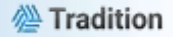


Market Daily Report

2026.04.29(수)



레포	한은RP매입 증액(6조→20조) 기대감으로 레포금리 하락(2.54%→2.51%)한 가운데 단기 유동성 풍부하여 매도 해소 원활하였음. 공모주 청약 진행됨에 따라 증권사 추가 매도 발생했으며, 제2금융권 잉여채 유지돼 수급 무난하였음. [공모주] 코스모로보틱스 - 모집 4.27~4.28 한불 4.30(목) 증거금 4.09조(유진 2.46조, NH 1.41조, 유안타0.22조)
채권	한국 : 국고채 금리 혼조 마감. 중동 지정학 리스크 완화 기대와 종전 협상 진전 뉴스가 이어지는 가운데, 수급 기대(WGBI 유입·입찰 공백)와 펀드멘털 부담이 엇갈리며 관망세 형성. 장 초반 종전 기대감 반영되며 강세 출발했으나, 미국채 금리 약세와 외국인 선물 매도 영향이 맞물리며 강세 제한. 이후 오전 중 호르무즈 해협 재개방 및 휴전 연장 가능성 보도에 강세 폭 확대되며 10년 선물 한때 30bp 이상 상승. 다만 오후 들어 외국인 매도 규모 확대되며 약세 압력 강화, 혼조 흐름 전환. 3년물은 전일 대비 0.4bp 하락, 10년물은 0.3bp 상승 마감. 외국인은 3년, 10년 국채 선물 순매도하며 금리 상방 압력 확대, 은행과 금융투자 순매수가 일부 완충. 입찰 공백 및 WGBI 자금 유입 기대가 하방을 지지했으나, 외국인 매도 지속이 상방 압력으로 작용. 향후 월말 수급 요인, 중동 지정학 전개, 글로벌 금리 흐름 및 외국인 선물 수급에 따라 변동성 확대 가능성. 미국 : 미 국채 금리 혼조 마감. 장 초반 미국-이란 협상 교착으로 미 국채 금리 상승. 다만 장전 UAE가 OPEC에서 탈퇴한다는 발표로 유가 상승폭이 제한되며 미 국채 금리 상승폭 축소. 미국 CB 소비자신뢰지수는 92.8로 예상치(89.0) 상회. 미 재무부에 따르면 440억 달러 규모의 미 7년물 국채 입찰은 2.51배의 응찰률 속에 발행 전 거래 수익률을 0.5bp 상회한 4.175%로 결정.
MONEY	예상대로 BOJ는 이틀간의 회의 끝에 기준금리를 0.75%로 동결 함. 하지만, 9명의 정책위원 중 3명이 1%로 금리 인상을 제안하며 중동 분쟁으로 인한 인플레이션 압력에 대한 우려를 드러냄. 한편, 29일 발표 예정인 FED 역시 당분간 금리를 동결할 가능성에 무게를 두고 있으며, 현재로서는 2027년 상반기까지 금리 동결 전망이 제시되며, 단기적으로는 FOMC 회의에서 금리 변화보다는 인플레이션과 유가 관련 발언이 금리 방향에 영향을 줄 핵심 변수로 시장은 보고 있음. 중국계 렌더를 포함 6달 4.05 마켓 오피 제시에, 한국계를 비롯한 일부 비 중국계 네임엔테로도 운용 제시가 되었고, 4.00 레벨에 말레이시아계 네임 비드로 마켓 체결 리포트. 3달 또한 4.00 오피에 대만계 비드로 거래 되었고, 중국계간 거래는 3.87~3.88 수준에서 체결 됨. 3달 대만계는 4.00, 중국계 3.88 형성세, 6달의 경우 비중국계 4.00, 중국계 3.92 레벨로 형성 되면서, 3달~6달 구간을 중심으로 중국계와 비중국계간 레벨 격차가 대략 10bp 내외로 확대 됨. 이에 중국계 렌더의 경우 네임간 금리 차이로 인한 수익 실현을 위해 운용 시야를 점차 비중국계 한테로도 넓히기 시작하면서, 한국계를 포함한 비중국계 한테로도 기간을 오피 제시가 되고 있는것으로 예상 됨.
