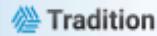


## Market Daily Report

2026.01.16(금)



레포	한은RP매입 증액 기대감 반영되어 레포금리 소폭 하락(2.58%→2.56%)했으며, 증권사 매도 주출해 수급 무난하였음. 장 초반 회사채 일부 난항을 겪었으나 오후께 정체 해소되었고, 장 중 잉여세 심화돼 저금리 매수 대기하였음.
채권	한국 : 국고채 금리 모두 급등. 장 초반 달러-원 환율 급락과 유가와 미 장기금리 흐름을 반영해 금리 하락 출발. 금통위의 통화정책방향문 공개 이후, 국고채 금리는 급상승 전환. "금리 인하 가능성은 열어두되, 추가 인하 여부 및 시기 결정하겠다"는 문구가 삭제된 여파. 특히 10년물과 30년물은 장중 연중 저점을 기록. 미국 : 미 국채 금리는 단기물의 약세 속에 상승 마감. 주간 신규 실업보험 청구 건수(19.8만 건)는 예상치(21.5만 건)를 하회하여 금리 인하 기대감을 악화, 영국 GDP 호조에 따른 길드 금리 급등이 단기물 금리 상승을 견인. 뉴욕주 제조업지수(7.7) 또한 확장 국면으로 전환하며(전달 -3.7) 금리 상방 압력을 더함. 한편, 이란발 우려 원화로 인한 국제유가 급락 (WTI 4%↓).
MONEY	타네임 대비 3.50대 낮게 유지해 오던 운송 하루짜리 레벨 상승세 보이며, 마켓 비중국계 레벨 수준인 3.60대로 진입. 월초 낙선했던 단기 유통성으로, 운송 하루짜리 스왑 환산금리가 마니 마켓 금리 대비 낮게 형성 되었으나, 그간 간극을 좁혀 오면서 어제 o/n usd/krw 스왑 환산금리 3.73%에 이어 금일 3.97% 까지 상승. 주요 서울을 차입처 다시 마켓에 등장하며, 하루짜리 3.60대 초반 레벨에 펑팅 시도 됨. 빠르면 1월에도 점쳐졌었던 fomc 금리 인하 시점이, 상반기 이후로 늦춰질것으로 다시 예상 되면서, 비중국계 네임을 중심으로 1달~3달의 단기 기간을 구간, 마켓 펑팅 계속해서 증가 되는 상황. 대만계 어제 1달 3.73 주체별 레벨에서 금일 3.75 체결 리포트 되었으며, 3달 또한 기준 3.70대 후반에서 3.80대 초반까지 레벨 소폭 상승하면서, 단기 기간을 구간 금리 오름세 보이는 중. 반면 6달~1년 이상의 장기 구간은 특별한 방향성 없이, 중국계 3.70~3.75, 비중국계 3.80~3.85 레벨선에 오퍼 대기만 되는 모습. 대만계간 6달 3.82 소액 체결 리포트.
FX SWAP	1월 15일 외환 스왑포인트는 한국은행 금융통화위원회의 매파적 기조 확인에 따라 장기 구간을 중심으로 큰 폭으로 상승함. 1년물은 시초가 대비 0.90원 급등한 -16.50원, 6개월 물은 0.40원 상승한 -9.20원에 마감하며 중장기물에서 큰 폭의 상승이 나옴. 반면 1개월물은 0.10원 하락한 -1.50원에 미김하며 단기 구간에서는 하방 조정이 이어짐. 현물환 시장에서 달러-원 환율은 스콧 베선트 미 재무장관의 원화 저평가에 관련 언급과 한은 금통위의 금리 동결 영향으로 전일 대비 7.80원 내린 1,469.70원에 마감하며 11거래일 만에 하락세로 돌아섬. 전반적으로 외환 스왑 시장은 금통위 통화정책방향 의결문에서 '금리 인하 가능성' 문구가 삭제됨에 따라 조기 금리 인하 기대가 후퇴하며 장기를 스왑포인트에 상승 압력으로 작용함. 단기 구간에서는 달러 유통성 잉여가 지속되며 초단기물이 약세를 보였으나, 장기 구간은 매파적 금통위 여파로 상승 흐름을 보임.
IRS	전일 IRS는 큰 폭으로 상승 마감. 금통위가 매파적으로 해석되어 강한 약세를 보이며 중단기 테너를 중심으로 베어스텝 기조를 보임. 장 초반 10년이 34/33.5에 대치되다가 오퍼가 내려오며 33.5에 거래되고 오퍼은 분위기를 보였으며, 6*9*12개월 나비가 -0.75 오퍼가 나온. 장기쪽으로 10*15년이 01/07.5에 대치되었으며, 12/15년이 -1.5/-2.0에 ND로 대치됨. 금통위 통화정책방향 결정문 발표 이후 강한 약세로 전환되어 레벨이 상승하는 분위기를 보임. 1*3년이 33에 거래되고 비드는 분위기를 보였으며, 단기쪽으로 6개월이 71.5/70.5에까지 대치됨. 오후 들어 단기쪽 테너 위주로 호가가 형성되는 분위기. 대치되던 6개월이 71.5에 거래되었으며, 9*12개월 08 오퍼와 9개월 78.85오퍼가 얹인 1년이 86.5에 거래되고, 86 비드 레벨까지 여러 차례 거래됨. 10*30년이 -37.39오퍼, 10*25년이 -22오퍼까지 내려오며 초장기쪽 커브가 움직였으며, 1*3년 32오퍼가 나오자마자 거래됨. 장 막판 12*15년이 -2에 만나 ND로 거래되었으며, 1년 85비드와 3년 17.5오퍼가 얹인 1*3년이 32.5에 거래. 3년이 17.75/18에 ND/D로 리버스를 이루다 17.75-18에 여러 차례 거래되었으며, 1.5년이 95.5에 거래됨. 마감 이후 4년이 25.5/25에서 비드가 내려오며 25에 여러 차례 거래되었으며, 3년이 ND로 17에 오퍼은 분위기를 보이며 여러 차례 거래됨.

