

Market Daily Report

2026.07.07(화)



레포	은행 신탁계정 및 제2금융권 매수에 강해 초반부터 저금리 거래 활발했으며, 일반채·회사채 모두 일시에 소진되었음. 장중 매수 대기했으나 추가 조달 수요 크지 않아 잉여 분위가 지속되었고, 익일 시작 기일을 금리 또한 소폭 하락하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 전구간 상승 마감. 달러-원 환율 반등이 채권시장 약세 압력으로 작용했고 장중 코스피 반락에 따른 안전자산 선호로 강세를 보이기도 했으나 장 막판 다시 약세로 전환함. 국고채 3년물 입찰은 시장금리 대비 다소 약하게 평가됨. 오후에는 일본 10년물 국채금리가 약 30년 만의 최고치를 기록하며 국내 금리 상승 압력을 더함. 시장은 환율과 해외 금리 흐름을 주시하며 제한적인 움직임을 이어가는 모습. 미국 : 미 국채 금리는 전구간 하락 마감. 6월 ISM 서비스업 PMI는 54.0으로 예상치에 부합했고 물가지수는 67.7로 전월(71.3) 대비 하락하며 물가 압력이 완화된 모습을 보임. 반면 고용지수는 51.2로 기준선을 회복하며 고용시장 견조함을 시사함. 시장은 이번 주 예정된 미 국채 입찰(3년물 580억달러·10년물 390억달러·30년물 220억달러)과 8월 공개되는 FOMC 의사록을 앞두고 관망세를 이어가는 모습.
MONEY	미국의 6월 고용지표 부진으로 연준의 추가 금리 인상 기대가 약화되면서, 시장은 올해 추가 금리 인상 가능성을 낮춰 반영하고 있음. 또한 최근 국채유가 하락으로 인플레이션 우려도 다소 완화되고 있음. 다만 실업률 하락 등 노동시장은 여전히 견조한 모습을 유지하고 있어 FED가 당장 완화된 기조로 전환하기보다는, 기존의 긴축 기조를 유지할 가능성이 있다는 의견도 제기되는 중. 이에 시장은 이번 주 공개되는 6월 FOMC 의사록을 통해 연준 위원들의 향후 금리 전망과 정책 기조를 확인하는 데 주목하고 있음. 6월 데포마켓, 연준의 긴축 기조 완화 기대가 반영되며, 1달 이상 기간물을 중심으로 마켓 렌딩이 확대되는 모습을 나타냄. 특히 중국계의 경우 기존 2달 4.00, 3달 4.05, 6달 4.13, 1년 4.25 오퍼 수준에서, 금일 낮게는 2달 3.92, 3달 4.00, 6달 4.10, 1년 4.20 레벨로 조정되며, 전반적으로 3~5bp 가량 운용 레벨을 하향 조율. 비중국계 한테로는 2달 4.03, 3달 4.04~4.05, 6달 4.18 수준의 마켓 오퍼가 제시됐으며, 대만계 2달 4.03, 3달 4.10 체결 리포트 됨. 차입 수요가 제한적인 영향으로 한국계 및 온소와의 거래는 제약 됨. 반면 1달 이하의 단기 구간은 중국계를 중심으로 견조한 펀딩 기조가 이어지며 큰 폭의 레벨 변화 없이 마감. 중국계 1주 3.70~3.72, 1달 3.80~3.85, 대만계는 1주 3.67, 1달 3.78 수준에서 마감.
FX SWAP	7월 6일 외환 스왑프 시장은 반기말 금등분을 되돌리는 흐름이 이어지며 단기를 중심으로 하락함. 1년물(12M)과 6개월물(6M)은 각각 -14.60원, -7.40원 보합에 그친 반면, 1개월물(1M)은 시초가 대비 0.20원 내린 -1.30원에 마감함. 지난달 말 반기말 원화 조달 쓸림에 ON이 한때 +11.10원까지 치솟았던 이후 초단기물부터 되돌림이 진행돼 왔는데, 이날은 그 여파가 1~3개월 구간까지 번지며 단기를 전반이 무거운 흐름을 보임. 현물환 달러-원은 24시간 개장 첫날을 맞은 가운데 달러-엔이 162엔대로 다시 올라서는 강달러와 외국인의 12개월 연속 코스피 순매도에 지난 금요일 급락분을 일부 되돌리며 전장 대비 4.70원 오른 1,530.30원에 마감함. 외환 스왑프시장은 반기말 외곽이 걸친 자리에서 단기 구간이 제 레벨을 찾아가는 정상화가 이어지는 가운데, SK하이닉스 ADR 상장예 따른 대규모 달러 유입 시점과 외국인 매도 지속 여부가 향후 주요 변수로 보임.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 환율 반등과 일본 금리 급등, 국고 3년물 입찰 부진으로 약세를 보였던 현물 시장과 달러 IRS는 분기 초 원화 유동성이 시중에 풀리면서 KOFR 등 단기 자금시장이 안정되자, 중단기 구간을 중심으로 오퍼가 유입되며 강세를 보였던 분위기가, 장 초반 5*10년이 06-07비드까지 올라오며 중장기쪽 커브가 스틱되었으며, 2*3년이 8.75-09에 ND로 계속해서 거래되며 커브가 움직임. 2*10년이 23.75비드가 나오자마자 거래되었으며, 2년이 국채선물과 연동되어 77에 거래되고 이후 76.5까지 내려와 초이스 분위기를 이루며 계속해서 거래됨. 오후 들어 국채선물이 일본 등 대외금리의 영향을 받아 장기물을 중심으로 하락 반전하며 10년 00거래 이후 장 막판 01까지 거래가 이루어졌으며, 초장기쪽 오퍼가 우세하여 15년, 20년쪽 오퍼가 비드를 찾는 분위기를 보임. 단기쪽으로 1년이 49.25, 9개월이 33.5 레벨에 계속해서 거래되었으며, 9*12개월이 계속해서 대치됨. 마감 이후 9*12개월 16오퍼와 1년 49비드가 엮인 9개월이 33에 거래되었으며, 2년이 77.5/77에 대치되었으나 거래 없이 리퍼됨.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리			
단위: 조 원						한국시간 오전 07:05 기준			
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비	
2026.06.30(화)	276.2	224.3	2.58%	2.650%	2.50%	2.92%	2년물	4.114%	-2.70
2026.07.01(수)	278.3	231.0	2.53%	2.508%		2.92%	5년물	4.202%	-3.20
2026.07.02(목)	272.9	239.7	2.50%	2.429%		2.92%	10년물	4.470%	-9.50
2026.07.03(금)	269.3	242.9	2.45%	2.435%		2.92%	30년물	4.986%	-0.30
2026.07.06(월)	270.7		2.45%			2.92%	10Y-2Y	35.6	-0.07

