

Market Daily Report

2026.02.13(금)



레포	원천세 납부에 상응하는 국고여유자금 및 공자기금 유입돼 운용사-은행신탁 유동성 회복되었고, 일반채 조달여건 호전되었음. 장 중 회사채 정체 계속됐으며, 일반채 추가 매도 이어져 오후 수급 다소 빠듯한 모습을 보임.
채권	한국 : 국고채 금리 모두 하락 마감. 간밤 미국의 고용 서프라이즈로 악세 출발했으나, 한국은행의 최근 채권 금리 상승을 우려하는 구두개입으로 하락 전환. 최용훈 한은 금융시장국장은 "최근 채권시장에서 금리가 상당히 많이 올랐다"며 "지금 기준금리가 2.5%인데, 국고채 3년물 금리가 3.2%를 상회 중이어서 상당히 높은 수준"이라고 발언. 다만 외국인이 3년 및 10년물 순매도를 이어가면서 강세폭은 감소한 채 마감. 미국 : 미 국채금리 모두 하락 마감. 오전에는 신규 실업보험 청구 건수가 예상치를 웃돌며 고용 둔화 신호로 해석돼 금리 하락. 미 노동부에 따르면 7일 기준 지난 한 주 신규 실업보험 청구 건수는 계절 조정 기준 22만7천건으로 시장 예상인 22만2천건을 상회. 오후에 실시된 30년물 입찰 호조로 인해 금리 낙폭 확대. 250억 달러 규모의 미 국채 30년물 입찰은 2.66배의 응찰률 속에 평행 전 거래 수익률을 2.1bp나 하회한 4.750%로 결정. 응찰률은 6년 만에 최고치를 경신.
MONEY	미국의 1월 비농업 부문 고용이 13만명 증가하며, 7만명 증가를 예상했던 마켓 대비 거의 2배에 달하면서 크게 상회 했고, 실업률도 4.3%로 하락하며 견조한 노동시장 상황이 확인되면서, 연준의 금리 동결 기간이 예상보다 길어질 수 있다는 전망에 힘이 실림. 3월 인하 가능성은 5% 대로 현저히 낮아지고, 6월 인하 기대도 소폭 하락 함. 머니마켓은 곧 다가오는 연휴 전 비교적 한산한 장세를 보이며, 지속적인 단기 구간 차입세를 보임. 대만계 위주 2주 3.73~3.74, 월 커버 3주 3.80~3.83, 1달 3.85~3.88, 2달~3달 3.90 수준으로 편성이 되며, 중국계의 경우 2주 3.72~3.73, 월 커버 3주 3.75, 1달 3.75~3.77, 3달 3.80~3.82 수준으로 최근 비슷한 수준으로 유지되며 편딩됨.
FX SWAP	2월 12일 외환 스와프포인트는 장단기 엇갈린 흐름을 보이며 혼조세로 마감함. 1년물은 전일 대비 0.20원 하락한 -15.00원, 6개월물은 0.20원 내린 -9.00원으로 중장기물은 소폭 밀렸으나, 1개월물은 0.10원 상승한 -1.50원으로 단기 구간은 반등하는 모습이 나타남. 현물환 시장에서는 외국인이 유가증권시장에서 3조원 규모 순매수에 나서며 달러-원이 전일 대비 9.90원 급락한 1,440.20원에 마감함. 전반적으로 외환 스와프 시장에서는 설 연휴로 인해 스팟 결제일이 19일로 이연되면서 명절 이후 달러 결제 부담이 완화되는 구조가 형성됐고, 이에 따라 단기 구간 중심으로 캐리 비드가 유입된 것으로 보임. 반면 장기물은 최근 한미 금리차 축소 기대가 상당 부분 반영된 상태에서 추가 상승 모멘텀이 제한되며 소폭 조정되는 흐름이 나타남.
IRS	전일 IRS는 하락 마감. 장 초반 전일 미국 고용지표 발표가 예상을 크게 상회함에 따라 상승 출발하였지만, 장중 한국은행 금융시장국장의 국고채 금리 상승 흐름이 과도하다는 발언에 따라 하락 마감함. 장 초반 상승 흐름을 보이며 10년이 53.25/52.5에 대치되다가 국채선물과 연동되어 비드가 강하게 올라오며 10년이 53.25레벨에 거래되었으며, 5*10년이 14에 거래됨. 한국은행 금융시장국장의 발언 이후 레밸이 강하게 내려오며 오퍼리쉬한 분위기를 보였으며, 중단기쪽으로 1년이 91.5/91에 대치되다가 91에 거래되었으며, 2년이 10에 거래되고 계속해서 오퍼온 분위기를 보임. 오후 들어 5*10년이 14.5/14에 대치되다가 14.25에 만나 계속해서 거래되었으며, 6*10년이 10/09에 대치되었으나 거래 없이 리퍼됨. 5년이 33에 계속해서 거래되었으며, 1*2년 17.5비드와 1년 89비드가 얹인 2년이 6.5에 몇 차례 거래됨. 중단기쪽 스프레드로 1.5*2년이 09에 초이스되다가 거래되었으며, 1*3년이 31에 거래됨. 또한 3년 3선스왑이 -1.25/-3.25에 대치되다가 -2.25에 만나서 거래됨. 장 막판 10*12년이 2.5오퍼가 나와 장기쪽 커브가 움직였으며, 5*10년이 14.5/14에 대치됨. 마감 이후 5*10년이 ND로 14에 거래되었으며, 1*2년이 19.75-20까지 ND로 여러 차례 거래됨.