FX SWAP	4월 28일 외환 스와프 시장은 한국은행 금리 인상 기대와 WGBI 환헤지 수요가 겹치며 초단기물을 제외한 전 구간에서 상승함. 1년물(12M)은 WGBI 관련 셀앤바이 수요에 시초가 대비 0.10원 상승한 -14.80원에 마감했고, 6개월물(6M)은 0.10원 오른 -8.30원, 1개월물(1M)도 한은 연내 두 차례 금리 인상 베팅이 반영되며 0.10원 상승한 -1.15원에 거래를 마감. 현물환 달러-원 환율은 마-이란 종전 협상 교착과 FOMC 개시를 앞둔 관망 심리로 수급 균형이 이어지며 전장 대비 1.10원 오른 1,473.60원에 강보합 마감됨. 외환 스와프 시장에서는 미국 연내 금리 동결 기대 대비 한국 금리 인상을 한미 금리 경로 차별화가 전반적으로 상승 동력으로 작용하고 있으며, FOMC 결과에 따른 미국 금리 경로 재확인 마-이란 종전 협상 진전 여부가 방향성의 핵심 변수로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 일본은행(BOJ)의 기준금리 동결에도 불구하고 금리 인상을 주장한 소수 의견과 매파적인 경제전망 보고서 영향에 약세 출발했으며, 외국인의 국채선물 대거 순매도와 손절 물량이 겹치며 IRS 금리는 전 구간 상승 마감함. 장 초반 1년 KOFR BASIS가 -21.5/-24에 대치되었으며, 1년 24오피와 엮어 1년 KOFR OIS가 2.5오피로 만들어짐. 1*3년이 39-40비드까지 올라와 40.5/40에 대치되다가 40.5에 거래되었으며, 2년이 56/55.5에 대치되다가 국채선물과 연동되어 56에 거래됨. 6*9개월이 14.5/14에 대치되다가 오피가 6개월 94.5오피와 엮어 9개월이 09에 거래되었으며, 3년이 국채선물과 연동되어 67.5-67.75까지 계속해서 거래됨. 오후 들어 10년이 41.75/41.25까지 올라와 대치되었으며, 10년이 76.5에 거래되고 비드는 분위기를 보임. 또한 2*10년이 21.5에 여러 차례 거래되었으며, 1년이 24에 거래됨. 장 막판 10*30년이 ND로 -54.5에 거래되었으며, 10년이 77.5까지 레벨이 올라오며 거래되었고 7년이 74.75-75.5비드까지 올라와 커브 레벨이 강하게 움직임. 마감 이후 1년 KOFR BASIS가 -22/-22.5에 대치됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2026.04.22(수)	271.3	259.8	2.51%	2.511%	2.83%	2년물	3.838%	3.70	
2026.04.23(목)	270.2	257.1	2.51%	2.539%	2.83%	5년물	3.979%	2.90	
2026.04.24(금)	267.5	255.4	2.53%	2.530%	2.82%	10년물	4.347%	0.50	
2026.04.27(월)	266.6	255.7	2.54%	2.531%	2.82%	30년물	4.937%	-1.20	
2026.04.28(화)	267.0		2.51%		2.82%	10Y-2Y	50.9	-0.03	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	6,641.02	25.99	56.03.10	국고 26-2	792	은행채 3,200	은행채 9,900	재정증권 63일물 25,000
KOSDAQ	1,215.58	-10.60	35.12.10	국고 25-11	529	여전채 4,200	여전채 1,300	
달러-원	1,473.60원	1.10원	52.09.10	국고 22-9	300	회사채 2,150	회사채 7,440	
국고3Y	3.529%	3.7	27.03.10	국고 25-1	-537	공사채 1,600	공사채 2,100	
국고10Y	3.861%	4.1	27.09.10	국고 25-6	-549			
국고10Y-3Y	33.2	0.4						

