

Market Daily Report

2026.06.12(금)



레포	청약자금 유입 기대감으로 레포금리 소폭 하락(2.55%→2.54%)했으나 단기 유동성 호전되지 못해 장 초반부터 체결금리 급등하였음. 은행 고유계정 매수 참여에 힘입어 정체 점차 완화됐으며, 오후에 제2금융권 추가자금 유입돼 무난히 마감하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 상승 마감. 중동 지역 긴장이 고조되며 국제유가와 달러-원 환율이 상승한 영향으로 서울 채권시장은 장 초반부터 약세 압력을 받음. 미국과 이란 간 무력 충돌이 발생하고 이란이 호르무즈 해협 폐쇄를 선언하면서 종전 기대가 약화됐고, 이에 따라 유가와 환율이 동반 상승하며 채권시장 투자심리를 위축시킴. 개장 직후 발표된 6월 초순 수출이 전년 동기 대비 85.9% 증가하며 역대 최고 수준을 기록했고, 가계대출도 주식 투자 수요 확대 영향으로 큰 폭 증가한 것으로 나타나며 금리 상승 압력을 더함. 다만 국제선물 만기(16일)를 앞둔 롤오버 장세 영향으로 변동성이 확대된 측면도 있었던 것으로 평가됨. 미국 : 미 국제 금리는 전지구 하락 마감. 트럼프 대통령은 이란과의 종전 협상이 이란 최고 지도부 차원에서 승인됐으며 그에 따라 오늘 밤으로 예정됐던 이란 공습 및 폭격을 취소했다고 밝힘. 이로 인해 유가는 즉각 급락세로 돌아서고 미 국제 금리는 전구간에서 가파르게 하락. 미국 5월 생산자물가지수(PPI)는 1.1%로 예상치(0.7%)를 상회했으나 근원 PPI는 0.4%로 예상치(0.5%) 하회. 주간 신규 실업보험 청구 건수는 계절조정 기준 22만9천건으로 예상치(21만9천건) 상회하며 2월 첫째 주 이후 최고치를 기록. 220억달러 규모 미 30년물 리오론 국제 입찰은 2.33배의 응찰률 속에 발행 전 거래 수익률을 1.2bp 상회하는 5.020%에 낙찰됨.
MONEY	11일, 온서마켓은 월말까지 오피 위주 흐름이 지속되는 가운데 금리는 전일 대비 2~3bp 높은 수준에서 거래가 시도되고 있음. 대만계-중국계의 분기말 커브 수요(1개월, 4~6개월)가 유입되며 차입금리가 동반 상승. 대만계 1개월 3.87%, 4개월 4.10% 체결 소식이 전해지고, 중국계 6개월물도 4.05%, 말레이계 6개월물도 4.15%까지 비드가 시도되고 있음. 한국계는 6개월 비드 4.02~4.06% 대비 오피 4.15%, 1년물도 비드 4.15~4.18% 대비 오피 4.30%로 비드-오피 스프레드가 좀처럼 좁아지지 않고 있음. 유럽계 7개월~1년 비드 금리도 강세를 유지하는 가운데, 2개월 이상 전 구간에 걸쳐 4% 상회 흐름이 굳어지는 양상임. 대외 여건으로는 미-이란 교전 재개 및 호르무즈 봉쇄 선언으로 브렌트유가 상승하고 달러는 소폭 약세를 나타냈음. 5월 CPI는 전년비 상승으로 Fed의 긴축 강계감이 지속되는 가운데, 근원 CPI의 전월비 상승폭이 소폭 둔화되며 물가 압력이 제한될 수 있다는 기대도 존재하고 있음. 시장은 12월 25bp 인상을 전가 반영 중이며, ECB의 금일 25bp 인상도 유력시됨. BOJ는 히미노 부총재 대행 체제 하에 6/15~16 회의 진행되나 25bp 인상 전망은 유지되고 있음.
FX SWAP	6월 11일 외환 스와프 시장은 장기물이 소폭 반등했으나 애셋스와프 우위에 실질적으로 무거운 혼조세를 보임. 1년물(12M)은 시초가 대비 0.20원 상승한 -14.00원에 마감했고, 6개월물(6M)도 0.20원 오른 -7.30원을 기록한 반면, 1개월물(1M)은 0.05원 하락한 -1.35원에 거래를 마친. 현물환 달러-원 환율은 외국인인 24거래일 연속 코스피 순매도와 미·이란 군사 긴장 고조에 4.70원 상승했으나, 당국-국민연금 경제감과 달러 인덱스 100 하회에 따른 강달러 진정이 상단을 제한하며 1,528.90원에 마감함. 외환 스와프 시장에서는 애셋-연금발 구조적 오피 우위에 외환공동검사에 따른 외국계 거래 위축까지 더해지며 약세 압력이 남아있는 만큼 미 PPI 결과와 비드 회복세가 다음 방향성의 변수로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 중동의 무력 충돌 재점화에 따른 국제유가 및 환율 상승과 현-선물 약세에 동조하며 IRS 금리는 전 구간에서 상승 마감. 특히 타이트한 단기자금시장 유동성과 기준금리 인상 전망으로 인해 91일물 CD금리의 상승세가 지속됨에 따라, 1년 이하 단기 구간을 중심으로 약세 압력이 더욱 심화되는 분위기. 장 초반 간밤 발표된 미국의 CPI가 대체로 시장 예상에 부합해 안도감을 주었으나, 호르무즈 해협 전면 폐쇄 소식에 약세를 보이며 7년이 12/11.25에서 비드가 올라오며 7년이 12에 여러 차례 거래되었으며, 10년 12오퍼가 나오자마자 거래됨. 다만 이후 원/달러 환율의 안정과 국제선물 만기를 앞둔 롤오버 장세 분위기에 따라 시장이 강세로 전환되며 5년이 8.5-08까지 레벨이 내려와 계속해서 거래되었으며, 10*15년이 -3.25/-3.75에서 오피가 내려오며 -3.75에 여러 차례 거래됨. 3*5년이 7.75에 오피온 분위기를 보이며 여러 차례 거래되었으며, 9*12*18개월 나비가 -5.5-6오퍼까지 내려왔고 9*12개월 17오퍼와 역대 1*1.5년이 23오퍼까지 레깅으로 만들어짐. 오후 들어 3*5년이 7.75-7.9레벨까지 거래되어 커브가 플랫되었으며, 5년 이 08, 4년이 03에 여러 차례 거래됨. 이후 국제선물이 다시 약세 전환되며 3개월 KOFR OIS가 72-74비드까지 올라오며 단가쪽 OIS 레벨이 상승하였으며, 1년이 55-57레벨까지 올라와 거래되고 이후 58.5비드까지 올라감. 장 막판 국제선물이 밀려 7년이 14.5-14오퍼가 나와 중장기쪽 커브가 눌렸으며, 1.5년 82비드가 나오자마자 거래되어 커브가 플랫됨. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 2.95%(+1bp)에 고시됨.

