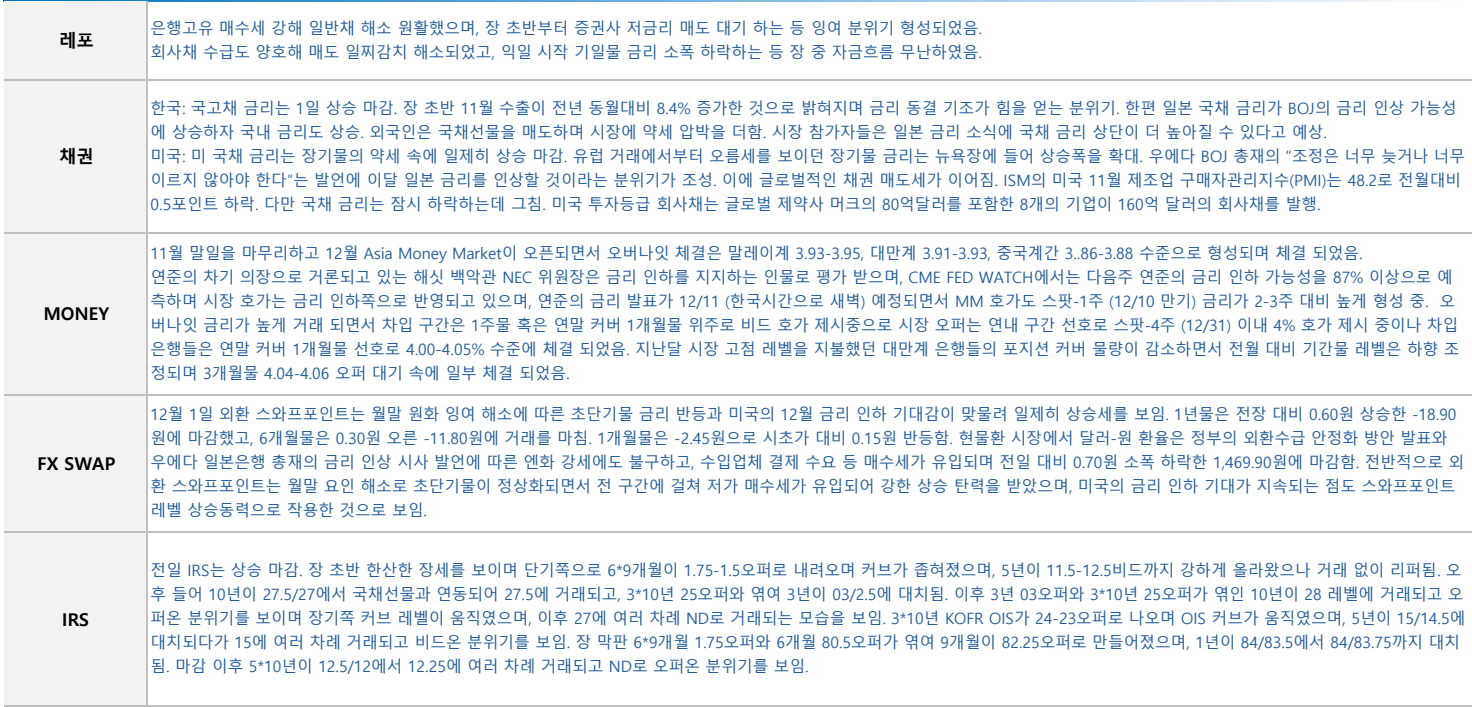


2025.12.02(화)



단기자금시장						전일 미국 국채 금리		
단위 : 조 원						한국시간 오전 07:05 기준 단위 : bp		
	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리	전일대비
2025.11.25(화)	269.8	220.2	2.51%	2.520%	2.50%	2.76%	3.532%	2.40
2025.11.26(수)	273.2	217.6	2.53%	2.533%		2.76%	3.666%	6.30
2025.11.27(목)	270.0	219.3	2.52%	2.513%		2.80%	4.089%	7.00
2025.11.28(금)	267.5	213.2	2.52%	2.514%		2.80%	4.738%	7.30
2025.12.01(월)	266.3		2.52%	2.511%		2.80%	10Y-2Y	55.7

