

2025.12.12(금)



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	
2025.12.05(금)	266.9	221.7	2.50%	2.514%	2.50%	2.83%	2년물	3.542%	0.20
2025.12.08(월)	268.7	217.5	2.52%	2.520%		2.83%	5년물	3.736%	0.30
2025.12.09(화)	272.2	217.2	2.55%	2.513%		2.83%	10년물	4.159%	0.90
2025.12.10(수)	273.4	214.9	2.55%	2.485%		2.83%	30년물	4.802%	1.40
2025.12.11(목)	273.0		2.54%	2.518%		2.83%	10Y-2Y	61.7	0.01

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	4,110.62	-24.38	27.12.10	국고 24-12	2,000	지방채 1,095	은행채 16,300	국고채 50년 3,000억원 입찰
KOSDAQ	934.64	-0.36	27.03.10	국고 25-1	1,500	여전채 9,900	여전채 6,640	
달러-원	1,471.90원	1.10원	27.06.10	국고 24-4	1,410	회사채 3,374	회사채 3,151	
국고3Y	3.101%	0.6	26.12.10	국고 16-8	-61		공사채 1,400	
국고10Y	3.378%	0.7	44.09.10	국고 24-10	-110			
국고10Y-3Y	27.7	0.1	30.06.10	국고 20-4	-227			

Money Market Closing										단위 : %, %p
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비	
O/N	3.68	3.62	3.65	-0.24	O/N	3.70	3.60	3.65	-0.23	
T/N	3.70	3.64	3.67	0.02	T/N	3.70	3.60	3.65	0.02	
1W	3.80	3.70	3.75	-0.05	1W	3.75	3.65	3.72	-0.08	
1S	4.00	3.90	3.96	-0.04	1S	3.95	3.80	3.90	-0.02	
3S	4.02	3.92	3.97	-0.03	3S	3.95	3.80	3.88	-0.05	
6S	4.05	3.90	3.99	-0.01	6S	3.90	3.70	3.85	-0.05	
1YR	3.95	3.80	3.90	-0.01	1YR	3.80	3.60	3.75	0.00	

FX SWAP CLOSING							ND SPREAD		
단위 : 전, % , p							단위 : 전		
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-9/-5	-7	4.21	0.00	2.50	3.93000	1M MAR	-215	-211
T/N	-20/-16	-18	3.96	-0.01	2.50	3.91339	1W*1S	-178	-172
1W	-47/-41	-44	4.04	0.00	2.50	3.89123	1*2	-200	-190
1S	-225/-215	-220	4.35	0.03	2.61	3.75832	1*3	-380	-370
3S	-625/-605	-615	4.50	0.00	2.83	3.73302	1*6	-930	-910
6S	-1170/-1110	-1140	4.49	-0.03	2.92	3.67788	1*9	-1360	-1330
1YR	-1910/-1810	-1860	4.18	-0.02	2.88	3.54028	1*12	-1665	-1635

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)

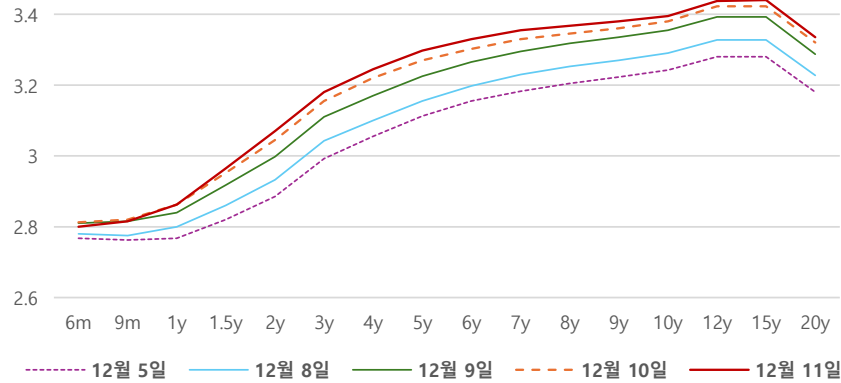
IRS 데일리 증가

12월 11일

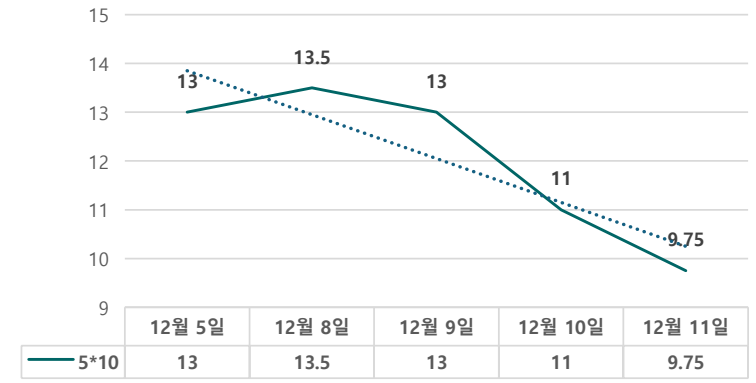
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	2.8000	-1.25
9m	2.8150	-0.50
1y	2.8625	0.00
1.5y	2.9650	1.25
2y	3.0700	2.50
3y	3.1800	2.50
4y	3.2450	2.50
5y	3.2975	2.75
6y	3.3300	2.75
7y	3.3550	2.50
8y	3.3675	2.25
9y	3.3800	2.00
10y	3.3950	1.50
12y	3.4375	1.50
15y	3.4400	1.75
20y	3.3350	1.50

