

Market Daily Report

2026.06.16(화)



레포	건보자금 유입에 따른 유동성 호전 기대했으나 연이은 국고여유자금 환수 영향으로 조달 여건 호전되지 못했음. 장중 일반채·회사채 모두 난항을 겪었으며, 은행 고유계정 및 제2금융권 추가 매수에도 불구하고 정체 더디게 해소되었음.
채권	한국·국고채 금리는 전구간 하락 마감. 미국·이란 중전 합의로 WTI가 80달러 수준까지 밀리면서 시장은 향후 물가 부담 완화 가능성을 반영 다만 환율이 기대만큼 하락하지 않아 추가 강세를 제한 장 초반 국고채 3년물 금리는 3.705%까지 하락하며 강세를 보였고, 국고채 10년물 입찰도 4.115%에 무난하게 소화됨. 특히 입찰 전부터 10년 지표물인 26·6호에 외국인 매수세가 집중되며 강한 수요가 확인됐고, 외국인 매수 물량만 6천억원을 웃돈 것으로 전해짐. 다만 오후 들어서는 FOMC를 앞둔 경계심리와 중전 합의 이후 추가 강세 재료 부재로 강세 폭을 일부 반납함. 미국: 미 국채 금리는 존조 마감. 장 초반 미국·이란 중전 합의에 따른 유가 급락으로 인플레이션 우려가 완화되며 미 국채 금리 하락 출발. 다만 엔비디아의 대규모 회사채 발행과 FOMC 경계감으로 인해 강세가 오래 이어지지 못하고 되돌림이 나타남. 엔비디아는 2년~30년 만기 7개 트랜치로 총 250억달러 회사채 발행에 나섰고 수요도 850억 수준으로 강했음. 또한 케빈 워시 연준 의장의 첫 FOMC를 앞두고 관망세가 이어짐. 한편 중전 합의가 발표됐으나 이란측 매체는 MOU 에서 이란의 호르무즈 해협 통항 수수료 징수권이 인정됐다고 보도.
MONEY	기준금리 동결 가능성이 높게 예상되는 가운데, 시장의 관심은 금주(16~17일) 예정된 FOMC 정책회의에 집중되는 중. 지난주까지는 최근 미국 노동시장 강세와 높은 물가를 고려하면서, 연준이 기존의 완화적 기조를 다소 축소할 가능성도 제기 됨. 하지만 금일 미국과 이란의 중전 합의로 유가가 급락했고, 이에 인플레이션 우려가 완화되면서 연준의 추가 금리 인상 기대가 크게 후퇴. Fed Funds Futures는 올헤 25bp 이상 금리 인상 가능성을 전일 59.3%에서 49%로 낮춰 반영했으며, 금리 동결 가능성은 39.6%에서 50.6%로 상승. 시장은 중동 지역의 긴장이 완화될 경우, 에너지 가격 상승 압력이 줄어들어, FED의 긴축 필요성도 완화될 것으로 보고 있는 중. 다만 5월 미국 CPI가 전년 대비 4.2% 상승하는 등 물가 수준은 여전히 높아 향후 물가 흐름과 연준의 정책 기조가 핵심 변수로 남아 있음. 또한 이번 회의는 케빈 워시 신임 연준 의장 취임 이후 처음 열리는 FOMC 회의인 만큼, 향후 통화정책 방향과 대외 소통 방식에 변화가 있을지 관심이 집중됨과 동시에, 시장은 점도표와 기자회견을 통해 연내 금리 인상 가능성에 대한 연준의 신호를 확인 하려 할 것으로 보임. 15일 데포 마켓, 단기 기간을 중심으로 차입 레벨 상승하는 모습. 특히 대만계 상승세가 지속적으로 두드러지고 있으며, 1달은 지난주 3.90 수준에서, 3.91~3.92까지 체결 리포트. 또한 2~3달은 기존 4.05 내외의 수준에서, 지난주 후반 4.10 레벨을 형성한 데 이어, 금일 4.11~4.12까지 차입 레벨 상향 조정 되면서, 1~3달 구간 중심으로 대만계 차입 금리 상승세가 두드러지고 있음. 장기 구간으로는, 지난주 6달 비중국계 체결 레벨인 4.15에 말레이시아 네임으로부터 재펀딩 트라이 되었으나, 마켓 운용 부족으로 체결까지는 제약 됨. 이외 to 중국계 한테로 6달 4.10, 1년 4.20 레벨선에 와이드한 오퍼만 제시 된 채 마감 됨.
