

# Market Daily Report



2024.06.26(수)

<b>레포</b>	청약 환불(이노스페이스) 및 공자기금 유입 혼재했으나 장 초반부터 은행권 운용에 적극적으로 나서 수급 무난하였음. 신규 청약(하스) 관련 추가 조달수요 발생하여 장 중 금리 낮아지지 못했으며, 분기말 대비 기일물 수요 증가하였음. [공모주] 이노스페이스, 모집 : 2024.06.20(목) ~ 2024.06.21(금) / 환불 : 2024.06.25(화) / 증거금 : 미래증권 7.96조, 신한증권 3,281억 [공모주] 하스, 모집 : 2024.06.24(월) ~ 2024.06.25(화) / 환불 : 2024.06.27(목) / 증거금 : 삼성증권 7.7조
<b>채권</b>	한국 : 장중 재료가 부재한 가운데 수급에 따라 제한적인 변동폭을 보였음. 외인 국채 선물 매수세 이어갔지만 영향은 크지 않았음. 미국 : 미 국채금리는 상승 마감. 5월 시카고 연준 전미활동지수가 0.18로 발표되며 3개월만의 경기 확장 국면으로 돌아선 점과 미셀 보먼 연준 이사의 "아직 금리인하가 적절한 시점이 아니다."라는 매파적 발언으로 국채 금리 상승.
<b>MONEY</b>	금일 달러 머니 시장은 어제 급등세를 보였던 월말 커버 1주-1개월물 레벨이 진정되었음. 장 시작하자마자 중국 본토 Big 렌더들의 오피 공세로 1주 -1개월물 5.60-5.63 수준으로 제시 되면서 오피 우위의 장세 속에 월말 커버 자금 수요가 어느정도 진정 국면에 들어서고 있음. 서울 마켓에서도 2주-2개월물까지 온소 렌더의 굿사이즈 오피 제시로 네임별로 기간물 체결 소식 전해지며 레벨 추가 급등세 없이 순조롭게 마감 예상. 금일 FX 오버나잇 -1주물 스왑이 장중 하락세 보이며 달러 환산 금리가 소폭 상승하자 포린 서울 오버나잇 비드 물량이 일부 증가 했으나, 온소 초단기 자금은 여유 있어 레벨은 5.32-5.36 수준으로 체결 되며 마무리됨.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 대부분 기간물이 보합세를 나타냈고, 초단기물은 무거운 흐름을 보이며 하락함. 이번주 발표되는 미국의 개인소비지출(PCE) 물가를 앞둔 방향성 탐색 장세 속에 변동성도 제한되는 모습이었으며, 실수급 외에는 거래가 많지 않은 분위기였음. 한편 초단기 쪽은 이론가 아래에서 계속 거래됐는데, 반기말일이 가까워지면서 단기자금을 맞추려는 오피가 많았던 것으로 파악됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 보합권에서 혼조세 마감.국내외에서 특별한 재료가 없는 가운데 주말 발표될 미국의 경제 지표 등을 대기하는 분위기를 보임. 8월 한은의 금리 인하에 대한 시장의 기대가 다소 과하다면서, 최근의 강세의 되돌림의 모습도 나올 수 있다는 분석.전체적으로 단기쪽으로 호가가 많이 형성되는 분위기였으며, 6개월 오피가 타이니로 나오면서 52.25/52.5로 잠시 리버스가 됐다 52.5에 거래가 이뤄짐.장 막판에 9개월이 46.5-47 레벨로 몇차례 거래가 이뤄졌으며, 장 막판에는 1.5년 비드가 올라오면서 32.25에 거래가 이뤄짐. 장 마감 후에 4*7년이 -2.25에 D/ND로 초이스까지 이뤄지다 거래됐으며, 1.5년은 32.5까지 거래됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.06.19(수)	204.9	204.0	3.47%	3.505%	3.500%	3.60%	2년물	4.755%	2.1
2024.06.20(목)	211.0	199.8	3.48%	3.519%		3.60%	5년물	4.283%	2.1
2024.06.21(금)	205.2	198.5	3.57%	3.560%		3.60%	10년물	4.252%	1.5
2024.06.24(월)	207.8	198.3	3.55%	3.554%		3.60%	30년물	4.380%	1.3
2024.06.25(화)	207.4		3.57%	3.757%		3.60%	10Y-2Y	-50.3	-0.6