단기자금시장						전일 미국 국제 금리			
						단위 : 조 원	한국시간 오전 07:05 기준	단위 : bp	
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2026.06.05(금)	275.6	257.1	2.50%	2.527%	2.50%	2.88%	2년물	4.066%	-8.10
2026.06.08(월)	272.7	256.2	2.50%	2.528%		2.92%	5년물	4.186%	-9.60
2026.06.09(화)	273.6	246.9	2.55%	2.513%		2.91%	10년물	4.464%	-9.00
2026.06.10(수)	275.6	238.6	2.55%	2.483%		2.94%	30년물	4.957%	-7.40
2026.06.11(목)	275.4		2.55%			2.95%	10Y-2Y	39.8	-0.01

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투형 최단호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	7,763.95	33.13	55.09.10	국고 25-7	3,187	은행채 10,100	은행채 5,900	국고채 50년 7,000억원
KOSDAQ	996.93	45.30	28.03.10	국고 26-1	2,600	여전채 5,550	여전채 9,960	
달러-원	1,531.60원	7.40원	27.06.10	국고 24-4	1,362	회사채 5,972	회사채 3,410	
국고3Y	3.904%	2.3	27.01.02	통안	-700	공사채 9,800	공사채 7,900	
국고10Y	4.300%	2.7	29.12.10	국고 19-8	-815			
국고10Y-3Y	39.6	0.4	31.06.10	국고 21-5	-928			

