

Market Daily Report

2026.06.08(월)



레포	MMF/MMT 설정자금 유입 더더 주초 조달 여건 크게 개선되지 못했으나 월말세입에 상응하는 국고여유자금 및 공자기금 유입 이어짐에 따라 수급 호전되었음. 단기 유동성 확대되어 은행 및 제2금융권의 견조한 매수를 바탕으로 일반채 해소 원활했던 반면, 증권사 전담채-CP 등 발행수요 강해 회사채 난항은 지속되었음.
채권	한국 : 국고채 금리는 급등 마감. 장 초반 이스라엘-레바논 휴전 소식에 유가가 내려가며 상승 출발했으나 헤즈볼라의 휴전 거부 소식 등에 환율이 다시 치솟으며 채권시장도 약세로 돌아섬. 환율 급등, 주가 조정, 채권 금리 상승이 겹치며 '트리플 약세'가 나타났으며 이에 따른 기준금리 인상 우려와 장세 위축으로 변동성이 커짐. 특히, 3년 국채선물은 하락하고 10년 국채선물도 약세를 보인 가운데 외국인은 3년 선물을 순매도하고 10년 선물은 순매수하는 흐름을 보임. 미국 : 미 국채 금리는 단기물의 상대적 약세 속에 전구간 상승 마감. 장 초반 5월 비농업 고용이 17만2천명 증가하며 시장 예상치(8만5천명)를 큰 폭 상회. 실업률도 4.3%로 예상치(4.3%)에 부합하며 견조한 고용 여건이 확인되자 금리 인상 기대가 강화됨. 이에 2년물 금리는 장중 4.178%까지 상승하며 지난해 2월 이후 최고 수준을 기록했고 장기물보다 단기 물 금리 상승폭이 더 크게 나타남. 한편 NDF는 현물 증가 대비 21.10원 상승한 1,559.20원을 기록함.
MONEY	개장 초반 중국계(동경-런던-대만 등 해외지점) 2~4개월물 말레이계 3개월물 달러 비드가 집중되며 1개월 초과 구간 전반 타이트한 수급 분위기 감지. 말레이계는 달러에 국한하지 않고 JPY/CNH 등 이중통화로도 3~6개월 구간 차입을 시도하는 모습으로, 중동 지정학 불확실성 장기화 및 호르무즈 에너지 비용 상승에 따른 LCR 규제 충족용 유동성 확보 수요가 배경으로 보임. 엔/달러 160선 돌파 직전 BOJ 개입 경계감도 아시아 달러 수급 타이트를 심화시키는 요인으로 작용 중. 온서 2개월 4.00-1년 4.15 오픈하는 비드와 스프레드 간 괴리가 좁혀지지 않아 체결 불발. 연말 넘기는 테너 수요는 여전히 활발하며, 금일 및 5월 NFP(컨센서스 +85K) 결과가 달러 방향성의 핵심 변수 □
FX SWAP	6월 5일 외환 스와프 시장은 위험회피 심리 확산에 전 구간에서 하락함. 1년물(12M)은 국채 금리 상승에도 리스크오프 수급이 가격을 좌우하며 시초가 대비 0.20원 하락한 -10.90원에 마감했고, 6개월물(6M)은 0.70원 급락한 -6.30원, 1개월물(1M)은 0.35원 내린 -1.00원에 거래를 마침. 현물환 달러-원 환율은 외국인의 20거래일 연속 코스피 순매도와 헤즈볼라의 휴전 거부에 따른 종전 기대 약화, 코스피 5.54% 급락이 겹치며 전장 대비 9.40원 오른 1,539.10원에 마감함. 외환 스와프 시장에서는 한은 매파-WGBI-금리 상승으로 가파르게 회복했던 레벨이 극심한 리스크오프 국면에서 그간의 상승에 대한 일시적 되돌림을 보임.
IRS	전일 IRS는 혼조세 마감. 달러-원 환율 급등에 따른 통화정책 긴축 우려와 주말을 앞둔 포지션 축소로 현물 금리가 상승하자, IRS 금리도 중장기 구간을 중심으로 대체로 상승하는 흐름을 보임. 다만 1년 이하 단기 테너는 최근 급등에 따른 레벨 부담과 차익실현 인식 속에 소폭 하락하며 강세를 보인 것으로 해석됨. 장 초반 2년이 93.25-93에 여러 차례 거래되었으며, 1*1.5*2년 나비가 9.75비드로 나와 단기쪽으로 커브가 움직이는 모습을 보임. 5년이 13-12오픈으로 내려오며 거래되고 오픈은 분위기를 보였으며, 5*10년이 03/2.5에 대치되다가 2.5에 거래, 20년 아웃라잇이 01오픈으로 나와 장기쪽 커브가 다소 플랫트닝되는 분위기를 보임. 오후 들어 3년이 4.25/2.75에서 스타트해 3.5/03에서 3.5에 거래되고 비드는 분위기를 보였으며, 2*4년 15.5오픈, 3*4년 5.75오픈이 나와 커브가 움직임. 1.5년이 국채선물과 연동되어 82.5에 여러 차례 거래되었으며, 3년 KOFR OIS가 83 거래, 1.5년 OIS가 59.5에 초이스를 이루다 거래됨. 장 막판 5년이 13.5/12.5에서 비드가 강하게 올라와 13.5에 초이스를 이루며 여러 차례 거래되어 레벨이 강하게 상승하였으며, 12년이 16오픈이 나와 12년 커브가 강하게 놀림. 마감 이후 9개월이 ND로 38에 거래됨. 이날 양도성에금증서(CD)는 상승하여 2.88%(+1bp)에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2026.05.29(금)	275.1	253.6	2.55%	2.592%	2.50%	2.86%	2년물	4.151%	10.40
2026.06.01(월)	276.9	255.2	2.53%	2.536%		2.86%	5년물	4.271%	8.30
2026.06.02(화)	277.4	256.3	2.52%	2.518%		2.87%	10년물	4.532%	5.60
2026.06.04(목)	276.2	255.5	2.51%	2.514%		2.87%	30년물	4.998%	2.10
2026.06.05(금)	275.6		2.50%			2.88%	10Y-2Y	38.1	-0.05