단기자금시장							전일 미국 국채 금리		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	단위 : 조 원	한국시간 오전 07:05 기준	단위 : bp
2026.02.05(목)	279.5	237.0	2.54%	2.535%	2.50%	2.75%	2년물	3.458%	-5.60
2026.02.06(금)	280.9	234.7	2.54%	2.514%		2.78%	5년물	3.661%	-8.40
2026.02.10(월)	283.5	235.1	2.54%	2.533%		2.78%	10년물	4.100%	-7.40
2026.02.11(화)	277.7	227.9	2.56%	2.533%		2.78%	30년물	4.735%	-7.30
2026.02.12(수)	285.4		2.54%	2.546%		2.78%	10Y-2Y	64.2	-0.02

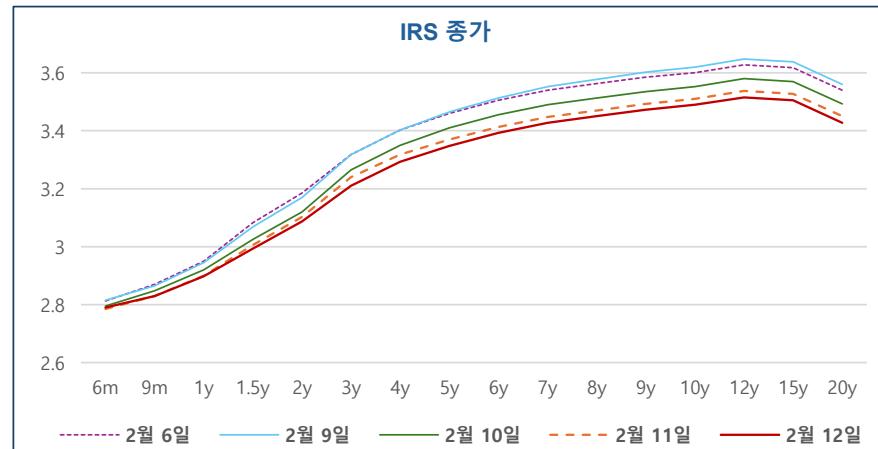
국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금투협 최종호기수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	5,522.27	167.78	27.09.10	국고 25-6	1,500	여전체 5,200	은행체 6,700	국고채 50년 9,000억 원 입찰
KOSDAQ	1,125.99	11.12	35.06.10	국고 25-5	1,310	회사채 2,820	여전체 9,350	
달러-원	1,438.60원	-11.50원	27.02.10	외평채	900		회사채 23,960	
국고3Y	3.154%	-4.6	54.09.10	국고 24-8	-200		공사채 5,500	
국고10Y	3.618%	-2.1	27.03.10	국고 25-1	-801			
국고10Y-3Y	46.4	2.5	28.06.10	국고 18-4	-1,199			