## 단기자금시장

단기자금시장					단위 : 조 원	전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)		CD(91일)	금리	전일대비
2026.01.09(금)	278.7	224.1	2.56%	2.567%	2.50%	2.70%	2년물	3.568%
2026.01.12(월)	277.6	221.2	2.57%	2.570%		2.69%	5년물	3.769%
2026.01.13(화)	280.0	222.4	2.57%	2.559%		2.69%	10년물	4.173%
2026.01.14(수)	279.6	222.0	2.58%	2.565%		2.69%	30년물	4.797%
2026.01.15(목)	281.8	221.8	2.56%	2.535%		2.68%	10Y-2Y	60.5
								-0.02

## 국내 금융시장 동

금투협 최종호가수익률

국내 금융시장 동향 금투법 최종호가수익률			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	4,797.55	74.45	30.03.10	국고 25-3	900	여전채 5,350	은행채 11,100	국고채 50년 8,000억원 입찰
KOSDAQ	951.16	8.98	53.09.10	국고 23-7	700	회사채 2,120	여전채 3,650	
달러-원	1,469.20원	5.20원	53.03.10	국고 23-2	500		회사채 13,350	
국고3Y	3.090%	9.4	27.12.10	국고 17-7	-974		공사채 3,100	
국고10Y	3.493%	7.5	28.03.10	국고 23-1	-1,000			
국고10Y-3Y	40.3	-1.9	26.03.10	국고 21-1	-1,644			

## 전일 외국인 순매수 순매도

10 of 10 | Page | [Home](#) | [About](#) | [Contact](#) | [Feedback](#) | [Help](#) | [Logout](#)

국내 금융시장 동향 금투법 최종호가수익률			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	4,797.55	74.45	30.03.10	국고 25-3	900	여전채 5,350	은행채 11,100	국고채 50년 8,000억원 입찰
KOSDAQ	951.16	8.98	53.09.10	국고 23-7	700	회사채 2,120	여전채 3,650	
달러-원	1,469.20원	5.20원	53.03.10	국고 23-2	500		회사채 13,350	
국고3Y	3.090%	9.4	27.12.10	국고 17-7	-974		공사채 3,100	
국고10Y	3.493%	7.5	28.03.10	국고 23-1	-1,000			
국고10Y-3Y	40.3	-1.9	26.03.10	국고 21-1	-1,644			

## Money Market Closing

Money Market Closing								단위 : %, %p	
기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.66	3.60	3.61	0.06	O/N	3.62	3.55	3.59	0.01
T/N	3.67	3.61	3.62	0.07	T/N	3.62	3.56	3.59	0.00
1W	3.70	3.60	3.66	0.00	1W	3.65	3.55	3.60	0.00
1S	3.78	3.68	3.73	0.01	1S	3.70	3.60	3.67	0.01
3S	3.85	3.75	3.81	0.00	3S	3.75	3.65	3.69	-0.01
6S	3.85	3.70	3.80	0.00	6S	3.78	3.63	3.71	-0.01
1YR	3.88	3.68	3.81	-0.01	1YR	3.75	3.60	3.69	-0.01

## FX SWAP CLOSING

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	단위 : 전. %, %p		
							TENOR	BID	OFFER
O/N	-8/-4	-6	3.97	0.24	2.50	3.65000	1M MAR	-142	-138
T/N	-22/-18	-20	3.72	0.25	2.50	3.65088	1W*1S	-113	-107
1W	-36/-30	-33	3.66	0.11	2.50	3.65618	1*2	-140	-130
1S	-155/-145	-150	3.77	0.08	2.58	3.67738	1*3	-305	-295
3S	-465/-445	-455	3.94	0.01	2.69	3.67113	1*6	-765	-745
6S	-950/-890	-920	3.99	-0.05	2.72	3.62770	1*9	-1135	-1105
1YR	-1700/-1600	-1650	3.89	-0.06	2.74	3.49381	1*12	-1460	-1430

국내외 일정

<b>FOMC</b>	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
<b>금통위</b>	1.16(목) / 2.25(화) / 4.17(금) / 5.29(목) / 7.10(목) / 8.28(목) / 10.23(금) / 11.27(목)
<b>지준일</b>	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 종가		
1월 15일		
구분	종가	전일대비
6m	2.7175	1.75
9m	2.7750	4.25
1y	2.8500	7.00
1.5y	2.9550	8.75
2y	3.0475	9.00
3y	3.1750	9.50
4y	3.2500	8.75
5y	3.2975	8.25
6y	3.3375	8.25
7y	3.3625	7.50
8y	3.3800	7.00
9y	3.4000	6.75
10y	3.4150	6.50
12y	3.4350	5.50
15y	3.4150	5.00
20y	3.3100	5.00

