Market Daily Report

2026.10.16(금)

Tradition

레포	근래의 빠듯했던 장세 반영되어 레포금리 소폭 상승(3.03%→3.04%) 출발했으나 장중 은행(고유·신탁) 및 제2금융권 추가 매수 이어져 별다른 어려움 없이 마감하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 전구간 하락 마감. 미국 9월 CPI가 대체로 예상을 웃돌았지만 기술주 급락으로 미 국채 장기금리가 하락한 가운데 코스피와 코스닥이 각각 7% 넘게 폭락하며 위험회피 심리가 채권시장 강세를 이끔. 아시아장에서 미국과 일본 국채 금리가 큰 폭으로 하락하고 국제유가도 약세를 보이면서 10년물 금리는 6.8bp 내린 4.193%. 시장은 반도체 투자 지속성에 대한 우려와 국내 증시 흐름을 주시하는 가운데 미국 소매판매와 PPI를 통해 추가 강세 여부를 가늠하려는 모습. 미국 :미 국채 금리는 전구간 하락 마감. 9월 헤드라인 PPI가 전월 대비 1.3% 올라 예상치 0.5%를 크게 웃돌고 근원 PPI도 0.7% 상승해 예상치 0.3%를 상회했지만 AI와 반도체주 약세에 따른 위험회피 수요가 물가 충격을 압도하며 국채 매수세가 유입됨. 10년물 금리는 장중 5.037%까지 하락한 뒤 증시 반등에 낙폭을 일부 되돌렸지만 5.061%에서 마감했고 30년물도 5.408% 수준까지 내려 장기물 강세가 두드러짐.
MONEY	15일 머니마켓, 단기물은 월말 커버, 장기물은 6개월 이상 달러 확보 수요 중심으로 나뉨. 단기물은 역외 일본계·싱가폴계·중국계가 2주 4.00, 1개월 4.05·4.02에 차입한 이후 비드를 하향 조정했으나, 렌더 측은 레벨을 고수하며 소극적인 운용 태도를 보임. 장기물은 시은 해외지점들로부터 다양한 기간과 네임의 비드가 나왔으나, 렌더 측이 추가 인상 가능성을 감안해 6개월 4.63, 9개월 4.75, 1년 4.92 오퍼를 유지한 가운데 네고 끝에 9개월물 4.75 체결소식이 전해짐.
FX SWAP	10월 15일 외환 스와프 시장은 예상치를 웃돈 미국 CPI와 국내 증시 급락에 따른 위험회피 심리로 장기물 위주로 하락함. 1년물(12M)은 시초가 대비 0.40원 내린 -14.50원, 6개월물(6M)은 0.20원 하락한 -6.90원, 3개월물(3M)은 0.10원 내린 -3.20원에 마감했으며, 1개월물(1M)은 -1.05원으로 보합을 나타냄. 미국 물가 부담에 연준의 금리 인상 우려가 부각된 가운데 국내 증시의 위험회피 분위기와 수급 부담이 스와프포인트 하락 압력으로 작용함. 현물환 달러-원 환율은 전장 대비 6.30원 오른 1,344.60원에 마감함. 코스피와 코스닥이 각각 7% 넘게 급락하고 외국인이 유가증권시장에서 3조6천억원을 순매도하면서 커스터디 달러 매수와 외국인의 달러선물 순매수 약 3만7천계약이 환율을 끌어올렸으나, 수출업체 네고 물량이 상승폭을 제한함. 향후 스와프포인트는 위험회피 심리와 미국 물가 지표에 따른 금리 전망 변화가, 현물환은 외국인 주식 매도세와 네고 물량의 지속 여부가 주요 변수가 될 전망임.
IRS	전일 IRS는 혼조세 마감. 국내 증시 폭락(코스피 7.5%대)에 따른 위험회피 심리와 미 국채 장기물 강세에 연동되어 중장기물 위주로 급락한 반면, CD 금리 상승세로 1년 이하 단기구간은 소폭 오르며 플래트닝 마감함. 장 초반부터 간밤 미국 CPI 발표 영향으로 국채선물의 강한 움직임과 연동되는 분위기를 보임. 2년이 77.5-77로 오퍼가 내려오며 계속해서 거래되었으며, 3년이 88/87 레벨에 계속해서 대치되었으나 거래 없이 리퍼됨. 또한 1주일 KOFR OIS가 05/02에 대치되었으며, 10년이 97.5/96 레벨에 대치되어 장기 테너 커브가 움직임. 오후 들어 5년이 국채선물과 연동되어 90.5-91에 여러 차례 거래되고 비드온 분위기를 보였으며, 3년이 85/84.5에 대치되다가 오퍼가 85.25로 빠졌으나 비드가 올라와 85.25에 거래되었으며, 이후 강하게 레벨이 올라와 86.5까지 여러 차례 거래됨. 이후 다시 국채선물이 강세로 전환, 1*3년이 26/25에서 비드가 25.5까지 올라왔으나 거래 없이 리퍼되었으며, 5년이 94.5에 거래되고 오퍼가 94까지 내려옴. 장 막판 오후부터 대치되던 1*3년이 비드가 올라와 26.5 레벨에 여러 차례 거래되고 오퍼온 분위기를 보였으며, 1년이 61-60.5오퍼로 내려와 3년이 87오퍼까지 만들어져 거래됨. 마감 이후 2년이 79에 초이스를 이루다 ND로 거래되었으며, 이후 오퍼가 내려오며 78.75까지 거래됨.