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
금류업 최종호가수익률			단위 : 억 원			단위 : 억 원		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	3,920.37	-6.22	27.09.10	국고 25-6	4,720	여전채 3,500	은행채 9,000	국고채 30년 10,000억원 입찰
KOSDAQ	922.38	9.71	35.06.10	국고 25-5	3,030	회사채 8,000	여전채 3,000	
달러-원	1,468.00원	1.20원	28.06.10	국고 25-4	2,459	공사채 2,000	회사채 500	
국고3Y	3.045%	5.4	41.09.10	국고 21-9	-150		통안채 8,900	
국고10Y	3.387%	4.3	53.09.10	국고 23-7	-245		공사채 2,800	
국고10Y-3Y	34.2	-1.1	27.03.10	국고 22-1	-1,050			

Money Market Closing										단위 : %, %p
기간	KOREAN/FOREIGN		종가	전일대비	기간	CHINESE		종가	전일대비	
O/N	3.92	3.86	3.89	-0.08	O/N	3.90	3.86	3.87	-0.03	
T/N	3.94	3.88	3.91	-0.01	T/N	3.90	3.86	3.88	0.00	
1W	3.98	3.90	3.95	-0.01	1W	3.97	3.87	3.95	0.03	
1S	4.10	4.00	4.05	-0.03	1S	4.03	3.93	4.00	-0.02	
3S	4.12	4.02	4.07	-0.05	3S	4.05	3.95	4.03	0.00	
6S	4.10	3.95	4.05	-0.01	6S	4.00	3.80	3.93	0.03	
1YR	3.98	3.83	3.94	0.02	1YR	3.90	3.70	3.83	0.03	

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, %, %p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-6/-2	-4	3.48	-0.73	2.50	4.05000	1M MAR	-232	-228
T/N	-8/-4	-6	3.97	-0.24	2.50	4.04437	1W*1S	-190	-184
1W	-52/-46	-49	4.22	-0.21	2.50	4.01058	1*2	-205	-195
1S	-250/-240	-245	4.42	-0.12	2.60	3.86417	1*3	-400	-390
3S	-655/-635	-645	4.57	0.00	2.79	3.78743	1*6	-940	-920
6S	-1210/-1150	-1180	4.49	-0.02	2.88	3.70377	1*9	-1375	-1345
1YR	-1940/-1840	-1890	4.15	-0.03	2.83	3.51111	1*12	-1665	-1635

국내의 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

12월 1일

단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	2.8000	3.00
9m	2.8150	2.75
1y	2.8375	3.75
1.5y	2.8900	5.00
2y	2.9575	5.75
3y	3.0425	5.75
4y	3.1075	6.00
5y	3.1625	6.75
6y	3.2025	6.25
7y	3.2275	5.75
8y	3.2475	5.75
9y	3.2675	5.75
10y	3.2875	5.75
12y	3.3275	5.75
15y	3.3275	5.75
20y	3.2375	5.75

IRS 주요 커브

SPREAD

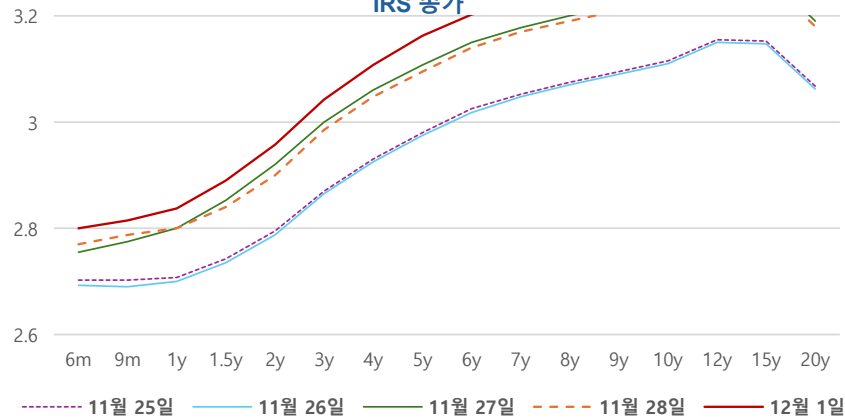
구분	증가	전일대비
1*2y	12.00	2.00
1*3y	20.50	2.00
2*5y	20.50	1.00
3*5y	12.00	1.00
5*10y	12.50	-1.00
10*20y	-5.00	0.00

