

Market Daily Report

2024.06.27(목)



레포	공모주(하스) 청약자금 운용 기대되어 금리 소폭 하락 출발했으며, 은행권 매수세 유지되어 조달여건 양호했음. 장 중 금리 낙폭 크지 않아 시은 저금리 거래 제한적이었던 반면, 분기말 대비 기일을 거래 활발하였음. [공모주] 하스, 모집 : 2024.06.24(월) ~ 2024.06.25(화) / 환불 : 2024.06.27(목) / 증거금 : 삼성증권 7.7조
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 호주 5월 CPI가 컨센서스를 상회하며 시장 악세를 이끌었으며, 이후 외국인 투자자 동향에 따라 움직이며 커브 플레트닝 발생함. 미국 : 미 국채금리는 상승 마감. 주요 지표 발표가 없던 가운데 분기말을 맞아 6월 국채 금리 하락폭에 대한 청산 수요와 호주 CPI의 컨센서스 상회의 영향으로 중장기 물 중심으로 금리 상승폭이 확대됨.
MONEY	달러 머니 시장은 6월말 마감이 거의 마무리 되고 있는 시점에 역외 오픈 공세가 이어지면서 1주-1개월물은 오퍼가 대기중으로 레벨은 전일비 소폭 하락세를 보였고, 7월초 시작 기간물 운용 인트가 시작되면서 그동안 반기말 커버 구간에 대한 프리미엄이 감안된 스팟-1개월물과 7월초 스타트 1개월물 레벨은 10-15bp 가량 레벨차를 보이고 있음. FX 스왑이 반기말 달러 수요에 테너별로 하락세를 보였다는 보도가 있었지만, 온쇼 시은 자금 부족분은 발생하지 않은 상태라 이는 온쇼 월말 마감 달러 자금 부족이라기 보다는 스왑으로 매칭 시킬 포지션이었을 것으로 파악.
FX SWAP	외환 스와프포인트는 반기말일임에 따라 달러 수요가 물리면서 큰 하락세를 보였으며, 1년 만기는 전장보다 -60전 내린 -2930전, 6개월물은 -40전 내린 -1500전에 마감됨. 증가를 기준으로 충분히 최하단까지 내려온 상황으로 보이며, 이는 외인 재정거래가 유입될 만한 레벨로 향후 스와프는 하방보다는 상방 우위일 것으로 예상됨.
IRS	전일 IRS는 호주 물가 상승에 대한 우려로 상승 마감, 다만 국내 금리 인하에 대한 기대감은 여전히 분위기를 보임. 전체적으로 초단기쪽으로 호가가 많이 형성되는 모습을 보였으며, 9개월이 48-47.5에 몇차례 거래됨. 1년으로도 꾸준히 비드가 나오면서 41.5-41.75에 거래가 이뤄짐. 장 막판에는 4년이 3*5년 비드가 -4까지 올라오고, 10년이 15.75 오퍼가 나오면서 커브 레벨이 움직였으며, 1년이 9*12개월 레깅으로 41.25거래 후 41.5까지 비드가 올라옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
						단위 : bp			
2024.06.20(목)	211.0	199.8	3.48%	3.519%	3.500%	3.60%	2년물	4.758%	0.3
2024.06.21(금)	205.2	198.5	3.57%	3.560%		3.60%	5년물	4.350%	6.7
2024.06.24(월)	207.8	198.3	3.55%	3.554%		3.60%	10년물	4.334%	8.2
2024.06.25(화)	207.4	195.7	3.57%	3.757%		3.60%	30년물	4.465%	8.5
2024.06.26(수)	212.8		3.55%	3.552%		3.60%	10Y-2Y	-42.4	7.9

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	2,792.05	17.66	24.08.29	재정채	4,880	은행채 2,200	은행채 10,300	
KOSDAQ	842.12	0.13	25.07.02	통안채	1,200	여전채 1,550	여전채 870	
달러-원	1,388.70원	1.20원	27.06.10	국고 24-4	1,001	회사채 2,835	회사채 8,680	
국고3Y	3.215%	1.4	25.03.10	국고 23-3	-500	공사채 2,700	공사채 1,000	
국고10Y	3.278%	0.7	30.12.10	국고 20-9	-1,029			
국고10Y-3Y	6.3	-0.7	28.06.10	국고 18-4	-2,691			

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		전일대비
단위 : % , %p								
O/N	5.38	5.31	5.35	0.00	O/N	5.36	5.32	-0.01
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.38	5.33	-0.01
1W	5.58	5.48	5.53	0.01	1W	5.63	5.53	0.00
1S	5.58	5.48	5.53	0.01	1S	5.67	5.57	0.00
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.73	5.63	0.00
6S	5.69	5.54	5.62	0.01	6S	5.73	5.63	0.00
1YR	5.60	5.45	5.53	0.00	1YR	5.73	5.63	-0.01

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
단위 : 전, %, %p						단위 : 전			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-6	-7	5.31	-0.26	3.50	5.31000	1M MAR	-237	-233
TN	-9/-7	-8	5.57	0.00	3.50	5.31109	1W*1S	-197	-192
1W	-62/-54	-58	5.65	0.07	3.50	5.31762	1*2	-235	-225
1S	-265/-245	-255	5.56	0.02	3.54	5.34594	1*3	-485	-475
3S	-760/-730	-745	5.68	0.05	3.59	5.33939	1*6	-1220	-1210
6S	-1550/1450	-1500	5.73	0.02	3.58	5.26830	1*9	-1950	-1935
1YR	-2980/2880	-2930	5.70	0.04	3.51	5.04090	1*12	-2620	-2600

국내의 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)