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투업 최종호가수익률			단위 : 조 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	8,051.33	-37.01	27.03.10	국고 25-1	1,900	은행채 6000	은행채 1400	
KOSDAQ	847.07	-21.34	28.09.10	국고 23-6	1,182	여전채 2300	여전채 2400	
달러-원	1,530.30원	4.70원	28.07.02	통안	1,000	통안채 6200	회사채 120	
국고3Y	3.776%	2.8	28.12.10	국고 25-10	-740	공사채 6740	통안채 5000	
국고10Y	4.203%	0.6	28.06.10	국고 25-4	-821			
국고10Y-3Y	42.7	-2.2	27.06.10	국고 17-3	-1,200			

Money Market Closing									
단위 : % , %p									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	3.66	3.60	3.63	-0.01	O/N	3.66	3.63	3.64	0.00
T/N	3.67	3.61	3.64	-0.01	T/N	3.67	3.64	3.65	0.00
1W	3.72	3.62	3.68	0.00	1W	3.72	3.67	3.70	0.00
1S	3.80	3.70	3.77	0.02	1S	3.82	3.77	3.78	0.00
3S	4.12	4.02	4.08	-0.02	3S	4.05	3.95	4.00	-0.06
6S	4.20	4.50	4.16	-0.02	6S	4.15	4.05	4.08	-0.02
1YR	4.40	4.25	4.35	-0.05	1YR	4.25	4.15	4.20	-0.05