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가
O/N	3.67	3.57	3.65	0.01	O/N	3.69	3.59	3.67
T/N	3.68	3.58	3.66	0.01	T/N	3.69	3.59	3.67
1W	3.80	3.70	3.75	0.00	1W	3.78	3.68	3.75
1S	3.83	3.73	3.78	0.00	1S	3.80	3.70	3.77
3S	4.03	3.93	3.98	0.00	3S	3.90	3.80	3.88
6S	4.05	3.90	4.00	-0.04	6S	3.95	3.85	3.92
1YR	4.08	3.93	4.03	-0.02	1YR	4.00	3.90	3.95

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7/-3	-5	3.72	-0.25	2.50	3.66000	1M MAR	-120	-116
T/N	-6/-2	-4	3.48	-0.24	2.50	3.65026	1W*1S	-93	-87
1W	-31/-25	-28	3.48	-0.07	2.50	3.65184	1*2	-140	-130
1S	-120/-110	-115	3.57	-0.09	2.60	3.65907	1*3	-285	-275
3S	-420/-400	-410	3.87	-0.04	2.77	3.66889	1*6	-680	-660
6S	-860/-800	-830	3.97	-0.02	2.84	3.67257	1*9	-1030	-1000
1YR	-1530/-1430	-1480	4.14	-0.01	3.11	3.68295	1*12	-1300	-1270

국내외 일정	
FOMC	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
금통위	1.16(목) / 2.25(화) / 4.17(금) / 5.29(목) / 7.10(목) / 8.28(목) / 10.23(금) / 11.27(목)
지준일	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)

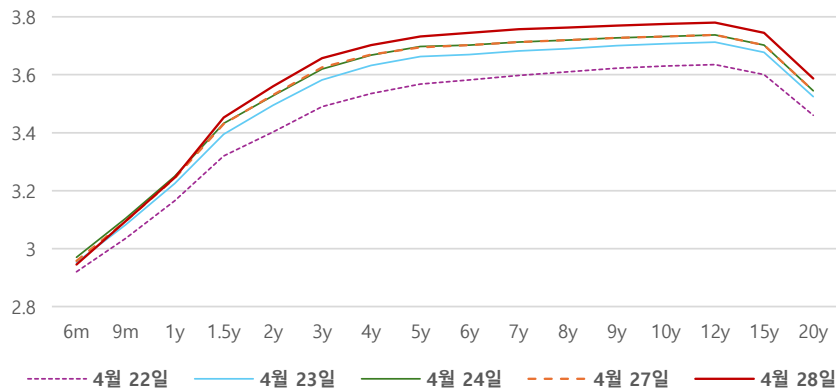
IRS 데일리 증가

4월 28일

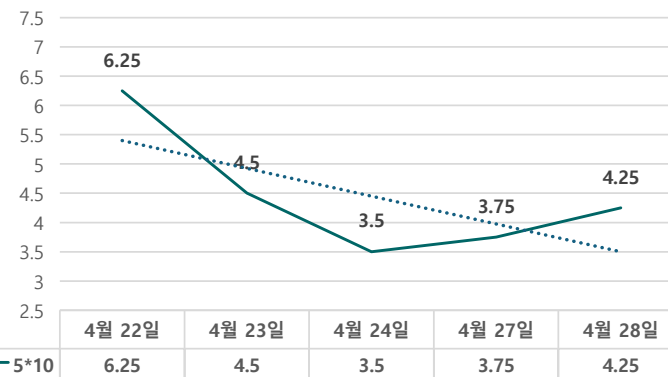
단위 : % , bp

구분	증가	전일대비
6m	2.9450	-1.25
9m	3.0950	0.00
1y	3.2450	0.25
1.5y	3.4525	2.25
2y	3.5600	3.00
3y	3.6575	3.25
4y	3.7025	3.25
5y	3.7325	3.75
6y	3.7450	4.25
7y	3.7575	4.50
8y	3.7625	4.25
9y	3.7700	4.25
10y	3.7750	4.25
12y	3.7800	4.25
15y	3.7450	4.25
20y	3.5875	4.25