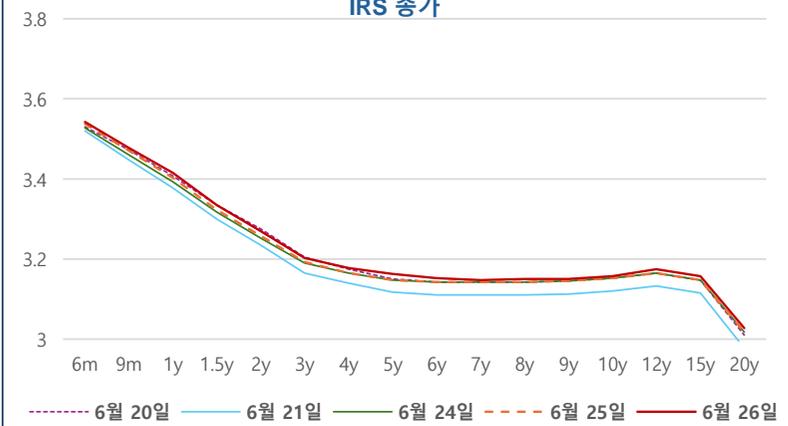
IRS 데일리 증가

6월 26일

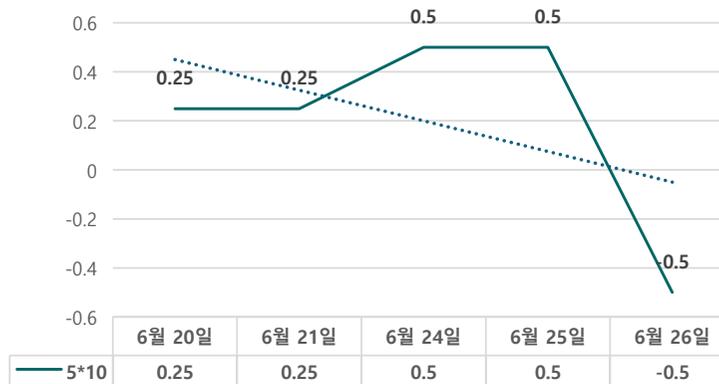
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5425	0.50
9m	3.4775	0.75
1y	3.4150	1.25
1.5y	3.3350	1.25
2y	3.2700	1.25
3y	3.2025	1.00
4y	3.1775	1.25
5y	3.1625	1.50
6y	3.1525	1.00
7y	3.1475	0.50
8y	3.1500	0.75
9y	3.1500	0.50
10y	3.1575	0.50
12y	3.1750	1.00
15y	3.1575	1.00
20y	3.0275	1.00

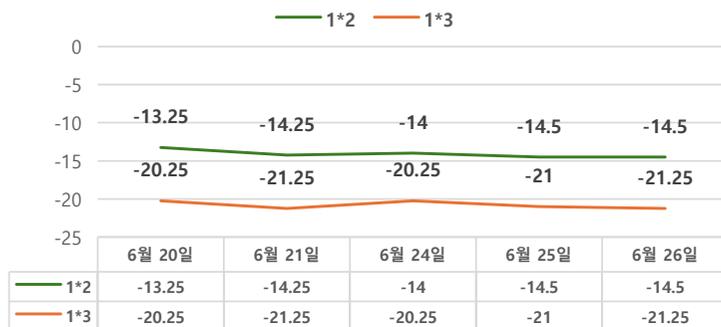
IRS 증가



5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

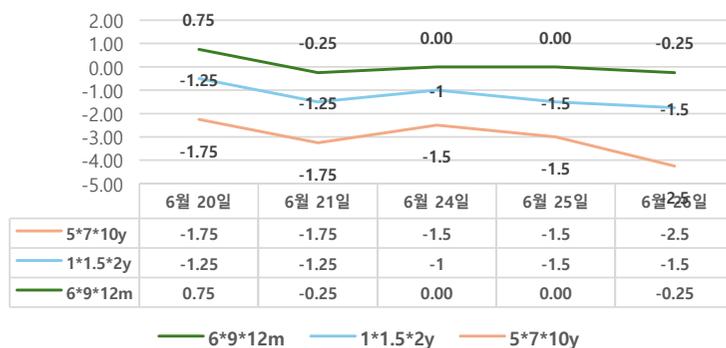


IRS 주요 커브

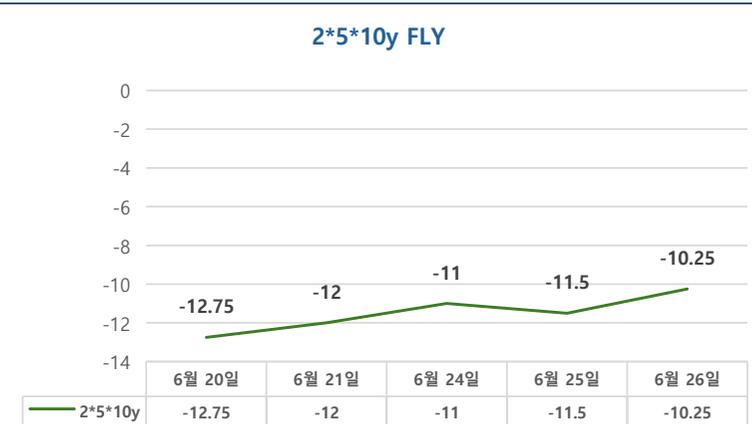
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.50	0.00
1*3y	-21.25	-0.25
2*5y	-10.75	0.25
3*5y	-4.00	0.50
5*10y	-0.50	-1.00
10*20y	-13.00	0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	-0.25
1*1.5*2y	-1.50	0.00
2*5*10y	-10.25	1.25
5*7*10y	-2.50	-1.00