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
							단위 : 전, % , %p		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-4	-6	3.91	0.23	2.50	3.66000	1M MAR	-89	-85
T/N	-8/-4	-6	3.91	0.23	2.50	3.67949	1W*1S	-80	-74
1W	-38/-32	-35	3.68	0.19	2.50	3.67640	1*2	-95	-85
1S	-135/-125	-130	3.60	0.12	2.67	3.66738	1*3	-195	-185
3S	-360/-340	-350	3.95	0.05	3.05	3.75202	1*6	-540	-520
6S	-770/-710	-740	4.25	-0.02	3.29	3.87192	1*9	-845	-815
1YR	-1510/-1410	-1460	4.72	-0.01	3.73	4.02612	1*12	-1135	-1105

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)

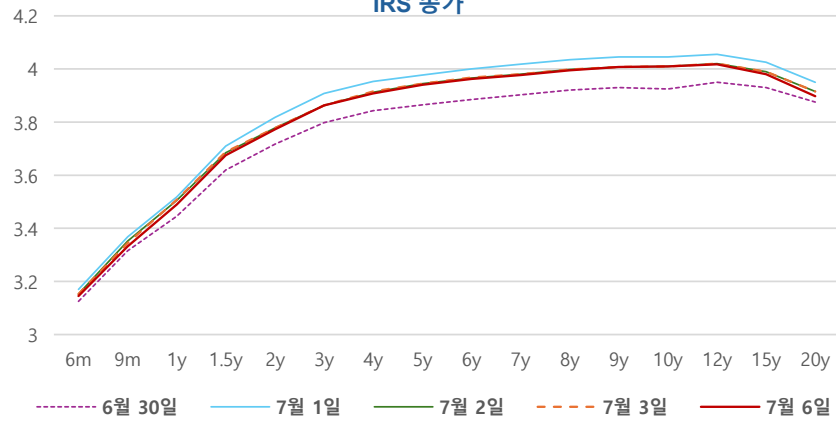
IRS 데일리 증가

7월 6일

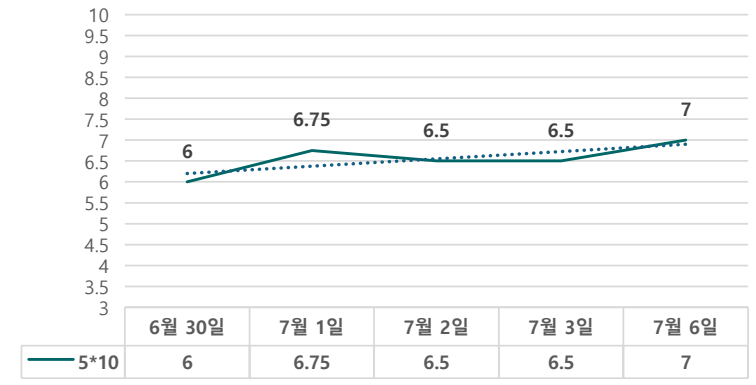
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.1450	-0.75
9m	3.3325	-1.25
1y	3.4900	-1.75
1.5y	3.6750	-1.25
2y	3.7725	-0.50
3y	3.8625	0.00
4y	3.9075	-0.75
5y	3.9400	-0.50
6y	3.9625	-0.50
7y	3.9775	-0.25
8y	3.9950	-0.25
9y	4.0075	0.00
10y	4.0100	0.00
12y	4.0175	-0.25
15y	3.9800	-1.00
20y	3.8975	-1.75

