. 주 후반에 나올 예정이기는 하지만 PCE 물가가 둔화할 것으로 예상하는 분위기라 스와프포인트가 상승압력이 있었던 것으로 판단됨.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 특별한 이슈는 없었고 현물예에 따라서 연동되어 움직였으며, 막판에 단기쪽으로 오퍼가 시장에 나오는 모습을 보임.전체적으로 거래가 많지 않은 분위기였으며, 장중 2년쪽으로 비드가 소폭 올라오면서 24.75에 거래되고, 장 막판에 6개월이 53/52.5에 대체됐으며, 5년쪽으로 호가가 형성되면서 14.75에 거래가 이뤄짐. 장 마감 이후에는 미국채와 연동되어 5년이 15/14.75까지 대체를 이룸.

단기자금시장						전일 미국 국제 금리				
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	한국시간 오전 07:05 기준		단위 : bp	
							금리	전일대비		
2024.06.18(화)	202.7	204.0	3.47%	3.506%	3.500%	3.60%	2년물	4.734%	-0.7	
2024.06.19(수)	204.9	204.0	3.47%	3.505%		3.60%	5년물	4.262%	-1.8	
2024.06.20(목)	211.0	199.8	3.48%	3.519%		3.60%	10년물	4.237%	-2.4	
2024.06.21(금)	205.2	198.5	3.57%	3.560%		3.60%	30년물	4.367%	-3.3	
2024.06.24(월)	207.8		3.55%	3.554%		3.60%	10Y-2Y	-49.7	-1.7	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,764.73	-19.53	52.03.10	국고 22-2	498	여전채 3,000	지방채 46	국고채 20년 7,000
KOSDAQ	841.52	-11.15	54.03.10	국고 24-2	469	회사채 7,100	은행채 9,600	
달러-원	1,389.00원	0.70원	33.03.10	국고 23-5	270	통안채 5,900	여전채 2,200	
국고3Y	3.194%	1.8	27.06.10	국고 17-3	-779	공사채 18,001	회사채 1,700	
국고10Y	3.264%	0.9	28.06.10	국고 18-4	-999		통안채 5,100	
국고10Y-3Y	7	-0.9	28.12.10	국고 18-10	-1,418		공사채 3,361	

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	0.00	O/N	5.38	5.32	5.35	-0.01
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.38	5.33	5.36	-0.02
1W	5.56	5.46	5.51	0.01	1W	5.70	5.55	5.62	0.05
1S	5.56	5.46	5.51	0.01	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	0.00	6S	5.75	5.65	5.68	0.00
1YR	5.60	5.45	5.52	0.00	1YR	5.75	5.65	5.69	-0.01

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-7	-8	5.57	0.17	3.50	5.31000	1M MAR	-241	-240
TN	-9/-7	-8	5.57	0.26	3.50	5.31117	1W*1S	-179	-170
1W	-57/-53	-55	5.54	0.00	3.50	5.31822	1*2	-242	-235
1S	-240/-220	-230	5.54	-0.04	3.54	5.34523	1*3	-480	-475
3S	-740/-700	-720	5.64	-0.02	3.59	5.34455	1*6	-1215	-1195
6S	-1500/-1420	-1460	5.71	-0.02	3.58	5.27558	1*9	-1930	-1910
1YR	-2920/-2820	-2870	5.66	-0.05	3.51	5.05165	1*12	-2600	-2580

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)