Money Market Closing									
단위 : %, %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	3.67	3.61	3.64	-0.01	O/N	3.69	3.63	3.66	0.00
T/N	3.69	3.63	3.66	-0.01	T/N	3.70	3.64	3.67	0.00
1W	3.73	3.69	3.69	0.00	1W	3.75	3.65	3.71	0.00
1S	3.95	3.87	3.87	0.05	1S	3.98	3.87	3.90	-0.03
3S	4.10	43.05	4.05	0.02	3S	4.03	3.93	4.00	0.01
6S	4.18	4.14	4.14	0.05	6S	4.05	3.95	4.05	0.05
1YR	4.30	4.23	4.23	0.03	1YR	4.15	4.05	4.12	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-5	-7	4.15	0.22	2.50	3.60000	1M MAR	-120	-116
T/N	-20/-16	-18	3.91	0.22	2.50	3.60071	1W*1S	-99	-93
1W	-37/-31	-34	3.64	0.05	2.50	3.60497	1*2	-135	-125
1S	-140/-130	-135	3.68	0.02	2.62	3.62128	1*3	-230	-220
3S	-380/-360	-370	3.85	0.02	2.90	3.66369	1*6	-570	-550
6S	-760/-700	-730	4.05	-0.02	3.09	3.74725	1*9	-895	-865
1YR	-1450/-1350	-1400	4.52	-0.02	3.57	3.91842	1*12	-1165	-1135

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)

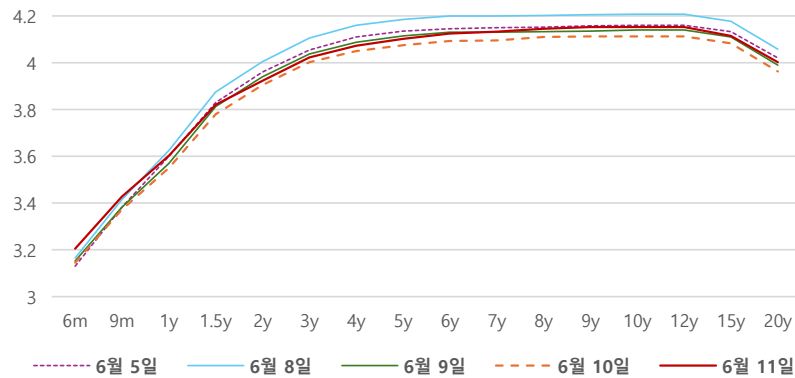
IRS 데일리 증가

6월 11일

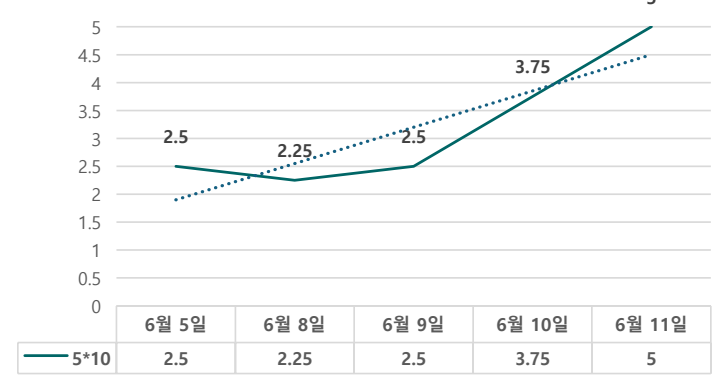
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.2050	6.00
9m	3.4275	5.50
1y	3.6025	5.25
1.5y	3.8200	4.00
2y	3.9225	1.75
3y	4.0225	2.00
4y	4.0725	2.25
5y	4.1025	2.75
6y	4.1250	3.25
7y	4.1325	3.75
8y	4.1450	3.50
9y	4.1525	4.00
10y	4.1525	4.00
12y	4.1525	4.00
15y	4.1150	3.25
20y	4.0025	4.00