FX SWAP	6월 15일 외환 스와프 시장은 보험사 등의 에셋스와프 물량 위위에 재정거래 비드가 부재하며 전 구간에서 하락함. 1년물(12M)은 시초가 대비 0.40일 하락한 -13.80원에 마감했고, 6개월물(6M)은 0.20원 내린 -7.30원, 1개월물(1M)은 0.05원 하락한 -1.45원에 거래를 마침. 현물한 달러-원 환율은 미·이란이 중전 MOU 체결에 합의했다는 소식에 달러 인덱스가 99.37로, WTI가 80달러대로 내리고 외국인이 이를 연속 순매수에 나서면서 8.70원 하락한 1,511.10원에 마감함. 외환 스와프 시장에서는 보험사 에셋스와프와 국민연금 선물환 매도에 더해 한화오션의 환헤지 비율 상향까지 더해지며 중장기 오퍼 압력이 누적되고 있어, 이를 흡수할 비드의 복귀와 19일 MOU 서명 이후 자금 흐름이 향후 방향의 지표가 될 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 미국과 이란의 공식적인 중전 합의 소식에 유가가 배럴당 80달러 선으로 밀리며 현·선물 시장이 강세 플래트닝 양상을 보이자 이와 연동되어 전 구간 하락 마감함. 장 초반 미·이란 간 중전을 위한 MOU 체결과 호르무즈 해협 개방 소식이 전해지며 강세 출발하는 모습을 보임. 2*10년은 20.5-19오퍼까지 내려왔으며, 1.5*2년은 7.5-7.75까지 거래되어 커브가 움직임. 이후 국제선물과 연동되어 2년이 74/73.75에서 74에 거래, 3년이 83에 거래되어 중단기쪽 레벨이 움직임. 단기쪽으로 9개월*2년이 43/41.5에서 43 거래, 1*2년이 27/26에서 27에 비드가 강하게 올라오며 각각 거래되어 단기쪽 커브가 다소 스티프되었으며, 이후 1*2년은 28, 2년은 76.75까지 거래되어 커브가 움직임. 오후에도 계속해서 국제선물과 연동되어 움직이는 모습을 보였으며, 중단기쪽으로 비디쉬한 분위기를 보임. 2년이 76.5-76.25, 3년이 84.5-84 레벨에 꾸준히 거래되었으며, 장 막판 2년이 76.25, 3년이 84.5에 각각 초이스를 이루다 여러 차례 거래됨. 또한 10년은 96/95.5까지 대치되어 2*10년이 19.75바드 레벨까지 만들어졌으며, 1*1.5년이 19.5오퍼가 나와 단기쪽 커브가 움직임.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2026.06.09(화)	273.6	246.9	2.55%	2.513%	2.50%	2.91%	2년물	4.070%
2026.06.10(수)	275.6	238.6	2.55%	2.483%		2.94%	5년물	4.193%
2026.06.11(목)	275.4	241.3	2.54%	2.556%		2.95%	10년물	4.477%
2026.06.12(금)	275.7	245.8	2.54%	2.538%		2.92%	30년물	4.982%
2026.06.15(월)	271.9		2.53%			2.92%	10Y-2Y	40.7
								0.01