단기자금시장

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)
2026.10.08(목)	280.5	260.2	3.01%	3.031%	3.00%	3.24%
2026.10.12(월)	279.6	257.3	3.03%	3.050%		3.24%
2026.10.13(화)	285.1	259.3	3.05%	3.060%		3.24%
2026.10.14(수)	285.4	262.0	3.03%	3.041%		3.25%
2026.10.15(목)	284.2		3.04%			3.25%

전일 미국 국채 금리

한국시간 오전 07:05 기준

단위 : bp

	금리	전일대비
2년물	4.740%	-6.20
5년물	4.878%	-11.10
10년물	5.061%	-12.70
30년물	5.408%	-11.70
10Y-2Y	32.1	-0.06

국내 금융시장 동향

금투협 최종호가수익률

항목	지표	전일대비
KOSPI	5,554.22	-454.59
KOSDAQ	760.82	-63.06
달러-원	1,344.60원	6.30원
국고3Y	3.867%	-1.6
국고10Y	4.193%	-6.8
국고10Y-3Y	32.6	-5.2

전일 외국인 순매수 순매도

단위 : 억 원

만기	종목	금액
27.09.10	국고 25-6	1,600
27.06.10	국고 24-4	1,500
28.06.10	국고 25-4	1,300
53.09.10	국고 23-7	-200
55.09.10	국고 25-7	-200
53.03.10	국고 23-2	-3,800

오늘의 채권

단위 : 억 원

채권 발행	채권 만기	채권 입찰
은행채 7900	은행채 11600	국고채 50년 6000억원 입찰
여전채 7600	여전채 6210	
회사채 3013	회사채 5850	
공사채 8923		

Money Market Closing

단위 : %, %p

기간	KOREAN	FOREIGN	종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.92	3.86	3.89	0.01	O/N	3.90	3.85	3.88	0.00
T/N	3.92	3.86	3.89	0.00	T/N	3.91	3.86	3.89	0.00
1W	3.95	3.85	3.90	0.00	1W	3.93	3.88	3.91	-0.01
1S	4.05	3.95	4.01	0.00	1S	4.03	3.98	4.00	-0.01
3S	4.57	4.42	4.50	0.02	3S	4.40	4.35	4.39	-0.01
6S	4.68	4.53	4.63	0.00	6S	4.50	4.45	4.50	0.00
1YR	4.93	4.78	4.88	-0.01	1YR	4.75	4.70	4.75	0.00