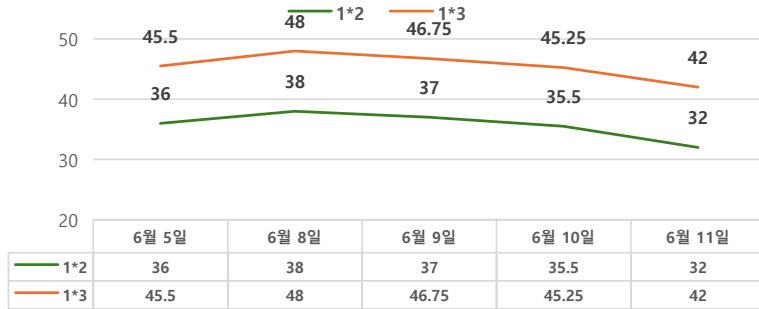
IRS 증가



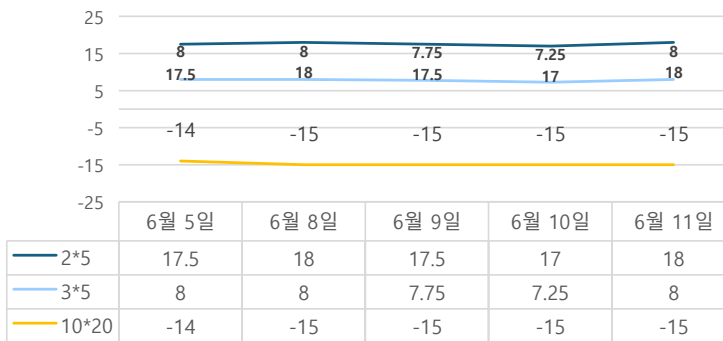
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

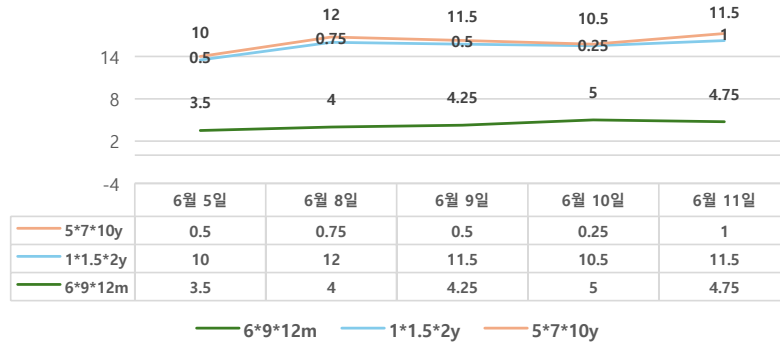


IRS 주요 커브

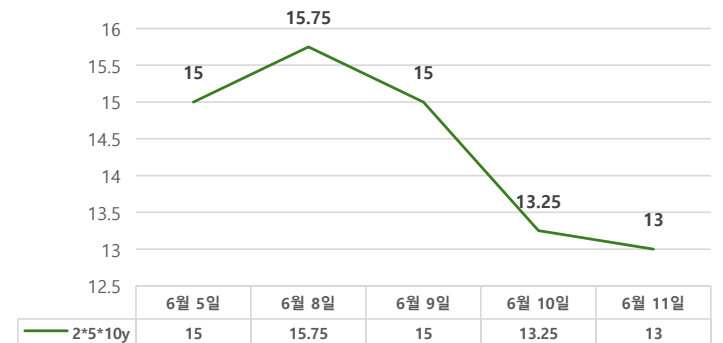
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	32.00	-3.50
1*3y	42.00	-3.25
2*5y	18.00	1.00
3*5y	8.00	0.75
5*10y	5.00	1.25
10*20y	-15.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	4.75	-0.25
1*1.5*2y	11.50	1.00
2*5*10y	13.00	-0.25
5*7*10y	1.00	0.75