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	8,545.98	422.36	36.06.10	국고 26-6	8,409	은행채 4,000	지방채 1,000	국고채 30년 5,000억원 교환 입찰
KOSDAQ	1,034.03	4.98	27.12.15	산금	1,200	여전채 2,100	은행채 5,300	통안채 20,000 조기환매
달러-원	1,511.10원	-8.70원	29.06.10	국고 26-5	800	회사채 6,950	연전채 500	
국고3Y	3.744%	-6.4	31.03.10	국고 26-3	-799	통안채 4,000	회사채 1,650	
국고10Y	4.118%	-7.7	29.12.10	국고 19-8	-1,207	공사채 12,503	통안채 5,000	
국고10Y-3Y	37.4	-1.3	27.03.10	국고 22-1	-1,499		공사채 3,300	

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	3.68	3.62	3.65	-0.01	O/N	3.69	3.63	3.66	-0.01
T/N	3.69	3.63	3.66	-0.01	T/N	3.70	3.64	3.67	-0.01
1W	3.73	3.63	3.69	0.00	1W	3.73	3.67	3.71	0.00
1S	3.95	3.80	3.89	0.01	1S	3.95	3.85	3.90	0.00
3S	4.12	3.97	4.07	0.01	3S	4.05	3.95	4.01	0.01
6S	4.18	4.03	4.13	-0.02	6S	4.10	4.00	4.05	0.00
1YR	4.25	4.10	4.20	-0.03	1YR	4.15	4.05	4.12	0.00

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7/-3	-5	3.69	-0.15	2.50	3.60000	1M MAR	-126	-122
T/N	-7/-3	-5	3.69	-0.23	2.50	3.60100	1W*1S	-108	-102
1W	-35/-29	-32	3.59	-0.06	2.50	3.60703	1*2	-115	-105
1S	-150/-140	-145	3.69	-0.01	2.64	3.63312	1*3	-225	-215
3S	-390/-370	-380	3.92	0.04	2.93	3.67045	1*6	-550	-530
6S	-760/-700	-730	4.09	0.03	3.12	3.75101	1*9	-875	-845
1YR	-1430/-1330	-1380	4.49	0.01	3.55	3.91357	1*12	-1155	-1125

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)

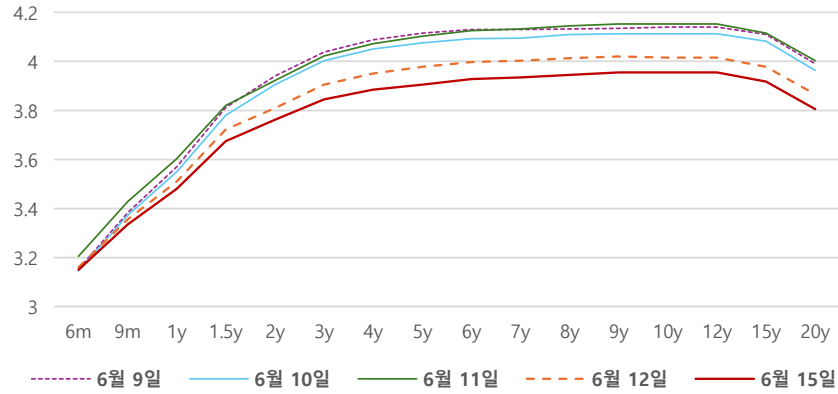
IRS 데일리 증가

6월 15일

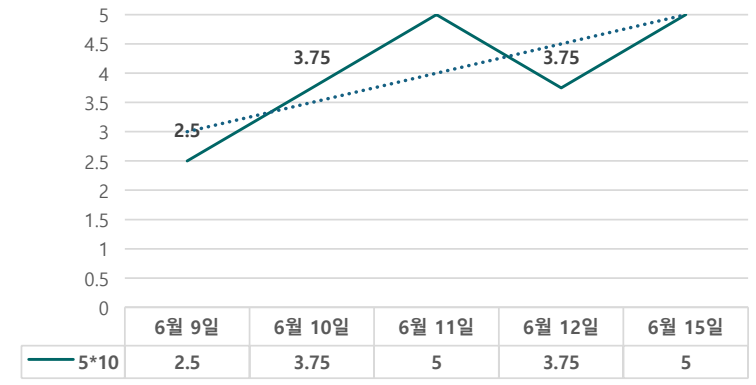
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1500	-1.00
9m	3.3350	-2.00
1y	3.4800	-3.00
1.5y	3.6750	-4.75
2y	3.7625	-4.75
3y	3.8450	-6.00
4y	3.8850	-6.50
5y	3.9050	-7.25
6y	3.9275	-7.00
7y	3.9350	-6.75
8y	3.9450	-6.75
9y	3.9550	-6.50
10y	3.9550	-6.00
12y	3.9550	-6.00
15y	3.9175	-6.00
20y	3.8050	-6.00

