

Market Daily Report

Tradition

2026.02.10(화)

레포	별다른 자금 변동요인 없어 금리 보합(2.54%) 출발한 가운데 은행신탁 및 고유계정 매수세 꾸준하여 일반채 해소 원활하였음. 장 중 회사채 일부 간헐적인 정체를 겪은 반면, 운용사 은행 추가 자금 운용돼 일반채 체결금리 하락하였음.
채권	한국 : 국고채 금리는 모두 상승 마감. 일본 자민당의 선거 압승에 따른 JGB 금리 상승과 중국 은행들의 미 국채 이스포저 축소 우려 등 대외 악재가 겹치며 투자 심리가 급격히 위축됨. 특히 3년물 국고채 입찰과 다음날 예정된 10년물 입찰을 앞두고 크레딧 시장의 패닉셀과 설 연휴 전 수급 괴임 현상이 더해지며, 3년물, 10년물 금리 모두 2023년 11월 이후 최고치를 기록함. 미국 : 미 국채 금리 모두 하락 마감. 장 초반 중국의 미 국채 보유 축소 권고 보도와 알파벳의 20억 달러 회사채 발행 소식에 금리 상승. 그러나 이후 케빈 해시 NEC 위원장이 "낮은 고용 지표에 당황할 필요 없다"며 고용 둔화를 시사하자 하락 반전. 여기에 1년 기대 인플레이션이 6개월 만에 3.1로 최저치를 기록하며 금리 인하 기대감을 뒷받침.
MONEY	이번주 미국 FED 주요 인사들의 발언 및 그간 섯다운 여파로 지연된 주요 경제지표 고시를 앞두고 있어, 시장 참여자들은 소식 발표에 촉각을 세우고 있는 중. 금일 할부 연준의 정책 완화 가능성 여부를 가능할수 있는 FED 총재/이사들의 발언을 시작으로, 11일 고용보고서, 13일 CPI 등 그동안 미루어 졌던 미국의 주요 고용지표, 물가지표가 발표될 예정. 머니마켓 또한 이번주 주요 발표에 따른 앞으로의 금리 방향성을 체크하면서, 네임별로 큰 레벨 변동없이 마감이 됨. 중국계 1달 3.73~3.75, 2달~3달 3.80~3.83, 6달 3.80, 1년 3.75, 대만계는 단기 위주의 2주 3.74~3.75, 1달 3.82~3.84 레벨선에 각각 마감.
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. 혼란한 시장에서 달리-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 조단기 유동성 공급이 유입되며 최근까지 타이트했던 단기 스와프포인트가 되돌림이 나온 것으로 보임.
IRS	전일 IRS는 혼조세 마감. 일본 중의원 선거 결과와 중국 은행들의 국채 이스포저 축소 우려가 반영되어, 중장기쪽 테너가 전반적으로 상승하는 분위기를 보임. 장 초반 1*3년이 37/36.5에 대치되다가 오후가 내려오며 36.5에 거래되었으며, 2년이 국채선물과 연동되어 16.75/16.5에 대치되다가 16.5에 여러 차례 거래되는 모습을 보임. 또한 2*5년이 29.25/28.75에 대치되었으나 거래 없이 리퍼팅. 오후 들어 다소 한산한 장세를 보이며 비디쉬한 분위기가 이어짐. 중단기쪽으로 5년 46비드, 3년이 31.5비드로 나왔으며, 1년이 94에 여러 차례 테이크损. 이후 레벨이 강하게 오르며 2년이 16.5-17비드로 올라왔으며, 1.5년이 07/6.5에 대치되다가 비드가 올라오며 07에 거래됨. 장 막판 1.5*2년이 10.5/10에 대치되었으며, 1.5년 07/6.5와 엮여 2년이 17.5/16.5에 대치되다가 1.5년이 6.75에 만나서 여러 차례 거래되는 모습을 보임. 또한 3년이 32.25/31.75에 대치되어 중단기쪽 커브 레벨이 움직였으며, 2*10년 45오퍼, 5*10년 15.75오퍼가 나옴.

단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2026.02.03(화)	278.3	232.7	2.53%	2.536%	2.50%	2.74%	2년물	3.489%
2026.02.04(수)	278.8	235.8	2.53%	2.526%		2.75%	5년물	3.746%
2026.02.05(목)	279.5	237.0	2.54%	2.535%		2.75%	10년물	4.203%
2026.02.06(금)	280.9	234.7	2.54%	2.514%		2.78%	30년물	4.859%
2026.02.10(월)	283.5		2.54%	2.533%		2.78%	10Y-2Y	71.4
								0.01

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	5,298.04	208.90	28.01.02	통안채	1,000	은행채 2,200	은행채 2,500	국고채 10년 26,000억원 입찰
KOSDAQ	1,127.55	46.78	26.05.12	통안채	800	여전채 1,800	여전채 1,000	
달러-원	1,457.70원	-6.00원	27.09.10	국고 25-6	782	회사채 1,075	회사채 2,400	
국고3Y	3.267%	3.4	30.09.10	국고 25-8	-1,090	통안채 5,000	통안채 10,000	
국고10Y	3.754%	4.4	31.12.10	국고채원금	-1,100	공사채 14,051	공사채 6,600	
국고10Y-3Y	48.7	1	55.03.10	국고 25-2	-2,000			

Money Market Closing								단위 : %, %p	
기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.70	3.64	3.67	0.01	O/N	3.70	3.63	3.66	-0.02
T/N	3.71	3.65	3.68	0.01	T/N	3.71	3.64	3.67	-0.02
1W	3.75	3.65	3.70	0.00	1W	3.73	3.67	3.70	-0.02
1S	3.85	3.73	3.77	0.00	1S	3.76	3.73	3.75	-0.02
3S	3.90	3.80	3.85	0.00	3S	3.85	3.78	3.82	0.02
6S	3.90	3.75	3.83	-0.02	6S	3.80	3.75	3.80	0.00
1YR	3.88	3.73	3.80	-0.02	1YR	3.75	3.70	3.75	0.00

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	0.41	2.50	3.65000	1M MAR	-135	-131
T/N	-8/-4	-6	3.98	0.26	2.50	3.65055	1W*1S	-93	-87
1W	-50/-44	-47	3.95	0.17	2.50	3.65382	1*2	-157	-147
1S	-165/-155	-160	4.02	0.15	2.60	3.66529	1*3	-317	-307
3S	-495/-475	-485	4.13	0.08	2.77	3.63988	1*6	-747	-727
6S	-940/-880	-910	4.10	0.04	2.83	3.57871	1*9	-1087	-1057
1YR	-1540/-1440	-1490	4.04	-0.01	3.00	3.43423	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(화) / 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)

