

# Market Daily Report



2024.06.28(금)

<b>레포</b>	시장 유동성 풍부하여 금리 보합 출발했으며, 은행권 매수세 꾸준히 일일채 해소 원활하였음. 장 중 추가자금 유입되어 시은 저금리 조달 가능했으며, 월말 전임에도 기일물 금리 소폭 하락하였음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 국고채 3년물, 10년물은 각각 0.5bp, 2.2bp 상승하며 특별한 시장 변수 없이 조정장을 이어가는 모습을 보임. 미국 : 미 국채금리는 하락 마감. 1분기 GDP 성장률이 1.4%로 예상치 1.3%를 소폭 상회하며 이전치 3.4%에 비해 경기 둔화 흐름이 이어지고 있다는 점에서 시장은 매수 심리 강세를 보임. 또한 미 국채 7년물 입찰에서 견고한 국채 수요를 재확인한 점도 국채가 상승에 영향을 미침.
<b>MONEY</b>	캐나다와 호주의 CPI 상승률이 시장 예상치를 상회하고, 불확실한 연준의 스탠스 및 일본 엔화의 약세 (달러/엔 환율 160엔 안착)가 달러 강세를 지지하면서 일본의 환율 방어를 위해 미국채 매도 가능성도 시장에서 언급되는 되고 있어, 28일 미국의 5월 CPI 발표를 앞두고 다소 긴장 모드. 달러/원 환율이 1390원대에서 기업체 월말 네고 물량이 출회되면서 환율은 1380원대로 하락했으며, 말일 자금 수요 (매입외환 물량과 기업체 네고 물량 출회에 따른 예금 인출 그리고 월말 원화 자금 포지션)로 일부 시중 은행 달러 자금이 다소 타이트하게 집계 되면서 주 후반 자금 운용은 최대한 자제된 가운데 반기말 마감 준비에 집중. 역외 마켓에서도 말일 커버 T/N 그리고 1주를 구간이 5.55-5.60 사이로 레벨 형성되며 월말 마감 준비로 기간물 거래는 소강 상태로 마무리.
<b>FX SWAP</b>	외환 스와프포인트는 전일 크게 밀렸던 부분을 다시 되돌리며 대부분 소폭 상승했으며, 1년 만기는 30전 오른 -2900전, 6개월은 10전 오른 -1490전에 증가를 형성함. 전 날 한산한 흐름을 보였던 것과 대조적으로 이날 현물환 기준 결제일이 반기를 넘어가면서 단기물은 거래가 다소 활발한 모습을 보임. 반기말 달러를 맞추려는 수요도 있었지만 현 레벨을 고려했을때 최하단으로 인식되고 장기물 매수 심리가 강했던 것도 영향이 큰 것으로 파악됨.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 소폭의 반등 흐름을 이어감. 미국의 1분기 국내총생산(GDP) 확정치와 미 대선 후보 첫 토론 및 개인소비지출(CE) 발표를 앞두고 뚜렷한 재료가 없는 분위기 속에서 그동안 보였던 금리 강세를 되돌리는 모습을 보임. 전체적으로 초단기 6개월과 9개월 쪽으로 호가가 많이 형성되는 분위기였으며, 6개월은 55, 9개월은 49.25에 초이스를 이루다 몇차례 거래가 이뤄짐. 10년 오퍼가 장 막판에 내려오고 2년 비드가 나오면서 10년은 17.75에, 2년은 28.5에 거래됨. 5*10년 0.5, 5*7*10년이 -2가 엮이면서 7*10년이 1.25에 레깅으로 거래가 이뤄짐.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	단위 : bp
2024.06.21(금)	205.2	198.5	3.57%	3.560%	3.500%	3.60%	2년물	4.722%	-3.6
2024.06.24(월)	207.8	198.3	3.55%	3.554%		3.60%	5년물	4.304%	-4.6
2024.06.25(화)	207.4	195.7	3.57%	3.757%		3.60%	10년물	4.291%	-4.3
2024.06.26(수)	212.8	196.5	3.55%	3.552%		3.60%	30년물	4.429%	-3.6
2024.06.27(목)	215.3		3.55%	3.560%		3.60%	10Y-2Y	-43.1	-0.7

