Market Daily Report

2026.10.30(금)

Tradition

레포	공모주 청약 환불 영향 제한적일 것으로 예상됐으나 매수자금 이른 시간에 소진되어 장 초반부터 부족 분위기 형성되었음. 장중 제2금융권 자금 이탈 이어져 체결금리 상승했으며, 은행 고유계정의 매수 참여에도 막판까지 수급 빠듯하였음.
채권	한국: 국고채 금리는 전구간 하락 마감. 워시 연준 의장의 FOMC 기자회견 발언이 비둘기파적으로 해석된 가운데 코스피가 1.24% 하락하며 강세 흐름이 이어짐. 외국인이 3년과 10년 국채선물을 장중 꾸준히 순매수했고 3년물 금리는 3.3bp 내린 3.766%를 기록함. 오후에는 이형일 부총리의 11월 발행물량 신중 검토 발언 속에 장 마감 후 공개될 11월 국고채 발행계획을 앞두고 관망세가 짙어짐. 시장은 발행계획 결과와 월말 WGBI 자금 유입을 주시하는 모습. 미국: 미 국채 금리는 전 구간 하락 마감. 장 초반 마이크로소프트의 9년 만의 대규모 회사채 발행 소식에 금리가 오르기도 했지만 알파벳 주가가 13% 안팎으로 폭락하자 위험회피 심리 속에 안전자산 매수세가 유입됨. 3분기 GDP 속보치가 연율 3.4%로 예상치를 웃돌고 국내 민간 최종판매도 5%에 육박했으며 9월 PCE 물가도 상승세가 가팔라졌지만 AI 투자심리 악화의 영향력이 지표를 압도함. 7년물 국채 입찰은 응찰률 2.46배로 발행 수익률은 발행 전 거래 수익률에 부합한 4.894%에 견조한 수요를 보이며 결정됨.
MONEY	FED가 기준금리를 동결한 가운데, 인플레이션이 여전히 높은 수준을 유지하고 있음에도 워시 의장이 명확한 정책 방향을 제시하지 않으면서 향후 통화정책에 대한 불확실성이 지속됐고, 시장의 추가 금리 인상 기대도 다소 약화됨. 다만 CME 페드워치에 따르면 12월 금리 인상 확률은 78%로, 추가 인상 가능성은 여전히 높게 반영됨. 한편, 연준의 정책 신뢰성에 대한 시장의 의구심이 이어지면서 향후 미 국채 장기물 주도의 수익률곡선 스티프닝 가능성도 제기됨. 29일 데포마켓, 웰커버 구간으로 시장의 관심이 집중되는 가운데 스팟 밸류가 다음 달로 접어들면서 11월 스타팅 자금 수요에도 관심이 확대됨. 투데이/탐 스타팅의 막바지 웰커버 수요가 집중 되면서, 단기 위크 및 1달 구간은 4.00~4.05 수준에서 레벨이 형성됨. 2달 구간에서는 대만계 펀딩 수요가 이어지며 4.25~4.28 수준에서 거래가 진행됐고, 12월 초 만기의 짧은 2달 구간에서는 4.20에 체결 리포트됨. 한편, 스팟 밸류 2달 구간이 1월 만기의 연커버 구간으로 접어들면서, 비중국계 네임을 중심으로 4.30~4.35 수준에서 펀딩 시도가 이어졌으며, 말레이시아계는 4.40, 포린 네임은 4.35에 각각 체결됨. 금일 FOMC 발표에 장기 구간은 다소 소강 상태를 보였으며, 유럽계 네임들을 중심으로 1년 구간은 5BP 내외의 하락세 보이면서, 4.80 전후반 레벨로 하락 마감.
FX SWAP	10월 29일 외환 스와프 시장은 월말 원화 자금 수요가 소멸하면서 대부분 구간에서 하락함. 1년물은 전일과 같은 -14.60에 보합 마감했으며, 6개월물은 0.30 하락한 -6.70, 3개월물은 0.15 내린 -3.10, 1개월물은 0.20 하락한 -0.95를 기록함. O/N은 0.00, T/N은 -0.03을 나타냄. 전일 월말 원화 자금 확보를 위한 셀앤드바이 수요로 상승했던 기간물은 스팟 결제일이 11월로 넘어가면서 관련 수요가 소멸해 상승분을 되돌림. 반면 1년물은 미국 금리 안정세에 힘입어 보합권을 유지함. 현물환 시장에서는 간밤 FOMC의 금리 동결과 연준 의장의 신중한 긴축 기조에도 전일 급등에 따른 되돌림 압력이 우세했으며, 수출업체 네고와 외국인의 달러 선물 순매도가 환율 하락을 이끎. 달러-원은 1,342.00원으로 출발해 장중 1,331.30원까지 하락했으나, 저점에서 결제 수요가 유입되며 낙폭을 줄여 전장 대비 0.90원 내린 1,336.80원에 마감함. 월말 수급 효과가 사라진 가운데 기간물은 셀앤드바이 수요 약화에 따른 조정 압력이 이어질지, 장기물은 미국 금리 흐름에 연동해 안정세를 유지할지 주목됨.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 비둘기파적이었던 FOMC 결과와 국내 증시 약세, 외국인의 국채선물 순매수 흐름에 연동되어 전 구간 하락 마감함. 다만, 단기 구간은 CD금리 상승 경계감이 작용하고 중장기 구간은 최근 지속되던 외국인 리시브 모멘텀이 소강 상태를 보이면서, 국고채 현·선물 시장의 강세 폭에는 미치지 못하는 상대적 약세 흐름을 나타냄. 장 초반 단기 구간으로 강세를 보이며 9개월이 49.25-49까지 오퍼가 내려와 여러 차례 거래되었으며, 2년 오퍼가 비드를 찾는 분위기를 보이며 69.5에 계속해서 거래되는 분위기를 보임. 오후 들어 2*3*5년 나비가 -2-1.75비드로 올라온 이후 -1비드 시장 소식에 중단기 구간 커브가 전반적으로 움직였으며, 6*9*12개월 나비가 2.75에 ND로 거래됨. 장 막판 10*20년이 -18에 D/ND로 초이스를 이루다 ND로 거래 이후 오퍼가 -19까지 내려와 -19/-18에 리버스를 이루다 거래 없이 리퍼되었으며, 10년 비드가 87까지 올라오며 여러 차례 거래, 20년이 아웃라잇으로 68오퍼가 나오며 초장기 커브가 움직임. 마감 이후 7년이 85.5-85.75비드로 올라와 거래되었으며, 7*10년이 01비드로 나옴. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.29%(+2bp)에 고시됨.