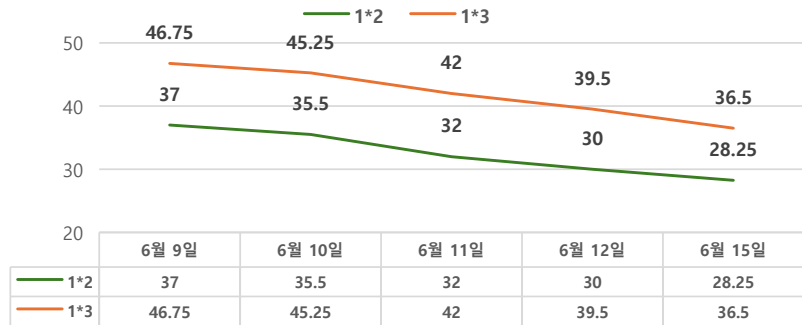
IRS 증가



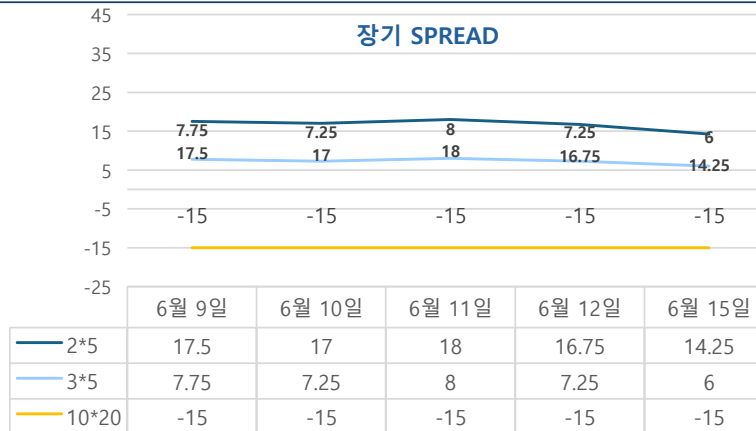
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

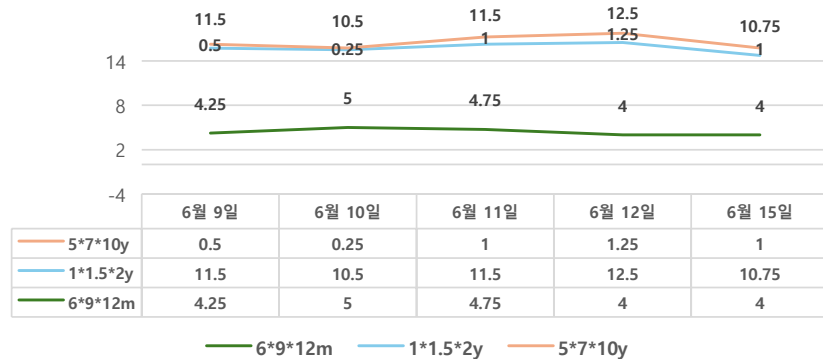


IRS 주요 커브

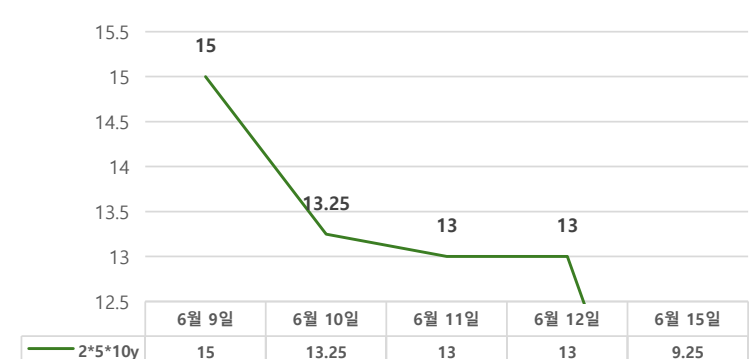
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	28.25	-1.75
1*3y	36.50	-3.00
2*5y	14.25	-2.50
3*5y	6.00	-1.25
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	4.00	0.00
1*1.5*2y	10.75	-1.75
2*5*10y	9.25	-3.75
5*7*10y	1.00	-0.25