

Market Daily Report

2026.06.17(수)



레포	근래의 빠듯했던 장세 반영되어 금리 보험(2.53%) 출발했으나 건보자금 유입됨에 따라 단기 유동성 크게 호전되었음. 제2금융권 매수 증가 두드러졌으며, 장중 잉여 분위기 심화되어 일반채 체결금리 하락하였음.
채권	한국 :국고채 금리는 혼조 마감. 장전 미국과 이란의 종전 합의로 국제유가가 5% 가까이 급락했으나 미 국채 금리는 크게 강세를 띄지는 않음. 일본은행(BOJ) 및 호주중앙은행(RBA) 금리 결정을 앞두고 경계감이 더해지면서 오전 중에는 대체로 약세 분위기가 이어짐. 특히 오전부터 국고채 30년물에 대한 일부 손절 움직임이 나오면서 10년 국채선물 위주로 약세폭을 키우기도 함. 이 가운데 이날 국채선물 만기일을 맞아 오전 중 막바지 월물교체가 진행됨. 오후 중 전해진 BOJ는 기준금리 1% 인상, RBA의 금리 동결 결정은 시장 예상에 부합하며 시장 영향력이 크지는 않았음. 한편, 장 막판 공개된 5월 금융통화위원회 의사록에 따르면 한 금통위원은 "금리인상 시점과 속도에 대한 메시지 관리가 중요한 시점"이라고 진단함. 미국: 미 3대 주가 지수는 혼조 마감. 미-이란의 종전양해각서(MOU) 체결 이후 지정학적 불안이 완화되자 주가 지수별 디커플링이 나타남. 미국과 이란이 MOU 체결 이후 세부 조항과 관련해 언론의 추측성 보도가 이어지고 있으나 미 정부는 금주 내로 구체적인 내용을 공개한다는 입장만 고수. 또한 나스닥 100 지수에 편입 예정인 스페이스X로 인해 기술주 매도가 이어졌고 이와 반대로 경기순환주*우량주 위주의 다우지수는 상승 마감. 업종별로는 기술은 하락 마감했고 금융은 상승 마감.
MONEY	금주 수요일 FOMC 회의에서는 금리 동결이 확실시되는 가운데, 시장의 관심은 워시 신임 의장의 첫 기자회견에 집중됐음. 가이던스 최소화 기조가 예상되나, 추가 인상 가능성을 열어두는 발언이 나올 경우 금리 재상승 압력이 불가피할 것으로 관측됨. 현재 CME FedWatch 기준 12월 인상 가능성은 50%수준으로, 이 같은 불확실성을 반영해 16일 장, 한국계는 1주~5개월물 구간에서 차입수요가 제한되며 거래가 소강상태를 보였음. 6개월물은 4.05~4.10%, 1년물은 4.15~4.20% 수준에서 차입수요가 형성됐으며, 대만계 및 중국계렌더로부터 3개월~1년 구간 오퍼가 집중됐으나 실제 체결은 6개월물 4.14%에서만 성사됐음. 1개월물의 경우 중국계 대상으로 3.95% 오퍼가 제시됐으나 3bp 차이로 체결에 이르지 못했음. 한편 연말 인상 기대가 시장에 상당 부분 선반영된 영향으로, 7개월~1년 구간 유럽계 금리는 추가 상승이 제한되며 소폭씩 하향 조정되는 흐름을 보였음.