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	8,160.59	-478.82	28.03.10	국고 26-1	1,950	은행채 1,100	은행채 3,000	국고채 3년물 28,000억원 입찰
KOSDAQ	1,002.44	-47.29	35.12.10	국고 25-11	1,133	공사채 4,500	여전채 4,500	통안채 91일물 5,000억원 입찰
달러-원	1,539.10원	9.40원	31.03.10	국고 26-3	797		회사채 2,600	
국고3Y	3.882%	2.4	53.03.10	국고채이자	-200			
국고10Y	4.254%	2.5	56.03.10	국고 26-2	-289			
국고10Y-3Y	37.2	0.1						

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		전일대비
O/N	3.64	3.58	3.61	0.00	O/N	3.67	3.63	-0.01
T/N	3.66	3.60	3.63	0.00	T/N	3.68	3.64	0.00
1W	3.70	3.60	3.66	0.00	1W	3.73	3.68	0.02
1S	3.80	3.70	3.77	0.01	1S	3.85	3.76	0.00
3S	4.05	3.90	3.99	0.01	3S	4.00	3.90	0.04
6S	4.10	3.95	4.06	0.00	6S	4.05	3.95	0.07
1YR	4.20	4.05	4.15	0.03	1YR	4.15	4.05	0.01

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-20/-16	-18	3.90	1.16	2.50	3.61000	1M MAR	-92	-88
T/N	-7/-3	-5	3.67	1.17	2.50	3.61012	1W*1S	-68	-62
1W	-28/-22	-25	3.34	0.53	2.50	3.61083	1*2	-100	-90
1S	-105/-95	-100	3.40	0.27	2.62	3.61356	1*3	-190	-180
3S	-305/-285	-295	3.77	0.01	2.87	3.65209	1*6	-490	-470
6S	-660/-600	-630	3.85	0.10	3.03	3.71729	1*9	-750	-720
1YR	-1140/-1040	-1090	4.22	0.06	3.49	3.87205	1*12	-935	-905

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)