Money Market Closing							단위 : %, %p		
기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비
O/N	3.67	3.61	3.64	-0.04	O/N	3.68	3.62	3.65	-0.01
T/N	3.68	3.62	3.65	-0.04	T/N	3.69	3.63	3.66	-0.01
1W	3.75	3.65	3.71	0.00	1W	3.75	3.65	3.70	0.00
1S	3.83	3.73	3.76	-0.01	1S	3.80	3.70	3.75	0.00
3S	3.90	3.80	3.85	-0.01	3S	3.85	3.78	3.82	0.00
6S	3.87	3.75	3.83	0.02	6S	3.85	3.75	3.80	0.00
1YR	3.82	3.70	3.78	0.01	1YR	3.80	3.70	3.75	0.00

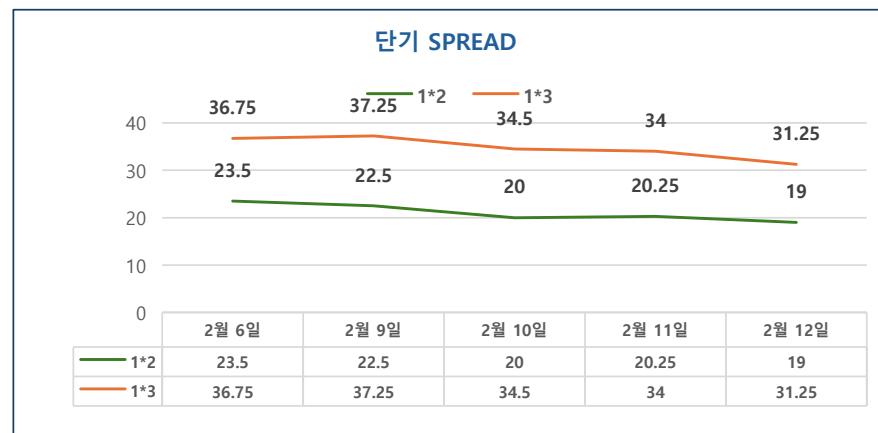
FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-7/-3	-5	3.75	-0.24	2.50	3.65000	1M MAR	-150	-146
T/N	-32/-26	-29	3.71	-0.03	2.50	3.65034	1W*1S	-118	-112
1W	-40/-34	-37	3.82	-0.14	2.50	3.65241	1*2	-170	-160
1S	-155/-145	-150	3.94	-0.08	2.60	3.65964	1*3	-312	-302
3S	-470/-460	-465	4.10	-0.01	2.78	3.63308	1*6	-732	-712
6S	-930/-870	-900	4.10	0.04	2.83	3.56016	1*9	-1062	-1032
1YR	-1550/-1450	-1500	4.07	0.03	3.00	3.40165	1*12	-1327	-1297

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 12일		
구분	증가	전일대비
6m	2.7900	0.50
9m	2.8300	0.00
1y	2.8975	-0.25
1.5y	2.9925	-1.25
2y	3.0875	-1.50
3y	3.2100	-3.00
4y	3.2925	-2.50
5y	3.3475	-2.25
6y	3.3925	-2.00
7y	3.4275	-2.00
8y	3.4500	-2.00
9y	3.4725	-2.00
10y	3.4900	-2.00
12y	3.5150	-2.25
15y	3.5050	-2.25
20y	3.4275	-2.25



IRS 주요 커브 SPREAD		
구분	증가	전일대비
1*2y	19.00	-1.25
1*3y	31.25	-2.75
2*5y	26.00	-0.75
3*5y	13.75	0.75
5*10y	14.25	0.25
10*20y	-6.25	-0.25



IRS 주요 커브 FLY		
구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-2.75	-0.25
1*1.5*2y	0.00	-0.75
2*5*10y	11.75	-1.00
5*7*10y	1.75	0.25