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부형 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,784.06	-7.99	27.03.10	국고 22-1	1,006	지방채 202	은행채 6,200	
KOSDAQ	838.65	-3.47	27.03.03	통안채	600	은행채 7,000	여전채 7,600	
달러-원	1,385.80원	-2.90원	34.06.10	국고 24-5	600	여전채 5,440	회사채 7,708	
국고3Y	3.220%	0.5	24.12.10	국고 21-10	-700	회사채 6,880	공사채 500	
국고10Y	3.300%	2.2	27.06.10	국고 24-4	-920	공사채 1,300		
국고10Y-3Y	8	1.7	25.03.10	국고 23-3	-1,000			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	5.38	5.31	5.35	0.00	O/N	5.36	5.32	5.34	0.00
TN	5.39	5.32	5.36	0.00	TN	5.60	5.45	5.55	0.20
1W	5.45	5.35	5.40	-0.13	1W	5.45	5.35	5.43	-0.17
1S	5.55	5.45	5.50	-0.03	1S	5.65	5.55	5.60	-0.02
3S	5.61	5.51	5.56	0.00	3S	5.73	5.60	5.65	-0.03
6S	5.69	5.54	5.62	0.00	6S	5.73	5.60	5.67	-0.02
1YR	5.58	5.43	5.50	-0.03	1YR	5.73	5.60	5.68	-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	5.32	0.01	3.50	5.31000	1M MAR	-237	-235
TN	-23/-19	-21	5.32	-0.25	3.50	5.31109	1W*1S	-182	-177
1W	-58/-53	-55	5.55	-0.10	3.50	5.31766	1*2	-255	-247
1S	-245/-225	-235	5.51	-0.04	3.54	5.34393	1*3	-475	-470
3S	-740/-700	-720	5.65	-0.02	3.59	5.33458	1*6	-1240	-1220
6S	-1520/-1460	-1490	5.73	0.01	3.58	5.26398	1*9	-1950	-1920
1YR	-2930/2870	-2900	5.70	0.00	3.51	5.03709	1*12	-2620	-2590

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)

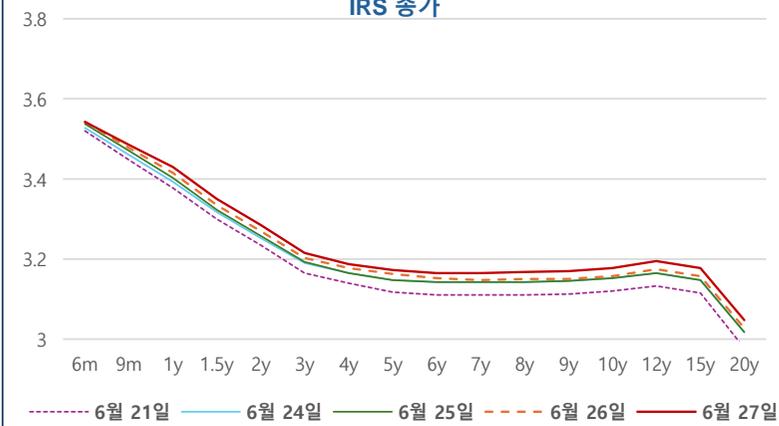
IRS 데일리 증가

6월 27일

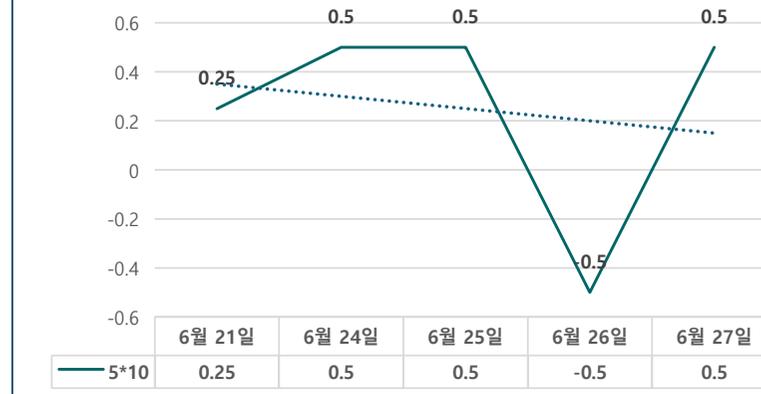
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.5425	0.00
9m	3.4850	0.75
1y	3.4300	1.50
1.5y	3.3500	1.50
2y	3.2850	1.50
3y	3.2150	1.25
4y	3.1875	1.00
5y	3.1725	1.00
6y	3.1650	1.25
7y	3.1650	1.75
8y	3.1675	1.75
9y	3.1700	2.00
10y	3.1775	2.00
12y	3.1950	2.00
15y	3.1775	2.00
20y	3.0475	2.00