IRS 주요 커브

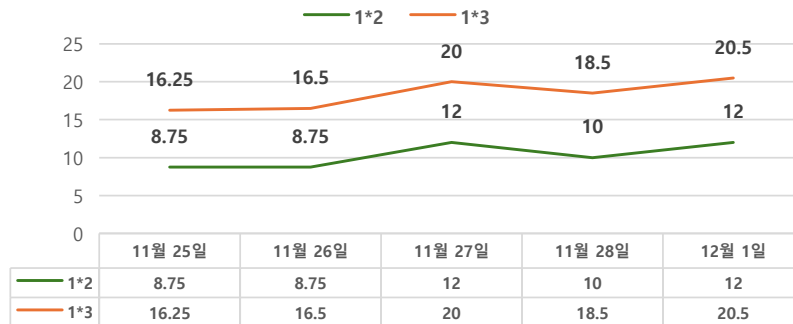
FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-0.75	-1.25
1*1.5*2y	-1.50	0.50
2*5*10y	8.00	2.00
5*7*10y	0.50	-1.00

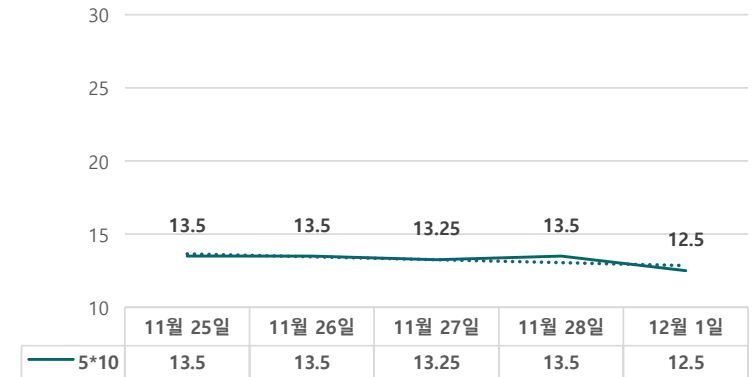
IRS 증가



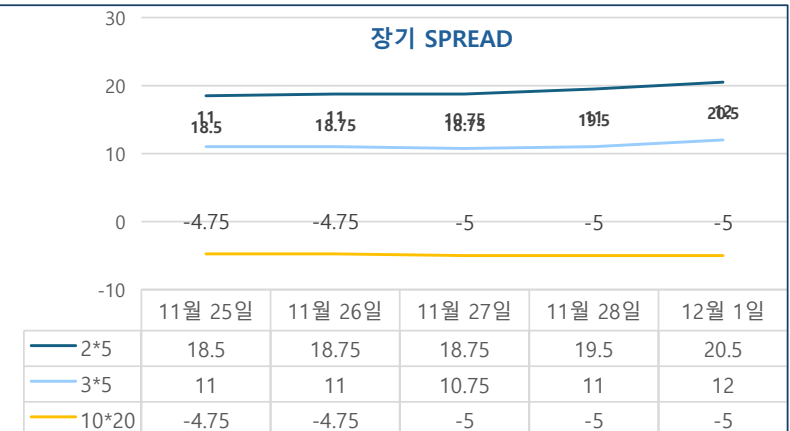
단기 SPREAD



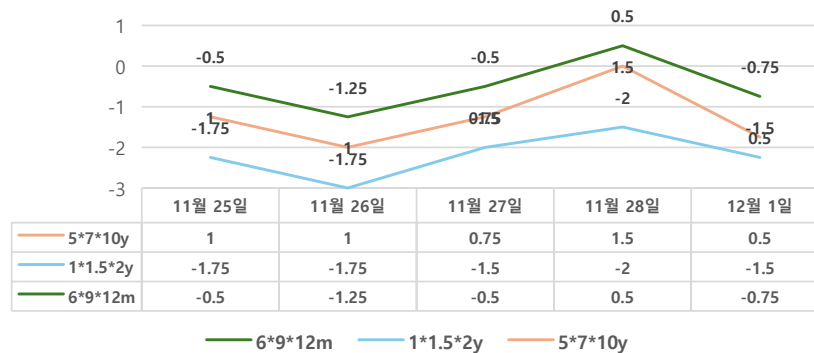
5*10 SPREAD



장기 SPREAD



주요 FLY



2*5*10y FLY

