Market Daily Report

2026.11.02(월)

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. 간밤 미 국채 금리 급락에 이어 코스피가 장중 4%대 하락하며 매도 사이드카까지 발동되자 위험회피 심리가 강세를 이끔. 10년물 금리는 장중 4.0%선을 하회하며 5월 이후 최저 수준까지 내려갔고 7.3bp 내린 4.008%로 마감하며 장기물 중심 강세가 나타남. 외국인은 국채선물을 소폭 순매도했지만 WGBI 관련 현물 매수세가 유입되며 수급도 우호적으로 작용함. 시장은 주가 조정과 연말 발행 감소에 따른 우호적 수급이 이어질지 주시하는 모습. 미국: 미 국채 금리는 혼조 마감. 기술주 급락으로 미국 경제를 지탱해온 AI 테마가 흔들리자 안전자산 매수세가 유입됐고 12월 동결 가능성이 한때 30%를 웃도는 등 추가 금리 인상 베팅도 약해짐. 중동 불안에 따른 유가 급등으로 오전 장중 반등하기도 했으나 기술주 매도세가 심화하자 단기물 중심으로 다시 하락했고 2년물 금리는 장중 4.561%까지 내려 9월 11일 이후 최저치를 기록함. 로건 댈러스 연은 총재와 무살렘 세인트루이스 연은 총재가 추가 긴축 필요성을 언급했지만 단기물 강세 흐름을 되돌리지는 못함. 시장의 관심은 AI 불안이 이어질지 아니면 고금리 장기화로 가는 과정의 일시적 장애물에 그칠지에 쏠리는 모습.
MONEY	이번 주 연준, ECB, BOJ 모두 동결로 마무리되며 온쇼 머니 시장은 조용한 월말 흐름을 보임. 역외시장은 월말 포지션을 대부분 정리한 가운데 월말 밸류로 대만계 숏 2개월물(12월초 만기)이 4.20-4.40, 말레이계는 4.40, 중국계는 4개월물이 4.46에 체결되며 월말을 걸치는 1개월 초과 구간으로 거래가 집중되었음. 1년물은 미 금리 하락에 레벨이 크게 내려왔음. 대만과 홍콩으로부터 타깃 지정 없이 4.75-4.78 오퍼가 나온 가운데 4.70-4.72 비드가 맞섰고, 유럽계도 전일보다 5-15bp 낮춘 가격으로 중국계와 나란히 비드에 가세했으며, 중국계와 4.72, 유럽계와 4.77에 체결 소식이 전해짐. 한편 AI 투자 회의론에 아시아 증시가 급락하며 대만은 외국인 자금 유출과 통화 약세 압력이 이어지고 있어, 대만계 달러 수급 변화가 향후 변수로 작용할 수 있음. 시중은행 본점들은 월말 마감에 집중하며 월초에도 당분간 관망 속에 운용 스탠스를 확인할 것으로 보임.
FX SWAP	10월 30일 외환 스와프 시장은 한산한 거래 속 셀앤바이 물량이 유입되며 기간물 중심으로 상승함. 1년물은 시초가 대비 0.30 상승한 -14.30, 6개월물은 0.20 오른 -6.50, 3개월물은 0.10 상승한 -3.00에 마감함. 1개월물은 -0.95로 보합을 나타냈으며, O/N은 -0.080, T/N은 -0.030을 기록함. 외시협 세미나 영향으로 거래가 한산한 가운데 월말 네고와 셀앤바이 물량이 유입되며 비디시한 흐름이 이어졌고, 국내 금리 하락에도 스와프포인트는 강세를 보임. 현물환 시장에서는 장 초반 커스터디성 달러 매수로 달러-원이 1,340.50원까지 상승했으나, 코스피 급락과 외국인의 달러 선물 순매도, 수출업체 네고가 맞물리며 하락세로 전환함. 코스피가 3.48% 급락하고 외국인이 달러 선물을 2만 계약 가까이 순매도한 가운데, 달러-원은 장중 1,333.60원까지 밀린 뒤 전장 대비 2.50원 하락한 1,334.30원에 마감함. 월말 자금 수요가 대부분 해소된 가운데, 스와프포인트는 셀앤바이 유입 지속 여부와 국내외 금리 흐름에 영향을 받을 것으로 전망됨.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 간밤 미 국채 금리 급락과 코스피 폭락(4%대 하락 및 매도 사이드카 발동)에 따른 글로벌 위험회피 심리 심화로 전 구간 급락세를 보이며 마감. 국채선물 강세와 연동된 가운데 5~10년 바디 및 장기 구간을 중심으로 강력한 리시브(매수) 물량이 유입되면서 수익률곡선은 가파른 불스팁 양상을 나타냄. 장 초반 1*2년이 13에 여러 찰 거래되고 비드온 분위기를 보였으며, 9개월이 48.5-48 레벨에 계속해서 거래되며 단기 구간 레벨이 움직이는 모습을 보임. 오후 들어 1년 56비드와 1.5년 65.25비드가 엮인 1*1.5년이 9.25에 거래되었으며, 2*3년이 04.5에 거래되어 짧은 테너 구간 커브가 변동됨. 이후 1년이 56, 2년이 68에 계속해서 거래되는 분위기를 보임. 장 막판 1*1.5년 09비드, 1.5*2년 3.75비드, 2년 베이시스 -36비드가 엮인 2년이 레깅으로 68.5에 거래된 이후 2년 오퍼가 68까지 내려오며 거래되어 커브 레벨이 전반적으로 내려옴. 마감 이후 2년이 69에 여러 차례 거래되었으며, 1.5*3년이 08.5/08에 대치되다가 1.5년 65.25오퍼와 엮여 3년이 레깅으로 73.25까지 거래됨. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 3.32%(+3bp)에 고시됨.