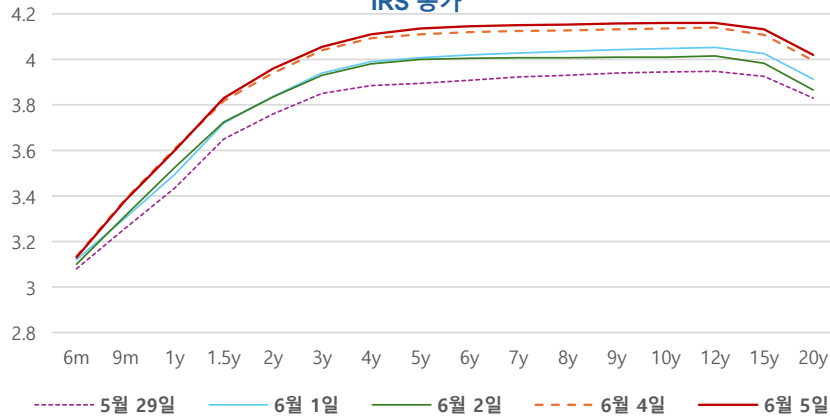
IRS 데일리 증가

6월 5일

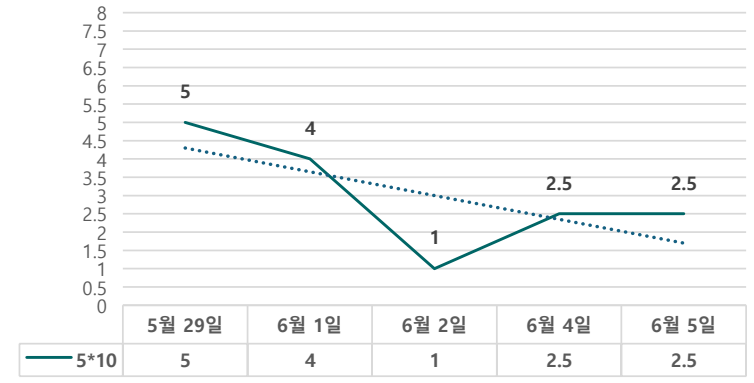
단위 : % bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1300	-0.50
9m	3.3825	-0.50
1y	3.6000	-0.75
1.5y	3.8300	1.25
2y	3.9600	2.00
3y	4.0550	1.50
4y	4.1100	1.75
5y	4.1350	2.50
6y	4.1450	2.50
7y	4.1500	2.50
8y	4.1525	2.50
9y	4.1575	2.50
10y	4.1600	2.50
12y	4.1600	2.00
15y	4.1325	2.50
20y	4.0200	2.50

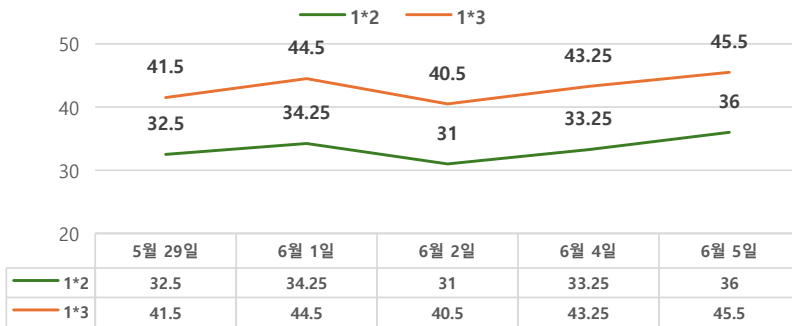
IRS 증가



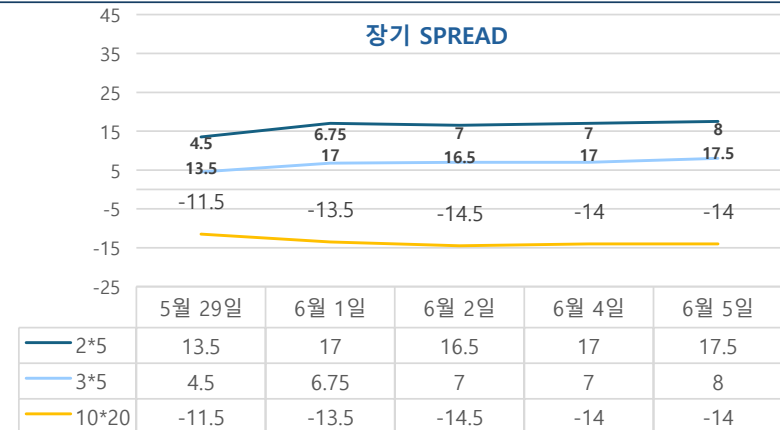
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

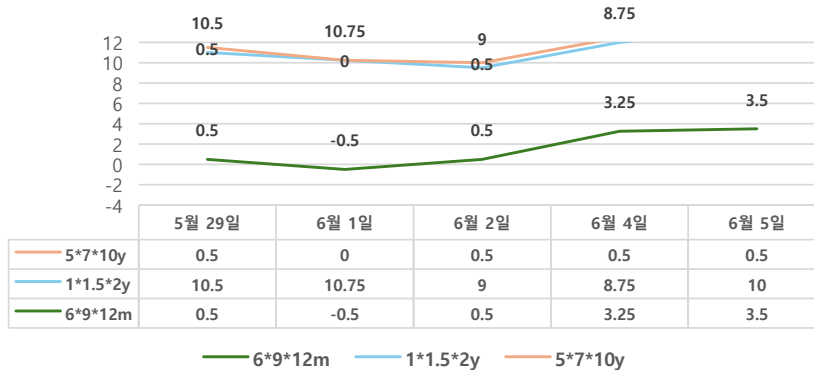


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	36.00	2.75
1*3y	45.50	2.25
2*5y	17.50	0.50
3*5y	8.00	1.00
5*10y	2.50	0.00
10*20y	-14.00	0.00

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	3.50	0.25
1*1.5*2y	10.00	1.25
2*5*10y	15.00	0.50
5*7*10y	0.50	0.00

2*5*10y FLY

