

# Market Daily Report



2026.03.06(금)

<b>레포</b>	공자기금 및 국고여유자금 유입 이어져 레포금리 추가 하락(2.50%→2.49%)했으며, 장 초반부터 저금리 거래 활발하였음. 장 중 추가 매도 해소 원활하였고, 익일물 및 기일물 금리 동반 하락하는 등 잉여 분위기 심화되었음.
<b>채권</b>	한국 : 국고채 금리 전 구간 하락. 이란의 중전 협상 접촉 소식과 미국 정부의 호르무즈 해협 교역선 보호 대책 발표로 전쟁 리스크가 경감되자, 전일의 급격한 약세를 되돌리며 강세. 정부와 한국은행의 강력한 시장 안정 의지도 강세 폭을 더함. 이재명 대통령의 '100조 원 규모 시장안정 프로그램' 신속 집행 주문과 재정경제부의 '채권시장 안정조치(100조 원 +α)' 언급이 이어지며 시장 불안 심리가 진정. 다만, 아시아 장에서 국제유가가 다시 상승 폭을 확대함에 따라 장 후반 금리 하락 폭은 다소 제한. 미국 : 미 국채 금리는 전구간 상승 마감. 국제 유가의 재급등과 견조한 고용 지표가 연준의 금리 인하 기대감을 위축시킨 영향. 미 노동부에 따르면 주간 신규 실업보험 청구 건수는 21만 3천 건으로 예상치(21만 5천 건)를 하회. 기업 감원 계획 또한 전월 대비 55% 급감. 이란 전쟁으로 연기되었던 약 320억 달러의 회사채 발행 물량이 쏟아지며 금리에 상당 압력.
<b>MONEY</b>	지난밤 미국 민간 고용과 서비스 PMI가 예상치를 상회하며 경기의 견조함을 확인 시켰고, 이에 미 국채 수익률이 상승하면서 FED의 금리 인하 기대도 다소 약화된 모습. 금중 중동 전쟁이 장기화되지 않을 것이라는 전망이 제기되면서, 주요 통화 대비 글로벌 달러를 이어오던 달러의 상승세가 잠시 주춤했고, 금융시장 심리도 다소 개선된 분위기. 반전된 시장 분위기와는 달리 머니마켓은 여전히 기간물 구간 중심으로 차입세 심화 되는 중. 1달을 기점으로 1달 이하 구간으로는 중국계, 1달 이상 구간으로는 비중국계 네임 위주로 마켓 주된 편딩 이루어지는 중. 중국계 본점들의 단기 렌딩 감소 영향으로 워크 구간에서 여타 네임은 3.65~3.68 레벨을 형성하고 있는 반면, 중국계는 여전히 3.70 내외 수준으로 상대적으로 높은 레벨을 유지. 마켓 운용 부족세가 지속되는 가운데 1달 3.80, 2~3달 3.90 이상 레벨에서 대만계 네임 중심의 차입 수요 또한 이어 지는 중. 6달의 경우 3.90 오픈 대기에, 전일 3.85 체결에 이어 금일 대만계 간 3.87 일부 체결 리포트 되면서, 6달 이상 장기 구간도 전반적인 레벨 상승 흐름을 보이고 있음.
<b>FX SWAP</b>	3월5일 외환 스왑 시장은 지정학적 리스크 완화와 위험 선호 심리 회복의 영향으로 초단기물을 제외한 전 구간에서 상승세를 보임. 1년물은 시초가 대비 0.10원 상승한 -15.50원에 마감했고, 6개월물은 -9.10원에 보합 마감, 1개월물은 0.05원 상승한 -1.35원에 마감함. 현물환 달러-원 환율은 미국과 이란의 비밀 접촉 보도에 따른 중전 기대감으로 장중 한때 1,450원대까지 밀리기도 했으나, 외국인의 주식 매도세와 지상전 착수 소식 등 여전히 불확실성에 전장 대비 8.10원 하락한 1,468.10원에 마감. 외환 스왑프시장 전반적으로는 호르무즈 해협 봉쇄 우려가 진정되고 글로벌 위험 회피 움직임이 되돌려지며 스왑포인트가 반등하는 모습을 보임.
<b>IRS</b>	전일 IRS는 하락 마감. 미국-이란 간 지정학적 리스크가 다소 완화되는 분위기를 보이며 금중 상승분의 일부 되돌림을 보임. 장 초반 중단기쪽으로 강한 상승세를 보이며 1.5년이 7.5/7.25에서 오픈가 내려오며 7.25에 여러 차례 거래되었으며, 3년이 26-30까지 레벨이 상승하며 여러 차례 거래되는 모습을 보임. 오후 들어 삼성전자가 국내 채권 투자를 검토하고 있다는 소식이 전해져 국채선물이 강세 분위기를 보이며 레벨이 하락세로 전환, 10년이 51-50에 여러 차례 거래되며 장기쪽 커브가 움직였으며, 1년이 95, 2년이 18.5레벨에 계속해서 거래되는 분위기를 보임. 4년이 35.5-36까지 오픈가 올라와 거래되었으며, 1년 미만 단기쪽 호가가 우세한 분위기를 보임. 장 막판부터 미국채 강세와 연동되어 6개월이 81.5, 9개월이 86.5에 여러 차례 계속해서 거래되는 분위기를 보였으며, 10년이 47.5레벨까지 몇 차례 거래됨. 마감 이후 3년이 ND로 29.75에 거래되었으며, 1.5*2년이 10에 거래되고 오픈은 분위기를 보임.

