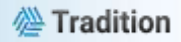


Market Daily Report



2026.06.30(화)

레포	은행 고유계정 매수세 강해 일반채 해소 원활했으며, 분기말 환매 대기자금 운용되어 회사채 정제도 이른 시간에 해소되었음. 장중 일부 저금리 매칭되는 등 익일물 조달 여건 양호했던 반면, 기일물 매수 급감하여 체결금리 3%를 상회하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 초장기를 중심 상승 마감. 달러-원 환율 급등과 2년물-30년물 입찰을 앞둔 수급 부담이 악재 재료로 작용함. 지난주 GPU 물량 확보 관련 추경 가능성 언급도 경계감을 키우며 장기물 악세를 자극함. 추가 하락과 환율 상승이 동반되며 채권시장도 조정을 받는 트리를 악재 흐름이 이어짐. 국고채 2년물 입찰은 3.665%에 낙찰됐고 시장은 다음날 예정된 3조1천억원 규모 30년물 입찰 결과를 주시하는 모습. WGBI 관련 외국인 수요는 일부 유입되며 하단을 지지함. 미국 : 미 국채 금리는 중단기물의 상대적 악세 속에 보험권 혼조세 마감. 주말 미국과 이란의 무력 충돌 여파로 국제유가가 반등하며 연내 금리 인상 기대가 소폭 강화됨. 다만 중 동 경제와 6월 고용보고서를 앞둔 경계심에 변동성은 제한됨. 시장은 6월 비농업부문 고용이 11만명대 증가할 것으로 예상. 케빈 워시 연중 의장의 신트라 포럼 발언도 대기
MONEY	29일, 월말 커브 수요에 따른 중국계-대만계의 강한 1주일 차입 수요가 유입되며, 중국계와는 1주 4.00%, 대만계와는 1주 3.97~3.93% 수준에서 거래됨. 온/오프서 렌더로부터 월말 밸류 1개월~3개월 오피어 시도가 있었으나, 월 마감이 마무리되어 가는 시점인 만큼 7월 초 스타트 기간을 수요가 대거 제시됨. 반기말 커브 구간 프리미엄이 감안된 가격으로 최종적으로 대만계 네임과 2개월 4.10, 3개월물 4.05%에 거래 체결됨. 오후 들어 유롭게 은행으로부터 6개월 4.05~4.07%, 9개월 4.15~4.19%, 1년 4.30~4.33% 비드가 제시됐으며, 전 영업일 대비 큰 변동은 없었으나 체결 소식은 확인되지 않았음.
FX SWAP	6월 29일 외환 스와프 시장은 반기-반기말이 겹친 가운데 초단기를 탐색이 이례적 급등세를 보인 반면 중장기물은 에셋스와프 물량에 조정받으며 구간별로 엇갈림. 1년물(12M)은 에셋스와프 물량을 소화하며 시초가 대비 0.20원 상승에 그친 -14.80원에 마감했고, 6개월물(6M)은 0.40원 하락한 -7.30원, 1개월물(1M)은 0.10원 내린 -0.75원으로 중기 구간은 오히려 조정을 받음. 반면 탐색(TN)은 반기말을 하루 앞두고 증권사-외국계 은행 등 일부 기관의 원화 조달 여건이 빠듯해지면서 시초가 대비 0.58원 급등한 +0.60원에 마감했는데, 단순한 원화 부족을 넘어 단기 자금시장 수급이 한쪽으로 쏠린 결과로 보임. 현물환 달러-원 환율은 외국인 코스피 7.7조원 순매도에 따른 코스피 매수가 상방을 주도하며 전장 대비 13.20원 급등한 1,545.20원에 마감했고, 당국 경계감과 월말-반기말 네고, 스무딩 추정 물량이 1,550원선을 막음. 외환 스와프 시장에서 초단기 급등은 7/1 밸류로 반기말을 넘기면 오피어 재개와 함께 빠르게 정상화될 일시적 현상으로 보이나, 커스터디 셀엔바이와 7월 인상 선반영이 깔린 1~3개월 구간의 비드는 금통위 통과 전까지 쉽게 식지 않을 가능성이 있어 월초 어느 정도의 되돌림이 있을지가 주요할 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 달러-원 환율 급등과 추경 편성 우려, 및 차주 예정된 3조 1천억 원 규모의 국고채 30년물 입찰 부담으로 현물 초장기물 금리가 급등(악세 스티프닝)한 가운데, IRS 금리는 장기 구간 위주로 상승 마감. 장 초반 2*3년 09비드와 3년 83오피어가 엮여 2년이 74오피어까지 만들어졌으며 이후 3년이 83에 거래되고 오피어 분위기를 보임. 10년 이 98.5/98에 대치되다가 98.25에 만나서 여러 차례 거래되었으며, 2*5년이 16.5-17까지 비드가 올라오며 여러 차례 거래되어 커브가 스티프닝됨. 7년 이 국채선물과 연동되어 95.5-96.5까지 계속해서 거래되었으며, 오후 들어 2년이 73-72.5까지 여러 차례 거래됨. 장기쪽으로 20년이 93-93.5오피어, 15년이 98-98.5비드로 올라오며 15*20년이 -5오피어만 들어졌으며, 1*3*10년 나비가 21.25-21까지 오피어가 내려와 거래되어 중장기쪽 커브 레벨이 움직임. 마감 이후 4년이 87.5에 거래되고 비드온 분위기를 보였으며, 2년이 83.5/82.5에 대치됨.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비		단위 : bp	
2026.06.22(월)	276.9	249.3	2.54%	2.551%	2.50%	2.92%	2년물	4.109%	1.50	
2026.06.23(화)	275.8	247.3	2.53%	2.545%		2.92%	5년물	4.144%	1.20	
2026.06.24(수)	277.9	242.0	2.53%	2.543%		2.92%	10년물	4.377%	0.50	
2026.06.25(목)	278.1	238.6	2.54%	2.550%		2.92%	30년물	4.865%	-0.10	
2026.06.29(월)	274.2		2.54%			2.92%	10Y-2Y	26.8	-0.01	