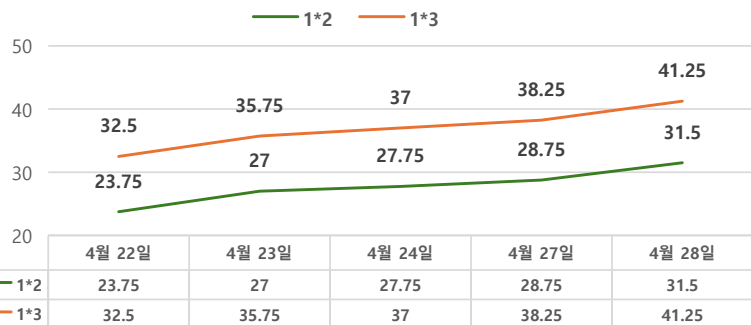
IRS 증가



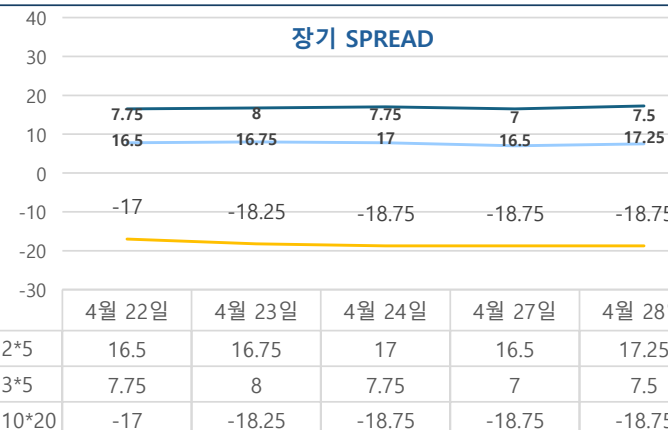
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

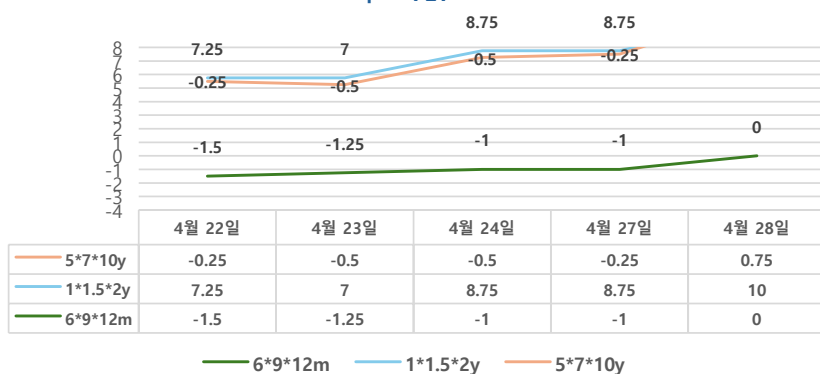


IRS 주요 커브

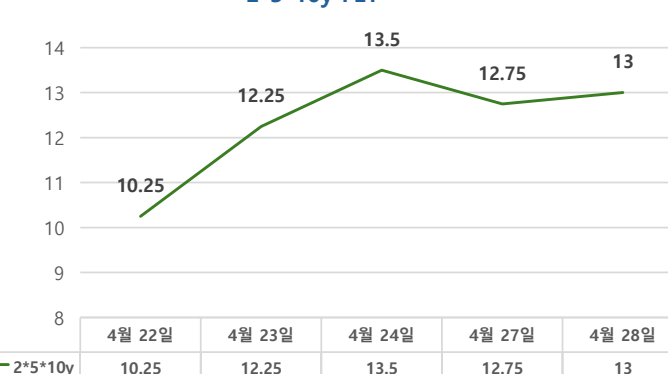
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	31.50	2.75
1*3y	41.25	3.00
2*5y	17.25	0.75
3*5y	7.50	0.50
5*10y	4.25	0.50
10*20y	-18.75	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	0.00	1.00
1*1.5*2y	10.00	1.25
2*5*10y	13.00	0.25
5*7*10y	0.75	1.00