단기자금시장

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)
2026.10.23(금)	283.7	255.8	3.05%	3.048%	3.00%	3.26%
2026.10.26(월)	285.4	258.4	3.05%	3.055%		3.26%
2026.10.27(화)	287.0	259.2	3.02%	2.995%		3.27%
2026.10.28(수)	295.7	264.5	2.95%	2.976%		3.27%
2026.10.29(목)	291.7		2.96%			3.29%

전일 미국 국채 금리

한국시간 오전 07:05 기준

단위 : bp

	금리	전일대비
2년물	4.602%	-9.80
5년물	4.745%	-9.40
10년물	4.941%	-7.80
30년물	5.302%	-4.40
10Y-2Y	33.9	0.02

국내 금융시장 동향

금투협 최종호가수익률

항목	지표	전일대비
KOSPI	5,937.66	-74.78
KOSDAQ	753.23	-18.05
달러-원	1,336.80원	-0.90원
국고3Y	3.766%	-3.3
국고10Y	4.081%	-2.7
국고10Y-3Y	31.5	0.6

전일 외국인 순매수 순매도

단위 : 억 원

만기	종목	금액
28.09.10	국고 26-7	2,027
31.09.10	국고 26-9	535
28.06.10	국고 25-4	372
56.09.10	국고 26-8	-315
36.06.10	국고 26-6	-554
56.03.10	국고 26-2	-2,327

오늘의 채권

단위 : 억 원

채권 발행	채권 만기	채권 입찰
은행채 12,000	은행채 12,000	
여전채 3,541	여전채 4,660	
회사채 2,410	회사채 7,840	
	공사채 4,000	