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	8,394.65	-16.56	31.12.10	국고 21-11	2,006	지방채 3212	지방채 4695	국고채 30년 31000억원 입찰
KOSDAQ	920.57	69.20	27.06.10	외평	1,000	은행채 500	은행채 1800	
달러-원	1,545.20원	13.20원	29.03.03	통안	500	여전채 3300	여전채 1130	
국고3Y	3.733%	1.1	31.03.10	국고 26-3	-727	회사채 1175	회사채 1320	
국고10Y	4.144%	2.7	28.12.10	국고 25-10	-933	통안채 5000	통안채 5000	
국고10Y-3Y	41.1	1.6	34.12.10	국고 24-13	-1,743	공사채 5469	공사채 2375	

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	3.65	3.59	3.62	0.00	O/N	3.70	3.65	3.67	0.02
T/N	3.95	3.80	3.85	0.22	T/N	3.95	3.85	3.90	0.24
1W	3.80	3.70	3.72	-0.19	1W	3.83	3.73	3.78	-0.17
1S	3.98	3.88	3.92	-0.03	1S	3.95	3.85	3.90	-0.06
3S	4.15	4.00	4.05	-0.08	3S	4.10	4.00	4.05	-0.05
6S	4.20	4.05	4.15	-0.04	6S	4.15	4.05	4.10	0.00
1YR	4.40	4.25	4.32	-0.05	1YR	4.30	4.20	4.25	0.00

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-3/1	-1	2.73	-0.24	2.50	3.64000	1M MAR	-24	-20
T/N	58/62	60	-11.47	-14.50	2.50	3.64012	1W*1S	-38	-32
1W	-3/3	0	2.50	0.50	2.50	3.64083	1*2	-80	-70
1S	-80/-70	-75	3.21	0.08	2.68	3.64392	1*3	-180	-170
3S	-300/-280	-290	3.76	0.03	3.02	3.73222	1*6	-540	-520
6S	-760/-700	-730	4.17	0.05	3.24	3.84627	1*9	-880	-850
1YR	-1530/-1430	-1480	4.66	0.00	3.67	3.99367	1*12	-1185	-1155

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)

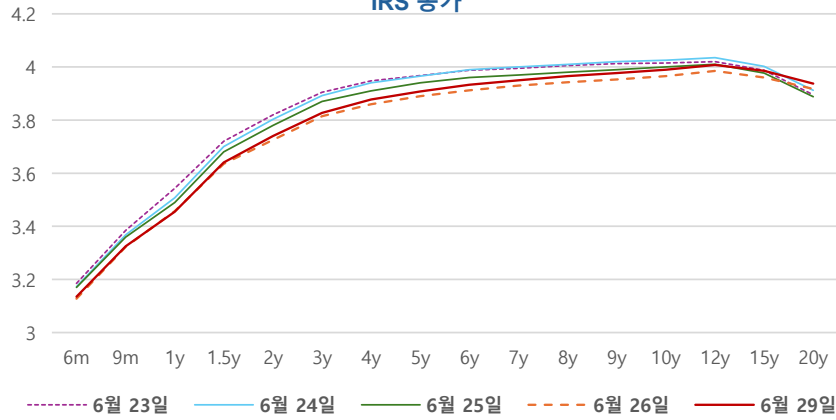
IRS 데일리 증가

6월 29일

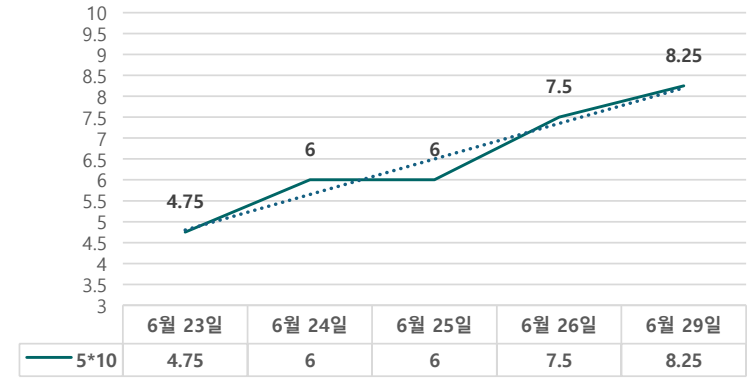
단위 : % , bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1350	0.75
9m	3.3250	0.25
1y	3.4550	-0.25
1.5y	3.6400	0.50
2y	3.7400	1.50
3y	3.8275	1.25
4y	3.8775	1.75
5y	3.9075	1.75
6y	3.9325	2.00
7y	3.9500	2.00
8y	3.9650	2.25
9y	3.9775	2.50
10y	3.9900	2.50
12y	4.0075	2.25
15y	3.9850	2.50
20y	3.9375	2.00