FX SWAP CLOSING

단위 : 전, %, %p

기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR
O/N	-6/-2	-4	4.08	0.00	3.00	3.89000
T/N	-16/-12	-14	4.25	0.18	3.00	3.89137
1W	-30/-24	-27	4.04	-0.11	3.00	3.89962
1S	-110/-100	-105	4.04	0.00	3.13	3.93260
3S	-330/-310	-320	4.31	0.03	3.37	4.06116
6S	-720/-660	-690	4.79	0.04	3.74	4.21711
1YR	-1500/-1400	-1450	5.12	0.03	3.99	4.50556

ND SPREAD

단위 : 전

TENOR	BID	OFFER
1M MAR	-71	-67
1W*1S	-60	-50
1*2	-72	-62
1*3	-170	-160
1*6	-450	-430
1*9	-795	-765
1*12	-1145	-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 / 12.9~12.10ㅁ
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)

Tradition

IRS 데일리 종가

10월 15일

단위 : %, bp

구분	종가	전일대비
6m	3.4075	0.75
9m	3.5175	0.75
1y	3.6050	0.75
1.5y	3.7350	0.00
2y	3.7925	-1.25
3y	3.8700	-3.25
4y	3.9125	-4.75
5y	3.9425	-5.25
6y	3.9600	-6.00
7y	3.9775	-6.25
8y	3.9875	-6.25
9y	4.0000	-6.25
10y	4.0075	-6.50
12y	4.0175	-6.50
15y	3.9775	-6.50
20y	3.8625	-6.50

IRS 주요 커브

SPREAD

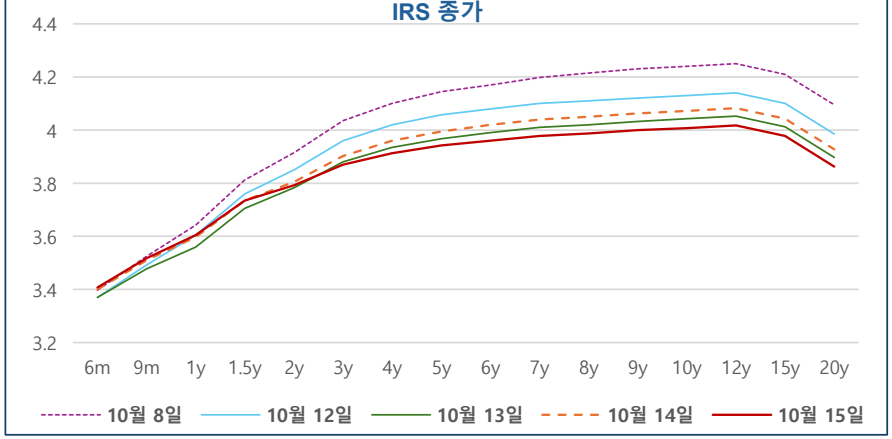
구분	종가	전일대비
1*2y	18.75	-2.00
1*3y	26.50	-4.00
2*5y	15.00	-4.00
3*5y	7.25	-2.00
5*10y	6.50	-1.25
10*20y	-14.50	0.00

IRS 주요 커브

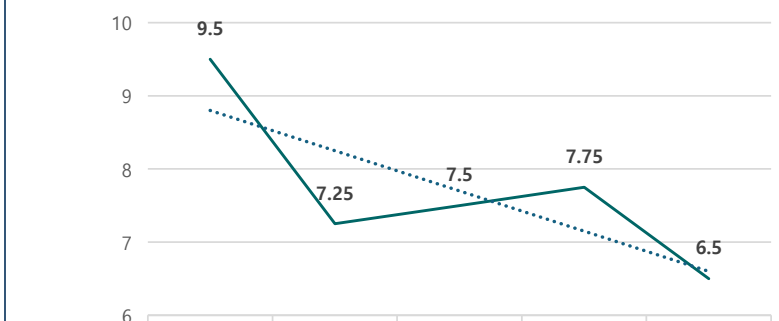
FLY

구분	종가	전일대비
6m*9m*1y	2.25	0.00
1*1.5*2y	7.25	0.50
2*5*10y	8.50	-2.75
5*7*10y	0.50	-0.75