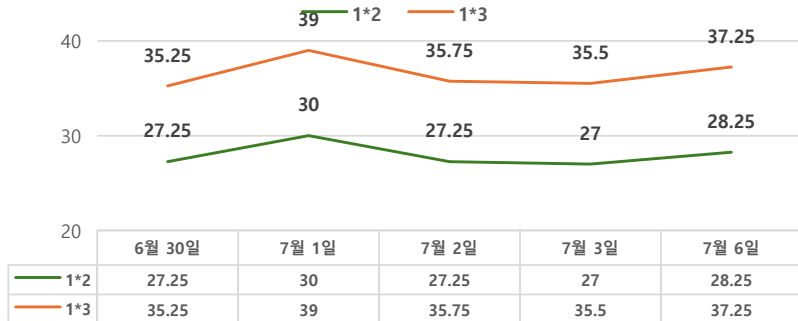
IRS 증가



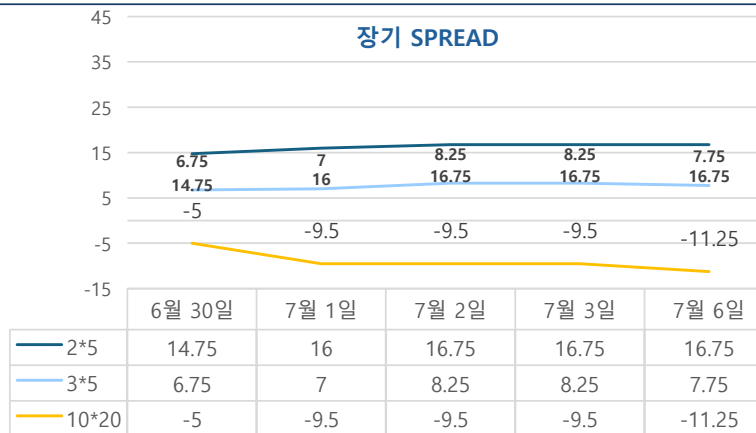
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

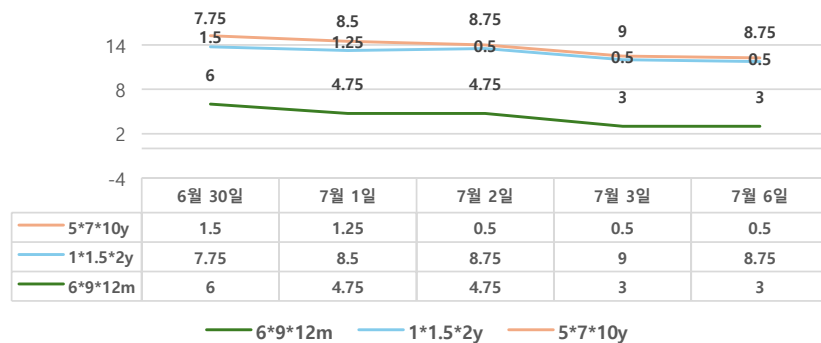


IRS 주요 커브

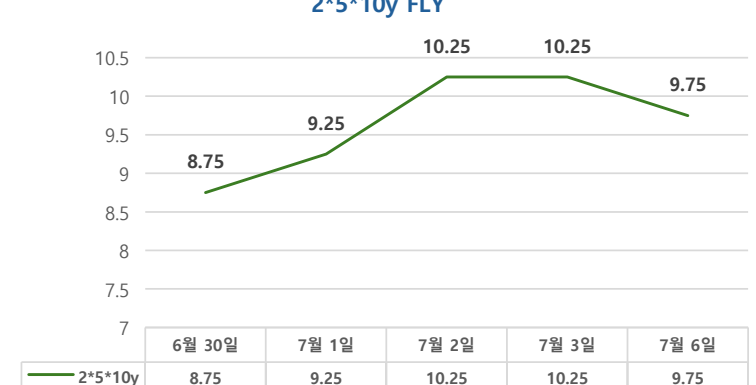
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	28.25	1.25
1*3y	37.25	1.75
2*5y	16.75	0.00
3*5y	7.75	-0.50
5*10y	7.00	0.50
10*20y	-11.25	-1.75

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	3.00	0.00
1*1.5*2y	8.75	-0.25
2*5*10y	9.75	-0.50
5*7*10y	0.50	0.00