FX SWAP	6월 16일 외환 스와프 시장은 에셋스와프 물량이 집중된 장기물과 비드가 유입된 단기물의 흐름이 엇갈리며 장단기 혼조세를 보임. 1년물(12M)은 보험사 에셋스와프 오퍼가 우위를 보이며 시초가 대비 0.70원 하락한 -14.50원에 마감한 반면, 6개월물(6M)은 -7.30원 보합, 1개월물(1M)은 단기 구간에 비드가 되살아나며 0.10원 상승한 -1.30원에 거래를 마침. 현물환 달러-원 환율은 외국인의 3거래일 연속 코스피 순매수에도 종전 MOU 서명 전 불확실성과 케빈 워시 신임 의장의 첫 FOMC를 앞둔 관망 심리에 1,510원대 초중반 레인지를 유지하며 전장 대비 0.50원 오른 1,511.60원에 강보합 마감함. 외환 스와프 시장에서는 단기물 비드 회복이 외국인 매도세 진정이라는 긍정적 신호를 반영하는 반면 중장기 구간은 에셋-국민연금-한화오션발 구조적 오퍼 압력이 지속되고 있어, FOMC에서 확인될 미 금리 경로와 19일 미-이란 MOU 서명 이후 자금 흐름이 주요 변수로 보임.
IRS	전일 IRS는 혼조세 마감. 미국과 이란의 종전 합의 이후 국제유가 하락 기대감이 이어지는 가운데, 그간 시장에 과도하게 반영되었던 기준금리 인상 시기와 폭에 대한 우려가 완화되는 분위기를 보이며 중단기 위주로 하락 마감. 다만 BOJ의 31년 만의 금리 인상(1%) 및 테이퍼링 중단 결정과 매파적인 RBA 동결 등의 대외 이벤트를 소화하며 장기적으로는 약세를 나타냄. 장 초반 1*2년이 28.5-30비드까지 올라와 여러 차례 거래되고 비드는 분위기를 보였으며, 1*1.5년 20오퍼와 얹어 1.5*2년이 레깅으로 10에 거래됨. 10*20년이 -14.5-12까지 계속해서 올라오며 초장기쪽 커브가 움직였으며, 2*10년이 20에 거래됨. 단기쪽으로는 6*9*12개월 나비가 4.25/04에 대치되었으며, 9개월이 33.5-32오퍼까지 내려오며 거래됨. 오후 들어 5*10년이 05-6.5비드까지 올라와 6.5에 거래되어 장기 테너가 스티프닝되었으며, 2년이 국채선물과 연동되어 76.75-76까지 초이스 분위기를 보이며 계속해서 거래됨. 이후 3*10년 13.5오퍼와 3*5년 07비드가 얹인 5*10년이 6.5에 한 차례 거래되었으며, 오전부터 대치중이던 6*9*12개월 나비 비드가 올라오며 4.25에 거래되고 비드는 분위기를 보임. 9*12개월 13.5오퍼와 1년 44비드가 얹인 9개월이 30.5비드까지만 들어져 레깅으로 거래되었으며, 9개월*2년이 43/42.5에 대치되다가 오퍼가 내려오며 42.5에 여러 차례 거래됨. 장 막판 5*10년이 6.75-07까지 여러 차례 거래된 후 10년이 97-98비드까지 올라와 장기쪽 커브가 강하게 스티프닝되었으며, 3년이 82.5/82.25에 대치됨. 마감 이후 3년이 82.25에 여러 차례 거래되었으며, 10년이 97.25오퍼로 나눔.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2026.06.10(수)	275.6	238.6	2.55%	2.483%	2.50%	2.94%	2년물	4.056%
2026.06.11(목)	275.4	241.3	2.54%	2.556%		2.95%	5년물	4.165%
2026.06.12(금)	275.7	245.8	2.54%	2.538%		2.92%	10년물	4.441%
2026.06.15(월)	271.9	247.9	2.53%	2.547%		2.92%	30년물	4.944%
2026.06.16(화)	274.7		2.53%			2.92%	10Y-2Y	38.5
								-0.02