IRS 종가

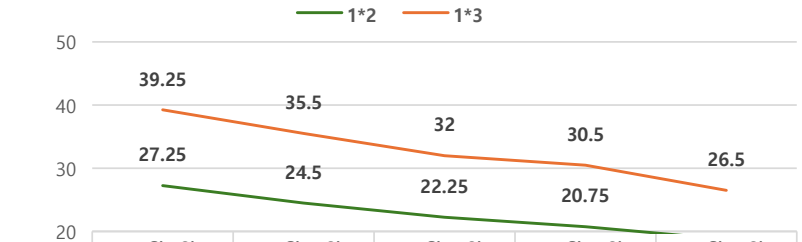


5*10 SPREAD



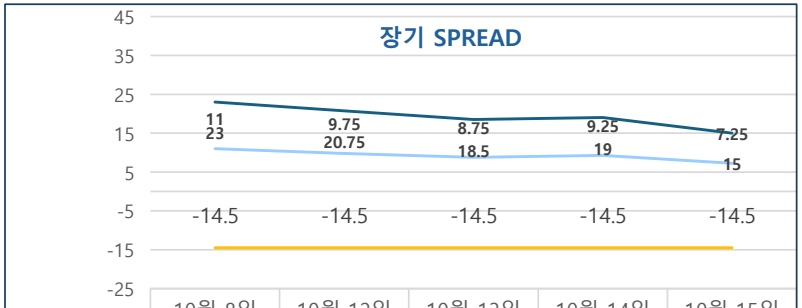
	10월 8일	10월 12일	10월 13일	10월 14일	10월 15일
5*10	9.5	7.25	7.5	7.75	6.5

단기 SPREAD



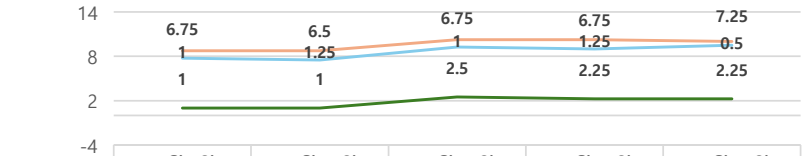
	10월 8일	10월 12일	10월 13일	10월 14일	10월 15일
1*2	27.25	24.5	22.25	20.75	18.75
1*3	39.25	35.5	32	30.5	26.5

장기 SPREAD



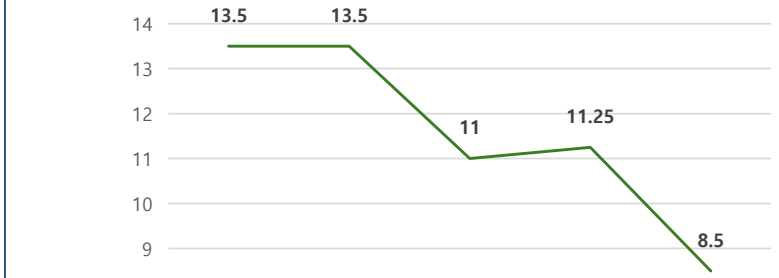
	10월 8일	10월 12일	10월 13일	10월 14일	10월 15일
2*5	23	20.75	18.5	19	15
3*5	11	9.75	8.75	9.25	7.25
10*20	-14.5	-14.5	-14.5	-14.5	-14.5

주요 FLY



	10월 8일	10월 12일	10월 13일	10월 14일	10월 15일
5*7*10y	1	1.25	1	1.25	0.5
1*1.5*2y	6.75	6.5	6.75	6.75	7.25
6*9*12m	1	1	2.5	2.25	2.25

2*5*10y FLY



	10월 8일	10월 12일	10월 13일	10월 14일	10월 15일
2*5*10y	13.5	13.5	11	11.25	8.5