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			
2026.02.26(목)	287.1	233.0	2.55%	2.557%	2.50%	2.81%	2년물	3.583%	3.20
2026.02.27(금)	283.6	232.0	2.55%	2.602%		2.81%	5년물	3.728%	4.40
2026.03.03(화)	280.4	234.8	2.53%	2.538%		2.81%	10년물	4.138%	3.80
2026.03.04(수)	278.6	240.1	2.50%	2.510%		2.81%	30년물	4.755%	1.80
2026.03.05(목)	279.5		2.51%	2.516%		2.81%	10Y-2Y	55.5	0.01

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금부업 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	5,583.90	490.36	28.03.10	국고 26-1	1,050	은행채 1,000	은행채 8,500	국고채 10년 1,000억원 교환
KOSDAQ	1,116.41	137.97	27.06.10	국고 24-4	1,000	여전채 6,094	여전채 6,400	통안채 15,000억원 조기환매
달러-원	1,482.20원	19.30원	55.09.10	국고 25-7	915	회사채 4,870	회사채 17,110	
국고3Y	3.189%	-3.4	26.12.10	국고 16-8	-670		공사채 2,100	
국고10Y	3.589%	-4.3	26.12.10	국고 23-10	-1,240			
국고10Y-3Y	40	-0.9	55.03.10	국고 25-2	-2,300			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
단위 : % , %p									
O/N	3.64	3.54	3.61	0.01	O/N	3.70	3.60	3.65	0.00
T/N	3.65	3.55	3.62	0.00	T/N	3.70	3.60	3.65	0.00
1W	3.70	3.60	3.66	-0.01	1W	3.73	3.65	3.70	0.00
1S	3.83	3.73	3.80	0.00	1S	3.80	3.75	3.77	0.00
3S	3.95	3.85	3.89	-0.01	3S	3.85	3.75	3.83	0.00
6S	3.90	3.80	3.87	-0.01	6S	3.85	3.75	3.83	0.00
1YR	3.93	3.78	3.88	0.03	1YR	3.85	3.75	3.83	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
단위 : 전, % , %p						단위 : 전			
O/N	-5/-1	-3	3.24	0.25	2.50	3.70000	1M MAR	-129	-125
T/N	-7/-3	-5	2.91	0.16	2.50	3.69914	1W*1S	-113	-107
1W	-25/-19	-22	3.27	-0.14	2.50	3.69399	1*2	-155	-145
1S	-140/-130	-135	3.68	-0.03	2.61	3.67340	1*3	-305	-295
3S	-460/-440	-450	4.00	-0.01	2.79	3.66946	1*6	-755	-735
6S	-940/-880	-910	4.07	0.01	2.83	3.62869	1*9	-1130	-1100
1YR	-1600/-1500	-1550	4.01	0.00	2.93	3.50891	1*12	-1390	-1360

국내외 일정	
<b>FOMC</b>	1.28~1.29 / 3.18~3.19 / 5.6~5.7 / 6.17~6.18 / 7.29~7.30 / 9.16~9.17 / 10.28~10.29 / 12.9~12.10
<b>금통위</b>	1.16(목) / 2.25(화) / 4.17(금) / 5.29(목) / 7.10(목) / 8.28(목) / 10.23(금) / 11.27(목)
<b>지준일</b>	1.8(수) / 2.5(수) / 3.5(수) / 4.9(수) / 5.7(수) / 6.11(수) / 7.9(수) / 8.6(수) / 9.10(수) / 10.8(수) / 11.5(수) / 12.10(수)