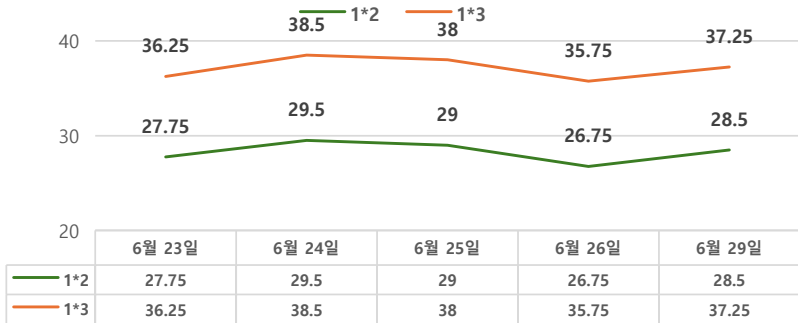
IRS 증가



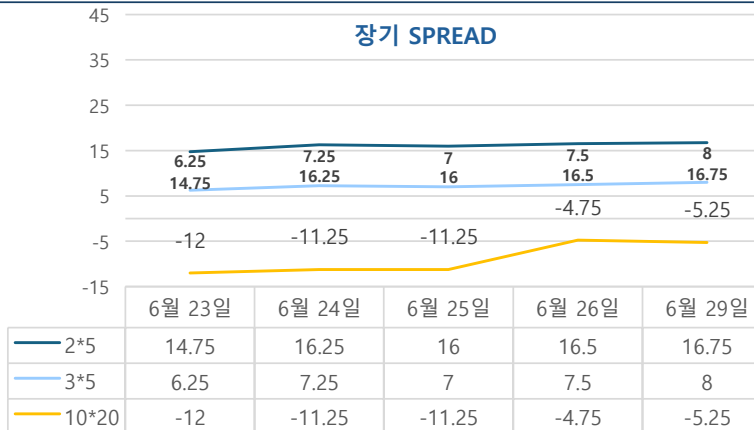
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

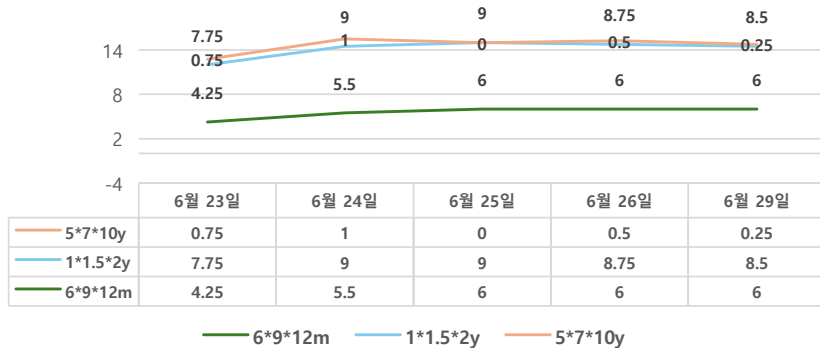


IRS 주요 커브

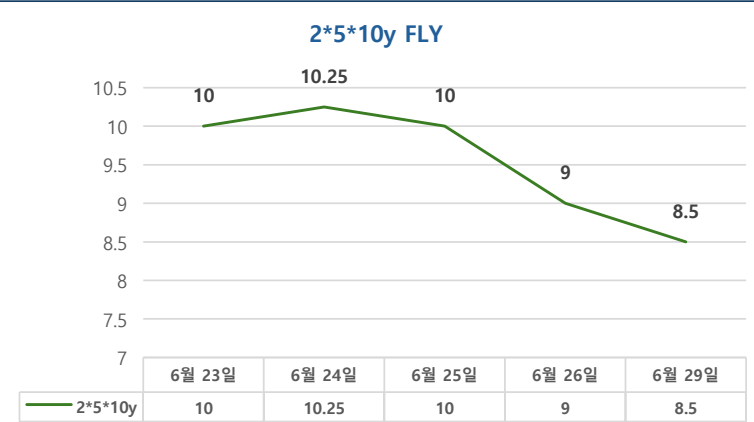
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	28.50	1.75
1*3y	37.25	1.50
2*5y	16.75	0.25
3*5y	8.00	0.50
5*10y	8.25	0.75
10*20y	-5.25	-0.50

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	6.00	0.00
1*1.5*2y	8.50	-0.25
2*5*10y	8.50	-0.50
5*7*10y	0.25	-0.25