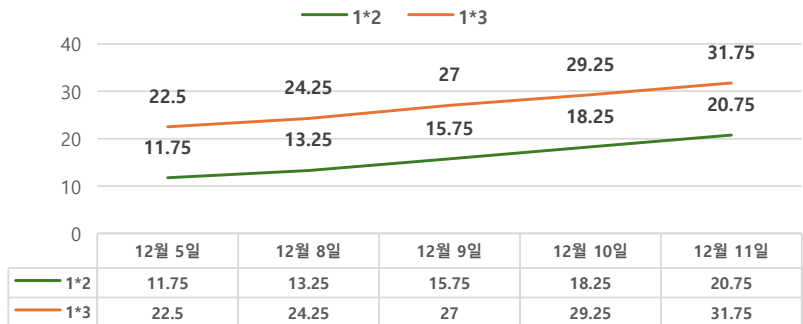
IRS 증가



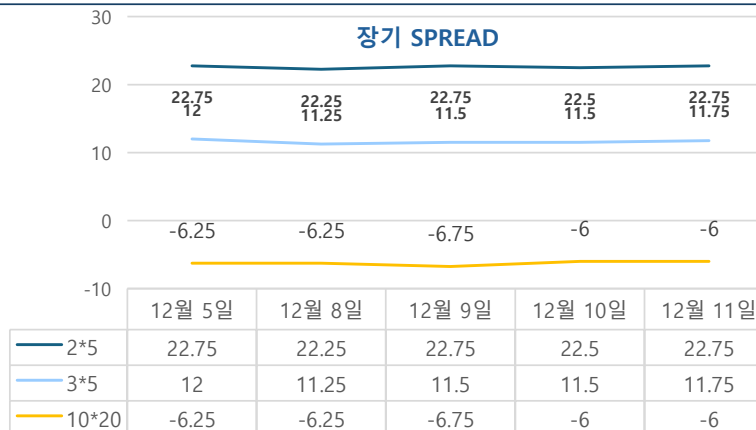
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

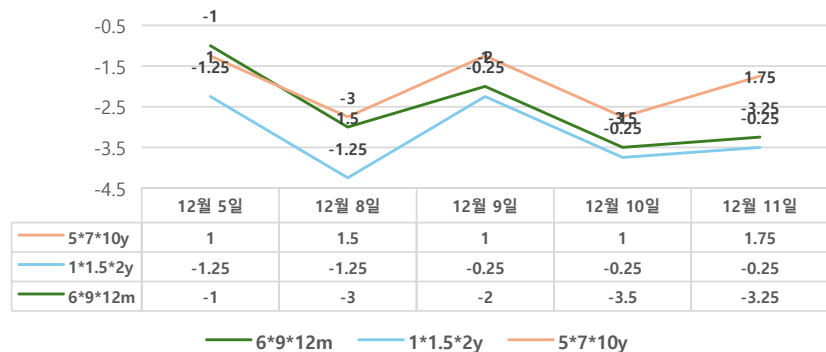


IRS 주요 커브

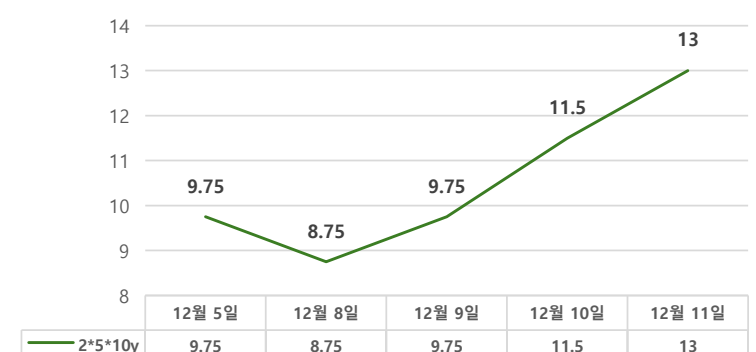
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	20.75	2.50
1*3y	31.75	2.50
2*5y	22.75	0.25
3*5y	11.75	0.25
5*10y	9.75	-1.25
10*20y	-6.00	0.00

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-3.25	0.25
1*1.5*2y	-0.25	0.00
2*5*10y	13.00	1.50
5*7*10y	1.75	0.75