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	8,726.60	180.62	27.06.10	국고 24-4	2,000	은행채 6,000	은행채 13,500	통안채 3년물 10,000억원 입찰
KOSDAQ	1,018.68	-15.35	27.06.10	국고 17-3	1,801	여전채 2,097	여전채 600	재정증권 63일물 10,000억원 입찰
달러-원	1,511.60원	0.50원	36.06.10	국고 26-6	1,746	회사채 1,750	회사채 770	
국고3Y	3.717%	-2.7	31.03.10	국고 26-3	-700	공사채 1,400		
국고10Y	4.110%	-0.8	56.03.10	국고 26-2	-783			
국고10Y-3Y	39.3	1.9	28.06.10	국고 25-4	-1,699			

Money Market Closing								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가
O/N	3.68	3.62	3.65	0.00	O/N	3.71	3.65	3.68
T/N	3.69	3.63	3.66	0.00	T/N	3.72	3.66	3.69
1W	3.75	3.65	3.70	0.01	1W	3.74	3.68	3.72
1S	3.95	3.80	3.90	0.01	1S	3.95	3.85	3.92
3S	4.12	3.97	4.07	0.00	3S	4.05	3.95	4.01
6S	4.18	4.03	4.14	0.01	6S	4.10	4.00	4.05
1YR	4.24	4.09	4.21	0.01	1YR	4.15	4.05	4.12

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID
O/N	-6/-2	-4	3.45	-0.24	2.50	3.65000	1M MAR	-106
T/N	-5/-1	-3	3.21	-0.48	2.50	3.64957	1W*1S	-98
1W	-30/-24	-27	3.42	-0.17	2.50	3.64702	1*2	-115
1S	-135/-125	-130	3.61	-0.09	2.64	3.63639	1*3	-215
3S	-390/-370	-380	3.94	0.02	2.94	3.66747	1*6	-560
6S	-760/-700	-730	4.09	0.00	3.12	3.73413	1*9	-930
1YR	-1500/-1400	-1450	4.53	0.03	3.54	3.88565	1*12	-1220

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)

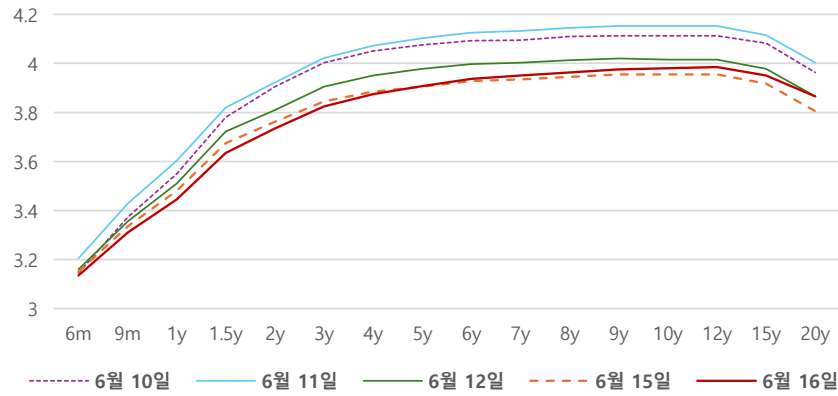
IRS 데일리 증가

6월 16일

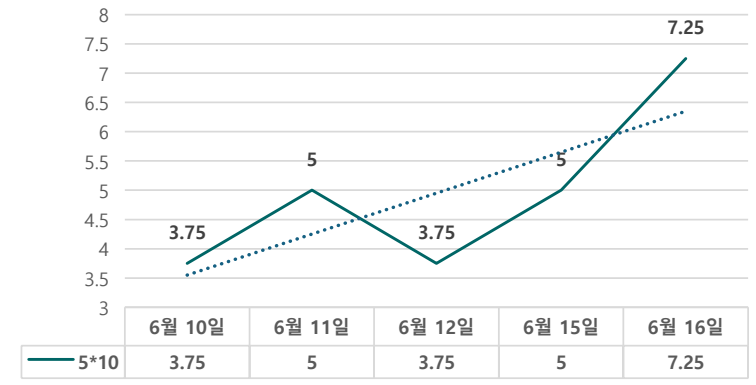
단위 : % bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1350	-1.50
9m	3.3100	-2.50
1y	3.4450	-3.50
1.5y	3.6350	-4.00
2y	3.7350	-2.75
3y	3.8250	-2.00
4y	3.8750	-1.00
5y	3.9075	0.25
6y	3.9375	1.00
7y	3.9500	1.50
8y	3.9625	1.75
9y	3.9750	2.00
10y	3.9800	2.50
12y	3.9850	3.00
15y	3.9500	3.25
20y	3.8650	6.00

