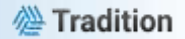


## Market Daily Report

2026.02.09(월)



레포	전일의 빠듯했던 장세 반영되어 레포금리 소폭 상승(2.53%→2.54%)했으며, 은행고유 매수 증가해 일반채 해소 원활하였음. 회사채 정채도 이른 시간에 해소되어 수급 무난한 모습을 보였고, 장 중 일부 저금리 매칭되었음.
채권	한국 : 미 국채 금리는 상승 마감. 비트코인이 10% 넘게 급등, 뉴욕증시가 강세를 보이는 등 위험자산 선호 심리 되살아나며 금리 인하 기대 다소 후퇴. 특히 2월 미시간대 소비자 심리지수 예비치가 57.3으로 시장 예상치 55.0를 상회하며, 6개월 만에 최고치 기록. 연방정부 첫다운 여파로 고용보고서 발표가 11일로 연기됨에 따라 노동시장 지표확인하려는 경계감이 확산. 미국 : 국고채 금리는 상승 마감. 장 초반 미 국채 금리 하락과 증시 조정에 따른 안전자산 선호로 강세를 보였으나, 코스피가 낙폭을 축소하고 외국인인 3년 국채선물을 1만 3천계약 넘게 투매하며 약세 전환함. 차주 3.1조 원 규모의 3년물 입찰을 앞둔 수급 부담까지 더해지며 중단기물을 중심으로 매도세가 심화됨.
MONEY	미국의 약화된 고용 지표로 3월 연준 25bp 금리 인하 확률이 20%로 급등. 영국은행(BOE) 기준금리 3.75%로 동결. 동결5 및 인하4 표로 팽팽한 차이로 동결이 되면서 다음 금리인하 기대가 상승함. 유럽중앙은행(ECB) 예상대로 3대 정책금리 동결. 멕시코 중앙은행 기준금리 7.00%로 동결. 머니마켓은 춘절 연휴를 앞두고 이번주 지속 제한적인 운용 물량 속에, 편당레벨이 전반적으로 지속 상승하며, 춘절 연휴 커브 2주물 구간 3.73~3.75 선으로 편당이 되며, 대만계 위주로 1달 3.83~3.84, 2달 3달 3.90~3.91 선까지 상승 체결됨. 중국계의 경우 1달 3.77, 3달부터 6달까지 3.80 까지 차입세가 심화 되며 상승 체결됨.
FX SWAP	2월 6일 외환 스와프포인트는 장·단기 구간이 엇갈리는 흐름을 보임. 1년물은 시초가 대비 0.50원 상승한 -15.20원에 마감하며 상승세를 이어갔으나 6개월물은 0.10원 하락한 -9.00원, 1개월물은 0.10원 내린 -1.45원에 마감하며 단기 구간은 약세를 보임. 현물환 시장에서 달러-원 환율은 계속된 외국인 투매에도 글로벌 달러화 약세의 영향으로 소폭 상승한 1469.50원에 마감함. 장기 스와프포인트 레벨 상승은 미국 ADP 고용지표 부진과 신규 실업수당 청구 증가로 미 국채 금리가 하락한 영향이 반영된 것으로 보이며, 이에 따라 한미 금리차 축소 기대가 1년물 중심으로 스와프 레벨을 지지함. 반면 단기 구간에서는 설 연휴를 앞두고 은행권 원화 자금 부족 상황에 대응한 당국발 초단기 유동성 공급이 유입되며 최근까지 타이트했던 단기 스와프포인트가 되돌림이 나온 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 선물 및 현물의 약세와 연동되어 움직임은 분위기였음. 장 초반부터 선물이 강하게 놀리며 커브가 상승하는 흐름을 보임. 장 초반 1년이 86-89비드로 강하게 올라오며 90/89에 대치되다가 1*3년 33비드와 엮여 3년이 23에 거래되었으며, 이후 1년이 91레벨, 3년이 24-25.5까지 여러 차례 거래가 이루어짐. 3*4*5년 나비가 2.75/02에 대치되어 중장기쪽 커브 레벨이 움직임. 2년이 10.5-11비드로 올라오며 ND로 몇 차례 거래되고 비드온 분위기를 보였으며, 5*10년이 14비드로 나옴. 오후 들어 다소 한산한 분위기를 보이며 단기쪽 오퍼가 9개월 85오퍼, 6개월이 80.25-80.5오퍼로 나옴. 장 막판 국채선물 하락 및 CD금리 상승 기대감으로 레벨이 강하게 오르며 2년이 18.5에 ND/D로 초이스를 이루다 ND로 거래되었으며, 9개월이 85.25/85에 대치되다가 비드가 올라오며 85.25에 거래됨. 마감 이후 3년이 31.75/31.5에 대치되었으며, 1년이 95레벨에 거래되고 오퍼를, 1.5년이 08비드가 나옴. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 2.78%(+3bp)에 고시됨.