단기자금시장

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)
2026.10.26(월)	285.4	258.4	3.05%	3.055%	3.00%	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	269.5	2.96%	3.031%		3.29%
2026.10.30(금)	288.8		3.03%			3.32%

전일 미국 국채 금리

한국시간 오전 07:05 기준

단위 : bp

	금리	전일대비
2년물	4.592%	-1.00
5년물	4.722%	-2.30
10년물	4.930%	-1.10
30년물	5.310%	0.80
10Y-2Y	33.8	0.00

국내 금융시장 동향

금투협 최종호가수익률

항목	지표	전일대비
KOSPI	5,730.74	-206.92
KOSDAQ	724.38	-28.85
달러-원	1,334.30원	-2.50원
국고3Y	3.715%	-5.1
국고10Y	4.008%	-7.3
국고10Y-3Y	29.3	-2.2

전일 외국인 순매수 순매도

단위 : 억 원

만기	종목	금액
56.09.10	국고 26-8	2,730
28.09.10	국고 26-7	2,322
31.09.10	국고 26-9	1,988
54.09.10	국고 24-8	-130
55.09.10	국고 25-7	-624
51.03.10	국고 21-2	-686

오늘의 채권

단위 : 억 원

채권 발행	채권 만기	채권 입찰
은행채 4,700	은행채 7,700	국고채 2년 18,000억원 입찰
여전채 2,000	여전채 1,100	통안채 91일물 6,000억원 입찰
회사채 105	공사채 1,500	

Money Market Closing

단위 : %, %p

기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	4.00	3.90	3.90	0.00	O/N	3.91	3.88	3.89	0.00
T/N	3.94	3.88	3.91	-0.04	T/N	3.91	3.88	3.90	0.00
1W	4.00	3.90	3.93	-0.02	1W	3.93	3.88	3.92	0.00
1S	4.03	3.93	3.98	-0.02	1S	4.01	3.96	4.00	0.00
3S	4.55	4.40	4.45	0.02	3S	4.40	4.30	4.35	0.00
6S	4.70	4.55	4.60	-0.02	6S	4.55	4.45	4.52	0.00
1YR	4.85	4.70	4.78	-0.09	1YR	4.80	4.70	4.75	0.00

FX SWAP CLOSING

단위 : 전, %, %p

기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR
O/N	-9/-5	-7	3.63	0.63	3.00	3.94000
T/N	-5/-1	-3	3.81	0.54	3.00	3.93913
1W	-25/-19	-22	3.84	0.00	3.00	3.93394
1S	-100/-90	-95	3.99	-0.01	3.14	3.91403
3S	-310/-290	-300	4.30	-0.04	3.41	4.06594
6S	-680/-620	-650	4.79	-0.02	3.81	4.22271
1YR	-1480/-1380	-1430	5.12	-0.03	4.01	4.49189

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 30일

단위 : %, bp

구분	종가	전일대비
6m	3.4200	1.00
9m	3.5025	-0.25
1y	3.5600	-1.25
1.5y	3.6475	-2.25
2y	3.6850	-2.75
3y	3.7275	-3.75
4y	3.7625	-4.25
5y	3.7850	-4.50
6y	3.7975	-4.50
7y	3.8100	-4.50
8y	3.8150	-4.50
9y	3.8200	-4.50
10y	3.8250	-4.50
12y	3.8350	-4.50
15y	3.7825	-4.50
20y	3.6375	-4.25