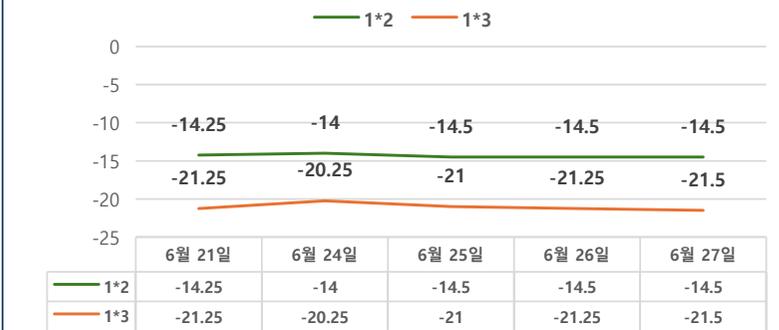
IRS 증가



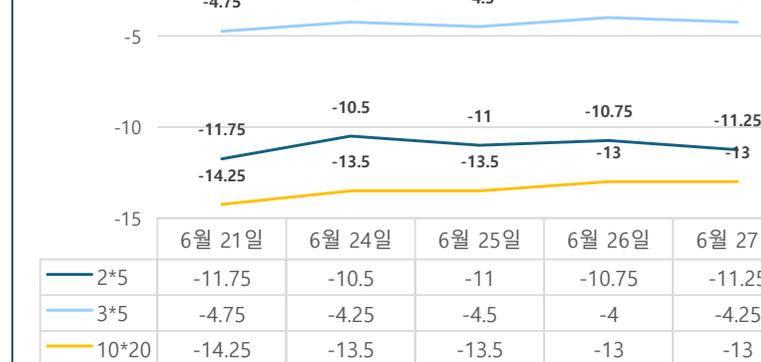
5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

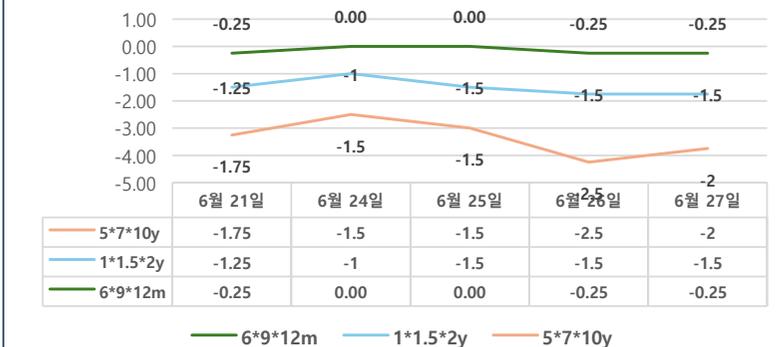


IRS 주요 커브

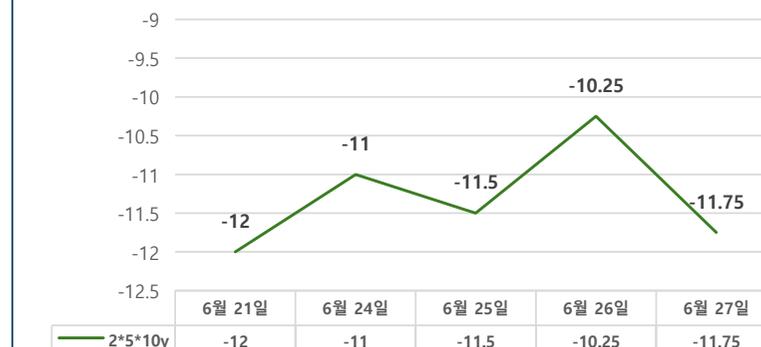
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-14.50	0.00
1*3y	-21.50	-0.25
2*5y	-11.25	-0.50
3*5y	-4.00	-0.25
5*10y	0.50	1.00
10*20y	-13.00	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.25	0.00
1*1.5*2y	-1.50	0.00
2*5*10y	-11.75	-1.50
5*7*10y	-2.00	0.50