Money Market Closing

단위 : %, %p

기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.93	3.87	3.90	0.00	O/N	3.91	3.88	3.89	0.00
T/N	4.00	3.90	3.95	0.03	T/N	3.91	3.88	3.90	0.00
1W	4.00	3.90	3.95	-0.04	1W	3.93	3.88	3.92	-0.08
1S	4.05	3.95	4.00	-0.02	1S	4.01	3.96	4.00	-0.01
3S	4.53	4.38	4.43	-0.04	3S	4.40	4.30	4.35	-0.01
6S	4.70	4.55	4.62	-0.01	6S	4.55	4.45	4.52	-0.03
1YR	4.92	4.77	4.87	-0.01	1YR	4.80	4.70	4.75	-0.02

FX SWAP CLOSING

단위 : 전, %, %p

기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR
O/N	-2/2	0	3.00	-1.35	3.00	3.95000
T/N	-5/-1	-3	3.27	-0.81	3.00	3.94933
1W	-25/-19	-22	3.85	0.19	3.00	3.94530
1S	-100/-90	-95	4.00	0.12	3.14	3.92987
3S	-320/-300	-310	4.33	0.06	3.41	4.06202
6S	-700/-640	-670	4.82	0.02	3.81	4.21579
1YR	-1510/-1410	-1460	5.15	0.00	4.01	4.47760

ND SPREAD

단위 : 전

TENOR	BID	OFFER
1M MAR	-119	-115
1W*1S	-100	-90
1*2	-125	-115
1*3	-235	-225
1*6	-600	-580
1*9	-1000	-960
1*12	-1390	-1350

국내외 일정

FOMC	1.27~1.28 / 3.17~3.18 / 4.28~4.29 / 6.16~6.17 / 7.28~7.29 / 9.15~9.16 / 10.27~10.28 / 12.8~12.9□
금통위	1.15(목) / 2.26(화) / 4.10(금) / 5.28(목) / 7.16(목) / 8.27(목) / 10.22(목) / 11.26(목)
지준일	1.7(수) / 2.11(수) / 3.11(수) / 4.8(수) / 5.6(수) / 6.10(수) / 7.8(수) / 8.5(수) / 9.9(수) / 10.7(수) / 11.11(수) / 12.9(수)

Tradition

IRS 데일리 종가

10월 29일

단위 : %, bp

구분	종가	전일대비
6m	3.4100	-0.25
9m	3.5050	0.00
1y	3.5725	0.25
1.5y	3.6700	-1.00
2y	3.7125	-1.75
3y	3.7650	-2.75
4y	3.8050	-2.50
5y	3.8300	-2.50
6y	3.8425	-2.50
7y	3.8550	-2.50
8y	3.8600	-2.75
9y	3.8650	-3.00
10y	3.8700	-3.00
12y	3.8800	-3.00
15y	3.8275	-3.25
20y	3.6800	-5.00

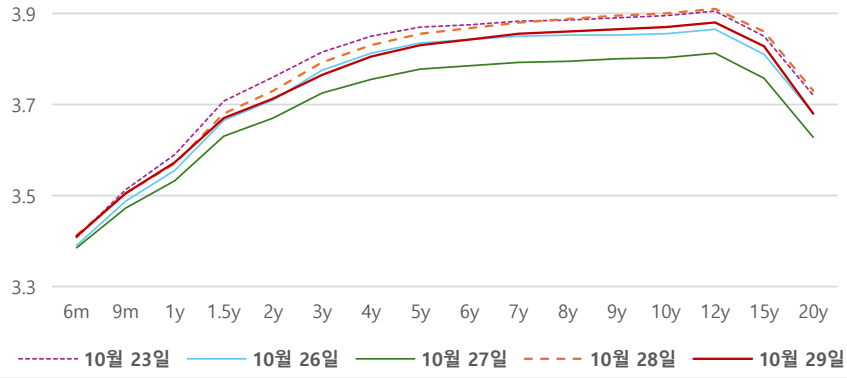
IRS 주요 커브 SPREAD

구분	종가	전일대비
1*2y	14.00	-2.00
1*3y	19.25	-3.00
2*5y	11.75	-0.75
3*5y	6.50	0.25
5*10y	4.00	-0.50
10*20y	-19.00	-2.00

