

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 월활하였음. 회사채 정체도 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 셧다운 여파로 고용보고서 발표가 11일로 연기됨에 따라 노동시장 지표를 확인하려는 경계감이 확산. 미국 : 국고채 금리는 상승 마감. 장 초반 미 국채 금리 하락과 증시 조정에 따른 안전자산 선호로 강세를 보였으나, 코스피가 낙폭을 축소하고 외국인이 3년 국채선물을 1만 3천 계약 넘게 투매하며 약세 전환함. 차주 3.1조 원 규모의 3년물 입찰을 앞둔 수급 부담까지 더해지며 중단기물 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 금리 인하 기대가 상승함. 유럽중앙은행(ECB) 예상대로 3대 정책금리 동결. 멕시코 중앙은행 기준금리 7.00%로 동결. 멀티마켓은 춘절 연휴를 앞두고 이번주 지속 저항적인 운용 물량 속에, 펀딩레벨이 전반적으로 지속 상승하며, 춘절 연휴 커버 2주율 구간 3.73~3.75 선으로 펀딩이 되며, 대만 경기 위주로 1달 3.83~3.84, 2달 3달 3.90~3.91 선까지 상승 체결됨. 중국경의 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, 1개월물도 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 당국별 단기 유동성 공급이 유입되며 최근까지 타이트했던 단기 스와프포인트가 되돌림이 나온 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 상승 마감. 선물 및 현물의 약세와 연동되어 움직이는 분위기였음. 장 초반부터 선물이 강하게 놀리며 커브가 상승하는 흐름을 보임. 장 초반 1년이 86-89비드로 강하게 올라오며 90/89에 대치되다가 1*3년 33비드와 엎어 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 오퍼온, 1.5년이 08비드가 나옴. 이날 양도성예금증서(CD)는 상승하여 2.78%(+3bp)에 고시됨.

단기자금시장

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	전일 미국 국채 금리		
							단위 : 조 원	금리	전일대비
2026.02.02(월)	277.5	226.4	2.55%	2.547%	2.50%	2.74%	2년물	3.502%	4.70
2026.02.03(화)	278.3	232.7	2.53%	2.536%		2.74%	5년물	3.760%	4.00
2026.02.04(수)	278.8	235.8	2.53%	2.526%		2.75%	10년물	4.208%	2.60
2026.02.05(목)	279.5	267.0	2.54%	2.535%		2.75%	30년물	4.853%	1.00
2026.02.06(금)	280.9		2.54%	2.514%		2.78%	10Y-2Y	70.6	-0.02

국내 금융시장 동향

금투협 최종호기수익률			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권			
항목	지표	전일대비	단위 : 억 원	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

기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.69	3.63	3.66	0.00	O/N	3.71	3.65	3.68	0.00
T/N	3.70	3.64	3.67	0.00	T/N	3.72	3.66	3.69	0.00
1W	3.75	3.65	3.70	0.01	1W	3.77	3.67	3.72	0.00
1S	3.82	3.72	3.77	0.02	1S	3.80	3.70	3.77	0.05
3S	3.88	3.78	3.85	0.01	3S	3.85	3.75	3.80	0.00
6S	3.88	3.78	3.85	0.01	6S	3.85	3.75	3.80	0.00
1YR	3.87	3.72	3.82	0.00	1YR	3.80	3.70	3.75	0.03

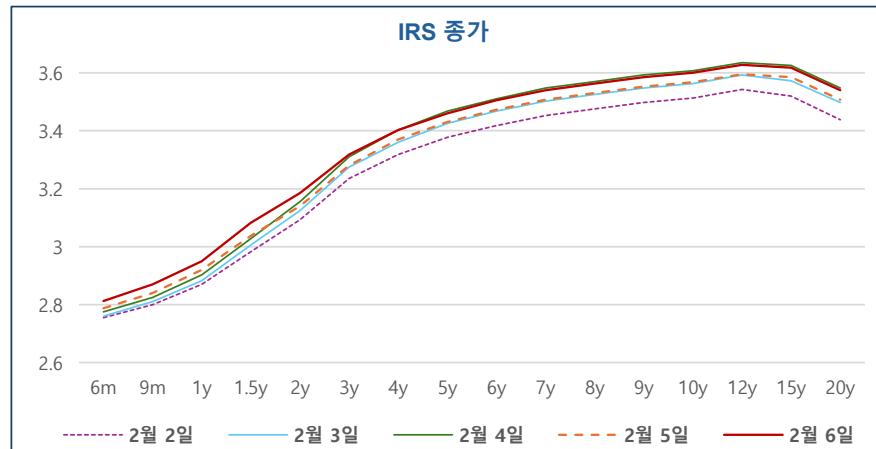
FX SWAP CLOSING

기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	ND SPREAD		
							단위 : 전		
O/N	-15/-11	-13	3.56	-0.18	2.50	3.65000	1M MAR	-135	-131
T/N	-7/-3	-5	3.72	-0.09	2.50	3.65065	1W*1S	-93	-87
1W	-50/-44	-47	3.78	0.11	2.50	3.65454	1*2	-157	-147
1S	-150/-140	-145	3.87	0.09	2.60	3.66814	1*3	-317	-307
3S	-475/-455	-465	4.05	0.04	2.77	3.65989	1*6	-747	-727
6S	-930/-870	-900	4.06	0.00	2.82	3.61899	1*9	-1087	-1057
1YR	-1570/-1470	-1520	4.06	-0.02	2.99	3.49689	1*12	-1342	-1312

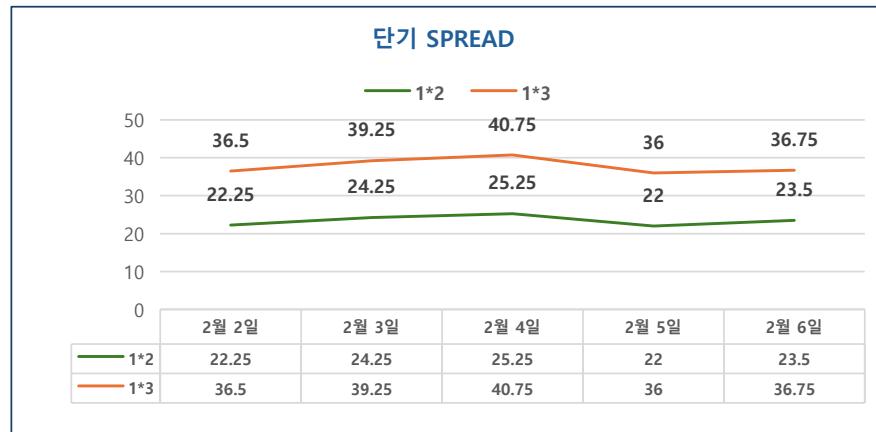
국내외 일정

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		
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 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



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