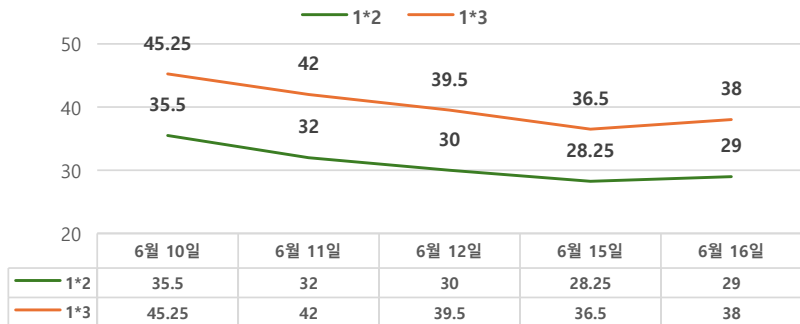
IRS 증가



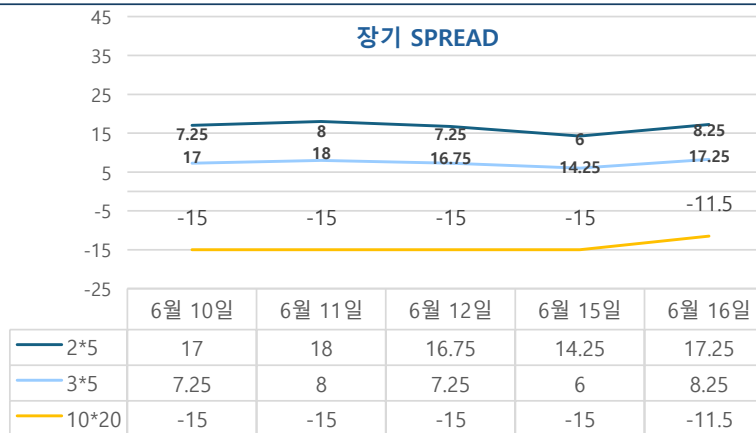
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

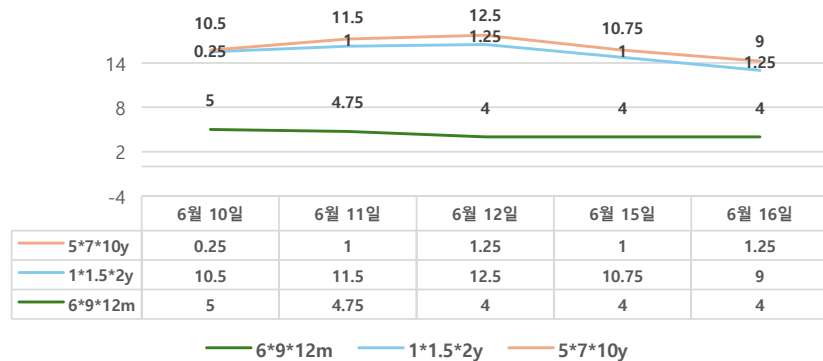


IRS 주요 커브

SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	29.00	0.75
1*3y	38.00	1.50
2*5y	17.25	3.00
3*5y	8.25	2.25
5*10y	7.25	2.25
10*20y	-11.50	3.50

주요 FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	4.00	0.00
1*1.5*2y	9.00	-1.75
2*5*10y	10.00	0.75
5*7*10y	1.25	0.25

2*5*10y FLY