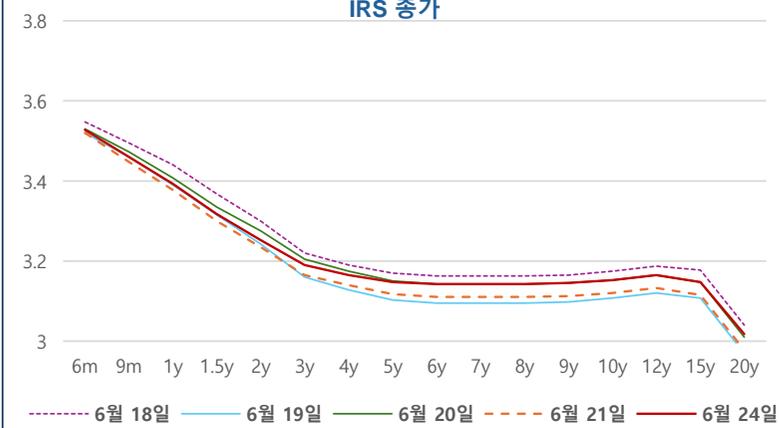
IRS 데일리 증가

6월 24일

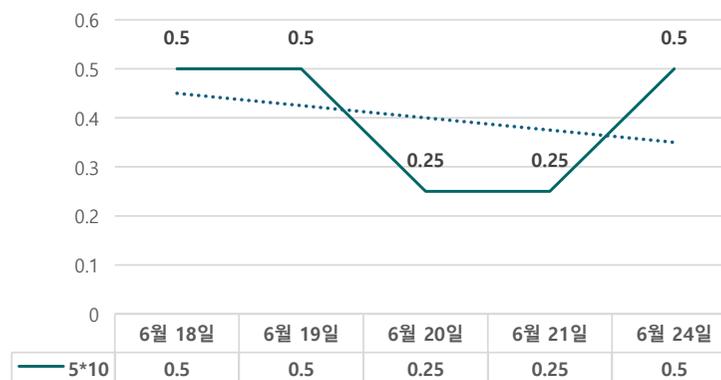
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5275	0.75
9m	3.4600	1.25
1y	3.3925	1.50
1.5y	3.3175	1.75
2y	3.2525	1.75
3y	3.1900	2.50
4y	3.1650	2.50
5y	3.1475	3.00
6y	3.1425	3.25
7y	3.1425	3.25
8y	3.1425	3.25
9y	3.1450	3.25
10y	3.1525	3.25
12y	3.1650	3.25
15y	3.1475	3.25
20y	3.0175	4.00

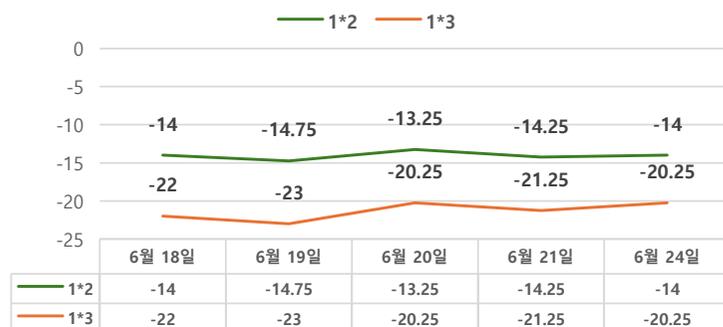
IRS 증가



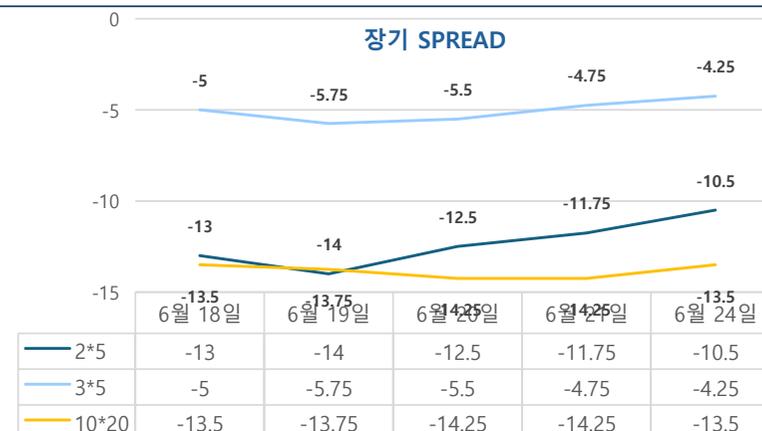
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

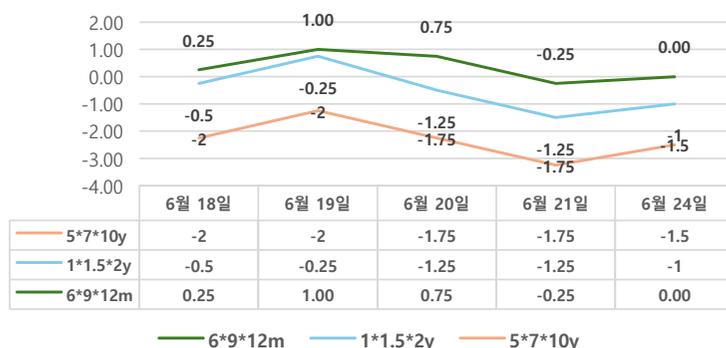


IRS 주요 커브

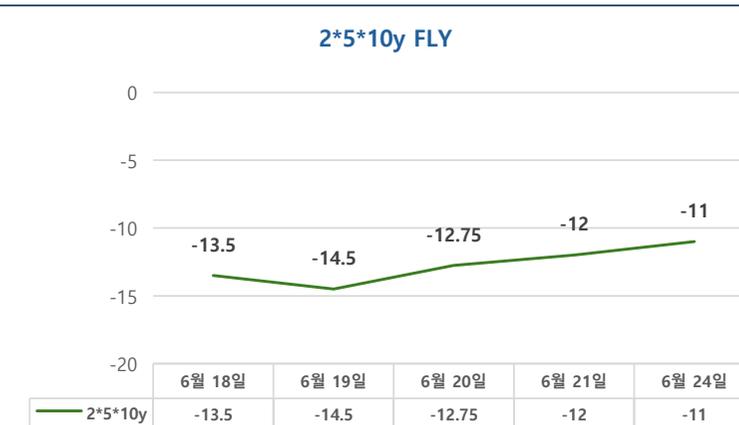
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.00	0.25
1*3y	-20.25	1.00
2*5y	-10.50	1.25
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	0.50	0.25
10*20y	-13.50	0.75

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.25
1*1.5*2y	-1.00	0.25
2*5*10y	-11.00	1.00
5*7*10y	-1.50	0.25