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
2026.02.02(월)	277.5	226.4	2.55%	2.547%	2.50%	2.74%	2년물	3.502%
2026.02.03(화)	278.3	232.7	2.53%	2.536%		2.74%	5년물	3.760%
2026.02.04(수)	278.8	235.8	2.53%	2.526%		2.75%	10년물	4.208%
2026.02.05(목)	279.5	267.0	2.54%	2.535%		2.75%	30년물	4.853%
2026.02.06(금)	280.9		2.54%	2.514%		2.78%	10Y-2Y	70.6
								-0.02

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투입 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	5,089.14	-74.43	30.09.10	국고 25-8	800	은행채 2,500	여전채 4,600	국고채 3년 31,000억원 입찰
KOSDAQ	1,080.77	-27.64	55.09.10	국고 25-7	715	여전채 700	회사채 2,300	통안채 91일물 5,000억원 입찰
달러-원	1,463.70원	0.00원	27.03.10	국고 07-3	650	회사채 5,850	공사채 2,003	
국고3Y	3.233%	2.9	53.09.10	국고 23-7	-720	공사채 400		
국고10Y	3.710%	2.3	30.12.10	국고 20-9	-800			
국고10Y-3Y	47.7	-0.6	27.03.10	국고 22-1	-900			

Money Market Closing								
단위 : %, %p								
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가
O/N	3.69	3.63	3.66	0.00	O/N	3.71	3.65	3.68
T/N	3.70	3.64	3.67	0.00	T/N	3.72	3.66	3.69
1W	3.75	3.65	3.70	0.01	1W	3.77	3.67	3.72
1S	3.82	3.72	3.77	0.02	1S	3.80	3.70	3.77
3S	3.88	3.78	3.85	0.01	3S	3.85	3.75	3.80
6S	3.88	3.78	3.85	0.01	6S	3.85	3.75	3.80
1YR	3.87	3.72	3.82	0.00	1YR	3.80	3.70	3.75

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p						단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID
O/N	-15/-11	-13	3.56	-0.18	2.50	3.65000	1M MAR	-135
T/N	-7/-3	-5	3.72	-0.09	2.50	3.65065	1W*1S	-93
1W	-50/-44	-47	3.78	0.11	2.50	3.65454	1*2	-157
1S	-150/-140	-145	3.87	0.09	2.60	3.66814	1*3	-317
3S	-475/-455	-465	4.05	0.04	2.77	3.65989	1*6	-747
6S	-930/-870	-900	4.06	0.00	2.82	3.61899	1*9	-1087
1YR	-1570/-1470	-1520	4.06	-0.02	2.99	3.49689	1*12	-1342

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)

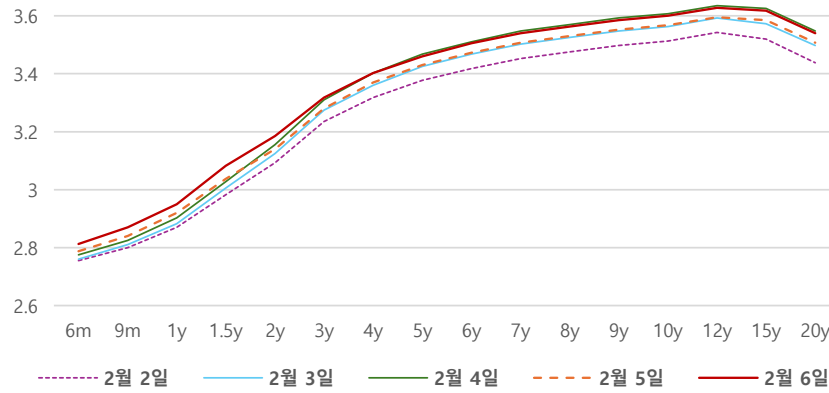
## IRS 데일리 증가

2월 6일

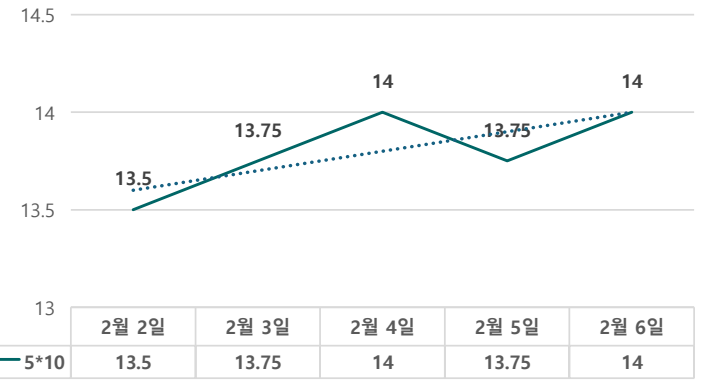
단위 : % bp

구분	증가	전일대비
6m	2.8125	2.50
9m	2.8700	3.00
1y	2.9500	3.00
1.5y	3.0825	4.50
2y	3.1850	4.50
3y	3.3175	3.75
4y	3.4025	3.25
5y	3.4600	3.00
6y	3.5050	3.25
7y	3.5400	3.25
8y	3.5625	3.25
9y	3.5850	3.25
10y	3.6000	3.25
12y	3.6275	3.25
15y	3.6175	3.25
20y	3.5400	3.25