IRS 주요 커브

SPREAD

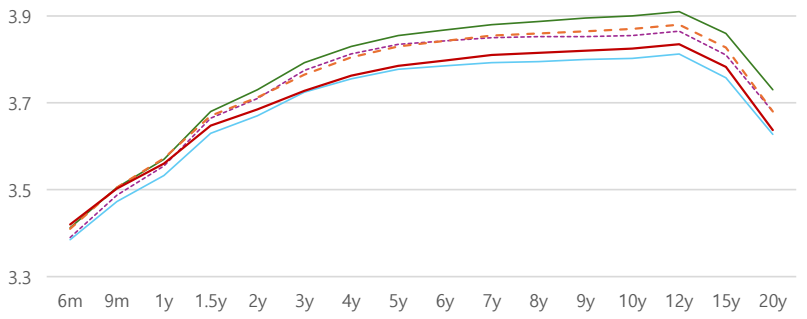
구분	종가	전일대비
1*2y	12.50	-1.50
1*3y	16.75	-2.50
2*5y	10.00	-1.75
3*5y	5.75	-0.75
5*10y	4.00	0.00
10*20y	-18.75	0.25

IRS 주요 커브

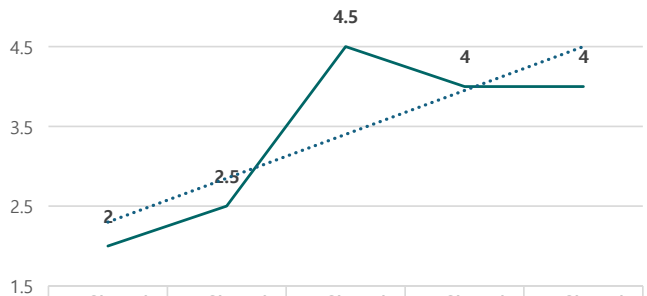
FLY

구분	종가	전일대비
6m*9m*1y	2.50	-0.25
1*1.5*2y	5.00	-0.50
2*5*10y	6.00	-1.75
5*7*10y	1.00	0.00

IRS 종가

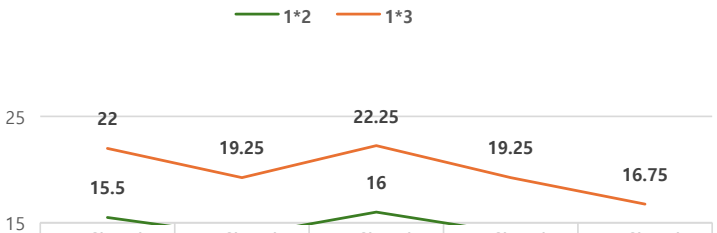


5*10 SPREAD



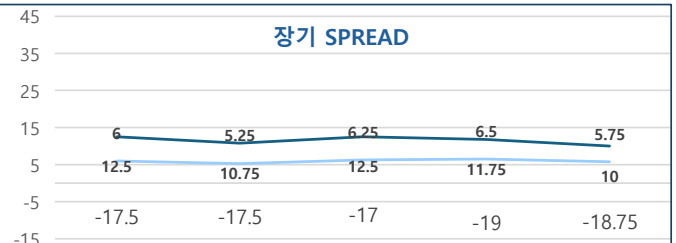
	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일	10월 30일
5*10	2	2.5	4.5	4	4

단기 SPREAD



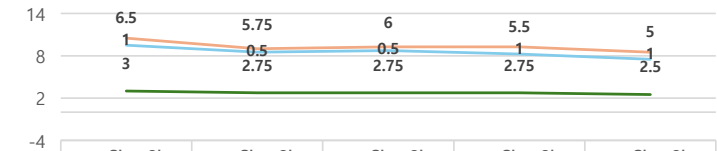
	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일	10월 30일
1*2	15.5	13.75	16	14	12.5
1*3	22	19.25	22.25	19.25	16.75

장기 SPREAD



	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일	10월 30일
2*5	12.5	10.75	12.5	11.75	10
3*5	6	5.25	6.25	6.5	5.75
10*20	-17.5	-17.5	-17	-19	-18.75

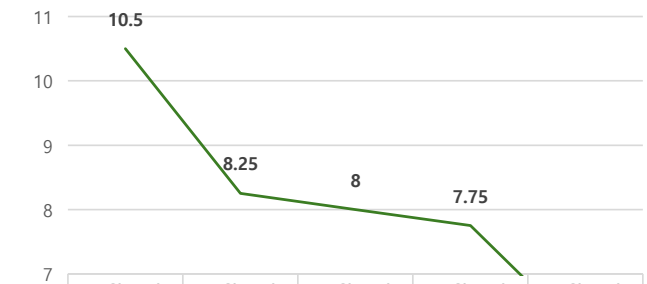
주요 FLY



	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일	10월 30일
5*7*10y	1	0.5	0.5	1	1
1*1.5*2y	6.5	5.75	6	5.5	5
6*9*12m	3	2.75	2.75	2.75	2.5

6*9*12m 1*1.5*2y 5*7*10y

2*5*10y FLY



	10월 26일	10월 27일	10월 28일	10월 29일	10월 30일
2*5*10y	10.5	8.25	8	7.75	6