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,774.39	9.66	27.06.10	국고 24-4	2,000	은행채 7,000	지방채 697	통안채 3년물 3,000 모집
KOSDAQ	841.99	0.47	52.03.10	국고 22-2	900	여전채 1,350	은행채 3,500	통안채 2년물 4,000 모집
달러-원	1,387.50원	-1.50원	54.03.10	국고 24-2	880	회사채 7,031	여전채 1,650	재정증권 63일물 2.00조
국고3Y	3.201%	0.7	28.03.10	국고 23-1	-600		회사채 3,350	
국고10Y	3.271%	0.7	33.06.10	국고 23-5	-651		공사채 1,260	
국고10Y-3Y	7	0	28.06.10	국고 18-4	-1,000			

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	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.40	5.33	5.36	0.00
1W	5.57	5.47	5.52	0.01	1W	5.65	5.55	5.60	-0.02
1S	5.57	5.47	5.52	0.01	1S	5.67	5.57	5.62	-0.03
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.75	5.65	5.68	0.00
6S	5.68	5.53	5.61	0.01	6S	5.75	5.65	5.69	0.01
1YR	5.60	5.45	5.53	0.01	1YR	5.75	5.65	5.70	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	0.00	3.50	5.31000	1M MAR	-240	-235
TN	-9/-7	-8	5.57	0.00	3.50	5.31109	1W*1S	-180	-175
1W	-66/-62	-64	5.58	0.04	3.50	5.31766	1*2	-230	-220
1S	-260/-230	-245	5.54	0.00	3.54	5.34500	1*3	-470	-460
3S	-730/700	-715	5.63	-0.01	3.59	5.34056	1*6	-1185	-1180
6S	-1500/-1420	-1460	5.71	0.01	3.58	5.27136	1*9	-1895	-1885
1YR	-2920/-2820	-2870	5.66	0.00	3.51	5.04462	1*12	-2580	-2560

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
<b>지준일</b>	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)

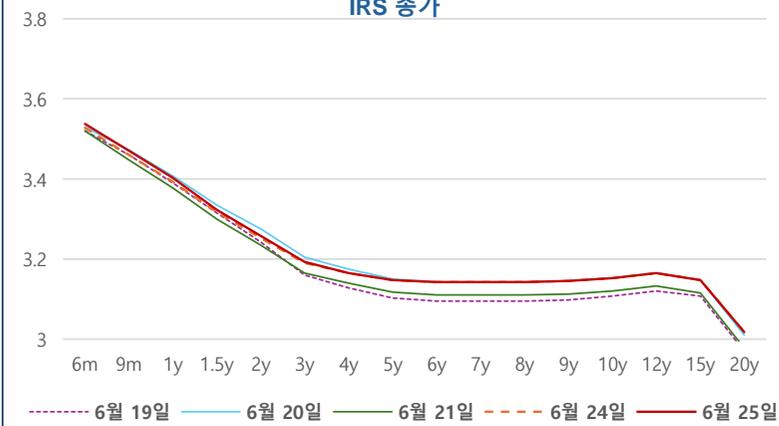
IRS 데일리 증가

6월 25일

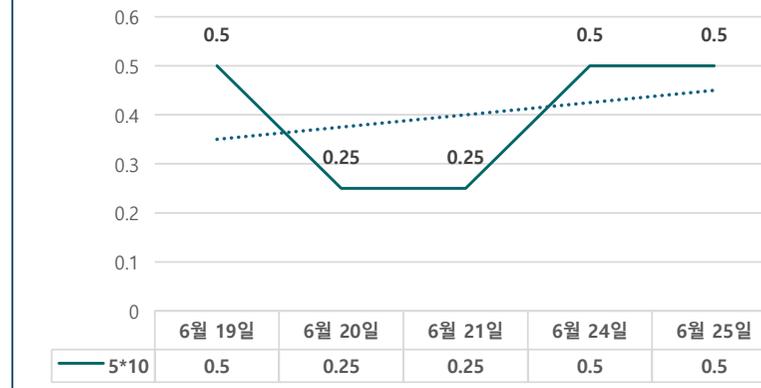
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5375	1.00
9m	3.4700	1.00
1y	3.4025	1.00
1.5y	3.3225	0.50
2y	3.2575	0.50
3y	3.1925	0.25
4y	3.1650	0.00
5y	3.1475	0.00
6y	3.1425	0.00
7y	3.1425	0.00
8y	3.1425	0.00
9y	3.1450	0.00
10y	3.1525	0.00
12y	3.1650	0.00
15y	3.1475	0.00
20y	3.0175	0.00