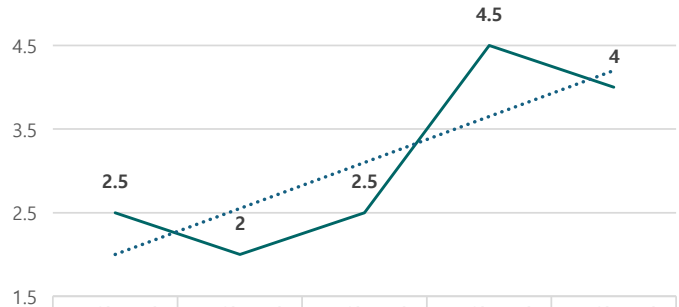
IRS 주요 커브 FLY

구분	종가	전일대비
6m*9m*1y	2.75	0.00
1*1.5*2y	5.50	-0.50
2*5*10y	7.75	-0.25
5*7*10y	1.00	0.50

IRS 종가

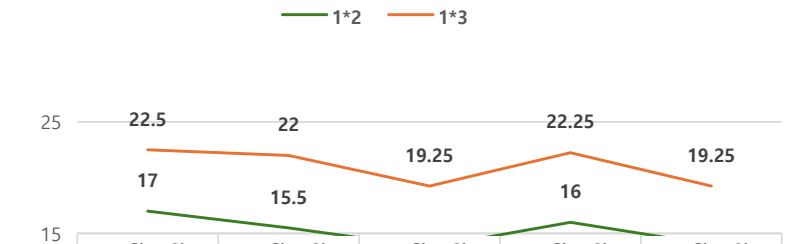


5*10 SPREAD



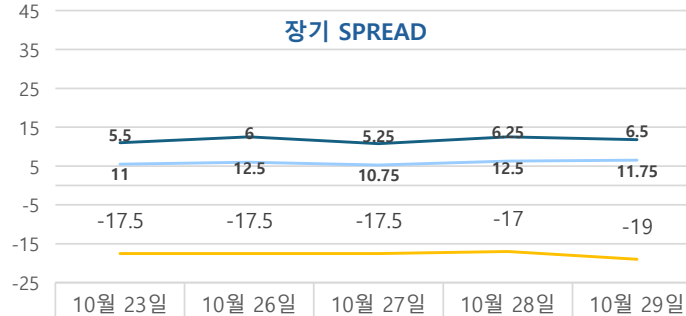
	10월 23일	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일
5*10	2.5	2	2.5	4.5	4

단기 SPREAD



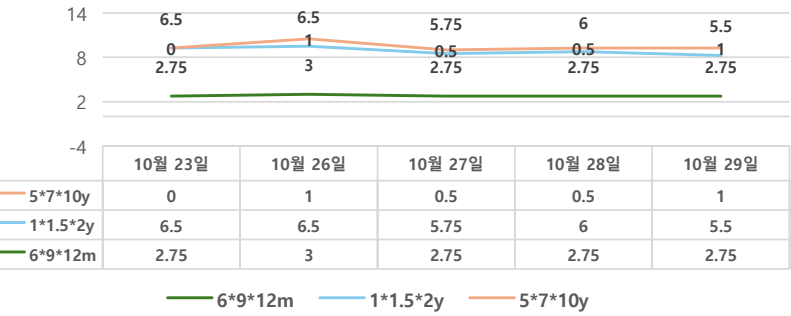
	10월 23일	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일
1*2	17	15.5	13.75	16	14
1*3	22.5	22	19.25	22.25	19.25

장기 SPREAD



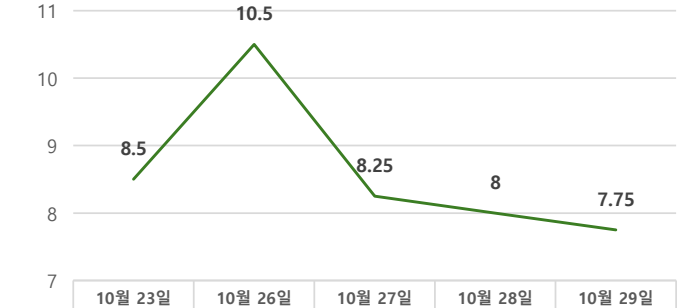
	10월 23일	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일
2*5	11	12.5	10.75	12.5	11.75
3*5	5.5	6	5.25	6.25	6.5
10*20	-17.5	-17.5	-17.5	-17	-19

주요 FLY



	10월 23일	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일
5*7*10y	0	1	0.5	0.5	1
1*1.5*2y	6.5	6.5	5.75	6	5.5
6*9*12m	2.75	3	2.75	2.75	2.75

2*5*10y FLY



	10월 23일	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일
2*5*10y	8.5	10.5	8.25	8	7.75