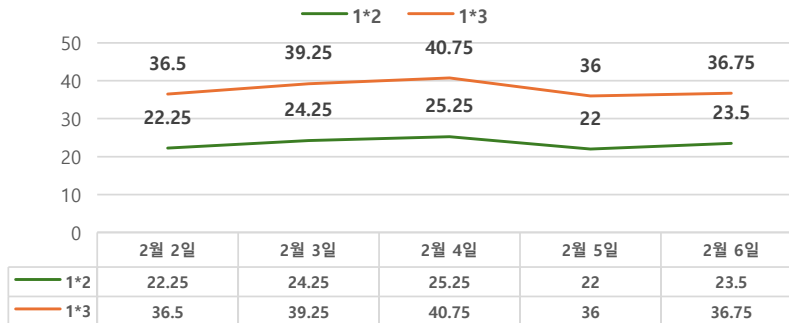
## IRS 증가



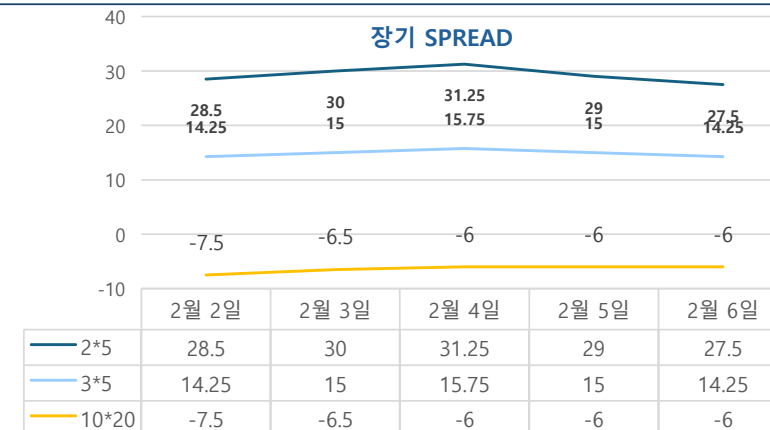
## 5\*10 SPREAD



## 단기 SPREAD



## 장기 SPREAD

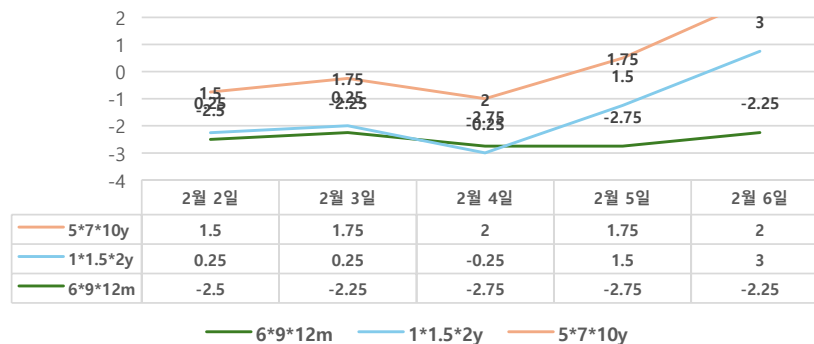


## IRS 주요 커브

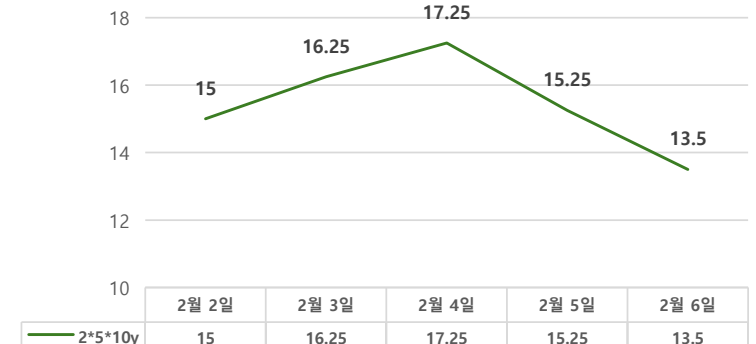
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	23.50	1.50
1*3y	36.75	0.75
2*5y	27.50	-1.50
3*5y	14.25	-0.75
5*10y	14.00	0.25
10*20y	-6.00	0.00

## 주요 FLY



## 2\*5\*10y FLY



## IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.25	0.50
1*1.5*2y	3.00	1.50
2*5*10y	13.50	-1.75
5*7*10y	2.00	0.25