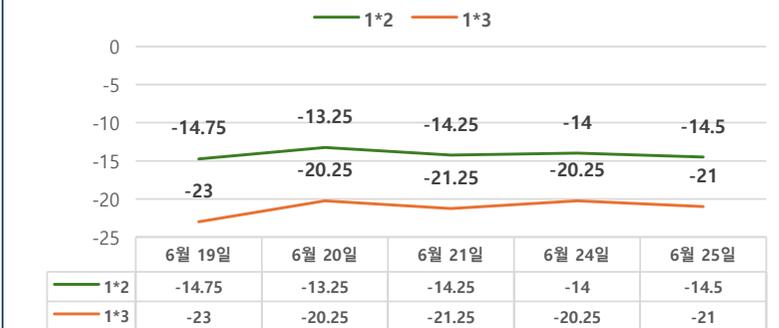
IRS 증가



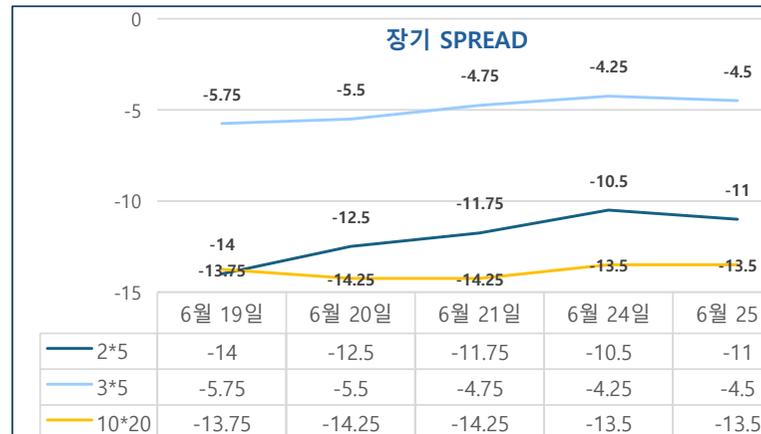
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

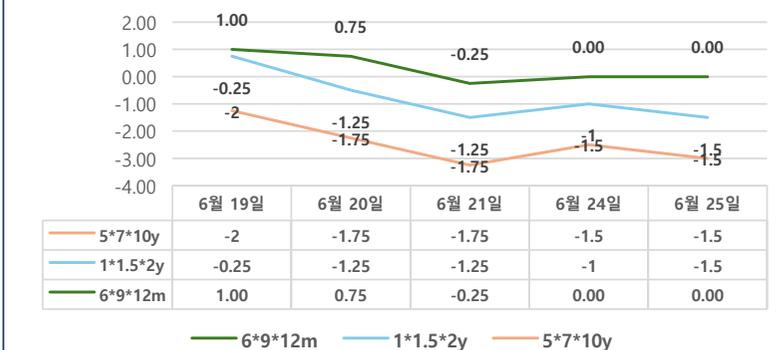


IRS 주요 커브

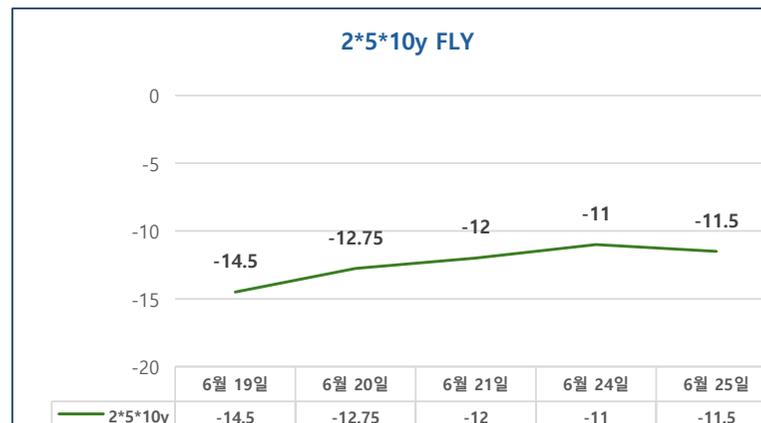
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.50	-0.50
1*3y	-21.00	-0.75
2*5y	-11.00	-0.50
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	0.50	0.00
10*20y	-13.50	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	0.00
1*1.5*2y	-1.50	-0.50
2*5*10y	-11.50	-0.50
5*7*10y	-1.50	0.00