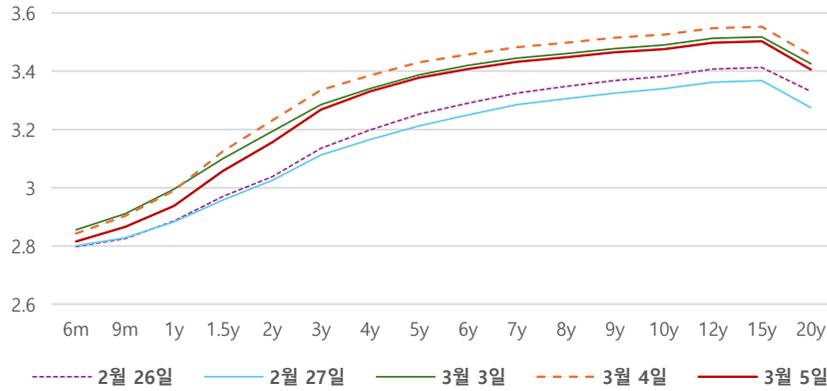
IRS 데일리 증가

3월 5일

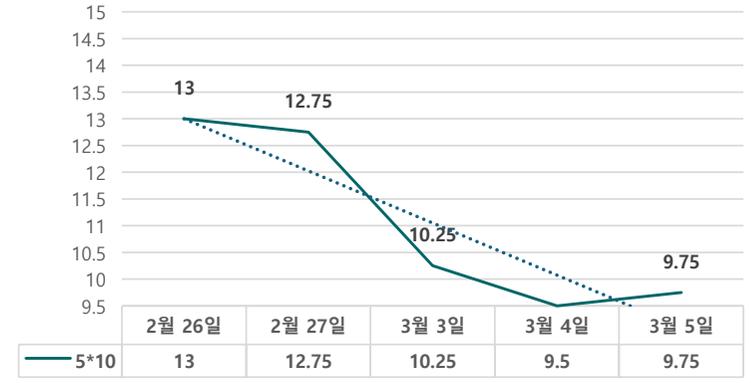
단위 : % , bp

구분	증가	전일대비
6m	2.8150	-2.75
9m	2.8650	-3.75
1y	2.9375	-5.25
1.5y	3.0575	-6.75
2y	3.1550	-7.50
3y	3.2675	-6.75
4y	3.3300	-5.50
5y	3.3775	-5.25
6y	3.4075	-5.00
7y	3.4325	-5.00
8y	3.4475	-5.00
9y	3.4650	-5.00
10y	3.4750	-5.00
15y	3.5025	-5.00
20y	3.4050	-5.00

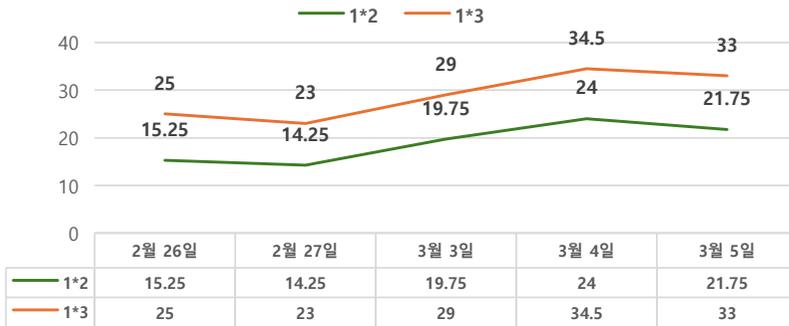
IRS 증가



5\*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

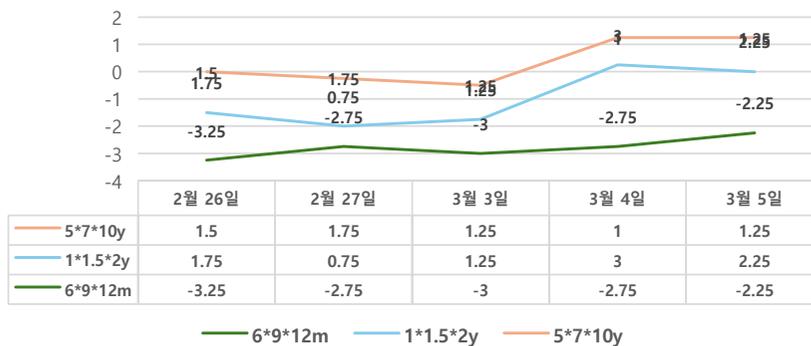


IRS 주요 커브

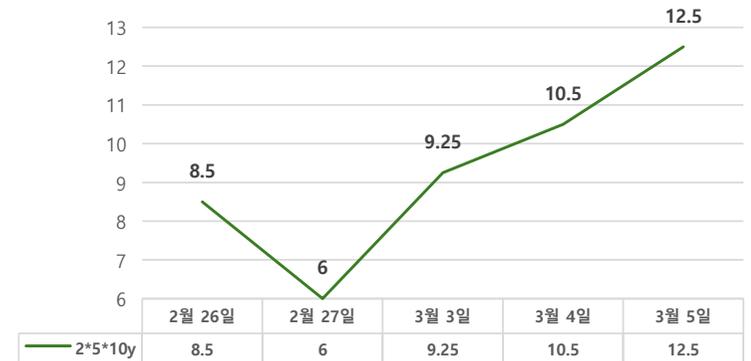
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	21.75	-2.25
1*3y	33.00	-1.50
2*5y	22.25	2.25
3*5y	11.00	1.50
5*10y	9.75	0.25
10*20y	-7.00	0.00

주요 FLY



2\*5\*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.25	0.50
1*1.5*2y	2.25	-0.75
2*5*10y	12.50	2.00
5*7*10y	1.25	0.25